

**【表紙】**

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年2月22日提出
【計算期間】	第2期中(自 2023年5月25日至 2023年11月24日)
【ファンド名】	10資産分散投資ファンド
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	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12月29日現在の状況について記載してあります。

## 【10資産分散投資ファンド】

## (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	1,778,051,935	98.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		19,521,900	1.09
合計(純資産総額)		1,797,573,835	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 (2023年 5月24日)	1,640,336,672	1,640,336,672	10,203	10,203
2022年12月末日	485,085		9,702	
2023年 1月末日	681,370,276		9,891	
2月末日	1,563,297,959		9,918	
3月末日	1,599,534,482		10,012	
4月末日	1,625,661,662		10,100	
5月末日	1,654,914,164		10,228	
6月末日	1,712,919,483		10,522	
7月末日	1,722,344,673		10,518	
8月末日	1,743,070,091		10,531	
9月末日	1,727,579,970		10,353	
10月末日	1,699,490,946		10,174	
11月末日	1,766,715,535		10,583	
12月末日	1,797,573,835		10,710	

## 【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	2022年 6月30日～2023年 5月24日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率(%)
第1期計算期間	2022年 6月30日～2023年 5月24日	2.0
第2期中間計算期間	2023年 5月25日～2023年11月24日	3.8

(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	586,637,466,610	98.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,241,509,381	1.22
合計(純資産総額)		593,878,975,991	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	7,168,980,000	1.21

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

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

## 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	436,821,245,267	68.92
	イギリス	24,618,803,131	3.88
	カナダ	21,498,781,749	3.39
	スイス	19,790,379,855	3.12
	フランス	19,459,694,281	3.07
	ドイツ	15,130,555,628	2.39
	オーストラリア	12,419,341,448	1.96
	オランダ	11,967,127,087	1.89
	アイルランド	11,327,699,665	1.79
	デンマーク	5,948,861,645	0.94
	スウェーデン	5,745,002,531	0.91
	スペイン	4,599,683,457	0.73
	イタリア	3,492,708,022	0.55
	香港	2,923,160,701	0.46
	シンガポール	1,990,878,487	0.31
	フィンランド	1,897,947,389	0.30
	ジャージー	1,668,614,638	0.26
	ベルギー	1,356,764,905	0.21
	イスラエル	1,251,430,089	0.20
ノルウェー	1,170,291,225	0.18	

	ケイマン	822,555,086	0.13
	キュラソー	817,138,352	0.13
	バミューダ	800,661,258	0.13
	ニュージーランド	515,461,679	0.08
	リベリア	381,134,046	0.06
	ルクセンブルク	370,673,947	0.06
	オーストリア	340,212,200	0.05
	ポルトガル	336,147,214	0.05
	パナマ	190,150,446	0.03
	マン島	89,348,667	0.01
	小計	609,742,454,095	96.20
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	68,791,609	0.01
	香港	52,713,045	0.01
	小計	121,504,654	0.02
投資証券	アメリカ	10,967,896,802	1.73
	オーストラリア	793,123,448	0.13
	フランス	271,340,844	0.04
	シンガポール	254,235,875	0.04
	イギリス	199,518,358	0.03
	香港	132,831,954	0.02
	ベルギー	58,274,249	0.01
	カナダ	56,326,500	0.01
	小計	12,733,548,030	2.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,202,036,242	1.77
合計(純資産総額)		633,799,543,021	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	7,950,153,003	1.25
	買建	カナダ	326,532,931	0.05
	買建	ドイツ	1,461,803,793	0.23
	買建	イギリス	629,755,623	0.10
	買建	オーストラリア	460,889,112	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		283,731,555	0.04

売建	82,169,702	0.01
----	------------	------

(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	インド	27,373,751,943	16.30
	台湾	25,312,046,881	15.08
	ケイマン	24,776,930,336	14.76
	韓国	21,142,409,403	12.59
	中国	16,385,534,532	9.76
	ブラジル	9,000,147,496	5.36
	サウジアラビア	6,724,167,134	4.01
	南アフリカ	4,577,727,992	2.73
	メキシコ	4,165,689,427	2.48
	インドネシア	3,067,411,281	1.83
	タイ	2,917,439,982	1.74
	マレーシア	2,160,458,425	1.29
	アラブ首長国連邦	2,013,040,022	1.20
	香港	1,490,809,284	0.89
	ポーランド	1,465,093,995	0.87
	カタール	1,448,993,951	0.86
	クウェート	1,193,728,245	0.71
	トルコ	1,009,437,156	0.60
	フィリピン	981,616,209	0.58
	チリ	818,656,347	0.49
	ギリシャ	769,781,700	0.46
	バミューダ	658,873,422	0.39
	アメリカ	593,551,562	0.35
	ハンガリー	416,412,040	0.25
	チェコ	249,361,169	0.15
	ルクセンブルク	226,829,759	0.14
	イギリス	182,542,842	0.11
	エジプト	166,403,778	0.10
	コロンビア	157,920,139	0.09
	ペルー	36,449,941	0.02
	シンガポール	25,270,245	0.02
	オランダ	21,343,337	0.01
ロシア	122	0.00	
キプロス	-	-	

	英ヴァージン諸島	-	-
	小計	161,529,830,097	96.21
投資信託受益証券	ブラジル	386,672,252	0.23
	メキシコ	130,787,763	0.08
	小計	517,460,015	0.31
投資証券	メキシコ	182,927,853	0.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,662,722,373	3.37
合計(純資産総額)		167,892,940,338	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	5,653,658,662	3.37

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

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

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		857,491,239	0.51
	売建		18,671,160	0.01

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

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

#### 国内債券インデックス マザーファンド

##### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	549,387,054,480	84.55
地方債証券	日本	32,859,840,918	5.06
特殊債券	日本	36,607,573,370	5.63
	国際機関	299,901,000	0.05
	小計	36,907,474,370	5.68
社債券	日本	27,984,534,000	4.31
	フランス	1,395,463,000	0.21
	韓国	99,613,000	0.02
	小計	29,479,610,000	4.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,123,042,875	0.17
合計(純資産総額)		649,757,022,643	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 外国債券インデックス マザーファンド

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	138,828,155,278	45.99
	フランス	25,137,414,172	8.33
	イタリア	22,555,698,209	7.47
	中国	22,192,630,962	7.35
	ドイツ	19,616,876,170	6.50
	イギリス	15,617,157,420	5.17
	スペイン	14,722,033,558	4.88
	カナダ	5,945,031,157	1.97
	ベルギー	5,358,708,128	1.78
	オランダ	4,549,218,529	1.51
	オーストラリア	4,245,766,262	1.41
	オーストリア	3,582,221,297	1.19
	メキシコ	2,700,465,553	0.89
	アイルランド	1,759,172,154	0.58
	フィンランド	1,583,609,641	0.52
	ポーランド	1,522,256,383	0.50
	マレーシア	1,491,873,985	0.49
	シンガポール	1,266,874,133	0.42
	イスラエル	888,889,820	0.29
	デンマーク	844,917,398	0.28
ニュージーランド	730,448,334	0.24	
スウェーデン	637,896,631	0.21	
ノルウェー	539,822,201	0.18	
	小計	296,317,137,375	98.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,551,829,720	1.84
合計(純資産総額)		301,868,967,095	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	1,057,010,248	0.35
	買建	ドイツ	1,031,283,830	0.34

(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		2,273,903,860	0.75

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

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

#### 外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

#### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	32,241,769,738	44.82
	フランス	5,836,797,722	8.11
	イタリア	5,237,116,338	7.28
	中国	5,148,113,565	7.16
	ドイツ	4,531,597,249	6.30
	イギリス	3,623,748,305	5.04
	スペイン	3,421,262,358	4.76
	カナダ	1,383,753,077	1.92
	ベルギー	1,247,048,907	1.73
	オランダ	1,055,718,709	1.47
	オーストラリア	990,195,380	1.38
	オーストリア	829,961,432	1.15
	メキシコ	639,137,208	0.89
	アイルランド	406,145,203	0.56
	フィンランド	364,947,378	0.51
	ポーランド	359,124,539	0.50
	マレーシア	340,927,616	0.47
	シンガポール	298,427,742	0.41
	イスラエル	206,339,343	0.29
	デンマーク	192,614,545	0.27
ニュージーランド	167,460,761	0.23	
スウェーデン	145,124,879	0.20	
ノルウェー	121,764,787	0.17	
	小計	68,789,096,781	95.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,141,343,843	4.37
合計(純資産総額)		71,930,440,624	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。

#### 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	113,760,957	0.16
	買建	ドイツ	171,848,428	0.24

(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		67,096,911,274	93.28

(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	メキシコ	12,314,242,573	9.86
	ブラジル	12,311,429,684	9.86
	マレーシア	12,281,160,017	9.83
	中国	12,168,745,552	9.74
	インドネシア	12,155,671,554	9.73
	タイ	12,108,981,843	9.70
	南アフリカ	10,189,855,066	8.16
	ポーランド	9,412,123,549	7.54
	チェコ	7,724,692,812	6.18
	コロンビア	5,728,441,977	4.59
	ルーマニア	4,701,887,380	3.76
	ハンガリー	3,928,186,892	3.15
	ペルー	2,847,797,489	2.28
	チリ	2,363,960,245	1.89
	ウルグアイ	235,702,281	0.19
	ドミニカ共和国	200,185,445	0.16
	フィリピン	72,357,347	0.06
	小計	120,745,421,706	96.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,151,045,923	3.32
合計(純資産総額)		124,896,467,629	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。

## 世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

### 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	976,145,109	51.45

	イギリス	403,919,389	21.29
	フランス	168,157,594	8.86
	イタリア	100,990,582	5.32
	ドイツ	52,955,981	2.79
	スペイン	44,385,704	2.34
	カナダ	31,689,436	1.67
	オーストラリア	20,796,567	1.10
	スウェーデン	13,781,257	0.73
	ニュージーランド	10,433,039	0.55
	デンマーク	3,044,259	0.16
	小計	1,826,298,917	96.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		71,022,257	3.74
合計(純資産総額)		1,897,321,174	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		1,761,408,029	92.84

(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。

#### 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	113,947,288,900	96.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,880,684,862	3.29
合計(純資産総額)		117,827,973,762	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	3,835,260,000	3.25

(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	89,580,950,096	77.14
	オーストラリア	7,855,754,177	6.76
	イギリス	5,585,558,664	4.81
	シンガポール	4,044,496,482	3.48
	フランス	2,117,085,357	1.82
	カナダ	1,734,071,768	1.49
	ベルギー	1,354,575,124	1.17
	香港	1,305,391,650	1.12
	スペイン	508,867,736	0.44
	ガンジー	337,745,375	0.29
	ニュージーランド	333,095,718	0.29
	オランダ	206,035,202	0.18
	韓国	205,939,949	0.18
	イスラエル	129,516,722	0.11
	ドイツ	39,705,795	0.03
	アイルランド	36,492,691	0.03
	イタリア	12,237,441	0.01
	小計	115,387,519,947	99.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		746,927,207	0.64
合計(純資産総額)		116,134,447,154	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		255,791,308	0.22

(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】

## 【10資産分散投資ファンド】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2022年 6月30日～2023年 5月24日	1,628,450,903	20,709,270	1,607,741,633
第2期中間計算期間	2023年 5月25日～2023年11月24日	98,251,916	44,186,117	1,661,807,432

(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2期中間計算期間(2023年5月25日から2023年11月24日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【10 資産分散投資ファンド】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2023年 5月24日現在)	第2期中間計算期間 (2023年11月24日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	16,085,368	16,936,083
親投資信託受益証券	1,623,873,177	1,740,292,174
未収入金	2,814,060	4,377,723
流動資産合計	1,642,772,605	1,761,605,980
資産合計	1,642,772,605	1,761,605,980
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,574,662	99,567
未払受託者報酬	156,598	283,646
未払委託者報酬	678,591	1,229,095
未払利息	27	9
その他未払費用	26,055	47,211
流動負債合計	2,435,933	1,659,528
負債合計	2,435,933	1,659,528
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,607,741,633	1,661,807,432
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	32,595,039	98,139,020
(分配準備積立金)	45,271,760	44,071,385
元本等合計	1,640,336,672	1,759,946,452
純資産合計	1,640,336,672	1,759,946,452
負債純資産合計	1,642,772,605	1,761,605,980

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2022年 6月30日 至 2022年12月29日	第2期中間計算期間 自 2023年 5月25日 至 2023年11月24日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	43
有価証券売買等損益	14,736	64,812,930
営業収益合計	14,736	64,812,973
<b>営業費用</b>		
支払利息	-	4,946
受託者報酬	33	283,646
委託者報酬	357	1,229,095
その他費用	-	47,211
営業費用合計	390	1,564,898
営業利益又は営業損失（ ）	15,126	63,248,075
経常利益又は経常損失（ ）	15,126	63,248,075
中間純利益又は中間純損失（ ）	15,126	63,248,075
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（ ）	-	676,747
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	32,595,039
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	3,900,679
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	3,900,679
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	928,026
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	928,026
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	15,126	98,139,020

## （３）【中間注記表】

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

## （中間貸借対照表に関する注記）

	第1期 (2023年 5月24日現在)	第2期中間計算期間 (2023年11月24日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,607,741,633口	1,661,807,432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) 1.0203円 (10,203円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0591円 (10,591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2期中間計算期間 (2023年11月24日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第1期 自 2022年 6月30日 至 2023年 5月24日	第2期中間計算期間 自 2023年 5月25日 至 2023年11月24日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	500,000円	1,607,741,633円
期中追加設定元本額	1,627,950,903円	98,251,916円
期中一部解約元本額	20,709,270円	44,186,117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11月24日現在	
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,434,534,823
株式	589,347,290,620
派生商品評価勘定	330,067,700
未収配当金	4,903,510,750
差入委託証拠金	378,195,336
流動資産合計	597,393,599,229
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	697,650
前受金	329,471,800
未払解約金	313,083,261
未払利息	1,382
流動負債合計	643,254,093
負債合計	
643,254,093	
純資産の部	
元本等	
元本	243,316,520,616
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	353,433,824,520
元本等合計	596,750,345,136
純資産合計	
596,750,345,136	
負債純資産合計	
597,393,599,229	

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2023年11月24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。  (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11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	243,316,520,616口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.4526円 (1万口当たり純資産額) (24,526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11月24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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	255,830,605,457円
期中追加設定元本額	12,649,554,643円
期中一部解約元本額	25,163,639,484円
期末元本額	243,316,520,616円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	311,505,178円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,450,864,305円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,123,646円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,067,252,003円
世界経済インデックスファンド	5,151,349,937円
日本株式インデックス・オープン	2,981,502,253円
DCマイセレクション25	5,376,566,480円
DCマイセレクション50	17,333,262,980円
DCマイセレクション75	18,583,973,627円
DC日本株式インデックス・オープン	6,014,857,689円
DCマイセレクションS25	3,178,764,225円
DCマイセレクションS50	9,555,863,544円
DCマイセレクションS75	8,201,309,554円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,151,189,092円
DCターゲット・イヤーフンド2025	91,694,118円
DCターゲット・イヤーフンド2035	618,748,422円
DCターゲット・イヤーフンド2045	484,820,539円
DC世界経済インデックスファンド	3,771,124,503円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	878,661,812円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,789,509円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,000,727円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	13,704,323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）	146,069,642円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,043,492円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	17,358,838円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	70,516,841円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	16,387,263円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	46,566,578円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	513,347,471円

区分	2023年11月24日現在
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	322,196,016円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,163,870,685円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	29,983,810円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	12,709,949円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	336,182,278円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	183,827,439円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	250,352,850円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	20,204,568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)	420,074,222円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,536,242,081円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,922,550,335円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,155,853,727円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,631,424,283円
分散投資コア戦略ファンドA	1,940,288,367円
分散投資コア戦略ファンドS	6,367,530,443円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	592,168,361円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	406,093,881円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,225,158,969円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	200,500,568円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,794,984円
SMTインデックスバランス・オープン	49,343,969円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	19,637,402,945円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	267,816,957円
SMT世界経済インデックス・オープン	52,045,044円
SMT世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	214,789,523円
SMT世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	37,126,352円
SMT8資産インデックスバランス・オープン	12,022,309円
グローバル経済コア	217,198,118円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	33,761,547円
MySMTTOPIXインデックス(ノーロード)	1,229,895,155円
DCターゲット・イヤーファンド2055	30,773,899円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	964,175,269円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	242,306,554円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	52,560,580円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	50,023,647円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	21,582,300円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	24,406,225円
10資産分散投資ファンド	92,843,016円
グローバル10資産バランスファンド	3,010,223円
DC世界経済インデックスファンド(株式特化型)	20,340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)	42,070,000,028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)	496,300,393円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	301,279,696円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	21,067,410円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	437,099,410円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P(適格機関投資家専用)	46,747,872,243円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	17,819,934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)	210,751,123円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年11月24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	6,406,098,200	-	6,735,570,000	329,471,800
合計		6,406,098,200	-	6,735,570,000	329,471,800

(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

	2023年11月24日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
<b>流動資産</b>	
預金	10,250,972,398
コール・ローン	300,808,523
株式	606,164,303,962
投資信託受益証券	158,865,302
投資証券	11,828,604,304
派生商品評価勘定	736,123,255
未収入金	5,056,883
未収配当金	873,703,450
差入委託証拠金	4,774,956,587
流動資産合計	635,093,394,664
<b>資産合計</b>	635,093,394,664
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	15,563,836
前受金	720,556,710
未払解約金	315,112,475
未払利息	170
流動負債合計	1,051,233,191
<b>負債合計</b>	1,051,233,191
<b>純資産の部</b>	
<b>元本等</b>	
元本	116,305,239,011
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	517,736,922,462
元本等合計	634,042,161,473
<b>純資産合計</b>	634,042,161,473
<b>負債純資産合計</b>	635,093,394,664

### 注記表

#### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年11月24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) 新株予約権証券 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(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、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) 投資信託受益証券</p>

2023年11月24日現在	
	<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>(4)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取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取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。</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11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	116,305,239,011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 5.4515円 (1万口当たり純資産額) (54,515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11月24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</p>

2023年11月24日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額は、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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	121,801,757,578円
期中追加設定元本額	7,419,418,381円
期中一部解約元本額	12,915,936,948円
期末元本額	116,305,239,011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）	1,578,677,951円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,026,183円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,701,506,453円
世界経済インデックスファンド	12,991,865,387円
外国株式インデックス・オープン	881,632,544円
D C マイセレクション 2 5	640,645,909円
D C マイセレクション 5 0	3,483,640,950円
D C マイセレクション 7 5	4,332,011,459円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,698,959,283円
D C マイセレクション S 2 5	410,902,517円
D C マイセレクション S 5 0	1,904,300,874円
D C マイセレクション S 7 5	1,913,025,427円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	20,760,338円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	140,091,960円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	109,773,486円
D C 世界経済インデックスファンド	9,506,709,434円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,008,840,248円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,773,301円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	3,142,957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）	21,893,215円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	7,895,440円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	33,182,785円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	7,602,496円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	21,595,270円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	160,245,813円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	131,534,924円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	997,759,753円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	68,523,807円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	17,431,747円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	114,632,304円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	37,007,623円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	787,426,934円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	850,581,797円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,180,407,120円
コア投資戦略ファンド（安定型）	135,892,093円
コア投資戦略ファンド（成長型）	319,464,712円
分散投資コア戦略ファンド A	1,605,660,699円
分散投資コア戦略ファンド S	7,339,764,093円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,478,490,783円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,012,186,821円

区分	2023年11月24日現在
コア投資戦略ファンド(切替型)	143,320,748円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	493,916,444円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	24,692,465円
SMT インデックスバランス・オープン	122,984,586円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	76,157,099円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	5,089,073,963円
SMT 世界経済インデックス・オープン	254,484,967円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	1,033,644,600円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	179,668,647円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,479,176円
My SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	1,256,359,451円
グローバル経済コア	535,481,795円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	15,441,274円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,987,438円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	128,458,335円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	31,671,774円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	142,822,008円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	135,156,099円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	59,016,451円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	66,409,951円
10資産分散投資ファンド	51,438,971円
グローバル10資産バランスファンド	1,372,162円
DC世界経済インデックスファンド(株式特化型)	50,271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)	57,881,541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)	200,349,746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)	618,572,828円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,456,012,944円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	99,880,394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)	69,905,701円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	86,849,283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)	81,444,025円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	186,731,857円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	180,617,821円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	179,700,011円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	181,779,484円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	179,977,573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)	91,791,755円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	116,188,483円

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2023年11月24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	15,193,361,816	-	15,913,918,526	720,556,710
合計		15,193,361,816	-	15,913,918,526	720,556,710

(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11月24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	64,297,900	-	64,300,609	2,709
	アメリカドル	64,297,900	-	64,300,609	2,709
合計		64,297,900	-	64,300,609	2,709

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 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11月24日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	7,749,307,191
コール・ローン	78,158,622
株式	158,990,869,979
投資信託受益証券	505,311,771
投資証券	137,621,332
派生商品評価勘定	171,868,066
未収配当金	247,774,094
差入委託証拠金	1,314,546,035
流動資産合計	169,195,457,090
資産合計	169,195,457,090
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,952,415
前受金	161,242,784
未払解約金	105,491,317
未払利息	44
流動負債合計	277,686,560
負債合計	277,686,560
純資産の部	
元本等	
元本	42,022,994,717
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	126,894,775,813
元本等合計	168,917,770,530
純資産合計	168,917,770,530
負債純資産合計	169,195,457,090

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2023年11月24日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式



2023年11月24日現在	
	<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 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。 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11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	42,022,994,717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) 4,0197円 (40,197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11月24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>

2023年11月24日現在	
	(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。
	(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2023年11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	41,605,821,743円
期中追加設定元本額	3,608,740,701円
期中一部解約元本額	3,191,567,727円
期末元本額	42,022,994,717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	7,733,027,059円
世界経済インデックスファンド	10,018,517,661円
D C 新興国株式インデックス・オープン	6,046,477,723円
D C 世界経済インデックスファンド	7,260,981,224円
新興国株式インデックス・オープン (S M A 専用)	93,633,169円
コア投資戦略ファンド (安定型)	60,817,634円
コア投資戦略ファンド (成長型)	142,991,154円
分散投資コア戦略ファンド A	310,316,270円
分散投資コア戦略ファンド S	1,419,462,050円
D C 世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	1,152,336,766円
D C 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	781,072,014円
コア投資戦略ファンド (切替型)	64,979,797円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	383,128,682円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	18,835,996円
S M T インデックスバランス・オープン	94,316,871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)	2,297,972,872円
S M T 世界経済インデックス・オープン	242,331,147円
S M T 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	1,016,699,525円
S M T 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	173,290,693円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	6,685,296円
グローバル経済コア	417,842,742円
M y S M T 新興国株式インデックス (ノーロード)	234,434,766円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	57,500,179円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	14,175,859円
D C ターゲット・イヤーファンド (6 資産・運用継続型) 2 0 3 0	95,941,720円
D C ターゲット・イヤーファンド (6 資産・運用継続型) 2 0 4 0	90,788,730円
D C ターゲット・イヤーファンド (6 資産・運用継続型) 2 0 5 0	39,641,779円
D C ターゲット・イヤーファンド (6 資産・運用継続型) 2 0 6 0	44,586,310円
1 0 資産分散投資ファンド	13,146,689円
グローバル 1 0 資産バランスファンド	1,847,772円
D C 世界経済インデックスファンド (株式特化型)	43,544円
世界株式ファンド (適格機関投資家専用)	1,441,350,750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)	96,736,628円
私募世界経済パッシブファンド (適格機関投資家専用)	82,357,674円

区分	2023年11月24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）	12,215,701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）	26,798,826円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2023年11月24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	9,141,014,908	-	9,302,257,692	161,242,784
合計		9,141,014,908	-	9,302,257,692	161,242,784

## （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11月24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	125,605,200	-	125,610,492	5,292
	アメリカドル	125,605,200	-	125,610,492	5,292
	売建	37,057,500	-	37,389,925	332,425
	アメリカドル	37,057,500	-	37,389,925	332,425
合計		162,662,700	-	163,000,417	327,133

## （注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年11月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	364,215,195
国債証券	539,083,769,660
地方債証券	32,883,276,705
特殊債券	38,144,133,288
社債券	29,669,103,000
未収入金	1,097,527,200

	2023年11月24日現在
項目	金額（円）
未収利息	1,278,240,920
前払費用	37,907,839
流動資産合計	642,558,173,807
資産合計	642,558,173,807
負債の部	
流動負債	
未払金	1,105,186,800
未払解約金	122,140,096
未払利息	206
流動負債合計	1,227,327,102
負債合計	1,227,327,102
純資産の部	
元本等	
元本	482,305,909,625
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	159,024,937,080
元本等合計	641,330,846,705
純資産合計	641,330,846,705
負債純資産合計	642,558,173,807

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年11月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	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によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	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11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	482,305,909,625口
2. 担保資産	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。 有価証券 99,296,000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 1.3297円 (1万口当たり純資産額) (13,297円)

（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11月24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

	2023年11月24日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2023年11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	463,653,275,174円
期中追加設定元本額	33,326,290,425円
期中一部解約元本額	14,673,655,974円
期末元本額	482,305,909,625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）	5,351,193,961円
S B I 資産設計オープン（分配型）	17,630,573円
S M T 国内債券インデックス・オープン	17,952,794,742円
世界経済インデックスファンド	6,252,489,724円
D Cマイセレクション25	28,382,979,455円
D Cマイセレクション50	34,236,887,100円
D Cマイセレクション75	10,820,069,188円
D C日本債券インデックス・オープン	408,872,535円
D C日本債券インデックス・オープンS	89,523,272,346円
D C日本債券インデックス・オープンP	63,506,344,971円
D CマイセレクションS25	16,305,477,389円
D CマイセレクションS50	18,999,361,372円
D CマイセレクションS75	4,809,276,150円
D Cターゲット・イヤーフンド2025	476,944,987円
D Cターゲット・イヤーフンド2035	2,781,117,183円
D Cターゲット・イヤーフンド2045	1,103,792,551円
D C世界経済インデックスファンド	4,517,657,973円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	1,674,031円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	17,621,963円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	8,474,766円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,103,784円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	63,528,811円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	103,013,462円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	27,399,059円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	22,711,694円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,159,730,423円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	724,426,844円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,088,546,608円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	62,697,056円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	48,723,356円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	905,639,987円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	999,625,124円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,332,083,051円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	96,453,068円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,778,919,746円
日本債券ファンド・シリーズ1	18,673,641,091円
分散投資コア戦略ファンドA	18,370,222,201円
分散投資コア戦略ファンドS	25,852,152,181円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	286,173,858円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,800,671,395円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	94,894,360円

区分	2023年11月24日現在
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	43,482,810円
SMT インデックスバランス・オープン	71,230,779円
SMT 世界経済インデックス・オープン	47,169,945円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	104,232,443円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	166,766,986円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	16,338,251円
グローバル経済コア	238,623,503円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	43,016,380円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	34,436,205円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	130,716,381円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	72,680,339円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	21,542,365円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	14,409,937円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	669,262,833円
10資産分散投資ファンド	315,006,091円
グローバル10資産バランスファンド	37,301,202円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	93,794,911,192円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	38,460,829円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,025,662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）	461,778,133円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年11月24日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	848,730,876
コール・ローン	1,959,821,313
国債証券	296,980,143,264
派生商品評価勘定	9,964,601
未収入金	4,819,427
未収利息	1,961,763,396
前払費用	155,988,184
差入委託証拠金	210,747,528
流動資産合計	302,131,978,589
資産合計	302,131,978,589
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,897,600
前受金	5,950,712
未払金	1,266,790
未払解約金	100,640,874
未払利息	1,113
流動負債合計	112,757,089
負債合計	112,757,089
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	88,846,300,958
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	213,172,920,542
元本等合計	302,019,221,500
純資産合計	302,019,221,500
負債純資産合計	302,131,978,589

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2023年11月24日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 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。</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 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。 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11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	88,846,300,958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 3.3993円 (1万口当たり純資産額) (33,993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11月24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。 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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	84,697,279,481円
期中追加設定元本額	7,567,373,180円
期中一部解約元本額	3,418,351,703円
期末元本額	88,846,300,958円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,153,009,219円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	522,426,900円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	341,382,731円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,469,678,472円
SBI資産設計オープン（分配型）	9,224,653円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,669,964,335円
世界経済インデックスファンド	18,908,948,031円
DCマイセクション25	1,968,307,417円
DCマイセクション50	1,770,990,626円
DCマイセクション75	1,361,228,396円
DC外国債券インデックス・オープン	2,250,516,369円
DCマイセクションS25	1,059,352,606円
DCマイセクションS50	965,157,408円
DCマイセクションS75	533,594,368円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	16,225,349円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	99,587,076円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	53,630,462円
DC世界経済インデックスファンド	13,755,959,502円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	646,261,287円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	913,708円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,011,151円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	15,967,931円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	29,577,182円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	51,554,161円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	54,953,177円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	52,048,914円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	851,034,675円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	382,737,228円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,559,113,788円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	52,388,370円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	31,095,201円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	364,358,474円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	132,701,308円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	180,554,443円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	641,969,049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）	1,501,508,777円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	631,367,705円
外国債券ファンド・シリーズ1	781,056,250円
分散投資コア戦略ファンドA	502,636,014円
分散投資コア戦略ファンドS	1,323,423,963円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	694,002,629円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,384,242,539円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	232,742,245円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	105,914,743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）	1,297,422,816円
SMT インデックスバランス・オープン	174,754,063円
SMT 世界経済インデックス・オープン	367,519,236円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	486,040,670円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	777,373,925円



区分	2023年11月24日現在
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,656,517円
グローバル経済コア	792,215,639円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	21,555,468円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,595,340円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	53,312,418円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	71,539,915円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	35,362,566円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	43,543,309円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	390,405,149円
10資産分散投資ファンド	26,120,580円
グローバル10資産バランスファンド	2,148,092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）	12,257,759,581円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	182,497,160円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	488,925,566円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	125,243,069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）	127,991,047円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2023年11月24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	1,652,208,417	-	1,658,159,129	5,950,712
合計		1,652,208,417	-	1,658,159,129	5,950,712

## （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11月24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	1,832,108,152	-	1,831,224,441	883,711
	アメリカドル	912,329,884	-	909,740,580	2,589,304
	カナダドル	74,109,325	-	74,073,692	35,633
	ユーロ	596,080,242	-	595,932,546	147,696
	イギリスポンド	102,175,941	-	102,912,040	736,099
	オフショア人民元	147,412,760	-	148,565,583	1,152,823
合計		1,832,108,152	-	1,831,224,441	883,711

## （注）時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 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

	2023年11月24日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	212,630,355
コール・ローン	391,465,104
国債証券	67,506,791,285
派生商品評価勘定	275,557,488
未収入金	3,955,214
未収利息	455,964,209
前払費用	39,532,039
差入委託証拠金	36,610,717
流動資産合計	68,922,506,411
<b>資産合計</b>	68,922,506,411
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	752,444,894
前受金	3,187,540
未払金	4,690,507
未払解約金	282,073
未払利息	222
流動負債合計	760,605,236
<b>負債合計</b>	760,605,236
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	83,187,891,391
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,025,990,216
元本等合計	68,161,901,175
<b>純資産合計</b>	68,161,901,175
<b>負債純資産合計</b>	68,922,506,411

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年11月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<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>

2023年11月24日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2023年11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	83,187,891,391口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 15,025,990,216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 0.8194円 (1万口当たり純資産額) (8,194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11月24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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	78,562,074,860円
期中追加設定元本額	8,108,262,560円
期中一部解約元本額	3,482,446,029円
期末元本額	83,187,891,391円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	20,252,480,457円
分散投資コア戦略ファンドS	28,235,905,835円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	1,183,181,849円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	528,417,286円

区分	2023年11月24日現在
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	116,326,237円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	27,301,796円
10資産分散投資ファンド	517,246,029円
グローバル10資産バランスファンド	8,701,564円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	6,892,342,043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)	2,546,629,087円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	3,491,298,990円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	3,534,104,399円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	3,516,144,509円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	3,398,707,865円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	3,365,017,160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)	3,300,519,205円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	2,273,567,080円

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 債券関連

(2023年11月24日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建	318,568,586	-	321,756,126	3,187,540
	合計	318,568,586	-	321,756,126	3,187,540

## (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11月24日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	66,258,897,551	-	66,738,972,497	480,074,946
	アメリカドル	31,981,479,563	-	31,709,289,169	272,190,394
	カナダドル	1,300,459,868	-	1,307,015,767	6,555,899
	メキシコペソ	587,949,450	-	615,549,480	27,600,030
	ユーロ	21,553,689,525	-	22,030,253,107	476,563,582
	イギリスポンド	3,265,646,722	-	3,344,907,817	79,261,095
	スウェーデンクローナ	129,892,216	-	137,236,489	7,344,273
	ノルウェークローネ	113,553,826	-	116,824,088	3,270,262
	デンマーククローネ	212,187,172	-	217,063,806	4,876,634
	ポーランドズロチ	335,701,480	-	350,287,343	14,585,863
	オーストラリアドル	945,552,017	-	972,269,100	26,717,083

	ニュージーランド ドル	149,956,092	-	155,169,300	5,213,208
	シンガポールドル	283,022,107	-	286,666,500	3,644,393
	マレーシアリン ギット	347,352,751	-	350,537,821	3,185,070
	イスラエルシェケ ル	190,695,946	-	204,104,342	13,408,396
	オフショア人民元	4,861,758,816	-	4,941,798,368	80,039,552
	合計	66,258,897,551	-	66,738,972,497	480,074,946

## (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11月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,958,764,007
コール・ローン	989,844,589
国債証券	121,777,135,076
未収利息	1,933,853,896
前払費用	203,370,188
流動資産合計	126,862,967,756
資産合計	126,862,967,756
負債の部	
流動負債	
未払金	1,322,257,706
未払解約金	29,707,533
未払利息	562
流動負債合計	1,351,965,801
負債合計	1,351,965,801
純資産の部	
元本等	
元本	57,068,137,122
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	68,442,864,833
元本等合計	125,511,001,955
純資産合計	125,511,001,955
負債純資産合計	126,862,967,756

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年11月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。

2023年11月24日現在	
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。
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11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	57,068,137,122口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.1993円 (21,993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11月24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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	52,278,352,105円
期中追加設定元本額	5,860,267,527円
期中一部解約元本額	1,070,482,510円
期末元本額	57,068,137,122円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	5,239,757,481円
世界経済インデックスファンド	19,505,015,401円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,807,176,457円
DC世界経済インデックスファンド	14,237,508,222円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	8,851,174円
分散投資コア戦略ファンドA	395,863,625円
分散投資コア戦略ファンドS	1,042,725,547円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	716,677,197円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,532,005,663円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	241,549,253円

区分	2023年11月24日現在
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	109,663,073円
SMT インデックスバランス・オープン	181,402,124円
SMT 世界経済インデックス・オープン	472,716,890円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	624,486,890円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	998,530,810円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,039,295円
グローバル経済コア	820,460,552円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	93,261,205円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	79,029,639円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	32,709,166円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	35,183,936円
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	155,517,739円
10資産分散投資ファンド	42,774,873円
グローバル10資産バランスファンド	3,356,149円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	237,609,804円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	161,353,966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）	22,227,442円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	230,204,334円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	220,416,015円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	219,295,696円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	224,099,208円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	221,877,764円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	141,790,532円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## 世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

## 貸借対照表

	2023年11月24日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	3,998,378
コール・ローン	3,728,181
国債証券	1,834,587,818
派生商品評価勘定	8,329,349
未収入金	361,587
未収利息	4,805,159
前払費用	264,018
流動資産合計	1,856,074,490
資産合計	1,856,074,490
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,724,187
未払金	59,548
未払解約金	15,116
未払利息	2
流動負債合計	18,798,853
負債合計	18,798,853
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	2,065,662,629
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	228,386,992
元本等合計	1,837,275,637
純資産合計	1,837,275,637
負債純資産合計	1,856,074,490

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年11月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,065,662,629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 228,386,992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) 0.8894円 (8,894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11月24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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	1,985,563,482円
期中追加設定元本額	90,584,544円
期中一部解約元本額	10,485,397円
期末元本額	2,065,662,629円
期末元本額の内訳	
10資産分散投資ファンド	80,536,170円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	1,462,197,866円
私募世界物価連動債バッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	522,928,593円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 通貨関連

（2023年11月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,782,661,492	-	1,793,056,330	10,394,838
	アメリカドル	977,913,454	-	969,584,105	8,329,349
	カナダドル	29,536,285	-	29,685,288	149,003
	ユーロ	362,931,371	-	370,938,155	8,006,784
	イギリスポンド	367,759,844	-	376,685,141	8,925,297
	スウェーデンクローナ	12,688,345	-	13,405,543	717,198
	デンマーククローネ	2,733,312	-	2,796,098	62,786
	オーストラリアドル	19,546,210	-	20,098,128	551,918
	ニュージーランドドル	9,552,671	-	9,863,872	311,201
合計	1,782,661,492	-	1,793,056,330	10,394,838	

（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11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,666,708,825
投資証券	114,925,389,000
派生商品評価勘定	3,035,200
未収入金	73,770,098

	2023年11月24日現在
項目	金額（円）
未収配当金	684,922,913
前払金	9,875,220
差入委託証拠金	197,489,282
流動資産合計	118,561,190,538
資産合計	118,561,190,538
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,914,380
未払解約金	213,388,092
未払利息	1,514
流動負債合計	226,303,986
負債合計	226,303,986
純資産の部	
元本等	
元本	55,963,740,733
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	62,371,145,819
元本等合計	118,334,886,552
純資産合計	118,334,886,552
負債純資産合計	118,561,190,538

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年11月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 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 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)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11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	55,963,740,733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 2.1145円 (1万口当たり純資産額) (21,145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11月24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11月24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>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> <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。 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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	64,195,508,562円
期中追加設定元本額	6,605,194,477円
期中一部解約元本額	14,836,962,306円
期末元本額	55,963,740,733円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,920,975,716円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,936,812円
SMT J-REITインデックス・オープン	17,678,416,284円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	26,717,008,959円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,011,513,433円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,637,547,155円
分散投資コア戦略ファンドA	1,017,119,866円
分散投資コア戦略ファンドS	1,830,619,539円
コア投資戦略ファンド(切替型)	764,413,759円
SMT インデックスバランス・オープン	23,680,269円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	211,531,584円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,451,230円
グローバル経済コア	280,132,420円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	15,420,966円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	526,962,705円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	132,020,059円
My SMT J-REITインデックス(ノーロード)	512,705,093円
10資産分散投資ファンド	23,141,001円
グローバル10資産バランスファンド	3,367,475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)	349,917,923円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	8,742,120円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	420,963,439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)	69,920,512円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05(適格機関投資家専用)	508,771,557円
J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03(適格機関投資家専用)	280,460,857円

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 投資証券関連

(2023年11月24日現在)

--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	3,400,907,220	-	3,391,032,000	9,875,220
	合計	3,400,907,220	-	3,391,032,000	9,875,220

## (注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## グローバルREITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2023年11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	108,188,063
コール・ローン	45,610,412
投資証券	109,437,607,301
未収入金	230,944,580
未収配当金	207,531,490
流動資産合計	110,029,881,846
資産合計	110,029,881,846
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	978,628
未払解約金	139,552,943
未払利息	25
流動負債合計	140,531,596
負債合計	140,531,596
純資産の部	
元本等	
元本	42,396,247,727
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	67,493,102,523
元本等合計	109,889,350,250
純資産合計	109,889,350,250
負債純資産合計	110,029,881,846

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年11月24日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>為替予約取引</p>

2023年11月24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11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	42,396,247,727口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2,5920円 (25,920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11月24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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月25日
期首元本額	36,697,065,105円
期中追加設定元本額	8,243,166,979円
期中一部解約元本額	2,543,984,357円
期末元本額	42,396,247,727円
期末元本額の内訳	

区分	2023年11月24日現在
グローバル3資産バランスオープン	55,090,495円
ワールド・ファイブインカム・ファンド(毎月決算型)	92,963,651円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,576,653,273円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,824,491円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,728,090,205円
グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)	19,820,761,003円
コア投資戦略ファンド(安定型)	515,173,421円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,382,411,427円
分散投資コア戦略ファンドA	1,038,546,021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)	633,426,707円
SMT インデックスバランス・オープン	110,086,481円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	176,477,358円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,956,087円
グローバル経済コア	237,306,140円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	14,497,088円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	444,030,757円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	109,346,956円
My SMT グローバルREITインデックス(ノーロード)	171,181,596円
10資産分散投資ファンド	12,807,918円
グローバル10資産バランスファンド	2,878,205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)	1,646,536,126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)	239,677,252円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	78,248,921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)	61,280,541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)	50,516,427円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	95,120,470円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	92,759,157円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	92,287,825円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	92,598,015円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	91,680,030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)	79,493,312円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	59,670,797円

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 通貨関連

(2023年11月24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	124,335,025	-	125,313,653	978,628
	アメリカドル	41,504,400	-	41,876,716	372,316
	オーストラリアドル	60,779,375	-	61,382,812	603,437
	香港ドル	22,051,250	-	22,054,125	2,875
合計		124,335,025	-	125,313,653	978,628

## (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12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12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	529	14,219,692
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	63	218,373
単位型公社債投資信託	51	177,896
合計	643	14,615,960

##### （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

2024年 2月22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37期事業年度（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。  
また、第38期事業年度の中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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 （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
<b>流動負債合計</b>	<b>12,423</b>	<b>9,958</b>
<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
<b>固定負債合計</b>	<b>986</b>	<b>1,086</b>
<b>負債合計</b>	<b>13,410</b>	<b>11,044</b>
<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
<b>資本剰余金合計</b>	<b>17,239</b>	<b>17,239</b>
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
<b>利益剰余金合計</b>	<b>44,548</b>	<b>47,355</b>
<b>株主資本合計</b>	<b>63,788</b>	<b>66,595</b>
<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
<b>評価・換算差額等合計</b>	<b>431</b>	<b>460</b>
<b>純資産合計</b>	<b>64,219</b>	<b>66,134</b>
<b>負債・純資産合計</b>	<b>77,629</b>	<b>77,179</b>

## （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

	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
	利益準備金	利益剰余金			
		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	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
	利益準備金	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いません。

### (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、金額の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、自社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、銀行勘定定貨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)

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せん。

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せん。

## （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せん。

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

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	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 (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)
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いません。

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 hands 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 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

## 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第38期中間会計期間末

(2023年9月30日)

## 資産の部

## 流動資産

現金及び預金	19,075
金銭の信託	16,243
未収委託者報酬	10,120
未収運用受託報酬	5,852
短期差入証拠金	4,241
その他	2,069
流動資産合計	57,601

## 固定資産

有形固定資産	1	727
無形固定資産		
ソフトウェア		7,456
その他		45
無形固定資産合計		7,502
投資その他の資産		
投資有価証券		4,409
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,136
その他		31
投資その他の資産合計		11,213
固定資産合計		19,443
資産合計		77,045
負債の部		
流動負債		
未払金		8,680
未払法人税等		441
賞与引当金		377
その他	2	1,624
流動負債合計		11,124
固定負債		
退職給付引当金		932
資産除去債務		154
その他		35
固定負債合計		1,121
負債合計		12,246

（単位：百万円）

第38期中間会計期間末

（2023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		43,700
利益剰余金合計		46,300
株主資本合計		65,540
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		164
繰延ヘッジ損益		906
評価・換算差額等合計		741

純資産合計	64,798
負債・純資産合計	77,045

## 中間損益計算書

（単位：百万円）

第38期中間会計期間

（自 2023年4月1日

至 2023年9月30日）

営業収益		
委託者報酬		21,671
運用受託報酬		5,502
その他営業収益		178
営業収益合計		27,352
営業費用		16,664
一般管理費	1	6,965
営業利益		3,722
営業外収益	2	1,680
営業外費用	3	2,074
経常利益		3,327
税引前中間純利益		3,327
法人税、住民税及び事業税		846
法人税等調整額		169
法人税等合計		1,015
中間純利益		2,312

## 中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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	44,755	47,355	66,595
当中間期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
中間純利益			2,312	2,312	2,312
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	-	-	1,055	1,055	1,055
当中間期末残高	500	2,100	43,700	46,300	65,540



	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	49	510	460	66,134
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,367
中間純利益				2,312
株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純 額）	114	395	280	280
当中間期変動額合計	114	395	280	1,335
当中間期末残高	164	906	741	64,798

## 注記事項

（重要な会計方針）

第38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 有価証券</p> <p>  子会社株式   移動平均法による原価法によっております。</p> <p>  その他有価証券   市場価格のない株式等以外のもの   時価法によっております。   （評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）</p> <p>  市場価格のない株式等   移動平均法による原価法によっております。   なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。</p> <p>(2) デリバティブ   時価法によっております。</p> <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> <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</p> <p>  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。</p> <p>4. 収益及び費用の計上基準</p> <p>  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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 投資助言業務</p>

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。

## (表示方法の変更)

第38期中間会計期間  
(自 2023年4月1日  
至 2023年9月30日)

従来「無形固定資産」に含めていた「ソフトウェア」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38期中間会計期間末  
(2023年9月30日)

- |   |                                              |        |
|---|----------------------------------------------|--------|
| 1 | 有形固定資産の減価償却累計額                               | 957百万円 |
| 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38期中間会計期間  
(自 2023年4月1日  
至 2023年9月30日)

- |   |            |          |
|---|------------|----------|
| 1 | 減価償却実施額    |          |
|   | 有形固定資産     | 91百万円    |
|   | 無形固定資産     | 972百万円   |
| 2 | 営業外収益の主要項目 |          |
|   | 金銭の信託運用益   | 1,589百万円 |
| 3 | 営業外費用の主要項目 |          |
|   | デリバティブ費用   | 1,269百万円 |
|   | 為替差損       | 784百万円   |

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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

2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26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38期中間会計期間末（2023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)	1,206	13,995	-	15,201
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	-	4,137	-	4,137
資産計	1,206	18,133	-	19,339
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	226	113	-	339
通貨関連取引	-	(134)	-	(134)
デリバティブ取引計	226	(20)	-	205

(\*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1,041百万円）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16,243百万円であります。

(\*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271百万円）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、短期差入証拠金、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。為替予約及びトータルリターンズスワップの時価は、為替レートや金利や株価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38期中間会計期間末（2023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	2,711	2,131	580
小計	2,711	2,131	580
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	1,426	1,769	343
小計	1,426	1,769	343
合計	4,137	3,900	237

(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271百万円）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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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)
店頭 為替予約取引 売建 米ドル 英ポンド カナダドル スイスフラン 香港ドル ユーロ	5,944 267 126 176 214 719	- - - - - -	76 1 1 0 2 3	76 1 1 0 2 3
合計	7,449	-	84	84

(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	9,373	-	226	226
店頭 トータルリターンスワップ取引 売建	3,866	-	113	113
合計	13,239	-	339	339

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建 米ドル 英ポンド スイスフラン 香港ドル ユーロ	投資有価証券 関係会社株式	1,935 3,612 22 90 51	- - - - -	24 23 0 1 0
	合計		5,713	-	49

（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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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	5,057百万円

〔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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023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38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）  
該当事項はありません。

（1株当たり情報）

	第38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
1株当たり純資産額	21,599,648円64銭
1株当たり中間純利益	770,782円86銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
中間純利益	2,312百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,312百万円
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**

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. 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**

2023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 田中洋一

**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2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023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2023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（2023年4月1日から2023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。

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に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、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

2024年2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 中島紀子

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている10資産分散投資ファンドの2023年5月25日から2023年11月24日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、10資産分散投資ファンドの2023年11月24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5月25日から2023年11月24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。