

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2025年2月21日提出
【計算期間】	第3期中(自 2024年5月25日至 2024年11月24日)
【ファンド名】	10資産分散投資ファンド
【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12月30日現在の状況について記載してあります。

【10資産分散投資ファンド】

(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	2,604,264,290	99.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		23,194,205	0.88
合計(純資産総額)		2,627,458,495	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末 (2023年 5月24日)	1,640,336,672	1,640,336,672	10,203	10,203
第2期計算期間末 (2024年 5月24日)	2,545,332,525	2,545,332,525	11,221	11,221
2023年12月末日	1,797,573,835		10,710	
2024年 1月末日	1,811,755,419		10,857	
2月末日	2,470,219,816		11,007	
3月末日	2,540,428,854		11,206	
4月末日	2,526,035,747		11,162	
5月末日	2,546,782,665		11,173	
6月末日	2,604,691,110		11,391	
7月末日	2,548,827,670		11,243	
8月末日	2,551,618,558		11,202	
9月末日	2,579,057,679		11,264	
10月末日	2,599,009,590		11,386	
11月末日	2,604,672,661		11,333	
12月末日	2,627,458,495		11,452	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金(円)
第1期計算期間	2022年 6月30日～2023年 5月24日	0
第2期計算期間	2023年 5月25日～2024年 5月24日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率(%)
第1期計算期間	2022年 6月30日～2023年 5月24日	2.0
第2期計算期間	2023年 5月25日～2024年 5月24日	10.0
第3期中間計算期間	2024年 5月25日～2024年11月24日	1.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	723,678,262,550	99.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,742,046,170	0.92
合計(純資産総額)		730,420,308,720	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	6,381,085,000	0.87

(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	630,016,447,513	72.81
	イギリス	29,543,432,447	3.41
	カナダ	27,140,831,529	3.14
	スイス	21,831,202,011	2.52
	フランス	20,592,141,816	2.38
	ドイツ	18,919,177,438	2.19
	アイルランド	15,396,976,935	1.78
	オーストラリア	13,909,370,153	1.61
	オランダ	13,467,306,772	1.56
	スウェーデン	6,460,406,290	0.75
	デンマーク	6,016,837,076	0.70
	スペイン	5,413,833,380	0.63
	イタリア	4,535,196,358	0.52
	香港	3,031,032,550	0.35
	シンガポール	2,598,553,290	0.30
	フィンランド	2,013,610,615	0.23
イスラエル	1,942,967,008	0.22	

	ベルギー	1,531,949,123	0.18
	ルクセンブルク	1,265,851,565	0.15
	ケイマン	1,238,732,584	0.14
	ノルウェー	1,174,355,479	0.14
	ジャージー	1,171,282,533	0.14
	バミューダ	912,429,406	0.11
	リベリア	703,109,105	0.08
	キュラソー	660,235,664	0.08
	ニュージーランド	625,707,588	0.07
	オーストリア	398,111,866	0.05
	パナマ	344,579,097	0.04
	ポルトガル	297,371,155	0.03
	マン島	66,869,745	0.01
	小計	833,219,908,091	96.30
新株予約権証券	カナダ	-	-
投資信託受益証券	香港	61,308,135	0.01
	オーストラリア	59,151,308	0.01
	小計	120,459,443	0.01
投資証券	アメリカ	12,946,747,791	1.50
	オーストラリア	918,331,285	0.11
	フランス	290,690,683	0.03
	シンガポール	207,548,924	0.02
	イギリス	202,143,911	0.02
	香港	159,579,476	0.02
	ベルギー	40,550,952	0.00
	カナダ	22,718,487	0.00
	小計	14,788,311,509	1.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		17,126,877,180	1.98
合計(純資産総額)		865,255,556,223	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	13,108,574,325	1.51
	買建	カナダ	392,511,175	0.05
	買建	ドイツ	2,136,059,882	0.25
	買建	イギリス	1,006,265,022	0.12
	買建	オーストラリア	528,654,425	0.06

(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		135,900,400	0.02

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

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

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	43,790,933,028	18.90
	台湾	43,713,882,769	18.87
	ケイマン	36,645,929,885	15.82
	中国	24,248,690,804	10.47
	韓国	20,220,716,014	8.73
	サウジアラビア	9,188,898,149	3.97
	ブラジル	7,828,385,644	3.38
	南アフリカ	6,145,029,979	2.65
	メキシコ	3,685,592,602	1.59
	マレーシア	3,403,961,121	1.47
	インドネシア	3,296,292,813	1.42
	タイ	3,213,781,287	1.39
	アラブ首長国連邦	3,038,577,165	1.31
	香港	1,964,475,628	0.85
	カタール	1,842,167,939	0.80
	ポーランド	1,776,991,906	0.77
	クウェート	1,670,910,677	0.72
	トルコ	1,526,010,801	0.66
	フィリピン	1,189,138,826	0.51
	ギリシャ	1,063,181,461	0.46
	チリ	943,976,878	0.41
	バミューダ	839,645,657	0.36
	アメリカ	753,486,349	0.33
	ハンガリー	576,080,265	0.25
	ルクセンブルク	357,222,241	0.15
	イギリス	327,593,699	0.14
	チェコ	310,810,024	0.13
	コロンビア	225,747,058	0.10
	エジプト	117,507,113	0.05
	シンガポール	84,759,605	0.04
	ペルー	71,617,862	0.03
ロシア	-	-	

	英ヴァージン諸島	-	-
	小計	224,061,995,249	96.73
投資信託受益証券	ブラジル	302,207,318	0.13
	メキシコ	120,809,376	0.05
	小計	423,016,694	0.18
投資証券	メキシコ	198,802,180	0.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,958,114,330	3.00
合計(純資産総額)		231,641,928,453	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,522,447,625	3.25

(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		645,173,492	0.28
	売建		6,771,035	0.00

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

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

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	604,790,117,550	84.92
地方債証券	日本	36,283,627,790	5.09
特殊債券	日本	36,964,437,333	5.19
	国際機関	297,705,000	0.04
	小計	37,262,142,333	5.23
社債券	日本	31,390,401,000	4.41
	フランス	1,587,378,000	0.22
	オーストラリア	99,446,000	0.01
	韓国	99,260,000	0.01
	小計	33,176,485,000	4.66
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		661,879,333	0.09
合計(純資産総額)		712,174,252,006	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

外国債券インデックス マザーファンド

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	177,768,510,647	46.08
	中国	43,539,774,434	11.29
	フランス	27,579,298,425	7.15
	イタリア	26,108,439,790	6.77
	ドイツ	21,937,378,672	5.69
	イギリス	19,325,116,229	5.01
	スペイン	16,532,878,891	4.29
	カナダ	7,227,524,709	1.87
	ベルギー	5,900,080,180	1.53
	オランダ	4,990,164,315	1.29
	オーストラリア	4,591,897,457	1.19
	オーストリア	4,160,662,576	1.08
	メキシコ	2,825,411,465	0.73
	ポルトガル	2,215,796,604	0.57
	ポーランド	2,011,338,991	0.52
	マレーシア	1,925,007,209	0.50
	フィンランド	1,871,051,650	0.48
	アイルランド	1,782,060,153	0.46
	シンガポール	1,461,482,099	0.38
	イスラエル	1,253,539,309	0.32
	ニュージーランド	1,036,756,308	0.27
デンマーク	845,724,539	0.22	
スウェーデン	626,547,404	0.16	
ノルウェー	577,059,858	0.15	
	小計	378,093,501,914	98.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,710,855,494	2.00
合計(純資産総額)		385,804,357,408	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	1,565,635,965	0.41
	買建	ドイツ	1,358,934,203	0.35

(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		3,662,218,215	0.95

(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	39,079,190,261	48.83
	中国	9,574,137,868	11.96
	フランス	6,064,215,745	7.58
	イタリア	5,739,757,166	7.17
	ドイツ	4,814,264,650	6.02
	イギリス	4,247,712,562	5.31
	スペイン	3,636,082,959	4.54
	カナダ	1,588,113,097	1.98
	ベルギー	1,296,620,539	1.62
	オランダ	1,095,893,824	1.37
	オーストラリア	1,007,277,981	1.26
	オーストリア	914,780,795	1.14
	メキシコ	621,770,298	0.78
	ポルトガル	486,824,880	0.61
	ポーランド	440,533,394	0.55
	マレーシア	422,563,509	0.53
	フィンランド	411,753,129	0.51
	アイルランド	392,363,691	0.49
	シンガポール	320,980,593	0.40
	イスラエル	274,663,026	0.34
	ニュージーランド	226,316,759	0.28
デンマーク	185,849,416	0.23	
スウェーデン	137,469,925	0.17	
ノルウェー	126,347,740	0.16	
	小計	83,105,483,807	103.85
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,078,384,671	3.85
合計（純資産総額）		80,027,099,136	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	68,617,988	0.09
	買建	ドイツ	58,978,690	0.07

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		85,322,531,736	106.62

(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	16,032,355,987	10.01
	マレーシア	15,849,925,075	9.90
	インドネシア	15,424,035,730	9.63
	メキシコ	15,239,886,676	9.51
	タイ	14,722,556,484	9.19
	南アフリカ	12,912,504,508	8.06
	ポーランド	11,558,794,851	7.22
	ブラジル	11,133,442,116	6.95
	インド	9,436,635,205	5.89
	チェコ	8,364,536,169	5.22
	コロンビア	5,930,892,962	3.70
	ルーマニア	5,574,516,125	3.48
	ハンガリー	3,812,590,675	2.38
	ペルー	3,250,181,518	2.03
	チリ	2,719,946,207	1.70
	トルコ	2,166,292,013	1.35
	ドミニカ共和国	391,743,472	0.24
ウルグアイ	288,935,214	0.18	
	小計	154,809,770,987	96.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,358,290,517	3.35
合計(純資産総額)		160,168,061,504	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		1,965,250,306	1.23

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

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

世界物価連動債マザーファンド 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	1,368,089,295	56.35
	イギリス	539,361,787	22.21
	フランス	229,913,609	9.47
	イタリア	162,687,905	6.70
	ドイツ	68,853,001	2.84
	スペイン	68,136,610	2.81
	カナダ	41,031,955	1.69
	オーストラリア	22,820,046	0.94
	スウェーデン	15,448,589	0.64
	ニュージーランド	9,218,777	0.38
	デンマーク	4,419,280	0.18
	小計	2,529,980,854	104.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		102,017,498	4.20
合計(純資産総額)		2,427,963,356	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		2,602,941,367	107.21

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

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

J-REITインデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	92,346,398,600	95.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,999,423,868	4.15
合計(純資産総額)		96,345,822,468	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	3,958,759,000	4.11

(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	108,412,408,478	79.41
	オーストラリア	9,930,712,673	7.27
	イギリス	5,494,935,886	4.03
	シンガポール	4,115,487,479	3.01
	フランス	2,337,572,884	1.71
	カナダ	1,682,673,661	1.23
	ベルギー	1,141,338,668	0.84
	香港	1,114,137,989	0.82
	スペイン	569,924,632	0.42
	韓国	213,112,095	0.16
	ガーンジー	211,566,517	0.15
	イスラエル	194,567,677	0.14
	オランダ	183,213,421	0.13
	ニュージーランド	117,226,675	0.09
	アイルランド	55,166,960	0.04
	ドイツ	38,320,811	0.03
イタリア	13,820,164	0.01	
	小計	135,826,186,670	99.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		692,403,321	0.51
合計(純資産総額)		136,518,589,991	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		244,693,534	0.18

(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】

【10資産分散投資ファンド】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間	2022年 6月30日～2023年 5月24日	1,628,450,903	20,709,270	1,607,741,633
第2期計算期間	2023年 5月25日～2024年 5月24日	790,951,104	130,323,608	2,268,369,129
第3期中間計算期間	2024年 5月25日～2024年11月24日	98,374,883	80,153,747	2,286,590,265

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

3【ファンドの経理状況】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「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)」並びに同規則第284条及び第307条の規定により、「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3期中間計算期間(2024年5月25日から2024年11月24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せん。

【10 資産分散投資ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2024年 5月24日現在)	第3期中間計算期間 (2024年11月24日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	26,276,778	25,967,382
親投資信託受益証券	2,519,820,556	2,575,066,665
未収入金	4,092,460	357,916
未収利息	48	460
流動資産合計	2,550,189,842	2,601,392,423
資産合計	2,550,189,842	2,601,392,423
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,935,360	359,722
未払受託者報酬	349,464	427,168
未払委託者報酬	1,514,305	1,851,011
その他未払費用	58,188	71,136
流動負債合計	4,857,317	2,709,037
負債合計	4,857,317	2,709,037
純資産の部		
元本等		
元本	2,268,369,129	2,286,590,265
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	276,963,396	312,093,121
（分配準備積立金）	216,478,131	208,980,882
元本等合計	2,545,332,525	2,598,683,386
純資産合計	2,545,332,525	2,598,683,386
負債純資産合計	2,550,189,842	2,601,392,423

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2023年 5月25日 至 2023年11月24日	第3期中間計算期間 自 2024年 5月25日 至 2024年11月24日
営業収益		
受取利息	43	21,189
有価証券売買等損益	64,812,930	35,303,692
営業収益合計	64,812,973	35,324,881
営業費用		
支払利息	4,946	-
受託者報酬	283,646	427,168
委託者報酬	1,229,095	1,851,011
その他費用	47,211	71,136
営業費用合計	1,564,898	2,349,315
営業利益又は営業損失（ ）	63,248,075	32,975,566
経常利益又は経常損失（ ）	63,248,075	32,975,566
中間純利益又は中間純損失（ ）	63,248,075	32,975,566
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（ ）	676,747	813,583
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	32,595,039	276,963,396
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,900,679	12,763,600
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,900,679	12,763,600
剰余金減少額又は欠損金増加額	928,026	9,795,858
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	928,026	9,795,858
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	98,139,020	312,093,121

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

（中間貸借対照表に関する注記）

	第2期 (2024年 5月24日現在)	第3期中間計算期間 (2024年11月24日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,268,369,129口	2,286,590,265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) 1,1221円 (11,221円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1,1365円 (11,365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3期中間計算期間 (2024年11月24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2期 自 2023年 5月25日 至 2024年 5月24日	第3期中間計算期間 自 2024年 5月25日 至 2024年11月24日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,607,741,633円	2,268,369,129円
期中追加設定元本額	790,951,104円	98,374,883円
期中一部解約元本額	130,323,608円	80,153,747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11月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,688,214,199
株式	677,245,438,330
派生商品評価勘定	299,724,700
未収入金	38,982,000
未収配当金	6,567,280,820
未収利息	27,742
差入委託証拠金	709,481,902
流動資産合計	689,549,149,693
資産合計	689,549,149,693
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,675,450
前受金	277,285,200
未払解約金	94,741,088
流動負債合計	394,701,738
負債合計	394,701,738
純資産の部	
元本等	
元本	243,406,021,052
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	445,748,426,903
元本等合計	689,154,447,955
純資産合計	689,154,447,955
負債純資産合計	689,549,149,693

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年11月24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11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	243,406,021,052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 2.8313円 (1万口当たり純資産額) (28,313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11月24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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	233,105,572,904円
期中追加設定元本額	22,037,499,026円
期中一部解約元本額	11,737,050,878円
期末元本額	243,406,021,052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）	261,278,548円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,245,280,726円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,073,425円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,435,907,184円
世界経済インデックスファンド	6,800,175,544円
日本株式インデックス・オープン	2,715,838,838円
DCマイセレクション25	4,738,261,395円
DCマイセレクション50	16,221,262,894円
DCマイセレクション75	18,528,461,607円
DC日本株式インデックス・オープン	5,948,928,196円
DCマイセレクションS25	3,023,557,158円
DCマイセレクションS50	9,704,501,968円
DCマイセレクションS75	9,202,969,760円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,622,278,684円
DCターゲット・イヤーフンド2025	36,378,128円
DCターゲット・イヤーフンド2035	545,085,158円
DCターゲット・イヤーフンド2045	451,638,366円
DC世界経済インデックスファンド	3,684,204,071円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	343,354,794円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	2,597,858円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	7,946,444円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	12,727,486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）	94,677,357円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	1,891,172円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	10,788,877円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	43,176,241円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	13,119,749円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	40,336,284円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	312,310,241円

区分	2024年11月24日現在
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	276,300,900円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,881,328,790円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	25,690,546円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	8,295,524円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	279,076,956円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	149,810,795円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	208,949,859円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	15,711,647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）	357,712,416円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,288,351,923円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,860,203,133円
コア投資戦略ファンド（安定型）	526,088,837円
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）	701,591,955円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	423,467,158円
コア投資戦略ファンド（切替型）	553,090,106円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	188,646,594円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,691,509円
SMT インデックスバランス・オープン	46,151,420円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	17,217,067,833円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	188,949,882円
SMT 世界経済インデックス・オープン	59,887,214円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	274,375,026円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	44,210,733円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,098,151円
グローバル経済コア	303,237,408円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	36,040,648円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	3,202,583,097円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	29,422,136円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	503,973,750円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	131,503,154円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	67,783,215円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	70,954,568円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	32,704,603円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	42,485,680円
10資産分散投資ファンド	113,799,444円
グローバル10資産バランスファンド	50,698,857円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	2,358,473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	344,650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	41,045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	256,962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	61,505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	96,976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	61,143円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	4,411,242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）	43,833,404,919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）	227,577,644円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	305,604,479円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,881,614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）	51,552,339,803円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	16,282,458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）	228,964,727円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2024年11月24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	11,299,279,800	-	11,576,565,000	277,285,200
	合計	11,299,279,800	-	11,576,565,000	277,285,200

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,746,598,297
コール・ローン	439,890,140
株式	813,076,091,614
投資信託受益証券	118,987,737
投資証券	15,571,191,187
派生商品評価勘定	324,534,162
未収入金	3,041,432
未収配当金	846,426,123
未収利息	2,603
差入委託証拠金	8,489,774,847
流動資産合計	843,616,538,142
資産合計	843,616,538,142
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	84,807,882
前受金	240,310,506
未払解約金	206,443,216
流動負債合計	531,561,604
負債合計	531,561,604
純資産の部	
元本等	
元本	117,275,298,332
剰余金	
剰余金又は欠損金()	725,809,678,206
元本等合計	843,084,976,538
純資産合計	843,084,976,538
負債純資産合計	843,616,538,142

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2024年11月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

2024年11月24日現在	
	<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取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取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11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	117,275,298,332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 7.1889円 (1万口当たり純資産額) (71,889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11月24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

2024年11月24日現在	
	<p>売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額は、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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	115,374,339,720円
期中追加設定元本額	8,017,212,517円
期中一部解約元本額	6,116,253,905円
期末元本額	117,275,298,332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）	1,340,539,612円
S B I 資産設計オープン（分配型）	5,066,077円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	34,321,644,668円
世界経済インデックスファンド	15,174,311,883円
外国株式インデックス・オープン	858,188,604円
D C マイセレクション 2 5	509,969,335円
D C マイセレクション 5 0	2,894,530,356円
D C マイセレクション 7 5	3,853,882,106円
D C 外国株式インデックス・オープン	13,512,988,139円
D C マイセレクション S 2 5	322,562,463円
D C マイセレクション S 5 0	1,762,637,720円
D C マイセレクション S 7 5	1,929,277,983円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	7,834,819円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	116,638,389円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	96,651,552円
D C 世界経済インデックスファンド	8,634,688,598円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	811,251,933円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,453,662円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,500,900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）	12,048,489円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	4,201,171円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	17,195,492円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	5,276,097円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	16,223,197円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	86,326,552円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	97,313,455円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	777,473,771円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	52,016,097円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	10,070,336円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	84,701,564円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	26,632,633円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	627,958,922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）	631,685,398円

区分	2024年11月24日現在
外国株式ファンド・シリーズ1	1,144,762,684円
コア投資戦略ファンド（安定型）	125,404,541円
コア投資戦略ファンド（成長型）	310,144,127円
分散投資コア戦略ファンドA	1,285,712,778円
分散投資コア戦略ファンドS	6,018,408,147円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,556,201,233円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	951,248,541円
コア投資戦略ファンド（切替型）	130,381,994円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	416,179,397円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	21,558,071円
SMT インデックスバランス・オープン	96,821,058円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	69,496,181円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	6,205,772,915円
SMT 世界経済インデックス・オープン	257,421,617円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,307,378,867円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	213,004,526円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,629,862円
My SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	3,133,768,195円
グローバル経済コア	701,495,917円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	15,280,189円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,296,129円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	126,983,021円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	35,310,017円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	174,542,523円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	182,836,307円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	83,752,634円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	109,860,655円
10資産分散投資ファンド	58,429,941円
グローバル10資産バランスファンド	20,495,668円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	5,394,140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	213,369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	26,626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	164,448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	40,072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	61,397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	38,035円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	456,112円
DC全世界株式インデックスファンド（オール・カンントリー）	67,412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）	50,710,788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）	486,207,914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）	684,029,046円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,476,923,423円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	103,294,238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）	54,550,137円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	75,234,574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）	92,561,996円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	153,127,006円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	144,262,347円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	143,733,691円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	150,009,176円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	148,763,609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）	43,648,234円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	91,446,102円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2024年11月24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	14,111,821,150	-	14,352,131,656	240,310,506
合計		14,111,821,150	-	14,352,131,656	240,310,506

(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11月24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	385,165,600	-	384,581,374	584,226
	アメリカドル	385,165,600	-	384,581,374	584,226
	合計	385,165,600	-	384,581,374	584,226

(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11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	10,041,397,886
コール・ローン	209,175,556
株式	212,000,672,116
投資信託受益証券	452,570,335
投資証券	202,835,170
派生商品評価勘定	349,434
未収配当金	229,308,169
未収利息	1,237
前払金	368,318,508
差入委託証拠金	1,648,974,522
流動資産合計	225,153,602,933
資産合計	225,153,602,933
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	369,446,953
未払金	53,417,105
未払解約金	8,841,285
流動負債合計	431,705,343
負債合計	431,705,343

	2024年11月24日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	48,167,693,720
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	176,554,203,870
元本等合計	224,721,897,590
純資産合計	224,721,897,590
負債純資産合計	225,153,602,933

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年11月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

		2024年11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		48,167,693,720口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.6654円 (46,654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11月24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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	45,060,646,602円
期中追加設定元本額	4,575,673,091円
期中一部解約元本額	1,468,625,973円
期末元本額	48,167,693,720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	6,952,186,113円
世界経済インデックスファンド	13,646,367,800円
DC 新興国株式インデックス・オープン	6,401,120,448円
DC 世界経済インデックスファンド	7,855,421,266円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	87,177,796円
コア投資戦略ファンド（安定型）	60,606,383円
コア投資戦略ファンド（成長型）	149,892,084円
分散投資コア戦略ファンドA	272,513,881円
分散投資コア戦略ファンドS	1,274,051,690円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,400,809,569円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	818,891,799円
コア投資戦略ファンド（切替型）	64,027,692円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	369,184,367円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,634,196円
SMT インデックスバランス・オープン	87,249,021円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	34,032,360円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	3,027,627,488円
SMT 世界経済インデックス・オープン	293,688,439円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,456,963,963円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	235,089,319円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,005,196円

区分	2024年11月24日現在
グローバル経済コア	647,979,985円
My SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	603,282,263円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	64,535,900円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	17,064,297円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	127,008,709円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	132,985,652円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	60,906,120円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	79,886,596円
10資産分散投資ファンド	18,029,761円
グローバル10資産バランスファンド	29,427,085円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	5,008,027円
DC全世界株式インデックスファンド（オール・カンントリー）	11,922円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,631,681,363円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	117,181,748円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	82,001,235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）	14,925,624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）	22,236,563円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2024年11月24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	12,444,684,631	-	12,076,366,123	368,318,508
合計		12,444,684,631	-	12,076,366,123	368,318,508

（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11月24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	212,851,032	-	211,838,477	1,012,555
	アメリカドル	212,851,032	-	211,838,477	1,012,555
	売建	20,589,032	-	20,355,488	233,544
	ブラジルリアル	20,589,032	-	20,355,488	233,544
合計		233,440,064	-	232,193,965	779,011

（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。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年11月24日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	550,003,266
国債証券	565,000,633,740
地方債証券	34,865,253,730
特殊債券	36,513,437,614
社債券	31,931,836,000
未収入金	4,141,614,500
未収利息	1,442,034,901
前払費用	67,789,941
流動資産合計	674,512,603,692
資産合計	674,512,603,692
負債の部	
流動負債	
未払金	2,180,686,900
未払解約金	3,379,214,634
流動負債合計	5,559,901,534
負債合計	5,559,901,534
純資産の部	
元本等	
元本	514,134,148,076
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	154,818,554,082
元本等合計	668,952,702,158
純資産合計	668,952,702,158
負債純資産合計	674,512,603,692

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年11月24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11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	514,134,148,076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 98,263,000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 1.3011円 (1万口当たり純資産額) (13,011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11月24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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	504,887,869,424円
期中追加設定元本額	48,161,118,545円
期中一部解約元本額	38,914,839,893円
期末元本額	514,134,148,076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）	5,127,578,496円
S B I 資産設計オープン（分配型）	19,706,465円
S M T 国内債券インデックス・オープン	17,202,179,602円
世界経済インデックスファンド	9,416,213,328円
D C マイセレクション 2 5	29,665,926,763円
D C マイセレクション 5 0	37,874,704,359円
D C マイセレクション 7 5	12,895,486,029円
D C 日本債券インデックス・オープン	399,640,168円
D C 日本債券インデックス・オープン S	86,145,403,459円
D C 日本債券インデックス・オープン P	59,818,836,308円
D C マイセレクション S 2 5	18,832,976,159円
D C マイセレクション S 5 0	23,094,514,703円
D C マイセレクション S 7 5	6,402,509,015円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	231,440,992円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	3,193,734,267円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	1,332,861,962円
D C 世界経済インデックスファンド	6,860,376,918円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	1,745,889円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	19,831,239円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	9,434,268円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	1,260,056円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	48,777,128円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	79,894,559円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	27,252,803円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	24,442,859円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,544,059,035円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	736,599,411円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	3,211,424,675円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	66,704,696円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	39,425,625円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	879,410,435円

区分	2024年11月24日現在
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	952,009,460円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,318,460,445円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	91,358,108円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,151,363,178円
日本債券ファンド・シリーズ1	15,029,347,456円
分散投資コア戦略ファンドA	19,221,920,466円
分散投資コア戦略ファンドS	26,765,256,706円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	358,861,400円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,270,385,522円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	91,406,364円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	50,450,464円
SMT インデックスバランス・オープン	65,748,229円
SMT 世界経済インデックス・オープン	79,123,619円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	174,706,693円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	259,747,779円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	23,727,753円
グローバル経済コア	452,178,797円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	59,526,086円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	42,879,356円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	222,570,499円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	133,659,083円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	40,941,717円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	33,624,450円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	1,441,283,842円
10資産分散投資ファンド	480,144,943円
グローバル10資産バランスファンド	727,120,242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	1,788,758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	180,733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	930,670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	230,045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	412,549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	785,129円
DCマイセレクションS50(2024-2026リスク抑制型)	85,207,833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)	111,557,646,218円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	55,750,797円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	22,567,484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)	664,055,442円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,046,881,398
コール・ローン	1,838,664,790
国債証券	364,433,753,427
派生商品評価勘定	424,008
未収利息	2,558,215,229
前払金	5,873,213
前払費用	284,204,536
差入委託証拠金	213,189,400
流動資産合計	370,381,206,001
資産合計	370,381,206,001

	2024年11月24日現在
項目	金額（円）
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,997,099
未払金	4,346,309
未払解約金	46,845,050
流動負債合計	68,188,458
負債合計	68,188,458
純資産の部	
元本等	
元本	101,672,882,744
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	268,640,134,799
元本等合計	370,313,017,543
純資産合計	370,313,017,543
負債純資産合計	370,381,206,001

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年11月24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11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	101,672,882,744口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.6422円 (1万口当たり純資産額) (36,422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11月24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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	95,258,832,835円
期中追加設定元本額	10,146,764,574円
期中一部解約元本額	3,732,714,665円
期末元本額	101,672,882,744円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,059,773,797円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	449,944,985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）	2,365,858,115円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,900,755円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,381,959,192円
世界経済インデックスファンド	25,958,376,301円
DCマイセレクション25	1,795,742,531円
DCマイセレクション50	1,709,851,998円
DCマイセレクション75	1,366,501,160円
DC外国債券インデックス・オープン	2,213,171,401円
DCマイセレクションS25	1,136,452,014円
DCマイセレクションS50	1,022,644,525円
DCマイセレクションS75	678,736,521円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	7,133,286円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	101,265,764円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	56,842,107円
DC世界経済インデックスファンド	16,195,219,372円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	794,512,396円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	906,751円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	986,557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）	7,648,924円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	19,381,956円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	33,967,294円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	48,676,880円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	49,895,171円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	542,940,026円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	338,198,539円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,422,854,853円

区分	2024年11月24日現在
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	49,643,903円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	22,409,359円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	309,923,077円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	111,956,348円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	157,312,901円
F O F s用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	600,405,629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）	1,099,223,297円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	603,986,386円
外国債券ファンド・シリーズ1	757,317,693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）	842,727,962円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,604,354,267円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	224,493,919円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	105,268,734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）	1,283,378,470円
SMT インデックスバランス・オープン	162,156,577円
SMT 世界経済インデックス・オープン	508,492,781円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	720,133,170円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,072,206,051円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,673,314円
グローバル経済コア	1,279,009,414円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	25,747,464円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,794,318円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	68,322,776円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	111,235,611円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	58,024,614円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	83,547,125円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	994,656,632円
10資産分散投資ファンド	35,950,814円
グローバル10資産バランスファンド	35,410,845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	236,243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	25,995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	151,290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	36,630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	60,153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	71,808円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	5,128,343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）	14,346,508,989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）	233,658,938円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	476,006,407円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	141,535,618円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2024年11月24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	1,413,372,835	-	1,407,499,622	5,873,213
合計		1,413,372,835	-	1,407,499,622	5,873,213

（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11月24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	1,595,187,859	-	1,584,487,981	10,699,878
	アメリカドル	769,238,312	-	767,485,230	1,753,082
	カナダドル	63,136,946	-	62,912,724	224,222
	ユーロ	465,435,188	-	458,798,308	6,636,880
	イギリスポンド	92,257,787	-	91,191,656	1,066,131
	オフショア人民元	205,119,626	-	204,100,063	1,019,563
合計		1,595,187,859	-	1,584,487,981	10,699,878

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2024年11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	671,024,663
コール・ローン	487,778,755
国債証券	78,426,620,357
派生商品評価勘定	543,539,068
未収入金	6,290
未収利息	540,543,003
前払金	2,117,208
前払費用	68,277,965
差入委託証拠金	50,347,274
流動資産合計	80,790,254,583
資産合計	80,790,254,583
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	670,360,518
未払金	429,198,413
未払解約金	451,442
流動負債合計	1,100,010,373
負債合計	1,100,010,373
純資産の部	
元本等	
元本	97,207,534,972
剰余金	
剰余金又は欠損金()	17,517,290,762
元本等合計	79,690,244,210

	2024年11月24日現在
項目	金額（円）
純資産合計	79,690,244,210
負債純資産合計	80,790,254,583

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年11月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</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11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	97,207,534,972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 17,517,290,762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 0.8198円 (1万口当たり純資産額) (8,198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11月24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</p>

2024年11月24日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	98,796,580,345円
期中追加設定元本額	9,368,269,883円
期中一部解約元本額	10,957,315,256円
期末元本額	97,207,534,972円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	20,662,961,673円
分散投資コア戦略ファンドS	29,234,845,970円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	2,060,478,966円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	947,291,059円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	225,699,203円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	76,248,495円
10資産分散投資ファンド	765,061,733円
グローバル10資産バランスファンド	148,853,129円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	14,181,597,829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）	2,682,909,515円
私募外国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	3,077,748,581円
SMTAM海外バランスファンド2020-01（適格機関投資家専用）	3,729,193,270円
SMTAM海外バランスファンド2020-08（適格機関投資家専用）	3,795,810,962円
SMTAM海外バランスファンド2020-11（適格機関投資家専用）	3,781,901,194円
SMTAM海外バランスファンド2021-04（適格機関投資家専用）	3,653,822,636円
SMTAM海外バランスファンド2021-07（適格機関投資家専用）	3,622,777,686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）	2,154,220,944円
SMTAM海外バランスファンド2023-02（適格機関投資家専用）	2,406,112,127円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2024年11月24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	369,218,840	-	367,101,632	2,117,208
合計		369,218,840	-	367,101,632	2,117,208

(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11月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	79,234,425,328	-	79,359,129,570	124,704,242
	アメリカドル	36,870,329,900	-	37,499,779,770	629,449,870
	カナダドル	1,540,306,685	-	1,559,560,399	19,253,714
	メキシコペソ	578,634,720	-	582,382,655	3,747,935
	ユーロ	24,133,138,139	-	23,678,377,462	454,760,677
	イギリスポンド	4,115,529,814	-	4,063,409,355	52,120,459
	スウェーデンクローナ	130,781,404	-	128,219,677	2,561,727
	ノルウェークローネ	120,026,514	-	120,820,093	793,579
	デンマーククローネ	208,156,594	-	204,231,251	3,925,343
	ポーランドズロチ	399,399,576	-	392,705,078	6,694,498
	オーストラリアドル	1,013,492,819	-	1,021,594,095	8,101,276
	ニュージーランドドル	219,221,925	-	218,447,681	774,244
	シンガポールドル	325,455,323	-	324,734,041	721,282
	マレーシアリングgit	395,718,399	-	391,228,581	4,489,818
	イスラエルシェケル	241,883,152	-	247,190,552	5,307,400
	オフショア人民元	8,942,350,364	-	8,926,448,880	15,901,484
合計		79,234,425,328	-	79,359,129,570	124,704,242

(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11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	746,857,940
コール・ローン	816,720,271
国債証券	151,941,588,830
未収入金	3,165,528
未収利息	2,328,256,856
前払費用	278,524,895

	2024年11月24日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	156,115,114,320
資産合計	156,115,114,320
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,992,879
未払金	1,855,172
未払解約金	26,672,838
流動負債合計	34,520,889
負債合計	34,520,889
純資産の部	
元本等	
元本	66,879,430,185
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	89,201,163,246
元本等合計	156,080,593,431
純資産合計	156,080,593,431
負債純資産合計	156,115,114,320

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年11月24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11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	66,879,430,185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 2.3338円 (1万口当たり純資産額) (23,338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11月24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11月24日現在	
	(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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	62,732,887,478円
期中追加設定元本額	6,411,236,295円
期中一部解約元本額	2,264,693,588円
期末元本額	66,879,430,185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	3,599,854,365円
世界経済インデックスファンド	26,504,532,745円
DC新興国債券インデックス・オープン	6,035,734,930円
DC世界経済インデックスファンド	16,145,902,802円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	4,538,846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)	864,126,621円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,749,974,220円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	233,325,335円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	109,012,863円
SMT インデックスバランス・オープン	168,471,650円
SMT 世界経済インデックス・オープン	604,085,670円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	850,163,630円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	1,265,600,839円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	15,389,723円
グローバル経済コア	1,267,338,934円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	137,072,449円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	126,142,516円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	54,777,361円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	68,673,202円
My SMT 新興国債券インデックス(ノーロード)	366,450,140円
10資産分散投資ファンド	57,962,432円
グローバル10資産バランスファンド	55,222,449円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	273,243,979円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	168,149,263円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	224,458,738円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	222,722,981円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	221,906,721円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	219,894,769円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	218,072,064円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	141,180,831円

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

（2024年11月24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	702,702,630	-	696,709,751	5,992,879
	メキシコペソ	112,103,465	-	110,822,650	1,280,815
	チェココルナ	60,003,546	-	59,128,992	874,554
	ハンガリーフォリント	29,128,238	-	28,505,431	622,807
	ポーランドズロチ	80,559,677	-	79,421,606	1,138,071
	マレーシアリングギット	109,822,172	-	109,450,830	371,342
	タイバーツ	105,805,195	-	105,022,508	782,687
	南アフリカランド	94,823,024	-	94,343,340	479,684
	オフショア人民元	110,457,313	-	110,014,394	442,919
合計	702,702,630	-	696,709,751	5,992,879	

(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。

世界物価連動債マザーファンド 為替ヘッジあり

貸借対照表

	2024年11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,887,558
コール・ローン	7,790,047
国債証券	2,430,231,984
派生商品評価勘定	25,299,907
未収入金	60,835
未収利息	6,066,880
前払費用	1,147,198
流動資産合計	2,475,484,409
資産合計	2,475,484,409
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,141,113
未払解約金	22,535
流動負債合計	12,163,648
負債合計	12,163,648
純資産の部	
元本等	
元本	2,821,888,959
剰余金	
剰余金又は欠損金()	358,568,198

	2024年11月24日現在
項目	金額（円）
元本等合計	2,463,320,761
純資産合計	2,463,320,761
負債純資産合計	2,475,484,409

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年11月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2024年11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	2,821,888,959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 358,568,198円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 0.8729円 (8,729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11月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	2,801,623,400円
期中追加設定元本額	712,325,834円
期中一部解約元本額	692,060,275円
期末元本額	2,821,888,959円
期末元本額の内訳	
10資産分散投資ファンド	119,271,766円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	2,180,910,815円
私募世界物価連動債パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	521,706,378円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2024年11月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	2,465,506,043	-	2,452,347,249	13,158,794
	アメリカドル	1,304,504,300	-	1,316,382,655	11,878,355
	カナダドル	41,799,075	-	41,977,117	178,042
	ユーロ	519,238,632	-	505,229,687	14,008,945
	イギリスポンド	547,856,199	-	537,307,117	10,549,082
	スウェーデンクローナ	15,670,013	-	15,241,338	428,675
	デンマーククローネ	4,523,660	-	4,401,161	122,499
	オーストラリアドル	22,315,795	-	22,322,233	6,438
	ニュージーランドドル	9,598,369	-	9,485,941	112,428
合計		2,465,506,043	-	2,452,347,249	13,158,794

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2024年11月24日現在
項目	金額(円)
資産の部	

	2024年11月24日現在
項目	金額（円）
流動資産	
コール・ローン	2,524,300,174
投資証券	92,471,998,000
未収配当金	667,457,814
未収利息	14,937
前払金	138,224,320
差入委託証拠金	199,691,763
流動資産合計	96,001,687,008
資産合計	96,001,687,008
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	138,660,140
未払解約金	40,941,498
流動負債合計	179,601,638
負債合計	179,601,638
純資産の部	
元本等	
元本	47,278,363,173
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	48,543,722,197
元本等合計	95,822,085,370
純資産合計	95,822,085,370
負債純資産合計	96,001,687,008

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年11月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2024年11月24日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	47,278,363,173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 2.0268円 (1万口当たり純資産額) (20,268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11月24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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	60,321,849,248円
期中追加設定元本額	5,593,858,021円
期中一部解約元本額	18,637,344,096円
期末元本額	47,278,363,173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）	1,835,996,739円
S B I 資産設計オープン（分配型）	6,938,281円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	15,846,934,005円
J リートインデックス・オープン（SMA専用）	20,371,502,013円
コア投資戦略ファンド（安定型）	602,448,365円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,042,334,487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）	459,626,988円
S M T インデックスバランス・オープン	21,730,059円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	137,260,651円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	16,506,347円
グローバル経済コア	572,759,384円
S B I 資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	20,487,959円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	299,327,569円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	80,105,958円
M y S M T J - R E I T インデックス（ノーロード）	1,202,192,998円
10資産分散投資ファンド	33,356,900円
グローバル10資産バランスファンド	60,037,941円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	212,404,617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）	12,564,136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）	846,874,774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）	63,477,032円
J - R E I T バッシブ・ファンド 2018 - 05（適格機関投資家専用）	486,594,922円

（デリバティブ取引に関する注記）

投資証券関連

（2024年11月24日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	3,459,370,820	-	3,321,146,500	138,224,320
合計		3,459,370,820	-	3,321,146,500	138,224,320

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

2024年11月24日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	239,880,764
コール・ローン	40,372,023
投資証券	140,393,160,672
派生商品評価勘定	442
未収入金	77,280,032
未収配当金	190,830,240
未収利息	238
流動資産合計	140,941,524,411
資産合計	
140,941,524,411	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	117,620
未払金	58,391,616
未払解約金	4,334,522
流動負債合計	62,843,758
負債合計	
62,843,758	
純資産の部	
元本等	
元本	42,318,639,236
剰余金	
剰余金又は欠損金()	98,560,041,417
元本等合計	140,878,680,653
純資産合計	
140,878,680,653	
負債純資産合計	
140,941,524,411	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2024年11月24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>為替予約取引</p>

2024年11月24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	(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11月24日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	42,318,639,236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) 3.3290円 (33,290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11月24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11月24日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 5月25日
期首元本額	40,273,482,755円
期中追加設定元本額	5,592,573,888円
期中一部解約元本額	3,547,417,407円
期末元本額	42,318,639,236円
期末元本額の内訳	

区分	2024年11月24日現在
グローバル3資産バランスオープン	45,207,252円
ワールド・ファイブインカム・ファンド(毎月決算型)	70,730,034円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,511,894,890円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,634,021円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	10,929,685,463円
グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)	19,282,809,820円
コア投資戦略ファンド(安定型)	381,863,011円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,091,049,272円
分散投資コア戦略ファンドA	1,289,822,691円
分散投資コア戦略ファンドS	3,459,827,749円
コア投資戦略ファンド(切替型)	473,875,605円
SMT インデックスバランス・オープン	102,699,249円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	140,109,442円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,763,836円
グローバル経済コア	387,031,800円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	16,778,567円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	375,695,734円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	99,132,517円
My SMT グローバルREITインデックス(ノーロード)	365,445,675円
10資産分散投資ファンド	17,679,842円
グローバル10資産バランスファンド	43,438,115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)	1,354,176,820円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	183,048,800円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	98,343,111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)	49,167,129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)	48,569,505円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	80,202,667円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	78,752,244円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	78,463,899円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	78,584,761円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	77,918,065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)	39,317,488円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	49,920,162円

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

(2024年11月24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	57,264,800	-	57,147,622	117,178
	アメリカドル	57,264,800	-	57,147,622	117,178
合計		57,264,800	-	57,147,622	117,178

(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12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12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	525	15,838,205
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	57	202,229
単位型公社債投資信託	52	171,026
合計	634	16,211,460

（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

2025年 2月21日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

5【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「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財務諸表等規則並びに同規則第2条、第282条及び第306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38期事業年度（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。
- また、第39期事業年度の中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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 (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 （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			
		その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	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

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あります。)

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

- 時価法によっております。
4. 固定資産の減価償却の方法
- (1) 有形固定資産
定額法によっております。
- (2) 無形固定資産
定額法によっております。
ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準
外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。
6. 引当金の計上基準
- (1) 賞与引当金
従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。
- (2) 退職給付引当金
従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。過去勤務費用及び数理計算上の差異の損益処理方法は次のとおりであります。
過去勤務費用：発生事業年度に損益処理
数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理
なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当事業年度末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。
7. 収益及び費用の計上基準
当社は投資運用、投資助言・代理を業として行っており、当該事業において顧客との契約から生じる主な履行義務の内容及び当履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。
- (1) 投資信託委託業務
当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
- (2) 投資一任業務
当社は、投資一任契約に基づき投資一任サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
- (3) 投資助言業務
当社は、投資顧問（助言）契約に基づき投資助言サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。当該収益は、年4回等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。
- (4) 成功報酬
当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資一任契約のもと、報酬を受領することが確実であり、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
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・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（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	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)
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

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第39期中間会計期間末

(2024年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		15,957
金銭の信託		18,219
未収委託者報酬		11,990
未収運用受託報酬		6,429
短期差入証拠金		2,431
その他		4,238
流動資産合計		59,268

固定資産

有形固定資産	1	592
無形固定資産		
ソフトウェア		6,988
その他		59
無形固定資産合計		7,047

投資その他の資産

投資有価証券		6,615
関係会社株式		6,077
繰延税金資産		1,127
その他		30
投資その他の資産合計		13,850

固定資産合計 21,491

資産合計 80,759

負債の部

流動負債

未払金		8,431
未払法人税等		1,202
賞与引当金		424
その他	2	2,306
流動負債合計		12,364

固定負債

退職給付引当金		1,035
資産除去債務		154
その他		53
固定負債合計		1,244
負債合計		13,608

（単位：百万円）

第39期中間会計期間末

（2024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		45,816
利益剰余金合計		48,416

株主資本合計

67,655

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		453
繰延ヘッジ損益		958
評価・換算差額等合計		504

純資産合計

67,150

負債・純資産合計

80,759

中間損益計算書

（単位：百万円）

第39期中間会計期間

（自 2024年4月1日

至 2024年9月30日）

営業収益

委託者報酬		24,956
運用受託報酬		6,026
その他営業収益		187
営業収益合計		31,169

営業費用

18,985

一般管理費

1 7,504

営業利益

4,678

営業外収益	2	193
営業外費用	3	976
経常利益		3,896
特別損失		61
税引前中間純利益		3,835
法人税、住民税及び事業税		1,202
法人税等還付税額		129
法人税等調整額		22
法人税等合計		1,050
中間純利益		2,785

中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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	45,974	48,574	67,813
当中間期変動額					
剰余金の配当			2,943	2,943	2,943
中間純利益			2,785	2,785	2,785
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	-	-	157	157	157
当中間期末残高	500	2,100	45,816	48,416	67,655

	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	360	1,071	710	67,103
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,943
中間純利益				2,785
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	92	112	205	205
当中間期変動額合計	92	112	205	47
当中間期末残高	453	958	504	67,150

注記事項

（重要な会計方針）

第39期中間会計期間
(自 2024年4月1日
至 2024年9月30日)

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

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

時価法によっております。

(3) 金銭の信託

時価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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。

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。

(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。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(中間貸借対照表関係)

第39期中間会計期間末 (2024年9月30日)	
1 有形固定資産の減価償却累計額	1,128百万円
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39期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	83百万円
無形固定資産	1,211百万円
2 営業外収益の主要項目	
投資有価証券売却益	149百万円
3 営業外費用の主要項目	
金銭の信託運用損	263百万円
投資有価証券償還損	239百万円
為替差損	146百万円
デリバティブ費用	138百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第39期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024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
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	981,032	2024年3月31日	2024年6月21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39期中間会計期間末(2024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、市場価格のない株式等、「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、「時価算定適用指針」という。)第24-3項を適用した投資信託及び第24-16項を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません(注1)*2及び(注2)、(注3)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	2,561	15,657	-	18,219

投資有価証券(*2)				
その他有価証券	-	3,269	-	3,269
資産計	2,561	18,927	-	21,488
デリバティブ取引(*3)				
株式関連取引	(281)	(230)	-	(511)
通貨関連取引	-	(286)	-	(286)
デリバティブ取引計	(281)	(517)	-	(798)

(*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、非上場株式（中間貸借対照表計上額876百万円）、時価算定適用指針第24-3項の基準価額を時価とみなす取扱いを適用した投資信託（中間貸借対照表計上額1,991百万円）及び第24-16項を適用した組合出資金等（中間貸借対照表計上額478百万円）は上記に含めておりません。

(*3)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。時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用し、基準価額を時価とみなした投資信託はレベルを付しておりません。

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	876
関係会社株式	6,077

(注3) 時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用した投資信託に関する情報
第24-3項の取扱いを適用した投資信託の期首残高から期末残高への調整表

(単位：百万円)

区分	期首残高	当期の損益に計上した額	その他有価証券評価差額金に計上した額	購入、売却及び償還による変動額	基準価額を時価とみなすこととした額	基準価額を時価とみなさないこととした額	期末残高	当期の損益に計上した額のうち貸借対照表日において保有する投資信託の評価損益
投資有価証券(その他有価証券)	-	-	8	2,000	1,991	-	1,991	-

(注) 決算日における解約等に関する制限の主な内容は、一定期間の解約制限があるものが1,991百万円であります。

(有価証券関係)

第39期中間会計期間末（2024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	6,077

2. その他有価証券

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	3,010	2,306	704
小計	3,010	2,306	704
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	2,249	2,306	57
小計	2,249	2,306	57
合計	5,260	4,613	647

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額478百万円）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39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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	5,053	-	83	83
	英ポンド	173	-	5	5
	カナダドル	130	-	2	2
	スイスフラン	74	-	1	1
	香港ドル	120	-	1	1
	ユーロ	461	-	9	9
	買建				
	米ドル	42	-	0	0
	ユーロ	11	-	0	0
合計		6,068	-	104	104

（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	10,399	-	281	281
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	5,524	-	230	230
合計		15,923	-	511	511

（注）上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,833	-	30
	英ポンド		4,463	-	137
	スイスフラン		49	-	0
	香港ドル		95	-	1
	ユーロ		31	-	0
	シンガポールドル		433	-	11
	合計			6,906	-

（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39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針4. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報が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39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,620百万円

〔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39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第39期中間会計期間 （自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）	
1株当たり純資産額	22,383,579円15銭
1株当たり中間純利益	928,397円37銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第39期中間会計期間 （自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）	
中間純利益	2,785百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,785百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

独立監査人の監査報告書

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12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 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2024年4月1日から2025年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024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2024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（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

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

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

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2025年2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

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている10資産分散投資ファンドの2024年5月25日から2024年11月24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、10資産分散投資ファンドの2024年11月24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5月25日から2024年11月24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。