

**【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11月17日提出
【計算期間】	第9期中(自 2023年2月18日至 2023年8月17日)
【ファンド名】	サテライト投資戦略ファンド(株式型)
【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9月29日現在の状況について記載してあります。

## 【サテライト投資戦略ファンド（株式型）】

## (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	3,792,635,160	42.15
投資証券	ルクセンブルク	373,354,591	4.15
	ケイマン	267,066,453	2.97
	ジャージー	143,691,435	1.60
	小計	784,112,479	8.71
親投資信託受益証券	日本	4,259,996,990	47.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		160,698,165	1.79
合計(純資産総額)		8,997,442,794	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	(2016年 2月17日)	37,286,279,341	37,286,279,341	8,647	8,647
第2期計算期間末	(2017年 2月17日)	30,621,118,809	30,621,118,809	9,555	9,555
第3期計算期間末	(2018年 2月19日)	18,433,690,243	18,433,690,243	10,131	10,131
第4期計算期間末	(2019年 2月18日)	18,337,969,638	18,337,969,638	9,864	9,864
第5期計算期間末	(2020年 2月17日)	13,138,863,682	13,138,863,682	10,917	10,917
第6期計算期間末	(2021年 2月17日)	11,518,211,025	11,518,211,025	11,845	11,845
第7期計算期間末	(2022年 2月17日)	9,679,176,610	9,679,176,610	12,563	12,563
第8期計算期間末	(2023年 2月17日)	8,916,277,272	8,916,277,272	12,791	12,791
	2022年 9月末日	8,806,443,040		12,214	
	10月末日	9,031,065,576		12,607	
	11月末日	8,983,468,829		12,689	
	12月末日	8,637,235,293		12,289	
	2023年 1月末日	8,850,453,532		12,642	
	2月末日	8,854,073,670		12,727	
	3月末日	8,796,555,240		12,736	
	4月末日	8,868,933,027		12,924	

5月末日	9,012,451,637		13,284
6月末日	9,184,302,234		13,777
7月末日	9,148,287,381		13,864
8月末日	9,133,634,261		14,015
9月末日	8,997,442,794		13,886

## 【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	2015年 6月16日～2016年 2月17日	0
第2期計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	0
第3期計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	0
第4期計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0
第5期計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月17日	0
第6期計算期間	2020年 2月18日～2021年 2月17日	0
第7期計算期間	2021年 2月18日～2022年 2月17日	0
第8期計算期間	2022年 2月18日～2023年 2月17日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2015年 6月16日～2016年 2月17日	13.5
第2期計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	10.5
第3期計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	6.0
第4期計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	2.6
第5期計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月17日	10.7
第6期計算期間	2020年 2月18日～2021年 2月17日	8.5
第7期計算期間	2021年 2月18日～2022年 2月17日	6.1
第8期計算期間	2022年 2月18日～2023年 2月17日	1.8
第9期中間計算期間	2023年 2月18日～2023年 8月17日	7.7

(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)

中小型株式 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	22,572,089,000	94.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,248,417,457	5.24
合計(純資産総額)		23,820,506,457	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。

## 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	567,182,679,660	98.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,787,912,121	1.35
合計(純資産総額)		574,970,591,781	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	5,971,395,000	1.04

(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ESGセレクト・リーダーズ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	11,690,404,280	97.27
投資証券	日本	149,444,400	1.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		178,113,932	1.48
合計(純資産総額)		12,017,962,612	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	176,586,000	1.47

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

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

## 外国株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	401,505,357,979	68.05
	イギリス	24,048,770,892	4.08
	カナダ	19,977,364,676	3.39
	フランス	18,086,055,796	3.07
	スイス	18,068,171,667	3.06
	ドイツ	13,551,974,450	2.30
	オーストラリア	11,001,412,050	1.86
	アイルランド	10,637,436,027	1.80
	オランダ	10,433,331,381	1.77
	デンマーク	5,449,818,244	0.92
	スウェーデン	4,702,722,134	0.80
	スペイン	4,217,731,360	0.71
	イタリア	3,092,605,394	0.52
	香港	2,806,932,492	0.48
	シンガポール	1,923,319,127	0.33
	フィンランド	1,799,404,712	0.30
	ジャージー	1,693,259,960	0.29
	ベルギー	1,275,022,972	0.22
	ノルウェー	1,198,262,968	0.20
	イスラエル	1,153,389,469	0.20
	キュラソー	962,258,635	0.16
	バミューダ	929,956,200	0.16
	ケイマン	836,634,552	0.14
	ニュージーランド	425,919,421	0.07
	ルクセンブルク	344,609,293	0.06
	オーストリア	328,501,688	0.06
	ポルトガル	317,459,559	0.05
リベリア	240,992,688	0.04	
パナマ	155,104,947	0.03	

	マン島	83,795,416	0.01
	小計	561,247,576,149	95.12
新株予約権証券	カナダ	-	-
投資信託受益証券	オーストラリア	110,654,920	0.02
	香港	49,060,147	0.01
	小計	159,715,067	0.03
投資証券	アメリカ	9,370,596,574	1.59
	オーストラリア	684,045,509	0.12
	シンガポール	237,310,576	0.04
	フランス	215,548,708	0.04
	イギリス	159,430,686	0.03
	香港	117,850,510	0.02
	カナダ	55,301,186	0.01
	ベルギー	46,684,626	0.01
	小計	10,886,768,375	1.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,722,711,493	3.00
合計(純資産総額)		590,016,771,084	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	13,008,505,162	2.20
	買建	カナダ	627,071,894	0.11
	買建	ドイツ	2,595,246,554	0.44
	買建	イギリス	893,842,108	0.15
	買建	オーストラリア	592,738,230	0.10

(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		730,540,746	0.12

(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E S Gリーダーズ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	8,445,930,191	68.44
	イギリス	486,489,864	3.94
	フランス	444,481,102	3.60
	カナダ	420,957,563	3.41
	アイルランド	336,055,438	2.72
	スイス	312,289,962	2.53
	オランダ	262,431,813	2.13
	デンマーク	208,885,832	1.69
	オーストラリア	178,669,324	1.45
	ドイツ	167,872,821	1.36
	スウェーデン	101,971,800	0.83
	香港	63,713,867	0.52
	スペイン	63,484,293	0.51
	イタリア	59,486,082	0.48
	フィンランド	54,905,164	0.44
	ノルウェー	43,159,850	0.35
	キュラソー	41,192,516	0.33
	ジャージー	41,008,692	0.33
	シンガポール	22,895,880	0.19
	バミューダ	22,525,120	0.18
	ニュージーランド	12,484,653	0.10
	ベルギー	10,172,890	0.08
	ポルトガル	6,085,723	0.05
	オーストリア	5,625,160	0.05
	イスラエル	5,560,941	0.05
	ルクセンブルク	4,220,417	0.03
ケイマン	1,848,319	0.01	
	小計	11,824,405,277	95.82
投資信託受益証券	オーストラリア	3,549,984	0.03
	香港	1,713,211	0.01
	小計	5,263,195	0.04
投資証券	アメリカ	204,737,406	1.66
	オーストラリア	25,395,913	0.21
	イギリス	4,591,324	0.04
	フランス	3,856,208	0.03
	シンガポール	2,962,151	0.02

	カナダ	2,485,371	0.02
	小計	244,028,373	1.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		266,957,313	2.16
合計(純資産総額)		12,340,654,158	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	194,640,975	1.58
	買建	ドイツ	39,664,320	0.32

(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。

#### 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	25,544,798,624	16.12
	インド	24,172,969,132	15.25
	台湾	22,196,375,022	14.01
	韓国	18,783,685,843	11.85
	中国	17,334,348,922	10.94
	ブラジル	7,849,290,576	4.95
	サウジアラビア	6,408,016,295	4.04
	南アフリカ	4,336,841,902	2.74
	メキシコ	3,707,861,763	2.34
	インドネシア	3,043,727,108	1.92
	タイ	2,856,111,255	1.80
	アラブ首長国連邦	2,199,506,548	1.39
	マレーシア	2,161,476,562	1.36
	香港	1,480,828,648	0.93
	カタール	1,456,032,144	0.92
	クウェート	1,268,994,166	0.80
	トルコ	1,134,263,590	0.72
ポーランド	1,023,323,213	0.65	
フィリピン	960,425,115	0.61	



	チリ	749,221,114	0.47
	アメリカ	727,548,870	0.46
	ギリシャ	658,022,615	0.42
	バミューダ	626,978,543	0.40
	ハンガリー	363,978,472	0.23
	チェコ	251,537,128	0.16
	ルクセンブルク	198,147,800	0.13
	イギリス	163,875,726	0.10
	コロンビア	146,155,217	0.09
	エジプト	78,781,632	0.05
	シンガポール	25,037,731	0.02
	ペルー	21,499,986	0.01
	オランダ	16,221,009	0.01
	ロシア	117	0.00
	キプロス	-	-
	英ヴァージン諸島	-	-
	小計	151,945,882,388	95.89
投資信託受益証券	ブラジル	340,695,987	0.22
	メキシコ	114,555,134	0.07
	小計	455,251,121	0.29
投資証券	メキシコ	93,845,186	0.06
	南アフリカ	38,870,151	0.02
	小計	132,715,337	0.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,925,761,193	3.74
合計(純資産総額)		158,459,610,039	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,959,917,873	3.76

(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		141,111,195	0.09
	売建		2,082,369	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。

## 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	126,597,388,300	96.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,192,637,384	3.21
合計(純資産総額)		130,790,025,684	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	4,171,750,000	3.19

(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	70,721,190,515	77.72
	オーストラリア	5,953,212,201	6.54
	イギリス	3,991,670,144	4.39
	シンガポール	3,288,491,481	3.61
	フランス	1,522,320,376	1.67
	カナダ	1,462,449,571	1.61
	香港	1,046,509,395	1.15
	ベルギー	928,004,658	1.02
	スペイン	364,691,871	0.40
	ニュージーランド	264,573,589	0.29
	韓国	175,865,273	0.19

	オランダ	169,938,603	0.19
	ガーンジー	155,445,808	0.17
	イスラエル	120,120,134	0.13
	ドイツ	36,888,260	0.04
	アイルランド	30,558,780	0.03
	イタリア	11,051,357	0.01
	小計	90,242,982,016	99.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		752,757,805	0.83
合計(純資産総額)		90,995,739,821	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		189,813,544	0.21

(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	29,780,035,257	103.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		909,049,301	3.15
合計(純資産総額)		28,870,985,956	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		30,543,083,559	105.79

(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。

## ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
社債券	ケイマン	27,672,322,550	92.80
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,147,003,074	7.20
合計(純資産総額)		29,819,325,624	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。

## 米国株式LSマザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
社債券	アイルランド	21,110,932,015	100.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		130,748,704	0.62
合計(純資産総額)		20,980,183,311	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		20,929,476,000	99.76

(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。

## コモディティLSアルファ・マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
社債券	アイルランド	17,139,690,000	92.99
	イギリス	1,065,350,000	5.78
	小計	18,205,040,000	98.78

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		225,769,594	1.22
合計(純資産総額)		18,430,809,594	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。

#### 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	11,826,206,960	56.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,154,671,924	43.63
合計(純資産総額)		20,980,878,884	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	9,422,400,000	44.91
	買建	イギリス	4,814,761,737	22.95
	売建	アメリカ	10,793,382,454	51.44
	売建	ドイツ	16,807,144,140	80.11

(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		6,976,660,240	33.25
	売建		8,012,223,411	38.19

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

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

#### 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

##### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
社債券	アイルランド	8,248,986,400	99.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		44,727,063	0.54
合計(純資産総額)		8,293,713,463	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。

## 2【設定及び解約の実績】

## 【サテライト投資戦略ファンド（株式型）】

	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	2015年 6月16日～2016年 2月17日	49,526,375,760	6,407,778,915	43,118,596,845
第2期計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	11,056,157,024	22,127,791,489	32,046,962,380
第3期計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	8,740,142,510	22,591,145,594	18,195,959,296
第4期計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	7,015,265,506	6,619,741,116	18,591,483,686
第5期計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月17日	1,220,521,390	7,776,843,668	12,035,161,408
第6期計算期間	2020年 2月18日～2021年 2月17日	167,978,519	2,478,672,606	9,724,467,321
第7期計算期間	2021年 2月18日～2022年 2月17日	97,944,390	2,117,977,175	7,704,434,536
第8期計算期間	2022年 2月18日～2023年 2月17日	70,367,550	804,261,025	6,970,541,061
第9期中間計算期間	2023年 2月18日～2023年 8月17日	40,261,661	443,134,967	6,567,667,755

(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】

(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9期中間計算期間(2023年2月18日から2023年8月17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。



## 【サテライト投資戦略ファンド（株式型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 （2023年 2月17日現在）	第9期中間計算期間 （2023年 8月17日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	272,623,265	299,659,225
投資信託受益証券	2,839,242,976	3,751,286,470
投資証券	516,765,394	785,953,531
親投資信託受益証券	5,361,287,130	4,294,393,950
流動資産合計	8,989,918,765	9,131,293,176
資産合計	8,989,918,765	9,131,293,176
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	14,163,121
未払受託者報酬	2,479,507	2,447,731
未払委託者報酬	70,914,039	70,005,056
未払利息	57	664
その他未払費用	247,890	244,717
流動負債合計	73,641,493	86,861,289
負債合計	73,641,493	86,861,289
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,970,541,061	6,567,667,755
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,945,736,211	2,476,764,132
（分配準備積立金）	1,999,575,150	1,872,890,631
元本等合計	8,916,277,272	9,044,431,887
純資産合計	8,916,277,272	9,044,431,887
負債純資産合計	8,989,918,765	9,131,293,176

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期中間計算期間 自 2022年 2月18日 至 2022年 8月17日	第9期中間計算期間 自 2023年 2月18日 至 2023年 8月17日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	2,560,239	2,256,859
受取利息	416	167
有価証券売買等損益	320,801,134	736,317,556
その他収益	-	503,685
営業収益合計	323,361,789	739,078,267
<b>営業費用</b>		
支払利息	22,692	69,614
受託者報酬	2,555,089	2,447,731
委託者報酬	73,075,350	70,005,056
その他費用	255,439	244,717
営業費用合計	75,908,570	72,767,118
営業利益又は営業損失（ ）	247,453,219	666,311,149
経常利益又は経常損失（ ）	247,453,219	666,311,149
中間純利益又は中間純損失（ ）	247,453,219	666,311,149
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（ ）	1,554,535	24,237,401
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,974,742,074	1,945,736,211
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,686,166	12,668,039
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,686,166	12,668,039
剰余金減少額又は欠損金増加額	118,638,416	123,713,866
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	118,638,416	123,713,866
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,115,797,578	2,476,764,132

## （ 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	<p>(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。</p> <p>(2)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>(3)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。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 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>

## （中間貸借対照表に関する注記）

	第8期 (2023年 2月17日現在)	第9期中間計算期間 (2023年 8月17日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	6,970,541,061口	6,567,667,755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 1.2791円 (1万口当たり純資産額) (12,791円)	1口当たり純資産額 1.3771円 (1万口当たり純資産額) (13,771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9期中間計算期間 (2023年 8月17日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

元本の移動

区分	第8期 自 2022年 2月18日 至 2023年 2月17日	第9期中間計算期間 自 2023年 2月18日 至 2023年 8月17日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	7,704,434,536円	6,970,541,061円
期中追加設定元本額	70,367,550円	40,261,661円
期中一部解約元本額	804,261,025円	443,134,967円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (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。

## 中小型株式 マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 8月17日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	963,024,880
株式	22,573,044,500
未収入金	186,299,809
未収配当金	26,491,400
流動資産合計	23,748,860,589
資産合計	23,748,860,589
負債の部	
流動負債	
未払金	19,246,967
未払利息	2,133
流動負債合計	19,249,100
負債合計	19,249,100
純資産の部	
元本等	
元本	4,469,774,507
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,259,836,982
元本等合計	23,729,611,489
純資産合計	23,729,611,489
負債純資産合計	23,748,860,589

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月17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. 収益及び費用の計上基準	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。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		4,469,774,507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)	5.3089円 (53,089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 8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	4,573,695,116円
期中追加設定元本額	185,425,298円
期中一部解約元本額	289,345,907円
期末元本額	4,469,774,507円
期末元本額の内訳	

区分	2023年 8月17日現在
中小型株式オープン	2,759,057,083円
中小型株式オープン（SMA専用）	50,222,216円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	1,636,030,413円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	24,464,795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。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年 8月17日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	2,695,498,000
株式	551,698,366,410
派生商品評価勘定	5,173,250
未収配当金	804,734,355
前払金	24,194,000
差入委託証拠金	102,750,000
流動資産合計	555,330,716,015
資産合計	555,330,716,015
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	29,410,150
未払解約金	792,939,585
未払利息	5,972
流動負債合計	822,355,707
負債合計	822,355,707
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	242,207,072,901
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	312,301,287,407
元本等合計	554,508,360,308
純資産合計	554,508,360,308
負債純資産合計	555,330,716,015

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	2023年 8月17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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引 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 8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	242,207,072,901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 2.2894円 (1万口当たり純資産額) (22,894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 8月17日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>売買目的有価証券</p> <p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引</p>



	2023年 8月17日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	258,952,777,044円
期中追加設定元本額	10,856,146,706円
期中一部解約元本額	27,601,850,849円
期末元本額	242,207,072,901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）	333,386,187円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	3,486,750,611円
S B I 資産設計オープン（分配型）	11,982,129円
S M T T O P I Xインデックス・オープン	11,116,608,541円
世界経済インデックスファンド	4,865,051,857円
日本株式インデックス・オープン	3,039,682,167円
D C マイセレクション 2 5	5,509,268,445円
D C マイセレクション 5 0	17,729,672,882円
D C マイセレクション 7 5	18,524,505,460円
D C 日本株式インデックス・オープン	6,040,396,600円
D C マイセレクション S 2 5	3,230,130,220円

区分	2023年 8月17日現在
DCマイセレクションS50	9,501,855,661円
DCマイセレクションS75	8,088,930,601円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,042,061,626円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	131,436,799円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	683,077,087円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	520,896,320円
DC世界経済インデックスファンド	3,714,374,735円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	920,674,448円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,668,401円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,059,381円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	15,125,814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）	159,070,511円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,072,124円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	17,934,767円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	74,963,432円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	16,846,659円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	48,815,045円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	596,015,510円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	331,974,155円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,241,726,636円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	31,095,300円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	13,271,382円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	348,598,556円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	198,346,837円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	260,050,409円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	21,623,051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）	445,706,848円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,635,142,630円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,799,359,444円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,241,824,743円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,805,562,216円
分散投資コア戦略ファンドA	1,593,061,162円
分散投資コア戦略ファンドS	6,059,257,110円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	570,861,845円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	400,997,839円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,322,566,262円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	206,304,106円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,632,222円
SMT インデックスバランス・オープン	50,616,597円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	18,903,179,888円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	285,794,619円
SMT 世界経済インデックス・オープン	49,627,485円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	203,540,608円

区分	2023年 8月17日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	34,885,123円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	11,588,897円
グローバル経済コア	212,216,739円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	33,424,097円
M y S M T T O P I Xインデックス（ノーロード）	929,462,161円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	28,618,283円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	980,337,953円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	226,289,632円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	55,833,393円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	50,064,093円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	20,776,312円
D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	21,844,873円
10資産分散投資ファンド	93,091,386円
F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,304,728,456円
F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	524,850,986円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	294,694,010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）	21,880,557円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	614,567,203円
S M T A M 日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	46,062,653,335円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,376,913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）	203,852,529円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2023年 8月17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	2,797,844,000	-	2,773,650,000	24,194,000
	合計	2,797,844,000	-	2,773,650,000	24,194,000

(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。

#### 日本株式E S Gセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

#### 貸借対照表

	2023年 8月17日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	87,184,951
株式	11,190,063,970
投資証券	146,821,300
派生商品評価勘定	449,348
未収入金	36,324
未収配当金	14,376,890
前払金	320,750
差入委託証拠金	4,092,250
流動資産合計	11,443,345,783
資産合計	11,443,345,783
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	773,728
未払解約金	2,634,488
未払利息	193
流動負債合計	3,408,409
負債合計	3,408,409
純資産の部	
元本等	
元本	9,276,550,341
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,163,387,033
元本等合計	11,439,937,374
純資産合計	11,439,937,374
負債純資産合計	11,443,345,783

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月17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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 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> <p>先物取引</p>

2023年 8月17日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、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>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

2023年 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,276,550,341口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.2332円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (12,332円)</p>

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

2023年 8月17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>

	2023年 8月17日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	9,766,829,960円
期中追加設定元本額	627,526,060円
期中一部解約元本額	1,117,805,679円
期末元本額	9,276,550,341円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	206,252,795円
コア投資戦略ファンド（成長型）	465,879,556円
コア投資戦略ファンド（切替型）	240,510,570円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	6,957,928,026円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	105,416,524円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	177,935,243円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	37,500,556円
DC日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスファンド	956,025,834円
私募日本株式ESGセレクト・リーダーズパッシブファンド（適格機関投資家専用）	41,674,525円
FOFs用 日本株式ESGセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	87,426,712円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2023年 8月17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	101,795,750	-	101,475,000	320,750
合計		101,795,750	-	101,475,000	320,750

## (注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2023年 8月17日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	8,393,640,441
コール・ローン	504,214,754
株式	560,845,281,781
投資信託受益証券	175,353,491
投資証券	11,367,728,136
派生商品評価勘定	19,573,498
未収入金	461,537
未収配当金	717,030,732
前払金	140,563,399
差入委託証拠金	4,712,871,411
流動資産合計	586,876,719,180
資産合計	586,876,719,180
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	163,010,679
未払解約金	859,992,946
未払利息	1,117
流動負債合計	1,023,004,742
負債合計	1,023,004,742
純資産の部	
元本等	
元本	113,433,464,160
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	472,420,250,278
元本等合計	585,853,714,438
純資産合計	585,853,714,438
負債純資産合計	586,876,719,180

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
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>



	2023年 8月17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。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2023年 8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	113,433,464,160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 5.1647円 (1万口当たり純資産額) (51,647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 8月17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 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	121,979,552,292円
期中追加設定元本額	6,500,598,183円
期中一部解約元本額	15,046,686,315円
期末元本額	113,433,464,160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）	1,584,064,210円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,440,412円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	33,993,762,745円
世界経済インデックスファンド	12,270,671,042円
外国株式インデックス・オープン	884,878,908円
D C マイセレクション 2 5	652,498,758円
D C マイセレクション 5 0	3,527,060,202円
D C マイセレクション 7 5	4,359,696,321円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,555,394,496円
D C マイセレクション S 2 5	414,470,068円
D C マイセレクション S 5 0	1,892,905,223円
D C マイセレクション S 7 5	1,869,231,740円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	29,528,417円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	153,554,044円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	117,131,212円
D C 世界経済インデックスファンド	9,362,432,752円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	986,984,156円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,777,533円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	3,528,471円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	23,420,454円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,128,323円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	35,548,191円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	7,702,248円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	22,324,805円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	180,550,450円

区分	2023年 8月17日現在
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	137,664,089円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,045,814,273円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	69,652,340円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	17,797,112円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	122,396,098円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	39,965,836円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	829,639,486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)	901,515,701円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,125,077,954円
コア投資戦略ファンド(安定型)	113,740,322円
コア投資戦略ファンド(成長型)	283,481,970円
分散投資コア戦略ファンドA	1,536,388,239円
分散投資コア戦略ファンドS	7,718,437,187円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,436,951,103円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	999,185,155円
コア投資戦略ファンド(切替型)	133,649,708円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	513,182,694円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	24,281,684円
SMT インデックスバランス・オープン	128,328,988円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	81,452,152円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	4,291,568,581円
SMT 世界経済インデックス・オープン	242,734,447円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	984,098,873円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	168,823,715円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,237,060円
My SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	963,943,440円
グローバル経済コア	522,903,532円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	15,308,388円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,443,049円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	116,500,119円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	26,636,361円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	150,139,584円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	136,525,421円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	56,429,444円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	58,766,356円
10資産分散投資ファンド	53,273,628円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	53,435,077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)	23,714,510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)	449,467,636円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,429,915,791円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	103,799,064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)	68,475,569円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	84,714,210円

区分	2023年 8月17日現在
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	70,000,285円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	194,200,383円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	186,765,260円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	185,818,200円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	189,041,134円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	187,171,165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)	85,911,878円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	120,414,728円

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2023年 8月17日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	13,459,556,323	-	13,318,992,924	140,563,399
合計		13,459,556,323	-	13,318,992,924	140,563,399

## (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 8月17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	76,128,000	-	76,127,532	468
	アメリカドル	76,128,000	-	76,127,532	468
	売建	482,547,480	-	485,420,794	2,873,314
	アメリカドル	364,175,000	-	366,168,250	1,993,250
	イギリスポンド	118,372,480	-	119,252,544	880,064
合計		558,675,480	-	561,548,326	2,873,782

## (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 ESG リーダーズインデックスマザーファンド

### 貸借対照表

	2023年 8月17日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	346,328,376
コール・ローン	5,755,259
株式	11,015,208,094
投資信託受益証券	5,778,057
投資証券	230,722,422
派生商品評価勘定	1,669,108
未収入金	3,819
未収配当金	12,655,807
前払金	2,894,988
差入委託証拠金	110,215,507
流動資産合計	11,731,231,437
資産合計	11,731,231,437
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,543,367
未払解約金	90
未払利息	12
流動負債合計	4,543,469
負債合計	4,543,469
純資産の部	
元本等	
元本	8,611,501,940
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,115,186,028
元本等合計	11,726,687,968
純資産合計	11,726,687,968
負債純資産合計	11,731,231,437

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

	2023年 8月17日現在
	<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)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。</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>(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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>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>

	2023年 8月17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。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2023年 8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	8,611,501,940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 1.3617円 (1万口当たり純資産額) (13,617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 8月17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 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	8,916,232,437円
期中追加設定元本額	427,840,767円
期中一部解約元本額	732,571,264円
期末元本額	8,611,501,940円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	148,840,675円
コア投資戦略ファンド（成長型）	368,868,172円
コア投資戦略ファンド（切替型）	185,653,993円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	96,694,266円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	5,411,041,248円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	155,144,883円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	34,192,199円
DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド	2,143,222,713円
FOFs用 外国株式ESGリーダーズ・インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	67,843,791円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

(2023年 8月17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	451,612,433	-	448,717,445	2,894,988
合計		451,612,433	-	448,717,445	2,894,988

## (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 8月17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	3,787,420	-	3,808,149	20,729
	アメリカドル	3,787,420	-	3,808,149	20,729
合計		3,787,420	-	3,808,149	20,729

### (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 8月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,848,106,228
コール・ローン	301,780,541
株式	149,613,822,708
投資信託受益証券	456,357,392
投資証券	130,715,460
派生商品評価勘定	14,898
未収入金	7,172,244
未収配当金	519,761,357
前払金	296,892,016
差入委託証拠金	1,017,594,793
流動資産合計	157,192,217,637
資産合計	157,192,217,637
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	296,902,137
未払金	2,852,086
未払解約金	286,916,560
未払利息	668
流動負債合計	586,671,451
負債合計	586,671,451
純資産の部	

	2023年 8月17日現在
項目	金額（円）
元本等	
元本	40,572,499,666
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	116,033,046,520
元本等合計	156,605,546,186
純資産合計	156,605,546,186
負債純資産合計	157,192,217,637

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

	2023年 8月17日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。  (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	2023年 8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	40,572,499,666口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.8599円 (1万口当たり純資産額) (38,599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 8月17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

	2023年 8月17日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	36,009,544,669円
期中追加設定元本額	7,554,859,033円
期中一部解約元本額	2,991,904,036円
期末元本額	40,572,499,666円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,710,661,168円
世界経済インデックスファンド	9,402,762,544円
DC 新興国株式インデックス・オープン	5,975,688,720円
DC 世界経済インデックスファンド	7,138,347,484円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	102,654,695円
コア投資戦略ファンド（安定型）	50,323,436円
コア投資戦略ファンド（成長型）	125,428,063円
分散投資コア戦略ファンドA	309,401,097円
分散投資コア戦略ファンドS	1,517,431,406円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,106,472,731円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	770,061,961円

区分	2023年 8月17日現在
コア投資戦略ファンド（切替型）	59,134,295円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	395,598,044円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,480,820円
S M T インデックスバランス・オープン	96,978,156円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	35,711,445円
外国株式 S M T B セレクション（ S M A 専用）	1,880,561,712円
S M T 世界経済インデックス・オープン	229,840,914円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	950,481,892円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	161,733,311円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	6,360,644円
グローバル経済コア	407,092,752円
M y S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	184,443,703円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	51,001,497円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	11,615,652円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	96,225,804円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	87,094,125円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	35,868,670円
D C ターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	37,048,528円
10資産分散投資ファンド	13,164,952円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,390,057,619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）	100,931,802円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	80,111,147円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	10,376,386円
F O F s 用 新興国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	23,352,491円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2023年 8月17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	6,718,326,577	-	6,421,434,561	296,892,016
	合計	6,718,326,577	-	6,421,434,561	296,892,016

（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 8月17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	54,008,872	-	54,023,455	14,583
	アメリカドル	54,008,872	-	54,023,455	14,583
	売建	2,768,872	-	2,778,678	9,806
	ブラジルリアル	2,768,872	-	2,778,678	9,806
合計		56,777,744	-	56,802,133	4,777

## (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。

## J - R E I T インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 8月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,797,414,434
投資証券	136,551,402,600
派生商品評価勘定	8,359,200
未収入金	141,209,948
未収配当金	1,030,331,249
差入委託証拠金	219,816,000
流動資産合計	140,748,533,431
資産合計	140,748,533,431
負債の部	
流動負債	
前受金	8,359,200
未払金	354,908,135
未払解約金	3,810,810
未払利息	6,198
流動負債合計	367,084,343
負債合計	367,084,343
純資産の部	
元本等	
元本	66,367,477,144
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	74,013,971,944
元本等合計	140,381,449,088

	2023年 8月17日現在
項目	金額（円）
純資産合計	140,381,449,088
負債純資産合計	140,748,533,431

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月17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 8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	66,367,477,144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 2.1152円 (1万口当たり純資産額) (21,152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 8月17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 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	62,078,472,542円
期中追加設定元本額	6,648,080,899円
期中一部解約元本額	2,359,076,297円
期末元本額	66,367,477,144円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,926,636,815円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,232,029円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,906,055,447円



区分	2023年 8月17日現在
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	35,843,925,520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）	2,252,990,018円
分散投資コア戦略ファンドA	1,060,652,310円
分散投資コア戦略ファンドS	1,874,236,312円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,065,600,194円
SMT インデックスバランス・オープン	24,377,577円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	256,354,957円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,865,545円
グローバル経済コア	272,743,817円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,791,041円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	672,228,737円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	155,626,702円
My SMT J-REITインデックス（ノーロード）	427,522,272円
10資産分散投資ファンド	23,177,769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）	500,860,945円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	9,138,352円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	504,418,156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）	100,140,078円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用）	518,954,856円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-11（適格機関投資家専用）	250,784,140円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用）	285,981,277円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 投資証券関連

（2023年 8月17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	3,802,816,800	-	3,811,176,000	8,359,200
	合計	3,802,816,800	-	3,811,176,000	8,359,200

（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 8月17日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	584,992,116
コール・ローン	110,295,015
投資証券	91,912,577,079
派生商品評価勘定	151,487
未収入金	10,366,887
未収配当金	185,144,601
流動資産合計	92,803,527,185
資産合計	92,803,527,185
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,020
未払金	357,996,956
未払解約金	64,358,725
未払利息	244
流動負債合計	422,366,945
負債合計	422,366,945
純資産の部	
元本等	
元本	36,023,614,309
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	56,357,545,931
元本等合計	92,381,160,240
純資産合計	92,381,160,240
負債純資産合計	92,803,527,185

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>

2023年 8月17日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 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 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	36,023,614,309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 2.5645円 (1万口当たり純資産額) (25,645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 8月17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。

2023年 8月17日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	35,000,748,719円
期中追加設定元本額	3,002,873,984円
期中一部解約元本額	1,980,008,394円
期末元本額	36,023,614,309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	55,859,963円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	100,877,861円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,581,360,701円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,230,928円
S M T グローバルR E I Tインデックス・オープン	12,139,984,268円
グローバルリートインデックス・オープン（S M A専用）	14,059,882,962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	1,109,821,859円
分散投資コア戦略ファンドS	1,578,869,574円
コア投資戦略ファンド（切替型）	510,318,247円
S M T インデックスバランス・オープン	113,320,019円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	176,477,358円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	9,452,577円
グローバル経済コア	231,082,612円
S B I 資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	13,964,309円

区分	2023年 8月17日現在
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	351,309,947円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	80,610,538円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	141,195,359円
10資産分散投資ファンド	12,825,323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）	1,362,520,914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）	174,141,660円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	81,789,731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）	57,560,119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）	36,083,014円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	94,617,784円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	92,985,353円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	92,513,618円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	92,104,212円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	91,193,091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）	72,210,338円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	59,950,939円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 通貨関連

（2023年 8月17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	37,067,200	-	37,207,667	140,467
	アメリカドル	27,677,300	-	27,828,787	151,487
	オーストラリアドル	9,389,900	-	9,378,880	11,020
合計		37,067,200	-	37,207,667	140,467

(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 8月17日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	6,820,854
コール・ローン	186,233,631
投資信託受益証券	31,344,379,581
流動資産合計	31,537,434,066
資産合計	31,537,434,066
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	946,522,135
未払金	17,553,559
未払解約金	143,895,764
未払利息	412
流動負債合計	1,107,971,870
負債合計	1,107,971,870
純資産の部	
元本等	
元本	25,095,411,185
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,334,051,011
元本等合計	30,429,462,196
純資産合計	30,429,462,196
負債純資産合計	31,537,434,066

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月17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>

2023年 8月17日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2023年 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	25,095,411,185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 1.2126円 (1万口当たり純資産額) (12,126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 8月17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。

2023年 8月17日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	25,393,569,450円
期中追加設定元本額	1,401,015,105円
期中一部解約元本額	1,699,173,370円
期末元本額	25,095,411,185円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,323,181,016円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,730,430,735円
分散投資コア戦略ファンドA	2,114,521,968円
分散投資コア戦略ファンドS	7,439,587,857円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,758,421,008円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	524,744,204円
グローバル経済コア	1,333,882,876円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	3,425,097,786円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	969,067,164円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	220,618,257円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	588,577,101円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	564,017,610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）	103,263,603円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連



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	30,660,379,792	-	31,606,901,927	946,522,135
	アメリカドル	30,660,379,792	-	31,606,901,927	946,522,135
合計		30,660,379,792	-	31,606,901,927	946,522,135

## (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。

## ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 8月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	534,991,573
社債券	29,661,382,260
流動資産合計	30,196,373,833
資産合計	30,196,373,833
負債の部	
流動負債	
未払解約金	207,744
未払利息	1,185
流動負債合計	208,929
負債合計	208,929
純資産の部	
元本等	
元本	29,758,531,883
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	437,633,021
元本等合計	30,196,164,904
純資産合計	30,196,164,904
負債純資産合計	30,196,373,833

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 8月17日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	2023年 8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	29,758,531,883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 1.0147円 (1万口当たり純資産額) (10,147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 8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	40,079,354,802円
期中追加設定元本額	404,013,000円
期中一部解約元本額	10,724,835,919円
期末元本額	29,758,531,883円
期末元本額の内訳	
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	218,013,770円
ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（SMA専用）	407,733,027円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	16,277,188,084円
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド（適格機関投資家専用）	12,293,233,113円
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンドS（適格機関投資家専用）	562,363,889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。

## 米国株式LSマザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 8月17日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	609,565,561
社債券	22,361,105,508
流動資産合計	22,970,671,069
資産合計	22,970,671,069
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	792,422,400
未払解約金	157,014
未払利息	1,350
流動負債合計	792,580,764
負債合計	792,580,764
純資産の部	
元本等	
元本	20,491,775,268

	2023年 8月17日現在
項目	金額（円）
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,686,315,037
元本等合計	22,178,090,305
純資産合計	22,178,090,305
負債純資産合計	22,970,671,069

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	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。  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	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 8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	20,491,775,268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 1.0823円 (1万口当たり純資産額) (10,823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 8月17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 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	18,894,924,082円
期中追加設定元本額	2,055,998,056円
期中一部解約元本額	459,146,870円
期末元本額	20,491,775,268円

区分	2023年 8月17日現在
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,462,094,500円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,913,062,233円
コア投資戦略ファンド（切替型）	898,365,040円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	267,116,183円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	14,770,422,476円
米国株式LSファンド（SMA専用）	213,325,768円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	399,064,145円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	91,092,829円
F O F s 用 米国株式LSファンドS（適格機関投資家専用）	477,232,094円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 通貨関連

（2023年 8月17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	21,669,032,000	-	22,461,454,400	792,422,400
	アメリカドル	21,669,032,000	-	22,461,454,400	792,422,400
合計		21,669,032,000	-	22,461,454,400	792,422,400

(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。

#### コモディティLSアルファ・マザーファンド

##### 貸借対照表

	2023年 8月17日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	231,541,760
社債券	21,195,934,000
流動資産合計	21,427,475,760
資産合計	21,427,475,760
負債の部	

	2023年 8月17日現在
項目	金額（円）
流動負債	
未払利息	513
流動負債合計	513
負債合計	513
純資産の部	
元本等	
元本	17,427,332,612
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,000,142,635
元本等合計	21,427,475,247
純資産合計	21,427,475,247
負債純資産合計	21,427,475,760

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月17日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までには個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年 8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	17,427,332,612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 1.2295円 (1万口当たり純資産額) (12,295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 8月17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 8月17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 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	19,485,803,008円
期中追加設定元本額	799,284,189円
期中一部解約元本額	2,857,754,585円
期末元本額	17,427,332,612円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,193,173,131円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,545,396,700円
コア投資戦略ファンド（切替型）	732,422,024円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	222,383,629円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	12,683,096,668円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	324,710,324円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	74,724,450円
コモディティLSアルファ・ファンド（SMA専用）	173,542,419円
FOFs用 コモディティLSアルファ・ファンドS（適格機関投資家専用）	477,883,267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。



## GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）

## 貸借対照表

	2023年 8月17日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,411,528,777
国債証券	11,826,579,460
派生商品評価勘定	279,195,550
未収入金	13,273,871
差入委託証拠金	2,524,259,220
流動資産合計	22,054,836,878
資産合計	22,054,836,878
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	124,768,253
前受金	205,726,778
未払金	6,237,572
未払解約金	481,802
未払利息	16,423
流動負債合計	337,230,828
負債合計	337,230,828
純資産の部	
元本等	
元本	18,644,462,294
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,073,143,756
元本等合計	21,717,606,050
純資産合計	21,717,606,050
負債純資産合計	22,054,836,878

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 8月17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、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>

2023年 8月17日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)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 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	18,644,462,294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 1.1648円 (1万口当たり純資産額) (11,648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 8月17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 8月17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 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日
期首元本額	5,483,012,464円
期中追加設定元本額	13,168,512,087円
期中一部解約元本額	7,062,257円
期末元本額	18,644,462,294円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	475,146,861円
コア投資戦略ファンド（成長型）	617,507,446円
分散投資コア戦略ファンドA	2,211,520,094円
分散投資コア戦略ファンドS	6,265,064,272円
コア投資戦略ファンド（切替型）	288,321,085円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	117,442,367円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	8,290,539,600円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	128,875,338円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	30,544,110円
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）	219,058,326円

区分	2023年 8月17日現在
F O F s 用 G B C A フ ァ ン ド S ( ミ ド ル リ ス ク 型 ) ( 適 格 機 関 投 資 家 専 用 )	442,795円

(デリバティブ取引に関する注記)

## 債券関連

(2023年 8月17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	7,373,890,000	-	7,317,000,000	56,890,000
	売建	12,694,116,815	-	12,431,500,037	262,616,778
合計		20,068,006,815	-	19,748,500,037	205,726,778

(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はありません。

## 通貨関連

(2023年 8月17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	3,178,377,215	-	3,174,591,833	3,785,382
	アメリカドル	571,898,113	-	580,844,474	8,946,361
	カナダドル	580,395,113	-	585,029,658	4,634,545
	スウェーデンクローナ	741,197,858	-	735,579,265	5,618,593
	ノルウェークローネ	1,284,886,131	-	1,273,138,436	11,747,695
	売建	4,936,812,639	-	4,984,310,238	47,497,599
	ユーロ	255,272,457	-	256,128,081	855,624
	イギリスポンド	1,246,715,640	-	1,267,687,848	20,972,208
	スイスフラン	2,211,770,307	-	2,239,205,626	27,435,319
	オーストラリアドル	1,003,468,154	-	1,002,049,855	1,418,299
	ニュージーランドドル	219,586,081	-	219,238,828	347,253

合計	8,115,189,854	-	8,158,902,071	51,282,981
----	---------------	---	---------------	------------

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年 8月17日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	100,020,000
社債券	9,175,656,800
流動資産合計	9,275,676,800
資産合計	9,275,676,800
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	71,392,000
未払利息	221
流動負債合計	71,392,221
負債合計	71,392,221
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	10,303,725,374
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,099,440,795
元本等合計	9,204,284,579
純資産合計	9,204,284,579
負債純資産合計	9,275,676,800

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 8月17日現在
有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2023年 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		10,303,725,374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	1,099,440,795円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8933円 (8,933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 8月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年 8月17日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 2月18日

区分	2023年 8月17日現在
期首元本額	9,300,432,418円
期中追加設定元本額	1,268,400,319円
期中一部解約元本額	265,107,363円
期末元本額	10,303,725,374円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	591,407,510円
コア投資戦略ファンド(成長型)	796,654,086円
コア投資戦略ファンド(切替型)	375,790,307円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	154,896,295円
ヘッジファンドSMTBセクション(SMA専用)	7,052,956,549円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	168,959,340円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	37,939,998円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド(SMA専用)	146,737,936円
FOFs用 米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドS(適格機関投資家専用)	204,506,380円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド(適格機関投資家専用)	773,876,973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。

#### 4【委託会社等の概況】

##### （１）【資本金の額】

2023年 9月29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9月29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	530	14,341,707
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	67	215,927
単体型公社債投資信託	51	169,297
合計	648	14,726,931

##### （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11月17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。

なお、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、当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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。

## (1)【貸借対照表】

	（単位：百万円）	
	前事業年度 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023年3月31日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,675	23,067
金銭の信託	14,913	14,693
前払費用	166	198
未収委託者報酬	9,067	9,147
未収運用受託報酬	6,252	5,815
未収収益	179	176
短期差入証拠金	2,528	3,541
その他	2,363	1,566
流動資産合計	57,146	58,207
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 289	1 255
器具備品	1 687	1 560
有形固定資産合計	976	816
無形固定資産		
ソフトウェア	6,292	7,203
その他	31	40
無形固定資産合計	6,324	7,244
投資その他の資産		
投資有価証券	6,607	4,063
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	907	1,181
その他	31	31
投資その他の資産合計	13,182	10,911
固定資産合計	20,482	18,972
資産合計	77,629	77,179

（単位：百万円）

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	47	49
未払金	8,285	7,174
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,561	4,586
その他未払金	3,723	2,588
未払費用	1,049	1,089
未払法人税等	504	726
賞与引当金	578	613
その他	1,958	303
流動負債合計	12,423	9,958
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	820	904
資産除去債務	153	153
その他	12	27
固定負債合計	986	1,086
負債合計	13,410	11,044
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
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	41,948	44,755
利益剰余金合計	44,548	47,355
株主資本合計	63,788	66,595
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	941	49
繰延ヘッジ損益	509	510
評価・換算差額等合計	431	460
純資産合計	64,219	66,134
負債・純資産合計	77,629	77,179

## （２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	前事業年度 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	当事業年度 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	41,730	40,724
運用受託報酬	11,883	10,918
その他営業収益	390	351
営業収益合計	54,004	51,993
営業費用		
支払手数料	20,567	20,123
広告宣伝費	286	307
公告費	-	2
調査費	5,567	5,309
調査費	1,062	1,104
委託調査費	4,487	4,191
図書費	17	13
営業雑経費	5,201	5,842
通信費	68	77
印刷費	454	419
協会費	55	58
諸会費	35	38
情報機器関連費	4,473	5,153
その他営業雑経費	112	94
営業費用合計	31,622	31,585
一般管理費		
給料	6,295	6,451
役員報酬	249	318
給料・手当	5,072	5,144
賞与	972	987
退職給付費用	254	252
福利費	632	671
交際費	3	7
旅費交通費	20	122
租税公課	327	289
不動産賃借料	323	327
寄付金	5	-
減価償却費	989	1,698
業務委託費	1,081	1,277
諸経費	1,301	1,454
一般管理費合計	11,234	12,553
営業利益	11,147	7,854

（単位：百万円）

	前事業年度 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	当事業年度 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
営業外収益		
受取利息	2	57
収益分配金	16	4
投資有価証券売却益	0	738
投資有価証券償還益	219	121
デリバティブ利益	-	565
その他	8	11
営業外収益合計	247	1,499
営業外費用		
金銭の信託運用損	332	158
投資有価証券売却損	0	16
為替差損	291	1,227
デリバティブ費用	1,191	-
その他	33	32
営業外費用合計	1,848	1,435
経常利益	9,545	7,918
特別損失		
退職給付費用	120	-
特別損失合計	120	-
税引前当期純利益	9,425	7,918
法人税、住民税及び事業税	3,403	2,350
法人税等調整額	465	119
法人税等合計	2,937	2,470
当期純利益	6,487	5,448

## （3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	791	65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	2,807	2,807	2,807

当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595
-------	-----	-------	--------	--------	--------

	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
当期変動額				
剰余金の配当				2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	891	0	891	891
当期変動額合計	891	0	891	1,915
当期末残高	49	510	460	66,134

## 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. 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)

#### 「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。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過の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。これによる財務諸表への影響はありません。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

### (表示方法の変更)

#### (貸借対照表関係)

前事業年度において、「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、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた4,891百万円は、「短期差入証拠金」2,528百万円、「その他」2,363百万円として組み替えております。

#### (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 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
建 物	146	百万円	184	百万円
器具備品	535	"	681	"
計	681	"	866	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31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	当事業年度末
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
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

## (2) 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
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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31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	当事業年度末
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

2023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
2023年6月22日 定時株主総会	普通株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26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（支払期日に支払い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。

## (4) 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。

## 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 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（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
資産計	-	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。

当事業年度（2023年3月31日）

区 分	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)	1,029	12,703	-	13,733
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
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	(10)	(48)	-	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(88)	-	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	-	(147)

(\*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（貸借対照表計上額は960百万円）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貸借対照表計上額は14,693百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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（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

当事業年度（2023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	23,067	-	-	-
未収委託者報酬	9,147	-	-	-
未収運用受託報酬	5,815	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	594	2,144	38

（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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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（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

当事業年度（2023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	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	292
小計	2,857	3,150	292
合計	3,844	3,772	71

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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
----	-----------------------	-----------------------

非上場株式	0	0
組合出資金等	133	218

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	3,429	738	16

## （デリバティブ取引関係）

## 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

前事業年度（2022年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,498	-	54	54
	英ポンド	277	-	1	1
	カナダドル	111	-	1	1
	スイスフラン	139	-	2	2
	香港ドル	190	-	1	1
	ユーロ	676	-	18	18
	買建 ユーロ	21	-	0	0
	合計	6,915	-	80	80

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

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	5,923	-	21	21
	英ポンド	256	-	6	6
	カナダドル	109	-	1	1
	スイスフラン	163	-	2	2
	香港ドル	202	-	0	0
	ユーロ	651	-	19	19
	買建 米ドル	152	-	3	3
	合計	7,458	-	48	48

（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

前事業年度（2022年3月31日）

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。

当事業年度（2023年3月31日）

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	12,195	-	9	9
	債券先物取引 売建	182	-	0	0
合計		12,378	-	10	10

(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

前事業年度（2022年3月31日）

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

当事業年度（2023年3月31日）

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		1,729	-	6
	英ポンド		3,228	-	81
	スイスフラン		20	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ	21	-	0	
合計			5,082	-	88

(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。

## 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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	626	820
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	-	6
退職給付の支払額	81	57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
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	820	911

## (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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	820	911
未認識数理計算上の差異	-	6
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904
退職給付引当金	820	904
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904

## (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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
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	274	142

## (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		当事業年度	
	(自 至	2021年4月1日 2022年3月31日)	(自 至	2022年4月1日 2023年3月31日)
割引率		0.4%		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100百万円、当事業年度109百万円であります。

## （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 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	112	百万円	58	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177	"	187	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	251	"	277	"
税務上の収益認識差額	74	"	-	"
税務上の費用認識差額	439	"	412	"
繰延ヘッジ損益	224	"	225	"
その他	76	"	75	"
繰延税金資産 合計	1,357	"	1,236	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	415	"	21	"
その他	34	"	32	"
繰延税金負債 合計	450	"	54	"
繰延税金資産の純額	907	"	1,181	"

## 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。

## 3．法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「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12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

## （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 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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	9,887百万円

## [ 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 ]

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 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	三井住	東京都		信託業務及び		営業上の取引	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421

の子会社	友信託銀行(株)	千代田区	342,037	銀行業務	-	役員の兼任	投信販売 代行手数料等	9,701	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。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

(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(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)

当事業年度(2023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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	21,406,512円22銭	22,044,962円63銭
1株当たり当期純利益金額	2,162,405円20銭	1,816,227円49銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

**独立監査人の監査報告書**

2023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2023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. XBR 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

2023年10月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているサテライト投資戦略ファンド（株式型）の2023年2月18日から2023年8月17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、サテライト投資戦略ファンド（株式型）の2023年8月17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（2023年2月18日から2023年8月17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。