

【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5月21日提出
【計算期間】	第7期中(自 2023年8月22日至 2024年2月21日)
【ファンド名】	グローバル経済コア
【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3月29日現在の状況について記載してあります。

【グローバル経済コア】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	17,458,271,601	99.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		155,969,233	0.89
合計(純資産総額)		17,614,240,834	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末 (2018年 8月20日)	13,643,422,697	13,643,422,697	9,632	9,632
第2期計算期間末 (2019年 8月20日)	12,745,858,008	12,745,858,008	10,021	10,021
第3期計算期間末 (2020年 8月20日)	11,044,987,442	11,044,987,442	10,880	10,880
第4期計算期間末 (2021年 8月20日)	10,716,800,292	10,716,800,292	12,281	12,281
第5期計算期間末 (2022年 8月22日)	11,407,002,963	11,407,002,963	12,927	12,927
第6期計算期間末 (2023年 8月21日)	12,110,129,607	12,110,129,607	13,500	13,500
2023年 3月末日	11,200,934,042		12,658	
4月末日	11,342,369,783		12,807	
5月末日	11,625,123,951		13,102	
6月末日	12,188,341,610		13,661	
7月末日	12,271,428,755		13,750	
8月末日	12,500,633,624		13,864	
9月末日	12,389,610,125		13,525	
10月末日	12,340,665,567		13,409	
11月末日	12,899,765,737		14,036	
12月末日	13,099,474,099		14,129	
2024年 1月末日	14,358,584,348		14,403	
2月末日	15,761,847,220		14,746	
3月末日	17,614,240,834		15,214	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金(円)
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	0
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	0
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	0
第4期計算期間	2020年 8月21日～2021年 8月20日	0

第5期計算期間	2021年 8月21日～2022年 8月22日	0
第6期計算期間	2022年 8月23日～2023年 8月21日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	3.7
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	4.0
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	8.6
第4期計算期間	2020年 8月21日～2021年 8月20日	12.9
第5期計算期間	2021年 8月21日～2022年 8月22日	5.3
第6期計算期間	2022年 8月23日～2023年 8月21日	4.4
第7期中間計算期間	2023年 8月22日～2024年 2月21日	8.5

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配)から前計算期間末の基準価額(分配)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配)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	662,742,852,480	98.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,125,463,403	1.80
合計(純資産総額)		674,868,315,883	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	11,689,400,000	1.73

(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	567,540,936,640	84.69
地方債証券	日本	33,311,138,853	4.97
特殊債券	日本	37,216,286,674	5.55
	国際機関	299,343,000	0.04
	小計	37,515,629,674	5.60
社債券	日本	29,236,699,000	4.36

	フランス	1,495,907,000	0.22
	韓国	99,638,000	0.01
	小計	30,832,244,000	4.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		900,453,012	0.13
合計(純資産総額)		670,100,402,179	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

外国株式インデックス マザーファンド

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	508,343,751,082	69.66
	イギリス	26,720,308,792	3.66
	カナダ	23,684,530,877	3.25
	フランス	21,684,348,542	2.97
	スイス	20,981,676,086	2.88
	ドイツ	17,086,928,201	2.34
	オランダ	14,511,179,571	1.99
	アイルランド	13,342,313,073	1.83
	オーストラリア	12,965,647,949	1.78
	デンマーク	7,192,370,987	0.99
	スウェーデン	6,058,383,988	0.83
	スペイン	5,081,170,725	0.70
	イタリア	3,963,393,293	0.54
	香港	2,672,923,387	0.37
	シンガポール	2,046,872,772	0.28
	フィンランド	1,886,487,809	0.26
	ジャージー	1,744,686,586	0.24
	ベルギー	1,477,264,543	0.20
	イスラエル	1,454,570,974	0.20
	ノルウェー	1,165,841,810	0.16
	キュラソー	915,247,781	0.13
	バミューダ	909,248,358	0.12
	ケイマン	832,220,852	0.11
	ニュージーランド	505,459,045	0.07
	ルクセンブルク	397,537,725	0.05
	リベリア	387,884,453	0.05
	オーストリア	362,394,830	0.05
	ポルトガル	303,618,317	0.04
	パナマ	177,660,769	0.02
	マン島	75,675,242	0.01
	小計	698,931,598,419	95.77

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	69,073,238	0.01
	香港	55,620,873	0.01
	小計	124,694,111	0.02
投資証券	アメリカ	11,481,070,226	1.57
	オーストラリア	952,958,463	0.13
	フランス	281,767,135	0.04
	シンガポール	241,306,194	0.03
	イギリス	205,878,971	0.03
	香港	108,617,017	0.01
	カナダ	57,391,729	0.01
	ベルギー	55,779,833	0.01
	小計	13,384,769,568	1.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,351,958,806	2.38
合計(純資産総額)		729,793,020,904	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	12,578,843,765	1.72
	買建	カナダ	479,942,188	0.07
	買建	ドイツ	2,205,269,644	0.30
	買建	イギリス	1,023,401,791	0.14
	買建	オーストラリア	686,042,096	0.09

(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		423,745,840	0.06
	売建		60,525,520	0.01

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

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	154,498,574,729	46.36
	中国	29,718,902,103	8.92
	フランス	26,029,119,170	7.81

イタリア	23,745,876,092	7.13
ドイツ	20,444,341,110	6.13
イギリス	16,964,326,313	5.09
スペイン	15,887,401,015	4.77
カナダ	6,733,320,794	2.02
ベルギー	5,771,693,815	1.73
オランダ	4,890,319,366	1.47
オーストラリア	4,464,220,653	1.34
オーストリア	3,945,907,969	1.18
メキシコ	2,870,507,316	0.86
ポーランド	1,818,057,885	0.55
フィンランド	1,722,661,280	0.52
アイルランド	1,686,273,110	0.51
マレーシア	1,609,572,076	0.48
シンガポール	1,362,707,119	0.41
イスラエル	1,097,287,651	0.33
デンマーク	881,551,038	0.26
ニュージーランド	819,569,650	0.25
スウェーデン	631,824,081	0.19
ノルウェー	518,563,905	0.16
小計	328,112,578,240	98.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	5,155,675,118	1.55
合計(純資産総額)	333,268,253,358	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	948,484,317	0.28
	買建	ドイツ	865,932,698	0.26

(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		5,383,280,723	1.62
	売建		771,054,208	0.23

(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。

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	32,914,906,427	17.14
	台湾	31,344,970,872	16.32
	ケイマン	26,228,719,376	13.66
	韓国	23,594,623,326	12.29
	中国	18,564,372,010	9.67
	ブラジル	9,187,970,605	4.78
	サウジアラビア	7,844,892,725	4.08
	南アフリカ	4,718,335,708	2.46
	メキシコ	4,624,420,329	2.41
	インドネシア	3,488,779,691	1.82
	タイ	2,736,419,972	1.42
	マレーシア	2,527,837,231	1.32
	アラブ首長国連邦	2,228,198,301	1.16
	ポーランド	1,651,229,058	0.86
	カタール	1,557,053,184	0.81
	クウェート	1,515,441,663	0.79
	香港	1,462,252,726	0.76
	トルコ	1,260,443,789	0.66
	フィリピン	1,145,939,415	0.60
	ギリシャ	937,098,018	0.49
	チリ	832,269,668	0.43
	バミューダ	677,057,594	0.35
	アメリカ	654,349,893	0.34
	ハンガリー	506,817,249	0.26
	チェコ	248,776,679	0.13
	ルクセンブルク	238,435,299	0.12
	イギリス	227,774,779	0.12
	エジプト	218,154,041	0.11
	コロンビア	186,609,325	0.10
	ペルー	88,794,152	0.05
	シンガポール	80,234,698	0.04
	オランダ	15,623,110	0.01
	ロシア	124	0.00
キプロス	-	-	
英ヴァージン諸島	-	-	
	小計	183,508,801,037	95.55
投資信託受益証券	ブラジル	389,795,774	0.20
	メキシコ	142,358,279	0.07
	小計	532,154,053	0.28

投資証券	メキシコ	238,292,779	0.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,769,226,235	4.05
合計(純資産総額)		192,048,474,104	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,925,571,591	4.13

(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		336,739,069	0.18
	売建		3,821,980	0.00

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

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

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	13,835,648,069	9.94
	マレーシア	13,632,874,092	9.79
	ブラジル	13,469,484,562	9.67
	インドネシア	13,439,270,017	9.65
	中国	13,407,920,474	9.63
	タイ	12,898,569,999	9.26
	ポーランド	10,938,291,549	7.86
	南アフリカ	10,903,769,373	7.83
	チェコ	8,586,564,091	6.17
	コロンビア	6,243,835,175	4.48
	ルーマニア	5,517,225,696	3.96
	ハンガリー	4,151,048,331	2.98
	ペルー	2,997,337,621	2.15
	チリ	2,337,223,742	1.68
	ウルグアイ	291,423,079	0.21
	ドミニカ共和国	211,020,505	0.15
	小計	132,861,506,375	95.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,379,752,576	4.58
合計(純資産総額)		139,241,258,951	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		3,483,543,437	2.50

(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	117,365,336,300	95.97
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		4,925,618,489	4.03
合計（純資産総額）		122,290,954,789	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	4,907,928,000	4.01

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

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

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	88,587,603,605	76.88
	オーストラリア	8,754,955,696	7.60
	イギリス	5,451,668,933	4.73
	シンガポール	3,685,867,763	3.20
	フランス	2,027,278,278	1.76
	カナダ	1,694,864,780	1.47
	ベルギー	1,200,149,393	1.04
	香港	1,021,686,491	0.89
	スペイン	471,196,592	0.41
	ニュージーランド	339,163,797	0.29
	ガーンジー	332,472,065	0.29
	韓国	216,070,705	0.19

	オランダ	206,976,512	0.18
	イスラエル	131,488,912	0.11
	アイルランド	45,397,044	0.04
	ドイツ	41,433,577	0.04
	イタリア	8,373,105	0.01
	小計	114,216,647,248	99.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,006,191,079	0.87
合計(純資産総額)		115,222,838,327	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		70,288,862	0.06

(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	30,016,208,806	99.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		71,664,582	0.24
合計(純資産総額)		30,087,873,388	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		30,112,710,387	100.08

(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】

【グローバル経済コア】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	17,310,062,925	3,145,035,108	14,165,027,817
第2期計算期間	2018年 8月21日～2019年 8月20日	3,975,335,196	5,420,865,904	12,719,497,109
第3期計算期間	2019年 8月21日～2020年 8月20日	3,287,324,947	5,855,394,358	10,151,427,698
第4期計算期間	2020年 8月21日～2021年 8月20日	1,307,931,638	2,732,701,316	8,726,658,020
第5期計算期間	2021年 8月21日～2022年 8月22日	1,388,526,736	1,290,690,879	8,824,493,877
第6期計算期間	2022年 8月23日～2023年 8月21日	1,225,075,777	1,078,889,688	8,970,679,966
第7期中間計算期間	2023年 8月22日～2024年 2月21日	1,995,010,848	506,736,971	10,458,953,843

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

3【ファンドの経理状況】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期中間計算期間(2023年8月22日から2024年2月21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。

【グローバル経済コア】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 (2023年 8月21日現在)	第7期中間計算期間 (2024年 2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	126,480,117	211,201,701
親投資信託受益証券	11,989,215,183	15,170,444,773
未収入金	71,988,712	-
流動資産合計	12,187,684,012	15,381,646,474
資産合計	12,187,684,012	15,381,646,474
負債の部		
流動負債		
未払解約金	23,597,879	10,738,496
未払受託者報酬	3,155,344	3,601,022
未払委託者報酬	50,485,413	46,358,923
未払利息	298	40
その他未払費用	315,471	360,044
流動負債合計	77,554,405	61,058,525
負債合計	77,554,405	61,058,525
純資産の部		
元本等		
元本	8,970,679,966	10,458,953,843
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	3,139,449,641	4,861,634,106
(分配準備積立金)	2,276,579,520	2,156,859,626
元本等合計	12,110,129,607	15,320,587,949
純資産合計	12,110,129,607	15,320,587,949
負債純資産合計	12,187,684,012	15,381,646,474

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期中間計算期間 自 2022年 8月23日 至 2023年 2月22日	第7期中間計算期間 自 2023年 8月22日 至 2024年 2月21日
営業収益		
受取利息	212	543
有価証券売買等損益	318,407,066	1,139,817,881
営業収益合計	318,406,854	1,139,818,424
営業費用		
支払利息	35,731	22,657
受託者報酬	3,056,599	3,601,022
委託者報酬	48,905,448	46,358,923
その他費用	305,602	360,048
営業費用合計	52,303,380	50,342,650
営業利益又は営業損失（ ）	370,710,234	1,089,475,774
経常利益又は経常損失（ ）	370,710,234	1,089,475,774
中間純利益又は中間純損失（ ）	370,710,234	1,089,475,774
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（ ）	15,010,474	21,611,800
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,582,509,086	3,139,449,641
剰余金増加額又は欠損金減少額	141,218,262	832,309,167
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	141,218,262	832,309,167
剰余金減少額又は欠損金増加額	156,036,449	177,988,676
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	156,036,449	177,988,676
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,211,991,139	4,861,634,106

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年8月21日から翌年8月20日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第7期中間計算期間は2023年 8月22日から2024年 2月21日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

	第6期 (2023年 8月21日現在)	第7期中間計算期間 (2024年 2月21日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	8,970,679,966口	10,458,953,843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) 1.3500円 (13,500円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4648円 (14,648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7期中間計算期間 (2024年 2月21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6期 自 2022年 8月23日 至 2023年 8月21日	第7期中間計算期間 自 2023年 8月22日 至 2024年 2月21日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	8,824,493,877円	8,970,679,966円
期中追加設定元本額	1,225,075,777円	1,995,010,848円
期中一部解約元本額	1,078,889,688円	506,736,971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 2月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,456,836,402
株式	650,836,012,390
派生商品評価勘定	96,823,450
未収入金	1,169,700
未収配当金	935,495,540
差入委託証拠金	178,926,946
流動資産合計	656,505,264,428
資産合計	656,505,264,428
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	949,950
前受金	95,956,000
未払解約金	1,058,002,264
未払利息	847
流動負債合計	1,154,909,061
負債合計	1,154,909,061
純資産の部	
元本等	
元本	242,774,172,757
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	412,576,182,610
元本等合計	655,350,355,367
純資産合計	655,350,355,367
負債純資産合計	656,505,264,428

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 2月21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 2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	242,774,172,757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 2.6994円 (1万口当たり純資産額) (26,994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 2月21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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	242,361,014,552円
期中追加設定元本額	12,621,042,092円
期中一部解約元本額	12,207,883,887円
期末元本額	242,774,172,757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）	300,228,318円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,323,692,092円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,832,876円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,635,649,150円
世界経済インデックスファンド	5,485,017,349円
日本株式インデックス・オープン	2,896,656,791円
DCマイセクション25	5,161,553,123円
DCマイセクション50	16,530,302,543円
DCマイセクション75	18,639,047,535円
DC日本株式インデックス・オープン	5,991,821,138円
DCマイセクションS25	2,883,860,038円
DCマイセクションS50	9,225,200,055円
DCマイセクションS75	8,406,639,363円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,319,188,659円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	90,343,484円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	623,847,752円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	490,232,258円
DC世界経済インデックスファンド	3,872,297,962円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	779,900,215円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,315,406円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	10,119,126円
マイセクション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）	145,837,773円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,942,020円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	13,916,110円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	66,062,210円

区分	2024年 2月21日現在
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	14,768,203円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	41,964,694円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	461,496,312円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	296,607,962円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,022,522,920円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	28,436,332円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	11,549,460円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	306,897,276円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	167,048,030円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	227,137,584円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	18,043,662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）	393,927,922円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,447,230,955円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,912,533,154円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,066,009,806円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,532,570,159円
分散投資コア戦略ファンドA	1,836,701,973円
分散投資コア戦略ファンドS	6,134,390,087円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	625,605,332円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	409,228,812円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,126,863,232円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	190,482,840円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,488,308円
SMT インデックスバランス・オープン	46,495,864円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	19,882,707,441円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	257,305,573円
SMT 世界経済インデックス・オープン	49,722,491円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	217,686,084円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	36,201,050円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,796,995円
グローバル経済コア	230,522,768円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	33,171,403円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	1,565,814,267円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,743,442円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	936,907,080円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	236,546,406円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	56,022,400円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	54,129,701円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	23,873,476円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	28,639,350円
10資産分散投資ファンド	87,067,994円
グローバル10資産バランスファンド	20,497,928円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	20,340円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	34,725円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	37,911円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	39,822円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	39,822円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	34,844円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	22,400円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	19,911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）	41,836,473,861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）	464,553,669円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	288,619,452円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	16,904,339円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	139,797,804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）	48,798,533,705円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,873,463円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	203,574,847円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 2月21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	3,847,544,000	-	3,943,500,000	95,956,000
合計		3,847,544,000	-	3,943,500,000	95,956,000

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2024年 2月21日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	916,682,052
国債証券	556,611,202,800
地方債証券	32,820,900,351
特殊債券	37,880,990,150
社債券	30,115,362,000
未収入金	348,738,000
未収利息	1,538,646,204
前払費用	54,302,936
流動資産合計	660,286,824,493
資産合計	660,286,824,493
負債の部	
流動負債	
未払金	758,927,000
未払解約金	414,203,097
未払利息	174
流動負債合計	1,173,130,271
負債合計	1,173,130,271
純資産の部	
元本等	
元本	493,121,238,389
剰余金	
剰余金又は欠損金()	165,992,455,833
元本等合計	659,113,694,222
純資産合計	659,113,694,222
負債純資産合計	660,286,824,493

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 2月21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。

2024年 2月21日現在	
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 2月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	493,121,238,389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 99,355,000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 1.3366円 (1万口当たり純資産額) (13,366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 2月21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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	479,700,304,301円
期中追加設定元本額	29,091,908,851円
期中一部解約元本額	15,670,974,763円
期末元本額	493,121,238,389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)	5,151,124,058円
SBI資産設計オープン(分配型)	17,633,860円
SMT 国内債券インデックス・オープン	17,193,600,001円
世界経済インデックスファンド	6,763,280,358円
DCマイセレクション25	28,733,761,134円
DCマイセレクション50	36,444,932,231円
DCマイセレクション75	11,308,078,883円
DC日本債券インデックス・オープン	406,006,531円
DC日本債券インデックス・オープンS	88,319,692,906円
DC日本債券インデックス・オープンP	62,747,754,990円
DCマイセレクションS25	17,477,712,288円

区分	2024年 2月21日現在
DCマイセレクションS50	20,565,131,020円
DCマイセレクションS75	5,297,796,021円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	469,203,406円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	2,805,210,213円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	1,116,935,406円
DC世界経済インデックスファンド	4,668,090,342円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,091,932円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	22,266,643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）	57,897,813円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	108,206,471円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	27,533,508円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	22,848,337円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,071,634,312円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	753,790,389円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,322,108,714円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	66,341,926円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	49,378,534円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	935,755,410円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,028,010,373円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,354,508,809円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	95,425,368円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,074,185,130円
日本債券ファンド・シリーズ1	18,679,500,286円
分散投資コア戦略ファンドA	18,505,094,073円
分散投資コア戦略ファンドS	26,151,867,452円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	306,160,086円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,966,219,112円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	88,952,994円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	45,221,327円
SMT インデックスバランス・オープン	66,176,359円
SMT 世界経済インデックス・オープン	58,174,066円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	135,862,246円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	208,977,413円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	17,445,774円
グローバル経済コア	337,135,248円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	45,068,219円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	34,430,904円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	139,937,211円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	79,060,308円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	23,982,933円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	17,065,633円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	872,141,569円
10資産分散投資ファンド	327,498,386円
グローバル10資産バランスファンド	266,828,889円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	149,986円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	135,136円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	126,226円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	126,226円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	149,429円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	207,418円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	219,038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）	98,715,512,002円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	41,196,637円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	18,568,959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）	482,907,915円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 2月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,611,728,727
コール・ローン	821,477,237
株式	665,378,378,160
投資信託受益証券	121,417,076
投資証券	12,831,223,496
派生商品評価勘定	304,010,676
未収入金	4,222,893
未収配当金	613,780,410
差入委託証拠金	5,610,852,648
流動資産合計	687,297,091,323
資産合計	687,297,091,323
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,692,459
前受金	301,383,605
未払金	24,140,339
未払解約金	703,645,769
未払利息	156
流動負債合計	1,031,862,328
負債合計	1,031,862,328
純資産の部	
元本等	
元本	115,104,315,548
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	571,160,913,447
元本等合計	686,265,228,995
純資産合計	686,265,228,995
負債純資産合計	687,297,091,323

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年 2月21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 2月21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 2月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	115,104,315,548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 5.9621円 (1万口当たり純資産額) (59,621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 2月21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 2月21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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	113,463,591,898円
期中追加設定元本額	6,332,346,082円
期中一部解約元本額	4,691,622,432円
期末元本額	115,104,315,548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）	1,521,570,831円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,796,259円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,236,731,862円
世界経済インデックスファンド	13,175,740,652円
外国株式インデックス・オープン	884,793,798円
D Cマイセクション25	629,406,189円
D Cマイセクション50	3,233,645,211円
D Cマイセクション75	4,290,896,083円
D C外国株式インデックス・オープン	12,971,758,512円
D CマイセクションS25	323,451,308円
D CマイセクションS50	1,811,002,838円
D CマイセクションS75	1,922,664,300円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	20,457,351円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	141,221,370円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	110,978,813円
D C世界経済インデックスファンド	9,368,646,394円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	917,926,065円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	2,014,261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）	21,849,038円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	6,274,054円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	29,668,119円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	6,614,760円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	18,799,225円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	144,514,495円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	117,783,314円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	917,593,292円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	63,931,678円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	15,576,725円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	103,970,311円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	32,263,324円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	735,306,519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）	781,709,769円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,179,318,821円
コア投資戦略ファンド（安定型）	120,638,147円
コア投資戦略ファンド（成長型）	290,213,250円
分散投資コア戦略ファンドA	1,491,590,936円
分散投資コア戦略ファンドS	6,952,080,946円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,485,722,157円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,019,872,619円
コア投資戦略ファンド（切替型）	130,977,347円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	439,141,803円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	23,925,767円
S M T インデックスバランス・オープン	109,795,682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）	5,073,214,982円

区分	2024年 2月21日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン	241,164,275円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,055,784,345円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	175,579,058円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,382,857円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	1,730,686,577円
グローバル経済コア	576,208,135円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,960,048円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,983,643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	152,183,308円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	146,146,060円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	65,206,142円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	77,788,082円
10資産分散投資ファンド	48,693,256円
グローバル10資産バランスファンド	9,273,322円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	50,271円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	23,675円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	25,847円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	27,150円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	27,150円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	23,756円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	15,277円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	13,575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）	54,244,246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）	201,676,776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）	622,686,730円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,399,563,159円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	81,983,480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）	76,978,155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）	80,129,160円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	179,358,397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）	174,601,806円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	172,871,024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）	91,215,580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 2月21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	7,457,850,313	-	7,759,233,918	301,383,605
合計		7,457,850,313	-	7,759,233,918	301,383,605

（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 2月21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	49,608,900	-	49,545,177	63,723
	アメリカドル	49,608,900	-	49,545,177	63,723
	売建	55,514,800	-	55,516,465	1,665
	アメリカドル	55,514,800	-	55,516,465	1,665
合計		105,123,700	-	105,061,642	65,388

(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。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

2024年 2月21日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	917,690,174
コール・ローン	4,174,937,477
国債証券	313,396,011,095
派生商品評価勘定	5,018,088
未収入金	2,871,499
未収利息	2,174,410,161
前払金	6,236,914
前払費用	190,803,069
差入委託証拠金	235,355,662
流動資産合計	321,103,334,139
資産合計	
321,103,334,139	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,227,805
未払金	2,849,333,641
未払解約金	44,238,839
未払利息	793
流動負債合計	2,900,801,078
負債合計	
2,900,801,078	
純資産の部	
元本等	
元本	91,325,895,061
剰余金	
剰余金又は欠損金()	226,876,638,000
元本等合計	318,202,533,061
純資産合計	
318,202,533,061	
負債純資産合計	
321,103,334,139	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 2月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	91,325,895,061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 3.4843円 (1万口当たり純資産額) (34,843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 2月21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。

（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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	86,820,791,837円
期中追加設定元本額	7,974,410,869円
期中一部解約元本額	3,469,307,645円
期末元本額	91,325,895,061円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,121,745,835円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	507,709,679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）	2,377,025,037円
SBI資産設計オープン（分配型）	9,040,358円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,658,373,133円
世界経済インデックスファンド	20,276,165,663円
DCマイセクション25	1,931,326,665円
DCマイセクション50	1,764,081,937円
DCマイセクション75	1,368,898,850円
DC外国債券インデックス・オープン	2,250,728,078円
DCマイセクションS25	1,116,214,773円
DCマイセクションS50	997,082,989円
DCマイセクションS75	549,324,502円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	15,971,357円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	100,421,887円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	54,243,565円
DC世界経済インデックスファンド	14,161,351,213円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	699,011,622円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,094,444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）	15,047,126円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	25,158,124円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	49,709,449円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	53,313,350円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	50,533,464円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	785,535,149円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	364,461,557円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,529,639,425円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	53,493,651円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	30,406,983円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	349,732,489円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	129,434,332円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	171,859,380円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	635,980,303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）	1,484,562,517円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	631,872,812円
外国債券ファンド・シリーズ1	780,512,760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）	737,060,390円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,419,733,694円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	219,854,292円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	102,457,356円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,297,059,481円
SMT インデックスバランス・オープン	163,823,052円
SMT 世界経済インデックス・オープン	404,171,836円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	566,364,519円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	871,098,705円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,971,364円
グローバル経済コア	955,388,022円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	21,961,840円

区分	2024年 2月21日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,594,709円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	56,934,900円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	77,579,162円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	39,219,769円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	51,291,347円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	546,642,661円
10資産分散投資ファンド	26,422,405円
グローバル10資産バランスファンド	15,185,130円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2060	22,068円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2065	22,068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）	12,704,968,821円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	171,705,029円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	279,564,730円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	129,005,606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）	130,263,977円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2024年 2月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	2,135,321,219	-	2,129,084,305	6,236,914
合計		2,135,321,219	-	2,129,084,305	6,236,914

（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 2月21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	5,073,758,901	-	5,077,786,098	4,027,197
	アメリカドル	2,436,151,044	-	2,436,479,550	328,506
	カナダドル	138,749,551	-	138,450,721	298,830
	メキシコペソ	32,882,080	-	32,866,746	15,334
	ユーロ	1,627,478,763	-	1,630,694,122	3,215,359
	イギリスポンド	271,792,047	-	272,235,737	443,690
	デンマーククローネ	9,793,800	-	9,795,555	1,755
	ポーランドズロチ	22,485,398	-	22,468,773	16,625
	オーストラリアドル	39,338,400	-	39,339,160	760

シンガポールドル	14,514,760	-	14,516,385	1,625
マレーシアリン ギット	18,128,480	-	18,135,730	7,250
イスラエルシェケ ル	12,222,000	-	12,219,630	2,370
オフショア人民元	450,222,578	-	450,583,989	361,411
合計	5,073,758,901	-	5,077,786,098	4,027,197

(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 2月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	8,624,733,445
コール・ローン	106,760,462
株式	170,388,600,897
投資信託受益証券	540,115,765
投資証券	187,500,208
派生商品評価勘定	279,124,413
未収入金	124,594
未収配当金	245,485,008
差入委託証拠金	1,572,233,137
流動資産合計	181,944,677,929
資産合計	181,944,677,929
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,682,854
前受金	276,445,310
未払金	1,278
未払解約金	116,533,387
未払利息	20
流動負債合計	395,662,849
負債合計	395,662,849
純資産の部	
元本等	
元本	43,535,269,546
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	138,013,745,534
元本等合計	181,549,015,080
純資産合計	181,549,015,080
負債純資産合計	181,944,677,929

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年 2月21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 2月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	43,535,269,546口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 4,1702円 (41,702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 2月21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

	2024年 2月21日現在
	「(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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	40,615,994,191円
期中追加設定元本額	3,929,302,346円
期中一部解約元本額	1,010,026,991円
期末元本額	43,535,269,546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	7,468,597,357円
世界経済インデックスファンド	10,772,816,643円
DC新興国株式インデックス・オープン	6,129,408,283円
DC世界経済インデックスファンド	7,484,453,410円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	77,605,723円
コア投資戦略ファンド(安定型)	56,489,423円
コア投資戦略ファンド(成長型)	136,653,244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)	1,234,668,009円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	787,554,975円
コア投資戦略ファンド(切替型)	61,643,166円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	362,028,092円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	18,173,080円
SMT インデックスバランス・オープン	88,078,389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)	2,461,319,140円
SMT 世界経済インデックス・オープン	266,497,944円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	1,166,759,655円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	194,028,573円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,957,933円
グローバル経済コア	535,181,609円
My SMT 新興国株式インデックス(ノーロード)	306,803,937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)	14,488,359円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	102,512,085円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	98,499,700円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	44,001,118円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	52,580,506円
10資産分散投資ファンド	13,305,211円
グローバル10資産バランスファンド	13,180,556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)	1,546,623,117円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	90,583,611円

区分	2024年 2月21日現在
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	85,071,139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）	12,585,591円
F O F s 用 新興国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	23,086,480円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 2月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	10,731,050,758	-	11,007,496,068	276,445,310
合計		10,731,050,758	-	11,007,496,068	276,445,310

（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 2月21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	595,300,589	-	595,409,703	109,114
	アメリカドル	595,300,589	-	595,409,703	109,114
	売建	25,148,589	-	25,261,454	112,865
	ブラジルリアル	25,148,589	-	25,261,454	112,865
合計		620,449,178	-	620,671,157	3,751

（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 2月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	963,329,798
コール・ローン	2,916,475,073
国債証券	128,457,320,141
派生商品評価勘定	6,831,165
未収入金	1,884,055

2024年 2月21日現在	
項目	金額（円）
未収利息	1,908,594,339
前払費用	118,986,067
流動資産合計	134,373,420,638
資産合計	134,373,420,638
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,293,115
未払金	1,485,762,161
未払解約金	20,698,766
未払利息	554
流動負債合計	1,508,754,596
負債合計	1,508,754,596
純資産の部	
元本等	
元本	59,040,894,921
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	73,823,771,121
元本等合計	132,864,666,042
純資産合計	132,864,666,042
負債純資産合計	134,373,420,638

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2024年 2月21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。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益 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 2月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	59,040,894,921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) 2,2504円 (22,504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 2月21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。

2024年 2月21日現在	
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 提条件等による場合、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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	54,157,444,415円
期中追加設定元本額	5,940,297,994円
期中一部解約元本額	1,056,847,488円
期末元本額	59,040,894,921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	5,085,717,112円
世界経済インデックスファンド	20,858,891,582円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,874,178,592円
DC世界経済インデックスファンド	14,639,092,012円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	8,508,262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)	759,324,238円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,566,889,645円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	228,702,342円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	106,214,058円
SMT インデックスバランス・オープン	170,498,785円
SMT 世界経済インデックス・オープン	476,725,725円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	668,029,051円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	1,027,463,787円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,527,844円
グローバル経済コア	950,257,739円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	99,613,297円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	85,720,414円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	36,290,164円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	41,461,198円
My SMT 新興国債券インデックス(ノーロード)	212,237,579円
10資産分散投資ファンド	43,246,585円
グローバル10資産バランスファンド	23,644,486円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	202,512,593円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	152,155,212円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	22,452,812円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	227,231,446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)	221,204,889円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	219,012,057円

区分	2024年 2月21日現在
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 2月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,418,617,646	-	3,423,155,696	4,538,050
	アメリカドル	450,120,000	-	450,133,500	13,500
	メキシコペソ	460,266,940	-	459,758,271	508,669
	チェココルナ	285,473,140	-	285,568,754	95,614
	ハンガリーフォリント	120,410,208	-	121,150,025	739,817
	ポーランドズロチ	344,598,825	-	347,400,252	2,801,427
	ルーマニアレイ	32,555,218	-	32,600,500	45,282
	マレーシアリングット	428,389,870	-	426,807,664	1,582,206
	タイバーツ	324,885,100	-	326,225,398	1,340,298
	南アフリカランド	510,838,565	-	511,851,112	1,012,547
	オフショア人民元	461,079,780	-	461,660,220	580,440
合計		3,418,617,646	-	3,423,155,696	4,538,050

（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 2月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,259,779,868
投資証券	109,904,505,750
未収配当金	950,567,210
前払金	204,901,360
差入委託証拠金	243,697,993
流動資産合計	114,563,452,181
資産合計	114,563,452,181
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	205,006,520
未払金	429,772,654
未払解約金	25,844,256
未払利息	619

	2024年 2月21日現在
項目	金額（円）
流動負債合計	660,624,049
負債合計	660,624,049
純資産の部	
元本等	
元本	57,182,294,142
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	56,720,533,990
元本等合計	113,902,828,132
純資産合計	113,902,828,132
負債純資産合計	114,563,452,181

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 2月21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 2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	57,182,294,142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 1.9919円 (1万口当たり純資産額) (19,919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 2月21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。

2024年 2月21日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2024年 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	66,568,277,606円
期中追加設定元本額	5,731,383,590円
期中一部解約元本額	15,117,367,054円
期末元本額	57,182,294,142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）	1,845,565,420円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,797,767円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	17,210,722,588円
Jリートインデックス・オープン（SMA専用）	27,790,820,994円
コア投資戦略ファンド（安定型）	994,368,691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
S M T インデックスバランス・オープン	22,019,122円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	211,531,584円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	12,589,710円
グローバル経済コア	360,907,267円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	16,108,666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）	133,905,607円
My S M T J - R E I T インデックス（ノーロード）	825,694,024円
10資産分散投資ファンド	23,441,503円
グローバル10資産バランスファンド	24,804,141円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	343,795,463円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	8,730,244円
S M T A M 9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	689,306,473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）	73,714,990円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	508,440,551円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2019 - 03（適格機関投資家専用）	280,278,387円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2024年 2月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益
			(円)	
市場取引	不動産投信指数先物取引			
	買建	4,148,818,360	-	204,901,360
	合計	4,148,818,360	-	204,901,360

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年 2月21日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	192,882,885
コール・ローン	215,112,462
投資証券	110,326,066,890
派生商品評価勘定	13,517
未収入金	10,794,314
未収配当金	192,750,524
流動資産合計	110,937,620,592
資産合計	110,937,620,592
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,565
未払解約金	217,007,851
未払利息	40
流動負債合計	217,010,456
負債合計	217,010,456
純資産の部	
元本等	
元本	39,405,288,895
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	71,315,321,241
元本等合計	110,720,610,136
純資産合計	110,720,610,136
負債純資産合計	110,937,620,592

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 2月21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	(1) 受取配当金

2024年 2月21日現在	
	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 2月21日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	39,405,288,895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) 2.8098円 (28,098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 2月21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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	36,111,716,588円
期中追加設定元本額	8,075,124,124円
期中一部解約元本額	4,781,551,817円
期末元本額	39,405,288,895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	52,864,691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）	1,518,943,948円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,715,922円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,257,054,520円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	18,340,617,773円
コア投資戦略ファンド（安定型）	448,238,308円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,227,996,779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）	555,506,587円
SMT インデックスバランス・オープン	103,146,486円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	162,214,836円

区分	2024年 2月21日現在
SMT 8 資産インデックスバランス・オープン	10,352,489円
グローバル経済コア	272,446,250円
SBI 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	14,755,532円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	404,702,572円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	104,627,417円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	221,727,707円
10 資産分散投資ファンド	12,954,787円
グローバル10 資産バランスファンド	19,041,097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）	1,017,764,604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）	210,515,141円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	72,443,734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）	46,833,700円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	89,154,296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）	86,789,890円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	85,929,475円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11（適格機関投資家専用）	78,969,031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 2月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	96,045,900	-	96,034,948	10,952
	アメリカドル	96,045,900	-	96,034,948	10,952
合計		96,045,900	-	96,034,948	10,952

(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 2月21日現在	
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,389,963
コール・ローン	78,726,662
投資信託受益証券	28,325,344,124
流動資産合計	28,405,460,749
資産合計	28,405,460,749
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	621,243,400

	2024年 2月21日現在
項目	金額（円）
未払金	4,175,387
未払解約金	158,400
未払利息	14
流動負債合計	625,577,201
負債合計	625,577,201
純資産の部	
元本等	
元本	22,157,563,023
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,622,320,525
元本等合計	27,779,883,548
純資産合計	27,779,883,548
負債純資産合計	28,405,460,749

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 2月21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 2月21日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	22,157,563,023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 1.2537円 (1万口当たり純資産額) (12,537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 2月21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。

2024年 2月21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>(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 2月21日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 8月22日
期首元本額	25,106,860,700円
期中追加設定元本額	1,472,854,299円
期中一部解約元本額	4,422,151,976円
期末元本額	22,157,563,023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	7,752,717,524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	1,179,391,097円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	3,157,688,800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	41,343,082円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	612,686,931円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	521,612,735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）	73,216,947円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年 2月21日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	27,777,377,299	-	28,398,620,699	621,243,400
	アメリカドル	27,777,377,299	-	28,398,620,699	621,243,400
合計		27,777,377,299	-	28,398,620,699	621,243,400

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

4【委託会社等の概況】

（１）【資本金の額】

2024年 3月29日現在の資本金の額	20億円
発行可能株式総数	12,000株
発行済株式総数	3,000株

（２）【事業の内容及び営業の状況】

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

2024年 3月29日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	529	14,768,608
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	62	216,733
単位型公社債投資信託	51	173,672
合計	642	15,159,012

（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 5月21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
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

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

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

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おりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 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</p> <p>子会社株式 移動平均法による原価法によっております。</p> <p>その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法によっております。 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)</p> <p>市場価格のない株式等 移動平均法による原価法によっております。 なお、投資事業有限責任組合への出資については、組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。</p> <p>(2) デリバティブ 時価法によっております。</p> <p>(3) 金銭の信託 時価法によっております。</p>
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おります。</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おります。</p> <p>(2) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。</p> <p>過去勤務費用 : 発生事業年度に損益処理 数理計算上の差異 : 各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理</p> <p>なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期間末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。</p>
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おります。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。</p> <p>(2) 投資一任業務 当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。</p> <p>(3) 投資助言業務</p>

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

(4) 成功報酬

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理しております。

(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	5,944	-	76	76
米ドル	267	-	1	1
英ポンド	126	-	1	1
カナダドル	176	-	0	0
スイスフラン	214	-	2	2
香港ドル	719	-	3	3
ユーロ				
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	投資有価証券 関係会社株式	1,935	-	24
	米ドル		3,612	-	23
	英ポンド		22	-	0
	スイスフラン		90	-	1
	香港ドル		51	-	0
	ユーロ				
	合計		5,713	-	49

（資産除去債務関係）
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

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

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

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

〔関連情報〕

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

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

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,057百万円

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

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

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

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

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

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

（1株当たり情報）

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

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

独立監査人の監査報告書

2023年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

三上和彦

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

田中洋一

中間監査意見

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

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

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

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2024年4月30日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 山田信之
業務執行社員

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」に掲げられているグローバル経済コアの2023年8月22日から2024年2月21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、グローバル経済コアの2024年2月21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8月22日から2024年2月21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、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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。