# 【表紙】

【提出書類】 半期報告書

【提出日】 2024年3月12日提出

【計算期間】 第7期中(自 2023年6月13日至 2023年12月12日)

【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。

# 【SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)】

# (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	6,911,831,617	98.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		84,602,489	1.21
合計(純資産総額)		6,996,434,106	100.00

<sup>(</sup>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)		1万口当たりの約	屯資産額(円)
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末	(2018年 6月11日)	545,359,273	545,359,273	10,037	10,037
第2期計算期間末	(2019年 6月10日)	823,199,920	823,199,920	10,104	10,104
第3期計算期間末	(2020年 6月10日)	1,375,543,408	1,375,543,408	10,625	10,625
第4期計算期間末	(2021年 6月10日)	2,387,407,826	2,387,407,826	12,027	12,027
第5期計算期間末	(2022年 6月10日)	4,030,020,115	4,030,020,115	12,294	12,294
第6期計算期間末	(2023年 6月12日)	5,665,714,018	5,665,714,018	12,924	12,924
	2022年12月末日	4,583,834,175		11,714	
	2023年 1月末日	4,822,413,817		12,020	
	2月末日	4,959,534,597		12,145	
	3月末日	5,168,483,928		12,265	
	4月末日	5,281,372,217		12,393	
	5月末日	5,536,485,525		12,761	
	6月末日	6,004,124,653		13,444	
	7月末日	6,135,022,506		13,407	
	8月末日	6,420,490,177		13,611	
	9月末日	6,468,205,426		13,351	
	10月末日	6,493,033,168		13,237	
	11月末日	6,856,464,188		13,819	
	12月末日	6,996,434,106		13,818	

# 【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	2017年 8月25日~2018年 6月11日	0
第2期計算期間	2018年 6月12日~2019年 6月10日	0
第3期計算期間	2019年 6月11日~2020年 6月10日	0
第4期計算期間	2020年 6月11日~2021年 6月10日	0

第5期計算期間	2021年 6月11日~2022年 6月10日	0
第6期計算期間	2022年 6月11日~2023年 6月12日	0

### 【収益率の推移】

	期間	収益率(%)
第1期計算期間	2017年 8月25日~2018年 6月11日	0.4
第2期計算期間	2018年 6月12日~2019年 6月10日	0.7
第3期計算期間	2019年 6月11日~2020年 6月10日	5.2
第4期計算期間	2020年 6月11日~2021年 6月10日	13.2
第5期計算期間	2021年 6月11日~2022年 6月10日	2.2
第6期計算期間	2022年 6月11日~2023年 6月12日	5.1
第7期中間計算期間	2023年 6月13日~2023年12月12日	5.8

<sup>(</sup>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。

### (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

<sup>(</sup>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。

# 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

<sup>(</sup>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。

# 国内債券インデックス マザーファンド

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

<sup>(</sup>注2)小数第2位を四捨五入しております。

<sup>(</sup>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。

<sup>(</sup>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。

	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。

# 外国株式インデックス マザーファンド

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	0.59
	香港	2,923,160,701	0.46
	シンガポール	1,990,878,487	0.3
	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	0.2
	イスラエル	1,251,430,089	0.2
	ノルウェー	1,170,291,225	0.18
	ケイマン	822,555,086	0.10
	キュラソー	817,138,352	0.10
	バミューダ	800,661,258	0.10
	ニュージーランド	515,461,679	0.08
	リベリア	381,134,046	0.00
	ルクセンブルク	370,673,947	0.00
	オーストリア	340,212,200	0.09
	ポルトガル	336,147,214	0.09
	パナマ	190,150,446	0.03
	マン島	89,348,667	0.0
	小計	609,742,454,095	96.20

			切取口官(内国仅具后武
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 /	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。

### 外国債券インデックス マザーファンド

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社(E12444)

半期起生津	(内国投資信託受益証券)
十别取口百	

		十	明报古者(内国投食后式
	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。

新興国株式インデックス マザーファンド

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社(E12444) 半期報告書(内国投資信託受益証券)

- (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

<sup>(</sup>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

<sup>(</sup>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。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社(E12444)

半期報告書(内国投資信託受益証券)

(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】

# 【SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)】

	期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2017年 8月25日~2018年 6月11日	755,925,234	212,584,152	543,341,082
第2期計算期間	2018年 6月12日~2019年 6月10日	566,171,068	294,755,895	814,756,255
第3期計算期間	2019年 6月11日~2020年 6月10日	723,541,962	243,618,762	1,294,679,455
第4期計算期間	2020年 6月11日~2021年 6月10日	923,844,272	233,468,732	1,985,054,995
第5期計算期間	2021年 6月11日~2022年 6月10日	1,555,340,467	262,475,209	3,277,920,253
第6期計算期間	2022年 6月11日~2023年 6月12日	1,458,301,303	352,304,880	4,383,916,676
第7期中間計算期間	2023年 6月13日~2023年12月12日	831,505,363	230,471,868	4,984,950,171

<sup>(</sup>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7期中間計算期間(2023年6月13日から 2023年12月12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。

# 【SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)】

# (1)【中間貸借対照表】

		<u>(単位:円)</u>
	第6期 (2023年 6月12日現在)	第7期中間計算期間 (2023年12月12日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	63,491,490	74,155,066
親投資信託受益証券	5,609,820,006	6,733,098,922
未収入金	11,210,000	36,394,980
流動資産合計	5,684,521,496	6,843,648,968
資産合計	5,684,521,496	6,843,648,968
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,092,419	8,664,459
未払受託者報酬	1,397,261	1,747,877
未払委託者報酬	11,178,005	13,982,950
未払利息	129	24
その他未払費用	139,664	174,723
流動負債合計	18,807,478	24,570,033
負債合計	18,807,478	24,570,033
純資産の部		
元本等		
元本	4,383,916,676	4,984,950,171
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,281,797,342	1,834,128,764
(分配準備積立金)	590,627,390	562,767,283
元本等合計	5,665,714,018	6,819,078,935
純資産合計	5,665,714,018	6,819,078,935
負債純資産合計	5,684,521,496	6,843,648,968

# (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(2)【刊明原血及0利水亚时并自1		(単位:円)
	第6期中間計算期間 自 2022年 6月11日 至 2022年12月10日	第7期中間計算期間 自 2023年 6月13日 至 2023年12月12日
営業収益		
受取利息	75	198
有価証券売買等損益	1,002,253	361,274,167
その他収益	<u>-</u>	1,050
営業収益合計	1,002,328	361,275,415
三世 三世 三世		
支払利息	12,805	17,820
受託者報酬	1,186,804	1,747,877
委託者報酬	9,494,341	13,982,950
その他費用	118,610	174,725
営業費用合計	10,812,560	15,923,372
営業利益又は営業損失( )	9,810,232	345,352,043
経常利益又は経常損失( )	9,810,232	345,352,043
中間純利益又は中間純損失( )	9,810,232	345,352,043
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( )	212,040	12,508,570
期首剰余金又は期首欠損金()	752,099,862	1,281,797,342
剰余金増加額又は欠損金減少額	154,498,947	287,720,466
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少 額	154,498,947	287,720,466
剰余金減少額又は欠損金増加額	34,177,354	68,232,517
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加 額	34,177,354	68,232,517
分配金	<u>-</u>	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	862,823,263	1,834,128,764

# (3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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。
ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年6月11日から翌年6月10日までとなって おりますが、前計算期間末日が休業日のため、第7期中間計算期間は2023年 6月13 日から2023年12月12日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

			6期 月12日現在)	第7期中間 (2023年12月	
1 .	計算期間の末日にお ける受益権の総数		4,383,916,676□		4,984,950,171□
2 .	計算期間の末日にお		1.2924円	1口当たり純資産額	1.3679円
	ける1単位当たりの純 資産の額	(1万口当たり純資産額)	(12,924円)	(1万口当たり純資産額)	(13,679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) 金融音品の時毎第5月間末3東項

金融商品の時価等に関する事項	
	第7期中間計算期間 (2023年12月12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。
	(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。
	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)

	_ ~	14	エエ
元	$\mathbf{N} \mathbf{U}$	1 To 2	曲川
111/	トソノ	ソリン	Ŧ/I

ル中の移動		
区分	第6期 自 2022年 6月11日 至 2023年 6月12日	第7期中間計算期間 自 2023年 6月13日 至 2023年12月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	3,277,920,253円	4,383,916,676円
期中追加設定元本額	1,458,301,303円	831,505,363円
期中一部解約元本額	352,304,880円	230,471,868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12月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,308,363,417
株式	583,994,342,210
派生商品評価勘定	15,620,700
未収入金	376,900
未収配当金	251,084,768
差入委託証拠金	196,300,818
流動資産合計	588,766,088,813
資産合計	588,766,088,813
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	41,100
前受金	15,584,000
未払金	18,412,221
未払解約金	652,676,595
未払利息	1,417
流動負債合計	686,715,333
負債合計	686,715,333
純資産の部	
元本等	
元本	243,616,329,149
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	344,463,044,331
元本等合計	588,079,373,480
純資産合計	588,079,373,480
負債純資産合計	588,766,088,813

# 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

( 里安な会計力針に係る事項に関 9	3/注心 /
	2023年12月12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12月12日現在	
1.	計算期間の末日における受益権の総数			243,616,329,149
2 .		1口当たり純資産額		2.4140円

		2023年12月12日現在	,
計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額	(1万口当たり純資産額)		(24,140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

- 本殿的前の時間寺に割りる事項		
	2023年12月12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。	
	(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。	
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12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 6月13日
期首元本額	253,755,785,513円
期中追加設定元本額	12,938,544,627円
期中一部解約元本額	23,078,000,991円
期末元本額	243,616,329,149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)	309,619,193円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,423,980,750円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,094,963円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,029,994,756円
世界経済インデックスファンド	5,183,815,086円
日本株式インデックス・オープン	2,963,223,391円
DCマイセレクション25	5,346,989,548円
DCマイセレクション50	17,256,229,417円
DCマイセレクション75	18,633,711,318円
DC日本株式インデックス・オープン	6,012,794,109円
D C マイセレクション S 2 5	3,165,070,713円
DCマイセレクションS50	9,550,985,540円
DCマイセレクションS75	8,276,536,673円
D C 日本株式インデックス・オープン S	9,159,961,526円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	91,582,985円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	621,840,409円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	487,679,216円
D C 世界経済インデックスファンド	3,797,824,116円
日本株式インデックス・オープン (SMA専用)	861,173,742円
国内バランス60 VA1 (適格機関投資家専用)	3,504,090円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	10,124,653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)	146,024,854円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,043,492円

区分 2023年12月12日現在		半期報告書(内国投資信託
(プランス 5 0 V A 1 (通格機助投資家専用) 79.516,841円 15/フスス 5 0 V A 2 (通路機助投資家専用) 16.6,582円 バランス 3 0 V A 2 (通路機助投資家専用) 42.929,946円 507,723,50 V A 2 (通路機助投資家専用) 42.929,946円 507,723,50 V A 1 (通格機助投資家専用) 42.929,946円 507,723,50 V A 1 (通格機助投資家専用) 30.041,03 M 1 (通格機助投資家専用) 2,142,119,294円 12月パランス C (5 0 ) V A 1 (通格機助投資家専用) 2,142,119,294円 12月パランス C (5 0 ) V A 1 (通格機助投資家専用) 2,142,119,294円 12月パランス V A 2 (通路機助投資家専用) 12.562,183円 12.		2023年12月12日現在
(万シス2 5 VA 2 (連格機間投資家専用) 42,929,946円 75 ンスA (2 5 ) VA 1 (連格機間投資家専用) 42,929,946円 75 ンスA (2 5 ) VA 1 (連格機間投資家専用) 507,129,553円 75 ンスA (2 7 5 ) VA 1 (連格機間投資家専用) 320,611,952円 世界パランスVA 1 (連格機間投資家専用) 21,142,119,294円 世界パランスVA 2 (連格機間投資家専用) 12,562,183円 330,004,333円 75 ンスA (2 (2 5 ) VA 1 (連格機間投資家専用) 12,562,183円 332,995,816円 75 ンスE (2 5 ) VA 1 (連格機間投資家専用) 12,562,183円 332,995,816円 162,287,222円 17,700円 70 - 1/ルル・パランス 1 (2 5 ) VA 1 (連格機間投資家専用) 12,562,183円 17,500円 70 - 1/ルル・パランス 1 (2 5 ) VA 1 (連格機間投資家専用) 12,262,183円 12,270円 17,00円 17,	バランス30VA1(適格機関投資家専用)	15,523,066円
(スランス 5 0 V A 2 ( 適格機開投資家専用) 507,129,553円 (スランス 6 ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機開投資家専用) 507,129,553円 (スランス 6 ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機開投資家専用) 507,129,553円 (スランス 6 ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機開投資家専用) 20,611,933円 世界パランス 0 ( 2 5 0 ) V A 1 ( 適格機開投資家専用) 2,142,119,294円 世界パランス V A 1 ( 適格機開投資家専用) 12,562,183円 世界パランス V A 2 ( 適格機開投資家専用) 12,562,183円 (スランス 6 ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機開投資家専用) 12,562,183円 (スランス 6 ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機開投資家専用) 12,562,183円 (スランス 6 ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機開投資家専用) 162,287,222円 (スランス 6 ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機開投資家専用) 249,263,166円 国内パランス 7 × V A 1 ( 適格機開投資家専用) 20,204,568円 (アローバル・バランス 7 × V - 7 × V ) でローバル・バランス 7 × V - 7 × V ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機開投資家専用) 20,204,568円 ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機開投資家専用) 20,204,568円 ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機開投資家専用) 20,204,568円 ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機開投資家専用) 20,204,568円 ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機開投資家専用) 20,204,568円 ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機開投資家専用) 20,204,568円 ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機開投資家専用) 20,204,568円 ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機開投資家専用) 20,204,568円 ( 2 5 ) V A 1 ( 3 6 8 2 ) V A 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2	バランス50VA1(適格機関投資家専用)	70,516,841円
(ランス A ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用) 30,7129,563円 320,611,953円 (プランス B ( 3 7 . 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用) 30,611,953円 は界パランス V A 1 (適格機関投資家専用) 30,004,333円 世界パランス V A 1 (適格機関投資家専用) 30,004,333円 世界パランス V A 1 (適格機関投資家専用) 332,395,816円 (プランス E ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用) 32,395,816円 (プランス E ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用) 32,395,816円 (プランス E ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用) 12,562,183円 (プランス E ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用) 124,222円 (パランス E ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用) 124,223,166円 ( 1 5 ) 2 ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用) 124,223,166円 ( 1 5 ) 2 ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用) 124,222円 ( 7 5 ) 2 ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用) 124,222円 ( 7 5 ) 2 ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用) 124,222円 ( 7 5 ) 2 ( 2 5 ) V A 1 ( 3 6 8 機関投資家専用) 124,222円 ( 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7		16,046,582円
(プランス G 5 の ) V A 1 (適格機即投資家専用) 2,142,119,294円 2月79 (	バランス50VA2(適格機関投資家専用)	42,929,946円
(テランス V A 1 ( 適格機関投資家専用) 2,142,119,294円世界パランス V A 1 ( 適格機関投資家専用) 30,004,333円 世界パランス V A 1 ( 適格機関投資家専用) 12,562,183所 バランス D ( 3 5 ) V A 1 ( 適格機関投資家専用) 12,562,183所 バランス D ( 3 5 ) V A 1 ( 適格機関投資家専用) 323,395,816円 バランス F ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機関投資家専用) 322,395,816円 バランス F ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機関投資家専用) 12,287,222円 バランス F ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機関投資家専用) 12,002,016円 バランス F ( 2 5 ) V A 1 ( 適格機関投資家専用) 120,024,568円 F O F s 用日本株式インデックス・オープン ( 適格機関投資家専用) 20,024,568円 P O F s 用日本株式インデックス・オープン ( 3 6 機関投資家専用) 20,024,568円 コア投資戦略 アッド に 反配型 17投資戦略 アッド・シリーズ 1 1,155,863,727円 コア投資戦略 アッド ド ( 6 反配型 ) 1,155,863,727円 コア投資戦略 アッド ド ( 6 反配型 ) 2,031,08日円 1 ( 5 0,081円 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1		507,129,553円
世界パランスVA1 (適格機関投資家専用) 12,562,183円 12,562,183円 12,562,183円 12,562,183円 12,562,183円 12,562,183円 132,393,391円 12,562,183円 132,393,816円 17ランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用) 12,297,222円 17ランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用) 12,297,222円 17ランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用) 249,283,166円 18内パランス25VA1 (適格機関投資家専用) 20,204,568円 17 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0	バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	320,611,953円
世界パランスVA2 (適格機関的投資家専用) パランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用) パランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用) リススF(25)VA1 (適格機関投資家専用) 国内パランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用) 国内パランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用) 国内パランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用) 日本株式インデックス・オープン (適格機関投資家専用) 日本株式インデックス・オープン (適格機関投資家専用) コア投資戦略ファンド (安定型) コア投資戦略ファンド(反長型) コア投資戦略ファンド(成長型) 分散投資コア戦略ファンド(株式シフト型) して世界経済インデックスファンド (横勢シフト型) コア投資戦略ファンド((横勢シフト型) コア投資戦略ファンド((横勢シフト型) コア投資戦略ファンド (横勢シフト型) サ系済インデックスファンド (横勢シフト型) カー株式 アックスプランと (横勢シフト型) コア投資戦略ファンド (株式シフト型) 国内株式 SMT B セレクション (S MA 専用) サラづイ 大投資戦略ファンド (株式シフト型) 第9.991、289円 B MT 世界経済インデックス・オープン (大式シフト型) SMT 世界経済インデックス・オープン (大式シアープ) コア投資戦略ファンド (株団型フィド) コア投資戦略ファンド (棒種成長型) コア投資戦略ファンド (棒種成長型) コア投資戦略ファンド (棒種成長型) コア投資戦略ファンド (棒種成長型) コア投資戦略ファンド (横種成長型) コア投資戦略ファンド (横種成長型) コア投資戦略ファンド (横層成長資家専用) ロ (カース・オーランド) (高資産・運用継続型) 2 0 4 0	バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,142,119,294円
(プランスD (35) VA 1 (適格機関投資家専用) 182,287,227例 182,287,227例 182,287,227例 182,287,227例 182,287,227例 182,287,227例 182,287,227例 182,287,227例 292,253,166円 国内パランス25 VA 1 (適格機関投資家専用) 249,283,166円 国内パランス25 VA 1 (適格機関投資家専用) 249,283,166円 グローバル・パランスファンド・シリーズ1 2,536,242,081円 日本株式ファンド・シリーズ2 1,922,303,988円 1,922,303,988円 1,922,303,988円 1,922,303,988円 1,155,883,727円 フ投資戦略ファンド(成長型) 1,155,883,727円 フ投資戦略ファンド(成長型) 2,631,424,283円 分散投資コア戦略ファンドの大人を受力 1,942,283,577円 分散投資コア戦略ファンド(株式シフト型) 2,631,424,283円 分取投資コア戦略ファンド(株式シフト型) 1,942,283,577円 分散投資コア戦略ファンド(株式シフト型) 499,284,985日 コア投資戦略ファンド(植物型) 1,219,002,091円 世界経済インデックスファンド(債券シフト型) 199,104,687円 世界経済インデックスファンド(株式シフト型) 199,104,687円 197,63,215,485円 197,63,215,485	世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	30,004,333円
グランスE(25) VA1 (適格機関投資家専用) 249,263,166円 国内パランスE(25) VA1 (適格機関投資家専用) 249,263,166円 国内パランス2 5 VA1 (適格機関投資家専用) 20,204,568円 国内パランス2 5 VA1 (適格機関投資家専用) 20,204,568円 日本株式フデックス・オープン (適格機関投資家専用) 420,022,670円 プローバル・バランスファンド・シリーズ1 1,922,303,988円 コア投資戦略ファンド・シリーズ2 1,922,303,988円 コア投資戦略ファンド・交足型) 1,555,853,727円 2,653,424,283円 2,653,424,283円 2,653,424,283円 2,653,424,283円 2,653,424,283円 2,653,424,283円 2,783,225,242,281円 2,783,225,225,225,225,225,225,225,225,225,22	世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	12,562,183円
グランス F ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	332,395,816円
国内バランス 2 5 V A 1 (適格機関投資家専用)	バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	182,287,222円
F O F S 用日本株式インデックス・オーブン(適格機関投資家専用) 2,536,242,081円 日本株式ファンド・シリーズ1 1,922,303,988円 コア投資戦略ファンド(安定型) 1,155,883,727円 2,631,424,283円 分散投資コア戦略ファンド(成長型) 1,462,8367分散投資コア戦略ファンド (成長型) 2,631,424,283円分散投資コア戦略ファンド (成長型) 1,404,288,367円分散投資コア戦略ファンド (株式シフト型) 602,778,473円 0 C 世界経済インデックスファンド(情劳シフト型) 409,224,936万円 1,219,002,091円 世界経済インデックスファンド(情劳シフト型) 199,104,687円 世界経済インデックスファンド(債劳シフト型) 9,991,289円 197,104,687円 世界経済インデックスファンド(債劳シフト型) 199,104,687円 世界経済インデックスファンド(債劳シフト型) 1,219,002,091円 世界経済インデックスファンド(債劳シフト型) 1,219,002,091円 世界経済インデックス・オーブン 48,881,127円 197,763,215,485円 サテライト投資戦略ファンド(株式型) 9,991,289円 5 MT セ界経済インデックス・オーブン 267,816,957円 5 MT 世界経済インデックス・オーブン 52,249,868円 5 MT 世界経済インデックス・オーブン 267,816,957円 5 MT 世界経済インデックス・オーブン 216,423,849円 5 MT 世界経済インデックス・オーブン (債券シフト型) 37,268,650円 5 MT 8 資産インデックス・オーブン 217,244,401円 5 8 I 資産設計オープン (つみたてN I S A 対応型) 37,268,650円 5 MT 8 資産インデックス (ノーロード) 1,305,671,355円 33,654,909円 My S MT T O P I X インデックス (ノーロード) 1,305,671,355円 7 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 5 3 0,392,042円 7 投資戦略ファンド(10 資産がアンド) 964,175,269円 2 424,306,554円 5 0 5 0 5 5 0 5 0 5 5 0	バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	249,263,166円
グローバル・パランスファンド・シリーズ 1 2,536,242,081円 日本株式ファンド・シリーズ 2 1,922,303,988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 分散投資コブ戦略ファンド(成長型) 2,631,424,283円 分散投資コブ戦略ファンド(成長型) 2,631,424,283円 りて世界経済インデックスファンド(株式シフト型) 602,178,473円 D C 世界経済インデックスファンド(横参ント型) 409,284,985円 1,219,002,091円 世界経済インデックスファンド(横参ント型) 1,219,002,091円 世界経済インデックスファンド(横参ント型) 9,991,289円 と解経済インデックスファンド(横参ント型) 9,991,289円 5 8 M T インデックスファンド(横参ント型) 9,991,289円 5 8 M T インデックスファンド(横参ント型) 9,991,289円 5 8 M T 世界経済インデックスファンド(株式型) 267,816,957円 5 M T 世界経済インデックス・オーブン (横ちント型) 277,816,957円 5 M T 世界経済インデックス・オーブン(株式シフト型) 52,249,858円 5 M T 世界経済インデックス・オーブン(株式シフト型) 277,844,401円 5 B I 資産インデックス・オーブン(向参ンフト型) 37,268,650円 5 M T 8 資産インデックス・オーブン(つみたてN I S A 対応型) 37,268,650円 5 12,194,823円 7 12,219,423円 7 1	国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	20,204,568円
日本株式ファンド・シリーズ2 1,922,303,988円 1,155,853,727円 1,155,853,727円 7月貨費略8ファンド(安定型) 1,651,853,727円 1,655,853,727円 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 (株式シフト型) 602,178,473円 D C 世界経済インデックスファンド(構労シフト型) 409,284,985円 1,219,002,091円 世界経済インデックスファンド(債券シフト型) 1,219,002,091円 世界経済インデックスファンド(債券シフト型) 9,991,289円 5 M T インデックスファンド(債券シフト型) 199,104,687円 世界経済インデックスファンド(債券シフト型) 199,104,687円 世界経済インデックスファンド(債券シフト型) 199,763,215,485円 5 M T 世界経済インデックス・オープン 48,881,127円 19,763,215,485円 7 サテライト投資戦略ファンド(株式型) 267,816,957円 7 5 2,249,858円 267,816,957円 7 5 2,249,858円 3 7 2,268,650円 5 M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型) 216,423,494円 3 7 2,286,650円 5 M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型) 37,268,650円 5 M T 8 資産インデックス・オープン(情労シフト型) 37,268,650円 5 M T 8 資産インデックスパランス・オープン(情労シフト型) 37,268,650円 5 M T 8 資産インデックスパランス・オープン(情労シフト型) 33,654,909円 M y S M T T O P I X インデックス (ノーロード) 1,305,671,355円 3 3,303,145円 0 C ターゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2030 53,036,145円 0 C ターゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2050 21,986,739円 0 C ターゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2050 21,986,739円 0 C 全ーゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2050 21,986,739円 0 C 生界経済インデックスファンド 9 2,513,578円 3,049円 0 C 全ーゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2050 21,986,739円 0 C 生界経済インデックスファンド 9 (364,879円 0 C 年) 5 7 7 9 3,49円 0 C 7 9 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7	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)	420,022,670円
コア投資戦略ファンド(成長型) 1,155,853,727円 2,631,424,288円 30枚投資コア戦略ファンド(成長型) 4,42,288円 1,940,288,367円 6,367,530,443円 6,367,530,443円 6,367,530,443円 602,178,473円 72円投資戦略ファンド(債券シフト型) 409,284,985円 1,219,002,091円 世界経済インデックスファンド(債券シフト型) 199,104,687円 199,104,687円 199,104,687円 199,104,687円 199,104,687円 199,104,687円 199,763,215,485円 199,763,215,485円 197,763,215,485円 197,763,797,203,215,485円 197,763,215,485円 197,763,215 197,215,215 197,215,215 197,215,215 197,2	グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	2,536,242,081円
コア投資戦略ファンド(成長型) 分散投資コア戦略ファンドス 分散投資コア戦略ファンドス か散投資コア戦略ファンド(株式シフト型)	日本株式ファンド・シリーズ 2	1,922,303,988円
対散投資コア戦略ファンドA	コア投資戦略ファンド(安定型)	1,155,853,727円
会験投資コア戦略ファンドS D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型) D C 世界経済インデックスファンド(横参シフト型) コア投資戦略ファンド(団替型) 世界経済インデックスファンド(横参シフト型) コア投済戦略ファンド(団がシフト型) 世界経済インデックスファンド(株式シアト型) コタスパランス・オープン 国内株式SMTB セレクション(SMA専用) サテライト投資戦略ファンド(株式シフト型) コタインデックスファンド(株式シフト型) 国内株式SMTB セレクション(SMA専用) サラライト投資戦略ファンド(株式シフト型) 267,816,957円 SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型) SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型) SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型) SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型) SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型) SMT 世界経済インデックス・オープン(大量シアト型) SMT 世界経済インデックス・オープン(大量シアト型) SMT TOPIXインデックス(ノーロード) D C ターゲット・イヤー ファンド2 0 5 5 コア投資戦略ファンド(団替型ワイド) コア投資戦略ファンド(団替型フィド) コア投資戦略ファンド(は種様成長型) 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 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 コアサンド・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2 0 6 0 コアナツルト・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2 0 6 0 コクターゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2 0 7 9 9 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3 3	コア投資戦略ファンド(成長型)	2,631,424,283円
D C 世界経済インデックスファンド (株式シフト型) 602,178,473円 D C 世界経済インデックスファンド (債券シフト型) 409,284,985円 世界経済インデックスファンド (債券シフト型) 1,219,002,091円 世界経済インデックスファンド (債券シフト型) 199,104,687円 世界経済インデックスファンド (債券シフト型) 9,991,289円 S M T インデックスパランス・オーブン 48,881,127円 国内株式 S M T B セレクション (S M A 専用) 19,763,215,485円 サテライト投資戦略ファンド (株式型) 267,816,957円 S M T 世界経済インデックス・オーブン 267,816,957円 S M T 世界経済インデックス・オーブン 37,268,650円 S M T 世界経済インデックス・オーブン 416,423,849円 12,219,423円 グローバル経済コア 37,268,650円 S M T 8 資産インデックス・オーブン 12,219,423円 グローバル経済コア 33,654,909円 33,654,909円 33,654,909円 33,654,909円 33,654,909円 33,654,909円 32,065,547目 7投資戦略ファンド (切替型ワイド) 1,305,671,355円 0 C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5 30,392,042円 0 242,306,554円 0 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 53,036,145円 0 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 21,986,739円 0 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 50,721,567円 0 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 50,721,567円 0 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 50,721,567円 0 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 50,721,567円 0 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 50,721,567円 0 C ターゲット・イヤーファンド (6 資産・運用継続型) 2 0 7 9 92,513,578円 7 92,513,	分散投資コア戦略ファンドA	1,940,288,367円
D C 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)       409,284,985円         コア投資戦略ファンド (切替型)       1,219,002,091円         世界経済インデックスファンド (株式シフト型)       199,104,687円         世界経済インデックスプランス・オープン       48,881,127円         国内株式 S M T B セレクション ( S M A 専用)       19,763,215,485円         サテライト投資戦略ファンド (株式型)       267,816,957円         S M T 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)       267,816,957円         S M T 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)       37,268,650円         S M T 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)       37,268,650円         S M T 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)       37,268,650円         S M T 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)       37,268,650円         S M T 世界経済インデックス・オープン       12,219,423円         グローバル経済コア       33,654,90円         M y S M T T O P I X インデックス ( ノーロード )       1,305,671,355円         D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5       30,392,042円         コ 投資戦略ファンド ( 切替型ワイド )       924,306,554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       53,036,145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       50,721,567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       25,790,349円         1 0 資産が対シスファンド ( 株式特化型 )       20,340円         F O F s 用 国内株式インデックスファンド P ( 適格機関投資家専用 )       41,900,806,504円         T O F s 用 世界経済インデックスファンド ( 適格機関投資家専用 )       340,366,787円         S M T A M 日本株式	分散投資コア戦略ファンドS	6,367,530,443円
コア投資戦略ファンド(切替型) 1,219,002,091円 世界経済インデックスファンド(株式シフト型) 9,91,289円 848 841,127円 国内株式SMTBセレクション(SMA専用) 19,763,215,485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 268,850円 SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型) 37,268,650円 SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型) 12,219,423円 12,219,401円 13,305,671,355円 DCターゲット・イヤー ファンド2055 コの投資戦略ファンド(付替型ワイド) 1,305,671,355円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030 964,175,269円 コア投資戦略ファンド(積極成長型) 2030 53,036,145円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040 50,721,567円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040 50,721,567円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060 25,790,349円 10資産分散投資ファンド 3,694,879円 10資産分散投資ファンド 3,694,879円 10資産分散投資ファンド (適格機関投資家専用) 41,900,806,504円 FOFs用 国内株式インデックス・ファンドド(適格機関投資家専用) 41,900,806,504円 FOFs用 国内株式インデックス・ファンドド(適格機関投資家専用) 41,900,806,504円 FOFs用 国内株式インデックス・ファンドド(適格機関投資家専用) 41,900,806,504円 FOFs 用 田内株式インデックス・ファンドド(適格機関投資家専用) 300,608,504円 FOFs 用 田内株式インデックス・ファンドド(適格機関投資家専用) 41,190,806,5081円 21,111,111円 346,365,787円 346,365,787円 5MTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) 300,608,5081円 50 FS 用世界成長戦略ファンド(直格機関投資家専用) 346,365,787円 5MTAM9本株式インデックスファンド(194機関投資家専用) 47,165,716,820円	D C 世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	602,178,473円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型) 9,991,289円 8,881,127円 国内株式 S M T B セレクション ( S M A 専用 ) 19,763,215,485円 サテライト投資戦略ファンド ( 株式型 ) 267,816,957円 S M T 世界経済インデックス・オーブン 52,249,858円 S M T 世界経済インデックス・オーブン 52,249,858円 S M T 世界経済インデックス・オーブン 52,249,858円 S M T 世界経済インデックス・オーブン ( 株式型 ) 216,423,849円 37,268,650円 S M T 世界経済インデックス・オーブン ( 債券シフト型 ) 37,268,650円 S M T 世界経済インデックス・オーブン ( 債券シフト型 ) 12,219,423円 グローバル経済コア 31,65671,355円 グローバル経済コア 31,305,671,355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 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 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 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 25,790,349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 25,790,349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 25,790,349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 25,790,349円 D C 伊界経済インデックスファンド 3,694,879円 D C 世界経済インデックスファンド ( 適格機関投資家専用 ) 41,900,806,504円 F O F s 用 国内株式インデックス・ファンド ( 適格機関投資家専用 ) 41,900,806,504円 F O F s 用 国内株式インデックス・ファンド ( 適格機関投資家専用 ) 300,608,051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 ) 300,608,051円 S M T A M 9 資産アロケーションファンド ( 適格機関投資家専用 ) 346,365,787円 S M T A M 日本株式インデックスファンド ( 適格機関投資家専用 ) 347,165,716,820円	D C 世界経済インデックスファンド ( 債券シフト型 )	409,284,985円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型) 9,991,289円 SMT インデックスバランス・オープン 48,881,127円 19,763,215,485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 (株式シフト型) 216,423,849円 SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型) 37,268,650円 SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型) 37,268,650円 SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型) 37,268,650円 CP がリトイヤーファンド(15 A 対応型) 12,219,423円 217,244,401円 SBI資産設計オープン (つみたてNIS A 対応型) 1,305,671,355円 DC ターゲット・イヤーファンド 20 5 5 30,392,042円 DC ターゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2 0 3 0 53,036,145円 DC ターゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2 0 3 0 50,721,567円 DC ターゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2 0 4 0 50,721,567円 DC ターゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2 0 6 0 25,790,349円 1 0 資産分散投資ファンド 92,513,578円 3,694,879円 DC 世界経済インデックスファンド(6 資産・運用継続型)2 0 6 0 25,790,349円 1 0 可定分析のアンアンド(6 資産・運用継続型)2 0 6 0 25,790,349円 1 0 可定分析のアンアンド(6 資産・運用継続型)2 0 6 0 125,790,349円 1 0 可定が方のアンアンド(6 資産・運用継続型)2 0 6 0 125,790,349円 1 0 可定が方のアンアンアンド(6 資産・運用継続型)2 0 6 0 125,790,349円 1 0 可定が方のアンアンアンド(6 資産・運用継続型)2 0 6 0 125,790,349円 1 0 可定が方のアンアンアンド(6 資産・運用継続型)2 0 6 0 125,790,349円 1 0 可定が方のアンアンアンアンアンアンアンド(6 資産・運用継続型)2 0 6 0 125,790,349円 1 0 可定が方のアンアンアンアンアンアンアンアンド(6 資産・運用継続型)2 0 6 0 125,790,349円 1 0 可定が方のアンアンアンアンド(6 資産・運用継続型)2 0 6 0 125,790,349円 1 0 可定が方のアンアンアンアンアンアンアンアンアンアンアンアンアンアンアンアンアンアンアン	コア投資戦略ファンド(切替型)	1,219,002,091円
SMT インデックスパランス・オープン 国内株式SMT B セレクション(SMA専用) サテライト投資戦略ファンド(株式型) SMT 世界経済インデックス・オープン SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型) SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型) SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型) SMT と資産に設計オープン(のみたてNISA対応型) SB I 資産設計オープン(つみたてNISA対応型) My SMT TOPIXインデックス(ノーロード) DCターゲット・イヤー ファンド2055 コア投資戦略ファンド(積極成長型) DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060 10資産分散投資ファンド プローバル10資産パランスファンド DCサーバル10資産パランスファンド(株式特化型) 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) 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) FOFS用世界株式ファンド(適格機関投資家専用) FOFS用世界株式ファンド(適格機関投資家専用) FOFS用世界株式ファンド(適格機関投資家専用) SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) 44,439,705円 SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) 47,165,716,820円	世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	199,104,687円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用) サテライト投資戦略ファンド(株式型) SMT 世界経済インデックス・オープン SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型) SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型) SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型) SMT 世界経済インデックスパランス・オープン(16,423,849円) SMT 世界経済インデックスパランス・オープン(16,50円円) SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,991,289円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	S M T インデックスバランス・オープン	48,881,127円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型 ) 216,423,849円 SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型 ) 37,268,650円 SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型 ) 37,268,650円 SMT 8 資産インデックスパランス・オープン 12,219,423円 グローバル経済コア 217,244,401円 33,654,909円 My SMT TOPIXインデックス(ノーロード ) 1,305,671,355円 DCターゲット・イヤー ファンド2055 30,392,042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 ) 2030 50,721,567円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型 ) 2030 50,721,567円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型 ) 2050 21,386,739円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型 ) 2050 21,386,739円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型 ) 2060 25,790,349円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型 ) 2060 25,790,349円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型 ) 2060 25,790,349円 DC型界経済インデックスファンド (株式特化型 ) 92,513,578円 3,694,879円 DC世界経済インデックスファンド(6適格機関投資家専用 ) 41,900,806,504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 ) 41,900,806,504円 FOFs 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用 ) 300,608,051円 SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用 ) 314,365,776円 SMTAM日本株式インデックスファンドとL-P (適格機関投資家専用 ) 346,365,787円 SMTAM日本株式インデックスファンドとL-P (適格機関投資家専用 ) 47,165,716,820円	国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	19,763,215,485円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型) 316,423,849円 SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型) 37,268,650円 SMT 8資産インデックスバランス・オープン 12,219,423円 グローバル経済コア 217,244,401円 33,654,90円 DCターゲット・イヤー ファンド2055 30,392,042円 コア投資戦略ファンド(切替型ワイド) 1,305,671,355円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030 53,036,145円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040 50,721,567円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050 21,986,739円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050 21,986,739円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050 21,986,739円 DC型界経済インデックスファンド(6資産・運用継続型)2060 25,790,349円 0資産分散投資ファンド 92,513,578円 グローバル10資産バランスファンド(6資産・運用継続型)2060 25,790,349円 DC世界経済インデックスファンドド(適格機関投資家専用) 41,900,806,504円 FOFs用 国内株式インデックス・ファンドド(適格機関投資家専用) 41,900,806,504円 FOFs用 国内株式インデックス・ファンドド(適格機関投資家専用) 50,608,051円 50,608,051円 300,608,051円 300,608,051円 50,705円 346,365,787円 5MTAM日本株式インデックスファンド(適格機関投資家専用) 21,113,119円 346,365,787円 5MTAM日本株式インデックスファンドと・P(適格機関投資家専用) 346,365,787円 5MTAM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) 47,165,716,820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(債券シフト型) 12,219,423円 12,219,423円 グローバル経済コア 217,244,401円 SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型) 13,654,909円 My SMT TOPIXインデックス(ノーロード) 1,305,671,355円 DCターゲット・イヤー ファンド2055 30,392,042円 コア投資戦略ファンド(切替型ワイド) 964,175,269円 ロア投資戦略ファンド(積極成長型) 2030 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 53,036,145円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040 50,721,567円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040 50,721,567円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060 25,790,349円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060 25,790,349円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060 25,790,349円 DCサーバル10資産がランスファンド 3,694,879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F(適格機関投資家専用) 41,900,806,504円 FOFs用 国内株式インデックス・ファンドF(適格機関投資家専用) 494,439,705円 世界株式ファンド(適格機関投資家専用) 300,608,051円 FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用) 21,113,119円 SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) 346,365,787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) 47,165,716,820円	SMT 世界経済インデックス・オープン	52,249,858円
SMT 8資産インデックスパランス・オープン 12,219,423円 グローパル経済コア 217,244,401円 SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型) 33,654,909円 My SMT TOPIXインデックス(ノーロード) 1,305,671,355円 DCターゲット・イヤー ファンド 2055 30,392,042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) 2030 53,036,145円 DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2040 50,721,567円 DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2050 21,986,739円 DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2050 21,986,739円 DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2060 25,790,349円 DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2060 21,986,739円 DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2060 41,906,739円 DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型)2060 425,790,349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) 41,900,806,504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) 41,900,806,504円 FOFs用 国内株式インデックス・ファンド (適格機関投資家専用) 300,608,051円 FOFs用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用) 21,113,119円 SMTAM9資産アロケーションファンド (適格機関投資家専用) 346,365,787円 SMTAM9資産アロケーションファンド (適格機関投資家専用) 346,365,787円 SMTAM9年本式インデックスファンドVL-P (適格機関投資家専用) 47,165,716,820円	SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	216,423,849円
プローバル経済コア SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型) My SMT TOPIXインデックス(ノーロード) DCターゲット・イヤー ファンド2055 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 53,036,145円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040 50,721,567円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050 21,986,739円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060 25,790,349円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060 25,790,349円 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060 25,790,349円 DCサーバル10資産バランスファンド 92,513,578円 グローバル10資産バランスファンド(6項格機関投資家専用) 41,900,806,504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) 41,900,806,504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) 300,608,051円 FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用) 21,113,119円 SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) 346,365,787円 SMTAM9資産アロケーションファンドVL-P(適格機関投資家専用) 47,165,716,820円	SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	37,268,650円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型) My SMT TOPIXインデックス(ノーロード) DCターゲット・イヤー ファンド2055 コア投資戦略ファンド(切替型ワイド) コア投資戦略ファンド(積極成長型) DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050 DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060 10資産分散投資ファンド クローバル10資産パランスファンド(株式特化型) 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) 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) 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) FOFS用世界株式ファンド(適格機関投資家専用) FOFS用世界株式ファンド(適格機関投資家専用) SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) SMTAM9資産アロケーションファンドVL-P(適格機関投資家専用) 47,165,716,820円	SMT 8 資産インデックスバランス・オープン	12,219,423円
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)       1,305,671,355円         DCターゲット・イヤー ファンド2055       30,392,042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       53,036,145円         DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050       21,986,739円         DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050       21,986,739円         DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060       25,790,349円         10資産分散投資ファンド       92,513,578円         グローバル10資産バランスファンド       3,694,879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S(適格機関投資家専用)       41,900,806,504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)       494,439,705円         世界株式ファンド(適格機関投資家専用)       21,113,119円         SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)       346,365,787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)       47,165,716,820円	グローバル経済コア	217,244,401円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5 30,392,042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) 2 0 3 0 242,306,554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 53,036,145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 50,721,567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 21,986,739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 25,790,349円 1 0 資産分散投資ファンド 92,513,578円 グローバル 1 0 資産バランスファンド (株式特化型) 92,513,578円 D C 世界経済インデックスファンド (株式特化型) 2 0 6 0 20,340円 F O F s 用 国内株式インデックス・ファンド P (適格機関投資家専用) 41,900,806,504円 F O F s 用 国内株式インデックス・ファンド S (適格機関投資家専用) 494,439,705円 世界株式ファンド (適格機関投資家専用) 21,113,119円 S M T A M 9 資産アロケーションファンド (適格機関投資家専用) 346,365,787円 S M T A M 日本株式インデックスファンド V L - P (適格機関投資家専用) 47,165,716,820円	SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	33,654,909円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド) コア投資戦略ファンド(積極成長型) DCターゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2 0 3 0 DCターゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2 0 4 0 DCターゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2 0 5 0 DCターゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2 0 5 0 DCターゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2 0 6 0 1 0 資産分散投資ファンド グローバル1 0 資産パランスファンド DC世界経済インデックスファンド(株式特化型) 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) 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) EOFs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) EOFs用世界株式ファンド(適格機関投資家専用) FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用) SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) 47,165,716,820円		1,305,671,355円
コア投資戦略ファンド(積極成長型) 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 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 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 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 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 25,790,349円 1 0 資産分散投資ファンド グローバル 1 0 資産バランスファンド D C 世界経済インデックスファンド(株式特化型) F O F s 用 国内株式インデックス・ファンド P (適格機関投資家専用) F O F s 用 国内株式インデックス・ファンド S (適格機関投資家専用) 世界株式ファンド(適格機関投資家専用) E O F s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用) S M T A M 9 資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) S M T A M 9 資産アロケーションファンド V L - P (適格機関投資家専用) 47,165,716,820円	D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	30,392,042円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030 53,036,145円 D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040 50,721,567円 D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050 21,986,739円 D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060 25,790,349円 10資産分散投資ファンド 92,513,578円 グローバル10資産パランスファンド 3,694,879円 D C 世界経済インデックスファンド(株式特化型) 20,340円 F O F s 用 国内株式インデックス・ファンド P (適格機関投資家専用) 41,900,806,504円 F O F s 用 国内株式インデックス・ファンド S (適格機関投資家専用) 494,439,705円 世界株式ファンド(適格機関投資家専用) 300,608,051円 F O F s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用) 21,113,119円 S M T A M 9 資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) 346,365,787円 S M T A M H D 本株式インデックスファンド V L - P (適格機関投資家専用) 47,165,716,820円		964,175,269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 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 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 1 0 資産分散投資ファンド グローバル1 0 資産バランスファンド D C 世界経済インデックスファンド(株式特化型) F O F s 用 国内株式インデックス・ファンド P (適格機関投資家専用) F O F s 用 国内株式インデックス・ファンド S (適格機関投資家専用) 世界株式ファンド(適格機関投資家専用) F O F s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用) S M T A M 9 資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) S M T A M 日本株式インデックスファンド V L - P (適格機関投資家専用) 47,165,716,820円		242,306,554円
D C ターゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)205021,986,739円D C ターゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)206025,790,349円1 0 資産分散投資ファンド92,513,578円グローバル10 資産バランスファンド3,694,879円D C 世界経済インデックスファンド(株式特化型)20,340円F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)41,900,806,504円F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)494,439,705円世界株式ファンド(適格機関投資家専用)300,608,051円F O F s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)21,113,119円S M T A M 9 資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)346,365,787円S M T A M 日本株式インデックスファンド V L - P (適格機関投資家専用)47,165,716,820円		53,036,145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 25,790,349円 1 0 資産分散投資ファンド 92,513,578円 グローバル 1 0 資産バランスファンド 3,694,879円 D C 世界経済インデックスファンド(株式特化型) 20,340円 F O F s 用 国内株式インデックス・ファンド P (適格機関投資家専用) 41,900,806,504円 F O F s 用 国内株式インデックス・ファンド S (適格機関投資家専用) 494,439,705円 世界株式ファンド(適格機関投資家専用) 300,608,051円 F O F s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用) 21,113,119円 S M T A M 9 資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) 346,365,787円 S M T A M 日本株式インデックスファンド V L - P (適格機関投資家専用) 47,165,716,820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	50,721,567円
1 0 資産分散投資ファンド グローバル1 0 資産バランスファンド D C 世界経済インデックスファンド (株式特化型) F O F s 用 国内株式インデックス・ファンド P (適格機関投資家専用) F O F s 用 国内株式インデックス・ファンド S (適格機関投資家専用) 世界株式ファンド (適格機関投資家専用) F O F s 用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用) S M T A M 9 資産アロケーションファンド (適格機関投資家専用) S M T A M 日本株式インデックスファンド V L - P (適格機関投資家専用) 492,513,578円 3,694,879円 20,340円 41,900,806,504円 494,439,705円 300,608,051円 21,113,119円 346,365,787円 346,365,787円 47,165,716,820円	D C ターゲット・イヤーファンド(6 資産・運用継続型)2050	21,986,739円
グローバル10資産バランスファンド3,694,879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)41,900,806,504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)494,439,705円世界株式ファンド(適格機関投資家専用)300,608,051円FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)21,113,119円SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)346,365,787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)47,165,716,820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	25,790,349円
D C 世界経済インデックスファンド (株式特化型)20,340円F O F s 用 国内株式インデックス・ファンド P (適格機関投資家専用)41,900,806,504円F O F s 用 国内株式インデックス・ファンド S (適格機関投資家専用)494,439,705円世界株式ファンド (適格機関投資家専用)300,608,051円F O F s 用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)21,113,119円S M T A M 9 資産アロケーションファンド (適格機関投資家専用)346,365,787円S M T A M 日本株式インデックスファンド V L - P (適格機関投資家専用)47,165,716,820円	10資産分散投資ファンド	
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)41,900,806,504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)494,439,705円世界株式ファンド(適格機関投資家専用)300,608,051円FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)21,113,119円SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)346,365,787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)47,165,716,820円	グローバル10資産バランスファンド	3,694,879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)494,439,705円世界株式ファンド(適格機関投資家専用)300,608,051円FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)21,113,119円SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)346,365,787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)47,165,716,820円		20,340円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用) 300,608,051円 FOFS用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用) 21,113,119円 SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) 346,365,787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) 47,165,716,820円		1
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)21,113,119円SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)346,365,787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)47,165,716,820円		
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)346,365,787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)47,165,716,820円	世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	300,608,051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) 47,165,716,820円	FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	
		346,365,787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)	47,165,716,820円
	私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	17,688,069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) 213,977,148円	ファンドラップ運用戦略 F (中庸型) (適格機関投資家専用)	213,977,148円

# (デリバティブ取引に関する注記)

# 株式関連

(2023年12月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価	評価損益
<u></u> △刀		关约领守(口)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引	株価指数先物取引				

	買建	4,070,806,000	-	4,086,390,000	15,584,000
É	合計	4,070,806,000	-	4,086,390,000	15,584,000

# (注)1.時価の算定方法

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

- 2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
- 3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。 上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

# 国内債券インデックス マザーファンド

# 貸借対照表

	2023年12月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	369,531,885
国債証券	542,471,807,850
地方債証券	32,579,641,142
特殊債券	36,936,051,864
社債券	29,421,111,000
未収入金	527,645,000
未収利息	1,480,794,071
前払費用	65,888,199
流動資産合計	643,852,471,011
資産合計	643,852,471,011
負債の部	
流動負債	
未払金	300,000,000
未払解約金	372,481,591
未払利息	121
流動負債合計	672,481,712
負債合計	672,481,712
純資産の部	
元本等	
元本	483,501,933,016
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	159,678,056,283
元本等合計	643,179,989,299
純資産合計	643,179,989,299
負債純資産合計	643,852,471,011

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

(主女の女司刀列にかる事項には)	
	2023年12月12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

2023年12月12日現在
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12月12日現在	生
1 .	計算期間の末日における受益権の総数		483,501,933,016口
2 .		先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保 あります。	に供している資産は次の通りで
		有価証券	99,450,000円
3 .		1口当たり純資産額	1.3303円
	の額	(1万口当たり純資産額)	(13,303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12月12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

元本の移動	
区分	2023年12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 6月13日
期首元本額	469,662,622,453円
期中追加設定元本額	28,503,854,553円
期中一部解約元本額	14,664,543,990円
期末元本額	483,501,933,016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
SBI資産設計オープン(資産成長型)	5,309,662,871円
SBI資産設計オープン(分配型)	17,577,989円
SMT 国内債券インデックス・オープン	17,647,048,900円
世界経済インデックスファンド	6,299,960,973円
DCマイセレクション25	28,510,632,321円
DCマイセレクション50	34,581,997,922円
DCマイセレクション75	10,941,894,285円
D C 日本債券インデックス・オープン	407,983,690円
D C 日本債券インデックス・オープン S	89,547,491,817円
D C 日本債券インデックス・オープン P	63,624,203,542円
D C マイセレクション S 2 5	16,492,884,518円
DCマイセレクションS50	19,295,076,435円
DCマイセレクションS75	4,856,008,269円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	476,339,781円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	2,795,608,418円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	1,110,575,691円
D C 世界経済インデックスファンド	4,556,662,782円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,110,023円

	半期報告書(内国投資信託
区分	2023年12月12日現在
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	19,928,786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)	56,713,843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)	27,937,740円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	21,798,088円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,137,163,361円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	723,770,883円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,085,055,693円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	65,293,196円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	50,129,910円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	900,839,436円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	991,530,225円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,330,725,891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	18,672,026,732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)	292,020,218円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型 )	1,817,909,413円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	94,078,309円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	44,572,258円
SMT インデックスバランス・オープン	70,397,231円
SMT 世界経済インデックス・オープン	47,395,739円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	105,194,349円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	167,548,796円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	16,668,017円
グローバル経済コア	238,680,550円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	42,859,999円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	33,998,823円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	131,961,890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	73,750,145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	21,967,384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	15,262,917円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	692,172,477円
10資産分散投資ファンド	322,433,444円
グローバル 1 0 資産バランスファンド	46,558,409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)	93,933,752,584円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	38,563,750円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	15,882,236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)	469,103,619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。

外国株式インデックス マザーファンド

# 貸借対照表

	2023年12月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	6,407,330,098
コール・ローン	403,541,864
株式	604,641,688,346
投資信託受益証券	120,033,193
投資証券	12,229,906,217
派生商品評価勘定	713,093,023

Ţ <b>-</b>	
	2023年12月12日現在
項目	金額(円)
未収入金	17,575,004
未収配当金	813,173,371
差入委託証拠金	4,863,037,843
流動資産合計	630,209,378,959
資産合計	630,209,378,959
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,290,851
前受金	710,828,224
未払解約金	334,782,261
未払利息	132
流動負債合計	1,047,901,468
負債合計	1,047,901,468
純資産の部	
元本等	
元本	116,361,852,442
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	512,799,625,049
元本等合計	629,161,477,491
純資産合計	629,161,477,491
負債純資産合計	630,209,378,959

# 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関す	る注記)
	2023年12月12日現在
	(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。
	(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。
	(3)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。
	(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。
	(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。
	(2)為替予約取引

	十期報告書(內国投資信司
	2023年12月12日現在
	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、当該先物取引及び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。
	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当 金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該 収益分配金額を計上しております。
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

			2023年12月12日現在	
1.	計算期間の末日における受益権の総数			116,361,852,442 🗆
2 .		1口当たり純資産額		5.4069円
	の額	(1万口当たり純資産額)		(54,069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

立殿的中の時間寺に関する事項	
	2023年12月12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。
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

<u>/U-+// E//</u>	
区分	2023年12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 6月13日
期首元本額	121,623,869,603円

	半期報告書(内国投資信託
区分	2023年12月12日現在
期中追加設定元本額	7,170,401,629円
期中一部解約元本額	12,432,418,790円
期末元本額	116,361,852,442円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,566,587,947円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,013,265円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	34,633,438,356円
世界経済インデックスファンド	13,072,459,041円
外国株式インデックス・オープン	881,899,418円
D C マイセレクション 2 5	637,318,125円
D C マイセレクション 5 0	3,467,005,779円
D C マイセレクション 7 5	4,333,494,667円
D C 外国株式インデックス・オープン	12,728,162,089円
D C マイセレクション S 2 5	402,274,277円
DCマイセレクションS50	1,903,366,162円
D C マイセレクション S 7 5	1,918,345,959円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	20,738,851円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	140,789,494円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	110,416,025円
D C 世界経済インデックスファンド	9,530,800,188円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	991,827,202円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	1,991,576円
マイセレクション 7 5 VA 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VA1(適格機関投資家専用)	21,884,538円
バランス30 V A 1 (適格機関投資家専用)	7,064,750円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	33,182,785円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	7,257,873円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	19,430,905円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	158,381,100円
バランスB(37.5) V A 1 (適格機関投資家専用)	130,907,963円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	985,423,242円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	67,523,430円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	16,962,785円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	113,355,013円
バランス E ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	36,711,759円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	787,426,934円
FOFs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	841,316,544円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,180,201,332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)	307,825,343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)	1,487,556,744円
D C 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	1,020,135,019円
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)	484,318,178円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	25,198,590円
SMT インデックスバランス・オープン	121,842,892円
サテライト投資戦略ファンド (株式型)	77,417,800円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	5,125,761,114円
SMT 世界経済インデックス・オープン	254,768,685円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	1,029,029,755円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	180,349,089円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,518,864円
My SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	1,300,038,742円
グローバル経済コア	535,597,594円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	15,241,396円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,903,687円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	124,430,320円
コア投資戦略ファンド(切貨型ワイド)  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	144,110,176円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	137,038,605円

	干期報古書(內国投資信託)
区分	2023年12月12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	60,117,663円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	70,159,261円
10資産分散投資ファンド	51,253,414円
グローバル10資産バランスファンド	1,680,628円
D C 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)	57,816,046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)	202,316,358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)	624,662,280円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,442,050,540円
FOFS用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	100,097,232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)	85,769,080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)	82,692,653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12月12日現在)

区分		却约宛笑(田)		時価	評価損益
	作里大只	契約額等(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	11,398,146,275	-	12,108,974,499	710,828,224
	合計	11,398,146,275	-	12,108,974,499	710,828,224

# (注)1.時価の算定方法

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

# 通貨関連

(2023年12月12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	為替予約取引				
の取引	買建	34,875,750	-	34,874,973	777
	スイスフラン	34,875,750	-	34,874,973	777
	- - 売建	7,267,500	-	7,292,775	25,275
	アメリカドル	7,267,500	-	7,292,775	25,275
	合計	42,143,250	-	42,167,748	26,052

# (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

# 貸借対照表

	2023年12月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	795,258,853
コール・ローン	1,860,964,890
国債証券	293,494,516,895
派生商品評価勘定	4,736,585
未収入金	1,263,227,858
未収利息	1,853,264,005
前払費用	176,695,808
差入委託証拠金	229,873,723
流動資産合計	299,678,538,617
資産合計	299,678,538,617
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,400,446
前受金	2,610,920
未払金	24,720,036
未払解約金	1,700,820,482
未払利息	612
流動負債合計	1,760,552,496
負債合計	1,760,552,496
純資産の部	
元本等	
元本	88,790,449,328
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	209,127,536,793
元本等合計	297,917,986,121
純資産合計	297,917,986,121
負債純資産合計	299,678,538,617

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

(主女な女司刀列にぶる事項に関す	· 8/工印 /
	2023年12月12日現在
	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。
	(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。 (2)為替予約取引

	2023年12月12日現在
	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、当該先物取引及び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)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12月12日現在	
1.	計算期間の末日における受益権の総数			88,790,449,328□
2 .		1口当たり純資産額		3.3553円
	の額	(1万口当たり純資産額)		(33,553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

金融商品の時価寺に関する事項	
	2023年12月12日現在
	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。
	(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。
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

元本の移動	
区分	2023年12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 6月13日
期首元本額	85,391,300,001円
期中追加設定元本額	7,337,343,622円
期中一部解約元本額	3,938,194,295円
期末元本額	88,790,449,328円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	1,147,985,996円

	半期報告書(内国投資信託到
区分	2023年12月12日現在
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	519,264,658円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	338,394,891円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,450,390,264円
SBI資産設計オープン(分配型)	9,204,018円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,658,855,597円
世界経済インデックスファンド	19,037,694,390円
D C マイセレクション 2 5	1,957,695,313円
DCマイセレクション50	1,763,107,704円
D C マイセレクション 7 5	1,364,806,010円
D C 外国債券インデックス・オープン	2,247,837,805円
DCマイセレクションS25	1,054,442,146円
DCマイセレクションS50	964,658,265円
DCマイセレクションS75	539,015,390円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	16,201,873円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	100,089,017円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	53,947,127円
D C 世界経済インデックスファンド	13,861,768,273円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	654,549,323円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	1,028,294円
マイセレクション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)	15,962,521円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	26,499,579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)	55,393,147円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	49,400,636円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	840,604,571円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	380,885,156円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,543,456,886円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	53,944,503円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	31,626,708円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	360,286,145円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	131,598,706円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	179,772,106円
FOFS用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	640,853,306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)	1,501,285,321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	780,952,333円
分散投資コア戦略ファンドA	518,368,608円
分散投資コア戦略ファンドS	1,368,649,263円
D C 世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	706,693,230円
D C 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	4,421,708,890円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	230,972,590円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	108,280,828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)	1,314,500,927円
SMT インデックスバランス・オープン	172,978,948円
SMT 世界経済インデックス・オープン	369,083,603円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	490,038,943円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	780,624,876円
SMT 8 資産インデックスバランス・オープン	7,798,352円
グローバル経済コア	792,400,744円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	21,482,472円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,563,416円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	53,802,918円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	72,555,672円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	36,036,298円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	46,047,071円
My SMT グローバル債券インデックス(ノーロード)	409,619,187円
10資産分散投資ファンド	26,021,747円
グローバル10資産バランスファンド	2,641,426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)	12,333,440,514円
FOFS用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	182,915,003円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	49,614,561円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	124,240,576円
07/00	'

区分	2023年12月12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)	129,977,670円

# (デリバティブ取引に関する注記)

### 債券関連

(2023年12月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)	まりからる空(TT)		評価損益
四	作里大块	!	うち1年超	(円)	(円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	1,373,535,630	-	1,376,146,550	2,610,920
	合計	1,373,535,630	-	1,376,146,550	2,610,920

### (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はありません。

# 通貨関連

(2023年12月12日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価	評価損益
区刀	↑ <b>1</b>	关约领守(口)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外	為替予約取引				
の取引	買建	1,468,161,650	-	1,442,903,233	25,258,417
	アメリカドル	719,474,835	-	711,535,720	7,939,115
	カナダドル	60,718,849	-	60,172,336	546,513
	ユーロ	469,555,973	-	456,700,929	12,855,044
	イギリスポンド	87,575,970	-	86,087,033	1,488,937
	オフショア人民元	130,836,023	-	128,407,215	2,428,808
	売建	1,509,265,565	-	1,514,281,929	5,016,364
	アメリカドル	734,017,500	-	736,570,275	2,552,775
	カナダドル	32,095,800	-	32,245,050	149,250
	メキシコペソ	13,685,931	-	13,719,775	33,844
	ユーロ	493,999,212	-	495,430,773	1,431,561
	イギリスポンド	76,254,904	-	76,586,503	331,599
	ポーランドズロチ	10,859,478	-	10,897,373	37,895
	オーストラリアド ル	23,888,250	-	23,956,925	68,675
	イスラエルシェケ ル	3,962,230	-	3,958,775	3,455
	オフショア人民元	120,502,260	-	120,916,480	414,220
	合計	2,977,427,215	-	2,957,185,162	30,274,781

# (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12月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,805,529,255
コール・ローン	126,682,509
株式	158,067,404,853
投資信託受益証券	493,438,176
投資証券	178,131,919
派生商品評価勘定	118,758,063
未収配当金	183,616,432
差入委託証拠金	1,244,874,711
流動資産合計	163,218,435,918
資産合計	163,218,435,918
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,910,380
前受金	105,674,743
未払解約金	69,261,064
未払利息	41
流動負債合計	187,846,228
負債合計	187,846,228
純資産の部	
元本等	
元本	42,227,040,517
剰余金	
剰余金又は欠損金()	120,803,549,173
元本等合計	163,030,589,690
純資産合計	163,030,589,690
負債純資産合計	163,218,435,918

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

(里安な会計力針に係る事項に関す	<u> </u>
	2023年12月12日現在
	(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。
	(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。
	(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。

	2023年12月12日現在
	(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。
	(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。
	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。
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。
	(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当 金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該 収益分配金額を計上しております。
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

# (貸借対照表に関する注記)

		2023年12月12日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	42,227,040,517 <sub>[</sub>
2 .		1口当たり純資産額 3.8608円
	の額	(1万口当たり純資産額) (38,608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12月12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。
	(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。
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)

	_~	T/2	エエ
T /	本の	) 太子,	由川
ノレ~	ナヘンノ	ソコン	玉刀

<u>元本の移動</u> 区分	2023年12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 6月13日
期首元本額	42,049,511,619円
期中追加設定元本額	3,368,778,364円
期中一部解約元本額	3,191,249,466円
期末元本額	42,227,040,517円
 期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,693,397,797円
世界経済インデックスファンド	10,088,645,547円
D C 新興国株式インデックス・オープン	6,084,047,407円
D C 世界経済インデックスファンド	7,318,626,899円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	91,709,620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)	1,173,989,799円
D C 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	787,965,151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)	380,074,972円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	19,277,936円
SMT インデックスバランス・オープン	93,309,337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SMTBセレクション(SMA専用)	2,322,850,351円
SMT 世界経済インデックス・オープン	243,907,024円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	1,025,126,510円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	174,010,835円
SMT 8 資産インデックスバランス・オープン	6,807,662円
グローバル経済コア	417,942,770円
My SMT 新興国株式インデックス(ノーロード)	242,981,568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
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	96,821,941円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	92,077,823円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	40,395,872円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	47,153,651円
10資産分散投資ファンド	13,095,775円
グローバル10資産バランスファンド	2,275,187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)	1,447,737,517円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	96,978,334円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	81,664,101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)	12,403,948円
FOFs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)	25,767,251円

# (デリバティブ取引に関する注記)

# 株式関連

(2023年12月12日現在)

区公	種類	却4万克百年(四)	‡11.45.25.25 / FT \		評価損益
区分	作里天只	契約額等(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,328,778,203	-	4,434,452,946	105,674,743
	合計	4,328,778,203	-	4,434,452,946	105,674,743

(注)1.時価の算定方法

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

### 通貨関連

(2023年12月12日現在)

区分	区八 连辑	±刀-40-5克-4年(□□)		時価	評価損益
区刀	種類	契約額等(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外	為替予約取引				
の取引	買建	205,457,100	-	205,630,040	172,940
	アメリカドル	205,457,100	-	205,630,040	172,940
	合計	205,457,100	-	205,630,040	172,940

### (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。

### 新興国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2023年12月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,229,796,899
コール・ローン	349,490,780
国債証券	120,131,016,676
未収利息	1,751,860,289
前払費用	205,511,857
流動資産合計	123,667,676,501
資産合計	123,667,676,501
負債の部	
流動負債	
未払金	279,577,145
未払解約金	63,801,539
未払利息	114
流動負債合計	343,378,798
負債合計	343,378,798
純資産の部	
元本等	
元本	57,392,149,241
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	65,932,148,462
元本等合計	123,324,297,703
純資産合計	123,324,297,703
負債純資産合計	123,667,676,501

# 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年12月12日現在
	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。
	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。
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。
	 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12月12日現在	
1.	計算期間の末日における受益権の総数		57,392,149,241 🗆
2 .		1口当たり純資産額	2.1488円
	の額	(1万口当たり純資産額)	(21,488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

<u> </u>		
	2023年12月12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。	
	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。	

# <u>(重要な後発事象に関する注記)</u> 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12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 6月13日
期首元本額	52,846,131,448円
期中追加設定元本額	5,650,780,004円
期中一部解約元本額	1,104,762,211円
期末元本額	57,392,149,241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	5,213,325,197円
世界経済インデックスファンド	19,631,674,514円
D C 新興国債券インデックス・オープン	5,855,753,163円
D C 世界経済インデックスファンド	14,341,424,814円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	8,848,639円

	干期報古書(內国投資活式)
区分	2023年12月12日現在
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
D C 世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	729,159,571円
D C 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	4,568,778,182円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	239,782,374円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	112,013,374円
SMT インデックスバランス・オープン	179,640,697円
SMT 世界経済インデックス・オープン	474,619,374円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	629,368,971円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	1,002,448,377円
SMT 8 資産インデックスバランス・オープン	13,259,375円
グローバル経済コア	820,634,837円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	94,115,518円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	80,147,497円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	33,329,037円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	37,200,111円
My SMT 新興国債券インデックス (ノーロード)	162,791,164円
10資産分散投資ファンド	42,621,612円
グローバル10資産バランスファンド	4,123,156円
FOFS用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	238,136,903円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	160,113,123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)	22,566,940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。

### 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 3月12日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

### 5【委託会社等の経理状況】

(1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社(以下「委託者」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)により作成しております。 また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令、(平成19年内閣府令第52号)とより作成しております。

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

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 (2022年3月	年度 331日)	当事 (2023年	業年度 3月31日)
資産の部	(2022   0)	<u> </u>	(2020	<u> </u>
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 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
ー 固定資産合計		20,482		18,972
資産合計		77,629		77,179
_				

前事業年度 (2022年3月31日) (2023年3月31日) (2023年3月31			(単位:百万円)
(新動負債		前事業年度 ( 2022年3月31日 )	当事業年度 ( 2023年3日31日 )
預り金	負債の部	(2022—0/301日)	(2020-0/10111)
来払金     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       来払費用     1,049     1,088       未払済人税等     504     726       費与引出金     578     613       その他     1,958     303       流動負債合計     12,423     9,958       固定負債     820     904       資産協会債務     153     153       その他     12     27       固定負債合計     986     1,086       負債合計     13,410     11,044       純資産の部     17,239     17,239       資本輸完金     2,000     2,000       資本剩余金     17,239     17,239       利益率備金     500     500       その他利益剩余金     1,046     44,755       利益網介金合計     41,948     44,755       利益網介金合計     44,548     47,355       株主資本合計     63,788     66,595       評価・投資差額等     509     510       評価・投資差額等     431     460       統資在合計     431     460       統資在合計     64,219     66,134	流動負債		
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         573         613           その他         1,958         303           流動負債合計         12,423         9,958           固定負債         300         904           資産除去債務         153         153           その他         12         27           固定負債合計         986         1,086           負債合計         13,410         11,044           純資産の部         2,000         2,000           資本制余金         2,000         2,000           資本制余金合計         17,239         17,239           利益剰余金         17,239         17,239           利益剰余金合計         17,239         17,239           利益期余金         2,100         2,100           緑超利会金         2,100         2,100           緑超利会金         2,100         2,100           緑超利余金合計         41,948         44,755           利益剩余金合計         44,548         47,355           株主資本合計 <td>預り金</td> <td>47</td> <td>49</td>	預り金	47	49
未払手数料     4,561     4,586       その他末払金     3,723     2,588       末払費用     1,049     1,089       未払法人税等     504     726       賞与引当金     578     613       その他     1,958     303       流動負債合計     12,423     9,958       固定負債     820     904       資産除去債務     153     153       その他     12     27       固定負債合計     986     1,086       負債合計     13,410     11,044       純資産の部     4     1,086       株主資本     2,000     2,000       資本剩余金合計     17,239     17,239       資本剩余金合計     17,239     17,239       利益財余金     17,239     17,239       利益準備金     500     500       その他利益剥余金合計     41,948     44,755       利益剛余金合計     44,548     47,355       株主資本合計     44,548     47,355       株主資本合計     44,548     47,355       株主資本合計     44,548     47,355       評価・投算差額等     40     49       場域     40     49       銀延へッジ損益     509     510       評価・投算差額等合計     431     460       純資産計     431     460       純資産計     431 <t< td=""><td>未払金</td><td>8,285</td><td>7,174</td></t<>	未払金	8,285	7,174
その他未払金     3,723     2,588       末払強用     1,049     1,089       末払法人税等     504     726       買与引当金     578     613       その他     1,958     303       流動負債合計     12,423     9,958       固定負債     303     153       資産除去債務     153     153       その他     12     27       固定負債合計     986     1,086       負債合計     13,410     11,044       純資産の部     株主資本       株主資本     2,000     2,000       資本剩余金     17,239     17,239       資本剩余金合計     17,239     17,239       利益準備金     500     500       その他利益剩余金     11,948     44,755       利益申傭金合計     41,948     44,755       利益申余合計     44,548     47,355       株主資本合計     63,788     66,595       評価・換算差額等     941     49       緑延へッジ損益     509     510       評価・換算差額等合計     431     460       純資産合計     66,134	未払収益分配金	0	0
未払費用     1,049     1,089       未払法人税等     504     726       買与引当金     578     613       その他     1,958     303       流動負債合計     12,423     9,958       固定負債     820     904       資産除法債務     153     153       その他     12     27       固定負債合計     986     1,086       負債合計     13,410     11,044       純資産の部 株主資本     2,000     2,000       資本剩余金     17,239     17,239       利益剩余金合計     17,239     17,239       利益剩余金合計     17,239     17,239       利益剩余金合計     17,239     17,239       利益剩余金合計     44,735     14,248     44,755       利益剩余金合計     44,548     47,355       株主資本合計     66,595     50       評価・換棄差額等     44,548     47,355       千の他有価証券評価差額金     941     49       線延へッジ損益     509     510       評価・換算差額等合計     431     460       純資産合計     64,219     66,134	未払手数料	4,561	4,586
未払法人税等 買与引当金     504     726 目38       その他     1,958     303 流動負債合計     12,423     9,958       固定負債 退職給付引当金 資産除去債務     820     904 到2     27       固定負債合計     153     153     153       その他     12     27       固定負債合計     986     1,086       負債合計     13,410     11,044       純資産の部 株主資本 資本働余金     2,000     2,000       資本剩余金 資本剩余金合計     17,239     17,239       利益剩余金合計     17,239     17,239       利益剩余金合計     17,239     17,239       利益剩余金合計     41,948     44,755       利益剩余金合計     44,548     47,355       株主資本合計     44,548     47,355       株主資本合計     66,595       評価・換賣差額等     941     49       繰延へッジ損益     509     510       評価・換算差額等合計     431     460       純資産合計     64,219     66,134	その他未払金	3,723	2,588
賞与引当金     578     613       その他     1,958     303       流動負債合計     12,423     9,958       固定負債     820     904       資産除去債務     153     153       その他     12     27       固定負債合計     986     1,086       負債合計     13,410     11,044       純資産の部 株主資本 資本金     2,000     2,000       資本剰余金     17,239     17,239       資本剰余金合計     17,239     17,239       利益剰余金合計     17,239     17,239       利益業備金     500     500       その他利益剩余金     41,948     44,755       利益剩余金合計     44,548     44,755       利益剩余金合計     44,548     47,356       株主資本合計     63,788     66,595       評価・換算差額等     941     49       繰延へッジ損益     509     510       評価・換算差額等合計     431     460       純資産合計     64,219     66,134	未払費用	1,049	1,089
その他     1,958     303       流動負債合計     12,423     9,958       固定負債     820     904       資産除去債務     153     153       その他     12     27       固定負債合計     986     1,086       負債合計     13,410     11,044       純資産の部 株主資本 資本金     2,000     2,000       資本剰余金     17,239     17,239       資本剩余金合計     17,239     17,239       資本剩余金合計     17,239     17,239       利益剩余金     500     500       その他利益剩余金     2,100     2,100       燥越利益剩余金     41,948     44,755       利益剩余金合計     44,548     47,355       株主資本合計     63,788     66,595       評価・換算差額等     941     49       保延ヘッジ損益     509     510       評価・換算差額等合計     431     460       純資産合計     64,219     66,134	未払法人税等	504	726
流動負債合計 12,423 9,958 固定負債 退職給付引当金 820 904 資産除去債務 153 153 その他 12 27 固定負債合計 986 1,086 負債合計 13,410 11,044  ・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・	賞与引当金	578	613
国定負債	その他	1,958	303
退職給付引当金 資産除去債務		12,423	9,958
資産除去債務 その他153153その他1227固定負債合計9861,086負債合計13,41011,044再資産の部 株主資本 資本量余金 資本剰余金 者本剰余金合計 利益剰余金 利益剰余金 利益単備金 その他利益剩余金 別途積立金 泉遊利益剰余金 別途積立金 保越利益剩余金合計 利益剰余金合計 利益則余金合計 イ7,239 利益則余金合計 利益則余金合計 イ7,239 	固定負債		
その他     12     27       固定負債合計     986     1,086       負債合計     13,410     11,044       神漢産の部       株主資本 資本金 資本剰余金 資本剰余金     2,000     2,000       資本剩余金     17,239     17,239       資本剩余金合計     17,239     17,239       利益剩余金 股別益準備金     500     500       その他利益剩余金 別途積立金     2,100     2,100       繰越利益剩余金合計     44,755       利益剩余金合計     44,548     47,355       株主資本合計     63,788     66,595       評価・換算差額等     941     49       繰延ヘッジ損益     509     510       評価・換算差額等合計     431     460       純資産合計     64,219     66,134	退職給付引当金	820	904
固定負債合計9861,086負債合計13,41011,044屯資産の部株主資本 資本金 資本和余金 資本剰余金 資本剩余金合計 利益剩余金合計 利益車構金 その他利益剰余金 別途積立金 規越利益剩余金 利益剩余金 別途積立金 保越利益剩余金 利益剩余金合計 利益剩余金合計 利益剩余金合計 	資産除去債務	153	153
負債合計     13,410     11,044       屯資産の部株主資本     2,000     2,000       資本金     2,000     2,000       資本剩余金     17,239     17,239       資本剩余金合計     17,239     17,239       利益剩余金     500     500       その他利益剩余金     2,100     2,100       繰越利益剩余金     41,948     44,755       利益剩余金合計     44,548     47,355       株主資本合計     63,788     66,595       評価・換算差額等     941     49       繰延へッジ損益     509     510       評価・換算差額等合計     431     460       純資産合計     64,219     66,134	その他	12	27
・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・	 固定負債合計	986	1,086
株主資本資本金2,000資本剰余金17,239資本剰余金合計17,239利益剰余金17,239利益準備金500500その他利益剰余金2,1002,100燥越利益剰余金41,94844,755利益剰余金合計44,54847,355株主資本合計63,78866,595評価・換算差額等94149繰延ヘッジ損益509510評価・換算差額等合計431460純資産合計64,21966,134	負債合計	13,410	11,044
株主資本 資本金 資本剰余金 その他資本剰余金 	純資産の部		
資本剰余金17,23917,239資本剰余金合計17,23917,239利益剰余金500500その他利益剰余金2,1002,100繰越利益剰余金41,94844,755利益剰余金合計44,54847,355株主資本合計63,78866,595評価・換算差額等94149繰延ヘッジ損益509510評価・換算差額等合計431460純資産合計64,21966,134	株主資本		
資本剰余金17,23917,239資本剰余金合計17,23917,239利益剰余金500500その他利益剰余金2,1002,100燥越利益剰余金41,94844,755利益剰余金合計44,54847,355株主資本合計63,78866,595評価・換算差額等94149繰延ヘッジ損益509510評価・換算差額等合計431460純資産合計64,21966,134	資本金	2,000	2,000
その他資本剰余金 資本剰余金合計17,23917,239利益剰余金 利益準備金 その他利益剰余金 別途積立金 燥越利益剰余金 別途積立金 操越利益剰余金合計 株主資本合計 株主資本合計 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2,100 44,548 44,755 63,788 509 510 509 510 66,134純資産合計431 460 66,134	資本剰余金		
資本剰余金合計17,23917,239利益剰余金500500その他利益剰余金2,1002,100繰越利益剰余金41,94844,755利益剰余金合計44,54847,355株主資本合計63,78866,595評価・換算差額等94149繰延ヘッジ損益509510評価・換算差額等合計431460純資産合計64,21966,134		17,239	17,239
利益剰余金 利益準備金 500 500 その他利益剰余金 別途積立金 2,100 2,100 繰越利益剰余金 41,948 44,755 利益剰余金合計 44,548 47,355 株主資本合計 63,788 66,595 評価・換算差額等 その他有価証券評価差額金 941 49 繰延ヘッジ損益 509 510 評価・換算差額等合計 431 460 純資産合計 64,219 66,134			
利益準備金 その他利益剰余金500500別途積立金 繰越利益剰余金 利益剰余金合計 株主資本合計 株主資本合計 株主資本合計 株主資本合計 株主資本合計 株主資本合計 株主資本合計 毎3,788 第個・換算差額等 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 契 40941 49 510 510 66,134純資産合計431 66,134		·	, , , , , , , , , , , , , , , , , , ,
その他利益剰余金別途積立金2,100繰越利益剰余金41,948利益剰余金合計44,548株主資本合計63,78866,595評価・換算差額等941その他有価証券評価差額金941繰延ヘッジ損益509評価・換算差額等合計431純資産合計66,134		500	500
別途積立金 繰越利益剰余金2,1002,100科益剰余金合計41,94844,755株主資本合計63,78866,595評価・換算差額等 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94149経延へッジ損益 評価・換算差額等合計509510評価・換算差額等合計431460純資産合計66,134			
繰越利益剰余金41,94844,755利益剰余金合計44,54847,355株主資本合計63,78866,595評価・換算差額等94149繰延ヘッジ損益509510評価・換算差額等合計431460純資産合計64,21966,134		2,100	2,100
利益剰余金合計44,54847,355株主資本合計63,78866,595評価・換算差額等その他有価証券評価差額金94149繰延ヘッジ損益509510評価・換算差額等合計431460純資産合計64,21966,134			
株主資本合計63,78866,595評価・換算差額等94149繰延ヘッジ損益509510評価・換算差額等合計431460純資産合計64,21966,134			
評価・換算差額等94149繰延ヘッジ損益509510評価・換算差額等合計431460純資産合計64,21966,134			
その他有価証券評価差額金94149繰延ヘッジ損益509510評価・換算差額等合計431460純資産合計64,21966,134	<del>-</del>		·
繰延ヘッジ損益509510評価・換算差額等合計431460純資産合計64,21966,134		941	49
評価・換算差額等合計431460純資産合計64,21966,134			
純資産合計 64,219 66,134			
	_		
	_		

# (2)【損益計算書】

(単位:百万円)

		(単位:日万円)
	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)
	至 2022年3月31日 )	主 2020年0月01日 )
委託者報酬	41,730	40,724
運用受託報酬	11,883	10,918
その他営業収益	390	351
営業収益合計	54,004	51,993
営業費用		
支払手数料	20,567	20,123
広告宣伝費	286	307
公告費	-	2
調査費	5,567	5,309
調査費	1,062	1,104
委託調査費	4,487	4,191
図書費	17	13
営業雑経費	5,201	5,842
通信費	68	77
印刷費	454	419
協会費	55	58
諸会費	35	38
情報機器関連費	4,473	5,153
その他営業雑経費	112	94
営業費用合計	31,622	31,585
一般管理費		
給料	6,295	6,451
役員報酬	249	318
給料・手当	5,072	5,144
賞与	972	987
退職給付費用	254	252
福利費	632	671
交際費	3	7
旅費交通費	20	122
租税公課	327	289
不動産賃借料	323	327
寄付金	5	-
減価償却費	989	1,698
業務委託費	1,081	1,277
諸経費	1,301	1,454
一般管理費合計	11,234	12,553
営業利益	11,147	7,854

(単位:百万円)

		(半位、日八〇)
	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
三 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
退職給付費用	120	-
	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
<del>-</del>		

# (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			
	貝쑤並	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	-	ı	-		
当期末残高	2,000	17,239	17,239		

		利益	剰余金			
	-11111H	その他利	益剰余金	利益剰全全	株主資本合計	
	利益準備金	別途積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098	
当期変動額						
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797	
当期純利益			6,487	6,487	6,487	
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)						
当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689	
当期末残高	500	2.100	41.948	44.548	63.788	

		評価・換算差額等			
	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	純資産合計	
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)

	資本金	資本乗	余金
	貝쑤並	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

**灶**十次末

	株主資本					
		利益	剰余金			
		その他利	益剰余金	제츴剰全全	   株主資本合計	
	利益準備金	別途積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	小工关节目目	
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				
	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	純資産合計		
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)子会社株は「トス原係はにトラス

(1)子会在株式 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。)

(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。

- 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。 ・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。

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 : 発生事業年度の発生時の経営場の変われる数数期間中の 第90年数(40年)による実施

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 数理計算上の差異

古事業年度の先生時の従業員の平均な行動が新聞的の一定の年数(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 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

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職 務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

. 収益及び費用の計上基準

外温(人) (1973年) - 12年年 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

×呉、は来初 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 ます。当該収益は、 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

(2) へいジ処理によっております。 (2) へいジ手段とへいジ対象 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 登上に記載する。 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力却で付水にいた。これによる財務諸表への影響はありません。 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 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

# (表示方法の変更) (貸借対照表関係)

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、 当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の 組替えを行っております

〒っております。 - 前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」 1,528百万円、「その他」2,363百万円として組み替えております。 -「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、

#### (貸借対照表関係)

1右取田守咨彦の減価償却男計額

「日が回た貝座の水川県小糸川田	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

		' U HU ' U / U / H		. H 13 ユテネース		
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	•	1	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す

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。

						<u> </u>
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

(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

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 当社では、 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 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。 また自己査定要領に基づき定期的に債

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

大家となる資産なたは負債に関する情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 ヷます。

### (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	<u>(2022年3月31日)</u>
--	-------	---------------------

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	1	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	(1,333)	(80)	-	(1,413)	
σ					
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
- (\*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。

当事業任度 (2023年3日31日)

□ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □	貸借対照表計上額(百万円)(*1)				
区分	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)					
その他有価証券	-	3,844	-	3,844	
資産計	1,029	16,547	1	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	(10)	(48)	-	(58)
0				
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銭ののは優に公額しており、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。

132月 日間に対してい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。

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。

/ 甾位·舌万田、

		(半位.日八日)
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)

	<u> </u>			<u> </u>
	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	-	1	-
未収運用受託報酬	6,252	-	-	-
投資有価証券		108	1.712	0
投資信託	-	100	1,712	0

当事業任度 (2023年3日31日) ( ) ( ) ( ) ( ) ( ) ( )

<u> </u>	JOIH /			<u> </u>
	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)

#### . 子会社株式

・」 云 江 が 込 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。

(甾位:百万四)

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

半期報告書(内国投資信託受益証券) (単位:百万円)

前事業年度(2022年3月31日)

刖尹耒牛及(2022牛3月31日)	( <u> </u>		
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) 貸借対照表 区分 取得原価 差額 計上額 貸借対照表計上額が取得原価を超える もの その他 986 622 364 622 小計 986 364 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

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。

2,857

3,844

292

71

3,150

3,772

		( <u>甲位:白万円)</u>
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

小計

合計

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	(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)

(百万円)   (百万円)   (百万円)
-----------------------

	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	5,498	-	54	54
	英ポンド	277	-	1	1
市場取引以外	カナダドル	111	-	1	1
の取引	スイスフラン	139	-	2	2
	香港ドル	190	-	1	1
	ユーロ	676	-	18	18
	買建				
	ユーロ	21	-	0	0
	合計	6,915	-	80	80

(注)上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業任度(2023年3日31日)

<u> </u>					
	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)
	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	5,923	-	21	21
	英ポンド	256	-	6	6
市場取引以外	カナダドル	109	-	1	1
の取引	スイスフラン	163	-	2	2
	香港ドル	202	-	0	0
	ユーロ	651	-	19	19
	買建				
	米ドル	152	-	3	3
	合計	7,458	-	48	48

(注)上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2)株式関連 前事業年度(2022年3月31日)

133 3 3 1 1 2 1 = 3	種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	17,197	-	1,333	1,333
	合計	17,197	-	1,333	1,333

(注)上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度(2023年3月31日)

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 売建 債券先物取引 売建	12,195 182	-	9	9
合計		12,378	-	10	10

(注)上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

# 2 . ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引 (1)通貨関連 前事業年度(2022年3月31日)

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
--------------	----	---------	---------------	-------------------------	-------------	--

	為替予約取引 売建				
	米ドル		4,422	-	43
原則的	英ポンド	投資有価証券	3,297	-	21
処理方法	スイスフラン	関係会社株式	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 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	1,729 3,228 20 83 21		6 81 0 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

議職給付債務の期主残高当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年4月1日 至 2022年4月1日 至 2022年4月1日 至 2022年3月31日)当 2022年3月31日)退職給付債務の期首残高626820勤務費用124133利息費用23数理計算上の差異の発生額23退職給付の支払額8157簡便法で計算した退職給付費用857簡便法から原則法への変更に伴う振替額1203その他185退職給付債務の期未残高820911			<u> </u>
室 2022年3月31日)室 2023年3月31日)退職給付債務の期首残高626820勤務費用124133利息費用23数理計算上の差異の発生額-6退職給付の支払額8157簡便法で計算した退職給付費用86簡便法から原則法への変更に伴う振替額120-その他18-		前事業年度	当事業年度
退職給付債務の期首残高626820勤務費用124133利息費用23数理計算上の差異の発生額-6退職給付の支払額8157簡便法で計算した退職給付費用86簡便法から原則法への変更に伴う振替額120-その他18-		(自 2021年4月1日	
勤務費用124133利息費用23数理計算上の差異の発生額-6退職給付の支払額8157簡便法で計算した退職給付費用86簡便法から原則法への変更に伴う振替額120-その他18-		至 2022年3月31日)	至 2023年3月31日)
利息費用23数理計算上の差異の発生額-6退職給付の支払額8157簡便法で計算した退職給付費用86簡便法から原則法への変更に伴う振替額120-その他18-	退職給付債務の期首残高	626	820
数理計算上の差異の発生額-6退職給付の支払額8157簡便法で計算した退職給付費用86簡便法から原則法への変更に伴う振替額120-その他18-	勤務費用	124	133
退職給付の支払額8157簡便法で計算した退職給付費用86簡便法から原則法への変更に伴う振替額120-その他18-	利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用86簡便法から原則法への変更に伴う振替額120-その他18-	数理計算上の差異の発生額	-	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額       120       -         その他       18       -	退職給付の支払額	81	57
その他 18 -	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	-
退職給付債務の期末残高 820 911	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	当事業年度
	(2022年3月31日)	(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
莫旧为流状[ch]工C10/C负债C负压(0) ind	020	904

#### (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	(単位:百万円) 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

(0) 数注时并上切时并坐陇门员 5 0 争项		
	前事業年度	当事業年度
	(自 2021年4月1日	(自 2022年4月1日
	至 2022年3月31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月		当事業年) (2023年3月3	
————————————————————— 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	
繰延へッジ損益	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	<i>"</i>
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	<i>"</i>	1,181	<i>"</i>

- 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。

- . 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 「重要な会計方針7.収益及び費用の計上基準」に記 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、 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

(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)

135×1×(1 -0-: 1 :/3:11	
顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

(\*)当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載 しております。

当<u>事</u>举年度(白 2022年4日1日 至 2023年3日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)

122 - 21	· · · · · ·	7 20217			T 0/ 30 1 1 /					
種類	会 会 名 名 又 氏 氏	所在地	資本金 又は 出資金 (百万 円)	事業 の 内 又 職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当者 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	三井住友信託	東京都	342.037	信託業 務及び		営業上 の取引	運用受託報酬	10,090	未収運用 受託報酬	5,421
社	銀行(株)	千代田区	342,037	銀行業 務	-	役員の 兼任	投信販売 代行手数料等	9,701	未払 手数料	1,995

(注)1.上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2.取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

種類	会 会 等 名 取 氏 氏 氏 氏 氏 氏 た に た に た に た に た ら に り た り た り た り た り た り た り た り た り と り と	所在地	資本金 又は 出資金 (百万 円)	事業 の 内 又 職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当者と 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	三井住友信託	東京都	342.037	信託業 務及び		営業上 の取引	運用受託報酬	9,593	未収運用 受託報酬	5,271
社	銀行(株)	千代田区	342,037	銀行業務	-	役員の 兼任	投信販売 代行手数料等	9,445	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おりません。
2 . 1株当たり当期純利益金額の質定上の基礎は、以下のとおりであります。

2.「休日だり日朔代利血並領の昇足工	.の圣诞は、以下のこのりてのりより。	)
	前事業年度	当事業年度
	(自 2021年4月1日	(自 2022年4月1日
	至 2022年3月31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

	半期報告書(『
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
只读口叫	
	(単位:百万円)
	(単位:百万円) 第38期中間会計期間末
純資産の部	第38期中間会計期間末
純資産の部 株主資本	第38期中間会計期間末
	第38期中間会計期間末
株主資本	第38期中間会計期間末 (2023年9月30日)
株主資本 資本金	第38期中間会計期間末 (2023年9月30日)
株主資本 資本金 資本剰余金	第38期中間会計期間末 (2023年9月30日) 2,000
株主資本 資本金 資本剰余金 その他資本剰余金	第38期中間会計期間末 (2023年9月30日) 2,000
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	第38期中間会計期間末 (2023年9月30日) 2,000
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 利益剰余金	第38期中間会計期間末 (2023年9月30日)  2,000  17,239  17,239
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 利益剰余金 利益準備金	第38期中間会計期間末 (2023年9月30日)  2,000  17,239  17,239
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 利益剰余金 利益準備金 その他利益剰余金	第38期中間会計期間末 (2023年9月30日)  2,000  17,239  17,239  500
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 利益剰余金 利益準備金 その他利益剰余金 別途積立金	第38期中間会計期間末 (2023年9月30日) 2,000 17,239 17,239 500 2,100
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 利益剰余金 利益準備金 その他利益剰余金 別途積立金 繰越利益剰余金	第38期中間会計期間末 (2023年9月30日) 2,000 17,239 17,239 500 2,100 43,700
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 利益剰余金 利益業備金 その他利益剰余金 別途積立金 繰越利益剰余金 利益剰余金 料益剰余金 料益利益利余金 利益利金	第38期中間会計期間末 (2023年9月30日) 2,000 17,239 17,239 500 2,100 43,700 46,300
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 利益剰余金 利益準備金 その他利益剰余金 別途積立金 繰越利益剰余金 利益剰余金合計 株主資本合計 評価・換算差額等	第38期中間会計期間末 (2023年9月30日) 2,000 17,239 17,239 500 2,100 43,700 46,300 65,540
資本金 資本剰余金 その他資本剰余金 資本剰余金合計 利益剰余金 利益準備金 その他利益剰余金 別途積立金 繰越利益剰余金 利益剰余金合計 株主資本合計	第38期中間会計期間末 (2023年9月30日) 2,000 17,239 17,239 500 2,100 43,700 46,300

64,798

77,045

半期報告書(内国投資信託受益証券)

純資産合計 負債・純資産合計

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)

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			
	恣★◆	資本剰余金			
	資本金 -	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			
	112444	その他利		利益剰余金	株主資本合計	
	利益準備金	別途積立金	繰越利益 剰余金	合計		
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		
	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	純資産合計
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

# (重要な会計方針)

第38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 2023年9月30日)

- 1. 資産の評価基準及び評価方法
  - (1)有価証券 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

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

場価格のない体工等 移動平均法による原価法によっております。 もれ、机容重要右限青仟組合への出資については、 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 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。 組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可

- (2) デリバティブ 時価法によっております。
- (3) 金銭の信託 時価法によっております。
- 2. 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。

- 3 . 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中間会計期間の負担額を計上 しております。

(2) 退職給付引当金

経職制的司事並 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差処理方法は次のとおりであります。 す。過去動物である。過去勤務費用

: 発生事業年度に損益処理

: 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 数理計算上の差異

4. 収益及び費用の計上基準

4. WAMA U 見用いぼし 本学 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

2023年は、投資ー任契約に基づき投資ー任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(3)投資助言業務

当社は、投資顧問(助言)契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(4)成功報酬

当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いと合理的に判断した時点で収益を認識しております。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上し ております。

- 6 . ヘッジ会計の方法 (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。 (2)ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針 自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を 比較して有効性を判定しております。

7.グループ通算制度の適用 グループ通算制度を適用しております。

#### (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)

有形固定資産の減価償却累計額

957百万円

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 2023年9月30日)

減価償却実施額 1

有形固定資産 無形固定資産

91百万円 972百万円

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 784百万円 為替差損

(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)

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。

### . 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 1 株当たり 基準日 効力発生日 総額(百万円) 配当額(円)		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)			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上記載2015年に入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たが、12015年に入れた。 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

<u>・ 私募投信等</u>、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

リステの方面を求められるほどの重要な耐限がない場合には基準値韻等を時間としており、レベル2の時間に方類しております。 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

個に分類してのります。 (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)

	(辛四・ロノハコノ
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)

子会社株式

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。

<u> </u>		
中間貸借対照表計上額		
F 626		

#### 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	١	诵	臽	뽀	迧

(1)	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 カイスフラン 香港ドル ユーロ	5,944 267 126 176 214 719	11111	76 1 1 0 2 3	76 1 1 0 2 3
	合計	7,449	1	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) 週頁(別連 へッジ 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、 載の通りです。 「重要な会計方針4.収益及び費用の計上基準」に記
- 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し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。

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

- <u>/ 100 日本</u> - 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。 . 主要な顧客ごとの情報

· 工女'6 殿 日 C C V 旧 和	
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 第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日) 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 ] 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 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株当たり中間纯利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります

(圧)が当たり中国総利血の昇足工の金姫は、	<b>、以下のこのりてのりより。</b>
	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

#### 監杳意見

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

が経営者の責任は、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 . XBRL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.XBRL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21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SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)の2023年6月13日から2023年12月12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、SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)の2023年12月12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6月13日から2023年12月12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、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。