

【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4月25日提出 |
| 【計算期間】 | 第13期中(自 2022年7月26日至 2023年1月25日) |
| 【ファンド名】 | インデックスコレクション（外国株式） |
| 【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】 | 上坪 直樹 |
| 【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。 |

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13期中間計算期間(2022年7月26日から2023年1月25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。

【インデックスコレクション(外国株式)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

| | 第12期 (2022年7月25日現在) | 第13期中間計算期間 (2023年1月25日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 167,321,370 | 146,130,584 |
| 親投資信託受益証券 | 70,489,921,325 | 75,707,865,504 |
| 未収入金 | 32,788,246 | - |
| 流動資産合計 | 70,690,030,941 | 75,853,996,088 |
| 資産合計 | 70,690,030,941 | 75,853,996,088 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 113,834,056 | 49,596,911 |
| 未払受託者報酬 | 7,090,317 | 8,238,305 |
| 未払委託者報酬 | 42,541,835 | 49,429,755 |
| 未払利息 | 68 | 73 |
| その他未払費用 | 909,459 | 954,433 |
| 流動負債合計 | 164,375,735 | 108,219,477 |
| 負債合計 | 164,375,735 | 108,219,477 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 14,404,844,045 | 15,455,978,821 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 56,120,811,161 | 60,289,797,790 |
| (分配準備積立金) | 17,005,425,851 | 15,706,817,022 |
| 元本等合計 | 70,525,655,206 | 75,745,776,611 |
| 純資産合計 | 70,525,655,206 | 75,745,776,611 |
| 負債純資産合計 | 70,690,030,941 | 75,853,996,088 |

(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12期 | 第13期中間計算期間 |
|----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日 | 自 2022年 7月26日 至 2023年 1月25日 |
| 投資信託財産に係る元本の状況 | | |
| 期首元本額 | 11,167,433,861円 | 14,404,844,045円 |
| 期中追加設定元本額 | 5,769,271,220円 | 2,235,338,797円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,531,861,036円 | 1,184,204,021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。

外国株式マザーファンド

貸借対照表

| 項目 | 2023年 1月25日現在 |
|----------|-----------------|
| | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 9,637,390,656 |
| コール・ローン | 1,123,526,051 |
| 株式 | 327,492,882,697 |
| 投資信託受益証券 | 133,002,263 |
| 投資証券 | 7,680,320,951 |
| 派生商品評価勘定 | 277,859,364 |
| 未収入金 | 23,432,035 |
| 未収配当金 | 261,614,338 |
| 差入委託証拠金 | 3,552,981,847 |
| 流動資産合計 | 350,183,010,202 |

| | 2023年 1月25日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額(円) |
| 資産合計 | 350,183,010,202 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 10,973,276 |
| 前受金 | 277,657,359 |
| 未払解約金 | 49,506,108 |
| 未払利息 | 566 |
| 流動負債合計 | 338,137,309 |
| 負債合計 | 338,137,309 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 76,778,591,222 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 273,066,281,671 |
| 元本等合計 | 349,844,872,893 |
| 純資産合計 | 349,844,872,893 |
| 負債純資産合計 | 350,183,010,202 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 2023年 1月25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> |

| | 2023年 1月25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 | 2023年 1月25日現在 |
|-------------------|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2022年 7月26日 |
| 期首元本額 | 74,737,903,542円 |
| 期中追加設定元本額 | 4,212,227,332円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,171,539,652円 |
| 期末元本額 | 76,778,591,222円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| 外国株式インデックスファンド | 1,486,879,007円 |
| DC外国株式インデックスファンド | 5,053,254,740円 |
| DC外国株式インデックスファンドL | 28,025,693,097円 |

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

