

【表紙】

| | |
|------------|---------------------------------|
| 【提出書類】 | 半期報告書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 2024年4月10日提出 |
| 【計算期間】 | 第12期中(自 2023年7月11日至 2024年1月10日) |
| 【ファンド名】 | 分散投資コア戦略ファンドA 分散投資コア戦略ファンドS |
| 【発行者名】 | 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 代表取締役社長 菱田 賀夫 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都港区芝公園一丁目1番1号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 北添 道生 |
| 【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、2024年1月31日現在の状況について記載してあります。

【分散投資コア戦略ファンドA】

(1)【投資状況】

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 11,243,953,656 | 12.58 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 76,786,768,523 | 85.93 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 1,332,230,349 | 1.49 |
| 合計(純資産総額) | | 89,362,952,528 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【運用実績】

【純資産の推移】

| | 純資産総額(円) | | 1万口当たりの純資産額(円) | |
|-------------------------|----------------|----------------|----------------|--------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) |
| 第2期計算期間末 (2014年 7月10日) | 16,628,969,770 | 16,628,969,770 | 10,208 | 10,208 |
| 第3期計算期間末 (2015年 7月10日) | 23,204,975,199 | 23,204,975,199 | 10,550 | 10,550 |
| 第4期計算期間末 (2016年 7月11日) | 40,992,277,841 | 40,992,277,841 | 9,890 | 9,890 |
| 第5期計算期間末 (2017年 7月10日) | 47,152,867,522 | 47,152,867,522 | 10,297 | 10,297 |
| 第6期計算期間末 (2018年 7月10日) | 56,957,731,265 | 56,957,731,265 | 10,442 | 10,442 |
| 第7期計算期間末 (2019年 7月10日) | 64,206,017,914 | 64,206,017,914 | 10,533 | 10,533 |
| 第8期計算期間末 (2020年 7月10日) | 69,610,450,591 | 69,610,450,591 | 10,401 | 10,401 |
| 第9期計算期間末 (2021年 7月12日) | 80,414,109,882 | 80,414,109,882 | 11,262 | 11,262 |
| 第10期計算期間末 (2022年 7月11日) | 83,363,228,383 | 83,363,228,383 | 10,759 | 10,759 |
| 第11期計算期間末 (2023年 7月10日) | 87,419,162,186 | 87,419,162,186 | 10,781 | 10,781 |
| 2023年 1月末日 | 83,942,018,109 | | 10,532 | |
| 2月末日 | 83,471,512,918 | | 10,515 | |
| 3月末日 | 84,929,769,174 | | 10,596 | |
| 4月末日 | 85,226,547,023 | | 10,666 | |
| 5月末日 | 86,769,502,129 | | 10,723 | |
| 6月末日 | 88,275,597,024 | | 10,876 | |
| 7月末日 | 88,190,505,431 | | 10,837 | |
| 8月末日 | 87,599,508,376 | | 10,811 | |
| 9月末日 | 87,035,337,384 | | 10,659 | |
| 10月末日 | 85,847,005,104 | | 10,503 | |
| 11月末日 | 87,833,682,161 | | 10,765 | |
| 12月末日 | 88,383,316,117 | | 10,865 | |
| 2024年 1月末日 | 89,362,952,528 | | 10,932 | |

【分配の推移】

| | 期 間 | 1万口当たりの分配金（円） |
|----------|-------------------------|---------------|
| 第2期計算期間 | 2013年 7月11日～2014年 7月10日 | 0 |
| 第3期計算期間 | 2014年 7月11日～2015年 7月10日 | 0 |
| 第4期計算期間 | 2015年 7月11日～2016年 7月11日 | 0 |
| 第5期計算期間 | 2016年 7月12日～2017年 7月10日 | 0 |
| 第6期計算期間 | 2017年 7月11日～2018年 7月10日 | 0 |
| 第7期計算期間 | 2018年 7月11日～2019年 7月10日 | 0 |
| 第8期計算期間 | 2019年 7月11日～2020年 7月10日 | 0 |
| 第9期計算期間 | 2020年 7月11日～2021年 7月12日 | 0 |
| 第10期計算期間 | 2021年 7月13日～2022年 7月11日 | 0 |
| 第11期計算期間 | 2022年 7月12日～2023年 7月10日 | 0 |

【収益率の推移】

| | 期 間 | 収益率（％） |
|------------|-------------------------|--------|
| 第2期計算期間 | 2013年 7月11日～2014年 7月10日 | 4.0 |
| 第3期計算期間 | 2014年 7月11日～2015年 7月10日 | 3.4 |
| 第4期計算期間 | 2015年 7月11日～2016年 7月11日 | 6.3 |
| 第5期計算期間 | 2016年 7月12日～2017年 7月10日 | 4.1 |
| 第6期計算期間 | 2017年 7月11日～2018年 7月10日 | 1.4 |
| 第7期計算期間 | 2018年 7月11日～2019年 7月10日 | 0.9 |
| 第8期計算期間 | 2019年 7月11日～2020年 7月10日 | 1.3 |
| 第9期計算期間 | 2020年 7月11日～2021年 7月12日 | 8.3 |
| 第10期計算期間 | 2021年 7月13日～2022年 7月11日 | 4.5 |
| 第11期計算期間 | 2022年 7月12日～2023年 7月10日 | 0.2 |
| 第12期中間計算期間 | 2023年 7月11日～2024年 1月10日 | 0.8 |

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

【分散投資コア戦略ファンドS】

(1)【投資状況】

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---------------------|------|-----------------|---------|
| 投資信託受益証券 | 日本 | 28,321,180,737 | 13.88 |
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 172,221,190,559 | 84.43 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 3,429,134,066 | 1.68 |
| 合計(純資産総額) | | 203,971,505,362 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【運用実績】

【純資産の推移】

| | 純資産総額（円） | | 1万口当たりの純資産額（円） | |
|--|----------|-------|----------------|-------|
| | (分配落) | (分配付) | (分配落) | (分配付) |
| | | | | |

| | | | | | |
|-----------|---------------|-----------------|-----------------|--------|--------|
| 第2期計算期間末 | (2014年 7月10日) | 9,560,643,872 | 9,560,643,872 | 10,451 | 10,451 |
| 第3期計算期間末 | (2015年 7月10日) | 23,718,308,897 | 23,718,308,897 | 11,013 | 11,013 |
| 第4期計算期間末 | (2016年 7月11日) | 40,713,425,166 | 40,713,425,166 | 9,845 | 9,845 |
| 第5期計算期間末 | (2017年 7月10日) | 57,661,475,690 | 57,661,475,690 | 10,759 | 10,759 |
| 第6期計算期間末 | (2018年 7月10日) | 75,431,956,580 | 75,431,956,580 | 11,008 | 11,008 |
| 第7期計算期間末 | (2019年 7月10日) | 89,663,756,248 | 89,663,756,248 | 11,109 | 11,109 |
| 第8期計算期間末 | (2020年 7月10日) | 143,157,363,596 | 143,157,363,596 | 10,980 | 10,980 |
| 第9期計算期間末 | (2021年 7月12日) | 171,466,226,114 | 171,466,226,114 | 12,554 | 12,554 |
| 第10期計算期間末 | (2022年 7月11日) | 177,910,582,335 | 177,910,582,335 | 12,378 | 12,378 |
| 第11期計算期間末 | (2023年 7月10日) | 194,020,660,452 | 194,020,660,452 | 12,871 | 12,871 |
| | 2023年 1月末日 | 178,805,211,389 | | 12,270 | |
| | 2月末日 | 181,819,948,071 | | 12,309 | |
| | 3月末日 | 184,362,226,350 | | 12,347 | |
| | 4月末日 | 185,767,340,437 | | 12,490 | |
| | 5月末日 | 189,997,113,663 | | 12,662 | |
| | 6月末日 | 196,246,824,574 | | 13,004 | |
| | 7月末日 | 196,745,070,257 | | 13,012 | |
| | 8月末日 | 196,324,338,692 | | 13,031 | |
| | 9月末日 | 195,056,230,015 | | 12,861 | |
| | 10月末日 | 192,611,015,541 | | 12,665 | |
| | 11月末日 | 197,810,238,338 | | 13,038 | |
| | 12月末日 | 199,219,442,703 | | 13,136 | |
| | 2024年 1月末日 | 203,971,505,362 | | 13,372 | |

【分配の推移】

| | 期 間 | 1万口当たりの分配金（円） |
|----------|-------------------------|---------------|
| 第2期計算期間 | 2013年 7月11日～2014年 7月10日 | 0 |
| 第3期計算期間 | 2014年 7月11日～2015年 7月10日 | 0 |
| 第4期計算期間 | 2015年 7月11日～2016年 7月11日 | 0 |
| 第5期計算期間 | 2016年 7月12日～2017年 7月10日 | 0 |
| 第6期計算期間 | 2017年 7月11日～2018年 7月10日 | 0 |
| 第7期計算期間 | 2018年 7月11日～2019年 7月10日 | 0 |
| 第8期計算期間 | 2019年 7月11日～2020年 7月10日 | 0 |
| 第9期計算期間 | 2020年 7月11日～2021年 7月12日 | 0 |
| 第10期計算期間 | 2021年 7月13日～2022年 7月11日 | 0 |
| 第11期計算期間 | 2022年 7月12日～2023年 7月10日 | 0 |

【収益率の推移】

| | 期 間 | 収益率（％） |
|---------|-------------------------|--------|
| 第2期計算期間 | 2013年 7月11日～2014年 7月10日 | 5.4 |
| 第3期計算期間 | 2014年 7月11日～2015年 7月10日 | 5.4 |
| 第4期計算期間 | 2015年 7月11日～2016年 7月11日 | 10.6 |
| 第5期計算期間 | 2016年 7月12日～2017年 7月10日 | 9.3 |

| | | |
|------------|-------------------------|------|
| 第6期計算期間 | 2017年 7月11日～2018年 7月10日 | 2.3 |
| 第7期計算期間 | 2018年 7月11日～2019年 7月10日 | 0.9 |
| 第8期計算期間 | 2019年 7月11日～2020年 7月10日 | 1.2 |
| 第9期計算期間 | 2020年 7月11日～2021年 7月12日 | 14.3 |
| 第10期計算期間 | 2021年 7月13日～2022年 7月11日 | 1.4 |
| 第11期計算期間 | 2022年 7月12日～2023年 7月10日 | 4.0 |
| 第12期中間計算期間 | 2023年 7月11日～2024年 1月10日 | 2.4 |

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|-----------------|---------|
| 株式 | 日本 | 631,937,949,060 | 99.31 |
| 新株予約権証券 | 日本 | 7,416,600 | 0.00 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 4,363,866,236 | 0.69 |
| 合計(純資産総額) | | 636,309,231,896 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|----------|---------|------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本 | 3,983,460,000 | 0.63 |

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

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

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|---------------|---------|
| 株式 | 日本 | 4,966,283,950 | 99.48 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 26,192,481 | 0.52 |
| 合計(純資産総額) | | 4,992,476,431 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|----------|---------|------|------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本 | 25,535,000 | 0.51 |

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

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

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|-----------------|---------|
| 国債証券 | 日本 | 553,664,125,760 | 84.52 |
| 地方債証券 | 日本 | 32,813,231,063 | 5.01 |
| 特殊債券 | 日本 | 36,998,838,429 | 5.65 |
| | 国際機関 | 299,508,000 | 0.05 |
| | 小計 | 37,298,346,429 | 5.69 |
| 社債券 | 日本 | 28,302,170,000 | 4.32 |
| | フランス | 1,393,900,000 | 0.21 |
| | 韓国 | 99,535,000 | 0.02 |
| | 小計 | 29,795,605,000 | 4.55 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 1,520,729,227 | 0.23 |
| 合計(純資産総額) | | 655,092,037,479 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-------|---------|----------------|---------|
| 国債証券 | アメリカ | 34,382,290,892 | 48.44 |
| | フランス | 5,966,448,796 | 8.41 |
| | 中国 | 5,773,922,959 | 8.13 |
| | イタリア | 5,313,380,989 | 7.49 |
| | ドイツ | 4,625,088,037 | 6.52 |
| | イギリス | 3,795,091,357 | 5.35 |
| | スペイン | 3,511,077,621 | 4.95 |
| | カナダ | 1,471,663,819 | 2.07 |
| | ベルギー | 1,267,124,531 | 1.79 |
| | オランダ | 1,074,456,357 | 1.51 |
| | オーストラリア | 1,007,029,530 | 1.42 |
| | オーストリア | 851,233,832 | 1.20 |
| | メキシコ | 623,315,232 | 0.88 |
| | アイルランド | 412,982,590 | 0.58 |
| | ポーランド | 382,086,752 | 0.54 |
| | フィンランド | 372,603,880 | 0.52 |
| | マレーシア | 363,944,093 | 0.51 |
| | シンガポール | 306,378,418 | 0.43 |

| | | | |
|---------------------|----------|----------------|--------|
| | イスラエル | 230,243,652 | 0.32 |
| | デンマーク | 198,922,658 | 0.28 |
| | ニュージーランド | 174,613,789 | 0.25 |
| | スウェーデン | 148,136,663 | 0.21 |
| | ノルウェー | 127,824,209 | 0.18 |
| | 小計 | 72,379,860,656 | 101.97 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 1,397,793,872 | 1.97 |
| 合計(純資産総額) | | 70,982,066,784 | 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 | 148,864,115 | 0.21 |
| | 買建 | ドイツ | 198,058,857 | 0.28 |

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

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

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|--------|---------|------|----------------|---------|
| 為替予約取引 | 売建 | | 73,987,635,257 | 104.23 |

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

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

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-------|---------|-----------------|---------|
| 株式 | アメリカ | 468,405,705,091 | 70.11 |
| | イギリス | 25,383,785,975 | 3.80 |
| | カナダ | 22,425,375,011 | 3.36 |
| | スイス | 20,823,440,313 | 3.12 |
| | フランス | 20,241,518,713 | 3.03 |
| | ドイツ | 15,611,026,295 | 2.34 |
| | オランダ | 12,866,658,159 | 1.93 |
| | オーストラリア | 12,487,210,617 | 1.87 |
| | アイルランド | 12,134,785,043 | 1.82 |
| | デンマーク | 6,312,925,552 | 0.94 |
| | スウェーデン | 5,624,189,119 | 0.84 |
| | スペイン | 4,635,111,683 | 0.69 |
| | イタリア | 3,621,837,134 | 0.54 |
| | 香港 | 2,768,402,803 | 0.41 |

| | | | |
|---------------------|----------|-----------------|--------|
| | シンガポール | 2,002,484,794 | 0.30 |
| | フィンランド | 1,957,838,604 | 0.29 |
| | ジャージー | 1,647,330,326 | 0.25 |
| | ベルギー | 1,369,044,702 | 0.20 |
| | イスラエル | 1,334,639,163 | 0.20 |
| | ノルウェー | 1,165,718,642 | 0.17 |
| | バミューダ | 882,382,632 | 0.13 |
| | キュラソー | 803,064,992 | 0.12 |
| | ケイマン | 794,574,111 | 0.12 |
| | ニュージーランド | 520,479,683 | 0.08 |
| | リベリア | 385,491,987 | 0.06 |
| | ルクセンブルク | 360,461,086 | 0.05 |
| | オーストリア | 353,160,771 | 0.05 |
| | ポルトガル | 320,371,462 | 0.05 |
| | パナマ | 174,508,964 | 0.03 |
| | マン島 | 89,011,277 | 0.01 |
| | 小計 | 647,502,534,704 | 96.92 |
| 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 | 67,652,935 | 0.01 |
| | 香港 | 56,587,356 | 0.01 |
| | 小計 | 124,240,291 | 0.02 |
| 投資証券 | アメリカ | 10,879,921,350 | 1.63 |
| | オーストラリア | 790,574,269 | 0.12 |
| | フランス | 265,442,656 | 0.04 |
| | シンガポール | 247,198,830 | 0.04 |
| | イギリス | 198,321,181 | 0.03 |
| | 香港 | 124,086,478 | 0.02 |
| | カナダ | 56,874,622 | 0.01 |
| | ベルギー | 55,778,020 | 0.01 |
| | 小計 | 12,618,197,406 | 1.89 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 7,848,909,389 | 1.17 |
| 合計(純資産総額) | | 668,093,881,790 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|----------|---------|---------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 5,588,478,382 | 0.84 |
| | 買建 | カナダ | 197,751,405 | 0.03 |
| | 買建 | ドイツ | 1,003,358,296 | 0.15 |
| | 買建 | イギリス | 444,659,601 | 0.07 |
| | 買建 | オーストラリア | 349,224,617 | 0.05 |

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

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

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国 / 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------|---------|--------|------------|---------|
| 為替予約取引 | 売建 | | 92,942,136 | 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。

外国株式最小分散インデックスマザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国 / 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---------------------|------------|----------------|---------|
| 株式 | アメリカ | 11,808,841,065 | 64.96 |
| | スイス | 1,488,193,631 | 8.19 |
| | カナダ | 1,465,331,781 | 8.06 |
| | ドイツ | 591,688,299 | 3.25 |
| | フランス | 298,684,815 | 1.64 |
| | オランダ | 284,576,194 | 1.57 |
| | アイルランド | 248,812,986 | 1.37 |
| | 香港 | 245,894,370 | 1.35 |
| | スペイン | 243,475,418 | 1.34 |
| | オーストラリア | 233,262,088 | 1.28 |
| | シンガポール | 205,157,251 | 1.13 |
| | フィンランド | 161,195,221 | 0.89 |
| | イスラエル | 105,023,509 | 0.58 |
| | イタリア | 55,144,216 | 0.30 |
| | イギリス | 54,921,132 | 0.30 |
| | ベルギー | 53,054,332 | 0.29 |
| | ノルウェー | 47,019,176 | 0.26 |
| | デンマーク | 34,541,466 | 0.19 |
| | ニュージーランド | 28,826,157 | 0.16 |
| | バミューダ | 23,604,459 | 0.13 |
| スウェーデン | 16,701,622 | 0.09 | |
| ケイマン | 10,013,177 | 0.06 | |
| | 小計 | 17,703,962,365 | 97.39 |
| 新株予約権証券 | カナダ | - | - |
| 投資信託受益証券 | 香港 | 28,383,499 | 0.16 |
| 投資証券 | アメリカ | 48,436,644 | 0.27 |
| | 香港 | 8,996,083 | 0.05 |
| | 小計 | 57,432,727 | 0.32 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 388,561,768 | 2.14 |

| | | |
|-----------|----------------|--------|
| 合計(純資産総額) | 18,178,340,359 | 100.00 |
|-----------|----------------|--------|

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資 比率 (%) |
|----------|---------------|------|-------------|-----------------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 146,104,010 | 0.80 |
| | 買建 | カナダ | 113,000,803 | 0.62 |

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|-------------|-----------------|---------|
| 国債証券 | アメリカ | 144,396,917,652 | 46.35 |
| | フランス | 25,040,656,252 | 8.04 |
| | 中国 | 24,226,373,814 | 7.78 |
| | イタリア | 22,293,001,189 | 7.16 |
| | ドイツ | 19,477,754,395 | 6.25 |
| | イギリス | 15,939,273,171 | 5.12 |
| | スペイン | 14,721,005,382 | 4.73 |
| | カナダ | 6,156,993,563 | 1.98 |
| | ベルギー | 5,310,235,191 | 1.70 |
| | オランダ | 4,507,007,331 | 1.45 |
| | オーストラリア | 4,222,023,801 | 1.36 |
| | オーストリア | 3,569,610,247 | 1.15 |
| | メキシコ | 2,604,205,638 | 0.84 |
| | アイルランド | 1,738,105,759 | 0.56 |
| | ポーランド | 1,587,703,404 | 0.51 |
| | フィンランド | 1,561,106,394 | 0.50 |
| | マレーシア | 1,526,301,685 | 0.49 |
| | シンガポール | 1,274,565,808 | 0.41 |
| | イスラエル | 964,079,626 | 0.31 |
| | デンマーク | 832,116,734 | 0.27 |
| | ニュージーランド | 721,908,175 | 0.23 |
| | スウェーデン | 623,205,614 | 0.20 |
| ノルウェー | 536,905,565 | 0.17 | |
| | 小計 | 303,831,056,390 | 97.52 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 7,722,450,540 | 2.48 |
| 合計(純資産総額) | | 311,553,506,930 | 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 | 1,929,808,737 | 0.62 |
| | 買建 | ドイツ | 1,777,960,169 | 0.57 |

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

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

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国 / 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------|---------|--------|---------------|---------|
| 為替予約取引 | 買建 | | 4,337,979,019 | 1.39 |

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

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

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国 / 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-------|-------------|----------------|---------|
| 株式 | インド | 28,818,560,433 | 16.94 |
| | 台湾 | 26,420,580,438 | 15.53 |
| | ケイマン | 22,780,668,310 | 13.39 |
| | 韓国 | 19,898,598,841 | 11.70 |
| | 中国 | 16,229,988,021 | 9.54 |
| | ブラジル | 8,787,719,952 | 5.17 |
| | サウジアラビア | 7,084,573,890 | 4.17 |
| | 南アフリカ | 4,559,960,715 | 2.68 |
| | メキシコ | 4,293,621,050 | 2.52 |
| | インドネシア | 3,145,986,856 | 1.85 |
| | タイ | 2,816,758,250 | 1.66 |
| | マレーシア | 2,235,530,607 | 1.31 |
| | アラブ首長国連邦 | 2,101,529,866 | 1.24 |
| | カタール | 1,437,650,105 | 0.85 |
| | ポーランド | 1,426,519,934 | 0.84 |
| | 香港 | 1,354,498,910 | 0.80 |
| | クウェート | 1,349,393,679 | 0.79 |
| | トルコ | 1,151,411,793 | 0.68 |
| | フィリピン | 1,009,816,050 | 0.59 |
| | ギリシャ | 840,631,911 | 0.49 |
| チリ | 763,871,774 | 0.45 | |
| バミューダ | 642,846,826 | 0.38 | |
| アメリカ | 536,735,840 | 0.32 | |

| | | | |
|---------------------|----------|-----------------|--------|
| | ハンガリー | 434,964,203 | 0.26 |
| | チェコ | 246,470,299 | 0.14 |
| | ルクセンブルク | 221,541,458 | 0.13 |
| | イギリス | 180,000,073 | 0.11 |
| | コロンビア | 166,776,817 | 0.10 |
| | エジプト | 153,909,493 | 0.09 |
| | ペルー | 37,919,966 | 0.02 |
| | シンガポール | 26,182,880 | 0.02 |
| | オランダ | 18,262,488 | 0.01 |
| | ロシア | 125 | 0.00 |
| | キプロス | - | - |
| | 英ヴァージン諸島 | - | - |
| | 小計 | 161,173,481,853 | 94.75 |
| 投資信託受益証券 | ブラジル | 373,932,784 | 0.22 |
| | メキシコ | 134,020,704 | 0.08 |
| | 小計 | 507,953,488 | 0.30 |
| 投資証券 | メキシコ | 172,206,902 | 0.10 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 8,243,016,865 | 4.85 |
| 合計(純資産総額) | | 170,096,659,108 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|----------|---------|------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 8,254,816,069 | 4.85 |

(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 | | 604,856,299 | 0.36 |

(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 | 中国 | 12,863,657,443 | 9.93 |
| | ブラジル | 12,828,838,328 | 9.91 |
| | メキシコ | 12,628,057,463 | 9.75 |
| | マレーシア | 12,622,285,448 | 9.75 |

| | | | |
|---------------------|---------|-----------------|--------|
| | インドネシア | 12,581,711,196 | 9.72 |
| | タイ | 12,291,046,056 | 9.49 |
| | 南アフリカ | 10,401,059,414 | 8.03 |
| | ポーランド | 9,642,192,346 | 7.45 |
| | チェコ | 7,903,981,411 | 6.10 |
| | コロンビア | 5,750,389,709 | 4.44 |
| | ルーマニア | 4,896,267,334 | 3.78 |
| | ハンガリー | 3,932,048,966 | 3.04 |
| | ペルー | 2,884,248,617 | 2.23 |
| | チリ | 2,286,080,481 | 1.77 |
| | ウルグアイ | 248,765,743 | 0.19 |
| | ドミニカ共和国 | 206,162,789 | 0.16 |
| | フィリピン | 72,807,497 | 0.06 |
| | 小計 | 124,039,600,241 | 95.78 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 5,459,641,323 | 4.22 |
| 合計(純資産総額) | | 129,499,241,564 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|--------|---------|------|---------------|---------|
| 為替予約取引 | 買建 | | 2,404,020,409 | 1.86 |

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

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

J-REITインデックス マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|-----------------|---------|
| 投資証券 | 日本 | 113,853,655,400 | 96.41 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 4,241,794,200 | 3.59 |
| 合計(純資産総額) | | 118,095,449,600 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-------------|---------|------|---------------|---------|
| 不動産投信指数先物取引 | 買建 | 日本 | 4,223,890,000 | 3.58 |

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

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

グローバルREITインデックス マザーファンド

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---------------------|----------|-----------------|---------|
| 投資証券 | アメリカ | 84,564,936,192 | 77.32 |
| | オーストラリア | 7,424,027,623 | 6.79 |
| | イギリス | 5,220,209,612 | 4.77 |
| | シンガポール | 3,754,945,921 | 3.43 |
| | フランス | 1,981,844,648 | 1.81 |
| | カナダ | 1,691,670,602 | 1.55 |
| | ベルギー | 1,222,875,880 | 1.12 |
| | 香港 | 1,161,239,790 | 1.06 |
| | スペイン | 446,955,019 | 0.41 |
| | ニュージーランド | 322,467,959 | 0.29 |
| | ガーンジー | 311,604,036 | 0.28 |
| | 韓国 | 190,516,283 | 0.17 |
| | オランダ | 188,318,779 | 0.17 |
| | イスラエル | 132,305,514 | 0.12 |
| | アイルランド | 38,834,317 | 0.04 |
| | ドイツ | 38,650,352 | 0.04 |
| | イタリア | 11,837,796 | 0.01 |
| | 小計 | 108,703,240,323 | 99.39 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 671,839,107 | 0.61 |
| 合計（純資産総額） | | 109,375,079,430 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------|---------|------|------------|---------|
| 為替予約取引 | 買建 | | 81,139,960 | 0.07 |
| | 売建 | | 20,650,630 | 0.02 |

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

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

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---------------------|------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 28,113,547,618 | 98.19 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 517,306,102 | 1.81 |
| 合計（純資産総額） | | 28,630,853,720 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資 比率 (%) |
|--------|---------------|------|----------------|-----------------|
| 為替予約取引 | 売建 | | 29,349,089,760 | 102.51 |

(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。

H F リターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------|------|---------------|---------|
| 国債証券 | 日本 | 2,801,411,200 | 38.32 |
| 投資信託受益証券 | アメリカ | 1,073,302,774 | 14.68 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 3,436,287,715 | 47.00 |
| 合計(純資産総額) | | 7,311,001,689 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資 比率 (%) |
|----------|---------------|------|---------------|-----------------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 1,976,289,126 | 27.03 |
| | 買建 | ドイツ | 1,614,780,122 | 22.09 |
| | 売建 | アメリカ | 693,994,047 | 9.49 |
| | 売建 | ドイツ | 409,699,167 | 5.60 |
| | 売建 | イギリス | 487,691,175 | 6.67 |
| 債券先物取引 | 売建 | アメリカ | 1,647,026,875 | 22.53 |

(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 | | 320,087,876 | 4.38 |
| | 売建 | | 3,005,250,790 | 41.11 |

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

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

G B C A マザーファンド（ミドルリスク型）

投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---------------------|------|----------------|---------|
| 国債証券 | 日本 | 11,703,986,800 | 58.74 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 8,221,746,987 | 41.26 |
| 合計（純資産総額） | | 19,925,733,787 | 100.00 |

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資 比率 （％） |
|--------|---------------|------|---------------|-----------------|
| 債券先物取引 | 買建 | 日本 | 9,067,500,000 | 45.51 |
| | 売建 | アメリカ | 279,994,568 | 1.41 |
| | 売建 | ドイツ | 9,727,385,373 | 48.82 |
| | 売建 | イギリス | 9,243,072,009 | 46.39 |

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

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

| 資産の種類 | 買建 / 売建 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資 比率 （％） |
|--------|---------------|------|---------------|-----------------|
| 為替予約取引 | 買建 | | 6,083,515,262 | 30.53 |
| | 売建 | | 6,891,300,415 | 34.58 |

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

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

2【設定及び解約の実績】

【分散投資コア戦略ファンドA】

| | 期 間 | 設定口数（口） | 解約口数（口） | 発行済み口数（口） |
|------------|-------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 第2期計算期間 | 2013年 7月11日～2014年 7月10日 | 16,300,810,769 | 274,885,382 | 16,289,750,554 |
| 第3期計算期間 | 2014年 7月11日～2015年 7月10日 | 6,829,705,615 | 1,125,034,771 | 21,994,421,398 |
| 第4期計算期間 | 2015年 7月11日～2016年 7月11日 | 21,115,619,373 | 1,662,548,782 | 41,447,491,989 |
| 第5期計算期間 | 2016年 7月12日～2017年 7月10日 | 6,712,164,459 | 2,368,251,334 | 45,791,405,114 |
| 第6期計算期間 | 2017年 7月11日～2018年 7月10日 | 11,384,212,208 | 2,627,192,900 | 54,548,424,422 |
| 第7期計算期間 | 2018年 7月11日～2019年 7月10日 | 9,304,566,486 | 2,896,398,134 | 60,956,592,774 |
| 第8期計算期間 | 2019年 7月11日～2020年 7月10日 | 10,458,038,852 | 4,487,544,486 | 66,927,087,140 |
| 第9期計算期間 | 2020年 7月11日～2021年 7月12日 | 8,942,057,064 | 4,467,543,464 | 71,401,600,740 |
| 第10期計算期間 | 2021年 7月13日～2022年 7月11日 | 10,745,359,555 | 4,666,858,341 | 77,480,101,954 |
| 第11期計算期間 | 2022年 7月12日～2023年 7月10日 | 9,056,644,310 | 5,449,171,076 | 81,087,575,188 |
| 第12期中間計算期間 | 2023年 7月11日～2024年 1月10日 | 3,981,346,466 | 3,337,442,921 | 81,731,478,733 |

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

【分散投資コア戦略ファンドS】

| | 期 間 | 設定口数（口） | 解約口数（口） | 発行済み口数（口） |
|------------|-------------------------|----------------|----------------|-----------------|
| 第2期計算期間 | 2013年 7月11日～2014年 7月10日 | 9,258,266,615 | 164,756,557 | 9,148,260,389 |
| 第3期計算期間 | 2014年 7月11日～2015年 7月10日 | 13,807,316,695 | 1,419,809,778 | 21,535,767,306 |
| 第4期計算期間 | 2015年 7月11日～2016年 7月11日 | 22,822,224,799 | 3,002,745,419 | 41,355,246,686 |
| 第5期計算期間 | 2016年 7月12日～2017年 7月10日 | 15,776,145,748 | 3,537,868,655 | 53,593,523,779 |
| 第6期計算期間 | 2017年 7月11日～2018年 7月10日 | 19,014,211,372 | 4,083,197,323 | 68,524,537,828 |
| 第7期計算期間 | 2018年 7月11日～2019年 7月10日 | 17,123,071,331 | 4,937,538,036 | 80,710,071,123 |
| 第8期計算期間 | 2019年 7月11日～2020年 7月10日 | 60,254,110,229 | 10,583,069,703 | 130,381,111,649 |
| 第9期計算期間 | 2020年 7月11日～2021年 7月12日 | 17,432,745,205 | 11,230,399,627 | 136,583,457,227 |
| 第10期計算期間 | 2021年 7月13日～2022年 7月11日 | 17,903,179,345 | 10,752,318,272 | 143,734,318,300 |
| 第11期計算期間 | 2022年 7月12日～2023年 7月10日 | 20,898,235,211 | 13,888,973,046 | 150,743,580,465 |
| 第12期中間計算期間 | 2023年 7月11日～2024年 1月10日 | 7,694,151,096 | 5,993,090,179 | 152,444,641,382 |

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

3【ファンドの経理状況】

【分散投資コア戦略ファンドA】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期中間計算期間(2023年7月11日から2024年1月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第11期 (2023年7月10日現在) | 第12期中間計算期間 (2024年1月10日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 1,691,547,846 | 1,525,703,368 |
| 投資信託受益証券 | 11,490,926,176 | 10,995,358,702 |
| 親投資信託受益証券 | 74,727,756,164 | 76,841,997,344 |
| 流動資産合計 | 87,910,230,186 | 89,363,059,414 |
| 資産合計 | 87,910,230,186 | 89,363,059,414 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 97,415,463 | 94,616,720 |
| 未払受託者報酬 | 23,099,293 | 24,161,181 |
| 未払委託者報酬 | 369,588,638 | 386,578,853 |
| 未払利息 | 1,410 | 1,022 |
| その他未払費用 | 963,196 | 988,084 |
| 流動負債合計 | 491,068,000 | 506,345,860 |
| 負債合計 | 491,068,000 | 506,345,860 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 81,087,575,188 | 81,731,478,733 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 6,331,586,998 | 7,125,234,821 |
| (分配準備積立金) | 5,946,356,278 | 5,707,403,156 |
| 元本等合計 | 87,419,162,186 | 88,856,713,554 |
| 純資産合計 | 87,419,162,186 | 88,856,713,554 |
| 負債純資産合計 | 87,910,230,186 | 89,363,059,414 |

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第11期中間計算期間 自 2022年 7月12日 至 2023年 1月11日 | 第12期中間計算期間 自 2023年 7月11日 至 2024年 1月10日 |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 1,656 | 8,637 |
| 有価証券売買等損益 | 1,793,584,086 | 1,159,460,655 |
| 営業収益合計 | 1,793,582,430 | 1,159,469,292 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 421,835 | 294,741 |
| 受託者報酬 | 23,140,429 | 24,161,181 |
| 委託者報酬 | 370,246,802 | 386,578,853 |
| その他費用 | 979,882 | 988,159 |
| 営業費用合計 | 394,788,948 | 412,022,934 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 2,188,371,378 | 747,446,358 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 2,188,371,378 | 747,446,358 |
| 中間純利益又は中間純損失（ ） | 2,188,371,378 | 747,446,358 |
| 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（ ） | 23,579,981 | 13,515,525 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 5,883,126,429 | 6,331,586,998 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 267,747,013 | 292,925,194 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 267,747,013 | 292,925,194 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 179,501,536 | 260,239,254 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 179,501,536 | 260,239,254 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 3,806,580,509 | 7,125,234,821 |

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | |
|-----------------|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 |
|-----------------|---|

（中間貸借対照表に関する注記）

| | 第11期 (2023年 7月10日現在) | 第12期中間計算期間 (2024年 1月10日現在) |
|----------------------------|--|--|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 81,087,575,188口 | 81,731,478,733口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0781円 (10,781円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0872円 (10,872円) |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| | 第12期中間計算期間 (2024年 1月10日現在) |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 第11期 自 2022年 7月12日 至 2023年 7月10日 | 第12期中間計算期間 自 2023年 7月11日 至 2024年 1月10日 |
|----------------|--|--|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | | |
| 期首元本額 | 77,480,101,954円 | 81,087,575,188円 |
| 期中追加設定元本額 | 9,056,644,310円 | 3,981,346,466円 |
| 期中一部解約元本額 | 5,449,171,076円 | 3,337,442,921円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

【分散投資コア戦略ファンドS】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期中間計算期間(2023年7月11日から2024年1月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第11期 (2023年7月10日現在) | 第12期中間計算期間 (2024年1月10日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 3,328,847,911 | 3,689,836,145 |
| 投資信託受益証券 | 27,393,031,393 | 26,945,492,258 |
| 親投資信託受益証券 | 163,999,236,670 | 171,422,261,635 |
| 未収入金 | 400,000,000 | - |
| 流動資産合計 | 195,121,115,974 | 202,057,590,038 |
| 資産合計 | 195,121,115,974 | 202,057,590,038 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 243,540,244 | 200,196,960 |
| 未払受託者報酬 | 50,333,942 | 54,195,056 |
| 未払委託者報酬 | 805,343,022 | 867,120,841 |
| 未払利息 | 2,775 | 2,471 |
| その他未払費用 | 1,235,539 | 1,288,408 |
| 流動負債合計 | 1,100,455,522 | 1,122,803,736 |
| 負債合計 | 1,100,455,522 | 1,122,803,736 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 150,743,580,465 | 152,444,641,382 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 43,277,079,987 | 48,490,144,920 |
| (分配準備積立金) | 22,355,544,166 | 21,487,781,057 |
| 元本等合計 | 194,020,660,452 | 200,934,786,302 |
| 純資産合計 | 194,020,660,452 | 200,934,786,302 |
| 負債純資産合計 | 195,121,115,974 | 202,057,590,038 |

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第11期中間計算期間 自 2022年 7月12日 至 2023年 1月11日 | 第12期中間計算期間 自 2023年 7月11日 至 2024年 1月10日 |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 3,597 | 13,726 |
| 有価証券売買等損益 | 2,191,835,097 | 5,641,755,830 |
| 営業収益合計 | 2,191,831,500 | 5,641,769,556 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 973,488 | 659,375 |
| 受託者報酬 | 49,868,751 | 54,195,056 |
| 委託者報酬 | 797,899,982 | 867,120,841 |
| その他費用 | 1,247,160 | 1,288,598 |
| 営業費用合計 | 849,989,381 | 923,263,870 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 3,041,820,881 | 4,718,505,686 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 3,041,820,881 | 4,718,505,686 |
| 中間純利益又は中間純損失（ ） | 3,041,820,881 | 4,718,505,686 |
| 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（ ） | 31,534,023 | 47,970,813 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 34,176,264,035 | 43,277,079,987 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 1,994,402,739 | 2,263,726,842 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 1,994,402,739 | 2,263,726,842 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,287,087,210 | 1,721,196,782 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,287,087,210 | 1,721,196,782 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 31,873,292,706 | 48,490,144,920 |

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | |
|-----------------|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | (1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。 |
|-----------------|---|

（中間貸借対照表に関する注記）

| | 第11期 (2023年 7月10日現在) | 第12期中間計算期間 (2024年 1月10日現在) |
|----------------------------|--|--|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 150,743,580,465口 | 152,444,641,382口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2871円 (12,871円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.3181円 (13,181円) |

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| | 第12期中間計算期間 (2024年 1月10日現在) |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 第11期 自 2022年 7月12日 至 2023年 7月10日 | 第12期中間計算期間 自 2023年 7月11日 至 2024年 1月10日 |
|----------------|--|--|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | | |
| 期首元本額 | 143,734,318,300円 | 150,743,580,465円 |
| 期中追加設定元本額 | 20,898,235,211円 | 7,694,151,096円 |
| 期中一部解約元本額 | 13,888,973,046円 | 5,993,090,179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

| | 2024年 1月10日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 6,180,500,784 |
| 株式 | 605,974,738,150 |
| 派生商品評価勘定 | 283,918,850 |
| 未収入金 | 27,012,250 |
| 未収配当金 | 845,885,359 |
| 差入委託証拠金 | 413,334,617 |
| 流動資産合計 | 613,725,390,010 |
| 資産合計 | 613,725,390,010 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 前受金 | 284,014,000 |
| 未払解約金 | 567,555,992 |
| 未払利息 | 4,140 |
| 流動負債合計 | 851,574,132 |
| 負債合計 | 851,574,132 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 244,052,800,164 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 368,821,015,714 |
| 元本等合計 | 612,873,815,878 |
| 純資産合計 | 612,873,815,878 |
| 負債純資産合計 | 613,725,390,010 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 1月10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）

| | 2024年 1月10日現在 |
|----------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 244,052,800,164口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 2.5112円 (1万口当たり純資産額) (25,112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

| | 2024年 1月10日現在 |
|----------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|-------------------------------|------------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 7月11日 |
| 期首元本額 | 246,129,288,443円 |
| 期中追加設定元本額 | 12,300,773,961円 |
| 期中一部解約元本額 | 14,377,262,240円 |
| 期末元本額 | 244,052,800,164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） | 307,732,523円 |
| SBI資産設計オープン（資産成長型） | 3,372,075,405円 |
| SBI資産設計オープン（分配型） | 12,521,140円 |
| SMT TOPIXインデックス・オープン | 10,941,751,493円 |
| 世界経済インデックスファンド | 5,249,636,735円 |
| 日本株式インデックス・オープン | 2,950,685,953円 |
| DCマイセレクション25 | 5,355,262,304円 |
| DCマイセレクション50 | 17,284,525,979円 |
| DCマイセレクション75 | 18,743,694,219円 |
| DC日本株式インデックス・オープン | 6,000,350,525円 |
| DCマイセレクションS25 | 3,184,777,989円 |
| DCマイセレクションS50 | 9,614,853,344円 |
| DCマイセレクションS75 | 8,391,556,909円 |
| DC日本株式インデックス・オープンS | 9,228,674,473円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2025 | 91,280,837円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2035 | 623,708,921円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2045 | 489,438,747円 |
| DC世界経済インデックスファンド | 3,837,478,962円 |
| 日本株式インデックス・オープン（SMA専用） | 846,796,389円 |
| 国内バランス60VA1（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） | 12,731,768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） | 145,949,939円 |
| 国内バランス60VA2（適格機関投資家専用） | 2,043,492円 |
| バランス30VA1（適格機関投資家専用） | 14,958,010円 |
| バランス50VA1（適格機関投資家専用） | 67,375,820円 |

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|------------------------------------|-----------------|
| バランス25VA2(適格機関投資家専用) | 16,174,102円 |
| バランス50VA2(適格機関投資家専用) | 43,300,165円 |
| バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用) | 494,464,250円 |
| バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用) | 316,660,474円 |
| バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用) | 2,126,420,812円 |
| 世界バランスVA1(適格機関投資家専用) | 29,840,484円 |
| 世界バランスVA2(適格機関投資家専用) | 12,449,949円 |
| バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用) | 328,538,832円 |
| バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用) | 181,936,971円 |
| バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用) | 244,956,359円 |
| 国内バランス25VA1(適格機関投資家専用) | 19,486,404円 |
| FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用) | 419,338,186円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1 | 2,526,183,279円 |
| 日本株式ファンド・シリーズ2 | 1,913,206,995円 |
| コア投資戦略ファンド(安定型) | 1,155,853,727円 |
| コア投資戦略ファンド(成長型) | 2,631,424,283円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 1,940,288,367円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 6,367,530,443円 |
| DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型) | 612,590,224円 |
| DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型) | 411,381,794円 |
| コア投資戦略ファンド(切替型) | 1,206,404,459円 |
| 世界経済インデックスファンド(株式シフト型) | 195,540,810円 |
| 世界経済インデックスファンド(債券シフト型) | 9,661,630円 |
| SMT インデックスバランス・オープン | 46,876,980円 |
| 国内株式SMTBセレクション(SMA専用) | 19,888,144,852円 |
| サテライト投資戦略ファンド(株式型) | 267,816,957円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン | 52,960,783円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型) | 220,826,701円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型) | 38,230,620円 |
| SMT 8資産インデックスバランス・オープン | 12,169,183円 |
| グローバル経済コア | 221,177,947円 |
| SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型) | 33,323,610円 |
| My SMT TOPIXインデックス(ノーロード) | 1,348,016,714円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2055 | 30,463,819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 | 54,691,818円 |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040 | 53,045,008円 |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050 | 23,116,884円 |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060 | 27,494,174円 |
| 10資産分散投資ファンド | 92,963,462円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 7,464,529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) | 41,893,581,637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) | 487,748,253円 |
| 世界株式ファンド(適格機関投資家専用) | 301,624,599円 |
| FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用) | 20,763,677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) | 47,159,071,288円 |
| 私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用) | 17,619,274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) | 213,615,827円 |

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2024年 1月10日現在)

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|----------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 7,521,916,000 | - | 7,805,930,000 | 284,014,000 |

| | | | | |
|----|---------------|---|---------------|-------------|
| 合計 | 7,521,916,000 | - | 7,805,930,000 | 284,014,000 |
|----|---------------|---|---------------|-------------|

(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。

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

貸借対照表

| | 2024年 1月10日現在 |
|-------------|---------------|
| 項目 | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 15,315,939 |
| 株式 | 5,159,853,970 |
| 派生商品評価勘定 | 1,062,332 |
| 未収配当金 | 11,568,750 |
| 差入委託証拠金 | 1,617,774 |
| 流動資産合計 | 5,189,418,765 |
| 資産合計 | 5,189,418,765 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 前受金 | 1,063,300 |
| 未払利息 | 10 |
| 流動負債合計 | 1,063,310 |
| 負債合計 | 1,063,310 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 3,331,130,739 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 1,857,224,716 |
| 元本等合計 | 5,188,355,455 |
| 純資産合計 | 5,188,355,455 |
| 負債純資産合計 | 5,189,418,765 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 2024年 1月10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 |

| | |
|--|-----------------|
| | 2024年 1月10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）

| | |
|----------------------------|---------------------------|
| | 2024年 1月10日現在 |
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 3,331,130,739口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) |
| | 1.5575円 (15,575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

| | |
|----------------------------|--|
| | 2024年 1月10日現在 |
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

（重要な後発事象に関する注記）

| |
|-------------|
| 該当事項はありません。 |
|-------------|

（その他の注記）

元本の移動

| | |
|----------------|----------------|
| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 7月11日 |
| 期首元本額 | 3,229,512,028円 |
| 期中追加設定元本額 | 101,618,711円 |
| 期中一部解約元本額 | - 円 |
| 期末元本額 | 3,331,130,739円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 778,057,240円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 2,553,073,499円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

(2024年 1月10日現在)

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
|------|----------|------------|-------|------------|-----------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 25,853,700 | - | 26,917,000 | 1,063,300 |
| 合計 | | 25,853,700 | - | 26,917,000 | 1,063,300 |

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

| | 2024年 1月10日現在 |
|--------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 1,043,228,591 |
| 国債証券 | 551,100,801,670 |
| 地方債証券 | 33,200,281,486 |
| 特殊債券 | 36,932,361,464 |
| 社債券 | 29,540,555,000 |
| 未収入金 | 173,766,220 |
| 未収利息 | 1,020,523,233 |
| 前払費用 | 37,349,705 |
| 流動資産合計 | 653,048,867,369 |
| 資産合計 | 653,048,867,369 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 495,113,900 |
| 未払解約金 | 508,100,019 |
| 未払利息 | 698 |
| 流動負債合計 | 1,003,214,617 |
| 負債合計 | 1,003,214,617 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 484,135,744,291 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 167,909,908,461 |
| 元本等合計 | 652,045,652,752 |
| 純資産合計 | 652,045,652,752 |
| 負債純資産合計 | 653,048,867,369 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 1月10日現在 |
|----------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。 |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 2024年 1月10日現在 | |
|----------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 484,135,744,291口 |
| 2. 担保資産 | 先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 |
| | 有価証券 99,875,000円 |
| 3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.3468円 (1万口当たり純資産額) (13,468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

| 2024年 1月10日現在 | |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|--------------------------|------------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 7月11日 |
| 期首元本額 | 475,920,984,466円 |
| 期中追加設定元本額 | 22,826,718,863円 |
| 期中一部解約元本額 | 14,611,959,038円 |
| 期末元本額 | 484,135,744,291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) | 5,230,184,671円 |
| SBI資産設計オープン(分配型) | 17,079,203円 |
| SMT 国内債券インデックス・オープン | 17,395,534,950円 |
| 世界経済インデックスファンド | 6,395,329,771円 |
| DCマイセレクション25 | 28,555,485,219円 |
| DCマイセレクション50 | 34,693,857,870円 |
| DCマイセレクション75 | 11,009,091,471円 |
| DC日本債券インデックス・オープン | 406,416,872円 |
| DC日本債券インデックス・オープンS | 89,434,702,625円 |
| DC日本債券インデックス・オープンP | 63,467,418,706円 |
| DCマイセレクションS25 | 16,614,232,185円 |
| DCマイセレクションS50 | 19,426,465,853円 |
| DCマイセレクションS75 | 4,926,359,344円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2025 | 474,709,722円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2035 | 2,804,338,211円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2045 | 1,114,795,106円 |
| DC世界経済インデックスファンド | 4,613,712,748円 |
| 国内バランス60VA1(適格機関投資家専用) | 2,110,023円 |
| 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) | 7,880,588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) | 54,602,274円 |
| バランス50VA1(適格機関投資家専用) | 99,348,956円 |

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|-----------------------------------|-----------------|
| バランス25VA2(適格機関投資家専用) | 28,004,800円 |
| バランス50VA2(適格機関投資家専用) | 21,865,148円 |
| バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用) | 2,082,404,896円 |
| バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用) | 720,676,728円 |
| バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用) | 3,073,933,139円 |
| 世界バランスVA1(適格機関投資家専用) | 64,578,191円 |
| 世界バランスVA2(適格機関投資家専用) | 49,386,040円 |
| バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用) | 890,072,388円 |
| バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用) | 989,581,466円 |
| バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用) | 1,318,127,829円 |
| 国内バランス25VA1(適格機関投資家専用) | 92,837,307円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1 | 5,756,787,622円 |
| 日本債券ファンド・シリーズ1 | 18,683,314,125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 |
| DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型) | 298,007,182円 |
| DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型) | 1,829,088,118円 |
| 世界経済インデックスファンド(株式シフト型) | 92,024,305円 |
| 世界経済インデックスファンド(債券シフト型) | 42,826,763円 |
| SMT インデックスバランス・オープン | 66,879,951円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン | 48,166,701円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型) | 107,748,859円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型) | 172,688,446円 |
| SMT 8資産インデックスバランス・オープン | 16,945,210円 |
| グローバル経済コア | 243,925,315円 |
| SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型) | 42,350,110円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2055 | 34,082,812円 |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030 | 136,273,601円 |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040 | 77,288,194円 |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050 | 23,139,861円 |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060 | 16,299,922円 |
| My SMT 国内債券インデックス(ノーロード) | 760,137,921円 |
| 10資産分散投資ファンド | 324,082,693円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 93,423,459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) | 94,427,618,021円 |
| FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用) | 37,784,815円 |
| 私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用) | 15,807,583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) | 468,294,210円 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

貸借対照表

| | 2024年 1月10日現在 |
|----------|----------------|
| 項目 | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 2,136,433,429 |
| コール・ローン | 536,962,937 |
| 国債証券 | 71,042,360,780 |
| 派生商品評価勘定 | 3,613,878 |
| 未収入金 | 756,446,389 |
| 未収利息 | 500,826,619 |
| 前払費用 | 47,724,407 |
| 差入委託証拠金 | 41,248,171 |
| 流動資産合計 | 75,065,616,610 |
| 資産合計 | 75,065,616,610 |

| | 2024年 1月10日現在 |
|-------------|----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 1,279,509,440 |
| 前受金 | 589,974 |
| 未払金 | 2,761,714,804 |
| 未払解約金 | 897,109 |
| 未払利息 | 359 |
| 流動負債合計 | 4,042,711,686 |
| 負債合計 | 4,042,711,686 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 84,699,033,397 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 13,676,128,473 |
| 元本等合計 | 71,022,904,924 |
| 純資産合計 | 71,022,904,924 |
| 負債純資産合計 | 75,065,616,610 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 1月10日現在 |
|------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> |
| 4. 収益及び費用の計上基準 | <p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| | 2024年 1月10日現在 |
|--|--|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 84,699,033,397口 |
| 2. 「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第55条の6第10号に規定する額 | 元本の欠損 13,676,128,473円 |
| 3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 0.8385円 (1万口当たり純資産額) (8,385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

| | 2024年 1月10日現在 |
|----------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|---|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 7月11日 |
| 期首元本額 | 81,289,584,930円 |
| 期中追加設定元本額 | 6,902,374,906円 |
| 期中一部解約元本額 | 3,492,926,439円 |
| 期末元本額 | 84,699,033,397円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 20,252,480,457円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 28,235,905,835円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030 | 1,232,999,502円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040 | 561,560,470円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050 | 124,846,624円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060 | 30,851,498円 |
| 10資産分散投資ファンド | 517,831,059円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 21,521,366円 |
| SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用） | 8,295,048,291円 |
| ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 2,546,629,087円 |
| SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用） | 3,491,298,990円 |
| SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用） | 3,534,104,399円 |
| SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用） | 3,516,144,509円 |
| SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用） | 3,398,707,865円 |
| SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用） | 3,365,017,160円 |
| ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用） | 3,300,519,205円 |
| SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用） | 2,273,567,080円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2024年 1月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|----|----|---------|-------|-----------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|------|--------------|-------------|---|-------------|---------|
| 市場取引 | 債券先物取引 買建 | 393,509,268 | - | 394,099,242 | 589,974 |
| 合計 | | 393,509,268 | - | 394,099,242 | 589,974 |

(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

(2024年 1月10日現在)

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | 時価 | 評価損益 (円) | | |
|---------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|
| | | | (円) | | | |
| 市場取引以外 の取引 | 為替予約取引 売建 | 70,962,797,148 | - | 72,239,282,684 | 1,276,485,536 | |
| | アメリカドル | 33,286,134,941 | - | 34,100,067,144 | 813,932,203 | |
| | カナダドル | 1,453,695,142 | - | 1,472,376,665 | 18,681,523 | |
| | メキシコペソ | 614,055,235 | - | 628,968,071 | 14,912,836 | |
| | ユーロ | 23,282,823,932 | - | 23,550,797,254 | 267,973,322 | |
| | イギリスポンド | 3,800,892,680 | - | 3,882,294,065 | 81,401,385 | |
| | スウェーデンク ローナ | 150,991,884 | - | 150,645,042 | 346,842 | |
| | ノルウェークロー ネ | 128,121,056 | - | 129,348,401 | 1,227,345 | |
| | デンマーククロー ネ | 198,744,750 | - | 200,966,800 | 2,222,050 | |
| | ポーランドズロチ | 375,854,172 | - | 379,851,724 | 3,997,552 | |
| | オーストラリアド ル | 1,008,692,488 | - | 1,011,232,034 | 2,539,546 | |
| | ニュージーランド ドル | 176,680,350 | - | 177,862,212 | 1,181,862 | |
| | シンガポールドル | 301,069,484 | - | 305,388,350 | 4,318,866 | |
| | マレーシアリン ギット | 360,408,430 | - | 364,040,476 | 3,632,046 | |
| | イスラエルシェケ ル | 228,120,053 | - | 226,758,568 | 1,361,485 | |
| | オフショア人民元 | 5,596,512,551 | - | 5,658,685,878 | 62,173,327 | |
| | 合計 | | 70,962,797,148 | - | 72,239,282,684 | 1,276,485,536 |

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

| | 2024年 1月10日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 6,223,756,734 |
| コール・ローン | 523,514,250 |
| 株式 | 616,595,059,312 |
| 投資信託受益証券 | 124,095,710 |
| 投資証券 | 12,692,305,404 |
| 派生商品評価勘定 | 202,838,534 |
| 未収入金 | 2 |
| 未収配当金 | 574,381,163 |
| 差入委託証拠金 | 5,097,282,778 |
| 流動資産合計 | 642,033,233,887 |
| 資産合計 | 642,033,233,887 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 25,947,432 |
| 前受金 | 176,186,253 |
| 未払解約金 | 365,345,324 |
| 未払利息 | 350 |
| 流動負債合計 | 567,479,359 |
| 負債合計 | 567,479,359 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 116,102,138,625 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 525,363,615,903 |
| 元本等合計 | 641,465,754,528 |
| 純資産合計 | 641,465,754,528 |
| 負債純資産合計 | 642,033,233,887 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 1月10日現在 |
|--------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 投資証券</p> |

| 2024年 1月10日現在 | |
|------------------------|--|
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買取場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買取場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> |
| 4. 収益及び費用の計上基準 | <p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 2024年 1月10日現在 | |
|----------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 116,102,138,625口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 5.5250円 (1万口当たり純資産額) (55,250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

| 2024年 1月10日現在 | |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 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。 |

| | |
|--|---------------|
| | 2024年 1月10日現在 |
|--|---------------|

（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 | 2024年 1月10日現在 |
|-------------------------------------|------------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 7月11日 |
| 期首元本額 | 115,556,915,905円 |
| 期中追加設定元本額 | 6,690,164,658円 |
| 期中一部解約元本額 | 6,144,941,938円 |
| 期末元本額 | 116,102,138,625円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| S B I 資産設計オープン（資産成長型） | 1,543,547,194円 |
| S B I 資産設計オープン（分配型） | 5,755,896円 |
| S M T グローバル株式インデックス・オープン | 34,327,670,454円 |
| 世界経済インデックスファンド | 13,098,834,342円 |
| 外国株式インデックス・オープン | 883,796,976円 |
| D Cマイセクション25 | 638,212,510円 |
| D Cマイセクション50 | 3,471,618,382円 |
| D Cマイセクション75 | 4,314,538,701円 |
| D C外国株式インデックス・オープン | 12,800,838,733円 |
| D CマイセクションS25 | 404,444,608円 |
| D CマイセクションS50 | 1,915,489,329円 |
| D CマイセクションS75 | 1,917,828,282円 |
| D Cターゲット・イヤー ファンド2025 | 20,670,015円 |
| D Cターゲット・イヤー ファンド2035 | 141,199,056円 |
| D Cターゲット・イヤー ファンド2045 | 110,807,860円 |
| D C世界経済インデックスファンド | 9,516,896,554円 |
| 外国株式インデックス・オープン（SMA専用） | 981,392,899円 |
| マイセクション50VA1（適格機関投資家専用） | 1,991,576円 |
| マイセクション75VA1（適格機関投資家専用） | 2,927,777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） | 21,870,247円 |
| バランス30VA1（適格機関投資家専用） | 6,815,478円 |
| バランス50VA1（適格機関投資家専用） | 31,698,226円 |
| バランス25VA2（適格機関投資家専用） | 7,179,167円 |
| バランス50VA2（適格機関投資家専用） | 19,214,922円 |
| バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用） | 154,636,052円 |
| バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用） | 129,367,643円 |
| バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用） | 977,202,607円 |
| 世界バランスVA1（適格機関投資家専用） | 65,665,256円 |
| 世界バランスVA2（適格機関投資家専用） | 16,436,629円 |
| バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用） | 112,073,636円 |
| バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用） | 36,645,152円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1 | 784,470,399円 |
| F O F s 用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用） | 826,196,566円 |
| 外国株式ファンド・シリーズ1 | 1,179,852,342円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 127,534,818円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 300,506,762円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 1,570,591,910円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 7,247,527,069円 |
| D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 1,504,255,012円 |
| D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 1,025,254,442円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 136,289,740円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 467,233,637円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 24,402,772円 |
| S M T インデックスバランス・オープン | 116,183,508円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 76,270,162円 |
| 外国株式S M T Bセクション（SMA専用） | 5,162,545,562円 |

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|---|----------------|
| SMT 世界経済インデックス・オープン | 255,290,082円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 1,047,113,165円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 184,884,574円 |
| SMT 8資産インデックスバランス・オープン | 5,496,331円 |
| My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード） | 1,401,125,753円 |
| グローバル経済コア | 545,109,309円 |
| SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型） | 15,057,776円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2055 | 6,919,511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（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 | 148,551,061円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040 | 143,235,739円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050 | 63,153,289円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060 | 74,696,983円 |
| 10資産分散投資ファンド | 51,501,891円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 3,362,626円 |
| DC世界経済インデックスファンド（株式特化型） | 50,271円 |
| FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用） | 54,746,482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） | 202,281,089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） | 624,553,312円 |
| 世界株式ファンド（適格機関投資家専用） | 1,440,791,018円 |
| FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 98,456,911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） | 84,028,319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） | 82,557,494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

（2024年 1月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|----------|----------------|-------|----------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 11,691,600,462 | - | 11,867,786,715 | 176,186,253 |
| 合計 | | 11,691,600,462 | - | 11,867,786,715 | 176,186,253 |

（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購入しております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2024年 1月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|--------|-------------|-------|-------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 138,172,800 | - | 138,880,704 | 707,904 |

| | | | | | |
|--|--------|-------------|---|-------------|---------|
| | アメリカドル | 138,172,800 | - | 138,880,704 | 707,904 |
| | 売建 | 94,016,000 | - | 94,019,055 | 3,055 |
| | アメリカドル | 94,016,000 | - | 94,019,055 | 3,055 |
| | 合計 | 232,188,800 | - | 232,899,759 | 704,849 |

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国株式最小分散インデックスマザーファンド

貸借対照表

| 2024年 1月10日現在 | |
|---------------|----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 487,444,340 |
| コール・ローン | 5,832,473 |
| 株式 | 17,115,544,661 |
| 投資信託受益証券 | 27,344,823 |
| 投資証券 | 60,470,140 |
| 派生商品評価勘定 | 9,994,892 |
| 未収配当金 | 16,396,557 |
| 差入委託証拠金 | 117,740,351 |
| 流動資産合計 | 17,840,768,237 |
| 資産合計 | 17,840,768,237 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 前受金 | 9,994,892 |
| 未払利息 | 3 |
| 流動負債合計 | 9,994,895 |
| 負債合計 | 9,994,895 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 9,026,265,721 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 8,804,507,621 |
| 元本等合計 | 17,830,773,342 |
| 純資産合計 | 17,830,773,342 |
| 負債純資産合計 | 17,840,768,237 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 2024年 1月10日現在 | |
|-------------------|--|
| 1.有価証券の評価基準及び評価方法 | (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 |

| 2024年 1月10日現在 | |
|-----------------------|--|
| | <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（金融商品取引所等の上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> |
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p> |
| 3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> |
| 4.収益及び費用の計上基準 | <p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 2024年 1月10日現在 | |
|----------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 9,026,265,721口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.9754円 (19,754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

| 2024年 1月10日現在 | |
|---------------------|--|
| 1.貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2.時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> |

| | 2024年 1月10日現在 |
|----------------------------|--|
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|----------------------------|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 7月11日 |
| 期首元本額 | 10,057,036,381円 |
| 期中追加設定元本額 | 48,725,456円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,079,496,116円 |
| 期末元本額 | 9,026,265,721円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 1,247,748,012円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 5,678,114,753円 |
| マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用） | 2,100,402,956円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 1月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|----------------|-------------|-------|-------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | 397,666,820 | - | 407,661,712 | 9,994,892 |
| 合計 | | 397,666,820 | - | 407,661,712 | 9,994,892 |

(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。

- 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。
- 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。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

| | 2024年 1月10日現在 |
|------|---------------|
| 項目 | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |

| | 2024年 1月10日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 預金 | 1,928,084,822 |
| コール・ローン | 2,177,478,014 |
| 国債証券 | 298,031,191,517 |
| 派生商品評価勘定 | 23,217,902 |
| 未収入金 | 183,732 |
| 未収利息 | 2,194,849,297 |
| 前払金 | 9,709,976 |
| 前払費用 | 199,673,307 |
| 差入委託証拠金 | 240,348,180 |
| 流動資産合計 | 304,804,736,747 |
| 資産合計 | 304,804,736,747 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 15,692,933 |
| 未払金 | 1,451,240,666 |
| 未払解約金 | 132,284,419 |
| 未払利息 | 1,458 |
| 流動負債合計 | 1,599,219,476 |
| 負債合計 | 1,599,219,476 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 89,212,965,941 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 213,992,551,330 |
| 元本等合計 | 303,205,517,271 |
| 純資産合計 | 303,205,517,271 |
| 負債純資産合計 | 304,804,736,747 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 1月10日現在 |
|------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> |
| 4. 収益及び費用の計上基準 | <p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> |

| | |
|--|--------------------------------------|
| | 2024年 1月10日現在 |
| | (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）

| | |
|--------------------------------|---|
| | 2024年 1月10日現在 |
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 89,212,965,941口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産 の額 | 1口当たり純資産額 3.3987円 (1万口当たり純資産額) (33,987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

| | |
|--------------------------------|--|
| | 2024年 1月10日現在 |
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差 額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額 によっております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項につ いての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前 提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引におけ る名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引 のリスクの大きさを示すものではありません。 |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|------------------------|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 7月11日 |
| 期首元本額 | 86,522,070,708円 |
| 期中追加設定元本額 | 6,617,520,265円 |
| 期中一部解約元本額 | 3,926,625,032円 |
| 期末元本額 | 89,212,965,941円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| 外国債券オープン（毎月決算型） | 1,135,980,167円 |
| グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型） | 511,634,254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） | 2,413,313,731円 |
| SBI資産設計オープン（分配型） | 8,791,077円 |
| SMT グローバル債券インデックス・オープン | 8,657,738,338円 |
| 世界経済インデックスファンド | 19,297,072,124円 |
| DCマイセクション25 | 1,960,628,530円 |
| DCマイセクション50 | 1,765,979,085円 |
| DCマイセクション75 | 1,372,638,967円 |
| DC外国債券インデックス・オープン | 2,250,893,389円 |
| DCマイセクションS25 | 1,061,425,783円 |
| DCマイセクションS50 | 971,158,780円 |
| DCマイセクションS75 | 547,219,754円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2025 | 16,145,034円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2035 | 100,392,609円 |

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|-----------------------------------|-----------------|
| DCターゲット・イヤー ファンド2045 | 54,146,340円 |
| DC世界経済インデックスファンド | 14,016,977,635円 |
| 外国債券インデックス・オープン(SMA専用) | 666,167,727円 |
| マイセクション50VA1(適格機関投資家専用) | 1,028,294円 |
| マイセクション75VA1(適格機関投資家専用) | 940,568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) | 15,953,582円 |
| バランス30VA1(適格機関投資家専用) | 25,552,120円 |
| バランス50VA1(適格機関投資家専用) | 49,320,829円 |
| バランス25VA2(適格機関投資家専用) | 55,345,956円 |
| バランス50VA2(適格機関投資家専用) | 49,382,939円 |
| バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用) | 819,478,023円 |
| バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用) | 376,289,717円 |
| バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用) | 1,532,206,222円 |
| 世界バランスVA1(適格機関投資家専用) | 53,180,661円 |
| 世界バランスVA2(適格機関投資家専用) | 31,056,146円 |
| バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用) | 356,154,717円 |
| バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用) | 131,348,565円 |
| バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用) | 176,683,249円 |
| FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用) | 640,045,294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) | 1,500,904,192円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1 | 628,988,584円 |
| 外国債券ファンド・シリーズ1 | 780,773,819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 |
| DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型) | 719,749,703円 |
| DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型) | 4,446,013,758円 |
| 世界経済インデックスファンド(株式シフト型) | 226,484,144円 |
| 世界経済インデックスファンド(債券シフト型) | 104,493,736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) | 1,341,615,655円 |
| SMT インデックスバランス・オープン | 165,331,326円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン | 374,470,320円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型) | 500,751,898円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型) | 802,176,612円 |
| SMT 8資産インデックスバランス・オープン | 7,761,949円 |
| グローバル経済コア | 807,950,551円 |
| SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型) | 21,245,069円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2055 | 2,569,587円 |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030 | 55,504,820円 |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040 | 75,925,709円 |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050 | 37,904,308円 |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060 | 49,101,200円 |
| My SMT グローバル債券インデックス(ノーロード) | 450,280,127円 |
| 10資産分散投資ファンド | 26,154,155円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 5,350,579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) | 12,251,075,268円 |
| FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用) | 179,614,536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) | 123,718,945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) | 129,757,862円 |

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2024年 1月10日現在)

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | 時価 | 評価損益 |
|------|--------|---------------|-----|-----------|
| | | | (円) | |
| 市場取引 | 債券先物取引 | | | |
| | 買建 | 1,875,270,416 | - | 9,709,976 |
| 合計 | | 1,875,270,416 | - | 9,709,976 |

(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。

- 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。
- 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。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2024年 1月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|----------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 2,027,272,353 | - | 2,044,507,298 | 17,234,945 |
| | アメリカドル | 992,384,214 | - | 1,003,205,454 | 10,821,240 |
| | カナダドル | 83,616,131 | - | 84,238,596 | 622,465 |
| | ユーロ | 652,441,964 | - | 656,061,465 | 3,619,501 |
| | イギリスポンド | 118,136,814 | - | 119,466,165 | 1,329,351 |
| | オフショア人民元 | 180,693,230 | - | 181,535,618 | 842,388 |
| 合計 | | 2,027,272,353 | - | 2,044,507,298 | 17,234,945 |

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

| | 2024年 1月10日現在 |
|----------|-----------------|
| 項目 | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 4,381,752,166 |
| コール・ローン | 173,768,052 |
| 株式 | 159,759,287,222 |
| 投資信託受益証券 | 516,968,842 |
| 投資証券 | 179,833,761 |
| 派生商品評価勘定 | 35,160,857 |
| 未収配当金 | 254,651,845 |
| 差入委託証拠金 | 1,247,389,141 |
| 流動資産合計 | 166,548,811,886 |
| 資産合計 | 166,548,811,886 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 30,842,120 |
| 前受金 | 3,950,037 |
| 未払金 | 2,555 |
| 未払解約金 | 96,055,545 |
| 未払利息 | 116 |
| 流動負債合計 | 130,850,373 |
| 負債合計 | 130,850,373 |

| | 2024年 1月10日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 42,594,762,792 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 123,823,198,721 |
| 元本等合計 | 166,417,961,513 |
| 純資産合計 | 166,417,961,513 |
| 負債純資産合計 | 166,548,811,886 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 1月10日現在 |
|------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> |
| 4. 収益及び費用の計上基準 | <p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| | 2024年 1月10日現在 | |
|----------------------------|---------------------------|----------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | | 42,594,762,792口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 3.9070円 (39,070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

| | 2024年 1月10日現在 | |
|----------------------------|--|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 | |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|-----------------------------|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 7月11日 |
| 期首元本額 | 41,095,182,350円 |
| 期中追加設定元本額 | 3,314,747,436円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,815,166,994円 |
| 期末元本額 | 42,594,762,792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 | 7,600,699,446円 |
| 世界経済インデックスファンド | 10,231,694,652円 |
| DC 新興国株式インデックス・オープン | 6,123,855,601円 |
| DC 世界経済インデックスファンド | 7,404,783,709円 |
| 新興国株式インデックス・オープン（SMA専用） | 90,968,223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 |
| DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 1,196,610,841円 |
| DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 792,515,366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） | 372,294,889円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 18,559,147円 |
| SMT インデックスバランス・オープン | 88,957,302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） | 2,400,016,682円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン | 247,612,603円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 1,048,139,680円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 179,024,201円 |
| SMT 8資産インデックスバランス・オープン | 6,775,939円 |

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|------------------------------------|----------------|
| グローバル経済コア | 426,516,958円 |
| My SMT 新興国株式インデックス(ノーロード) | 263,984,347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 | 99,907,570円 |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040 | 96,388,058円 |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050 | 42,514,515円 |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060 | 50,325,511円 |
| 10資産分散投資ファンド | 13,165,097円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 4,623,924円 |
| DC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) | 1,476,881,648円 |
| FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用) | 95,144,680円 |
| 私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用) | 81,304,532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) | 12,382,492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) | 23,117,247円 |

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2024年 1月10日現在)

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|----------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 5,934,483,500 | - | 5,938,433,537 | 3,950,037 |
| 合計 | | 5,934,483,500 | - | 5,938,433,537 | 3,950,037 |

(注)1.時価の算定方法

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2024年 1月10日現在)

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|--------|------------|-------|------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 71,965,000 | - | 72,333,700 | 368,700 |
| | アメリカドル | 71,965,000 | - | 72,333,700 | 368,700 |
| 合計 | | 71,965,000 | - | 72,333,700 | 368,700 |

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

| | 2024年 1月10日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 1,593,130,718 |
| コール・ローン | 1,481,572,635 |
| 国債証券 | 122,690,858,474 |
| 派生商品評価勘定 | 60,840 |
| 未収入金 | 1,678,183,668 |
| 未収利息 | 1,588,014,498 |
| 前払費用 | 111,802,495 |
| 流動資産合計 | 129,143,623,328 |
| 資産合計 | 129,143,623,328 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 1,847,304 |
| 未払金 | 2,682,284,980 |
| 未払解約金 | 37,916,343 |
| 未払利息 | 992 |
| 流動負債合計 | 2,722,049,619 |
| 負債合計 | 2,722,049,619 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 57,873,516,333 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 68,548,057,376 |
| 元本等合計 | 126,421,573,709 |
| 純資産合計 | 126,421,573,709 |
| 負債純資産合計 | 129,143,623,328 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 2024年 1月10日現在 |
|------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p> |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> |
| 4. 収益及び費用の計上基準 | <p>為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| | 2024年 1月10日現在 |
|----------------------------|--|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 57,873,516,333口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.1844円 (21,844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

| | 2024年 1月10日現在 |
|----------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|--------------------------------|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 7月11日 |
| 期首元本額 | 53,714,392,724円 |
| 期中追加設定元本額 | 5,323,540,906円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,164,417,297円 |
| 期末元本額 | 57,873,516,333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 | 5,160,915,755円 |
| 世界経済インデックスファンド | 19,889,706,879円 |
| DC新興国債券インデックス・オープン | 5,870,644,747円 |
| DC世界経済インデックスファンド | 14,496,365,094円 |
| 新興国債券インデックス・オープン（SMA専用） | 8,844,362円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 395,863,625円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 1,042,725,547円 |
| DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 742,195,143円 |
| DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 4,593,035,399円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 235,294,462円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 108,220,080円 |
| SMT インデックスバランス・オープン | 171,998,176円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン | 481,298,990円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 642,630,801円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 1,029,178,589円 |
| SMT 8資産インデックスバランス・オープン | 13,202,323円 |
| グローバル経済コア | 836,098,283円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030 | 97,111,711円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040 | 83,894,556円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050 | 35,071,533円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060 | 39,691,937円 |
| My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード） | 174,648,315円 |
| 10資産分散投資ファンド | 42,829,933円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 8,354,133円 |
| FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 234,020,558円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 159,463,292円 |

| 区分 | 2024年 1月10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） | 22,528,561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）

通貨関連

（2024年 1月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 556,797,074 | - | 555,709,770 | 1,087,304 |
| | チェココルナ | 45,010,000 | - | 45,017,000 | 7,000 |
| | ポーランドズロチ | 102,155,760 | - | 101,832,360 | 323,400 |
| | ルーマニアレイ | 104,975,244 | - | 104,926,800 | 48,444 |
| | マレーシアリンギット | 102,821,070 | - | 102,569,610 | 251,460 |
| | オフショア人民元 | 201,835,000 | - | 201,364,000 | 471,000 |
| | 売建 | 288,272,000 | - | 288,971,160 | 699,160 |
| | メキシコペソ | 254,856,000 | - | 255,609,000 | 753,000 |
| | ハンガリーフォリント | 33,416,000 | - | 33,362,160 | 53,840 |
| 合計 | 845,069,074 | - | 844,680,930 | 1,786,464 | |

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

| | 2024年 1月10日現在 |
|----------|-----------------|
| 項目 | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 2,878,006,991 |
| 投資証券 | 114,351,579,700 |
| 派生商品評価勘定 | 21,202,600 |
| 未収入金 | 250,762,348 |
| 未収配当金 | 1,127,809,461 |
| 差入委託証拠金 | 212,949,582 |
| 流動資産合計 | 118,842,310,682 |
| 資産合計 | 118,842,310,682 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |

| | 2024年 1月10日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 前受金 | 21,267,280 |
| 未払金 | 272,542,827 |
| 未払解約金 | 337,604,022 |
| 未払利息 | 1,927 |
| 流動負債合計 | 631,416,056 |
| 負債合計 | 631,416,056 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 56,169,850,329 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 62,041,044,297 |
| 元本等合計 | 118,210,894,626 |
| 純資産合計 | 118,210,894,626 |
| 負債純資産合計 | 118,842,310,682 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 1月10日現在 |
|----------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。 |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | (1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | 2024年 1月10日現在 |
|----------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 56,169,850,329口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 2.1045円 (1万口当たり純資産額) (21,045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

| | 2024年 1月10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 |

| 2024年 1月10日現在 | |
|----------------------------|---|
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|-------------------------------------|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 7月11日 |
| 期首元本額 | 64,657,212,453円 |
| 期中追加設定元本額 | 6,172,788,822円 |
| 期中一部解約元本額 | 14,660,150,946円 |
| 期末元本額 | 56,169,850,329円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| SBI資産設計オープン（資産成長型） | 1,875,326,865円 |
| SBI資産設計オープン（分配型） | 6,591,283円 |
| SMT J-REITインデックス・オープン | 17,242,939,542円 |
| Jリートインデックス・オープン（SMA専用） | 27,123,167,347円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 1,011,513,433円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 1,637,547,155円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 1,017,119,866円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 1,879,598,173円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 737,523,051円 |
| SMT インデックスバランス・オープン | 22,253,081円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 211,531,584円 |
| SMT 8資産インデックスバランス・オープン | 12,226,216円 |
| グローバル経済コア | 286,306,470円 |
| SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型） | 15,168,332円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 526,962,705円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 132,020,059円 |
| My SMT J-REITインデックス（ノーロード） | 559,507,264円 |
| 10資産分散投資ファンド | 23,176,847円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 8,537,615円 |
| FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用） | 345,199,684円 |
| FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 8,591,104円 |
| SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用） | 627,179,319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） | 70,914,324円 |
| J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用） | 508,588,864円 |
| J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用） | 280,360,146円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2024年 1月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
|------|-------------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 不動産投信指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 3,819,649,720 | - | 3,840,917,000 | 21,267,280 |
| | 合計 | 3,819,649,720 | - | 3,840,917,000 | 21,267,280 |

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

| | 2024年 1月10日現在 |
|--------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 407,776,807 |
| コール・ローン | 241,890,715 |
| 投資証券 | 109,834,664,714 |
| 派生商品評価勘定 | 174,172 |
| 未収入金 | 4,729,675,532 |
| 未収配当金 | 456,617,412 |
| 流動資産合計 | 115,670,799,352 |
| 資産合計 | 115,670,799,352 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 196,421 |
| 未払解約金 | 199,118,514 |
| 未払利息 | 162 |
| 流動負債合計 | 199,315,097 |
| 負債合計 | 199,315,097 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 41,523,811,942 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 73,947,672,313 |
| 元本等合計 | 115,471,484,255 |
| 純資産合計 | 115,471,484,255 |
| 負債純資産合計 | 115,670,799,352 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 1月10日現在 |
|------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p> |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> |

| 2024年 1月10日現在 | |
|----------------|---|
| 4. 収益及び費用の計上基準 | (1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 2024年 1月10日現在 | |
|----------------------------|--|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 41,523,811,942口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.7808円 (27,808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

| 2024年 1月10日現在 | |
|----------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|----------------------------|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 7月11日 |
| 期首元本額 | 35,682,145,567円 |
| 期中追加設定元本額 | 8,175,585,509円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,333,919,134円 |
| 期末元本額 | 41,523,811,942円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| グローバル3資産バランスオープン | 53,226,984円 |
| ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型） | 92,963,651円 |
| SBI資産設計オープン（資産成長型） | 1,541,388,294円 |
| SBI資産設計オープン（分配型） | 5,560,446円 |
| SMT グローバルREITインデックス・オープン | 11,435,414,052円 |
| グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用） | 19,962,383,097円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 456,960,323円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 1,244,870,344円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 1,006,149,778円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 1,578,869,574円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 563,037,443円 |

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|---|----------------|
| SMT インデックスバランス・オープン | 104,096,247円 |
| サテライト投資戦略ファンド(株式型) | 162,214,836円 |
| SMT 8資産インデックスバランス・オープン | 10,092,574円 |
| グローバル経済コア | 242,001,203円 |
| SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型) | 14,308,483円 |
| コア投資戦略ファンド(切替型ワイド) | 416,896,905円 |
| コア投資戦略ファンド(積極成長型) | 106,064,560円 |
| My SMT グローバルREITインデックス(ノーロード) | 179,153,327円 |
| 10資産分散投資ファンド | 12,821,285円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 6,843,850円 |
| グローバルリートインデックス・オープン(適格機関投資家専用) | 1,320,062,810円 |
| FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用) | 215,320,761円 |
| FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用) | 77,018,615円 |
| ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド(適格機関投資家専用) | 61,280,541円 |
| ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用) | 51,202,353円 |
| SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用) | 95,120,470円 |
| SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用) | 92,759,157円 |
| SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用) | 92,287,825円 |
| SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用) | 92,598,015円 |
| SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用) | 91,680,030円 |
| ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11(適格機関投資家専用) | 79,493,312円 |
| SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用) | 59,670,797円 |

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

(2024年 1月10日現在)

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|-----------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 38,932,210 | - | 39,100,042 | 167,832 |
| | アメリカドル | 21,589,500 | - | 21,700,110 | 110,610 |
| | ユーロ | 17,342,710 | - | 17,399,932 | 57,222 |
| | 売建 | 4,825,762,070 | - | 4,825,952,151 | 190,081 |
| | アメリカドル | 3,760,640,000 | - | 3,760,762,200 | 122,200 |
| | カナダドル | 70,240,300 | - | 70,238,610 | 1,690 |
| | ユーロ | 185,035,500 | - | 185,050,008 | 14,508 |
| | イギリスポンド | 248,258,250 | - | 248,271,345 | 13,095 |
| | オーストラリアドル | 300,011,800 | - | 300,007,150 | 4,650 |
| | 香港ドル | 87,704,220 | - | 87,712,278 | 8,058 |
| | シンガポールドル | 173,872,000 | - | 173,910,560 | 38,560 |
| 合計 | | 4,864,694,280 | - | 4,865,052,193 | 22,249 |

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

貸借対照表

| | 2024年 1月10日現在 |
|-------------|----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 670,533,762 |
| コール・ローン | 114,796,183 |
| 投資信託受益証券 | 28,638,946,619 |
| 流動資産合計 | 29,424,276,564 |
| 資産合計 | 29,424,276,564 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 273,757,496 |
| 未払金 | 669,086,862 |
| 未払解約金 | 39,750,705 |
| 未払利息 | 76 |
| 流動負債合計 | 982,595,139 |
| 負債合計 | 982,595,139 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 22,496,456,140 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 5,945,225,285 |
| 元本等合計 | 28,441,681,425 |
| 純資産合計 | 28,441,681,425 |
| 負債純資産合計 | 29,424,276,564 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 1月10日現在 |
|------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 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。 |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。 |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。 |
| 4. 収益及び費用の計上基準 | 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| | 2024年 1月10日現在 |
|----------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 22,496,456,140口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.2643円 (1万口当たり純資産額) (12,643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

| | 2024年 1月10日現在 |
|----------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|--------------------------------|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 7月11日 |
| 期首元本額 | 24,854,962,097円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,795,501,812円 |
| 期中一部解約元本額 | 4,154,007,769円 |
| 期末元本額 | 22,496,456,140円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 1,624,197,759円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 2,655,968,565円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 2,114,521,968円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 7,673,402,803円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 1,204,574,837円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 316,330,899円 |
| グローバル経済コア | 1,415,391,547円 |
| SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり） | 3,280,298,526円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 719,469,911円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 183,841,968円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 14,368,671円 |
| FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 571,213,355円 |
| SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用） | 652,713,959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） | 70,161,372円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年 1月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|--------|----------------|-------|----------------|-------------|
| | | | | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | 28,238,167,393 | - | 28,511,924,889 | 273,757,496 |
| | アメリカドル | 28,238,167,393 | - | 28,511,924,889 | 273,757,496 |

| | | | | |
|----|----------------|---|----------------|-------------|
| 合計 | 28,238,167,393 | - | 28,511,924,889 | 273,757,496 |
|----|----------------|---|----------------|-------------|

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

HFリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

| | 2024年 1月10日現在 |
|--------------|---------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 10,514,725 |
| コール・ローン | 1,722,010,725 |
| 国債証券 | 2,801,307,600 |
| 投資信託受益証券 | 1,035,766,831 |
| 派生商品評価勘定 | 83,624,981 |
| 未収入金 | 197,307,013 |
| 差入委託証拠金 | 1,533,642,802 |
| 流動資産合計 | 7,384,174,677 |
| 資産合計 | 7,384,174,677 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 63,977,362 |
| 前受金 | 19,663,411 |
| 未払金 | 7,021,888 |
| 未払利息 | 1,153 |
| 流動負債合計 | 90,663,814 |
| 負債合計 | 90,663,814 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 8,178,964,186 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 885,453,323 |
| 元本等合計 | 7,293,510,863 |
| 純資産合計 | 7,293,510,863 |
| 負債純資産合計 | 7,384,174,677 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 2024年 1月10日現在 |
|--------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> |

| 2024年 1月10日現在 | |
|------------------------|--|
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>(1)先物取引 株価指数先物取引及び債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> |
| 4. 収益及び費用の計上基準 | <p>(1)受取配当金 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 2024年 1月10日現在 | | |
|--|---------------------------|---------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | | 8,178,964,186口 |
| 2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額 | 元本の欠損 | 885,453,323円 |
| 3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.8917円 (8,917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

| 2024年 1月10日現在 | |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|----------------|----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 7月11日 |
| 期首元本額 | 8,130,578,453円 |
| 期中追加設定元本額 | 655,539,893円 |
| 期中一部解約元本額 | 607,154,160円 |
| 期末元本額 | 8,178,964,186円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 3,497,633,373円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 4,681,330,813円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 1月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|----------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 3,423,960,047 | - | 3,503,242,049 | 79,282,002 |
| | 売建 | 1,518,400,118 | - | 1,539,020,269 | 20,620,151 |
| 合計 | | 4,942,360,165 | - | 5,042,262,318 | 58,661,851 |

(注)1.時価の算定方法

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

債券関連

（2024年 1月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|--------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 債券先物取引 | | | | |
| | 売建 | 1,580,173,091 | - | 1,619,171,531 | 38,998,440 |
| 合計 | | 1,580,173,091 | - | 1,619,171,531 | 38,998,440 |

(注)1.時価の算定方法

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（2024年 1月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|--------|-------------|-------|-------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 315,507,393 | - | 315,486,704 | 20,689 |

| | | | | | |
|--|----------------|---------------|---|---------------|--------|
| | カナダドル | 62,168,061 | - | 62,166,674 | 1,387 |
| | ユーロ | 224,663,448 | - | 224,654,749 | 8,699 |
| | スウェーデンク ローナ | 28,675,884 | - | 28,665,281 | 10,603 |
| | 売建 | 3,143,261,280 | - | 3,143,256,383 | 4,897 |
| | アメリカドル | 2,850,192,962 | - | 2,850,173,235 | 19,727 |
| | イギリスポンド | 88,564,498 | - | 88,568,224 | 3,726 |
| | スイスフラン | 204,503,820 | - | 204,514,924 | 11,104 |
| | 合計 | 3,458,768,673 | - | 3,458,743,087 | 15,792 |

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

GBCAマザーファンド（ミドルリスク型）

貸借対照表

| | 2024年 1月10日現在 |
|-------------|----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 5,644,944,064 |
| 国債証券 | 11,705,444,200 |
| 派生商品評価勘定 | 244,997,037 |
| 未収入金 | 135,256,481 |
| 差入委託証拠金 | 2,376,865,996 |
| 流動資産合計 | 20,107,507,778 |
| 資産合計 | 20,107,507,778 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 181,967,662 |
| 前受金 | 97,238,554 |
| 未払金 | 78,195,419 |
| 未払解約金 | 60,366 |
| 未払利息 | 3,781 |
| 流動負債合計 | 357,465,782 |
| 負債合計 | 357,465,782 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 17,993,868,192 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 1,756,173,804 |
| 元本等合計 | 19,750,041,996 |
| 純資産合計 | 19,750,041,996 |
| 負債純資産合計 | 20,107,507,778 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 2024年 1月10日現在 |
|--------------------|---------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 国債証券 |

| 2024年 1月10日現在 | |
|------------------------|--|
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段（外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場）によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p> |
| 4. 収益及び費用の計上基準 | <p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 2024年 1月10日現在 | |
|----------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 17,993,868,192口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1口当たり純資産額 1.0976円 (1万口当たり純資産額) (10,976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

| 2024年 1月10日現在 | |
|----------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 2024年 1月10日現在 |
|---|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 7月11日 |
| 期首元本額 | 18,037,415,789円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,842,057,040円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,885,604,637円 |
| 期末元本額 | 17,993,868,192円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 344,838,529円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 470,003,414円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 3,027,614,598円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 6,382,953,534円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 226,527,080円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 135,075,942円 |
| ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用） | 6,822,564,896円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 82,859,039円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 20,385,380円 |
| SMTAM・FOFs用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド（4%目標コース）（適格機関投資家専用） | 201,058,139円 |
| FOFs用GBCAファンドS（ミドルリスク型）（適格機関投資家専用） | 279,987,641円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2024年 1月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|--------|----------------|-------|----------------|-------------|
| | | | | | |
| 市場取引 | 債券先物取引 | | | | |
| | 買建 | 5,536,990,000 | - | 5,587,140,000 | 50,150,000 |
| | 売建 | 16,196,516,292 | - | 16,149,427,738 | 47,088,554 |
| 合計 | | 21,733,506,292 | - | 21,736,567,738 | 97,238,554 |

(注)1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段(外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場)で評価しております。

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 外貨建先物取引は、計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2024年 1月10日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|-----------|------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 8,228,941,935 | - | 8,289,672,243 | 60,730,308 |
| | アメリカドル | 2,634,199,232 | - | 2,672,371,644 | 38,172,412 |
| | カナダドル | 1,035,662,293 | - | 1,051,146,477 | 15,484,184 |
| | スウェーデンクローナ | 2,990,667,131 | - | 2,996,526,149 | 5,859,018 |
| | オーストラリアドル | 1,568,413,279 | - | 1,569,627,973 | 1,214,694 |

| | | | | | |
|--|------------|----------------|---|----------------|------------|
| | 売建 | 7,370,171,599 | - | 7,465,098,546 | 94,926,947 |
| | ユーロ | 1,525,157,251 | - | 1,539,452,177 | 14,294,926 |
| | イギリスポンド | 1,552,054,829 | - | 1,567,396,080 | 15,341,251 |
| | スイスフラン | 3,710,278,320 | - | 3,771,021,470 | 60,743,150 |
| | ノルウェークローネ | 235,516,232 | - | 237,200,411 | 1,684,179 |
| | ニュージーランドドル | 347,164,967 | - | 350,028,408 | 2,863,441 |
| | 合計 | 15,599,113,534 | - | 15,754,770,789 | 34,196,639 |

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

4【委託会社等の概況】

（１）【資本金の額】

| | |
|---------------------|---------|
| 2024年 1月31日現在の資本金の額 | 20億円 |
| 発行可能株式総数 | 12,000株 |
| 発行済株式総数 | 3,000株 |

（２）【事業の内容及び営業の状況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2024年 1月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きま
す。）は次の通りです。

| | 本数（本） | 純資産総額（百万円） |
|------------|-------|------------|
| 追加型株式投資信託 | 540 | 14,616,414 |
| 追加型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 単位型株式投資信託 | 63 | 219,430 |
| 単位型公社債投資信託 | 51 | 176,359 |
| 合計 | 654 | 15,012,203 |

（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 4月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

5【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第37期事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第38期事業年度の中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

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

| | (単位：百万円) | |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 前事業年度 (2022年3月31日) | 当事業年度 (2023年3月31日) |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 47 | 49 |
| 未払金 | 8,285 | 7,174 |
| 未払収益分配金 | 0 | 0 |
| 未払手数料 | 4,561 | 4,586 |
| その他未払金 | 3,723 | 2,588 |
| 未払費用 | 1,049 | 1,089 |
| 未払法人税等 | 504 | 726 |
| 賞与引当金 | 578 | 613 |
| その他 | 1,958 | 303 |
| 流動負債合計 | 12,423 | 9,958 |
| 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 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,000 | 2,000 |
| 資本剰余金 | | |
| その他資本剰余金 | 17,239 | 17,239 |
| 資本剰余金合計 | 17,239 | 17,239 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 500 | 500 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 2,100 | 2,100 |
| 繰越利益剰余金 | 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 |
| 負債・純資産合計 | 77,629 | 77,179 |

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

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

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

（3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

| | 株主資本 | | | | 株主資本合計 |
|-------------------------|-------|-------------|--------|-------------|--------|
| | 利益剰余金 | | | 利益剰余金 合計 | |
| | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | | |
| 別途積立金 | | 繰越利益 剰余金 | | | |
| 当期首残高 | 500 | 2,100 | 41,948 | 44,548 | 63,788 |
| 当期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | 2,641 | 2,641 | 2,641 |
| 当期純利益 | | | 5,448 | 5,448 | 5,448 |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | | | | | |
| 当期変動額合計 | - | - | 2,807 | 2,807 | 2,807 |
| 当期末残高 | 500 | 2,100 | 44,755 | 47,355 | 66,595 |

| | 評価・換算差額等 | | | 純資産合計 |
|-------------------------|------------------|---------|------------|--------|
| | その他有価証券 評価差額金 | 繰延ヘッジ損益 | 評価・換算差額等合計 | |
| 当期首残高 | 941 | 509 | 431 | 64,219 |
| 当期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | 2,641 |
| 当期純利益 | | | | 5,448 |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | 891 | 0 | 891 | 891 |
| 当期変動額合計 | 891 | 0 | 891 | 1,915 |
| 当期末残高 | 49 | 510 | 460 | 66,134 |

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定してあります。）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理

なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当事業年度末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。

7. 収益及び費用の計上基準

当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる財務諸表への影響はありません。

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

(表示方法の変更)

(貸借対照表関係)

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

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

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|---------|----|----|--------|
| 普通株式（株） | 3,000 | - | - | 3,000 |

2. 自己株式に関する事項
該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額(百万円) | 1株当たり配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|-------|-------------|-------------|------------|------------|
| 2021年6月23日 定時株主総会 | 普通株式 | 2,797 | 932,488 | 2021年3月31日 | 2021年6月24日 |

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額(百万円) | 配当金の原資 | 1株当たり配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|-------|-------------|--------|-------------|------------|------------|
| 2022年6月23日 定時株主総会 | 普通株式 | 2,641 | 利益剰余金 | 880,447 | 2022年3月31日 | 2022年6月24日 |

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|---------|----|----|--------|
| 普通株式（株） | 3,000 | - | - | 3,000 |

2. 自己株式に関する事項
該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額(百万円) | 1株当たり配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|-------|-------------|-------------|------------|------------|
| 2022年6月23日 定時株主総会 | 普通株式 | 2,641 | 880,447 | 2022年3月31日 | 2022年6月24日 |

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2023年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額(百万円) | 配当金の原資 | 1株当たり配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|-------|-------------|--------|-------------|------------|------------|
| 2023年6月22日 定時株主総会 | 普通株式 | 3,367 | 利益剰余金 | 1,122,459 | 2023年3月31日 | 2023年6月26日 |

(リ - ス取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針 8 .ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。
デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（（1）*2、*3及び（注2）参照）。

また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

- レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

（1）時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債 前事業年度（2022年3月31日）

| 区 分 | 貸借対照表計上額（百万円）（*1、*2） | | | |
|------------------|----------------------|-------|------|---------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| 金銭の信託(*3) | - | 196 | - | 196 |
| 資産計 | - | 196 | - | 196 |
| デリバティブ取引(*4) | | | | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | (1,333) | (80) | - | (1,413) |
| ヘッジ会計が適用されているもの | - | (71) | - | (71) |
| デリバティブ取引計 | (1,333) | (151) | - | (1,485) |

(*1) 負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

(*2) 投資有価証券のうち、投資信託（貸借対照表計上額6,474百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額133百万円）は上記に含めておりません。

(*3) 金銭の信託の信託財産のうち、投資信託（貸借対照表計上額13,876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額840百万円）は上記に含めておりません。これらも含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,913百万円であります。

(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2023年3月31日）

| 区 分 | 貸借対照表計上額（百万円）（*1） | | | |
|--------------|-------------------|--------|------|--------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| 金銭の信託(*2) | 1,029 | 12,703 | - | 13,733 |
| 投資有価証券(*3) | | | | |
| 其他有価証券 | - | 3,844 | - | 3,844 |
| 資産計 | 1,029 | 16,547 | - | 17,577 |
| デリバティブ取引(*4) | | | | |

| | | | | |
|------------------|------|-------|---|-------|
| ヘッジ会計が適用されていないもの | (10) | (48) | - | (58) |
| ヘッジ会計が適用されているもの | - | (88) | - | (88) |
| デリバティブ取引計 | (10) | (136) | - | (147) |

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額は960百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,693百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）は上記に含めておりません。

(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定定貨については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約の時価は、為替レート等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

| 区分 | 前事業年度 (2022年3月31日) | 当事業年度 (2023年3月31日) |
|--------|-----------------------|-----------------------|
| 投資有価証券 | 0 | 0 |
| 関係会社株式 | 5,636 | 5,636 |

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2022年3月31日)

(単位:百万円)

| | 1年以内 | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|----------------|--------|---------|----------|------|
| 現金及び預金 | 21,675 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 9,067 | - | - | - |
| 未収運用受託報酬 | 6,252 | - | - | - |
| 投資有価証券 投資信託 | - | 108 | 1,712 | 0 |

当事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

| | 1年以内 | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|----------------|--------|---------|----------|------|
| 現金及び預金 | 23,067 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 9,147 | - | - | - |
| 未収運用受託報酬 | 5,815 | - | - | - |
| 投資有価証券 投資信託 | - | 594 | 2,144 | 38 |

(有価証券関係)

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位:百万円)

| 区分 | 前事業年度 (2022年3月31日) | 当事業年度 (2023年3月31日) |
|-------|-----------------------|-----------------------|
| 子会社株式 | 5,636 | 5,636 |

2. その他有価証券

前事業年度(2022年3月31日)

| 区分 | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|----------------------|----------|-------|-------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | | | |
| その他 | 4,888 | 3,403 | 1,485 |
| 小計 | 4,888 | 3,403 | 1,485 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| その他 | 1,585 | 1,711 | 126 |
| 小計 | 1,585 | 1,711 | 126 |
| 合計 | 6,474 | 5,115 | 1,358 |

当事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

| 区分 | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|----------------------|----------|-------|-----|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | | | |
| その他 | 986 | 622 | 364 |
| 小計 | 986 | 622 | 364 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | | | |
| その他 | 2,857 | 3,150 | 292 |
| 小計 | 2,857 | 3,150 | 292 |
| 合計 | 3,844 | 3,772 | 71 |

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

| 区分 | 前事業年度 (2022年3月31日) | 当事業年度 (2023年3月31日) |
|--------|-----------------------|-----------------------|
| 非上場株式 | 0 | 0 |
| 組合出資金等 | 133 | 218 |

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:百万円)

| 区分 | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|-----|-----|---------|---------|
| その他 | 7 | 0 | 0 |

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:百万円)

| 区分 | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|-----|-------|---------|---------|
| その他 | 3,429 | 738 | 16 |

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度(2022年3月31日)

| 種類 | 契約額等 (百万円) | 契約額等の うち1年超 (百万円) | 時価 (百万円) | 評価損益 (百万円) |
|----|---------------|-------------------------|-------------|---------------|
| | | | | |

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上していません。

当事業年度（2023年3月31日）

| 種類 | | 契約額等 (百万円) | 契約額等の うち1年超 (百万円) | 時価 (百万円) | 評価損益 (百万円) |
|-----------|--------------|---------------|-------------------------|-------------|---------------|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 | | | | |
| | 米ドル | 5,923 | - | 21 | 21 |
| | 英ポンド | 256 | - | 6 | 6 |
| | カナダドル | 109 | - | 1 | 1 |
| | スイスフラン | 163 | - | 2 | 2 |
| | 香港ドル | 202 | - | 0 | 0 |
| | ユーロ | 651 | - | 19 | 19 |
| | 買建 米ドル | 152 | - | 3 | 3 |
| | 合計 | 7,458 | - | 48 | 48 |

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上していません。

（2）株式関連

前事業年度（2022年3月31日）

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

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上していません。

当事業年度（2023年3月31日）

| 種類 | | 契約額等 (百万円) | 契約額等の うち1年超 (百万円) | 時価 (百万円) | 評価損益 (百万円) |
|------|----------------|---------------|-------------------------|-------------|---------------|
| 市場取引 | 株価指数先物取引 売建 | 12,195 | - | 9 | 9 |
| | 債券先物取引 売建 | 182 | - | 0 | 0 |
| | 合計 | 12,378 | - | 10 | 10 |

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上していません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

（1）通貨関連

前事業年度（2022年3月31日）

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

| | | | | | |
|-------------|--------------|------------------|-------|---|----|
| 原則的 処理方法 | 為替予約取引 売建 | 投資有価証券 関係会社株式 | | | |
| | 米ドル | | 4,422 | - | 43 |
| | 英ポンド | | 3,297 | - | 21 |
| | スイスフラン | | 79 | - | 1 |
| | 香港ドル | | 119 | - | 1 |
| | ユーロ | | 125 | - | 3 |
| | 人民元 | | 13 | - | 0 |
| 合計 | | | 8,057 | - | 71 |

当事業年度（2023年3月31日）

| ヘッジ 会計の方法 | 種類 | 主なヘッジ対象 | 契約額等 (百万円) | 契約額等の うち1年超 (百万円) | 時価 (百万円) |
|--------------|--------------|------------------|---------------|-------------------------|-------------|
| 原則的 処理方法 | 為替予約取引 売建 | 投資有価証券 関係会社株式 | | | |
| | 米ドル | | 1,729 | - | 6 |
| | 英ポンド | | 3,228 | - | 81 |
| | スイスフラン | | 20 | - | 0 |
| | 香港ドル | | 83 | - | 0 |
| | ユーロ | | 21 | - | 0 |
| 合計 | | | 5,082 | - | 88 |

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

| | 前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | | 当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) | |
|--------------------|--|-----|--|-----|
| | 退職給付債務の期首残高 | 626 | | 820 |
| 勤務費用 | 124 | | 133 | |
| 利息費用 | 2 | | 3 | |
| 数理計算上の差異の発生額 | - | | 6 | |
| 退職給付の支払額 | 81 | | 57 | |
| 簡便法で計算した退職給付費用 | 8 | | 6 | |
| 簡便法から原則法への変更に伴う振替額 | 120 | | - | |
| その他 | 18 | | - | |
| 退職給付債務の期末残高 | 820 | | 911 | |

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：百万円)

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

| | | |
|---------------------|-----|-----|
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 820 | 904 |
|---------------------|-----|-----|

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

| | (単位：百万円) | |
|--------------------|--|--|
| | 前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | 当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) |
| 勤務費用 | 124 | 133 |
| 利息費用 | 2 | 3 |
| 簡便法で計算した退職給付費用 | 8 | 6 |
| 簡便法から原則法への変更に伴う振替額 | 120 | - |
| その他 | 18 | - |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 274 | 142 |

(5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

| | 前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | 当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) |
|-----|--|--|
| 割引率 | 0.4% | 0.4% |

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度100百万円、当事業年度109百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報
顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針7.収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。
3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報
単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。
2. 地域ごとの情報
(1) 営業収益
内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。
- (2) 有形固定資産
本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。
3. 主要な顧客ごとの情報
前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

| 顧客の名称 | 営業収益 |
|--------------|----------|
| 三井住友信託銀行株式会社 | 9,887百万円 |

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

- (ア) 財務諸表提出会社の親会社
重要性が乏しいため、記載を省略しております。
- (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等
重要性が乏しいため、記載を省略しております。
- (ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金（百万円） | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有（被所有）割合（%） | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（百万円） | 科目 | 期末残高（百万円） |
|---------|-------------|---------|---------------|------------|-------------------|----------------|----------------------|-----------|----------|-----------|
| 親会社の子会社 | 三井住友信託銀行(株) | 東京都千代田区 | 342,037 | 信託業務及び銀行業務 | - | 営業上の取引 役員兼任 | 運用受託報酬 | 10,090 | 未収運用受託報酬 | 5,421 |
| | | | | | | | 投信販売 代 hands 手数料等 | 9,701 | 未払手数料 | 1,995 |

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金（百万円） | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有（被所有）割合（%） | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（百万円） | 科目 | 期末残高（百万円） |
|---------|-------------|---------|---------------|------------|-------------------|--------------------|------------|-----------|----------|-----------|
| 親会社の子会社 | 三井住友信託銀行(株) | 東京都千代田区 | 342,037 | 信託業務及び銀行業務 | - | 営業上の取引 役員 兼任 | 運用受託報酬 | 9,593 | 未収運用受託報酬 | 5,271 |
| | | | | | | | 投信販売代行手数料等 | 9,445 | 未払手数料 | 2,029 |

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2022年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2023年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第38期中間会計期間末

(2023年9月30日)

資産の部

流動資産

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

固定資産

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

（単位：百万円）

第38期中間会計期間末

（2023年9月30日）

| | | |
|--------------|--|--------|
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | | 2,000 |
| 資本剰余金 | | |
| その他資本剰余金 | | 17,239 |
| 資本剰余金合計 | | 17,239 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | | 500 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | | 2,100 |
| 繰越利益剰余金 | | 43,700 |
| 利益剰余金合計 | | 46,300 |
| 株主資本合計 | | 65,540 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | | 164 |
| 繰延ヘッジ損益 | | 906 |
| 評価・換算差額等合計 | | 741 |

| | |
|----------|--------|
| 純資産合計 | 64,798 |
| 負債・純資産合計 | 77,045 |

中間損益計算書

（単位：百万円）

第38期中間会計期間

（自 2023年4月1日

至 2023年9月30日）

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

中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：百万円）

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

| | 株主資本 | | | | |
|---------------------------|-------|----------|-------------|-------------|--------|
| | 利益剰余金 | | | | 株主資本合計 |
| | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | 利益剰余金 合計 | |
| | | 別途積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| 当期首残高 | 500 | 2,100 | 44,755 | 47,355 | 66,595 |
| 当中間期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | 3,367 | 3,367 | 3,367 |
| 中間純利益 | | | 2,312 | 2,312 | 2,312 |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額） | | | | | |
| 当中間期変動額合計 | - | - | 1,055 | 1,055 | 1,055 |
| 当中間期末残高 | 500 | 2,100 | 43,700 | 46,300 | 65,540 |

| | 評価・換算差額等 | | | 純資産合計 |
|-----------------------------------|------------------|---------|--------------------|--------|
| | その他有価証券 評価差額金 | 繰延ヘッジ損益 | 評価・換算差額 等 合計 | |
| 当期首残高 | 49 | 510 | 460 | 66,134 |
| 当中間期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | 3,367 |
| 中間純利益 | | | | 2,312 |
| 株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純 額） | 114 | 395 | 280 | 280 |
| 当中間期変動額合計 | 114 | 395 | 280 | 1,335 |
| 当中間期末残高 | 164 | 906 | 741 | 64,798 |

注記事項

(重要な会計方針)

| 第38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日) | |
|---|--|
| 1. 資産の評価基準及び評価方法 | <p>(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 移動平均法による原価法によっております。 なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。</p> <p>(2) デリバティブ 時価法によっております。</p> <p>(3) 金銭の信託 時価法によっております。</p> |
| 2. 固定資産の減価償却の方法 | <p>(1) 有形固定資産 定額法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却してあります。</p> |
| 3. 引当金の計上基準 | <p>(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上してあります。</p> <p>(2) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上してあります。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あります。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。 過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理 数理計算上の差異 : 各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理 なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期間末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用してあります。</p> |
| 4. 収益及び費用の計上基準 | <p>当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。</p> <p>(1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領してあります。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。</p> <p>(2) 投資一任業務 当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領してあります。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。</p> <p>(3) 投資助言業務</p> |

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

(4) 成功報酬

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理しております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(表示方法の変更)

第38期中間会計期間
(自 2023年4月1日
至 2023年9月30日)

従来「無形固定資産」に含めていた「ソフトウェア」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。

(中間貸借対照表関係)

第38期中間会計期間末
(2023年9月30日)

- | | | |
|---|--|--------|
| 1 | 有形固定資産の減価償却累計額 | 957百万円 |
| 2 | 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。 | |

(中間損益計算書関係)

第38期中間会計期間
(自 2023年4月1日
至 2023年9月30日)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当中間会計期間末 |
|---------|---------|----|----|----------|
| 普通株式(株) | 3,000 | - | - | 3,000 |

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の 総額(百万円) | 1株当たり 配当額(円) | 基準日 | 効力発生日 |
|----|-------|-----------------|-----------------|-----|-------|
| | | | | | |

| | | | | | |
|----------------------|------|-------|-----------|------------|------------|
| 2023年6月23日 定時株主総会 | 普通株式 | 3,367 | 1,122,459 | 2023年3月31日 | 2023年6月26日 |
|----------------------|------|-------|-----------|------------|------------|

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの該当事項はありません。

(リース取引関係)
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

第38期中間会計期間末（2023年9月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(1)*2、*3及び(注2)参照）。

また、金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

| 区 分 | 中間貸借対照表計上額（百万円）（*1） | | | |
|--------------|---------------------|--------|------|--------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| 金銭の信託(*2) | 1,206 | 13,995 | - | 15,201 |
| 投資有価証券(*3) | | | | |
| その他有価証券 | - | 4,137 | - | 4,137 |
| 資産計 | 1,206 | 18,133 | - | 19,339 |
| デリバティブ取引(*4) | | | | |
| 株式関連取引 | 226 | 113 | - | 339 |
| 通貨関連取引 | - | (134) | - | (134) |
| デリバティブ取引計 | 226 | (20) | - | 205 |

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額1,041百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は16,243百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額271百万円）は上記に含めておりません。

(*4) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(2) 時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、短期差入証拠金、未払金は、短期間（1年以内）で決済されるものが大半を占めており、時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株価指数先物の時価は、金融商品取引所が定める清算指数を用いて評価しております。株価指数先物は活発な市場で取引されているため、その市場価格をレベル1の時価に分類しております。為替予約及びトータルリターンズワップの時価は、為替レートや金利や株価等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

(単位：百万円)

| 区分 | 中間貸借対照表計上額 |
|--------|------------|
| 投資有価証券 | 0 |
| 関係会社株式 | 5,636 |

(有価証券関係)

第38期中間会計期間末（2023年9月30日）

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位：百万円)

| | 中間貸借対照表計上額 |
|-------|------------|
| 子会社株式 | 5,636 |

2. その他有価証券

(単位：百万円)

| 区分 | 中間貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|-----------------------------|------------|-------|-----|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他 | 2,711 | 2,131 | 580 |
| 小計 | 2,711 | 2,131 | 580 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他 | 1,426 | 1,769 | 343 |
| 小計 | 1,426 | 1,769 | 343 |
| 合計 | 4,137 | 3,900 | 237 |

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額271百万円）は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

| 種類 | 契約額等 (百万円) | 契約額等の うち1年超 (百万円) | 時価 (百万円) | 評価損益 (百万円) |
|---|--|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 店頭 為替予約取引 売建 米ドル 英ポンド カナダドル スイスフラン 香港ドル ユーロ | 5,944 267 126 176 214 719 | - - - - - - | 76 1 1 0 2 3 | 76 1 1 0 2 3 |
| 合計 | 7,449 | - | 84 | 84 |

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

| 種類 | 契約額等 (百万円) | 契約額等の うち1年超 (百万円) | 時価 (百万円) | 評価損益 (百万円) |
|----------------------------|---------------|-------------------------|-------------|---------------|
| 市場取引 株価指数先物取引 売建 | 9,373 | - | 226 | 226 |
| 店頭 トータルリターンスワップ取引 売建 | 3,866 | - | 113 | 113 |
| 合計 | 13,239 | - | 339 | 339 |

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

（資産除去債務関係）
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。
2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報
顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針4．収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。
3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

〔関連情報〕

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報
単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。
2. 地域ごとの情報
 - (1) 営業収益
内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。
 - (2) 有形固定資産
本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。
3. 主要な顧客ごとの情報

| 顧客の名称 | 営業収益 |
|--------------|----------|
| 三井住友信託銀行株式会社 | 5,057百万円 |

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

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

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

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

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

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

（1株当たり情報）

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

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日） |
|--------------|---|
| 中間純利益 | 2,312百万円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | - |
| 普通株式に係る中間純利益 | 2,312百万円 |
| 普通株式の期中平均株式数 | 3,000株 |

独立監査人の監査報告書

2023年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第37期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人

は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 三上和彦

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 田中洋一

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務

諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2024年3月22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 山田信之

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドAの2023年7月11日から2024年1月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、分散投資コア戦略ファンドAの2024年1月10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7月11日から2024年1月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2024年3月22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 山田信之

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドSの2023年7月11日から2024年1月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、分散投資コア戦略ファンドSの2024年1月10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7月11日から2024年1月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。