

【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11日提出
【計算期間】	第11期中(自 2022年7月12日至 2023年1月11日)
【ファンド名】	分散投資コア戦略ファンドA 分散投資コア戦略ファンドS
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	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。

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。

【分散投資コア戦略ファンドA】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	12,224,208,787	14.56
親投資信託受益証券	日本	70,444,184,556	83.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,273,624,766	1.52
合計(純資産総額)		83,942,018,109	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（2）【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (2013年 7月10日)	258,830,299	258,830,299	9,811	9,811
第2期計算期間末 (2014年 7月10日)	16,628,969,770	16,628,969,770	10,208	10,208
第3期計算期間末 (2015年 7月10日)	23,204,975,199	23,204,975,199	10,550	10,550
第4期計算期間末 (2016年 7月11日)	40,992,277,841	40,992,277,841	9,890	9,890
第5期計算期間末 (2017年 7月10日)	47,152,867,522	47,152,867,522	10,297	10,297
第6期計算期間末 (2018年 7月10日)	56,957,731,265	56,957,731,265	10,442	10,442
第7期計算期間末 (2019年 7月10日)	64,206,017,914	64,206,017,914	10,533	10,533
第8期計算期間末 (2020年 7月10日)	69,610,450,591	69,610,450,591	10,401	10,401
第9期計算期間末 (2021年 7月12日)	80,414,109,882	80,414,109,882	11,262	11,262
第10期計算期間末 (2022年 7月11日)	83,363,228,383	83,363,228,383	10,759	10,759
2022年 1月末日	81,217,462,974		11,055	
2月末日	80,577,463,338		11,002	
3月末日	82,298,081,573		11,138	
4月末日	80,861,467,282		10,986	
5月末日	81,211,470,560		10,927	
6月末日	82,795,487,554		10,766	
7月末日	84,727,910,833		10,882	
8月末日	84,139,535,228		10,775	
9月末日	82,631,403,217		10,522	
10月末日	83,721,748,421		10,629	

11月末日	83,421,662,660		10,621	
12月末日	82,145,346,847		10,417	
2023年 1月末日	83,942,018,109		10,532	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2013年 3月29日～2013年 7月10日	0
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	0
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2013年 3月29日～2013年 7月10日	1.9
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	4.0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	3.4
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	6.3
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	4.1
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	1.4
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.9
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1.3
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	8.3
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	4.5
第11期中間計算期間	2022年 7月12日～2023年 1月11日	2.6

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

【分散投資コア戦略ファンドS】

(1) 【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	27,436,779,946	15.34
親投資信託受益証券	日本	148,697,616,031	83.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,670,815,412	1.49
合計(純資産総額)		178,805,211,389	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末	(2013年 7月10日)	54,287,050	54,287,050	9,915	9,915
第2期計算期間末	(2014年 7月10日)	9,560,643,872	9,560,643,872	10,451	10,451
第3期計算期間末	(2015年 7月10日)	23,718,308,897	23,718,308,897	11,013	11,013
第4期計算期間末	(2016年 7月11日)	40,713,425,166	40,713,425,166	9,845	9,845
第5期計算期間末	(2017年 7月10日)	57,661,475,690	57,661,475,690	10,759	10,759
第6期計算期間末	(2018年 7月10日)	75,431,956,580	75,431,956,580	11,008	11,008
第7期計算期間末	(2019年 7月10日)	89,663,756,248	89,663,756,248	11,109	11,109
第8期計算期間末	(2020年 7月10日)	143,157,363,596	143,157,363,596	10,980	10,980
第9期計算期間末	(2021年 7月12日)	171,466,226,114	171,466,226,114	12,554	12,554
第10期計算期間末	(2022年 7月11日)	177,910,582,335	177,910,582,335	12,378	12,378
	2022年 1月末日	172,787,807,627		12,366	
	2月末日	172,111,235,783		12,363	
	3月末日	179,947,548,637		12,818	
	4月末日	176,272,987,474		12,599	
	5月末日	177,105,396,808		12,544	
	6月末日	175,910,883,604		12,373	
	7月末日	180,625,009,151		12,520	
	8月末日	180,688,918,772		12,460	
	9月末日	177,375,712,792		12,143	
	10月末日	182,174,902,215		12,426	
	11月末日	181,063,403,414		12,374	
	12月末日	177,177,529,602		12,046	
	2023年 1月末日	178,805,211,389		12,270	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
--	-----	---------------

第1期計算期間	2013年 3月29日～2013年 7月10日	0
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	0
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	0
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2013年 3月29日～2013年 7月10日	0.9
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	5.4
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	5.4
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	10.6
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	9.3
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	2.3
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.9
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1.2
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	14.3
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	1.4
第11期中間計算期間	2022年 7月12日～2023年 1月11日	1.7

(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。

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	3,804,927,140	98.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		51,955,247	1.35
合計(純資産総額)		3,856,882,387	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	39,510,000	1.02

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

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

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	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(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。

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。

外国株式最小分散インデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	9,738,692,581	60.40
	カナダ	1,389,431,650	8.62
	スイス	1,308,870,141	8.12
	ドイツ	402,722,093	2.50
	オーストラリア	323,931,394	2.01
	香港	314,056,551	1.95
	オランダ	270,861,180	1.68
	アイルランド	270,317,301	1.68
	フランス	238,462,738	1.48
	シンガポール	215,685,383	1.34
	デンマーク	196,494,953	1.22
	フィンランド	152,212,769	0.94
	スペイン	149,816,973	0.93
	イスラエル	106,640,549	0.66
	ベルギー	74,605,699	0.46
	イタリア	62,185,416	0.39
	ノルウェー	42,010,395	0.26
	イギリス	38,412,965	0.24
	ニュージーランド	26,538,773	0.16
	スウェーデン	19,787,508	0.12
	ケイマン	18,264,384	0.11
	ポルトガル	14,240,936	0.09
	バミューダ	13,351,517	0.08
	小計	15,387,593,849	95.43
投資信託受益証券	香港	49,094,190	0.30
投資証券	アメリカ	187,632,524	1.16
	香港	36,400,230	0.23
	小計	224,032,754	1.39

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		463,244,994	2.87
合計(純資産総額)		16,123,965,787	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	184,142,096	1.14
	買建	カナダ	96,822,036	0.60

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	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。

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。

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。

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。

ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	32,002,776,217	99.55
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		144,086,047	0.45
合計（純資産総額）		32,146,862,264	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		32,095,487,427	99.84

(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。

HFリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	6,304,548,600	48.79
投資信託受益証券	アメリカ	2,255,500,125	17.46
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		4,360,764,229	33.75
合計（純資産総額）		12,920,812,954	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	2,522,758,134	19.52
	買建	ドイツ	1,051,746,181	8.14
	買建	イギリス	939,014,733	7.27
	売建	アメリカ	868,098,454	6.72
	売建	ドイツ	1,450,781,199	11.23

債券先物取引	売建	アメリカ	3,086,426,860	23.89
--------	----	------	---------------	-------

(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		453,396,342	3.51
	売建		5,028,826,863	38.92

(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。

GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)

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	3,121,576,640	50.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,021,867,553	49.19
合計(純資産総額)		6,143,444,193	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	日本	3,077,760,000	50.10
	買建	イギリス	16,865,616	0.27
	売建	アメリカ	1,953,245,984	31.79
	売建	ドイツ	2,844,634,044	46.30

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,975,242,794	32.15

	売建		1,549,182,607	25.22
--	----	--	---------------	-------

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

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

2【設定及び解約の実績】

【分散投資コア戦略ファンドA】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2013年 3月29日～2013年 7月10日	263,825,167		263,825,167
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	16,300,810,769	274,885,382	16,289,750,554
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	6,829,705,615	1,125,034,771	21,994,421,398
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	21,115,619,373	1,662,548,782	41,447,491,989
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	6,712,164,459	2,368,251,334	45,791,405,114
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	11,384,212,208	2,627,192,900	54,548,424,422
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	9,304,566,486	2,896,398,134	60,956,592,774
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	10,458,038,852	4,487,544,486	66,927,087,140
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	8,942,057,064	4,467,543,464	71,401,600,740
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	10,745,359,555	4,666,858,341	77,480,101,954
第11期中間計算期間	2022年 7月12日～2023年 1月11日	4,306,089,933	2,368,812,262	79,417,379,625

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

【分散投資コア戦略ファンドS】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2013年 3月29日～2013年 7月10日	54,750,331		54,750,331
第2期計算期間	2013年 7月11日～2014年 7月10日	9,258,266,615	164,756,557	9,148,260,389
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	13,807,316,695	1,419,809,778	21,535,767,306
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	22,822,224,799	3,002,745,419	41,355,246,686
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	15,776,145,748	3,537,868,655	53,593,523,779
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	19,014,211,372	4,083,197,323	68,524,537,828
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	17,123,071,331	4,937,538,036	80,710,071,123
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	60,254,110,229	10,583,069,703	130,381,111,649
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	17,432,745,205	11,230,399,627	136,583,457,227
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	17,903,179,345	10,752,318,272	143,734,318,300
第11期中間計算期間	2022年 7月12日～2023年 1月11日	8,592,747,059	5,414,111,969	146,912,953,390

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

3【ファンドの経理状況】

【分散投資コア戦略ファンドA】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第11期中間計算期間(2022年7月12日から2023年1月11日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 (2022年7月11日現在)	第11期中間計算期間 (2023年1月11日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,475,945,530	1,607,037,339
投資信託受益証券	12,531,431,872	12,174,151,232
親投資信託受益証券	69,783,677,062	69,878,117,142
流動資産合計	83,791,054,464	83,659,305,713
資産合計	83,791,054,464	83,659,305,713
負債の部		
流動負債		
未払解約金	53,084,744	40,976,705
未払受託者報酬	21,987,576	23,140,429
未払委託者報酬	351,801,239	370,246,802
未払利息	451	1,761
その他未払費用	952,071	979,882
流動負債合計	427,826,081	435,345,579
負債合計	427,826,081	435,345,579
純資産の部		
元本等		
元本	77,480,101,954	79,417,379,625
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	5,883,126,429	3,806,580,509
(分配準備積立金)	5,976,709,617	5,798,578,877
元本等合計	83,363,228,383	83,223,960,134
純資産合計	83,363,228,383	83,223,960,134
負債純資産合計	83,791,054,464	83,659,305,713

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期中間計算期間 自 2021年 7月13日 至 2022年 1月12日	第11期中間計算期間 自 2022年 7月12日 至 2023年 1月11日
営業収益		
受取利息	5,409	1,656
有価証券売買等損益	397,107,930	1,793,584,086
営業収益合計	397,113,339	1,793,582,430
営業費用		
支払利息	402,500	421,835
受託者報酬	22,560,042	23,140,429
委託者報酬	394,551,114	370,246,802
その他費用	974,077	979,882
営業費用合計	418,487,733	394,788,948
営業利益又は営業損失（ ）	21,374,394	2,188,371,378
経常利益又は経常損失（ ）	21,374,394	2,188,371,378
中間純利益又は中間純損失（ ）	21,374,394	2,188,371,378
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,689,143	23,579,981
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	9,012,509,142	5,883,126,429
剰余金増加額又は欠損金減少額	481,209,749	267,747,013
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	481,209,749	267,747,013
剰余金減少額又は欠損金増加額	261,221,411	179,501,536
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	261,221,411	179,501,536
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	9,208,433,943	3,806,580,509

（ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
	(2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第11期中間計算期間は2022年 7月12日から2023年 1月11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10期 (2022年 7月11日現在)	第11期中間計算期間 (2023年 1月11日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	77,480,101,954口	79,417,379,625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 1.0759円 (1万口当たり純資産額) (10,759円)	1口当たり純資産額 1.0479円 (1万口当たり純資産額) (10,479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11期中間計算期間 (2023年 1月11日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券

	第11期中間計算期間 (2023年 1月11日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価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10期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日	第11期中間計算期間 自 2022年 7月12日 至 2023年 1月11日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	71,401,600,740円	77,480,101,954円
期中追加設定元本額	10,745,359,555円	4,306,089,933円
期中一部解約元本額	4,666,858,341円	2,368,812,262円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

【分散投資コア戦略ファンドS】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第11期中間計算期間(2022年7月12日から2023年1月11日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けておりません。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 (2022年7月11日現在)	第11期中間計算期間 (2023年1月11日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,827,903,189	3,467,358,939
投資信託受益証券	28,139,073,200	27,261,995,981
親投資信託受益証券	147,616,246,741	149,584,103,205
未収入金	350,000,000	790,000,000
流動資産合計	178,933,223,130	181,103,458,125
資産合計		
	178,933,223,130	181,103,458,125
負債の部		
流動負債		
未払解約金	212,826,500	1,468,192,337
未払受託者報酬	47,565,031	49,868,751
未払委託者報酬	761,040,550	797,899,982
未払利息	864	3,799
その他未払費用	1,207,850	1,247,160
流動負債合計	1,022,640,795	2,317,212,029
負債合計		
	1,022,640,795	2,317,212,029
純資産の部		
元本等		
元本	143,734,318,300	146,912,953,390
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	34,176,264,035	31,873,292,706
(分配準備積立金)	19,403,362,850	18,696,434,455
元本等合計	177,910,582,335	178,786,246,096
純資産合計		
	177,910,582,335	178,786,246,096
負債純資産合計		
	178,933,223,130	181,103,458,125

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期中間計算期間 自 2021年 7月13日 至 2022年 1月12日	第11期中間計算期間 自 2022年 7月12日 至 2023年 1月11日
営業収益		
受取利息	11,860	3,597
有価証券売買等損益	3,686,341,711	2,191,835,097
営業収益合計	3,686,353,571	2,191,831,500
営業費用		
支払利息	858,861	973,488
受託者報酬	48,375,185	49,868,751
委託者報酬	845,696,204	797,899,982
その他費用	1,232,228	1,247,160
営業費用合計	896,162,478	849,989,381
営業利益又は営業損失（ ）	2,790,191,093	3,041,820,881
経常利益又は経常損失（ ）	2,790,191,093	3,041,820,881
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,790,191,093	3,041,820,881
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	48,976,788	31,534,023
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	34,882,768,887	34,176,264,035
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,050,165,877	1,994,402,739
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,050,165,877	1,994,402,739
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,283,484,596	1,287,087,210
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,283,484,596	1,287,087,210
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	38,390,664,473	31,873,292,706

（ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
	(2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月11日から翌年7月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第11期中間計算期間は2022年 7月12日から2023年 1月11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10期 (2022年 7月11日現在)	第11期中間計算期間 (2023年 1月11日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	143,734,318,300口	146,912,953,390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 1.2378円 (1万口当たり純資産額) (12,378円)	1口当たり純資産額 1.2170円 (1万口当たり純資産額) (12,170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11期中間計算期間 (2023年 1月11日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券

	第11期中間計算期間 (2023年 1月11日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価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10期 自 2021年 7月13日 至 2022年 7月11日	第11期中間計算期間 自 2022年 7月12日 至 2023年 1月11日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	136,583,457,227円	143,734,318,300円
期中追加設定元本額	17,903,179,345円	8,592,747,059円
期中一部解約元本額	10,752,318,272円	5,414,111,969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

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,490,152,433
株式	494,914,276,630
派生商品評価勘定	8,535,050
未収入金	2,945,000
未収配当金	867,728,995
差入委託証拠金	157,659,400
流動資産合計	498,441,297,508
資産合計	498,441,297,508
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,186,300
前受金	4,355,900
未払解約金	57,029,615
未払利息	2,728
流動負債合計	65,574,543
負債合計	65,574,543
純資産の部	
元本等	
元本	261,665,082,476
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	236,710,640,489
元本等合計	498,375,722,965
純資産合計	498,375,722,965
負債純資産合計	498,441,297,508

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11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。

	2023年 1月11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）

	2023年 1月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	261,665,082,476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 1.9046円 (1万口当たり純資産額) (19,046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

	2023年 1月11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11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	263,755,440,320円
期中追加設定元本額	10,115,408,767円
期中一部解約元本額	12,205,766,611円
期末元本額	261,665,082,476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）	379,795,854円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	4,083,473,385円
SBI資産設計オープン（分配型）	14,347,857円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,987,915,955円
世界経済インデックスファンド	4,504,719,791円
日本株式インデックス・オープン	3,228,412,549円
DCマイセレクション25	6,169,558,303円
DCマイセレクション50	19,071,401,721円
DCマイセレクション75	19,460,015,661円
DC日本株式インデックス・オープン	6,252,267,881円
DCマイセレクションS25	3,257,075,412円
DCマイセレクションS50	9,595,952,779円
DCマイセレクションS75	7,477,139,542円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,692,075,057円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	159,942,648円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	694,091,345円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	519,347,776円
DC世界経済インデックスファンド	3,864,215,597円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,330,420,418円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	7,427,334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）	170,515,554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）	25,219,362円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	95,330,151円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	22,513,920円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	60,370,555円

区分	2023年 1月11日現在
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	776,320,396円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	408,922,014円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,660,532,505円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	37,995,017円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	16,235,877円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	443,135,050円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	246,032,707円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	324,715,250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）	554,179,042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	1,994,789,157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）	536,642,038円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	452,086,412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）	223,702,013円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,974,154円
SMT インデックスバランス・オープン	56,451,212円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	28,123,777,137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	55,545,164円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	211,542,982円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	38,314,505円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,275,166円
グローバル経済コア	222,601,109円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	30,851,978円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	523,479,470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）	246,311,392円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	21,634,324円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	19,065,996円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	7,777,956円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	10,562,271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）	44,562,950,956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）	766,374,139円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	350,386,789円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	25,915,833円

区分	2023年 1月11日現在
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	367,521,214円
SMTAM日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	45,663,218,336円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	20,051,973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）	213,671,495円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 1月11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	2,350,404,100	-	2,354,760,000	4,355,900
合計		2,350,404,100	-	2,354,760,000	4,355,900

（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。

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	38,041,104
株式	3,684,455,280
未収配当金	9,250,150
前払金	970,000
差入委託証拠金	1,950,000
流動資産合計	3,734,666,534
資産合計	3,734,666,534
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	971,100
未払利息	41
流動負債合計	971,141
負債合計	971,141
純資産の部	
元本等	
元本	3,157,712,643
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	575,982,750
元本等合計	3,733,695,393

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
純資産合計	3,733,695,393
負債純資産合計	3,734,666,534

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11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2023年 1月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,157,712,643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 1.1824円 (1万口当たり純資産額) (11,824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

2023年 1月11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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	3,029,447,803円
期中追加設定元本額	128,264,840円
期中一部解約元本額	- 円
期末元本額	3,157,712,643円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	617,380,484円
分散投資コア戦略ファンドS	2,540,332,159円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 1月11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	38,950,000	-	37,980,000	970,000
合計		38,950,000	-	37,980,000	970,000

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2023年 1月11日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	375,009,872
国債証券	515,173,308,220
地方債証券	32,129,459,123
特殊債券	35,680,932,778
社債券	27,219,806,000
未収入金	687,084,400
未収利息	953,333,295
前払費用	28,783,479
流動資産合計	612,247,717,167
資産合計	612,247,717,167
負債の部	
流動負債	
未払解約金	763,712,896
未払利息	410
流動負債合計	763,713,306
負債合計	763,713,306
純資産の部	
元本等	
元本	458,977,730,393
剰余金	
剰余金又は欠損金()	152,506,273,468
元本等合計	611,484,003,861
純資産合計	611,484,003,861
負債純資産合計	612,247,717,167

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11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）

	2023年 1月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	458,977,730,393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 99,080,000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 1.3323円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,323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

	2023年 1月11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	<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>

	2023年 1月11日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	454,636,713,292円
期中追加設定元本額	18,834,850,795円
期中一部解約元本額	14,493,833,694円
期末元本額	458,977,730,393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）	4,206,131,347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	20,878,342,390円
世界経済インデックスファンド	4,447,994,578円
D C マイセレクション 2 5	26,528,425,114円
D C マイセレクション 5 0	30,611,014,705円
D C マイセレクション 7 5	9,171,004,984円
D C 日本債券インデックス・オープン	428,562,353円
D C 日本債券インデックス・オープン S	91,523,013,787円
D C 日本債券インデックス・オープン P	65,298,025,123円
D C マイセレクション S 2 5	13,865,566,479円
D C マイセレクション S 5 0	15,488,950,395円
D C マイセレクション S 7 5	3,555,235,290円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	681,294,609円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	2,370,150,030円

区分	2023年 1月11日現在
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	901,773,535円
D C世界経済インデックスファンド	3,647,433,793円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,355,279円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	27,034,740円
マイセクション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）	76,265,181円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	108,258,936円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	30,772,282円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	24,072,703円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,539,258,295円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	720,069,303円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,017,713,642円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	64,919,215円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	50,856,804円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	934,463,591円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,044,005,169円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,361,021,317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	16,947,059,542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	24,771,108,099円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	186,500,918円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,493,463,870円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	73,473,825円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	37,278,188円
S M T インデックスバランス・オープン	59,228,237円
S M T 世界経済インデックス・オープン	44,923,110円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	88,137,110円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	142,177,390円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	12,888,462円
グローバル経済コア	234,556,289円
S B I資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	36,234,823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	40,060,534円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	22,636,479円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	6,056,548円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	4,788,773円
M y S M T 国内債券インデックス（ノーロード）	92,405,744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）	84,867,285,177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）	46,819,018円

区分	2023年 1月11日現在
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	18,570,247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）	405,809,315円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

項目	2023年 1月11日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,085,148,999
コール・ローン	463,874,016
国債証券	65,777,259,277
派生商品評価勘定	11,018,404
未収利息	389,417,008
前払費用	41,374,052
差入委託証拠金	83,373,111
流動資産合計	68,851,464,867
資産合計	68,851,464,867
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,237,427,166
前受金	761,274
未払金	2,057,531,360
未払解約金	170,819,298
未払利息	508
流動負債合計	3,466,539,606
負債合計	3,466,539,606
純資産の部	
元本等	
元本	75,988,822,513
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,603,897,252
元本等合計	65,384,925,261
純資産合計	65,384,925,261
負債純資産合計	68,851,464,867

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11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	2023年 1月11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)

	2023年 1月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	75,988,822,513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 10,603,897,252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 0.8605円 (1万口当たり純資産額) (8,605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

	2023年 1月11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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	73,444,156,090円
期中追加設定元本額	4,272,185,482円
期中一部解約元本額	1,727,519,059円
期末元本額	75,988,822,513円

区分	2023年 1月11日現在
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	26,280,305,952円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	334,558,031円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	149,941,090円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	29,625,248円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	6,021,187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

（2023年 1月11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	259,606,646	-	260,367,920	761,274
	合計	259,606,646	-	260,367,920	761,274

(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

（2023年 1月11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	63,910,564,511	-	65,137,734,547	1,227,170,036
	アメリカドル	32,205,020,043	-	32,552,221,348	347,201,305
	カナダドル	1,324,817,065	-	1,361,316,097	36,499,032
	メキシコペソ	529,722,139	-	545,960,843	16,238,704
	ユーロ	21,358,673,537	-	21,957,445,812	598,772,275
	イギリスポンド	3,061,771,134	-	3,137,435,963	75,664,829
	スウェーデンクローナ	133,278,915	-	136,667,057	3,388,142
	ノルウェークローネ	131,509,223	-	134,340,868	2,831,645
	デンマーククローネ	210,724,568	-	216,582,478	5,857,910
	ポーランドズロチ	286,138,032	-	293,106,640	6,968,608
	オーストラリアドル	1,024,806,647	-	1,058,952,637	34,145,990
	ニュージーランドドル	140,393,468	-	144,497,886	4,104,418
	シンガポールドル	306,258,419	-	312,403,229	6,144,810
	マレーシアリンギット	359,535,129	-	365,781,187	6,246,058
	イスラエルシェケル	220,299,986	-	227,063,563	6,763,577
	オフショア人民元	2,617,616,206	-	2,693,958,939	76,342,733
合計	63,910,564,511	-	65,137,734,547	1,227,170,036	

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	11,207,447,977
コール・ローン	345,973,741
株式	498,010,047,891
投資信託受益証券	223,631,997
投資証券	11,518,704,560
派生商品評価勘定	158,338,178
未収入金	8,268,362,650
未収配当金	471,059,403

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
差入委託証拠金	3,397,343,546
流動資産合計	533,600,909,943
資産合計	533,600,909,943
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	138,273,983
前受金	70,758,395
未払解約金	12,066,808,023
未払利息	379
流動負債合計	12,275,840,780
負債合計	12,275,840,780
純資産の部	
元本等	
元本	123,723,945,724
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	397,601,123,439
元本等合計	521,325,069,163
純資産合計	521,325,069,163
負債純資産合計	533,600,909,943

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11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1) 先物取引</p>

2023年 1月11日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2023年 1月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	123,723,945,724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 4.2136円 (1万口当たり純資産額) (42,136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

	2023年 1月11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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	126,863,910,081円
期中追加設定元本額	8,073,799,254円
期中一部解約元本額	11,213,763,611円
期末元本額	123,723,945,724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）	1,853,642,091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	33,518,442,358円

区分	2023年 1月11日現在
世界経済インデックスファンド	12,158,914,108円
外国株式インデックス・オープン	904,420,632円
DCマイセレクション25	791,850,685円
DCマイセレクション50	3,653,000,367円
DCマイセレクション75	4,379,220,570円
DC外国株式インデックス・オープン	12,328,438,675円
DCマイセレクションS25	410,701,907円
DCマイセレクションS50	1,882,185,664円
DCマイセレクションS75	1,681,242,418円
DCターゲット・イヤーフンド2025	35,233,576円
DCターゲット・イヤーフンド2035	152,413,073円
DCターゲット・イヤーフンド2045	114,042,584円
DC世界経済インデックスファンド	10,187,487,435円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,199,973,758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）	26,188,872円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	11,147,622円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	41,036,517円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	10,417,138円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	27,941,094円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	223,078,336円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	156,852,275円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,162,239,487円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	90,086,955円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	23,089,991円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	145,605,115円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	46,741,153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）	1,036,792,901円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,173,839,222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	1,580,128,367円
分散投資コア戦略ファンドS	8,402,108,841円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,417,777,373円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,162,029,342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）	584,267,333円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	29,204,966円
SMT インデックスバランス・オープン	152,022,092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）	10,110,829,744円

区分	2023年 1月11日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン	224,145,222円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	865,447,306円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	161,370,756円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	4,553,347円
M y S M T グローバル株式インデックス(ノーロード)	453,608,553円
グローバル経済コア	643,313,270円
S B I資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	14,712,050円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	5,768,850円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	456,682,822円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	92,249,421円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	57,339,209円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	50,866,970円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	20,639,634円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	27,959,141円
10資産分散投資ファンド	18,092円
F O F s用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	231,398,267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)	187,296,048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)	888,530,303円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,434,209,392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)	103,588,823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)	82,597,070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)	74,343,691円
S M T A M海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	219,879,354円
S M T A M海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	213,286,445円
S M T A M海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	212,187,298円
S M T A M海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	214,996,816円
S M T A M海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	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

(2023年 1月11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	10,978,272,665	-	11,049,031,060	70,758,395
	合計	10,978,272,665	-	11,049,031,060	70,758,395

(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

（2023年 1月11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	12,231,606,300	-	12,282,300,500	50,694,200
	アメリカドル	8,991,477,000	-	9,028,414,560	36,937,560
	カナダドル	442,777,500	-	443,599,200	821,700
	ユーロ	1,258,388,500	-	1,265,940,370	7,551,870
	イギリスポンド	561,487,500	-	563,403,400	1,915,900
	スイスフラン	357,517,500	-	359,039,500	1,522,000
	スウェーデンクローナ	139,271,000	-	139,910,100	639,100
	デンマーククローネ	76,488,000	-	76,510,400	22,400
	オーストラリアドル	273,201,000	-	273,963,600	762,600
	香港ドル	101,298,000	-	101,691,000	393,000
	シンガポールドル	29,700,300	-	29,828,370	128,070
合計		12,231,606,300	-	12,282,300,500	50,694,200

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国株式最小分散インデックスマザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	395,007,467
コール・ローン	2,073,969
株式	15,738,877,724

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
投資信託受益証券	47,794,254
投資証券	213,974,421
未収配当金	13,118,345
前払金	4,931,108
差入委託証拠金	44,864,306
流動資産合計	16,460,641,594
資産合計	16,460,641,594
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,931,108
未払利息	2
流動負債合計	4,931,110
負債合計	4,931,110
純資産の部	
元本等	
元本	9,710,980,342
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,744,730,142
元本等合計	16,455,710,484
純資産合計	16,455,710,484
負債純資産合計	16,460,641,594

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11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1) 先物取引</p>

2023年 1月11日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2023年 1月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,710,980,342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 1.6945円 (1万口当たり純資産額) (16,945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

2023年 1月11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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	11,229,018,204円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	1,518,037,862円
期末元本額	9,710,980,342円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	1,154,504,393円
分散投資コア戦略ファンドS	6,061,848,131円
マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	2,494,627,818円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 1月11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	282,231,299	-	277,300,191	4,931,108
合計		282,231,299	-	277,300,191	4,931,108

(注)1.時価の算定方法

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	130,953,289
コール・ローン	3,463,214,907
国債証券	290,288,334,000
派生商品評価勘定	27,881,200
未収入金	2,533,283
未収利息	1,869,661,385
前払費用	148,830,094
差入委託証拠金	450,690,852
流動資産合計	296,382,099,010
資産合計	296,382,099,010
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,421,132
前受金	13,022,443
未払金	151,442,064
未払解約金	70,084,281
未払利息	3,795
流動負債合計	247,973,715
負債合計	247,973,715
純資産の部	
元本等	
元本	98,215,424,424
剰余金	
剰余金又は欠損金()	197,918,700,871
元本等合計	296,134,125,295

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
純資産合計	296,134,125,295
負債純資産合計	296,382,099,010

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11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2023年 1月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		98,215,424,424口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.0151円 (30,151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

	2023年 1月11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11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2023年 1月11日現在
期首	2022年 7月12日
期首元本額	100,796,020,727円
期中追加設定元本額	9,467,766,017円
期中一部解約元本額	12,048,362,320円
期末元本額	98,215,424,424円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,250,648,172円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	541,098,112円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	371,830,524円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,231,334,013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	8,764,731,890円
世界経済インデックスファンド	16,099,036,461円
D C マイセレクション 2 5	1,930,572,966円
D C マイセレクション 5 0	1,689,327,473円
D C マイセレクション 7 5	1,177,223,935円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,327,237,347円
D C マイセレクション S 2 5	983,313,331円
D C マイセレクション S 5 0	782,252,468円
D C マイセレクション S 7 5	458,524,125円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	25,006,728円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	93,682,837円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	48,837,312円
D C 世界経済インデックスファンド	13,647,091,010円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	476,344,113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）	20,682,067円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	37,421,122円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	58,195,344円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	68,635,332円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	61,342,231円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,088,073,769円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	403,298,504円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	1,632,817,272円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	60,331,726円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	36,092,292円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	399,795,263円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	149,806,551円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	195,816,503円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	696,255,518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）	3,262,410,038円

区分	2023年 1月11日現在
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	735,039,967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	276,386,697円
分散投資コア戦略ファンドS	590,656,608円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	614,627,208円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,346,473,976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）	253,999,567円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	109,283,715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）	1,380,915,293円
SMT インデックスバランス・オープン	191,373,969円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	10,158,748,823円
SMT 世界経済インデックス・オープン	300,103,654円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	375,799,114円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	610,479,898円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,114,970円
グローバル経済コア	859,825,110円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	18,576,490円
DCターゲット・イヤーフンド2055	1,893,782円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	102,830,030円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	21,180,418円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030	21,122,714円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040	24,633,213円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050	11,259,052円
DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060	16,679,124円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	100,797,263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）	150,519,956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）	11,543,939,707円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	328,677,046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）	298,390,243円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	184,320,133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）	112,214,322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）	54,156,545円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2023年 1月11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	2,416,418,951	-	2,429,441,394	13,022,443
	合計	2,416,418,951	-	2,429,441,394	13,022,443

(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

(2023年 1月11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	2,406,404,960	-	2,407,842,585	1,437,625
	アメリカドル	1,242,634,135	-	1,238,276,520	4,357,615
	カナダドル	102,137,134	-	102,456,120	318,986
	ユーロ	805,204,882	-	809,092,395	3,887,513
	イギリスポンド	135,279,693	-	135,142,980	136,713
	オフショア人民元	121,149,116	-	122,874,570	1,725,454
	合計	2,406,404,960	-	2,407,842,585	1,437,625

(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

	2023年 1月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,633,491,599
コール・ローン	30,489,942

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
株式	113,954,631,757
投資信託受益証券	258,859,878
投資証券	121,233,213
派生商品評価勘定	196,602,500
未収入金	266,896
未収配当金	128,647,598
差入委託証拠金	1,114,917,315
流動資産合計	118,439,140,698
資産合計	118,439,140,698
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,284
前受金	196,592,816
未払金	27,663
未払解約金	20,341,404
未払利息	33
流動負債合計	216,969,200
負債合計	216,969,200
純資産の部	
元本等	
元本	33,094,394,144
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	85,127,777,354
元本等合計	118,222,171,498
純資産合計	118,222,171,498
負債純資産合計	118,439,140,698

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11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</p>

2023年 1月11日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2023年 1月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	33,094,394,144口

		2023年 1月11日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.5723円 (35,723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

		2023年 1月11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11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	31,174,998,147円

区分	2023年 1月11日現在
期中追加設定元本額	2,611,996,082円
期中一部解約元本額	692,600,085円
期末元本額	33,094,394,144円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国株式インデックス・オープン	7,791,869,169円
世界経済インデックスファンド	6,881,915,215円
D C 新興国株式インデックス・オープン	5,694,829,809円
D C 世界経済インデックスファンド	5,768,689,292円
新興国株式インデックス・オープン（S M A 専用）	125,514,802円
分散投資コア戦略ファンドA	276,729,621円
分散投資コア戦略ファンドS	1,486,419,585円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	866,229,031円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	653,497,549円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	343,054,734円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	16,517,451円
S M T インデックスバランス・オープン	80,902,368円
S M T 世界経済インデックス・オープン	193,843,067円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	775,892,495円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	130,986,987円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	5,358,836円
グローバル経済コア	360,389,708円
M y S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	91,480,126円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	35,549,273円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	31,520,960円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	12,781,547円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	17,315,842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）	1,274,750,077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）	96,867,103円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	71,730,715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）	9,754,649円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 1月11日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,720,676,334	-	3,917,269,150	196,592,816

合計	3,720,676,334	-	3,917,269,150	196,592,816
----	---------------	---	---------------	-------------

(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

(2023年 1月11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	66,180,136	-	66,182,538	2,402
	アメリカドル	66,180,136	-	66,182,538	2,402
	売建	136	-	138	2
	ブラジルリアル	136	-	138	2
合計		66,180,272	-	66,182,676	2,400

(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

	2023年 1月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,544,068,616
コール・ローン	723,118,479
国債証券	85,637,287,468
派生商品評価勘定	9,310,612
未収入金	37,698,603
未収利息	1,098,855,676
前払費用	58,130,538
流動資産合計	91,108,469,992
資産合計	91,108,469,992
負債の部	
流動負債	

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	6,186,088
未払金	3,008,143,993
未払解約金	16,701,361
未払利息	792
流動負債合計	3,031,032,234
負債合計	3,031,032,234
純資産の部	
元本等	
元本	48,138,531,644
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	39,938,906,114
元本等合計	88,077,437,758
純資産合計	88,077,437,758
負債純資産合計	91,108,469,992

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11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）

	2023年 1月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		48,138,531,644口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8297円 (18,297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

	2023年 1月11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11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2023年 1月11日現在
期首	2022年 7月12日
期首元本額	47,067,575,964円
期中追加設定元本額	4,019,683,041円
期中一部解約元本額	2,948,727,361円
期末元本額	48,138,531,644円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国債券インデックス・オープン	4,966,603,505円
世界経済インデックスファンド	14,181,630,653円
D C 新興国債券インデックス・オープン	5,340,443,722円
D C 世界経済インデックスファンド	11,678,947,955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)	3,979,856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(S M A 専用)	36,032,641円
分散投資コア戦略ファンドA	227,137,108円
分散投資コア戦略ファンドS	487,361,674円
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	514,074,848円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,720,473,309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)	210,353,957円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	94,254,874円
S M T インデックスバランス・オープン	163,853,124円
外国債券S M T B セレクション(S M A 専用)	1,942,180,440円
S M T 世界経済インデックス・オープン	391,899,196円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	489,752,257円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	794,956,340円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	10,871,070円
グローバル経済コア	750,748,603円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	19,402,087円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	3,565,644円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	36,770,058円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	29,699,378円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	11,409,480円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	14,785,575円
M y S M T 新興国債券インデックス(ノーロード)	25,209,712円
10資産分散投資ファンド	13,984円
F O F s 用 新興国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	30,498,632円
F O F s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	232,296,785円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	146,163,556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)	9,986,185円
S M T A M 海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	258,840,573円
S M T A M 海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	259,681,915円

区分	2023年 1月11日現在
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）

通貨関連

（2023年 1月11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	1,584,374,249	-	1,593,684,861	9,310,612
	ブラジルリアル	1,584,374,249	-	1,593,684,861	9,310,612
	売建	1,584,374,249	-	1,590,560,337	6,186,088
	アメリカドル	1,584,374,249	-	1,590,560,337	6,186,088
合計		3,168,748,498	-	3,184,245,198	3,124,524

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,542,617,843
投資証券	122,860,938,000
未収配当金	930,594,434
前払金	218,587,600
差入委託証拠金	249,194,000
流動資産合計	127,801,931,877
資産合計	127,801,931,877
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	218,587,600
未払金	444,924,736
未払解約金	422,521,742
未払利息	3,882

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	1,086,037,960
負債合計	1,086,037,960
純資産の部	
元本等	
元本	61,352,601,615
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	65,363,292,302
元本等合計	126,715,893,917
純資産合計	126,715,893,917
負債純資産合計	127,801,931,877

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11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)

	2023年 1月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	61,352,601,615口
2. 1口当たり純資産額	2.0654円

	2023年 1月11日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額)	(20,654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

	2023年 1月11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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	54,153,941,017円
期中追加設定元本額	10,222,949,320円

区分	2023年 1月11日現在
期中一部解約元本額	3,024,288,722円
期末元本額	61,352,601,615円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,739,434,796円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,348,462円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,724,135,174円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	32,038,258,449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
SMT インデックスバランス・オープン	25,662,797円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	243,554,016円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,940,087円
グローバル経済コア	246,877,714円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	13,409,812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)	119,205,899円
My SMT J-REITインデックス(ノーロード)	233,442,409円
10資産分散投資ファンド	7,002円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	506,551,777円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	9,900,838円
SMTAM9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)	88,179,009円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05(適格機関投資家専用)	582,560,084円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11(適格機関投資家専用)	255,846,897円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03(適格機関投資家専用)	291,735,719円

(デリバティブ取引に関する注記)

投資証券関連

(2023年 1月11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	-	3,809,256,000	218,587,600
	合計	4,027,843,600	-	3,809,256,000	218,587,600

(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ではありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	294,743,122
コール・ローン	221,963,491
投資証券	80,299,061,097
派生商品評価勘定	914,104
未収配当金	312,255,853
流動資産合計	81,128,937,667
資産合計	81,128,937,667
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,365
未払解約金	12,435,382
未払利息	243
流動負債合計	12,467,990
負債合計	12,467,990
純資産の部	
元本等	
元本	34,836,857,284
剰余金	
剰余金又は欠損金()	46,279,612,393
元本等合計	81,116,469,677
純資産合計	81,116,469,677
負債純資産合計	81,128,937,667

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11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> <p>為替予約取引</p>

2023年 1月11日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (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)

2023年 1月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	34,836,857,284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 2.3285円 (1万口当たり純資産額) (23,285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

2023年 1月11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。

	2023年 1月11日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	39,468,176,591円
期中追加設定元本額	4,046,987,275円
期中一部解約元本額	8,678,306,582円
期末元本額	34,836,857,284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）	1,698,926,996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	12,437,622,506円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	13,231,485,087円
コア投資戦略ファンド（安定型）	353,133,064円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,090,366,067円
分散投資コア戦略ファンドA	717,849,611円
分散投資コア戦略ファンドS	1,552,054,929円

区分	2023年 1月11日現在
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	128,912,429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	7,632,225円
グローバル経済コア	238,740,300円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	12,791,110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）	68,408,671円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	83,797,092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）	1,102,788,680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）	198,161,231円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	77,945,585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）	34,902,123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

（2023年 1月11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	201,079,220	-	201,993,084	913,864
	アメリカドル	165,026,120	-	165,742,764	716,644
	ユーロ	21,202,950	-	21,336,135	133,185
	シンガポールドル	14,850,150	-	14,914,185	64,035
	売建	488,261,927	-	488,294,052	32,125
	アメリカドル	348,106,800	-	348,119,424	12,624
	カナダドル	1,675,588	-	1,675,608	20
	ユーロ	29,155,100	-	29,157,519	2,419
	イギリスポンド	21,243,684	-	21,246,033	2,349
	オーストラリアドル	28,759,815	-	28,763,406	3,591

ニュージーランド ドル	8,435,300	-	8,435,060	240
香港ドル	26,352,585	-	26,352,585	-
シンガポールドル	19,382,805	-	19,386,081	3,276
イスラエルシケ ル	5,150,250	-	5,158,336	8,086
合計	689,341,147	-	690,287,136	881,739

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	34,331,250
コール・ローン	57,846,213
投資信託受益証券	32,067,488,384
未収入金	150,380,394
流動資産合計	32,310,046,241
資産合計	32,310,046,241
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	339,164,777
未払金	1,922,340
未払解約金	185,120,198
未払利息	63
流動負債合計	526,207,378
負債合計	526,207,378
純資産の部	
元本等	
元本	25,343,967,809
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,439,871,054
元本等合計	31,783,838,863
純資産合計	31,783,838,863
負債純資産合計	32,310,046,241

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11日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2023年 1月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,343,967,809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 1.2541円 (1万口当たり純資産額) (12,541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

2023年 1月11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

	2023年 1月11日現在
	<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)デリバティブ取引</p> <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</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	25,625,430,409円
期中追加設定元本額	3,960,042,859円
期中一部解約元本額	4,241,505,459円
期末元本額	25,343,967,809円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,477,391,331円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,714,459,383円
分散投資コア戦略ファンドA	2,163,979,134円
分散投資コア戦略ファンドS	7,604,496,827円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,673,739,703円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	531,503,932円
グローバル経済コア	876,867,434円

区分	2023年 1月11日現在
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	3,919,414,782円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	867,992,469円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	167,158,762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）	620,119,342円
SMT AM9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	637,236,456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）	89,608,254円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2023年 1月11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	31,182,699,974	-	31,521,864,751	339,164,777
	アメリカドル	31,182,699,974	-	31,521,864,751	339,164,777
合計		31,182,699,974	-	31,521,864,751	339,164,777

(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。

H F リターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	147,889,525
コール・ローン	1,335,494,845
国債証券	6,304,901,400
投資信託受益証券	2,245,883,352
派生商品評価勘定	65,564,785
未収入金	662,631,350
差入委託証拠金	2,243,396,698
流動資産合計	13,005,761,955
資産合計	13,005,761,955
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	53,052,426

項目	2023年 1月11日現在
	金額（円）
前受金	12,581,085
未払金	2,096,885
未払解約金	103,595,703
未払利息	1,463
流動負債合計	171,327,562
負債合計	171,327,562
純資産の部	
元本等	
元本	14,203,969,723
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,369,535,330
元本等合計	12,834,434,393
純資産合計	12,834,434,393
負債純資産合計	13,005,761,955

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11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引及び債券先物取引 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>

	2023年 1月11日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2023年 1月11日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	14,203,969,723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 1,369,535,330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 0.9036円 (1万口当たり純資産額) (9,036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

	2023年 1月11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>

	2023年 1月11日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	14,257,391,013円
期中追加設定元本額	100,104,133円
期中一部解約元本額	153,525,423円
期末元本額	14,203,969,723円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	3,927,125,252円
分散投資コア戦略ファンドS	4,108,260,778円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	6,088,045,301円
HFRリターン・ターゲット・ファンド・為替ヘッジあり（SMA専用）	80,538,392円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 1月11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	4,401,453,968	-	4,459,084,848	57,630,880
	売建	2,265,985,840	-	2,285,238,382	19,252,542
合計		6,667,439,808	-	6,744,323,230	38,378,338

(注)1. 時価の算定方法

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

債券関連

(2023年 1月11日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	売建	3,098,577,947	-	3,124,375,200	25,797,253
合計		3,098,577,947	-	3,124,375,200	25,797,253

(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

(2023年 1月11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	456,102,011	-	456,081,810	20,201
	カナダドル	100,243,822	-	100,241,780	2,042
	ユーロ	309,887,765	-	309,876,850	10,915
	スウェーデンクローナ	45,970,424	-	45,963,180	7,244
	売建	5,743,010,323	-	5,743,058,848	48,525
	アメリカドル	5,280,743,281	-	5,280,771,498	28,217
	イギリスポンド	226,973,782	-	226,980,150	6,368

	スイスフラン	235,293,260	-	235,307,200	13,940
	合計	6,199,112,334	-	6,199,140,658	68,726

(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。

GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）

貸借対照表

	2023年 1月11日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,505,313,291
国債証券	3,121,749,360
派生商品評価勘定	68,726,112
未収入金	40,003,618
前払金	22,337,081
差入委託証拠金	522,938,506
流動資産合計	6,281,067,968
資産合計	6,281,067,968
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	86,495,992
未払金	40,556,702
未払利息	2,745
流動負債合計	127,055,439
負債合計	127,055,439
純資産の部	
元本等	
元本	5,483,456,054
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	670,556,475
元本等合計	6,154,012,529
純資産合計	6,154,012,529
負債純資産合計	6,281,067,968

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11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

2023年 1月11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、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(外貨建先物取引は、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)

2023年 1月11日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	5,483,456,054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 1.1223円 (1万口当たり純資産額) (11,223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

	2023年 1月11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	2023年 1月11日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 7月12日
期首元本額	252,120,355円
期中追加設定元本額	5,256,891,881円
期中一部解約元本額	25,556,182円
期末元本額	5,483,456,054円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	981,922,457円
分散投資コア戦略ファンドS	4,274,969,424円

区分	2023年 1月11日現在
SMTAM・FOFs用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド(4%目標コース)(適格機関投資家専用)	226,564,173円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2023年 1月11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	3,411,950,598	-	3,381,600,102	30,350,496
	売建	5,081,348,665	-	5,073,335,250	8,013,415
合計		8,493,299,263	-	8,454,935,352	22,337,081

(注)1.時価の算定方法

債券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(外貨建先物取引は、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.外貨建先物取引は、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

(2023年 1月11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	2,130,828,431	-	2,143,621,394	12,792,963
	アメリカドル	120,114,907	-	120,255,700	140,793
	カナダドル	155,179,314	-	159,595,110	4,415,796
	ユーロ	210,828,730	-	213,151,054	2,322,324
	イギリスポンド	173,860,637	-	178,099,141	4,238,504
	スウェーデンクローナ	732,746,786	-	730,524,309	2,222,477
	ノルウェークローネ	478,146,473	-	481,135,372	2,988,899
	ニュージーランドドル	259,951,584	-	260,860,708	909,124
	売建	1,437,496,783	-	1,445,714,955	8,218,172
	スイスフラン	881,867,912	-	884,542,117	2,674,205

	オーストラリアドル	555,628,871	-	561,172,838	5,543,967
	合計	3,568,325,214	-	3,589,336,349	4,574,791

(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 4月11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)
負債の部		
流動負債		
預り金	44	47
未払金	7,572	8,285
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,154	4,561
その他未払金	3,417	3,723
未払費用	1,046	1,049
未払法人税等	517	504
賞与引当金	556	578
その他	818	1,958
流動負債合計	10,555	12,423
固定負債		
退職給付引当金	626	820
資産除去債務	133	153
その他	8	12
固定負債合計	768	986
負債合計	11,324	13,410
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	38,258	41,948
利益剰余金合計	40,858	44,548
株主資本合計	60,098	63,788
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	791	941

繰延ヘッジ損益	65	509
評価・換算差額等合計	726	431
純資産合計	60,824	64,219
負債・純資産合計	72,149	77,629

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	37,224	41,730
運用受託報酬	10,982	11,883
その他営業収益	403	390
営業収益合計	48,611	54,004
営業費用		
支払手数料	17,936	20,567
広告宣伝費	203	286
調査費	5,064	5,567
調査費	898	1,062
委託調査費	4,154	4,487
図書費	11	17
営業雑経費	4,492	5,201
通信費	56	68
印刷費	449	454
協会費	58	55
諸会費	18	35
情報機器関連費	3,815	4,473
その他営業雑経費	93	112
営業費用合計	27,696	31,622
一般管理費		
給料	5,976	6,295
役員報酬	214	249
給料・手当	4,861	5,072
賞与	901	972
退職給付費用	170	254
福利費	608	632
交際費	1	3
旅費交通費	13	20
租税公課	315	327
不動産賃借料	276	323
寄付金	3	5

減価償却費	748	989
業務委託費	966	1,081
諸経費	848	1,301
一般管理費合計	9,929	11,234
営業利益	10,984	11,147

(単位：百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239

当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	
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用いた簡便法を適用しておりましたが、対象となる従業員数の増加に伴い、当事業年度より原則法による計算を併用しております。これにより、退職給付引当金が120百万円増加し、同額を退職給付費用として特別損失に計上しております。

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

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度		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
	英ポンド	250	-	1
	カナダドル	111	-	1
	スイスフラン	164	-	1
	香港ドル	219	-	0
	ユーロ	721	-	0
	買建			
	米ドル	259	-	0
	香港ドル	2	-	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23日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドAの2022年7月12日から2023年1月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、分散投資コア戦略ファンドAの2023年1月11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7月12日から2023年1月11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. XBR 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23日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 松崎雅則

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドSの2022年7月12日から2023年1月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、分散投資コア戦略ファンドSの2023年1月11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7月12日から2023年1月11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。