

**【表紙】**

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年10月22日提出
【計算期間】	第12期中(自 2024年1月23日至 2024年7月22日)
【ファンド名】	D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	北添 道生
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【ファンドの運用状況】

以下は、2024年8月30日現在の状況について記載してあります。

## 【DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

## (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	40,745,106,939	99.36
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		263,423,549	0.64
合計（純資産総額）		41,008,530,488	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第2期計算期間末 (2015年 1月20日)	1,511,892,680	1,511,892,680	11,996	11,996
第3期計算期間末 (2016年 1月20日)	3,769,356,945	3,769,356,945	10,806	10,806
第4期計算期間末 (2017年 1月20日)	5,951,230,510	5,951,230,510	11,445	11,445
第5期計算期間末 (2018年 1月22日)	10,598,819,384	10,598,819,384	12,729	12,729
第6期計算期間末 (2019年 1月21日)	14,352,111,502	14,352,111,502	11,903	11,903
第7期計算期間末 (2020年 1月20日)	19,297,710,395	19,297,710,395	13,136	13,136
第8期計算期間末 (2021年 1月20日)	23,026,069,017	23,026,069,017	13,664	13,664
第9期計算期間末 (2022年 1月20日)	27,004,013,251	27,004,013,251	14,418	14,418
第10期計算期間末 (2023年 1月20日)	29,845,055,410	29,845,055,410	14,231	14,231
第11期計算期間末 (2024年 1月22日)	38,309,482,253	38,309,482,253	16,907	16,907
2023年 8月末日	36,150,392,902		16,276	
9月末日	35,580,693,657		15,982	
10月末日	35,463,178,217		15,832	
11月末日	37,225,777,189		16,518	
12月末日	37,456,170,279		16,529	
2024年 1月末日	38,536,293,831		16,917	
2月末日	39,487,726,773		17,309	
3月末日	40,387,049,421		17,592	
4月末日	41,108,316,506		17,901	
5月末日	41,793,850,831		18,049	
6月末日	43,208,668,317		18,605	
7月末日	41,748,833,120		17,911	
8月末日	41,008,530,488		17,561	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
--	-----	---------------

第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	0
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	0
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	0
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	0
第6期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	0
第7期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	0
第8期計算期間	2020年 1月21日～2021年 1月20日	0
第9期計算期間	2021年 1月21日～2022年 1月20日	0
第10期計算期間	2022年 1月21日～2023年 1月20日	0
第11期計算期間	2023年 1月21日～2024年 1月22日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	12.0
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	9.9
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	5.9
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	11.2
第6期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	6.5
第7期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	10.4
第8期計算期間	2020年 1月21日～2021年 1月20日	4.0
第9期計算期間	2021年 1月21日～2022年 1月20日	5.5
第10期計算期間	2022年 1月21日～2023年 1月20日	1.3
第11期計算期間	2023年 1月21日～2024年 1月22日	18.8
第12期中間計算期間	2024年 1月23日～2024年 7月22日	9.4

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(参考)

## 国内債券インデックス 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	565,816,487,020	84.42
地方債証券	日本	34,395,136,180	5.13
特殊債券	日本	36,485,288,871	5.44
	国際機関	298,668,000	0.04
	小計	36,783,956,871	5.49
社債券	日本	29,637,680,000	4.42
	フランス	1,496,383,000	0.22
	韓国	99,502,000	0.01
	小計	31,233,565,000	4.66
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,029,482,178	0.30

合計(純資産総額)	670,258,627,249	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。

## 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	676,337,706,030	99.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,847,929,328	0.86
合計(純資産総額)		682,185,635,358	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	5,621,085,000	0.82

(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。

## 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	163,377,532,795	46.16
	中国	36,278,476,373	10.25
	フランス	26,389,623,559	7.46
	イタリア	24,138,470,551	6.82
	ドイツ	21,248,961,229	6.00
	イギリス	18,650,861,495	5.27
	スペイン	15,691,228,533	4.43
	カナダ	7,016,922,888	1.98
	ベルギー	5,623,672,210	1.59
	オランダ	4,723,470,374	1.33
	オーストラリア	4,610,318,514	1.30
	オーストリア	3,996,748,440	1.13
	メキシコ	2,438,255,665	0.69
	マレーシア	1,807,995,130	0.51
	ポーランド	1,802,245,099	0.51
	フィンランド	1,732,026,153	0.49
	アイルランド	1,693,719,418	0.48
	シンガポール	1,422,602,668	0.40
	イスラエル	1,099,754,569	0.31

	デンマーク	921,963,147	0.26
	ニュージーランド	901,541,772	0.25
	スウェーデン	561,657,453	0.16
	ノルウェー	553,570,653	0.16
	小計	346,681,618,688	97.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,269,325,748	2.05
合計(純資産総額)		353,950,944,436	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	1,448,951,367	0.41
	買建	ドイツ	1,306,363,447	0.37

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		3,253,121,163	0.92

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

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

#### 外国株式インデックス マザーファンド

##### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	517,160,933,018	68.74
	イギリス	28,241,572,618	3.75
	カナダ	23,921,712,164	3.18
	スイス	22,292,749,763	2.96
	フランス	20,286,846,762	2.70
	ドイツ	17,015,769,510	2.26
	オランダ	13,439,262,343	1.79
	オーストラリア	13,296,195,883	1.77
	アイルランド	13,152,357,886	1.75
	デンマーク	7,254,869,539	0.96
	スウェーデン	6,305,351,632	0.84
	スペイン	5,112,809,873	0.68
	イタリア	4,117,922,079	0.55
	香港	2,680,755,617	0.36
	シンガポール	2,077,531,346	0.28

	フィンランド	1,970,149,015	0.26
	ベルギー	1,534,604,798	0.20
	イスラエル	1,524,253,923	0.20
	ジャージー	1,129,694,899	0.15
	ノルウェー	1,115,874,906	0.15
	バミューダ	922,868,176	0.12
	ケイマン	868,934,611	0.12
	キュラソー	705,535,055	0.09
	ニュージーランド	487,636,873	0.06
	リベリア	445,215,743	0.06
	オーストリア	382,355,464	0.05
	ポルトガル	321,038,244	0.04
	ルクセンブルク	311,280,683	0.04
	パナマ	171,984,376	0.02
	マン島	59,815,267	0.01
	小計	708,307,882,066	94.15
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	62,066,941	0.01
	香港	58,846,473	0.01
	小計	120,913,414	0.02
投資証券	アメリカ	12,129,378,910	1.61
	オーストラリア	935,528,627	0.12
	フランス	282,974,549	0.04
	イギリス	235,269,149	0.03
	シンガポール	170,094,641	0.02
	香港	114,055,454	0.02
	カナダ	58,443,723	0.01
	ベルギー	49,436,063	0.01
	小計	13,975,181,116	1.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		29,944,347,783	3.98
合計(純資産総額)		752,348,324,379	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	22,704,567,600	3.02
	買建	カナダ	778,197,825	0.10
	買建	ドイツ	3,873,432,522	0.51
	買建	イギリス	1,650,231,031	0.22
	買建	オーストラリア	906,666,854	0.12

(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		634,682,066	0.08

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

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

## 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	マレーシア	15,328,311,702	10.24
	インドネシア	15,217,284,977	10.16
	中国	14,626,443,246	9.77
	タイ	14,245,600,018	9.51
	メキシコ	13,454,442,320	8.98
	南アフリカ	13,014,325,040	8.69
	ブラジル	12,280,599,142	8.20
	ポーランド	11,631,926,646	7.77
	チェコ	8,592,194,516	5.74
	コロンビア	6,206,949,003	4.14
	ルーマニア	5,785,663,339	3.86
	ハンガリー	4,371,253,374	2.92
	ペルー	3,072,302,981	2.05
	インド	2,877,972,741	1.92
	チリ	2,802,215,150	1.87
	ドミニカ共和国	375,838,656	0.25
ウルグアイ	287,990,480	0.19	
	小計	144,171,313,331	96.27
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,583,148,570	3.73
合計(純資産総額)		149,754,461,901	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		1,998,396,356	1.33

(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	41,204,727,124	19.94
	台湾	36,517,830,538	17.67
	ケイマン	26,252,231,331	12.70
	韓国	22,353,432,057	10.82
	中国	18,525,113,458	8.96
	ブラジル	8,326,629,859	4.03
	サウジアラビア	7,734,024,160	3.74
	南アフリカ	5,904,275,095	2.86
	メキシコ	3,645,465,839	1.76
	インドネシア	3,379,723,516	1.64
	マレーシア	2,918,247,129	1.41
	タイ	2,858,481,556	1.38
	アラブ首長国連邦	2,241,246,834	1.08
	ポーランド	1,612,766,316	0.78
	カタール	1,525,412,391	0.74
	香港	1,421,099,145	0.69
	クウェート	1,405,254,418	0.68
	トルコ	1,329,334,304	0.64
	フィリピン	1,128,940,680	0.55
	ギリシャ	986,944,211	0.48
	チリ	922,294,029	0.45
	バミューダ	691,871,662	0.33
	アメリカ	557,064,405	0.27
	ハンガリー	534,424,148	0.26
	イギリス	330,106,278	0.16
	ルクセンブルク	264,919,216	0.13
	チェコ	246,777,817	0.12
	コロンビア	168,094,746	0.08
	エジプト	118,890,415	0.06
	シンガポール	85,791,914	0.04
	ペルー	68,019,742	0.03
	ロシア	-	-
英ヴァージン諸島	-	-	
	小計	195,259,434,333	94.48
投資信託受益証券	ブラジル	289,889,568	0.14
	メキシコ	119,835,306	0.06
	小計	409,724,874	0.20
投資証券	メキシコ	200,415,327	0.10



現金・預金・その他の資産(負債控除後)		10,807,075,612	5.23
合計(純資産総額)		206,676,650,146	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	10,727,809,184	5.19

(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		613,174,290	0.30
	売建		564,387,720	0.27

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

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

## 2【設定及び解約の実績】

## 【DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第2期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	1,264,200,461	4,819,258	1,260,381,203
第3期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	2,314,726,589	86,743,414	3,488,364,378
第4期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	1,917,237,311	205,920,631	5,199,681,058
第5期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	3,590,828,070	463,827,028	8,326,682,100
第6期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月21日	4,302,064,238	571,611,813	12,057,134,525
第7期計算期間	2019年 1月22日～2020年 1月20日	3,471,717,558	838,615,756	14,690,236,327
第8期計算期間	2020年 1月21日～2021年 1月20日	3,142,690,133	980,872,638	16,852,053,822
第9期計算期間	2021年 1月21日～2022年 1月20日	3,096,946,530	1,219,467,367	18,729,532,985
第10期計算期間	2022年 1月21日～2023年 1月20日	3,463,965,366	1,222,261,483	20,971,236,868
第11期計算期間	2023年 1月21日～2024年 1月22日	3,276,154,004	1,588,057,873	22,659,332,999
第12期中間計算期間	2024年 1月23日～2024年 7月22日	1,492,384,962	962,432,388	23,189,285,573

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

### 3【ファンドの経理状況】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期中間計算期間(2024年1月23日から2024年7月22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。

## 【DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （2024年 1月22日現在）	第12期中間計算期間 （2024年 7月22日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	365,078,091	395,288,317
親投資信託受益証券	37,934,614,402	42,597,105,237
未収入金	134,660,000	12,280,000
未収利息	-	724
流動資産合計	38,434,352,493	43,004,674,278
資産合計	38,434,352,493	43,004,674,278
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	32,611,565	25,302,172
未払受託者報酬	8,124,481	8,924,972
未払委託者報酬	83,275,843	91,480,818
未払利息	187	-
その他未払費用	858,164	849,906
流動負債合計	124,870,240	126,557,868
負債合計	124,870,240	126,557,868
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	22,659,332,999	23,189,285,573
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	15,650,149,254	19,688,830,837
（分配準備積立金）	8,460,801,043	8,113,155,795
元本等合計	38,309,482,253	42,878,116,410
純資産合計	38,309,482,253	42,878,116,410
負債純資産合計	38,434,352,493	43,004,674,278

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 自 2023年 1月21日 至 2023年 7月20日	第12期中間計算期間 自 2024年 1月23日 至 2024年 7月22日
<b>営業収益</b>		
受取利息	471	92,993
有価証券売買等損益	3,796,060,378	3,725,480,835
その他収益	473	-
<b>営業収益合計</b>	<b>3,796,061,322</b>	<b>3,725,573,828</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	67,471	5,253
受託者報酬	7,008,717	8,924,972
委託者報酬	71,839,249	91,480,818
その他費用	823,819	849,906
<b>営業費用合計</b>	<b>79,739,256</b>	<b>101,260,949</b>
営業利益又は営業損失（ ）	3,716,322,066	3,624,312,879
経常利益又は経常損失（ ）	3,716,322,066	3,624,312,879
中間純利益又は中間純損失（ ）	3,716,322,066	3,624,312,879
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（ ）	66,125,199	76,909,796
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	8,873,818,542	15,650,149,254
剰余金増加額又は欠損金減少額	948,362,939	1,157,758,504
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	948,362,939	1,157,758,504
剰余金減少額又は欠損金増加額	357,364,682	666,480,004
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	357,364,682	666,480,004
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	13,115,013,666	19,688,830,837

## （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1月21日から翌年1月20日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第12期中間計算期間は2024年 1月23日から2024年 7月22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11期 (2024年 1月22日現在)	第12期中間計算期間 (2024年 7月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	22,659,332,999口	23,189,285,573口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6907円 (16,907円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8490円 (18,490円)

## （中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	第12期中間計算期間 (2024年 7月22日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	第11期 自 2023年 1月21日 至 2024年 1月22日	第12期中間計算期間 自 2024年 1月23日 至 2024年 7月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	20,971,236,868円	22,659,332,999円
期中追加設定元本額	3,276,154,004円	1,492,384,962円
期中一部解約元本額	1,588,057,873円	962,432,388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。

国内債券インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2024年 7月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,048,785,658
国債証券	573,478,072,630
地方債証券	34,661,987,317
特殊債券	37,292,143,265
社債券	31,758,203,000
未収入金	546,225,700
未収利息	1,246,038,963
前払費用	69,868,767
流動資産合計	680,101,325,300
資産合計	680,101,325,300
負債の部	
流動負債	
未払金	1,045,165,061
未払解約金	219,272,848
流動負債合計	1,264,437,909
負債合計	1,264,437,909
純資産の部	
元本等	
元本	521,222,375,931
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	157,614,511,460
元本等合計	678,836,887,391
純資産合計	678,836,887,391
負債純資産合計	680,101,325,300

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月22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 7月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	521,222,375,931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 98,740,000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 1.3024円 (1万口当たり純資産額) (13,024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 7月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2024年 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 1月23日
期首元本額	485,264,268,572円
期中追加設定元本額	51,585,798,847円
期中一部解約元本額	15,627,691,488円
期末元本額	521,222,375,931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）	5,140,602,447円
S B I 資産設計オープン（分配型）	19,797,078円
S M T 国内債券インデックス・オープン	16,545,911,397円
世界経済インデックスファンド	8,728,351,271円
D C マイセレクション 2 5	29,926,576,885円
D C マイセレクション 5 0	38,811,011,842円
D C マイセレクション 7 5	13,203,805,793円
D C 日本債券インデックス・オープン	393,287,896円
D C 日本債券インデックス・オープン S	86,319,920,917円
D C 日本債券インデックス・オープン P	60,287,692,266円
D C マイセレクション S 2 5	18,596,078,361円
D C マイセレクション S 5 0	23,901,645,280円
D C マイセレクション S 7 5	6,382,600,074円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	348,972,805円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	3,054,574,143円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	1,267,703,648円
D C 世界経済インデックスファンド	6,721,390,057円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,916,473円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	23,830,709円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	9,274,358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）	53,896,159円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	98,455,760円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	30,060,498円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	25,679,627円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,925,190,031円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	788,705,682円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,536,848,214円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	67,100,805円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	44,231,331円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	957,123,163円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,047,428,670円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,381,125,799円



区分	2024年 7月22日現在
国内バランス 25VA1（適格機関投資家専用）	96,973,612円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,304,191,136円
日本債券ファンド・シリーズ1	17,613,243,624円
分散投資コア戦略ファンドA	19,153,562,574円
分散投資コア戦略ファンドS	27,595,445,922円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	342,126,282円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,236,515,222円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	91,456,373円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	50,249,922円
SMT インデックスバランス・オープン	73,852,354円
SMT 世界経済インデックス・オープン	64,174,352円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	159,910,554円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	239,835,376円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	22,236,714円
グローバル経済コア	462,672,272円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	56,133,048円
DCターゲット・イヤー ファンド 2055	43,270,603円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	207,708,021円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	106,965,637円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	31,889,504円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	23,934,193円
My SMT 国内債券インデックス（ノーロード）	1,162,131,601円
10資産分散投資ファンド	473,499,225円
グローバル10資産バランスファンド	608,095,439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	169,809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	154,544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	142,071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	142,071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	153,103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	210,850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	234,291円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	279,544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）	113,688,319,266円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	60,282,502円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	21,897,931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）	585,978,377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。

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年 7月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,550,367,462
株式	679,593,146,040
派生商品評価勘定	22,165,400
未収入金	28,290,400
未収配当金	786,765,930
未収利息	6,503
前払金	28,931,000
差入委託証拠金	133,525,327
流動資産合計	684,143,198,062
資産合計	684,143,198,062
負債の部	
流動負債	

	2024年 7月22日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	51,177,250
未払金	1,666,200
未払解約金	121,685,801
流動負債合計	174,529,251
負債合計	174,529,251
純資産の部	
元本等	
元本	232,737,672,868
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	451,230,995,943
元本等合計	683,968,668,811
純資産合計	683,968,668,811
負債純資産合計	684,143,198,062

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月22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 7月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	232,737,672,868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 2.9388円 (1万口当たり純資産額) (29,388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 7月22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 7月22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 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 1月23日
期首元本額	243,250,242,592円
期中追加設定元本額	13,082,943,304円
期中一部解約元本額	23,595,513,028円
期末元本額	232,737,672,868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）	255,079,311円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,253,390,482円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,122,912円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,407,004,062円
世界経済インデックスファンド	6,395,290,380円
日本株式インデックス・オープン	2,778,663,172円
DCマイセクション25	4,542,175,650円
DCマイセクション50	15,434,826,703円
DCマイセクション75	17,979,394,487円
DC日本株式インデックス・オープン	5,951,967,372円
DCマイセクションS25	2,868,190,226円
DCマイセクションS50	8,914,463,845円
DCマイセクションS75	8,778,958,380円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,507,473,600円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	56,709,777円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	553,548,479円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	454,371,982円
DC世界経済インデックスファンド	3,605,809,530円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	396,944,308円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,478,977円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	8,989,944円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,612,773円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	94,813,654円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,841,719円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	11,895,303円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	53,220,783円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	14,011,961円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	41,036,039円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	374,522,475円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	279,009,214円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,885,875,650円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	25,025,238円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	8,999,950円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	266,183,760円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	151,874,044円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	201,898,023円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	14,541,903円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	361,230,201円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,351,453,409円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,894,874,570円
コア投資戦略ファンド（安定型）	526,088,837円

区分	2024年 7月22日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,284,647,733円
分散投資コア戦略ファンドA	1,695,277,593円
分散投資コア戦略ファンドS	5,988,441,971円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	677,738,310円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	418,319,808円
コア投資戦略ファンド（切替型）	573,424,327円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	188,833,121円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,660,054円
SMT インデックスバランス・オープン	50,163,256円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	15,668,723,933円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	189,957,492円
SMT 世界経済インデックス・オープン	54,340,536円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	252,609,303円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	41,035,868円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,344,656円
グローバル経済コア	307,962,235円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	34,153,738円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	2,449,557,170円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	31,370,827円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	492,281,238円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	127,899,661円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	64,912,146円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	69,510,538円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	30,223,507円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	38,010,336円
10資産分散投資ファンド	113,137,091円
グローバル10資産バランスファンド	39,205,466円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	893,971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	31,734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	34,978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	37,585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	37,585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	34,970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	22,495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	17,859円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	14,076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）	40,870,144,526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）	224,619,499円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	295,866,145円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	23,598,710円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	84,640,244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）	49,385,151,219円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	15,763,118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）	204,159,155円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2024年 7月22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	4,180,946,000	-	4,152,015,000	28,931,000
合計		4,180,946,000	-	4,152,015,000	28,931,000

## （注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国債券インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年 7月22日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	4,029,945,206
コール・ローン	2,460,550,657
国債証券	364,077,987,517
派生商品評価勘定	4,318,752
未収利息	2,854,371,134
前払費用	338,067,757
差入委託証拠金	231,289,654
流動資産合計	373,996,530,677
<b>資産合計</b>	<b>373,996,530,677</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,582,304
前受金	1,089,687
未払金	3,540,265,715
未払解約金	73,607,265
流動負債合計	3,647,544,971
<b>負債合計</b>	<b>3,647,544,971</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	99,457,269,513
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	270,891,716,193
元本等合計	370,348,985,706
<b>純資産合計</b>	<b>370,348,985,706</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>373,996,530,677</b>

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月22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>

2024年 7月22日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。  (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2024年 7月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	99,457,269,513口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3,7237円 (37,237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 7月22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る場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2024年 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 1月23日
期首元本額	89,483,539,916円
期中追加設定元本額	12,360,456,367円
期中一部解約元本額	2,386,726,770円
期末元本額	99,457,269,513円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	1,079,204,604円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	466,302,464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)	2,371,615,234円
SBI資産設計オープン(分配型)	8,940,086円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,752,764,185円

区分	2024年 7月22日現在
世界経済インデックスファンド	24,230,088,519円
DCマイセレクション25	1,813,873,203円
DCマイセレクション50	1,798,325,738円
DCマイセレクション75	1,461,446,088円
DC外国債券インデックス・オープン	2,231,218,221円
DCマイセレクションS25	1,116,349,650円
DCマイセレクションS50	1,021,593,724円
DCマイセレクションS75	596,007,745円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	11,156,435円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	101,276,884円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	56,735,255円
DC世界経済インデックスファンド	15,845,669,156円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	791,096,353円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,025,898円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	962,230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）	11,479,872円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	21,848,334円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	42,178,995円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	52,215,455円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	50,976,007円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	661,463,121円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	345,257,633円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,468,389,373円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	48,565,524円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	24,449,599円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	319,225,064円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	118,755,675円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	160,793,540円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	622,076,871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）	1,482,605,656円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	613,989,414円
外国債券ファンド・シリーズ1	763,616,208円
分散投資コア戦略ファンドA	845,594,890円
分散投資コア戦略ファンドS	1,606,006,912円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	809,489,765円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,537,086,674円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	224,667,846円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	104,821,531円
SMT グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	1,210,512,885円
SMT インデックスバランス・オープン	179,289,567円
SMT 世界経済インデックス・オープン	443,557,599円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	661,658,645円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	993,201,675円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,576,956円
グローバル経済コア	1,290,877,215円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	23,905,126円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,975,677円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	72,392,659円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	102,034,327円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	50,788,728円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	69,858,262円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	859,048,766円
10資産分散投資ファンド	35,735,630円
グローバル10資産バランスファンド	29,949,246円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2035	22,018円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2040	22,194円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2045	22,322円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2050	22,322円
DCターゲット・イヤーファンド（ライフステージ対応型）2055	22,025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	21,345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	21,210円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	16,457円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	13,779,673,894円

区分	2024年 7月22日現在
F O F s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	251,607,786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)	253,388,249円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	137,128,536円

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 債券関連

(2024年 7月22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	1,828,186,536	-	1,829,276,223	1,089,687
合計		1,828,186,536	-	1,829,276,223	1,089,687

## (注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

(2024年 7月22日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	2,151,756,124	-	2,122,402,885	29,353,239
	アメリカドル	1,039,616,508	-	1,025,045,444	14,571,064
	カナダドル	84,115,696	-	82,462,752	1,652,944
	ユーロ	661,450,755	-	653,902,634	7,548,121
	イギリスポンド	125,481,705	-	123,808,955	1,672,750
	オフショア人民元	241,091,460	-	237,183,100	3,908,360
合計		2,151,756,124	-	2,122,402,885	29,353,239

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 外国株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2024年 7月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	13,235,340,568
コール・ローン	522,726,493



	2024年 7月22日現在
項目	金額（円）
株式	754,023,463,515
投資信託受益証券	128,182,135
投資証券	14,416,129,126
派生商品評価勘定	157,719,799
未収入金	2
未収配当金	497,705,417
未収利息	957
差入委託証拠金	7,433,413,727
流動資産合計	790,414,681,739
資産合計	790,414,681,739
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	103,390,270
前受金	54,362,403
未払金	53,096,184
未払解約金	198,209,001
流動負債合計	409,057,858
負債合計	409,057,858
純資産の部	
元本等	
元本	115,008,856,263
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	674,996,767,618
元本等合計	790,005,623,881
純資産合計	790,005,623,881
負債純資産合計	790,414,681,739

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 投資証券 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>

2024年 7月22日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<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> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

2024年 7月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	115,008,856,263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 6.8691円 (1万口当たり純資産額) (68,691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 7月22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 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	

区分	2024年 7月22日現在
期首	2024年 1月23日
期首元本額	115,832,461,957円
期中追加設定元本額	5,505,236,419円
期中一部解約元本額	6,328,842,113円
期末元本額	115,008,856,263円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン(資産成長型)	1,405,790,221円
S B I 資産設計オープン(分配型)	5,298,536円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,481,075,553円
世界経済インデックスファンド	14,438,508,482円
外国株式インデックス・オープン	877,262,071円
D C マイセレクション 2 5	522,257,699円
D C マイセレクション 5 0	2,934,618,342円
D C マイセレクション 7 5	3,954,798,519円
D C 外国株式インデックス・オープン	13,376,871,566円
D C マイセレクション S 2 5	323,542,826円
D C マイセレクション S 5 0	1,617,764,027円
D C マイセレクション S 7 5	1,925,401,828円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	12,836,107円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	125,245,586円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	102,759,197円
D C 世界経済インデックスファンド	8,448,259,331円
外国株式インデックス・オープン(S M A 専用)	842,187,290円
マイセレクション 5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	1,643,193円
マイセレクション 7 5 V A 1(適格機関投資家専用)	2,592,530円
外国株式インデックス・オープン V A 1(適格機関投資家専用)	19,936,258円
バランス 3 0 V A 1(適格機関投資家専用)	5,125,682円
バランス 5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	22,882,268円
バランス 2 5 V A 2(適格機関投資家専用)	5,853,633円
バランス 5 0 V A 2(適格機関投資家専用)	17,143,564円
バランス A ( 2 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	108,869,092円
バランス B ( 3 7 . 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	100,595,127円
バランス C ( 5 0 ) V A 1(適格機関投資家専用)	794,260,892円
世界バランス V A 1(適格機関投資家専用)	52,037,785円
世界バランス V A 2(適格機関投資家専用)	11,232,367円
バランス D ( 3 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	85,192,095円
バランス E ( 2 5 ) V A 1(適格機関投資家専用)	27,464,943円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	676,684,589円
F O F s 用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	680,985,225円
外国株式ファンド・シリーズ 1	1,158,776,673円
コア投資戦略ファンド(安定型)	106,117,974円
コア投資戦略ファンド(成長型)	263,824,942円
分散投資コア戦略ファンド A	1,386,650,142円
分散投資コア戦略ファンド S	6,674,283,956円
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,534,927,763円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	968,852,027円
コア投資戦略ファンド(切替型)	119,535,001円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	426,294,284円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	22,382,955円
S M T インデックスバランス・オープン	111,588,632円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	65,295,576円
外国株式 S M T B セレクション(S M A 専用)	4,690,092,123円
S M T 世界経済インデックス・オープン	263,051,741円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	1,221,833,709円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	198,571,746円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	5,441,957円
M y S M T グローバル株式インデックス(ノーロード)	2,597,074,179円
グローバル経済コア	762,242,519円
S B I 資産設計オープン(つみたて N I S A 対応型)	14,632,583円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	7,083,953円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	114,572,329円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	29,143,797円

区分	2024年 7月22日現在
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	163,974,302円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	186,138,360円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	81,925,182円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	102,317,735円
10資産分散投資ファンド	60,167,782円
グローバル10資産バランスファンド	17,520,505円
DC世界経済インデックスファンド(株式特化型)	2,091,234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	20,814円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2040	22,941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	24,654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	24,654円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2055	22,738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	14,732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	11,713円
DCマイセレクションS50(2024-2026リスク抑制型)	1,502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)	43,774,310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)	293,856,369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)	626,382,787円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,433,222,293円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	114,917,366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)	60,868,495円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	72,834,268円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	73,621,064円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	148,051,885円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	156,318,641円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	155,645,401円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	144,550,011円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	143,116,935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)	78,612,474円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	99,558,131円

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2024年 7月22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	21,422,850,905	-	21,477,213,308	54,362,403
合計		21,422,850,905	-	21,477,213,308	54,362,403

## (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 7月22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	404,021,620	-	403,988,746	32,874
	アメリカドル	144,890,800	-	144,893,468	2,668

	カナダドル	43,628,180	-	43,648,890	20,710
	ユーロ	24,000,200	-	24,024,224	24,024
	イギリスポンド	191,502,440	-	191,422,164	80,276
	合計	404,021,620	-	403,988,746	32,874

## (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 7月22日現在	
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	435,659,508
コール・ローン	2,393,256,331
国債証券	149,769,807,569
派生商品評価勘定	91,212
未収利息	2,301,080,869
前払費用	365,842,804
流動資産合計	155,265,738,293
資産合計	155,265,738,293
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	50,259,715
未払解約金	32,625,048
流動負債合計	82,884,763
負債合計	82,884,763
純資産の部	
元本等	
元本	65,652,703,157
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	89,530,150,373
元本等合計	155,182,853,530
純資産合計	155,182,853,530
負債純資産合計	155,265,738,293

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2024年 7月22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> <p>為替予約取引</p>

2024年 7月22日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	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 7月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	65,652,703,157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) 2,3637円 (23,637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 7月22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 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 1月23日
期首元本額	58,039,006,751円
期中追加設定元本額	8,567,141,263円
期中一部解約元本額	953,444,857円
期末元本額	65,652,703,157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	4,892,412,361円
世界経済インデックスファンド	24,785,533,722円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,992,960,899円
DC世界経済インデックスファンド	15,803,451,563円

区分	2024年 7月22日現在
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	7,794,908円
分散投資コア戦略ファンドA	659,901,660円
分散投資コア戦略ファンドS	1,245,545,457円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	831,198,325円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,683,617,139円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	233,509,207円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	108,572,547円
SMT インデックスバランス・オープン	185,767,063円
SMT 世界経済インデックス・オープン	523,352,475円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	780,836,043円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,171,950,108円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	14,470,572円
グローバル経済コア	1,283,862,135円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	129,042,349円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	112,962,732円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	47,073,508円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	56,530,533円
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	323,291,474円
10資産分散投資ファンド	57,632,748円
グローバル10資産バランスファンド	46,672,762円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	294,653,723円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	162,936,791円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	217,762,217円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	218,907,727円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	217,965,256円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	212,611,355円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	210,503,600円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	139,420,198円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 通貨関連

（2024年 7月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,231,442,152	-	2,181,273,649	50,168,503
	メキシコペソ	346,570,807	-	336,110,559	10,460,248
	チェココルナ	210,005,069	-	207,776,350	2,228,719
	ハンガリーフォリント	102,492,723	-	101,420,694	1,072,029
	ポーランドズロチ	276,657,606	-	270,559,772	6,097,834
	マレーシアリング	340,266,758	-	332,922,117	7,344,641
	タイバーツ	317,163,436	-	309,759,450	7,403,986
	南アフリカランド	301,712,336	-	293,471,440	8,240,896
	オフショア人民元	336,573,417	-	329,253,267	7,320,150
合計		2,231,442,152	-	2,181,273,649	50,168,503

## (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 新興国株式インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

	2024年 7月22日現在
項目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	10,047,779,598
コール・ローン	115,215,109
株式	205,791,203,798
投資信託受益証券	430,671,958
投資証券	198,429,046
派生商品評価勘定	57,651,233
未収入金	1,577,440
未収配当金	1,124,120,641
未収利息	211
差入委託証拠金	1,912,086,924
流動資産合計	219,678,735,958
資産合計	219,678,735,958
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	57,508,402
前受金	73,256
未払金	284,884
未払解約金	21,862,317
流動負債合計	79,728,859
負債合計	79,728,859
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	46,270,557,043
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	173,328,450,056
元本等合計	219,599,007,099
純資産合計	219,599,007,099
負債純資産合計	219,678,735,958

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 7月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>



2024年 7月22日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

2024年 7月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	46,270,557,043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 4.7460円 (1万口当たり純資産額) (47,460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 7月22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> <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 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 1月23日
期首元本額	42,679,478,090円
期中追加設定元本額	4,958,887,600円
期中一部解約元本額	1,367,808,647円
期末元本額	46,270,557,043円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国株式インデックス・オープン	7,167,681,552円
世界経済インデックスファンド	12,782,512,098円
D C 新興国株式インデックス・オープン	6,324,726,900円
D C 世界経済インデックスファンド	7,686,222,118円
新興国株式インデックス・オープン（S M A 専用）	78,654,045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
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,350,007,280円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	807,912,479円
コア投資戦略ファンド（切替型）	57,039,289円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	369,473,463円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,563,221円
S M T インデックスバランス・オープン	96,190,776円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	32,497,669円
外国株式S M T B セレクション（S M A 専用）	2,195,497,712円
S M T 世界経済インデックス・オープン	290,384,231円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,348,237,575円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	219,163,835円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	7,439,702円
グローバル経済コア	705,942,748円
M y S M T 新興国株式インデックス（ノーロード）	498,343,386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
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 3 0	118,674,960円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 4 0	127,387,636円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 5 0	56,073,234円
D C ターゲット・イヤーファンド（6 資産・運用継続型）2 0 6 0	70,205,841円
1 0 資産分散投資ファンド	17,931,162円
グローバル1 0 資産バランスファンド	25,086,155円
D C 世界経済インデックスファンド（株式特化型）	1,917,678円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,583,619,814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）	125,850,659円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	79,429,880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）	11,774,350円
F O F s 用 新興国株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	21,206,070円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2024年 7月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	13,153,571,504	-	13,153,644,760	73,256
	合計	13,153,571,504	-	13,153,644,760	73,256

(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 7月22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	86,564,500	-	86,634,075	69,575
	アメリカドル	86,564,500	-	86,634,075	69,575
	合計	86,564,500	-	86,634,075	69,575

#### (注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 4【委託会社等の概況】

##### （１）【資本金の額】

2024年 8月30日現在の資本金の額	20億円
発行可能株式総数	12,000株
発行済株式総数	3,000株

##### （２）【事業の内容及び営業の状況】

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

2024年 8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	530	15,487,993
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	60	209,161
単位型公社債投資信託	52	173,949
合計	642	15,871,103

##### （３）【その他】

###### (1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

###### (2)訴訟事件その他の重要事項

2024年10月22日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 5【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「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、当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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。

## (1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,067	14,909
金銭の信託	14,693	18,596
前払費用	198	429
未収委託者報酬	9,147	10,943
未収運用受託報酬	5,815	5,967
未収収益	176	185
短期差入証拠金	3,541	3,660
その他	1,566	4,074
流動資産合計	58,207	58,767
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 255	1 219
器具備品	1 560	1 436
有形固定資産合計	816	655
無形固定資産		
ソフトウェア	7,203	7,463
その他	40	61
無形固定資産合計	7,244	7,524
投資その他の資産		
投資有価証券	4,063	5,753
関係会社株式	5,636	6,077
繰延税金資産	1,181	1,196
その他	31	31
投資その他の資産合計	10,911	13,058
固定資産合計	18,972	21,238
資産合計	77,179	80,005

(単位：百万円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	49	86
未払金	7,174	8,475
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,586	5,524
その他未払金	2,588	2,951
未払費用	1,089	797
未払法人税等	726	694
賞与引当金	613	719
その他	303	957
流動負債合計	9,958	11,730
固定負債		
退職給付引当金	904	975
資産除去債務	153	154
その他	27	42
固定負債合計	1,086	1,171
負債合計	11,044	12,902
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	44,755	45,974
利益剰余金合計	47,355	48,574
株主資本合計	66,595	67,813
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	49	360
繰延ヘッジ損益	510	1,071
評価・換算差額等合計	460	710
純資産合計	66,134	67,103
負債・純資産合計	77,179	80,005

## （２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	40,724	44,551
運用受託報酬	10,918	11,077
その他営業収益	351	356
営業収益合計	51,993	55,985
営業費用		
支払手数料	20,123	22,341
広告宣伝費	307	342
公告費	2	0
調査費	5,309	5,796
調査費	1,104	1,172
委託調査費	4,191	4,610
図書費	13	14
営業雑経費	5,842	5,887
通信費	77	78
印刷費	419	439
協会費	58	56
諸会費	38	29
情報機器関連費	5,153	5,193
その他営業雑経費	94	89
営業費用合計	31,585	34,369
一般管理費		
給料	6,451	6,981
役員報酬	318	385
給料・手当	5,144	5,432
賞与	987	1,163
退職給付費用	252	278
福利費	671	747
交際費	7	13
旅費交通費	122	191
租税公課	289	276
不動産賃借料	327	328
寄付金	-	0
減価償却費	1,698	2,239
業務委託費	1,277	1,544
諸経費	1,454	1,637
一般管理費合計	12,553	14,239
営業利益	7,854	7,376

（単位：百万円）

前事業年度

当事業年度

（自 2022年4月1日  
至 2023年3月31日）（自 2023年4月1日  
至 2024年3月31日）

営業外収益		
受取利息	57	138
収益分配金	4	0
金銭の信託運用益	-	4,007
投資有価証券売却益	738	1
投資有価証券償還益	121	1
デリバティブ利益	565	-
その他	11	12
営業外収益合計	1,499	4,162
営業外費用		
金銭の信託運用損	158	-
投資有価証券売却損	16	33
投資有価証券償還損	-	1
為替差損	1,227	1,273
デリバティブ費用	-	3,613
その他	32	3
営業外費用合計	1,435	4,925
経常利益	7,918	6,613
税引前当期純利益	7,918	6,613
法人税、住民税及び事業税	2,350	1,931
法人税等調整額	119	95
法人税等合計	2,470	2,027
当期純利益	5,448	4,585

## （3）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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



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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	44,755	47,355	66,595
当期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
当期純利益			4,585	4,585	4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	1,218	1,218	1,218
当期末残高	500	2,100	45,974	48,574	67,813

	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
当期変動額				
剰余金の配当				3,367
当期純利益				4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	310	560	250	250
当期変動額合計	310	560	250	968
当期末残高	360	1,071	710	67,103

## 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。

## (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 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024年3月31日)	
建物	184	百万円	220	百万円
器具備品	681	"	823	"
計	866	"	1,044	"

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（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

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23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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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
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  
2024年6月20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
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	利益剰余金	981,032	2024年3月31日	2024年6月21日

#### (リ - 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（2023年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	-	13,733
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(10)	-	-	(10)
通貨関連取引	-	(136)	-	(136)
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。

当事業年度（2024年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,530	16,048	-	17,579
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,517	-	4,517
資産計	1,530	20,565	-	22,096
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(268)	(262)	-	(530)
通貨関連取引	-	21	-	21
デリバティブ取引計	(268)	(241)	-	(509)

(\*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1,017百万円）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18,596百万円であります。

(\*3) 投資有価証券のうち、非上場株式（貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額359百万円）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、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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
投資有価証券	0	876
関係会社株式	5,636	6,077

(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(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

当事業年度(2024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	14,909	-	-	-
未収委託者報酬	10,943	-	-	-
未収運用受託報酬	5,967	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,829	807	-

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
子会社株式	5,636	6,077

## 2. その他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(2024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	3,394	2,593	800

小計	3,394	2,593	800
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,123	1,410	287
小計	1,123	1,410	287
合計	4,517	4,004	513

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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非上場株式	0	876
組合出資金等	218	359

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	185	1	33

## （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（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)
店頭	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。

当事業年度（2024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)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	6,735	-	4	4
	英ポンド	288	-	0	0
	カナダドル	145	-	0	0
	スイスフラン	180	-	0	0
	香港ドル	217	-	0	0
	ユーロ	664	-	3	3

合計	8,231	-	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) 株式関連

前事業年度（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。

当事業年度（2024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	10,306	-	268	268
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	4,184	-	262	262
合計		14,490	-	530	530

(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（2023年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	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

当事業年度（2024年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		2,126	-	1
	英ポンド		4,586	-	7
	スイスフラン		28	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		63	-	0
	シンガポールドル		448	-	1
合計			7,337	-	10

(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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	820	911
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理計算上の差異の発生額	6	11
退職給付の支払額	57	85
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
退職給付債務の期末残高	911	993

## (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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	911	993
未認識数理計算上の差異	6	17
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975
退職給付引当金	904	975
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975

## (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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理差異償却	-	0
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
確定給付制度に係る退職給付費用	142	155

## (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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024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109百万円、当事業年度122百万円であります。

## (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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
--	-----------------------	-----------------------



繰延税金資産				
未払事業税	58	百万円	63	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	187	"	220	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	277	"	298	"
税務上の費用認識差額	412	"	256	"
繰延ヘッジ損益	225	"	472	"
その他	75	"	78	"
繰延税金資産 合計	1,236	"	1,390	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	21	"	159	"
その他	32	"	35	"
繰延税金負債 合計	54	"	194	"
繰延税金資産の純額	1,181	"	1,196	"

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

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（収益認識関係）

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針7.収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報  
重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	10,223百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社  
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等  
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 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。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	9,926	未収運用受託報酬	5,520
							投信販売代行手数料等	10,187	未払手数料	2,482

(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（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）

当事業年度（2024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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	22,044,962円63銭	22,367,677円92銭
1株当たり当期純利益金額	1,816,227円49銭	1,528,527円02銭

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

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

**独立監査人の監査報告書**

2024年6月3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**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2024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. XBR 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

2024年10月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 百瀬和政

## 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DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）の2024年1月23日から2024年7月22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、DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）の2024年7月22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（2024年1月23日から2024年7月22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。