

【表紙】

| | |
|--|---|
| 【提出書類】 | 訂正有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 2024年6月28日提出 |
| 【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 |
| 【電話番号】 | 03-6453-3610 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】 | グローバル10資産バランスファンド |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】 | (1)当初自己設定額 50万円を上限とします。 (2)継続申込額 10兆円を上限とします。 該当事項はありません。 |
| 【縦覧に供する場所】 | |

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出したこと等に伴い、2023年 9月12日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に更新するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

<訂正前> 及び <訂正後> に記載している下線部 _____ は訂正部分を示し、<更新・訂正後> に記載している内容は、当該内容にて原届出書が更新されます。

第一部【証券情報】

(1 2) その他

< 訂正前 >

(前略)

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

2024年11月5日受付分からは、取得申込みの取扱いは、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(後略)

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

<訂正前>

(前略)

委託会社の概況(2023年 6月30日現在)

(後略)

<訂正後>

(前略)

委託会社の概況(2024年 4月30日現在)

(後略)

2 投資方針

(2) 投資対象

(参考)のうち「ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)」の概要の 10を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

※10 金現物市場を代表する指標(円ヘッジベース)とはLBMA金価格(円ヘッジベース)です(2024年4月30日現在)。LBMA金価格の正式名称は LBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)によってロンドン時間の午後に公表される1トロイオンスあたりの金現物価格(米ドル建て)を指します。なお、LBMAは、ロンドン貴金属市場協会(London Bullion Market Association)の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。
ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)は、LBMA金価格及びLBMA金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

3 投資リスク

(1) ファンドのリスク

<訂正前>

(前略)

流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

(後略)

<訂正後>

(前略)

流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

有価証券の貸付等に係るリスク

有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産などにより決済が不履行となるリスクがあります。貸付契約が不履行となった場合、担保金による有価証券の買戻しの際、時価変動の影響から損失を被り、基準価額の下落要因となる可能性があります。

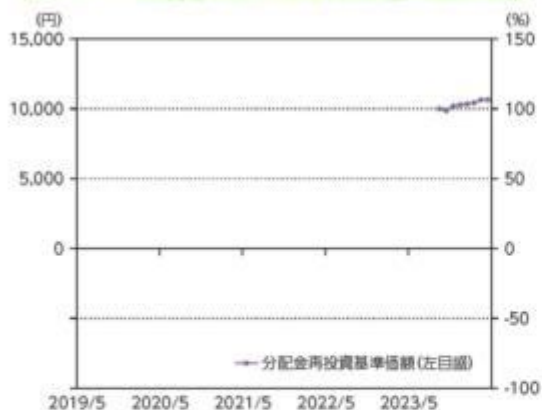
（後略）

〔参考情報〕を以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

〔参考情報〕

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- *当ファンドは設定から基準日まで1年経過していないため、表示に必要とする年間騰落率のデータが不足しております。従って、当ファンドの年間騰落率は記載していません。
- *当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- *2019年5月～2024年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- *当ファンドは設定から基準日まで1年経過していないため、表示に必要とする年間騰落率のデータが不足しております。従って、当ファンドの年間騰落率は記載していません。

各資産クラスの指数について

| | |
|---|---|
| 日本株 TOPIX (東証株価指数) (配当込み) | TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX協研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を立軸に編成するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケットベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。〔配当込み〕指数は、配当収益を考慮して算出した時価指数です。同指数の時価総額及び同指数に係る権限又は権限は、株式会社JPX協研又は株式会社JPX協研の関連会社（以下「JPX」という）の知的財産であり、指数の算出、指数の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る権限又は権限に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、漏脱又は不備に對し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に對してもJPXは責任を負いません。 |
| 先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース) | MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す時価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また〔配当込み〕指数は、配当収益を考慮して算出した時価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。 |
| 新興国株 MSCI Emerging Markets インデックス (配当込み、円ベース) | MSCI Emerging Markets インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す時価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また〔配当込み〕指数は、配当収益を考慮して算出した時価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。 |
| 日本国債 NOMURA-BPI国債 | NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社が発行する、国内で発行された公募固定付債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社（以下「野村」）に帰属します。野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに關し一切責任を負いません。 |
| 先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース) | FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより編成されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、漏脱又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 |
| 新興国債 EPAI Emerging Markets インデックス (配当込み、円ベース) | 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は特許を受けて使用されています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved. |

〔注〕海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

4 手数料等及び税金

(3) 信託報酬等

<訂正前>

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.66%（税抜 0.6%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

| | | |
|------|---------------------|---|
| 委託会社 | 年率 0.308%（税抜 0.28%） | 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 |
| 販売会社 | 年率 0.308%（税抜 0.28%） | 運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| 受託会社 | 年率 0.044%（税抜 0.04%） | 運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価 |

（後略）

<訂正後>

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

イ．当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.66%（税抜 0.6%）を乗じて得た額（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

| | | |
|------|---------------------|---|
| 委託会社 | 年率 0.308%（税抜 0.28%） | 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 |
| 販売会社 | 年率 0.308%（税抜 0.28%） | 運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| 受託会社 | 年率 0.044%（税抜 0.04%） | 運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価 |

ロ．有価証券の貸付の指図を行った場合は、ファンドの品貸料及びマザーファンドの品貸料のうちファンドに属するとみなした額に50%未満の率（ ）を乗じて得た額

2024年6月28日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

（後略）

(5) 課税上の取扱い

<訂正前>

（前略）

個人の受益者に対する課税

（中略）

二．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度です。

NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となりますが、2024年1月1日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象となる予定ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（中略）

上記は、2023年 6月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

（後略）

<訂正後>

（前略）

個人の受益者に対する課税

（中略）

二．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（中略）

上記は、2024年 4月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

（中略）

（参考情報）ファンドの総経費率

運用報告書作成対象期間の末日が到来していないため、該当する記載事項はありません。

5 運用状況

<更新・訂正後>

以下は、2024年4月30日現在の状況について記載してあります。

グローバル10資産バランスファンド

（1）投資状況

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---------------------|------|---------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 1,336,049,627 | 99.07 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 12,505,368 | 0.93 |
| 合計（純資産総額） | | 1,348,554,995 | 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）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資 比率 (%) |
|----------|---------------|--------------------------------|-------------|---------------|---------------|--------------|--------------|-----------------|
| 日本 | 親投資信託受 益証券 | 国内債券インデックス マザーファ ンド | 436,753,433 | 1.3358 | 583,425,946 | 1.3199 | 576,470,856 | 42.75 |
| 日本 | 親投資信託受 益証券 | 新興国株式インデックス マザー ファンド | 19,659,580 | 4.0389 | 79,403,723 | 4.5192 | 88,845,573 | 6.59 |
| 日本 | 親投資信託受 益証券 | ゴールドマザーファンド(為替ヘッ ジあり) | 62,053,329 | 1.2796 | 79,403,723 | 1.4292 | 88,686,617 | 6.58 |
| 日本 | 親投資信託受 益証券 | 外国株式インデックス マザーファ ンド | 13,743,178 | 5.7776 | 79,403,723 | 6.4150 | 88,162,486 | 6.54 |
| 日本 | 親投資信託受 益証券 | 国内株式インデックス マザーファ ンド | 30,357,327 | 2.6156 | 79,403,723 | 2.8461 | 86,399,988 | 6.41 |
| 日本 | 親投資信託受 益証券 | 外国債券インデックス マザーファ ンド | 23,032,667 | 3.4474 | 79,403,723 | 3.6058 | 83,051,190 | 6.16 |
| 日本 | 親投資信託受 益証券 | 新興国債券インデックス マザー ファンド | 35,832,050 | 2.2159 | 79,403,723 | 2.3130 | 82,879,531 | 6.15 |
| 日本 | 親投資信託受 益証券 | グローバルREITインデックス マザーファンド | 28,738,797 | 2.7629 | 79,403,723 | 2.8770 | 82,681,518 | 6.13 |
| 日本 | 親投資信託受 益証券 | J-REITインデックス マザー ファンド | 38,280,137 | 2.0742 | 79,403,723 | 2.1295 | 81,517,551 | 6.04 |
| 日本 | 親投資信託受 益証券 | 外国債券インデックスマザーファ ンド(為替ヘッジあり) | 94,913,273 | 0.8298 | 78,768,484 | 0.8150 | 77,354,317 | 5.74 |

(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)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 99.07 |
| 合計 | 99.07 |

(注)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 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) |
| 2023年 9月末日 | 492,950 | | 10,000 | |
| 10月末日 | 74,216,936 | | 9,863 | |
| 11月末日 | 122,775,896 | | 10,209 | |
| 12月末日 | 207,179,172 | | 10,291 | |
| 2024年 1月末日 | 638,041,850 | | 10,337 | |
| 2月末日 | 921,966,510 | | 10,440 | |
| 3月末日 | 1,231,182,799 | | 10,640 | |
| 4月末日 | 1,348,554,995 | | 10,656 | |

分配の推移

該当事項はありません。

収益率の推移

| | 期 間 | 収益率（％） |
|-----------|-------------------------|--------|
| 第1期中間計算期間 | 2023年 9月29日～2024年 3月28日 | 6.4 |

(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。

(4) 設定及び解約の実績

| | 期 間 | 設定口数（口） | 解約口数（口） | 発行済み口数（口） |
|-----------|-------------------------|---------------|-----------|---------------|
| 第1期中間計算期間 | 2023年 9月29日～2024年 3月28日 | 1,141,420,071 | 6,013,596 | 1,135,406,475 |

(注1)第1期中間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。

(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 | 649,649,606,820 | 98.03 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 13,072,947,356 | 1.97 |
| 合計(純資産総額) | | 662,722,554,176 | 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 | 13,158,130,000 | 1.99 |

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿価額(円)単価 | 帳簿価額(円)金額 | 評価額(円)単価 | 評価額(円)金額 | 投資比率(%) |
|------|----|-------------------|-------|------------|-----------|----------------|-----------|----------------|---------|
| 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 9,211,800 | 1,949.30 | 17,956,561,740 | 3,638.00 | 33,512,528,400 | 5.06 |
| 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 10,062,200 | 937.25 | 9,430,796,950 | 1,579.50 | 15,893,244,900 | 2.40 |
| 日本 | 株式 | ソニーグループ | 電気機器 | 1,186,700 | 13,269.36 | 15,746,749,512 | 13,085.00 | 15,527,969,500 | 2.34 |
| 日本 | 株式 | 東京エレクトロン | 電気機器 | 355,100 | 19,788.63 | 7,026,942,513 | 35,120.00 | 12,471,112,000 | 1.88 |

| | | | | | | | | | |
|----|----|-----------------|--------|------------|-----------|----------------|-----------|----------------|------|
| 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 3,408,200 | 2,005.56 | 6,835,349,592 | 3,620.00 | 12,337,684,000 | 1.86 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 814,300 | 8,178.23 | 6,659,532,689 | 14,620.00 | 11,905,066,000 | 1.80 |
| 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 167,800 | 68,425.93 | 11,481,871,054 | 70,300.00 | 11,796,340,000 | 1.78 |
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 1,174,700 | 5,692.47 | 6,686,944,509 | 8,980.00 | 10,548,806,000 | 1.59 |
| 日本 | 株式 | 三井物産 | 卸売業 | 1,329,400 | 4,709.00 | 6,260,144,600 | 7,639.00 | 10,155,286,600 | 1.53 |
| 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 1,506,900 | 4,422.30 | 6,663,963,870 | 6,195.00 | 9,335,245,500 | 1.41 |
| 日本 | 株式 | リクルートホールディングス | サービス業 | 1,241,200 | 4,457.15 | 5,532,214,580 | 6,902.00 | 8,566,762,400 | 1.29 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 50,048,600 | 163.02 | 8,158,922,772 | 170.80 | 8,548,300,880 | 1.29 |
| 日本 | 株式 | 伊藤忠商事 | 卸売業 | 1,193,100 | 5,002.25 | 5,968,184,475 | 7,136.00 | 8,513,961,600 | 1.28 |
| 日本 | 株式 | 任天堂 | その他製品 | 1,059,200 | 5,934.04 | 6,285,335,168 | 7,720.00 | 8,177,024,000 | 1.23 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 1,612,000 | 3,122.76 | 5,033,889,120 | 4,991.00 | 8,045,492,000 | 1.21 |
| 日本 | 株式 | 第一三共 | 医薬品 | 1,465,800 | 4,532.60 | 6,643,885,080 | 5,364.00 | 7,862,551,200 | 1.19 |
| 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 3,974,900 | 1,347.78 | 5,357,290,722 | 1,812.00 | 7,202,518,800 | 1.09 |
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 2,230,200 | 2,087.53 | 4,655,609,406 | 3,052.00 | 6,806,570,400 | 1.03 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 830,000 | 5,568.12 | 4,621,539,600 | 7,915.00 | 6,569,450,000 | 0.99 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 1,489,100 | 4,530.99 | 6,747,097,209 | 4,153.00 | 6,184,232,300 | 0.93 |
| 日本 | 株式 | HOYA | 精密機器 | 330,300 | 17,139.04 | 5,661,024,912 | 18,470.00 | 6,100,641,000 | 0.92 |
| 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 1,300,200 | 4,361.40 | 5,670,692,280 | 4,400.00 | 5,720,880,000 | 0.86 |
| 日本 | 株式 | 三菱電機 | 電気機器 | 1,885,900 | 1,826.03 | 3,443,709,977 | 2,773.00 | 5,229,600,700 | 0.79 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンク | 情報・通信業 | 2,683,500 | 1,517.14 | 4,071,245,190 | 1,911.00 | 5,128,168,500 | 0.77 |
| 日本 | 株式 | 住友商事 | 卸売業 | 1,074,200 | 2,765.62 | 2,970,829,004 | 4,155.00 | 4,463,301,000 | 0.67 |
| 日本 | 株式 | 村田製作所 | 電気機器 | 1,526,400 | 2,752.52 | 4,201,446,528 | 2,903.50 | 4,431,902,400 | 0.67 |
| 日本 | 株式 | ダイキン工業 | 機械 | 202,300 | 26,672.84 | 5,395,915,532 | 21,745.00 | 4,399,013,500 | 0.66 |
| 日本 | 株式 | 日本たばこ産業 | 食料品 | 1,003,800 | 3,094.89 | 3,106,650,582 | 4,245.00 | 4,261,131,000 | 0.64 |
| 日本 | 株式 | S M C | 機械 | 50,700 | 74,502.90 | 3,777,297,030 | 83,520.00 | 4,234,464,000 | 0.64 |
| 日本 | 株式 | 三菱重工業 | 機械 | 2,963,100 | 618.68 | 1,833,210,708 | 1,417.50 | 4,200,194,250 | 0.63 |

(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)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

| 種類 | 国内/外国 | 業種 | 投資比率(%) |
|----|-------|----------|---------|
| 株式 | 国内 | 水産・農林業 | 0.08 |
| | | 鉱業 | 0.34 |
| | | 建設業 | 2.06 |
| | | 食料品 | 3.10 |
| | | 繊維製品 | 0.35 |
| | | パルプ・紙 | 0.16 |
| | | 化学 | 5.48 |
| | | 医薬品 | 4.27 |
| | | 石油・石炭製品 | 0.51 |
| | | ゴム製品 | 0.71 |
| | | ガラス・土石製品 | 0.70 |
| | | 鉄鋼 | 0.89 |

| | |
|------------|-------|
| 非鉄金属 | 0.76 |
| 金属製品 | 0.50 |
| 機械 | 5.46 |
| 電気機器 | 17.01 |
| 輸送用機器 | 9.13 |
| 精密機器 | 2.16 |
| その他製品 | 2.17 |
| 電気・ガス業 | 1.44 |
| 陸運業 | 2.37 |
| 海運業 | 0.75 |
| 空運業 | 0.38 |
| 倉庫・運輸関連業 | 0.13 |
| 情報・通信業 | 6.81 |
| 卸売業 | 7.77 |
| 小売業 | 4.00 |
| 銀行業 | 7.44 |
| 証券、商品先物取引業 | 0.90 |
| 保険業 | 2.73 |
| その他金融業 | 1.14 |
| 不動産業 | 2.09 |
| サービス業 | 4.25 |
| 小計 | 98.03 |
| 合計 | 98.03 |

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額 (円) | 評価金額 (円) | 投資比率 (%) |
|----------|-------|----------|---------|------|----|----------------|----------------|----------|
| 株価指数先物取引 | 大阪取引所 | 東証株価指数先物 | 買建 | 479円 | | 13,136,810,450 | 13,158,130,000 | 1.99 |

(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 | 562,800,519,960 | 84.78 |
| 地方債証券 | 日本 | 32,943,645,238 | 4.96 |
| 特殊債券 | 日本 | 36,710,480,782 | 5.53 |
| | 国際機関 | 298,965,000 | 0.05 |

| | | | |
|---------------------|------|-----------------|--------|
| | 小計 | 37,009,445,782 | 5.58 |
| 社債券 | 日本 | 28,857,996,000 | 4.35 |
| | フランス | 1,494,670,000 | 0.23 |
| | 韓国 | 99,555,000 | 0.01 |
| | 小計 | 30,452,221,000 | 4.59 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 630,456,135 | 0.09 |
| 合計(純資産総額) | | 663,836,288,115 | 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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円)単価 | 帳簿価額(円)金額 | 評価額(円)単価 | 評価額(円)金額 | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|------|------|----------------|---------------|-----------|---------------|----------|---------------|-------|------------|---------|
| 日本 | 国債証券 | 第144回利付国債(5年) | 6,580,000,000 | 100.26 | 6,597,521,300 | 100.00 | 6,580,329,000 | 0.100 | 2025/6/20 | 0.99 |
| 日本 | 国債証券 | 第350回利付国債(10年) | 6,570,000,000 | 100.04 | 6,572,628,000 | 98.96 | 6,502,000,500 | 0.100 | 2028/3/20 | 0.98 |
| 日本 | 国債証券 | 第370回利付国債(10年) | 6,160,000,000 | 100.39 | 6,184,604,300 | 97.67 | 6,016,656,800 | 0.500 | 2033/3/20 | 0.91 |
| 日本 | 国債証券 | 第148回利付国債(5年) | 5,940,000,000 | 100.15 | 5,948,910,000 | 99.41 | 5,905,251,000 | 0.005 | 2026/6/20 | 0.89 |
| 日本 | 国債証券 | 第339回利付国債(10年) | 5,860,000,000 | 100.78 | 5,905,957,400 | 100.34 | 5,880,275,600 | 0.400 | 2025/6/20 | 0.89 |
| 日本 | 国債証券 | 第344回利付国債(10年) | 5,900,000,000 | 100.44 | 5,926,373,000 | 99.56 | 5,874,099,000 | 0.100 | 2026/9/20 | 0.88 |
| 日本 | 国債証券 | 第153回利付国債(5年) | 5,920,000,000 | 99.95 | 5,917,621,400 | 99.02 | 5,862,043,200 | 0.005 | 2027/6/20 | 0.88 |
| 日本 | 国債証券 | 第346回利付国債(10年) | 5,750,000,000 | 100.39 | 5,772,942,500 | 99.41 | 5,716,247,500 | 0.100 | 2027/3/20 | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | 第149回利付国債(5年) | 5,680,000,000 | 100.05 | 5,683,361,000 | 99.33 | 5,642,228,000 | 0.005 | 2026/9/20 | 0.85 |
| 日本 | 国債証券 | 第373回利付国債(10年) | 5,700,000,000 | 98.94 | 5,639,609,600 | 97.72 | 5,570,553,000 | 0.600 | 2033/12/20 | 0.84 |
| 日本 | 国債証券 | 第366回利付国債(10年) | 5,760,000,000 | 98.38 | 5,667,065,000 | 96.22 | 5,542,675,200 | 0.200 | 2032/3/20 | 0.83 |
| 日本 | 国債証券 | 第372回利付国債(10年) | 5,320,000,000 | 100.66 | 5,355,261,900 | 99.82 | 5,310,690,000 | 0.800 | 2033/9/20 | 0.80 |
| 日本 | 国債証券 | 第368回利付国債(10年) | 5,550,000,000 | 98.02 | 5,440,214,200 | 95.65 | 5,309,074,500 | 0.200 | 2032/9/20 | 0.80 |
| 日本 | 国債証券 | 第364回利付国債(10年) | 5,520,000,000 | 97.90 | 5,404,080,000 | 96.05 | 5,302,180,800 | 0.100 | 2031/9/20 | 0.80 |
| 日本 | 国債証券 | 第360回利付国債(10年) | 5,430,000,000 | 98.63 | 5,355,718,700 | 97.19 | 5,277,525,600 | 0.100 | 2030/9/20 | 0.80 |
| 日本 | 国債証券 | 第150回利付国債(5年) | 5,310,000,000 | 100.08 | 5,314,248,000 | 99.24 | 5,269,644,000 | 0.005 | 2026/12/20 | 0.79 |
| 日本 | 国債証券 | 第349回利付国債(10年) | 5,160,000,000 | 100.17 | 5,169,092,800 | 99.10 | 5,113,611,600 | 0.100 | 2027/12/20 | 0.77 |
| 日本 | 国債証券 | 第369回利付国債(10年) | 5,220,000,000 | 100.65 | 5,254,382,600 | 97.89 | 5,109,962,400 | 0.500 | 2032/12/20 | 0.77 |
| 日本 | 国債証券 | 第367回利付国債(10年) | 5,280,000,000 | 98.28 | 5,189,362,200 | 95.92 | 5,065,051,200 | 0.200 | 2032/6/20 | 0.76 |
| 日本 | 国債証券 | 第154回利付国債(5年) | 5,090,000,000 | 100.30 | 5,105,270,000 | 99.21 | 5,049,890,800 | 0.100 | 2027/9/20 | 0.76 |
| 日本 | 国債証券 | 第363回利付国債(10年) | 5,220,000,000 | 98.15 | 5,123,743,000 | 96.38 | 5,031,036,000 | 0.100 | 2031/6/20 | 0.76 |

| | | | | | | | | | | |
|----|------|----------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-------|------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第341回利付国債（10年） | 5,020,000,000 | 100.90 | 5,065,631,800 | 100.14 | 5,027,329,200 | 0.300 | 2025/12/20 | 0.76 |
| 日本 | 国債証券 | 第147回利付国債（5年） | 5,040,000,000 | 100.12 | 5,046,399,600 | 99.54 | 5,016,816,000 | 0.005 | 2026/3/20 | 0.76 |
| 日本 | 国債証券 | 第145回利付国債（5年） | 5,020,000,000 | 100.37 | 5,038,574,000 | 99.93 | 5,016,486,000 | 0.100 | 2025/9/20 | 0.76 |
| 日本 | 国債証券 | 第361回利付国債（10年） | 5,130,000,000 | 98.40 | 5,048,320,800 | 96.96 | 4,974,150,600 | 0.100 | 2030/12/20 | 0.75 |
| 日本 | 国債証券 | 第371回利付国債（10年） | 5,100,000,000 | 97.58 | 4,976,668,800 | 96.51 | 4,922,061,000 | 0.400 | 2033/6/20 | 0.74 |
| 日本 | 国債証券 | 第365回利付国債（10年） | 5,077,000,000 | 97.85 | 4,968,275,600 | 95.75 | 4,861,379,810 | 0.100 | 2031/12/20 | 0.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第345回利付国債（10年） | 4,880,000,000 | 100.35 | 4,897,140,600 | 99.48 | 4,855,063,200 | 0.100 | 2026/12/20 | 0.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第146回利付国債（5年） | 4,800,000,000 | 100.39 | 4,818,720,000 | 99.82 | 4,791,360,000 | 0.100 | 2025/12/20 | 0.72 |
| 日本 | 国債証券 | 第351回利付国債（10年） | 4,835,000,000 | 99.94 | 4,832,534,150 | 98.81 | 4,777,898,650 | 0.100 | 2028/6/20 | 0.72 |

(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)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

| 種類 | 投資比率（%） |
|-------|---------|
| 国債証券 | 84.78 |
| 地方債証券 | 4.96 |
| 特殊債券 | 5.58 |
| 社債券 | 4.59 |
| 合計 | 99.91 |

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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

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 | 513,785,064,551 | 69.50 |
| | イギリス | 28,295,575,192 | 3.83 |
| | カナダ | 24,103,359,917 | 3.26 |
| | フランス | 22,057,410,695 | 2.98 |
| | スイス | 20,863,775,082 | 2.82 |
| | ドイツ | 17,190,666,770 | 2.33 |
| | オランダ | 14,377,546,424 | 1.94 |
| | オーストラリア | 13,099,197,040 | 1.77 |
| | アイルランド | 13,026,935,988 | 1.76 |
| | デンマーク | 7,357,578,063 | 1.00 |
| | スウェーデン | 6,131,944,248 | 0.83 |
| | スペイン | 5,260,609,032 | 0.71 |

| | | | |
|---------------------|----------|-----------------|--------|
| | イタリア | 4,118,009,537 | 0.56 |
| | 香港 | 2,925,072,731 | 0.40 |
| | シンガポール | 2,165,135,877 | 0.29 |
| | フィンランド | 2,001,187,171 | 0.27 |
| | ジャージー | 1,832,510,251 | 0.25 |
| | ベルギー | 1,542,227,316 | 0.21 |
| | イスラエル | 1,399,232,119 | 0.19 |
| | ノルウェー | 1,222,252,003 | 0.17 |
| | ケイマン | 935,119,731 | 0.13 |
| | バミューダ | 924,360,510 | 0.13 |
| | キュラソー | 851,531,331 | 0.12 |
| | ニュージーランド | 511,869,433 | 0.07 |
| | リベリア | 414,526,888 | 0.06 |
| | オーストリア | 386,632,412 | 0.05 |
| | ルクセンブルク | 382,110,184 | 0.05 |
| | ポルトガル | 349,505,078 | 0.05 |
| | パナマ | 170,469,544 | 0.02 |
| | マン島 | 80,004,435 | 0.01 |
| | 小計 | 707,761,419,553 | 95.74 |
| 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 | 71,605,745 | 0.01 |
| | 香港 | 54,568,080 | 0.01 |
| | 小計 | 126,173,825 | 0.02 |
| 投資証券 | アメリカ | 11,113,484,736 | 1.50 |
| | オーストラリア | 910,486,727 | 0.12 |
| | フランス | 300,636,646 | 0.04 |
| | シンガポール | 237,712,302 | 0.03 |
| | イギリス | 204,096,337 | 0.03 |
| | 香港 | 113,106,461 | 0.02 |
| | カナダ | 55,014,122 | 0.01 |
| | ベルギー | 54,407,808 | 0.01 |
| | 小計 | 12,988,945,139 | 1.76 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 18,354,831,469 | 2.48 |
| 合計(純資産総額) | | 739,231,369,986 | 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 | 14,011,240,605 | 1.90 |
| | 買建 | カナダ | 576,122,446 | 0.08 |
| | 買建 | ドイツ | 2,474,155,389 | 0.33 |
| | 買建 | イギリス | 1,029,358,572 | 0.14 |

| | | | |
|----|---------|-------------|------|
| 買建 | オーストラリア | 630,856,512 | 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 | | 682,323,000 | 0.09 |

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国 / 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資比率 (%) |
|--------|----|--------------------------------|------------------------|-----------|------------|----------------|------------|----------------|----------|
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 545,058 | 52,271.23 | 28,490,854,806 | 63,113.02 | 34,400,259,180 | 4.65 |
| アメリカ | 株式 | APPLE INC | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 1,133,924 | 27,506.13 | 31,189,871,160 | 27,222.15 | 30,867,849,217 | 4.18 |
| アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP | 半導体・半導体製造装置 | 190,578 | 61,374.57 | 11,696,643,374 | 137,690.73 | 26,240,824,514 | 3.55 |
| アメリカ | 株式 | AMAZON.COM | 一般消費財・サービス流通・小売 | 717,541 | 18,925.27 | 13,579,662,902 | 28,392.62 | 20,372,871,818 | 2.76 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A | メディア・娯楽 | 456,849 | 19,562.29 | 8,937,013,538 | 26,068.93 | 11,909,566,886 | 1.61 |
| アメリカ | 株式 | META PLATFORMS INC-CLASS A | メディア・娯楽 | 171,346 | 41,388.65 | 7,091,779,794 | 67,878.07 | 11,630,637,153 | 1.57 |
| アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C | メディア・娯楽 | 397,755 | 19,672.12 | 7,824,684,886 | 26,343.50 | 10,478,262,820 | 1.42 |
| アメリカ | 株式 | BROADCOM INC | 半導体・半導体製造装置 | 34,367 | 124,568.65 | 4,281,050,804 | 210,029.47 | 7,218,083,070 | 0.98 |
| アメリカ | 株式 | ELI LILLY & CO | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 62,224 | 67,738.43 | 4,214,956,504 | 115,666.67 | 7,197,243,496 | 0.97 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 222,518 | 21,500.00 | 4,784,138,557 | 30,325.63 | 6,747,998,981 | 0.91 |
| アメリカ | 株式 | TESLA INC | 自動車・自動車部品 | 221,215 | 30,615.90 | 6,772,697,861 | 30,446.44 | 6,735,210,331 | 0.91 |
| アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B | 金融サービス | 101,297 | 50,535.82 | 5,119,127,629 | 62,910.62 | 6,372,657,479 | 0.86 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL | エネルギー | 307,151 | 16,479.20 | 5,061,604,909 | 18,771.51 | 5,765,689,911 | 0.78 |
| アメリカ | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC | ヘルスケア機器・サービス | 71,401 | 75,818.78 | 5,413,537,211 | 76,728.80 | 5,478,513,549 | 0.74 |
| アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | 金融サービス | 122,188 | 35,322.89 | 4,316,034,139 | 42,651.69 | 5,211,525,431 | 0.70 |
| デンマーク | 株式 | NOVO NORDISK A/S-B | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 253,029 | 12,899.15 | 3,263,861,089 | 19,952.24 | 5,048,495,335 | 0.68 |

| | | | | | | | | | |
|------|----|------------------------|------------------------|---------|------------|---------------|------------|---------------|------|
| アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC-CLASS A | 金融サービス | 64,870 | 58,700.94 | 3,807,930,401 | 71,718.98 | 4,652,410,881 | 0.63 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO | 家庭用品・パーソナル用品 | 181,466 | 22,857.19 | 4,147,803,204 | 25,364.45 | 4,602,786,010 | 0.62 |
| オランダ | 株式 | ASML HOLDING NV | 半導体・半導体製造装置 | 31,092 | 113,978.63 | 3,543,823,726 | 142,515.32 | 4,431,086,454 | 0.60 |
| アメリカ | 株式 | JOHNSON & JOHNSON | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 185,343 | 24,193.97 | 4,484,184,835 | 23,036.05 | 4,269,572,098 | 0.58 |
| アメリカ | 株式 | HOME DEPOT | 一般消費財・サービス流通・小売り | 77,067 | 45,891.01 | 3,536,682,806 | 52,843.92 | 4,072,522,383 | 0.55 |
| アメリカ | 株式 | MERCK & CO | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 195,618 | 17,382.95 | 3,400,418,109 | 20,415.82 | 3,993,703,442 | 0.54 |
| アメリカ | 株式 | COSTCO WHOLESALE CORP | 生活必需品流通・小売り | 34,237 | 80,020.56 | 2,739,664,221 | 113,961.17 | 3,901,688,817 | 0.53 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | エネルギー | 138,024 | 24,151.61 | 3,333,502,785 | 26,097.17 | 3,602,036,758 | 0.49 |
| アメリカ | 株式 | ABBVIE INC | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 136,294 | 21,639.64 | 2,949,354,184 | 25,342.48 | 3,454,029,059 | 0.47 |
| アメリカ | 株式 | WALMART INC | 生活必需品流通・小売り | 347,772 | 7,690.88 | 2,674,672,817 | 9,451.65 | 3,287,021,310 | 0.44 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA - REGISTERED | 食品・飲料・タバコ | 205,438 | 19,196.95 | 3,943,784,041 | 15,853.41 | 3,256,893,583 | 0.44 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 銀行 | 549,785 | 4,432.70 | 2,437,036,626 | 5,891.59 | 3,239,110,557 | 0.44 |
| アメリカ | 株式 | SALESFORCE INC | ソフトウェア・サービス | 74,662 | 33,720.76 | 2,517,659,800 | 43,263.60 | 3,230,147,351 | 0.44 |
| アメリカ | 株式 | ADVANCED MICRO DEVICES | 半導体・半導体製造装置 | 124,711 | 19,750.57 | 2,463,113,585 | 25,135.37 | 3,134,658,375 | 0.42 |

(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)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□.種類別及び業種別の投資比率

| 種類 | 国内/外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|-------|------------------|----------|
| 株式 | 外国 | エネルギー | 4.82 |
| | | 素材 | 3.82 |
| | | 資本財 | 7.08 |
| | | 商業・専門サービス | 1.55 |
| | | 運輸 | 1.63 |
| | | 自動車・自動車部品 | 1.70 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 1.43 |
| | | 消費者サービス | 1.98 |
| | | メディア・娯楽 | 6.34 |
| | | 一般消費財・サービス流通・小売り | 4.80 |
| | | 生活必需品流通・小売り | 1.69 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 3.23 |

| | | |
|----------|------------------------|-------|
| | 家庭用品・パーソナル用品 | 1.60 |
| | ヘルスケア機器・サービス | 4.14 |
| | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.66 |
| | 銀行 | 5.49 |
| | 金融サービス | 6.54 |
| | 保険 | 2.98 |
| | エクイティ不動産投資信託（REIT） | 0.03 |
| | ソフトウェア・サービス | 9.62 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 5.60 |
| | 電気通信サービス | 1.07 |
| | 公益事業 | 2.54 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 8.11 |
| | 不動産管理・開発 | 0.30 |
| | 小計 | 95.74 |
| 新株予約権証券 | | |
| 投資信託受益証券 | | 0.02 |
| 投資証券 | | 1.76 |
| 合計 | | 97.52 |

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 地域 | 取引所 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 通貨 | 簿価金額 (現地通貨) | 帳簿価額 (円) | 評価金額 (現地通貨) | 評価金額 (円) | 投資比率 (%) |
|----------|---------|--------------------|---------------|---------|-----|-----------|----------------|----------------|----------------|----------------|-------------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | シカゴ商業取引所 | S&P 500 EMIN | 買建 | 347 | アメリカドル | 89,953,033.7 | 14,113,630,988 | 89,300,450 | 14,011,240,605 | 1.90 |
| | カナダ | モントリオール取引所 | S&P/TSE 60 | 買建 | 19 | カナダドル | 5,010,457.5 | 575,050,207 | 5,019,800 | 576,122,446 | 0.08 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | SWISS MKT IX | 買建 | 44 | スイスフラン | 5,058,948 | 870,999,077 | 4,978,160 | 857,089,807 | 0.12 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | DJ EURO STOXX | 買建 | 194 | ユーロ | 9,535,345.8 | 1,603,082,335 | 9,618,520 | 1,617,065,582 | 0.22 |
| | オーストラリア | シドニー先物取引所 | SPI 200 FUTU | 買建 | 32 | オーストラリアドル | 6,164,149 | 634,660,781 | 6,127,200 | 630,856,512 | 0.09 |
| | イギリス | ロンドン国際金融先物オプション取引所 | FTSE 100 | 買建 | 64 | イギリスポンド | 4,976,140 | 980,399,102 | 5,224,640 | 1,029,358,572 | 0.14 |

(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。

| 種類 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資比率 (%) |
|--------|--------|---------|--------------|-------------|-------------|-------------|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 買建 | 4,350,000.00 | 681,414,000 | 682,323,000 | 0.09 |

(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 | 156,642,694,702 | 45.90 |
| | 中国 | 31,006,620,475 | 9.09 |
| | フランス | 26,470,015,474 | 7.76 |
| | イタリア | 24,241,395,943 | 7.10 |
| | ドイツ | 20,744,645,784 | 6.08 |
| | イギリス | 16,944,349,788 | 4.96 |
| | スペイン | 16,223,049,281 | 4.75 |
| | カナダ | 6,787,766,107 | 1.99 |
| | ベルギー | 5,868,238,663 | 1.72 |
| | オランダ | 4,960,637,285 | 1.45 |
| | オーストラリア | 4,513,896,547 | 1.32 |
| | オーストリア | 4,011,951,078 | 1.18 |
| | メキシコ | 2,809,024,486 | 0.82 |
| | ポーランド | 1,853,889,900 | 0.54 |
| | フィンランド | 1,753,267,955 | 0.51 |
| | アイルランド | 1,715,085,755 | 0.50 |
| | マレーシア | 1,641,284,053 | 0.48 |
| | シンガポール | 1,367,149,718 | 0.40 |
| | イスラエル | 1,095,562,314 | 0.32 |
| | デンマーク | 893,009,170 | 0.26 |
| ニュージーランド | 829,191,895 | 0.24 | |
| スウェーデン | 636,780,932 | 0.19 | |
| ノルウェー | 523,569,839 | 0.15 | |
| | 小計 | 333,533,077,144 | 97.73 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 7,745,243,905 | 2.27 |
| 合計(純資産総額) | | 341,278,321,049 | 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 | 1,772,156,103 | 0.52 |
| | 買建 | ドイツ | 1,617,403,503 | 0.47 |

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

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

| 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 | | 4,100,709,132 | 1.20 |

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|------|------|-------------------|------------|---------------|---------------|--------------|---------------|-----------|------------|-----------------|
| アメリカ | 国債証券 | T 4.375% 08/31/28 | 14,150,000 | 15,789.04 | 2,234,150,446 | 15,491.42 | 2,192,036,415 | 4.375 | 2028/8/31 | 0.64 |
| アメリカ | 国債証券 | T 4.125% 11/15/32 | 14,000,000 | 15,897.19 | 2,225,607,727 | 15,133.49 | 2,118,689,344 | 4.125 | 2032/11/15 | 0.62 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.375% 05/15/33 | 13,630,000 | 14,961.78 | 2,039,290,649 | 14,249.70 | 1,942,235,055 | 3.375 | 2033/5/15 | 0.57 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.75% 08/15/32 | 12,900,000 | 14,408.12 | 1,858,648,383 | 13,671.13 | 1,763,576,827 | 2.750 | 2032/8/15 | 0.52 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.375% 05/15/27 | 11,690,000 | 14,723.77 | 1,721,209,641 | 14,621.11 | 1,709,208,782 | 2.375 | 2027/5/15 | 0.50 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3% 07/15/25 | 11,150,000 | 15,265.61 | 1,702,115,681 | 15,300.81 | 1,706,040,806 | 3.000 | 2025/7/15 | 0.50 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.5% 02/15/33 | 11,200,000 | 14,887.90 | 1,667,444,865 | 14,417.63 | 1,614,775,575 | 3.500 | 2033/2/15 | 0.47 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.625% 05/15/26 | 10,770,000 | 14,481.97 | 1,559,708,551 | 14,679.95 | 1,581,031,288 | 1.625 | 2026/5/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.375% 11/15/31 | 12,580,000 | 12,968.60 | 1,631,450,704 | 12,472.93 | 1,569,095,493 | 1.375 | 2031/11/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.125% 08/15/25 | 10,200,000 | 15,162.96 | 1,546,622,484 | 15,300.81 | 1,560,683,070 | 3.125 | 2025/8/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 4.5% 07/15/26 | 10,000,000 | 15,682.86 | 1,568,286,010 | 15,545.97 | 1,554,597,066 | 4.500 | 2026/7/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.875% 02/15/32 | 11,720,000 | 13,468.57 | 1,578,517,334 | 12,884.49 | 1,510,062,605 | 1.875 | 2032/2/15 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | T 4.625% 10/15/26 | 9,520,000 | 15,920.39 | 1,515,621,523 | 15,593.77 | 1,484,527,494 | 4.625 | 2026/10/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.875% 05/15/28 | 10,060,000 | 14,924.84 | 1,501,439,540 | 14,635.52 | 1,472,333,482 | 2.875 | 2028/5/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.625% 08/15/30 | 11,950,000 | 12,554.75 | 1,500,293,579 | 12,284.77 | 1,468,031,172 | 0.625 | 2030/8/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 4.125% 08/31/30 | 9,200,000 | 14,969.20 | 1,377,167,006 | 15,241.36 | 1,402,205,494 | 4.125 | 2030/8/31 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.875% 05/15/32 | 10,100,000 | 14,581.89 | 1,472,771,268 | 13,850.10 | 1,398,860,343 | 2.875 | 2032/5/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.875% 11/15/30 | 11,150,000 | 12,753.94 | 1,422,065,135 | 12,410.42 | 1,383,762,078 | 0.875 | 2030/11/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.75% 04/30/26 | 9,500,000 | 14,196.38 | 1,348,656,630 | 14,440.00 | 1,371,800,907 | 0.750 | 2026/4/30 | 0.40 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.875% 11/30/25 | 9,000,000 | 15,027.19 | 1,352,447,600 | 15,167.20 | 1,365,048,390 | 2.875 | 2025/11/30 | 0.40 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.625% 12/31/27 | 9,600,000 | 13,482.67 | 1,294,336,748 | 13,528.94 | 1,298,778,967 | 0.625 | 2027/12/31 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.25% 09/30/28 | 9,500,000 | 13,660.41 | 1,297,739,203 | 13,555.60 | 1,287,782,792 | 1.250 | 2028/9/30 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.125% 11/15/28 | 8,400,000 | 15,053.51 | 1,264,495,093 | 14,694.97 | 1,234,377,652 | 3.125 | 2028/11/15 | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.625% 02/15/53 | 9,550,000 | 14,803.05 | 1,413,691,346 | 12,924.02 | 1,234,244,352 | 3.625 | 2053/2/15 | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.25% 06/30/28 | 9,000,000 | 13,695.28 | 1,232,576,030 | 13,656.73 | 1,229,106,187 | 1.250 | 2028/6/30 | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.875% 11/30/29 | 8,130,000 | 15,554.10 | 1,264,548,351 | 15,090.59 | 1,226,865,214 | 3.875 | 2029/11/30 | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.875% 08/15/33 | 8,170,000 | 15,453.56 | 1,262,556,130 | 14,803.76 | 1,209,467,196 | 3.875 | 2033/8/15 | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.875% 05/15/52 | 10,800,000 | 12,265.11 | 1,324,632,789 | 11,132.85 | 1,202,347,987 | 2.875 | 2052/5/15 | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.875% 08/15/28 | 8,220,000 | 14,680.97 | 1,206,776,283 | 14,585.87 | 1,198,959,139 | 2.875 | 2028/8/15 | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.375% 04/30/25 | 8,000,000 | 14,478.00 | 1,158,240,708 | 14,958.78 | 1,196,702,684 | 0.375 | 2025/4/30 | 0.35 |

(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) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|----|---------|
|----|---------|

| | |
|------|-------|
| 国債証券 | 97.73 |
| 合計 | 97.73 |

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 地域 | 取引所 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 通貨 | 簿価金額 (現地通貨) | 帳簿価額 (円) | 評価金額 (現地通貨) | 評価金額 (円) | 投資比率 (%) |
|--------|------|-------------------|--------------|---------|----|--------|--------------|-------------|--------------|-------------|----------|
| 債券先物取引 | アメリカ | シカゴ商品取引所 | US 5YR NOTE | 買建 | 46 | アメリカドル | 4,881,730.49 | 765,943,514 | 4,834,312.5 | 758,503,631 | 0.22 |
| | アメリカ | シカゴ商品取引所 | US 10YR NOTE | 買建 | 28 | アメリカドル | 3,062,500.35 | 480,506,305 | 3,022,687.64 | 474,259,691 | 0.14 |
| | アメリカ | シカゴ商品取引所 | US LONG BOND | 買建 | 30 | アメリカドル | 3,517,865.25 | 551,953,057 | 3,437,812.5 | 539,392,781 | 0.16 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO-SCHATZ | 買建 | 16 | ユーロ | 1,688,888.6 | 283,935,951 | 1,684,320 | 283,167,878 | 0.08 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO-BOBL FU | 買建 | 22 | ユーロ | 2,588,646.2 | 435,203,199 | 2,571,360 | 432,297,043 | 0.13 |
| | ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO-BUND | 買建 | 41 | ユーロ | 5,419,256.1 | 911,085,336 | 5,364,850 | 901,938,582 | 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。

| 種類 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資比率 (%) |
|--------|------------|---------|---------------|---------------|---------------|----------|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 買建 | 12,830,000.00 | 1,972,194,578 | 2,008,100,280 | 0.59 |
| | カナダドル | 買建 | 1,350,000.00 | 150,989,971 | 154,536,255 | 0.05 |
| | ユーロ | 買建 | 7,830,000.00 | 1,285,133,131 | 1,313,957,781 | 0.39 |
| | イギリスポンド | 買建 | 1,100,000.00 | 210,701,524 | 216,205,770 | 0.06 |
| | マレーシアリングット | 買建 | 189,000.00 | 6,212,127 | 6,210,426 | 0.00 |
| | オフショア人民元 | 買建 | 18,600,000.00 | 394,019,433 | 401,698,620 | 0.12 |

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

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

外国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 | 37,946,343,608 | 47.79 |
| | 中国 | 7,522,526,527 | 9.47 |
| | フランス | 6,417,395,175 | 8.08 |
| | イタリア | 5,875,070,227 | 7.40 |
| | ドイツ | 5,024,494,807 | 6.33 |

| | | |
|---------------------|----------------|--------|
| イギリス | 4,108,707,065 | 5.17 |
| スペイン | 3,931,419,285 | 4.95 |
| カナダ | 1,649,540,708 | 2.08 |
| ベルギー | 1,422,156,746 | 1.79 |
| オランダ | 1,199,932,556 | 1.51 |
| オーストラリア | 1,092,341,517 | 1.38 |
| オーストリア | 971,592,979 | 1.22 |
| メキシコ | 680,906,208 | 0.86 |
| ポーランド | 450,560,475 | 0.57 |
| フィンランド | 424,875,771 | 0.54 |
| アイルランド | 416,263,921 | 0.52 |
| マレーシア | 398,334,837 | 0.50 |
| シンガポール | 331,793,067 | 0.42 |
| イスラエル | 267,448,576 | 0.34 |
| デンマーク | 216,499,247 | 0.27 |
| ニュージーランド | 202,993,810 | 0.26 |
| スウェーデン | 154,423,890 | 0.19 |
| ノルウェー | 126,819,842 | 0.16 |
| 小計 | 80,832,440,844 | 101.79 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | 1,422,951,252 | 1.79 |
| 合計(純資産総額) | 79,409,489,592 | 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 | 221,667,832 | 0.28 |
| | 買建 | ドイツ | 204,338,091 | 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 | 売建 | | 83,094,955,079 | 104.64 |

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円)単価 | 帳簿価額(円)金額 | 評価額(円)単価 | 評価額(円)金額 | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|------|----|-----|----|-----------|-----------|----------|----------|-------|------|---------|
|------|----|-----|----|-----------|-----------|----------|----------|-------|------|---------|

| | | | | | | | | | | |
|------|------|-------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|-------|------------|------|
| アメリカ | 国債証券 | T 1.25% 04/30/28 | 5,040,000 | 13,786.97 | 694,863,521 | 13,719.25 | 691,450,209 | 1.250 | 2028/4/30 | 0.87 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.875% 05/15/28 | 4,230,000 | 14,798.44 | 625,974,090 | 14,635.52 | 619,082,567 | 2.875 | 2028/5/15 | 0.78 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.375% 05/15/33 | 4,010,000 | 14,787.09 | 592,962,408 | 14,249.70 | 571,413,247 | 3.375 | 2033/5/15 | 0.72 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.125% 08/15/25 | 3,700,000 | 15,260.36 | 564,633,457 | 15,300.81 | 566,130,132 | 3.125 | 2025/8/15 | 0.71 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.5% 02/15/33 | 3,800,000 | 14,803.14 | 562,519,593 | 14,417.63 | 547,870,284 | 3.500 | 2033/2/15 | 0.69 |
| アメリカ | 国債証券 | T 4.625% 11/15/26 | 3,400,000 | 15,628.82 | 531,380,162 | 15,595.61 | 530,250,907 | 4.625 | 2026/11/15 | 0.67 |
| アメリカ | 国債証券 | T 4.25% 10/15/25 | 3,300,000 | 15,548.72 | 513,108,044 | 15,501.84 | 511,560,803 | 4.250 | 2025/10/15 | 0.64 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.875% 08/15/33 | 3,150,000 | 15,278.47 | 481,271,876 | 14,803.76 | 466,318,440 | 3.875 | 2033/8/15 | 0.59 |
| アメリカ | 国債証券 | T 4.875% 10/31/30 | 2,900,000 | 16,582.93 | 480,905,187 | 15,887.96 | 460,750,947 | 4.875 | 2030/10/31 | 0.58 |
| アメリカ | 国債証券 | T 4.375% 08/15/26 | 2,890,000 | 15,640.96 | 452,023,997 | 15,503.06 | 448,038,676 | 4.375 | 2026/8/15 | 0.56 |
| アメリカ | 国債証券 | T 5% 08/31/25 | 2,750,000 | 15,712.04 | 432,081,118 | 15,659.96 | 430,649,129 | 5.000 | 2025/8/31 | 0.54 |
| アメリカ | 国債証券 | T 4.125% 10/31/27 | 2,800,000 | 15,729.02 | 440,412,652 | 15,363.94 | 430,190,380 | 4.125 | 2027/10/31 | 0.54 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.75% 08/31/25 | 2,730,000 | 15,278.53 | 417,103,935 | 15,211.63 | 415,277,741 | 2.750 | 2025/8/31 | 0.52 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.625% 05/15/26 | 2,640,000 | 15,522.59 | 409,796,597 | 15,283.95 | 403,496,540 | 3.625 | 2026/5/15 | 0.51 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.125% 02/15/31 | 3,190,000 | 12,749.65 | 406,714,067 | 12,554.45 | 400,487,004 | 1.125 | 2031/2/15 | 0.50 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.625% 04/15/25 | 2,600,000 | 15,211.94 | 395,510,578 | 15,313.63 | 398,154,392 | 2.625 | 2025/4/15 | 0.50 |
| アメリカ | 国債証券 | T 4.375% 11/30/30 | 2,510,000 | 15,776.39 | 395,987,439 | 15,450.35 | 387,804,026 | 4.375 | 2030/11/30 | 0.49 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.875% 05/15/32 | 2,730,000 | 14,168.80 | 386,808,391 | 13,850.10 | 378,107,795 | 2.875 | 2032/5/15 | 0.48 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.25% 08/31/25 | 2,550,000 | 14,693.02 | 374,672,254 | 14,713.05 | 375,182,835 | 0.250 | 2025/8/31 | 0.47 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3.125% 11/15/28 | 2,350,000 | 14,881.90 | 349,724,735 | 14,694.97 | 345,331,843 | 3.125 | 2028/11/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.875% 02/28/29 | 2,400,000 | 13,861.19 | 332,668,766 | 13,809.34 | 331,424,282 | 1.875 | 2029/2/28 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.125% 08/31/28 | 2,450,000 | 13,624.53 | 333,801,190 | 13,512.70 | 331,061,297 | 1.125 | 2028/8/31 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.125% 10/31/26 | 2,290,000 | 14,291.38 | 327,272,686 | 14,315.59 | 327,827,072 | 1.125 | 2026/10/31 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | T 1.375% 11/15/31 | 2,620,000 | 12,684.99 | 332,346,926 | 12,472.93 | 326,790,953 | 1.375 | 2031/11/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.875% 11/15/30 | 2,630,000 | 12,558.74 | 330,294,909 | 12,410.42 | 326,394,104 | 0.875 | 2030/11/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.75% 03/31/26 | 2,200,000 | 14,400.47 | 316,810,518 | 14,486.89 | 318,711,704 | 0.750 | 2026/3/31 | 0.40 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.625% 03/31/27 | 2,260,000 | 14,028.68 | 317,048,252 | 13,922.72 | 314,653,694 | 0.625 | 2027/3/31 | 0.40 |
| アメリカ | 国債証券 | T 0.75% 04/30/26 | 2,150,000 | 14,349.60 | 308,516,575 | 14,440.00 | 310,460,205 | 0.750 | 2026/4/30 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | T 3% 07/15/25 | 2,000,000 | 15,244.42 | 304,888,569 | 15,300.81 | 306,016,288 | 3.000 | 2025/7/15 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | T 2.875% 08/15/28 | 2,090,000 | 14,741.46 | 308,096,541 | 14,585.87 | 304,844,840 | 2.875 | 2028/8/15 | 0.38 |

(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)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 101.79 |
| 合計 | 101.79 |

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 地域 | 取引所 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 通貨 | 簿価金額 (現地通貨) | 帳簿価額 (円) | 評価金額 (現地通貨) | 評価金額 (円) | 投資比率 (%) |
|--------|------|----------|--------------|---------|----|--------|-------------|------------|-------------|------------|----------|
| 債券先物取引 | アメリカ | シカゴ商品取引所 | US 5YR NOTE | 買建 | 6 | アメリカドル | 635,376.19 | 99,690,524 | 630,562.5 | 98,935,256 | 0.12 |
| | アメリカ | シカゴ商品取引所 | US 10YR NOTE | 買建 | 3 | アメリカドル | 328,149.03 | 51,486,583 | 323,859.39 | 50,813,538 | 0.06 |

| | | | | | | | | | | |
|------|-------------------|--------------|----|---|--------|-----------|-------------|---------|-------------|------|
| アメリカ | シカゴ商品取引所 | US LONG BOND | 買建 | 4 | アメリカドル | 465,073.7 | 72,970,064 | 458,375 | 71,919,038 | 0.09 |
| ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO-SCHATZ | 買建 | 2 | ユーロ | 211,199.2 | 35,506,810 | 210,540 | 35,395,985 | 0.04 |
| ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO-BOBL FU | 買建 | 3 | ユーロ | 352,626.3 | 59,283,533 | 350,640 | 58,949,596 | 0.07 |
| ドイツ | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 | EURO-BUND | 買建 | 5 | ユーロ | 661,810.5 | 111,263,581 | 654,250 | 109,992,510 | 0.14 |

(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。

| 種類 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資比率 (%) |
|--------|------------|---------|----------------|----------------|----------------|----------|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 売建 | 249,932,000.00 | 37,662,136,102 | 39,166,343,856 | 49.32 |
| | カナダドル | 売建 | 14,748,000.00 | 1,634,596,074 | 1,690,426,082 | 2.13 |
| | メキシコペソ | 売建 | 78,612,000.00 | 710,313,035 | 722,389,251 | 0.91 |
| | ユーロ | 売建 | 156,559,000.00 | 25,504,860,669 | 26,296,479,401 | 33.12 |
| | イギリスポンド | 売建 | 21,771,000.00 | 4,136,333,916 | 4,284,212,764 | 5.40 |
| | スウェーデンクローナ | 売建 | 10,953,000.00 | 155,033,022 | 156,920,343 | 0.20 |
| | ノルウェークローネ | 売建 | 9,142,000.00 | 127,434,448 | 130,243,330 | 0.16 |
| | デンマーククローネ | 売建 | 9,845,000.00 | 215,112,480 | 221,820,647 | 0.28 |
| | ポーランドズロチ | 売建 | 11,937,000.00 | 450,050,491 | 464,312,293 | 0.58 |
| | オーストラリアドル | 売建 | 11,096,000.00 | 1,089,332,739 | 1,141,290,176 | 1.44 |
| | ニュージーランドドル | 売建 | 2,252,000.00 | 202,870,196 | 210,551,414 | 0.27 |
| | シンガポールドル | 売建 | 2,974,000.00 | 332,467,630 | 342,690,152 | 0.43 |
| | マレーシアリングット | 売建 | 12,328,000.00 | 392,561,318 | 405,090,682 | 0.51 |
| | イスラエルシェケル | 売建 | 6,592,000.00 | 269,379,164 | 275,778,956 | 0.35 |
| | オフショア人民元 | 売建 | 350,982,000.00 | 7,297,331,784 | 7,586,405,732 | 9.55 |

(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 | 34,740,598,612 | 17.18 |
| | 台湾 | 32,213,438,807 | 15.93 |
| | ケイマン | 29,250,495,099 | 14.47 |
| | 韓国 | 23,148,117,000 | 11.45 |
| | 中国 | 20,472,552,494 | 10.13 |
| | ブラジル | 9,311,050,964 | 4.61 |
| | サウジアラビア | 7,984,114,388 | 3.95 |
| | 南アフリカ | 5,072,742,527 | 2.51 |

| | | | |
|---------------------|-----------|-----------------|--------|
| | メキシコ | 4,702,176,878 | 2.33 |
| | インドネシア | 3,261,773,244 | 1.61 |
| | タイ | 2,796,336,396 | 1.38 |
| | マレーシア | 2,697,413,349 | 1.33 |
| | アラブ首長国連邦 | 2,225,867,593 | 1.10 |
| | ポーランド | 1,743,130,529 | 0.86 |
| | 香港 | 1,590,183,645 | 0.79 |
| | カタール | 1,569,958,567 | 0.78 |
| | トルコ | 1,463,348,359 | 0.72 |
| | クウェート | 1,409,577,158 | 0.70 |
| | フィリピン | 1,138,148,438 | 0.56 |
| | ギリシャ | 1,000,896,113 | 0.50 |
| | チリ | 872,796,317 | 0.43 |
| | バミューダ | 717,762,349 | 0.35 |
| | アメリカ | 716,092,342 | 0.35 |
| | ハンガリー | 550,103,701 | 0.27 |
| | イギリス | 263,745,968 | 0.13 |
| | チェコ | 262,538,013 | 0.13 |
| | ルクセンブルク | 247,169,409 | 0.12 |
| | エジプト | 216,136,591 | 0.11 |
| | コロンビア | 189,911,205 | 0.09 |
| | ペルー | 103,254,729 | 0.05 |
| | シンガポール | 85,525,280 | 0.04 |
| | オランダ | 17,388,247 | 0.01 |
| | ロシア | 128 | 0.00 |
| | キプロス | - | - |
| | 英ヴァージン諸島 | - | - |
| | 小計 | 192,034,344,439 | 94.98 |
| 投資信託受益証券 | ブラジル | 371,066,321 | 0.18 |
| | メキシコ | 153,833,755 | 0.08 |
| | 小計 | 524,900,076 | 0.26 |
| 投資証券 | メキシコ | 222,940,296 | 0.11 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 9,411,142,647 | 4.65 |
| | 合計(純資産総額) | 202,193,327,458 | 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 | 9,736,841,362 | 4.82 |

(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 | | 580,371,600 | 0.29 |

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国 / 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資比率 (%) |
|---------|----|------------------------------|--------------------|------------|------------|----------------|-----------|----------------|----------|
| 台湾 | 株式 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 半導体・半導体製造装置 | 4,160,389 | 2,710.51 | 11,276,797,856 | 3,825.69 | 15,916,396,037 | 7.87 |
| ケイマン | 株式 | TENCENT HOLDINGS LTD | メディア・娯楽 | 1,128,100 | 6,136.72 | 6,922,843,502 | 6,969.38 | 7,862,157,578 | 3.89 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 806,665 | 8,044.41 | 6,489,144,313 | 8,751.47 | 7,059,504,548 | 3.49 |
| ケイマン | 株式 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 一般消費財・サービス流通・小売り | 2,735,288 | 1,638.24 | 4,481,079,926 | 1,490.71 | 4,077,541,689 | 2.02 |
| インド | 株式 | RELIANCE INDUSTRIES LTD | エネルギー | 506,553 | 4,397.88 | 2,227,759,706 | 5,538.64 | 2,805,617,241 | 1.39 |
| ケイマン | 株式 | PDD HOLDINGS INC-ADR | 一般消費財・サービス流通・小売り | 101,071 | 17,279.98 | 1,746,505,867 | 19,898.05 | 2,011,116,620 | 0.99 |
| ケイマン | 株式 | MEITUAN-CLASS B | 消費者サービス | 873,750 | 2,258.07 | 1,972,992,119 | 2,233.56 | 1,951,581,787 | 0.97 |
| インド | 株式 | ICICI BANK LTD | 銀行 | 879,852 | 1,779.79 | 1,565,956,957 | 2,190.13 | 1,926,992,020 | 0.95 |
| 韓国 | 株式 | SK HYNIX INC | 半導体・半導体製造装置 | 91,166 | 14,739.22 | 1,343,715,875 | 20,070.19 | 1,829,718,942 | 0.90 |
| 中国 | 株式 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 銀行 | 16,601,620 | 90.14 | 1,496,525,238 | 101.65 | 1,687,612,779 | 0.83 |
| 台湾 | 株式 | HON HAI PRECISION INDUSTRY | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 2,185,248 | 473.53 | 1,034,784,869 | 762.73 | 1,666,762,292 | 0.82 |
| インド | 株式 | INFOSYS LTD | ソフトウェア・サービス | 553,283 | 2,619.90 | 1,449,551,368 | 2,712.14 | 1,500,586,488 | 0.74 |
| インド | 株式 | HDFC BANK LTD | 銀行 | 485,940 | 2,802.87 | 1,362,027,233 | 2,889.43 | 1,404,090,586 | 0.69 |
| 台湾 | 株式 | MEDIATEK INC | 半導体・半導体製造装置 | 253,804 | 4,408.66 | 1,118,936,729 | 4,884.38 | 1,239,675,943 | 0.61 |
| ブラジル | 株式 | VALE SA | 素材 | 581,587 | 2,156.59 | 1,254,249,695 | 1,956.48 | 1,137,865,550 | 0.56 |
| インド | 株式 | TATA CONSULTANCY SVCS LTD | ソフトウェア・サービス | 152,359 | 6,345.81 | 966,842,070 | 7,315.43 | 1,114,572,209 | 0.55 |
| サウジアラビア | 株式 | AL RAJHI BANK | 銀行 | 324,926 | 3,007.94 | 977,358,386 | 3,364.57 | 1,093,236,272 | 0.54 |
| 韓国 | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 141,877 | 6,540.24 | 927,910,721 | 7,382.27 | 1,047,374,321 | 0.52 |
| ケイマン | 株式 | NETEASE INC | メディア・娯楽 | 338,630 | 3,544.27 | 1,200,197,494 | 3,027.54 | 1,025,219,256 | 0.51 |

| | | | | | | | | | |
|--------|----|------------------------------|--------------------|------------|-----------|-------------|-----------|---------------|------|
| ブラジル | 株式 | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | エネルギー | 778,040 | 1,078.37 | 839,017,461 | 1,290.54 | 1,004,095,231 | 0.50 |
| インド | 株式 | BHARTI AIRTEL LTD | 電気通信サービス | 389,936 | 1,792.07 | 698,794,975 | 2,519.84 | 982,577,305 | 0.49 |
| ケイマン | 株式 | JD.COM INC - CL A | 一般消費財・サービス流通・小売り | 414,161 | 2,025.14 | 838,737,436 | 2,365.90 | 979,863,510 | 0.48 |
| 中国 | 株式 | BANK OF CHINA LTD-H | 銀行 | 13,437,200 | 56.06 | 753,417,355 | 72.78 | 977,979,572 | 0.48 |
| 南アフリカ | 株式 | NASPERS LTD-N SHS | 一般消費財・サービス流通・小売り | 30,591 | 27,160.85 | 830,877,620 | 30,420.73 | 930,600,738 | 0.46 |
| 中国 | 株式 | IND&COMM BK OF CHINA-H | 銀行 | 10,851,515 | 74.43 | 807,747,200 | 84.20 | 913,806,078 | 0.45 |
| ケイマン | 株式 | XIAOMI CORP-CLASS B | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 2,554,200 | 330.18 | 843,368,716 | 349.27 | 892,107,988 | 0.44 |
| インドネシア | 株式 | BANK CENTRAL ASIA PT | 銀行 | 9,369,500 | 87.28 | 817,854,875 | 95.06 | 890,664,670 | 0.44 |
| ブラジル | 株式 | PETROBRAS - PETROLEO BRAS | エネルギー | 634,100 | 1,149.77 | 729,069,491 | 1,363.72 | 864,735,655 | 0.43 |
| 中国 | 株式 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 保険 | 1,178,000 | 756.06 | 890,645,096 | 733.83 | 864,451,740 | 0.43 |
| インド | 株式 | AXIS BANK LTD | 銀行 | 391,573 | 1,938.86 | 759,206,986 | 2,191.36 | 858,077,605 | 0.42 |

(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)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

| 種類 | 国内/外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|-------------|-------|------------------------|----------|
| 株式 | 外国 | エネルギー | 5.16 |
| | | 素材 | 7.02 |
| | | 資本財 | 4.63 |
| | | 商業・専門サービス | 0.03 |
| | | 運輸 | 1.92 |
| | | 自動車・自動車部品 | 3.72 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 1.16 |
| | | 消費者サービス | 2.53 |
| | | メディア・娯楽 | 6.09 |
| | | 一般消費財・サービス流通・小売り | 4.90 |
| | | 生活必需品流通・小売り | 1.30 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 3.21 |
| | | 家庭用品・パーソナル用品 | 0.71 |
| | | ヘルスケア機器・サービス | 0.98 |
| | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 2.24 |
| | | 銀行 | 16.17 |
| | | 金融サービス | 2.51 |
| | | 保険 | 2.44 |
| | | ソフトウェア・サービス | 2.28 |
| | | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 8.47 |
| 電気通信サービス | 2.52 | | |
| 公益事業 | 2.67 | | |
| 半導体・半導体製造装置 | 10.95 | | |

| | | |
|----------|----------|-------|
| | 不動産管理・開発 | 1.37 |
| | 小計 | 94.98 |
| 投資信託受益証券 | | 0.26 |
| 投資証券 | | 0.11 |
| 合計 | | 95.35 |

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 地域 | 取引所 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 通貨 | 簿価金額 (現地通貨) | 帳簿価額 (円) | 評価金額 (現地通貨) | 評価金額 (円) | 投資比率 (%) |
|----------|------|----------------|--------------|---------|-------|--------|-------------|---------------|-------------|---------------|----------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | インターコンチネンタル取引所 | MSCI EMERG M | 買建 | 1,175 | アメリカドル | 61,840,360 | 9,702,752,483 | 62,057,625 | 9,736,841,362 | 4.82 |

(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。

| 種類 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資比率 (%) |
|--------|--------|---------|--------------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 買建 | 3,700,000.00 | 579,348,000 | 580,371,600 | 0.29 |

(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 | 14,362,878,209 | 10.01 |
| | マレーシア | 14,110,508,373 | 9.84 |
| | ブラジル | 13,862,852,174 | 9.67 |
| | インドネシア | 13,648,909,823 | 9.52 |
| | タイ | 13,572,536,932 | 9.46 |
| | メキシコ | 13,456,324,159 | 9.38 |
| | 南アフリカ | 11,997,027,607 | 8.37 |
| | ポーランド | 11,016,995,738 | 7.68 |
| | チェコ | 9,084,971,242 | 6.33 |
| | コロンビア | 6,493,385,229 | 4.53 |
| | ルーマニア | 5,924,904,559 | 4.13 |
| | ハンガリー | 4,141,746,566 | 2.89 |
| | ペルー | 3,196,800,081 | 2.23 |
| | チリ | 2,559,351,756 | 1.78 |
| | ウルグアイ | 294,588,597 | 0.21 |
| ドミニカ共和国 | 215,769,372 | 0.15 | |

| | | | |
|---------------------|----|-----------------|--------|
| | 小計 | 137,939,550,417 | 96.18 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 5,476,551,999 | 3.82 |
| 合計(純資産総額) | | 143,416,102,416 | 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 | | 2,298,697,412 | 1.60 |

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|-------|------|--------------------------|----------------|---------------|---------------|--------------|---------------|-----------|------------|-----------------|
| コロンビア | 国債証券 | COLOM 9.85% 06/28/27 | 62,300,000,000 | 3.86 | 2,405,259,486 | 3.90 | 2,434,326,349 | 9.850 | 2027/6/28 | 1.70 |
| ブラジル | 国債証券 | BNTNF 10% 01/01/27 | 68,300,000 | 3,019.16 | 2,062,086,968 | 3,008.42 | 2,054,751,991 | 10.000 | 2027/1/1 | 1.43 |
| ブラジル | 国債証券 | BLTN 0% 01/01/26 | 76,500,000 | 2,461.61 | 1,883,132,231 | 2,590.67 | 1,981,864,365 | 0.000 | 2026/1/1 | 1.38 |
| ブラジル | 国債証券 | BLTN 0% 07/01/26 | 78,000,000 | 2,337.49 | 1,823,249,283 | 2,457.49 | 1,916,848,567 | 0.000 | 2026/7/1 | 1.34 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 10.5% 12/21/26 | 209,200,000 | 875.01 | 1,830,532,574 | 862.19 | 1,803,708,174 | 10.500 | 2026/12/21 | 1.26 |
| マレーシア | 国債証券 | MGS 3.885% 08/15/29 | 51,800,000 | 3,300.56 | 1,709,692,468 | 3,300.40 | 1,709,609,045 | 3.885 | 2029/8/15 | 1.19 |
| ブラジル | 国債証券 | BNTNF 10% 01/01/25 | 54,900,000 | 3,028.41 | 1,662,600,652 | 3,053.19 | 1,676,202,529 | 10.000 | 2025/1/1 | 1.17 |
| コロンビア | 国債証券 | COLTES 7.25% 10/18/34 | 51,600,000,000 | 3.12 | 1,613,241,301 | 3.22 | 1,661,919,009 | 7.250 | 2034/10/18 | 1.16 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 8% 01/31/30 | 220,100,000 | 753.87 | 1,659,273,620 | 747.52 | 1,645,297,793 | 8.000 | 2030/1/31 | 1.15 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 8.875% 02/28/35 | 230,000,000 | 683.60 | 1,572,282,516 | 677.38 | 1,557,981,935 | 8.875 | 2035/2/28 | 1.09 |
| ブラジル | 国債証券 | BNTNF 10% 01/01/29 | 51,400,000 | 2,935.84 | 1,509,023,792 | 2,931.25 | 1,506,664,092 | 10.000 | 2029/1/1 | 1.05 |
| ブラジル | 国債証券 | BLTN 0% 07/01/27 | 68,000,000 | 2,181.12 | 1,483,167,608 | 2,200.94 | 1,496,640,368 | 0.000 | 2027/7/1 | 1.04 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 5.75% 03/05/26 | 175,300,000 | 836.54 | 1,466,469,198 | 846.54 | 1,483,994,476 | 5.750 | 2026/3/5 | 1.03 |
| マレーシア | 国債証券 | MGS 3.733% 06/15/28 | 43,000,000 | 3,280.82 | 1,410,753,813 | 3,277.98 | 1,409,532,441 | 3.733 | 2028/6/15 | 0.98 |
| ブラジル | 国債証券 | BLTN 0% 07/01/25 | 50,000,000 | 2,607.16 | 1,303,584,791 | 2,732.13 | 1,366,069,642 | 0.000 | 2025/7/1 | 0.95 |
| ポーランド | 国債証券 | POLGB 2.75% 10/25/29 | 38,900,000 | 3,417.39 | 1,329,368,234 | 3,395.98 | 1,321,038,852 | 2.750 | 2029/10/25 | 0.92 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 7.75% 05/29/31 | 160,800,000 | 827.08 | 1,329,950,783 | 817.45 | 1,314,460,384 | 7.750 | 2031/5/29 | 0.92 |
| コロンビア | 国債証券 | COLTES 7.25% 10/26/50 | 47,110,000,000 | 2.70 | 1,272,352,039 | 2.74 | 1,292,523,937 | 7.250 | 2050/10/26 | 0.90 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 8.25% 03/31/32 | 180,500,000 | 709.55 | 1,280,739,090 | 700.38 | 1,264,194,564 | 8.250 | 2032/3/31 | 0.88 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 8.5% 05/31/29 | 139,600,000 | 877.07 | 1,224,397,741 | 865.45 | 1,208,169,899 | 8.500 | 2029/5/31 | 0.84 |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------------------|-----------------|----------|---------------|----------|---------------|-------|------------|------|
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 7.5% 06/03/27 | 139,000,000 | 855.32 | 1,188,907,732 | 854.49 | 1,187,741,684 | 7.500 | 2027/6/3 | 0.83 |
| ポーランド | 国債証券 | POLGB 6% 10/25/33 | 29,300,000 | 4,067.32 | 1,191,726,086 | 3,977.55 | 1,165,424,570 | 6.000 | 2033/10/25 | 0.81 |
| マレーシア | 国債証券 | MGS 3.955% 09/15/25 | 33,900,000 | 3,319.17 | 1,125,200,592 | 3,308.35 | 1,121,531,784 | 3.955 | 2025/9/15 | 0.78 |
| ポーランド | 国債証券 | POLGB 7.5% 07/25/28 | 25,900,000 | 4,230.17 | 1,095,614,152 | 4,181.74 | 1,083,071,840 | 7.500 | 2028/7/25 | 0.76 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 8.75% 02/28/48 | 181,700,000 | 609.64 | 1,107,717,516 | 594.71 | 1,080,593,794 | 8.750 | 2048/2/28 | 0.75 |
| インドネシア | 国債証券 | INDOGB 5.5% 04/15/26 | 109,000,000,000 | 0.94 | 1,029,804,956 | 0.94 | 1,031,216,409 | 5.500 | 2026/4/15 | 0.72 |
| 南アフリカ | 国債証券 | SAGB 9% 01/31/40 | 162,300,000 | 643.43 | 1,044,291,231 | 630.07 | 1,022,615,296 | 9.000 | 2040/1/31 | 0.71 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 8% 11/07/47 | 130,700,000 | 784.56 | 1,025,428,652 | 754.73 | 986,441,301 | 8.000 | 2047/11/7 | 0.69 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 5.5% 03/04/27 | 120,000,000 | 809.19 | 971,030,063 | 814.22 | 977,068,815 | 5.500 | 2027/3/4 | 0.68 |
| メキシコ | 国債証券 | MBONO 7.5% 05/26/33 | 124,000,000 | 809.11 | 1,003,304,061 | 786.62 | 975,413,541 | 7.500 | 2033/5/26 | 0.68 |

(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)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 96.18 |
| 合計 | 96.18 |

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 種類 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資比率 (%) |
|--------|-------------|---------|----------------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | メキシコペソ | 買建 | 37,230,000.00 | 339,736,797 | 341,034,246 | 0.24 |
| | チェココルナ | 買建 | 33,980,000.00 | 220,649,246 | 226,432,526 | 0.16 |
| | ハンガリーフォリント | 買建 | 243,610,000.00 | 101,754,715 | 104,245,101 | 0.07 |
| | ポーランドズロチ | 買建 | 7,110,000.00 | 271,259,195 | 276,099,075 | 0.19 |
| | マレーシアリングギット | 買建 | 10,750,000.00 | 346,891,777 | 352,925,725 | 0.25 |
| | タイバーツ | 買建 | 80,260,000.00 | 335,533,940 | 339,074,422 | 0.24 |
| | 南アフリカランド | 買建 | 35,570,000.00 | 289,125,789 | 298,005,460 | 0.21 |
| | オフショア人民元 | 買建 | 16,710,000.00 | 354,321,435 | 360,880,857 | 0.25 |

(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 - R E I T 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 | 122,883,825,400 | 95.81 |

| | | | |
|---------------------|--|-----------------|--------|
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 5,371,287,338 | 4.19 |
| 合計（純資産総額） | | 128,255,112,738 | 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 | 5,330,820,000 | 4.16 |

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資 比率 （%） |
|----------|------|---------------------|--------|---------------|---------------|--------------|---------------|-----------------|
| 日本 | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 | 13,852 | 606,826.08 | 8,405,754,940 | 603,000 | 8,352,756,000 | 6.51 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 12,197 | 561,242.21 | 6,845,471,348 | 536,000 | 6,537,592,000 | 5.10 |
| 日本 | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 38,397 | 165,198.98 | 6,343,145,438 | 150,800 | 5,790,267,600 | 4.51 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人 | 20,684 | 273,770.59 | 5,662,671,051 | 272,600 | 5,638,458,400 | 4.40 |
| 日本 | 投資証券 | 日本都市ファンド投資法人 | 56,914 | 97,645.14 | 5,557,375,514 | 95,400 | 5,429,595,600 | 4.23 |
| 日本 | 投資証券 | KDX不動産投資法人 | 34,170 | 160,747.94 | 5,492,757,116 | 155,900 | 5,327,103,000 | 4.15 |
| 日本 | 投資証券 | GLP投資法人 | 39,883 | 135,686.15 | 5,411,570,872 | 128,500 | 5,124,965,500 | 4.00 |
| 日本 | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人 | 17,898 | 269,950.15 | 4,831,567,815 | 265,100 | 4,744,759,800 | 3.70 |
| 日本 | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人 | 57,489 | 57,771.27 | 3,321,212,982 | 70,800 | 4,070,221,200 | 3.17 |
| 日本 | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 26,560 | 149,610.18 | 3,973,646,533 | 151,500 | 4,023,840,000 | 3.14 |
| 日本 | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人 | 11,650 | 324,916.58 | 3,785,278,199 | 341,500 | 3,978,475,000 | 3.10 |
| 日本 | 投資証券 | オリックス不動産投資法人 | 23,658 | 170,184.93 | 4,026,235,134 | 166,500 | 3,939,057,000 | 3.07 |
| 日本 | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 39,747 | 67,617.32 | 2,687,585,756 | 83,000 | 3,299,001,000 | 2.57 |
| 日本 | 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人 | 35,679 | 78,259.02 | 2,792,203,772 | 81,000 | 2,889,999,000 | 2.25 |
| 日本 | 投資証券 | 産業ファンド投資法人 | 21,627 | 133,864.75 | 2,895,093,149 | 130,600 | 2,824,486,200 | 2.20 |
| 日本 | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人 | 8,120 | 346,493.46 | 2,813,526,914 | 342,000 | 2,777,040,000 | 2.17 |
| 日本 | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 4,100 | 608,534.21 | 2,494,990,300 | 658,000 | 2,697,800,000 | 2.10 |
| 日本 | 投資証券 | アクティブ・プロパティーズ投資法人 | 6,229 | 399,416.53 | 2,487,965,587 | 392,500 | 2,444,882,500 | 1.91 |
| 日本 | 投資証券 | ラサールロジポート投資法人 | 15,178 | 150,026.38 | 2,277,100,419 | 158,300 | 2,402,677,400 | 1.87 |
| 日本 | 投資証券 | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 4,939 | 465,185.67 | 2,297,552,044 | 453,000 | 2,237,367,000 | 1.74 |
| 日本 | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 7,579 | 283,343.5 | 2,147,460,447 | 281,300 | 2,131,972,700 | 1.66 |
| 日本 | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人 | 4,405 | 451,234.92 | 1,987,689,837 | 459,000 | 2,021,895,000 | 1.58 |
| 日本 | 投資証券 | イオンリート投資法人 | 14,565 | 142,199.2 | 2,071,131,408 | 138,100 | 2,011,426,500 | 1.57 |
| 日本 | 投資証券 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 5,839 | 317,458.96 | 1,853,642,881 | 342,500 | 1,999,857,500 | 1.56 |
| 日本 | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人 | 13,962 | 138,571.51 | 1,934,735,432 | 137,400 | 1,918,378,800 | 1.50 |
| 日本 | 投資証券 | 大和証券リビング投資法人 | 17,485 | 108,561.74 | 1,898,202,127 | 107,100 | 1,872,643,500 | 1.46 |
| 日本 | 投資証券 | ヒューリックリート投資法人 | 11,109 | 150,841.61 | 1,675,699,513 | 150,900 | 1,676,348,100 | 1.31 |

| | | | | | | | | |
|----|------|------------------|--------|------------|---------------|---------|---------------|------|
| 日本 | 投資証券 | 森トラストリート投資法人 | 22,887 | 73,107.61 | 1,673,213,938 | 73,200 | 1,675,328,400 | 1.31 |
| 日本 | 投資証券 | 三菱地所物流リート投資法人 | 4,100 | 377,328.3 | 1,547,046,048 | 404,500 | 1,658,450,000 | 1.29 |
| 日本 | 投資証券 | N T T都市開発リート投資法人 | 12,038 | 127,469.13 | 1,534,473,461 | 121,000 | 1,456,598,000 | 1.14 |

(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)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

(注3)銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

ロ.種類別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 95.81 |
| 合計 | 95.81 |

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 通貨 | 帳簿価額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|-------------|-------|------------|---------------|-------|----|---------------|---------------|-----------------|
| 不動産投信指数先物取引 | 大阪取引所 | 東証REIT指数先物 | 買建 | 2.955 | 円 | 5,086,318,730 | 5,330,820,000 | 4.16 |

(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 | 88,817,677,361 | 77.01 |
| | オーストラリア | 8,601,466,152 | 7.46 |
| | イギリス | 5,568,773,805 | 4.83 |
| | シンガポール | 3,768,169,070 | 3.27 |
| | フランス | 2,209,633,832 | 1.92 |
| | カナダ | 1,662,488,462 | 1.44 |
| | ベルギー | 1,271,481,932 | 1.10 |
| | 香港 | 1,092,641,467 | 0.95 |
| | スペイン | 526,094,060 | 0.46 |
| | ニュージーランド | 346,324,875 | 0.30 |
| | ガーンジー | 331,382,719 | 0.29 |
| | 韓国 | 215,713,967 | 0.19 |
| | オランダ | 204,849,239 | 0.18 |
| | イスラエル | 126,615,040 | 0.11 |
| | アイルランド | 45,165,438 | 0.04 |
| | ドイツ | 40,246,247 | 0.03 |
| | イタリア | 9,407,363 | 0.01 |
| 小計 | | 114,838,131,029 | 99.57 |

| | | | |
|---------------------|--|-----------------|--------|
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 496,174,081 | 0.43 |
| 合計（純資産総額） | | 115,334,305,110 | 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 | | 229,030,320 | 0.20 |

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円)単価 | 帳簿価額(円)金額 | 評価額(円)単価 | 評価額(円)金額 | 投資比率(%) |
|---------|------|------------------------------|-----------|------------|---------------|------------|---------------|---------|
| アメリカ | 投資証券 | PROLOGIS INC | 525,642 | 16,305.49 | 8,570,850,607 | 16,476.06 | 8,660,513,861 | 7.51 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUINIX INC | 53,409 | 118,988.01 | 6,355,031,099 | 113,962.74 | 6,086,636,301 | 5.28 |
| アメリカ | 投資証券 | WELLTOWER INC | 314,865 | 13,310.87 | 4,191,127,845 | 15,027.88 | 4,731,754,066 | 4.10 |
| アメリカ | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP | 185,255 | 18,015.13 | 3,337,394,362 | 22,723.82 | 4,209,702,571 | 3.65 |
| アメリカ | 投資証券 | REALTY INCOME CORP | 473,117 | 7,897.87 | 3,736,619,575 | 8,521.23 | 4,031,543,032 | 3.50 |
| アメリカ | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 172,291 | 20,102.80 | 3,463,532,589 | 22,333.14 | 3,847,800,058 | 3.34 |
| アメリカ | 投資証券 | PUBLIC STORAGE | 90,029 | 38,854.25 | 3,498,009,336 | 41,253.71 | 3,714,030,888 | 3.22 |
| オーストラリア | 投資証券 | GOODMAN GROUP | 984,071 | 2,347.75 | 2,310,353,882 | 3,211.32 | 3,160,169,245 | 2.74 |
| アメリカ | 投資証券 | VICI PROPERTIES INC | 589,410 | 4,423.21 | 2,607,085,733 | 4,557.94 | 2,686,498,362 | 2.33 |
| アメリカ | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC | 120,387 | 18,687.62 | 2,249,746,798 | 21,554.92 | 2,594,932,395 | 2.25 |
| アメリカ | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 80,872 | 26,192.88 | 2,118,270,676 | 29,971.03 | 2,423,817,785 | 2.10 |
| アメリカ | 投資証券 | IRON MOUNTAIN INC | 166,732 | 9,342.42 | 1,557,681,170 | 12,233.49 | 2,039,714,755 | 1.77 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL PPTY | 197,133 | 8,476.57 | 1,671,013,432 | 10,245.57 | 2,019,739,951 | 1.75 |
| アメリカ | 投資証券 | INVITATION HOMES INC | 326,177 | 4,910.96 | 1,601,842,831 | 5,425.60 | 1,769,706,584 | 1.53 |
| アメリカ | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 89,300 | 15,019.43 | 1,341,235,824 | 18,694.63 | 1,669,430,906 | 1.45 |
| アメリカ | 投資証券 | VENTAS INC | 228,277 | 6,611.48 | 1,509,249,704 | 7,008.72 | 1,599,930,260 | 1.39 |
| アメリカ | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST | 36,434 | 32,760.87 | 1,193,609,884 | 38,914.33 | 1,417,804,991 | 1.23 |
| アメリカ | 投資証券 | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 66,237 | 18,839.51 | 1,247,872,857 | 20,574.29 | 1,362,779,710 | 1.18 |
| アメリカ | 投資証券 | SUN COMMUNITIES INC | 70,625 | 18,002.42 | 1,271,420,985 | 18,876.63 | 1,333,162,629 | 1.16 |
| イギリス | 投資証券 | SEGR0 PLC | 761,753 | 1,552.36 | 1,182,515,776 | 1,685.30 | 1,283,789,247 | 1.11 |
| アメリカ | 投資証券 | HOST HOTELS AND RESORTS INC | 400,479 | 2,569.85 | 1,029,173,522 | 3,010.91 | 1,205,806,626 | 1.05 |
| アメリカ | 投資証券 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 402,007 | 2,497.34 | 1,003,949,128 | 2,971.68 | 1,194,638,574 | 1.04 |
| アメリカ | 投資証券 | KIMCO REALTY CORP | 378,461 | 2,779.94 | 1,052,101,291 | 2,951.28 | 1,116,947,786 | 0.97 |
| アメリカ | 投資証券 | WP CAREY INC | 124,225 | 8,526.28 | 1,059,178,224 | 8,739.32 | 1,085,643,269 | 0.94 |
| アメリカ | 投資証券 | UDR INC | 171,978 | 5,033.23 | 865,606,325 | 6,007.70 | 1,033,192,403 | 0.90 |
| アメリカ | 投資証券 | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 151,727 | 7,052.94 | 1,070,122,246 | 6,778.07 | 1,028,417,744 | 0.89 |
| アメリカ | 投資証券 | AMERICAN HOMES 4 RENT-A | 180,734 | 5,413.16 | 978,342,363 | 5,665.65 | 1,023,977,214 | 0.89 |
| アメリカ | 投資証券 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 105,934 | 10,185.01 | 1,078,939,598 | 9,525.39 | 1,009,063,618 | 0.87 |
| 香港 | 投資証券 | LINK REIT | 1,458,800 | 788.17 | 1,149,794,893 | 677.69 | 988,614,172 | 0.86 |

| | | | | | | | | |
|---------|------|---------------|-----------|--------|-------------|--------|-------------|------|
| オーストラリア | 投資証券 | SCENTRE GROUP | 2,955,904 | 265.98 | 786,226,265 | 324.32 | 958,670,609 | 0.83 |
|---------|------|---------------|-----------|--------|-------------|--------|-------------|------|

(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)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 99.57 |
| 合計 | 99.57 |

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 種類 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資比率 (%) |
|--------|--------|---------|--------------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 買建 | 1,460,000.00 | 227,666,400 | 229,030,320 | 0.20 |

(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 | 30,898,451,557 | 100.58 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 179,310,590 | 0.58 |
| 合計(純資産総額) | | 30,719,140,967 | 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 | | 31,735,436,498 | 103.31 |

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額(円) 単価 | 帳簿価額(円) 金額 | 評価額(円) 単価 | 評価額(円) 金額 | 投資比率 (%) |
|------|----------|--------------------|-----------|------------|----------------|-----------|----------------|----------|
| アメリカ | 投資信託受益証券 | ISHARES GOLD TRUST | 4,459,485 | 5,739.40 | 25,594,777,128 | 6,928.70 | 30,898,451,557 | 100.58 |

(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)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 種類別投資比率

| 種類 | 投資比率（％） |
|----------|---------|
| 投資信託受益証券 | 100.58 |
| 合計 | 100.58 |

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 種類 | 資産の名称 | 買建 / 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------|--------|---------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|
| 為替予約取引 | アメリカドル | 売建 | 203,200,898.62 | 31,494,267,419 | 31,735,436,498 | 103.31 |

(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。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2023年9月29日
作成基準日：2024年4月30日

基準価額・純資産の推移



基準価額 10,656円
純資産総額 13.49億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

| 決算期 | 分配金 |
|---------------|-----|
| - | - |
| - | - |
| - | - |
| - | - |
| - | - |
| 設定来 分配金合計額 | 0円 |

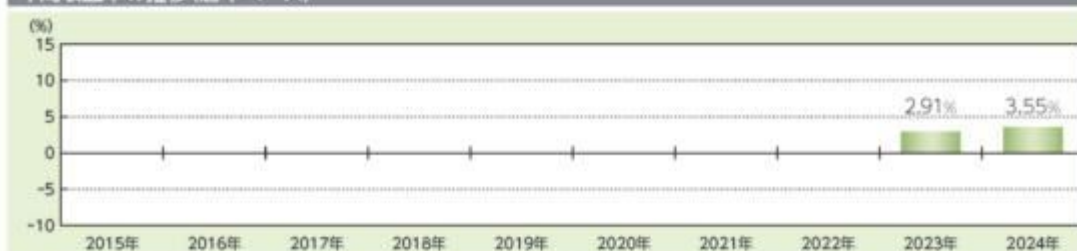
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

| マザーファンド | 投資比率 | 上位組入銘柄 | 国/地域 | 種類 | 業種 | 利率 | 償還期限 | 実質投資比率 |
|----------------------------|-------|------------------------------|-------|----------|-------------|--------|------------|--------|
| 国内債券インデックスマザーファンド | 42.7% | 第144回利付国債(5年) | 日本 | 国債 | - | 0.100% | 2025/06/20 | 0.4% |
| 新興国株式インデックスマザーファンド | 6.6% | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 台湾 | 株式 | 半導体・半導体製造装置 | - | - | 0.5% |
| ゴールドマザーファンド(海替ヘッジあり) | 6.6% | ISHARES GOLD TRUST | アメリカ | 投資信託受益証券 | - | - | - | 6.6% |
| 外国株式インデックスマザーファンド | 6.5% | MICROSOFT CORP. | アメリカ | 株式 | ソフトウェア・サービス | - | - | 0.3% |
| 国内株式インデックスマザーファンド | 6.4% | トヨタ自動車 | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | - | - | 0.3% |
| 外国債券インデックスマザーファンド | 6.2% | T 4.375% 08/31/28 | アメリカ | 国債 | - | 4.375% | 2028/08/31 | 0.0% |
| 新興国債券インデックスマザーファンド | 6.1% | COLOM 9.85% 06/28/27 | コロンビア | 国債 | - | 9.850% | 2027/06/28 | 0.1% |
| グローバルREITインデックスマザーファンド | 6.1% | PROLOGIS INC | アメリカ | 投資証券 | - | - | - | 0.5% |
| J-REITインデックスマザーファンド | 6.0% | 日本ビルファンド投資法人 | 日本 | 投資証券 | - | - | - | 0.4% |
| 外国債券インデックスマザーファンド(海替ヘッジあり) | 5.7% | T 1.25% 04/30/28 | アメリカ | 国債 | - | 1.250% | 2028/04/30 | 0.1% |

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2023年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2024年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページ等でご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1 申込（販売）手続等

< 訂正前 >

（前略）

< 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

（後略）

<訂正後>

（前略）

<申込みの受付>

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

2024年11月5日受付分からは、お申込みの受付は、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込受付分とします。当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（後略）

2 換金（解約）手続等

<訂正前>

（前略）

<一部解約の受付>

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

（後略）

<訂正後>

（前略）

<一部解約の受付>

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

2024年11月5日受付分からは、一部解約の実行の請求の受付は、原則として、営業日の午後3時半までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（後略）

第3【ファンドの経理状況】

<更新・訂正後>

(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1期中間計算期間(2023年9月29日から2024年3月28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 財務諸表

中間財務諸表

グローバル10資産バランスファンド

(1) 中間貸借対照表

(単位:円)

| 第1期中間計算期間 (2024年 3月28日現在) | |
|------------------------------|----------------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 13,723,500 |
| 親投資信託受益証券 | 1,195,555,063 |
| 未収利息 | 24 |
| 流動資産合計 | 1,209,278,587 |
| 資産合計 | 1,209,278,587 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 502,286 |
| 未払受託者報酬 | 87,394 |
| 未払委託者報酬 | 1,223,420 |
| その他未払費用 | 10,860 |
| 流動負債合計 | 1,823,960 |
| 負債合計 | 1,823,960 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 1,135,406,475 |
| 剰余金 | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 72,048,152 |
| 元本等合計 | 1,207,454,627 |
| 純資産合計 | 1,207,454,627 |
| 負債純資産合計 | 1,209,278,587 |

(2) 中間損益及び剰余金計算書

（単位：円）

| 第1期中間計算期間 自 2023年 9月29日 至 2024年 3月28日 | |
|---|------------|
| 営業収益 | |
| 受取利息 | 166 |
| 有価証券売買等損益 | 34,647,679 |
| 営業収益合計 | 34,647,845 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 157 |
| 受託者報酬 | 87,394 |
| 委託者報酬 | 1,223,420 |
| その他費用 | 10,860 |
| 営業費用合計 | 1,321,831 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 33,326,014 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 33,326,014 |
| 中間純利益又は中間純損失（ ） | 33,326,014 |
| 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（ ） | 94,918 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | - |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 38,992,654 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 38,992,654 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 175,598 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 175,598 |
| 分配金 | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 72,048,152 |

（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、第1期計算期間は設定日(2023年 9月29日)から2024年 8月20日までとなっております。第1期中間計算期間は設定日(2023年 9月29日)から2024年 3月28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1期中間計算期間 (2024年 3月28日現在) |
|----------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 1,135,406,475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 1.0635円 (1万口当たり純資産額) (10,635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1期中間計算期間 (2024年 3月28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。 |

| | 第1期中間計算期間 (2024年 3月28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。 |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

| 区分 | 第1期中間計算期間 自 2023年 9月29日 至 2024年 3月28日 |
|----------------|---|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首元本額 | 492,951円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,140,927,120円 |
| 期中一部解約元本額 | 6,013,596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 3月28日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 5,606,204,038 |
| 株式 | 658,676,552,630 |
| 派生商品評価勘定 | 94,031,850 |
| 未収入金 | 786,195,770 |
| 未収配当金 | 6,718,076,845 |
| 未収利息 | 9,982 |
| 差入委託証拠金 | 180,190,724 |
| 流動資産合計 | 672,061,261,839 |
| 資産合計 | 672,061,261,839 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 60,183,850 |
| 前受金 | 34,077,900 |
| 未払解約金 | 1,592,995,065 |
| 流動負債合計 | 1,687,256,815 |
| 負債合計 | 1,687,256,815 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 234,959,534,762 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 435,414,470,262 |
| 元本等合計 | 670,374,005,024 |
| 純資産合計 | 670,374,005,024 |
| 負債純資産合計 | 672,061,261,839 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 3月28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 3月28日現在 |
|----------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 234,959,534,762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 2.8531円 (1万口当たり純資産額) (28,531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 3月28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 3月28日現在 |
|----------------|------------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 9月29日 |
| 期首元本額 | 241,289,710,340円 |
| 期中追加設定元本額 | 12,452,020,839円 |

| 区分 | 2024年 3月28日現在 |
|-------------------------------------|------------------|
| 期中一部解約元本額 | 18,782,196,417円 |
| 期末元本額 | 234,959,534,762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） | 263,036,231円 |
| S B I 資産設計オープン（資産成長型） | 3,279,160,655円 |
| S B I 資産設計オープン（分配型） | 12,687,224円 |
| S M T T O P I X インデックス・オープン | 10,656,450,863円 |
| 世界経済インデックスファンド | 5,744,199,272円 |
| 日本株式インデックス・オープン | 2,846,991,621円 |
| D C マイセレクション 2 5 | 4,775,231,144円 |
| D C マイセレクション 5 0 | 15,612,390,502円 |
| D C マイセレクション 7 5 | 17,871,834,799円 |
| D C 日本株式インデックス・オープン | 6,004,300,662円 |
| D C マイセレクション S 2 5 | 2,888,226,667円 |
| D C マイセレクション S 5 0 | 9,123,704,826円 |
| D C マイセレクション S 7 5 | 8,358,722,928円 |
| D C 日本株式インデックス・オープン S | 9,406,149,201円 |
| D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5 | 57,716,348円 |
| D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5 | 552,904,799円 |
| D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5 | 449,117,118円 |
| D C 世界経済インデックスファンド | 3,927,385,013円 |
| 日本株式インデックス・オープン（SMA専用） | 743,222,892円 |
| 国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用） | 2,610,093円 |
| マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用） | 8,161,792円 |
| マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用） | 12,243,691円 |
| 日本株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用） | 139,387,470円 |
| 国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用） | 1,841,719円 |
| バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用） | 12,949,334円 |
| バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用） | 61,980,895円 |
| バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用） | 13,929,915円 |
| バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用） | 40,884,615円 |
| バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用） | 434,642,328円 |
| バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用） | 291,848,501円 |
| バランス C（50）V A 1（適格機関投資家専用） | 1,974,296,072円 |
| 世界バランス V A 1（適格機関投資家専用） | 26,434,518円 |
| 世界バランス V A 2（適格機関投資家専用） | 9,873,704円 |
| バランス D（35）V A 1（適格機関投資家専用） | 298,165,215円 |
| バランス E（25）V A 1（適格機関投資家専用） | 165,847,923円 |
| バランス F（25）V A 1（適格機関投資家専用） | 221,374,179円 |
| 国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用） | 16,037,940円 |
| F O F s 用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用） | 369,334,735円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ 1 | 2,407,483,902円 |
| 日本株式ファンド・シリーズ 2 | 1,896,523,676円 |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 979,876,095円 |
| コア投資戦略ファンド（成長型） | 2,406,395,078円 |
| 分散投資コア戦略ファンド A | 1,674,382,755円 |
| 分散投資コア戦略ファンド S | 5,988,441,971円 |
| D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 643,096,348円 |
| D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 414,078,543円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 1,049,581,218円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 184,699,325円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 9,466,762円 |
| S M T インデックスバランス・オープン | 47,961,008円 |
| 国内株式 S M T B セレクション（SMA専用） | 16,059,973,657円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 239,439,855円 |
| S M T 世界経済インデックス・オープン | 50,770,317円 |
| S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 228,183,770円 |
| S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 37,866,867円 |
| S M T 8 資産インデックスバランス・オープン | 11,706,457円 |
| グローバル経済コア | 253,175,574円 |
| S B I 資産設計オープン（つみたて N I S A 対応型） | 32,167,249円 |
| My S M T T O P I X インデックス（ノーロード） | 1,738,664,283円 |

| 区分 | 2024年 3月28日現在 |
|------------------------------------|-----------------|
| DCターゲット・イヤー ファンド 2055 | 29,539,682円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型ワイド） | 889,892,261円 |
| コア投資戦略ファンド（積極成長型） | 222,020,097円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030 | 60,846,327円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040 | 58,423,646円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050 | 25,956,844円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060 | 31,204,933円 |
| 10資産分散投資ファンド | 114,505,657円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 27,580,394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） | 41,395,260,776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） | 439,929,973円 |
| 世界株式ファンド（適格機関投資家専用） | 287,735,111円 |
| FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 26,724,215円 |
| SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用） | 153,450,380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） | 47,951,640,941円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 15,846,901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） | 199,514,735円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 3月28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 | 11,458,832,100 | - | 11,492,910,000 | 34,077,900 |
| 合計 | | 11,458,832,100 | - | 11,492,910,000 | 34,077,900 |

（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 3月28日現在 |
|---------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 3,684,998,721 |
| 国債証券 | 567,621,669,140 |
| 地方債証券 | 33,950,879,746 |
| 特殊債券 | 37,862,881,732 |
| 社債券 | 30,562,942,000 |
| 未収入金 | 516,706,680 |
| 未収利息 | 662,186,220 |

| | 2024年 3月28日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 前払費用 | 26,394,666 |
| 流動資産合計 | 674,888,658,905 |
| 資産合計 | 674,888,658,905 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 2,886,089,000 |
| 未払解約金 | 385,455,188 |
| 流動負債合計 | 3,271,544,188 |
| 負債合計 | 3,271,544,188 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 502,025,182,528 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 169,591,932,189 |
| 元本等合計 | 671,617,114,717 |
| 純資産合計 | 671,617,114,717 |
| 負債純資産合計 | 674,888,658,905 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 3月28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 3月28日現在 |
|----------------------------|--|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 502,025,182,528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 99,311,000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 1.3378円 (1万口当たり純資産額) (13,378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 3月28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。 |

| | |
|----------------------------|--|
| | 2024年 3月28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。 |

（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 3月28日現在 |
|---------------------------------|------------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 9月29日 |
| 期首元本額 | 483,089,616,164円 |
| 期中追加設定元本額 | 34,275,945,813円 |
| 期中一部解約元本額 | 15,340,379,449円 |
| 期末元本額 | 502,025,182,528円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| エマージング株式オープン | 2,227,240円 |
| S B I 資産設計オープン（資産成長型） | 5,119,985,827円 |
| S B I 資産設計オープン（分配型） | 18,300,369円 |
| S M T 国内債券インデックス・オープン | 16,968,800,381円 |
| 世界経済インデックスファンド | 7,194,106,423円 |
| D C マイセレクション 2 5 | 29,832,862,689円 |
| D C マイセレクション 5 0 | 38,723,582,062円 |
| D C マイセレクション 7 5 | 13,094,683,881円 |
| D C 日本債券インデックス・オープン | 405,891,110円 |
| D C 日本債券インデックス・オープン S | 88,152,366,852円 |
| D C 日本債券インデックス・オープン P | 62,917,924,320円 |
| D C マイセレクション S 2 5 | 17,535,319,386円 |
| D C マイセレクション S 5 0 | 21,044,733,315円 |
| D C マイセレクション S 7 5 | 5,767,871,854円 |
| D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5 | 355,560,543円 |
| D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5 | 3,050,834,397円 |
| D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5 | 1,252,249,603円 |
| D C 世界経済インデックスファンド | 4,760,838,880円 |
| 国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用） | 1,777,958円 |
| マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用） | 19,208,241円 |
| マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用） | 8,968,360円 |
| 国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用） | 1,321,333円 |
| バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用） | 53,873,321円 |
| バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用） | 105,943,892円 |
| バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用） | 27,473,655円 |
| バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用） | 23,514,206円 |
| バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用） | 2,053,964,712円 |
| バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用） | 749,421,661円 |
| バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用） | 3,289,576,993円 |
| 世界バランス V A 1（適格機関投資家専用） | 65,139,228円 |
| 世界バランス V A 2（適格機関投資家専用） | 44,689,437円 |
| バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用） | 923,075,762円 |
| バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用） | 1,021,751,024円 |
| バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用） | 1,345,731,054円 |
| 国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用） | 94,673,158円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ 1 | 6,000,089,106円 |
| 日本債券ファンド・シリーズ 1 | 18,402,239,283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 | 26,451,134,249円 |
| D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 317,927,005円 |
| D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 1,996,784,091円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 88,496,888円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 45,086,667円 |
| S M T インデックスバランス・オープン | 69,183,415円 |
| S M T 世界経済インデックス・オープン | 59,483,211円 |

| 区分 | 2024年 3月28日現在 |
|-----------------------------------|------------------|
| SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 142,873,086円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 219,283,801円 |
| SMT 8資産インデックスバランス・オープン | 19,087,392円 |
| グローバル経済コア | 372,610,065円 |
| SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型） | 47,150,892円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2055 | 40,597,081円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030 | 154,634,298円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040 | 86,709,627円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050 | 26,514,229円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060 | 18,880,669円 |
| My SMT 国内債券インデックス（ノーロード） | 938,485,769円 |
| 10資産分散投資ファンド | 455,467,006円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 387,145,197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） | 100,590,826,501円 |
| FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 68,817,743円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 18,535,516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） | 472,689,082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 3月28日現在 |
|--------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 9,053,413,880 |
| コール・ローン | 1,326,771,686 |
| 株式 | 698,978,273,701 |
| 投資信託受益証券 | 123,729,136 |
| 投資証券 | 13,293,159,417 |
| 派生商品評価勘定 | 360,910,575 |
| 未収入金 | 6,963,524 |
| 未収配当金 | 1,076,948,434 |
| 未収利息 | 2,362 |
| 差入委託証拠金 | 6,334,962,390 |
| 流動資産合計 | 730,555,135,105 |
| 資産合計 | 730,555,135,105 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 164,283 |
| 前受金 | 360,727,672 |
| 未払解約金 | 955,017,013 |
| 流動負債合計 | 1,315,908,968 |
| 負債合計 | 1,315,908,968 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 115,217,392,930 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 614,021,833,207 |

| | 2024年 3月28日現在 |
|---------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 元本等合計 | 729,239,226,137 |
| 純資産合計 | 729,239,226,137 |
| 負債純資産合計 | 730,555,135,105 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | 2024年 3月28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> |

| | |
|--|---------------|
| | 2024年 3月28日現在 |
|--|---------------|

（貸借対照表に関する注記）

| | |
|----------------------------|---------------------------|
| | 2024年 3月28日現在 |
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 115,217,392,930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) |
| | 6.3292円 (63,292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 3月28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 3月28日現在 |
|-------------------------|------------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 9月29日 |
| 期首元本額 | 114,456,454,131円 |
| 期中追加設定元本額 | 5,772,265,617円 |
| 期中一部解約元本額 | 5,011,326,818円 |
| 期末元本額 | 115,217,392,930円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| SBI資産設計オープン（資産成長型） | 1,490,862,309円 |
| SBI資産設計オープン（分配型） | 5,740,788円 |
| SMT グローバル株式インデックス・オープン | 34,196,982,808円 |
| 世界経済インデックスファンド | 13,521,561,958円 |
| 外国株式インデックス・オープン | 887,963,039円 |
| DCマイセクション25 | 546,766,185円 |
| DCマイセクション50 | 3,058,444,174円 |
| DCマイセクション75 | 4,094,568,416円 |
| DC外国株式インデックス・オープン | 13,096,023,149円 |
| DCマイセクションS25 | 323,941,204円 |
| DCマイセクションS50 | 1,792,765,197円 |
| DCマイセクションS75 | 1,941,868,069円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2025 | 13,058,554円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2035 | 125,109,880円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2045 | 101,630,994円 |
| DC世界経済インデックスファンド | 9,290,732,931円 |
| 外国株式インデックス・オープン（SMA専用） | 902,023,954円 |
| マイセクション50VA1（適格機関投資家専用） | 1,675,832円 |

| 区分 | 2024年 3月28日現在 |
|--|----------------|
| マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用） | 2,805,608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） | 19,988,498円 |
| バランス30VA1（適格機関投資家専用） | 5,850,313円 |
| バランス50VA1（適格機関投資家専用） | 28,620,264円 |
| バランス25VA2（適格機関投資家専用） | 6,296,245円 |
| バランス50VA2（適格機関投資家専用） | 18,468,486円 |
| バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用） | 135,928,554円 |
| バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用） | 116,837,003円 |
| バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用） | 905,878,584円 |
| 世界バランスVA1（適格機関投資家専用） | 59,814,335円 |
| 世界バランスVA2（適格機関投資家専用） | 13,434,209円 |
| バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用） | 101,753,391円 |
| バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用） | 32,072,974円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1 | 726,534,023円 |
| FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用） | 773,843,932円 |
| 外国株式ファンド・シリーズ1 | 1,160,145,285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 |
| DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 1,512,985,101円 |
| DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 1,008,119,661円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 126,172,035円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 429,276,362円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 22,939,711円 |
| SMT インデックスバランス・オープン | 111,195,900円 |
| サテライト投資戦略ファンド（株式型） | 72,983,607円 |
| 外国株式SMTBセレクション（SMA専用） | 5,042,244,083円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン | 246,324,681円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 1,107,410,188円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 183,782,708円 |
| SMT 8資産インデックスバランス・オープン | 5,325,291円 |
| My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード） | 1,963,435,882円 |
| グローバル経済コア | 632,917,509円 |
| SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型） | 14,578,649円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2055 | 6,684,604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） | 30,839,009円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030 | 165,359,423円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040 | 157,798,365円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050 | 70,928,349円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060 | 84,788,459円 |
| 10資産分散投資ファンド | 63,678,694円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 12,494,234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） | 51,457,965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） | 196,659,617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） | 607,195,917円 |
| 世界株式ファンド（適格機関投資家専用） | 1,395,115,108円 |
| FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 129,515,315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） | 76,848,303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） | 78,555,947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） | 167,795,325円 |
| SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用） | 166,942,593円 |

| 区分 | 2024年 3月28日現在 |
|---|---------------|
| 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） | 107,940,382円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 3月28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 | 16,577,456,104 | - | 16,938,183,776 | 360,727,672 |
| | | 合計 | - | | |

（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 3月28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 アメリカドル | 583,044,000 | - | 583,062,620 | 18,620 |
| | | 583,044,000 | - | | |
| | | 合計 | - | | |

（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 3月28日現在 | |
|---------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 662,279,823 |
| コール・ローン | 3,735,562,961 |
| 国債証券 | 325,998,946,842 |
| 派生商品評価勘定 | 19,387,929 |
| 未収入金 | 328,788,706 |
| 未収利息 | 2,530,565,926 |

| | 2024年 3月28日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 前払費用 | 257,799,558 |
| 差入委託証拠金 | 239,343,630 |
| 流動資産合計 | 333,772,675,375 |
| 資産合計 | 333,772,675,375 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 3,866,683 |
| 前受金 | 12,740,987 |
| 前受収益 | 2,031 |
| 未払金 | 340,743,413 |
| 未払解約金 | 131,923,267 |
| 流動負債合計 | 489,276,381 |
| 負債合計 | 489,276,381 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 93,939,024,260 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 239,344,374,734 |
| 元本等合計 | 333,283,398,994 |
| 純資産合計 | 333,283,398,994 |
| 負債純資産合計 | 333,772,675,375 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 3月28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 3月28日現在 |
|----------------------|-----------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 93,939,024,260口 |

| | | 2024年 3月28日現在 |
|----------------------------|---------------------------|----------------------|
| 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) | 3,5479円 (35,479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 3月28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 3月28日現在 |
|-------------------------------|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 9月29日 |
| 期首元本額 | 87,651,882,921円 |
| 期中追加設定元本額 | 9,647,961,081円 |
| 期中一部解約元本額 | 3,360,819,742円 |
| 期末元本額 | 93,939,024,260円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| 外国債券オープン（毎月決算型） | 1,111,789,026円 |
| グローバル・インカム&プラス（毎月決算型） | 491,466,142円 |
| 財産四分法ファンド（毎月決算型） | 309,732,561円 |
| SBI資産設計オープン（資産成長型） | 2,362,995,461円 |
| SBI資産設計オープン（分配型） | 9,143,859円 |
| SMT グローバル債券インデックス・オープン | 8,775,775,768円 |
| 世界経済インデックスファンド | 21,406,792,845円 |
| DCマイセクション25 | 1,903,676,436円 |
| DCマイセクション50 | 1,822,423,935円 |
| DCマイセクション75 | 1,454,625,168円 |
| DC外国債券インデックス・オープン | 2,251,086,528円 |
| DCマイセクションS25 | 1,117,972,881円 |
| DCマイセクションS50 | 986,454,718円 |
| DCマイセクションS75 | 558,149,803円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2025 | 11,354,629円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2035 | 101,168,485円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2045 | 56,091,653円 |
| DC世界経済インデックスファンド | 14,403,767,485円 |
| 外国債券インデックス・オープン（SMA専用） | 710,533,223円 |
| マイセクション50VA1（適格機関投資家専用） | 911,209円 |
| マイセクション75VA1（適格機関投資家専用） | 997,055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） | 15,036,638円 |
| バランス30VA1（適格機関投資家専用） | 23,413,417円 |

| 区分 | 2024年 3月28日現在 |
|--------------------------------------|-----------------|
| バランス50VA1（適格機関投資家専用） | 47,860,236円 |
| バランス25VA2（適格機関投資家専用） | 52,686,223円 |
| バランス50VA2（適格機関投資家専用） | 51,537,670円 |
| バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用） | 772,164,832円 |
| バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用） | 361,691,104円 |
| バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用） | 1,514,188,307円 |
| 世界バランスVA1（適格機関投資家専用） | 52,074,871円 |
| 世界バランスVA2（適格機関投資家専用） | 27,268,448円 |
| バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用） | 341,955,338円 |
| バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用） | 128,650,155円 |
| バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用） | 168,241,513円 |
| F O F s用外国債券オープン（適格機関投資家専用） | 634,778,991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） | 1,484,094,757円 |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1 | 624,198,319円 |
| 外国債券ファンド・シリーズ1 | 764,315,836円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 682,117,903円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 1,501,719,868円 |
| D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 761,691,412円 |
| D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 4,483,377,667円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 218,878,785円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 102,181,693円 |
| S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり） | 1,264,027,390円 |
| S M T インデックスバランス・オープン | 170,064,998円 |
| S M T 世界経済インデックス・オープン | 413,183,087円 |
| S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 595,263,847円 |
| S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 913,562,714円 |
| S M T 8資産インデックスバランス・オープン | 8,018,174円 |
| グローバル経済コア | 1,054,658,893円 |
| S B I資産設計オープン（つみたてN I S A対応型） | 22,338,572円 |
| D Cターゲット・イヤー ファンド2055 | 2,801,296円 |
| D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030 | 62,501,282円 |
| D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040 | 84,564,144円 |
| D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050 | 43,089,456円 |
| D Cターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060 | 56,435,784円 |
| M y S M T グローバル債券インデックス（ノーロード） | 633,289,466円 |
| 10資産分散投資ファンド | 36,000,117円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 20,814,810円 |
| D C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 |
| D C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 |
| D C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 |
| D C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 |
| D C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 |
| D C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 |
| D C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 |
| F O F s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） | 12,977,510,374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） | 284,816,062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） | 378,552,071円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 128,778,486円 |
| ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用） | 127,565,908円 |

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2024年 3月28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 | 3,995,763,158 | - | 4,008,504,145 | 12,740,987 |
| 合計 | | 3,995,763,158 | - | 4,008,504,145 | 12,740,987 |

(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 3月28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 | 4,299,416,724 | - | 4,302,196,983 | 2,780,259 |
| | アメリカドル | 2,095,565,844 | - | 2,099,557,470 | 3,991,626 |
| | カナダドル | 163,272,580 | - | 163,456,503 | 183,923 |
| | ユーロ | 1,409,202,112 | - | 1,408,150,002 | 1,052,110 |
| | イギリスポンド | 236,437,347 | - | 236,522,808 | 85,461 |
| | オフショア人民元 | 394,938,841 | - | 394,510,200 | 428,641 |
| 合計 | | 4,299,416,724 | - | 4,302,196,983 | 2,780,259 |

(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（為替ヘッジあり）

貸借対照表

| | 2024年 3月28日現在 |
|----------|----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 140,866,797 |
| コール・ローン | 1,651,578,383 |
| 国債証券 | 74,646,840,755 |
| 派生商品評価勘定 | 7,028,656 |
| 未収入金 | 72,194,706 |
| 未収利息 | 556,086,757 |
| 前払金 | 254,708 |
| 前払費用 | 79,630,982 |
| 差入委託証拠金 | 39,387,287 |
| 流動資産合計 | 77,193,869,031 |
| 資産合計 | 77,193,869,031 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 1,059,636,843 |
| 未払金 | 1,357,825,900 |
| 流動負債合計 | 2,417,462,743 |
| 負債合計 | 2,417,462,743 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |

| 2024年 3月28日現在 | |
|---------------|----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 元本 | 89,949,230,933 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 15,172,824,645 |
| 元本等合計 | 74,776,406,288 |
| 純資産合計 | 74,776,406,288 |
| 負債純資産合計 | 77,193,869,031 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 2024年 3月28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> <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 3月28日現在 | |
|--|--|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 89,949,230,933口 |
| 2. 「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第55条の6第10号に規定する額 | 元本の欠損 15,172,824,645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 0.8313円 (1万口当たり純資産額) (8,313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 3月28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 3月28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 3月28日現在 |
|---|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 9月29日 |
| 期首元本額 | 83,886,820,970円 |
| 期中追加設定元本額 | 8,190,613,402円 |
| 期中一部解約元本額 | 2,128,203,439円 |
| 期末元本額 | 89,949,230,933円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 20,614,187,716円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 29,721,680,463円 |
| DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030 | 1,398,657,792円 |
| DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040 | 629,830,919円 |
| DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050 | 142,999,169円 |
| DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060 | 35,729,397円 |
| 10資産分散投資ファンド | 733,291,263円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 85,461,016円 |
| SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用) | 10,689,886,005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) | 3,570,925,641円 |
| SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用) | 3,632,992,078円 |
| SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用) | 3,614,528,678円 |
| SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用) | 3,476,222,872円 |
| SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用) | 3,441,763,859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) | 3,277,268,602円 |
| SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用) | 2,337,176,376円 |

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2024年 3月28日現在)

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
|------|--------------|---------------|-------|---------------|---------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 債券先物取引 買建 | 1,193,454,141 | - | 1,193,199,433 | 254,708 |
| | 合計 | 1,193,454,141 | - | 1,193,199,433 | 254,708 |

(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 3月28日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | | 時価 (円) | 評価損益 (円) | |
|-----------|------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|
| | | | うち1年超 | | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | | |
| | 買建 | 1,340,657,935 | - | 1,339,858,871 | 799,064 | |
| | アメリカドル | 626,271,879 | - | 626,197,844 | 74,035 | |
| | カナダドル | 27,415,716 | - | 27,412,075 | 3,641 | |
| | メキシコペソ | 12,219,648 | - | 12,281,606 | 61,958 | |
| | ユーロ | 431,531,358 | - | 431,048,569 | 482,789 | |
| | イギリスポンド | 70,726,240 | - | 70,735,157 | 8,917 | |
| | デンマーククローネ | 3,759,862 | - | 3,756,510 | 3,352 | |
| | ポーランドズロチ | 12,945,976 | - | 12,900,280 | 45,696 | |
| | オーストラリアドル | 20,946,024 | - | 20,928,512 | 17,512 | |
| | シンガポールドル | 5,739,647 | - | 5,727,544 | 12,103 | |
| | マレーシアリングット | 7,112,258 | - | 7,098,472 | 13,786 | |
| | イスラエルシェケル | 4,629,307 | - | 4,608,912 | 20,395 | |
| | オフショア人民元 | 117,360,020 | - | 117,163,390 | 196,630 | |
| | 売建 | 73,967,607,501 | - | 75,019,161,916 | 1,051,554,415 | |
| | アメリカドル | 34,661,501,430 | - | 35,216,559,641 | 555,058,211 | |
| | カナダドル | 1,490,019,729 | - | 1,511,471,128 | 21,451,399 | |
| | メキシコペソ | 667,832,958 | - | 702,267,621 | 34,434,663 | |
| | ユーロ | 23,788,739,113 | - | 24,105,097,204 | 316,358,091 | |
| | イギリスポンド | 3,831,704,443 | - | 3,880,661,141 | 48,956,698 | |
| | スウェーデンクローナ | 145,252,224 | - | 143,356,331 | 1,895,893 | |
| | ノルウェークローネ | 132,832,252 | - | 132,032,808 | 799,444 | |
| | デンマーククローネ | 199,654,011 | - | 202,147,452 | 2,493,441 | |
| | ポーランドズロチ | 415,682,722 | - | 421,542,906 | 5,860,184 | |
| | オーストラリアドル | 1,007,313,921 | - | 1,023,173,137 | 15,859,216 | |
| | ニュージーランドドル | 183,389,152 | - | 182,930,484 | 458,668 | |
| | シンガポールドル | 305,813,139 | - | 309,440,371 | 3,627,232 | |
| | マレーシアリングット | 375,139,201 | - | 382,030,743 | 6,891,542 | |
| | イスラエルシェケル | 252,381,949 | - | 249,820,141 | 2,561,808 | |
| | オフショア人民元 | 6,510,351,257 | - | 6,556,630,808 | 46,279,551 | |
| | 合計 | | 75,308,265,436 | - | 76,359,020,787 | 1,052,353,479 |

(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 3月28日現在 | |
|---------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 4,784,427,104 |
| コール・ローン | 784,763,500 |
| 株式 | 182,946,860,464 |
| 投資信託受益証券 | 538,821,310 |
| 投資証券 | 239,241,559 |
| 派生商品評価勘定 | 1,297,851 |
| 未収配当金 | 526,130,826 |
| 未収利息 | 1,397 |
| 前払金 | 84,117,086 |
| 差入委託証拠金 | 1,610,584,318 |
| 流動資産合計 | 191,516,245,415 |
| 資産合計 | 191,516,245,415 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 85,508,723 |
| 未払金 | 1,277 |
| 未払解約金 | 120,886,794 |
| 流動負債合計 | 206,396,794 |
| 負債合計 | 206,396,794 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 44,523,058,120 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 146,786,790,501 |
| 元本等合計 | 191,309,848,621 |
| 純資産合計 | 191,309,848,621 |
| 負債純資産合計 | 191,516,245,415 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 2024年 3月28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> |

| 2024年 3月28日現在 | |
|-----------------------|--|
| 2.デリバティブの評価基準及び評価方法 | <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> <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 3月28日現在 | |
|----------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 44,523,058,120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 4.2969円 (1万口当たり純資産額) (42,969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 3月28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> |

| 2024年 3月28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 3月28日現在 |
|------------------------------------|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 9月29日 |
| 期首元本額 | 41,291,304,736円 |
| 期中追加設定元本額 | 4,225,766,049円 |
| 期中一部解約元本額 | 994,012,665円 |
| 期末元本額 | 44,523,058,120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 | 7,439,175,420円 |
| 世界経済インデックスファンド | 11,369,642,117円 |
| DC 新興国株式インデックス・オープン | 6,137,360,158円 |
| DC 世界経済インデックスファンド | 7,611,871,324円 |
| 新興国株式インデックス・オープン（SMA専用） | 79,618,369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） | 1,275,111,622円 |
| DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 798,825,778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） | 360,407,563円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 18,121,068円 |
| SMT インデックスバランス・オープン | 91,509,037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SMT Bセクション（SMA専用） | 2,437,944,277円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン | 272,170,013円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 1,223,582,931円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 203,062,558円 |
| SMT 8資産インデックスバランス・オープン | 6,997,845円 |
| グローバル経済コア | 587,513,722円 |
| My SMT 新興国株式インデックス（ノーロード） | 353,387,720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 | 112,120,747円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040 | 106,999,981円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050 | 48,168,036円 |
| DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060 | 57,655,148円 |
| 10資産分散投資ファンド | 18,059,182円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 17,846,297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） | 1,541,539,240円 |
| FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 141,839,638円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 84,927,779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） | 12,334,252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） | 22,958,618円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年 3月28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 | 7,785,068,811 | - | 7,700,951,725 | 84,117,086 |
| 合計 | | 7,785,068,811 | - | 7,700,951,725 | 84,117,086 |

(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 3月28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 | 797,701,377 | - | 797,605,704 | 95,673 |
| | アメリカドル | 797,701,377 | - | 797,605,704 | 95,673 |
| | 売建 | 3,836,677 | - | 3,834,790 | 1,887 |
| | ブラジルリアル | 1,706,880 | - | 1,704,993 | 1,887 |
| | カタールリアル | 2,129,797 | - | 2,129,797 | - |
| | 合計 | 801,538,054 | - | 801,440,494 | 93,786 |

(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 3月28日現在 | |
|---------------|-----------------|
| 項目 | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 701,468,042 |
| コール・ローン | 2,923,938,231 |
| 国債証券 | 133,213,089,024 |
| 派生商品評価勘定 | 19,843,829 |
| 未収入金 | 9,270,422 |
| 未収利息 | 2,013,571,419 |
| 前払費用 | 175,242,405 |
| 流動資産合計 | 139,056,423,372 |
| 資産合計 | 139,056,423,372 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 4,262,986 |

| 2024年 3月28日現在 | |
|---------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 前受収益 | 227,546 |
| 未払金 | 461,613 |
| 未払解約金 | 12,253,907 |
| 流動負債合計 | 17,206,052 |
| 負債合計 | 17,206,052 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 61,200,160,315 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 77,839,057,005 |
| 元本等合計 | 139,039,217,320 |
| 純資産合計 | 139,039,217,320 |
| 負債純資産合計 | 139,056,423,372 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 2024年 3月28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 3月28日現在 | |
|----------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 61,200,160,315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 2.2719円 (1万口当たり純資産額) (22,719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 3月28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ぬ。 |
| 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> |

| 2024年 3月28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。</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 3月28日現在 |
|-----------------------------------|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 9月29日 |
| 期首元本額 | 55,085,060,824円 |
| 期中追加設定元本額 | 7,148,917,594円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,033,818,103円 |
| 期末元本額 | 61,200,160,315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 | 5,096,498,477円 |
| 世界経済インデックスファンド | 21,974,714,524円 |
| DC新興国債券インデックス・オープン | 5,916,147,112円 |
| DC世界経済インデックスファンド | 14,878,808,042円 |
| 新興国債券インデックス・オープン（SMA専用） | 8,503,189円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA | 527,853,594円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 1,166,316,617円 |
| DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 783,693,032円 |
| DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 4,629,884,883円 |
| 世界経済インデックスファンド（株式シフト型） | 227,739,977円 |
| 世界経済インデックスファンド（債券シフト型） | 105,937,873円 |
| SMT インデックスバランス・オープン | 176,690,763円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン | 487,331,624円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型） | 702,060,712円 |
| SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型） | 1,077,498,414円 |
| SMT 8資産インデックスバランス・オープン | 13,600,503円 |
| グローバル経済コア | 1,048,257,322円 |
| DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2030 | 109,371,139円 |
| DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2040 | 93,455,791円 |
| DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2050 | 39,876,663円 |
| DCターゲット・イヤーフンド（6資産・運用継続型）2060 | 45,617,670円 |
| My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード） | 238,302,951円 |
| 10資産分散投資ファンド | 58,045,864円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 32,376,896円 |
| FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 334,252,356円 |
| 私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用） | 151,886,250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） | 21,986,864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） | 222,121,600円 |
| SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用） | 220,993,290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 |
| SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用） | 142,887,931円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年 3月28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 | 3,297,149,038 | - | 3,312,729,881 | 15,580,843 |
| | メキシコペソ | 520,378,299 | - | 528,461,912 | 8,083,613 |
| | チェココルナ | 330,170,859 | - | 330,723,049 | 552,190 |
| | ハンガリーフォロント | 160,064,872 | - | 160,958,875 | 894,003 |
| | ポーランドズロチ | 421,771,189 | - | 422,343,504 | 572,315 |
| | マレーシアリンギット | 432,891,006 | - | 434,889,324 | 1,998,318 |
| | タイバーツ | 496,786,143 | - | 497,387,986 | 601,843 |
| | 南アフリカランド | 417,857,366 | - | 419,234,256 | 1,376,890 |
| | オフショア人民元 | 517,229,304 | - | 518,730,975 | 1,501,671 |
| | 合計 | 3,297,149,038 | - | 3,312,729,881 | 15,580,843 |

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

J - R E I Tインデックス マザーファンド

貸借対照表

| | 2024年 3月28日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 3,576,707,062 |
| 投資証券 | 117,584,627,850 |
| 派生商品評価勘定 | 266,877,600 |
| 未収入金 | 27,388,800 |
| 未収配当金 | 1,424,740,841 |
| 未収利息 | 6,368 |
| 差入委託証拠金 | 298,828,201 |
| 流動資産合計 | 123,179,176,722 |
| 資産合計 | 123,179,176,722 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 865,080 |
| 前受金 | 266,617,080 |
| 未払金 | 75,098,333 |
| 未払解約金 | 289,740,289 |
| 流動負債合計 | 632,320,782 |
| 負債合計 | 632,320,782 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 57,930,086,565 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 64,616,769,375 |
| 元本等合計 | 122,546,855,940 |

| | 2024年 3月28日現在 |
|---------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 純資産合計 | 122,546,855,940 |
| 負債純資産合計 | 123,179,176,722 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 3月28日現在 |
|----------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>先物取引 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。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>(1) 受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| | 2024年 3月28日現在 |
|----------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 57,930,086,565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 2.1154円 (1万口当たり純資産額) (21,154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 3月28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 3月28日現在 |
|-------------------------------------|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 9月29日 |
| 期首元本額 | 62,073,049,789円 |
| 期中追加設定元本額 | 6,580,083,917円 |
| 期中一部解約元本額 | 10,723,047,141円 |
| 期末元本額 | 57,930,086,565円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| SBI資産設計オープン（資産成長型） | 1,833,299,324円 |
| SBI資産設計オープン（分配型） | 6,899,286円 |
| SMT J-REITインデックス・オープン | 17,019,357,572円 |
| Jリートインデックス・オープン（SMA専用） | 28,026,936,723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 | 2,029,781,182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 | 23,042,660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 | 13,722,083円 |
| グローバル経済コア | 399,826,115円 |
| SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型） | 17,589,482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 SMT J-REITインデックス（ノーロード） | 968,531,011円 |
| 10資産分散投資ファンド | 33,419,768円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 34,546,525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） | 341,880,649円 |
| FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 15,351,283円 |
| SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用） | 1,063,038,961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） | 72,063,528円 |
| J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05（適格機関投資家専用） | 497,548,936円 |
| J-REIT パッシブ・ファンド 2019-03（適格機関投資家専用） | 274,292,818円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2024年 3月28日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | うち1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
|------|-----------------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | | | |
| 市場取引 | 不動産投信指数先物 取引 買建 | 4,659,172,920 | - | 4,925,790,000 | 266,617,080 |
| 合計 | | 4,659,172,920 | - | 4,925,790,000 | 266,617,080 |

(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 3月28日現在 |
|-------------|-----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 126,323,954 |
| コール・ローン | 383,619,187 |
| 投資証券 | 113,296,580,488 |
| 派生商品評価勘定 | 3,565 |
| 未収入金 | 2,218,633 |
| 未収配当金 | 626,939,372 |
| 未収利息 | 683 |
| 流動資産合計 | 114,435,685,882 |
| 資産合計 | 114,435,685,882 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 55,696 |
| 未払金 | 31,680,917 |
| 未払解約金 | 169,749,962 |
| 流動負債合計 | 201,486,575 |
| 負債合計 | 201,486,575 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 39,348,103,231 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 74,886,096,076 |
| 元本等合計 | 114,234,199,307 |
| 純資産合計 | 114,234,199,307 |
| 負債純資産合計 | 114,435,685,882 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 3月28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 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 3月28日現在 |
|----------------------------|---------------------------|----------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | | 39,348,103,231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) | 2.9032円 (29,032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 3月28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 3月28日現在 |
|--------------------------------|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 9月29日 |
| 期首元本額 | 36,573,407,644円 |
| 期中追加設定元本額 | 8,020,280,483円 |
| 期中一部解約元本額 | 5,245,584,896円 |
| 期末元本額 | 39,348,103,231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 | 52,519,744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） | 1,510,259,534円 |
| SBI資産設計オープン（分配型） | 5,787,223円 |
| SMT グローバルREITインデックス・オープン | 11,171,745,716円 |
| グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用） | 18,433,215,879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 | 942,204,271円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 1,481,866,335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 | 107,105,365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 | 10,410,415円 |
| グローバル経済コア | 300,312,028円 |
| SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型） | 14,986,972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） | 261,696,333円 |
| 10資産分散投資ファンド | 17,718,926円 |
| グローバル10資産バランスファンド | 25,995,029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） | 1,004,607,518円 |

| 区分 | 2024年 3月28日現在 |
|---|---------------|
| F O F s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） | 209,346,481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） | 119,036,900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） | 45,854,316円 |
| S M T A M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 |
| S M T A M海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用） | 89,098,754円 |
| S M T A M海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用） | 88,645,928円 |
| S M T A M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 |
| S M T A M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 |
| S M T A M海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用） | 57,316,181円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年 3月28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 | 237,065,020 | - | 237,012,889 | 52,131 |
| | アメリカドル | 201,496,300 | - | 201,473,905 | 22,395 |
| | オーストラリアドル | 35,568,720 | - | 35,538,984 | 29,736 |
| | 合計 | 237,065,020 | - | 237,012,889 | 52,131 |

(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 3月28日現在 |
|----------|----------------|
| 項目 | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 1,515,200 |
| コール・ローン | 67,285,061 |
| 投資信託受益証券 | 29,947,403,036 |
| 派生商品評価勘定 | 255,158 |
| 未収入金 | 4,929,071 |
| 未収利息 | 119 |
| 流動資産合計 | 30,021,387,645 |
| 資産合計 | 30,021,387,645 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 314,918,398 |
| 未払解約金 | 1,562,502 |
| 流動負債合計 | 316,480,900 |
| 負債合計 | 316,480,900 |

| | 2024年 3月28日現在 |
|-------------|----------------|
| 項目 | 金額（円） |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 22,011,626,028 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 7,693,280,717 |
| 元本等合計 | 29,704,906,745 |
| 純資産合計 | 29,704,906,745 |
| 負債純資産合計 | 30,021,387,645 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | 2024年 3月28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 3月28日現在 |
|----------------------------|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 | 22,011,626,028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 1.3495円 (1万口当たり純資産額) (13,495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 3月28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 3月28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 3月28日現在 |
|--------------------------------|-----------------|
| 投資信託財産に係る元本の状況 | |
| 期首 | 2023年 9月29日 |
| 期首元本額 | 24,314,719,430円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,808,628,799円 |
| 期中一部解約元本額 | 4,111,722,201円 |
| 期末元本額 | 22,011,626,028円 |
| 期末元本額の内訳 | |
| コア投資戦略ファンド（安定型） | 1,587,294,785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 | 1,993,274,218円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS | 7,816,711,923円 |
| コア投資戦略ファンド（切替型） | 1,177,159,576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 | 1,299,963,110円 |
| SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり） | 3,009,838,045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 | 56,452,151円 |
| FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用） | 409,899,938円 |
| SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用） | 713,770,692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） | 71,650,247円 |

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年 3月28日現在）

| 区分 | 種類 | 契約額等(円) | 時価 | 評価損益 |
|-----------|--------|----------------|-----|----------------|
| | | | (円) | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | |
| | 売建 | 29,550,849,960 | - | 29,550,594,802 |
| | アメリカドル | 29,550,849,960 | - | 29,550,594,802 |
| 合計 | | 29,550,849,960 | - | 29,550,594,802 |

(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。

2 ファンドの現況

グローバル10資産バランスファンド

純資産額計算書

(2024年 4月30日現在)

| | |
|----------------|----------------|
| 資産総額 | 1,349,327,829円 |
| 負債総額 | 772,834円 |
| 純資産総額（ - ） | 1,348,554,995円 |
| 発行済口数 | 1,265,517,245口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0656円 |
| （1万口当たり純資産額） | （10,656円） |

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年 4月30日現在)

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 664,407,568,076円 |
| 負債総額 | 1,685,013,900円 |
| 純資産総額（ - ） | 662,722,554,176円 |
| 発行済口数 | 232,854,691,232口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.8461円 |
| （1万口当たり純資産額） | （28,461円） |

国内債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年 4月30日現在)

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 668,863,681,995円 |
| 負債総額 | 5,027,393,880円 |
| 純資産総額（ - ） | 663,836,288,115円 |
| 発行済口数 | 502,937,357,044口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.3199円 |
| （1万口当たり純資産額） | （13,199円） |

外国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年 4月30日現在)

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 739,755,953,631円 |
| 負債総額 | 524,583,645円 |
| 純資産総額（ - ） | 739,231,369,986円 |
| 発行済口数 | 115,235,602,435口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 6.4150円 |
| （1万口当たり純資産額） | （64,150円） |

外国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年 4月30日現在)

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 341,401,655,264円 |
| 負債総額 | 123,334,215円 |
| 純資産総額（ - ） | 341,278,321,049円 |
| 発行済口数 | 94,646,408,753口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 3.6058円 |
| （1万口当たり純資産額） | （36,058円） |

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

(2024年 4月30日現在)

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 82,329,223,829円 |
| 負債総額 | 2,919,734,237円 |
| 純資産総額（ - ） | 79,409,489,592円 |
| 発行済口数 | 97,439,462,388口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 0.8150円 |
| （1万口当たり純資産額） | （8,150円） |

新興国株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年 4月30日現在)

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 202,280,641,451円 |
| 負債総額 | 87,313,993円 |
| 純資産総額（ - ） | 202,193,327,458円 |
| 発行済口数 | 44,740,929,319口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 4.5192円 |
| （1万口当たり純資産額） | （45,192円） |

新興国債券インデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年 4月30日現在)

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 143,449,064,194円 |
| 負債総額 | 32,961,778円 |
| 純資産総額（ - ） | 143,416,102,416円 |
| 発行済口数 | 62,003,200,951口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.3130円 |
| （1万口当たり純資産額） | （23,130円） |

J-REITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年 4月30日現在)

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 128,775,039,086円 |
| 負債総額 | 519,926,348円 |
| 純資産総額（ - ） | 128,255,112,738円 |
| 発行済口数 | 60,227,876,072口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.1295円 |
| （1万口当たり純資産額） | （21,295円） |

グローバルREITインデックス マザーファンド

純資産額計算書

(2024年 4月30日現在)

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 115,445,004,337円 |
| 負債総額 | 110,699,227円 |
| 純資産総額（ - ） | 115,334,305,110円 |
| 発行済口数 | 40,089,007,662口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.8770円 |
| （1万口当たり純資産額） | （28,770円） |

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

(2024年 4月30日現在)

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 31,989,616,894円 |
| 負債総額 | 1,270,475,927円 |
| 純資産総額（ - ） | 30,719,140,967円 |
| 発行済口数 | 21,493,792,537口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.4292円 |
| （1万口当たり純資産額） | （14,292円） |

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

< 訂正前 >

(1) 資本金の額（2023年 6月30日現在）

（中略）

最近5年間における資本金の額の増減：2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

(2) 委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は2023年 9月12日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 訂正後 >

(1) 資本金の額（2024年 4月30日現在）

（中略）

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構

（中略）

委託会社の機構は2024年 6月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2 事業の内容及び営業の概況

< 訂正前 >

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

2023年6月30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 | 14,273,967 |
| 追加型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 単位型株式投資信託 | 66 | 203,577 |
| 単位型公社債投資信託 | 52 | 170,590 |
| 合計 | 647 | 14,648,134 |

< 訂正後 >

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 4月30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 | 533 | 15,018,346 |
| 追加型公社債投資信託 | 0 | 0 |
| 単位型株式投資信託 | 62 | 213,458 |
| 単位型公社債投資信託 | 51 | 170,655 |
| 合計 | 646 | 15,402,460 |

3 委託会社等の経理状況

<更新・訂正後>

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

(単位：百万円)

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

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(単位：百万円)

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

| | 株主資本 |
|--|-------|
| | 利益剰余金 |

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

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

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

注記事項

（重要な会計方針）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

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

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

7. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 投資信託委託業務

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

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-21項に定める経過措置に代って、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27-31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）

| 貸借対照表計上額（百万円）（*1） | |
|-------------------|--|
| | |

| 区分 | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
|------------------|-------|--------|------|--------|
| 金銭の信託(*2) | 1,029 | 12,703 | - | 13,733 |
| 投資有価証券(*3) | | | | |
| その他有価証券 | - | 3,844 | - | 3,844 |
| 資産計 | 1,029 | 16,547 | - | 17,577 |
| デリバティブ取引(*4) | | | | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | (10) | (48) | - | (58) |
| ヘッジ会計が適用されているもの | - | (88) | - | (88) |
| デリバティブ取引計 | (10) | (136) | - | (147) |

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

投資有価証券

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

デリバティブ取引

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2022年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

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

（有価証券関係）

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

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

2. その他有価証券

前事業年度（2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度（2022年3月31日）

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

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

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

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

前事業年度（2022年3月31日）

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

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

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

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度（2022年3月31日）

| ヘッジ 会計の方法 | 種類 | 主なヘッジ対象 | 契約額等 (百万円) | 契約額等の うち1年超 (百万円) | 時価 (百万円) |
|--------------|--------------|------------------|---------------|-------------------------|-------------|
| 原則的 処理方法 | 為替予約取引 売建 | 投資有価証券 関係会社株式 | | | |
| | 米ドル | | 4,422 | - | 43 |
| | 英ポンド | | 3,297 | - | 21 |
| | スイスフラン | | 79 | - | 1 |
| | 香港ドル | | 119 | - | 1 |
| | ユーロ | | 125 | - | 3 |
| | 人民元 | | 13 | - | 0 |
| 合計 | | | 8,057 | - | 71 |

当事業年度（2023年3月31日）

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

| | (単位：百万円) | |
|--------------------|--|--|
| | 前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | 当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) |
| 退職給付債務の期首残高 | 626 | 820 |
| 勤務費用 | 124 | 133 |
| 利息費用 | 2 | 3 |
| 数理計算上の差異の発生額 | - | 6 |
| 退職給付の支払額 | 81 | 57 |
| 簡便法で計算した退職給付費用 | 8 | 6 |
| 簡便法から原則法への変更に伴う振替額 | 120 | - |
| その他 | 18 | - |
| 退職給付債務の期末残高 | 820 | 911 |

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

| | (単位：百万円) | |
|--|-----------------------|-----------------------|
| | 前事業年度 (2022年3月31日) | 当事業年度 (2023年3月31日) |

| | | |
|---------------------|-----|-----|
| 非積立型制度の退職給付債務 | 820 | 911 |
| 未認識数理計算上の差異 | - | 6 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 820 | 904 |
| 退職給付引当金 | 820 | 904 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 820 | 904 |

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

| | 前事業年度 (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）

- 顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。
- 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報
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。
- 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〕

- 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。
- 地域ごとの情報
 - 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。
 - 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

- 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。
- 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。
- 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 | - | 営業上の取引役員の兼任 | 運用受託報酬 | 10,090 | 未収運用受託報酬 | 5,421 |
| | | | | | | | 投信販売代行手数料等 | 9,701 | 未払手数料 | 1,995 |

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
運用受託報酬
各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。
投信販売代行手数料等
ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2022年3月31日）

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

当事業年度（2023年3月31日）

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

(1株当たり情報)

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

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。
2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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 | | | | 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 | 44,755 | 47,355 | 66,595 |
| 当中間期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | 3,367 | 3,367 | 3,367 |
| 中間純利益 | | | 2,312 | 2,312 | 2,312 |

| | | | | | |
|---------------------------|-----|-------|--------|--------|--------|
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額） | | | | | |
| 当中間期変動額合計 | - | - | 1,055 | 1,055 | 1,055 |
| 当中間期末残高 | 500 | 2,100 | 43,700 | 46,300 | 65,540 |

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

注記事項
（重要な会計方針）

| 第38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日） |
|---|
| <p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 有価証券 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> <p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産 定額法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。</p> <p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。 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おります。</p> <p>4. 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。</p> <p>(1) 投資信託委託業務</p> |

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

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

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スワップの時価は、為替レートや金利や株価等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

(単位：百万円)

| 区分 | 中間貸借対照表計上額 |
|----|------------|
|----|------------|

| | |
|--------|-------|
| 投資有価証券 | 0 |
| 関係会社株式 | 5,636 |

(有価証券関係)

第38期中間会計期間末（2023年9月30日）

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

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

(単位：百万円)

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

2. その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

(デリバティブ取引関係)

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

| 種類 | 契約額等 (百万円) | 契約額等の うち1年超 (百万円) | 時価 (百万円) | 評価損益 (百万円) |
|--------------|---------------|-------------------------|-------------|---------------|
| 店頭 | | | | |
| 為替予約取引 売建 | | | | |
| 米ドル | 5,944 | - | 76 | 76 |
| 英ポンド | 267 | - | 1 | 1 |
| カナダドル | 126 | - | 1 | 1 |
| スイスフラン | 176 | - | 0 | 0 |
| 香港ドル | 214 | - | 2 | 2 |
| ユーロ | 719 | - | 3 | 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 | - | 24 |
| | | | 3,612 | - | 23 |
| | | | 22 | - | 0 |
| | | | 90 | - | 1 |
| | | | 51 | - | 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）

- 顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。
- 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報
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。
- 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）

- 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。
- 地域ごとの情報
 - 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。
 - 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。
- 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 |

5 その他

< 訂正前 >

(前略)

(2) 訴訟事件その他の重要事項

2023年 9月12日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

< 訂正後 >

(前略)

(2) 訴訟事件その他の重要事項

2024年 6月28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。

独立監査人の中間監査報告書

2024年6月10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」に掲げられているグローバル10資産バランスファンドの2023年9月29日から2024年3月28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10資産バランスファンドの2024年3月28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9月29日から2024年3月28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。

[次へ](#)

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。