

【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4月10日提出
【計算期間】	第13期中(自 2024年7月11日至 2025年1月10日)
【ファンド名】	分散投資コア戦略ファンドA 分散投資コア戦略ファンドS
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	北添 道生
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【ファンドの運用状況】

以下は、2025年1月31日現在の状況について記載してあります。

【分散投資コア戦略ファンドA】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	8,688,206,741	9.40
投資証券	ケイマン	1,934,068,500	2.09
	アイルランド	986,150,500	1.07
	小計	2,920,219,000	3.16
親投資信託受益証券	日本	79,635,148,315	86.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,146,661,517	1.24
合計(純資産総額)		92,390,235,573	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3期計算期間末	(2015年 7月10日)	23,204,975,199	23,204,975,199	10,550	10,550
第4期計算期間末	(2016年 7月11日)	40,992,277,841	40,992,277,841	9,890	9,890
第5期計算期間末	(2017年 7月10日)	47,152,867,522	47,152,867,522	10,297	10,297
第6期計算期間末	(2018年 7月10日)	56,957,731,265	56,957,731,265	10,442	10,442
第7期計算期間末	(2019年 7月10日)	64,206,017,914	64,206,017,914	10,533	10,533
第8期計算期間末	(2020年 7月10日)	69,610,450,591	69,610,450,591	10,401	10,401
第9期計算期間末	(2021年 7月12日)	80,414,109,882	80,414,109,882	11,262	11,262
第10期計算期間末	(2022年 7月11日)	83,363,228,383	83,363,228,383	10,759	10,759
第11期計算期間末	(2023年 7月10日)	87,419,162,186	87,419,162,186	10,781	10,781
第12期計算期間末	(2024年 7月10日)	91,968,608,759	91,968,608,759	11,398	11,398
	2024年 1月末日	89,362,952,528		10,932	
	2月末日	89,799,897,780		11,051	
	3月末日	90,892,554,970		11,234	
	4月末日	90,304,316,716		11,215	
	5月末日	90,324,244,914		11,198	
	6月末日	91,041,175,717		11,329	
	7月末日	90,803,364,722		11,235	
	8月末日	90,776,915,346		11,212	
	9月末日	90,972,156,757		11,270	
	10月末日	92,631,625,994		11,355	
	11月末日	92,091,870,012		11,292	

12月末日	91,857,803,182		11,323	
2025年 1月末日	92,390,235,573		11,334	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	0
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	0
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	0
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	0
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	0
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	0
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	0
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	0
第12期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	3.4
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	6.3
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	4.1
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	1.4
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.9
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1.3
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	8.3
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	4.5
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	0.2
第12期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	5.7
第13期中間計算期間	2024年 7月11日～2025年 1月10日	1.1

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

【分散投資コア戦略ファンドS】

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	日本	26,105,687,847	11.27
投資証券	ケイマン	4,195,440,900	1.81
	アイルランド	2,145,131,500	0.93
	小計	6,340,572,400	2.74
親投資信託受益証券	日本	195,415,359,987	84.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,826,129,608	1.65
合計(純資産総額)		231,687,749,842	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3期計算期間末	(2015年 7月10日)	23,718,308,897	23,718,308,897	11,013	11,013
第4期計算期間末	(2016年 7月11日)	40,713,425,166	40,713,425,166	9,845	9,845
第5期計算期間末	(2017年 7月10日)	57,661,475,690	57,661,475,690	10,759	10,759
第6期計算期間末	(2018年 7月10日)	75,431,956,580	75,431,956,580	11,008	11,008
第7期計算期間末	(2019年 7月10日)	89,663,756,248	89,663,756,248	11,109	11,109
第8期計算期間末	(2020年 7月10日)	143,157,363,596	143,157,363,596	10,980	10,980
第9期計算期間末	(2021年 7月12日)	171,466,226,114	171,466,226,114	12,554	12,554
第10期計算期間末	(2022年 7月11日)	177,910,582,335	177,910,582,335	12,378	12,378
第11期計算期間末	(2023年 7月10日)	194,020,660,452	194,020,660,452	12,871	12,871
第12期計算期間末	(2024年 7月10日)	223,716,185,671	223,716,185,671	14,489	14,489
	2024年 1月末日	203,971,505,362		13,372	
	2月末日	207,100,509,014		13,642	
	3月末日	215,770,767,033		13,976	
	4月末日	216,418,513,919		14,048	
	5月末日	218,027,373,367		14,094	
	6月末日	220,446,506,186		14,337	
	7月末日	218,173,828,846		14,109	
	8月末日	216,975,913,730		14,008	
	9月末日	217,938,702,669		14,099	
	10月末日	224,756,461,991		14,374	
	11月末日	223,691,993,882		14,272	
	12月末日	229,688,112,239		14,396	
	2025年 1月末日	231,687,749,842		14,449	

【分配の推移】

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

第12期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	0
----------	-------------------------	---

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	5.4
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	10.6
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	9.3
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	2.3
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	0.9
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	1.2
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	14.3
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	1.4
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	4.0
第12期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	12.6
第13期中間計算期間	2024年 7月11日～2025年 1月10日	1.1

(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	729,804,799,860	99.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,768,357,173	0.65
合計(純資産総額)		734,573,157,033	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	4,186,500,000	0.57

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

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

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	5,634,780,580	99.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		31,666,170	0.56
合計(純資産総額)		5,666,446,750	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	30,701,000	0.54

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

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

国内債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	608,062,180,130	84.87
地方債証券	日本	35,794,933,167	5.00
特殊債券	日本	37,180,094,828	5.19
	国際機関	297,210,000	0.04
	小計	37,477,304,828	5.23
社債券	日本	31,386,083,000	4.38
	フランス	1,683,543,000	0.23
	韓国	99,513,000	0.01
	オーストラリア	99,175,000	0.01
	小計	33,268,314,000	4.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,888,972,837	0.26
合計(純資産総額)		716,491,704,962	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	36,589,372,479	45.52
	中国	8,717,652,350	10.84
	フランス	5,530,915,809	6.88
	イタリア	5,227,151,484	6.50
	ドイツ	4,337,955,451	5.40
	イギリス	3,953,922,273	4.92
	スペイン	3,330,539,744	4.14
	カナダ	1,503,640,619	1.87
	ベルギー	1,177,986,181	1.47
	オランダ	991,480,436	1.23
	オーストラリア	934,255,834	1.16

	オーストリア	833,029,708	1.04
	メキシコ	581,541,214	0.72
	ポルトガル	444,549,384	0.55
	ポーランド	422,063,727	0.53
	マレーシア	398,222,928	0.50
	フィンランド	375,791,761	0.47
	アイルランド	356,631,341	0.44
	シンガポール	298,256,452	0.37
	イスラエル	269,623,335	0.34
	ニュージーランド	210,541,104	0.26
	デンマーク	170,879,346	0.21
	スウェーデン	129,349,387	0.16
	ノルウェー	119,123,962	0.15
	小計	76,904,476,309	95.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,483,130,208	4.33
合計(純資産総額)		80,387,606,517	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	322,302,655	0.40
	買建	ドイツ	274,448,923	0.34

(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		77,800,632,037	96.78

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

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

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	626,231,972,952	72.75
	イギリス	30,310,424,119	3.52
	カナダ	27,451,087,477	3.19
	スイス	22,750,521,426	2.64
	フランス	21,656,389,891	2.52
	ドイツ	19,969,415,401	2.32

	アイルランド	15,699,328,388	1.82
	オーストラリア	13,923,847,520	1.62
	オランダ	13,511,741,412	1.57
	スウェーデン	6,745,972,115	0.78
	スペイン	5,726,977,854	0.67
	デンマーク	5,644,585,509	0.66
	イタリア	4,802,055,168	0.56
	香港	2,886,123,888	0.34
	シンガポール	2,575,587,919	0.30
	フィンランド	2,104,290,910	0.24
	イスラエル	2,001,514,580	0.23
	ベルギー	1,491,932,047	0.17
	ルクセンブルク	1,425,802,905	0.17
	ケイマン	1,249,687,051	0.15
	ノルウェー	1,240,800,186	0.14
	ジャージー	1,139,914,971	0.13
	バミューダ	900,607,035	0.10
	リベリア	810,566,592	0.09
	キュラソー	699,492,297	0.08
	ニュージーランド	604,096,530	0.07
	オーストリア	401,799,133	0.05
	パナマ	382,150,072	0.04
	ポルトガル	285,995,720	0.03
	マン島	66,652,104	0.01
	小計	834,691,333,172	96.97
新株予約権証券	カナダ	-	-
投資信託受益証券	香港	59,810,814	0.01
	オーストラリア	54,697,334	0.01
	小計	114,508,148	0.01
投資証券	アメリカ	12,845,872,271	1.49
	オーストラリア	891,550,382	0.10
	フランス	300,596,552	0.03
	シンガポール	204,445,032	0.02
	イギリス	199,067,105	0.02
	香港	151,420,836	0.02
	ベルギー	42,825,985	0.00
	カナダ	21,009,219	0.00
	小計	14,656,787,382	1.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,335,721,600	1.32
合計(純資産総額)		860,798,350,302	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	8,759,736,750	1.02
	買建	カナダ	298,832,238	0.03
	買建	ドイツ	1,412,324,544	0.16
	買建	イギリス	629,065,239	0.07
	買建	オーストラリア	263,594,565	0.03

(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		1,343,020,002	0.16

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

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

外国株式最小分散インデックスマザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	12,320,559,051	64.72
	スイス	1,485,278,396	7.80
	カナダ	1,139,574,852	5.99
	ドイツ	746,201,579	3.92
	アイルランド	336,757,738	1.77
	オーストラリア	325,682,389	1.71
	オランダ	316,361,111	1.66
	フランス	242,433,359	1.27
	シンガポール	205,653,007	1.08
	香港	179,604,476	0.94
	イギリス	173,067,841	0.91
	スペイン	171,644,584	0.90
	イスラエル	143,286,032	0.75
	フィンランド	135,934,922	0.71
	バミューダ	72,686,711	0.38
	イタリア	40,857,081	0.21
	スウェーデン	36,892,937	0.19
	ケイマン	34,681,611	0.18
	ベルギー	32,251,290	0.17
	デンマーク	28,044,841	0.15

	ニュージーランド	22,950,241	0.12
	オーストリア	8,785,395	0.05
	小計	18,199,189,444	95.61
新株予約権証券	カナダ	-	-
投資信託受益証券	香港	24,873,703	0.13
投資証券	アメリカ	273,608,137	1.44
	香港	8,398,130	0.04
	小計	282,006,267	1.48
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		529,416,217	2.78
合計（純資産総額）		19,035,485,631	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	235,476,794	1.24
	買建	カナダ	99,610,746	0.52

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	176,818,361,703	46.36
	中国	42,159,410,635	11.05
	フランス	26,769,072,330	7.02
	イタリア	25,278,400,780	6.63
	ドイツ	21,067,051,924	5.52
	イギリス	19,113,241,891	5.01
	スペイン	16,106,112,352	4.22
	カナダ	7,275,892,273	1.91
	ベルギー	5,698,205,023	1.49
	オランダ	4,794,785,166	1.26
	オーストラリア	4,534,608,989	1.19
	オーストリア	4,036,057,896	1.06
	メキシコ	2,826,533,288	0.74
	ポルトガル	2,140,755,220	0.56
	ポーランド	2,061,822,599	0.54
	マレーシア	1,909,573,335	0.50
	フィンランド	1,802,560,684	0.47
アイルランド	1,718,226,067	0.45	

	シンガポール	1,426,172,351	0.37
	イスラエル	1,290,354,126	0.34
	ニュージーランド	1,007,158,318	0.26
	デンマーク	820,313,809	0.22
	スウェーデン	619,014,372	0.16
	ノルウェー	566,572,384	0.15
	小計	371,840,257,515	97.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,558,149,152	2.51
合計(純資産総額)		381,398,406,667	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	2,049,041,229	0.54
	買建	ドイツ	1,722,486,895	0.45

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		4,804,659,825	1.26

(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	台湾	43,625,999,622	18.91
	インド	40,391,015,298	17.51
	ケイマン	36,846,543,943	15.97
	中国	23,199,639,740	10.06
	韓国	21,112,778,571	9.15
	サウジアラビア	9,278,477,716	4.02
	ブラジル	8,443,536,358	3.66
	南アフリカ	6,097,143,573	2.64
	メキシコ	3,706,643,514	1.61
	マレーシア	3,211,709,687	1.39
	インドネシア	3,143,207,712	1.36
	アラブ首長国連邦	3,129,020,388	1.36
	タイ	3,059,119,555	1.33

	ポーランド	1,951,714,985	0.85
	香港	1,811,846,877	0.79
	カタール	1,791,681,216	0.78
	クウェート	1,728,897,302	0.75
	トルコ	1,479,142,735	0.64
	ギリシャ	1,126,070,561	0.49
	フィリピン	1,086,198,707	0.47
	チリ	1,008,171,318	0.44
	バミューダ	795,279,736	0.34
	アメリカ	718,735,085	0.31
	ハンガリー	603,655,956	0.26
	イギリス	405,447,078	0.18
	ルクセンブルク	363,332,523	0.16
	チェコ	336,051,307	0.15
	コロンビア	273,919,519	0.12
	エジプト	111,551,420	0.05
	シンガポール	79,703,355	0.03
	ペルー	72,942,648	0.03
	ロシア	-	-
	英ヴァージン諸島	-	-
	小計	220,989,178,005	95.79
投資信託受益証券	ブラジル	335,110,157	0.15
	メキシコ	119,252,253	0.05
	小計	454,362,410	0.20
投資証券	メキシコ	203,998,958	0.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,065,508,660	3.93
合計(純資産総額)		230,713,048,033	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	9,047,317,068	3.92

(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		63,293,012	0.03

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

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

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	マレーシア	15,728,005,343	9.76
	メキシコ	15,680,487,615	9.73
	中国	15,427,958,273	9.57
	インドネシア	15,179,104,870	9.42
	タイ	15,080,765,778	9.36
	南アフリカ	13,025,710,691	8.08
	ポーランド	11,244,272,358	6.98
	インド	10,675,694,706	6.62
	ブラジル	10,206,433,846	6.33
	チェコ	8,590,770,744	5.33
	コロンビア	6,546,096,886	4.06
	ルーマニア	5,399,147,593	3.35
	ハンガリー	3,857,200,816	2.39
	ペルー	3,278,239,347	2.03
	チリ	2,730,032,316	1.69
	トルコ	2,274,847,768	1.41
	ドミニカ共和国	367,127,043	0.23
ウルグアイ	284,939,454	0.18	
	小計	155,576,835,447	96.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,599,447,166	3.47
合計(純資産総額)		161,176,282,613	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		2,132,851,452	1.32

(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	96,714,000,100	96.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,601,677,395	3.59
合計(純資産総額)		100,315,677,495	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、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	3,581,964,000	3.57

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

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

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	110,403,920,892	79.75
	オーストラリア	9,900,819,837	7.15
	イギリス	5,548,836,011	4.01
	シンガポール	4,162,452,732	3.01
	フランス	2,469,553,870	1.78
	カナダ	1,668,399,515	1.21
	ベルギー	1,192,519,628	0.86
	香港	1,079,913,261	0.78
	スペイン	608,644,669	0.44
	韓国	219,522,561	0.16
	ガーンジー	201,312,559	0.15
	イスラエル	196,981,364	0.14
	オランダ	188,588,110	0.14
	ニュージーランド	128,735,815	0.09
	ドイツ	58,104,748	0.04
	アイルランド	53,641,607	0.04
イタリア	14,928,145	0.01	
	小計	138,096,875,324	99.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		344,861,870	0.25
合計(純資産総額)		138,441,737,194	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		24,165,266	0.02

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

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

ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	41,311,940,648	97.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		901,393,186	2.14
合計(純資産総額)		42,213,333,834	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、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		40,558,731,991	96.08

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

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

HFRリターン・ターゲット・マザーファンド(為替ヘッジあり)

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	1,196,095,200	37.55
投資信託受益証券	アメリカ	703,458,198	22.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,286,169,644	40.37
合計(純資産総額)		3,185,723,042	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	472,372,028	14.83
	買建	ドイツ	350,178,132	10.99
	買建	イギリス	215,206,529	6.76
	売建	ドイツ	21,331,030	0.67
債券先物取引	売建	アメリカ	84,345,326	2.65

(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		1,312,391,725	41.20

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

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

GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	11,689,577,000	51.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,154,234,328	48.83
合計(純資産総額)		22,843,811,328	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	イギリス	9,338,776,422	40.88
	売建	日本	11,112,930,000	48.65
	売建	アメリカ	4,588,385,762	20.09
	売建	ドイツ	2,834,298,856	12.41

(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		11,274,834,200	49.36
	売建		12,951,092,320	56.69

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

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

2【設定及び解約の実績】

【分散投資コア戦略ファンドA】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	6,829,705,615	1,125,034,771	21,994,421,398
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	21,115,619,373	1,662,548,782	41,447,491,989
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	6,712,164,459	2,368,251,334	45,791,405,114
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	11,384,212,208	2,627,192,900	54,548,424,422
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	9,304,566,486	2,896,398,134	60,956,592,774
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	10,458,038,852	4,487,544,486	66,927,087,140
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	8,942,057,064	4,467,543,464	71,401,600,740
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	10,745,359,555	4,666,858,341	77,480,101,954
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	9,056,644,310	5,449,171,076	81,087,575,188
第12期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	8,522,680,283	8,924,705,373	80,685,550,098
第13期中間計算期間	2024年 7月11日～2025年 1月10日	3,968,775,906	3,219,455,744	81,434,870,260

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

【分散投資コア戦略ファンドS】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第3期計算期間	2014年 7月11日～2015年 7月10日	13,807,316,695	1,419,809,778	21,535,767,306
第4期計算期間	2015年 7月11日～2016年 7月11日	22,822,224,799	3,002,745,419	41,355,246,686
第5期計算期間	2016年 7月12日～2017年 7月10日	15,776,145,748	3,537,868,655	53,593,523,779
第6期計算期間	2017年 7月11日～2018年 7月10日	19,014,211,372	4,083,197,323	68,524,537,828
第7期計算期間	2018年 7月11日～2019年 7月10日	17,123,071,331	4,937,538,036	80,710,071,123
第8期計算期間	2019年 7月11日～2020年 7月10日	60,254,110,229	10,583,069,703	130,381,111,649
第9期計算期間	2020年 7月11日～2021年 7月12日	17,432,745,205	11,230,399,627	136,583,457,227
第10期計算期間	2021年 7月13日～2022年 7月11日	17,903,179,345	10,752,318,272	143,734,318,300
第11期計算期間	2022年 7月12日～2023年 7月10日	20,898,235,211	13,888,973,046	150,743,580,465
第12期計算期間	2023年 7月11日～2024年 7月10日	18,352,523,646	14,690,213,957	154,405,890,154
第13期中間計算期間	2024年 7月11日～2025年 1月10日	11,683,399,899	5,976,340,798	160,112,949,255

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

3【ファンドの経理状況】

【分散投資コア戦略ファンドA】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「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13期中間計算期間(2024年7月11日から2025年1月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (2024年 7月10日現在)	第13期中間計算期間 (2025年 1月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,430,586,544	1,191,642,539
投資信託受益証券	9,894,177,256	8,552,701,376
投資証券	-	2,898,501,000
親投資信託受益証券	81,074,372,629	79,298,710,400
未収入金	90,000,000	370,000,000
未収利息	2,638	7,050
流動資産合計	92,489,139,067	92,311,562,365
資産合計	92,489,139,067	92,311,562,365
負債の部		
流動負債		
未払解約金	100,885,295	118,561,141
未払受託者報酬	24,627,091	25,333,708
未払委託者報酬	394,033,301	405,339,151
その他未払費用	984,621	1,001,816
流動負債合計	520,530,308	550,235,816
負債合計	520,530,308	550,235,816
純資産の部		
元本等		
元本	80,685,550,098	81,434,870,260
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	11,283,058,661	10,326,456,289
(分配準備積立金)	7,000,854,528	6,728,283,522
元本等合計	91,968,608,759	91,761,326,549
純資産合計	91,968,608,759	91,761,326,549
負債純資産合計	92,489,139,067	92,311,562,365

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第12期中間計算期間 自 2023年 7月11日 至 2024年 1月10日	第13期中間計算期間 自 2024年 7月11日 至 2025年 1月10日
営業収益		
受取利息	8,637	1,456,026
有価証券売買等損益	1,159,460,655	622,027,611
営業収益合計	1,159,469,292	620,571,585
営業費用		
支払利息	294,741	-
受託者報酬	24,161,181	25,333,708
委託者報酬	386,578,853	405,339,151
その他費用	988,159	1,001,816
営業費用合計	412,022,934	431,674,675
営業利益又は営業損失（ ）	747,446,358	1,052,246,260
経常利益又は経常損失（ ）	747,446,358	1,052,246,260
中間純利益又は中間純損失（ ）	747,446,358	1,052,246,260
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（ ）	13,515,525	37,260,756
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,331,586,998	11,283,058,661
剰余金増加額又は欠損金減少額	292,925,194	507,541,080
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	292,925,194	507,541,080
剰余金減少額又は欠損金増加額	260,239,254	449,157,948
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	260,239,254	449,157,948
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,125,234,821	10,326,456,289

（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	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)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>(3)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。</p>
-----------------	---

（中間貸借対照表に関する注記）

	第12期 (2024年 7月10日現在)	第13期中間計算期間 (2025年 1月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	80,685,550,098口	81,434,870,260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) 1.1398円 (11,398円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1268円 (11,268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13期中間計算期間 (2025年 1月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（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12期 自 2023年 7月11日 至 2024年 7月10日	第13期中間計算期間 自 2024年 7月11日 至 2025年 1月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	81,087,575,188円	80,685,550,098円
期中追加設定元本額	8,522,680,283円	3,968,775,906円
期中一部解約元本額	8,924,705,373円	3,219,455,744円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

【分散投資コア戦略ファンドS】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「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13期中間計算期間(2024年7月11日から2025年1月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (2024年7月10日現在)	第13期中間計算期間 (2025年1月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,522,250,945	3,879,291,147
投資信託受益証券	29,136,083,307	25,046,724,656
投資証券	-	6,293,421,000
親投資信託受益証券	192,082,585,348	194,924,270,922
未収入金	200,000,000	600,000,000
未収利息	6,495	22,952
流動資産合計	224,940,926,095	230,743,730,677
資産合計	224,940,926,095	230,743,730,677
負債の部		
流動負債		
未払解約金	234,491,087	227,605,792
未払受託者報酬	58,172,317	61,426,975
未払委託者報酬	930,756,954	982,831,470
その他未払費用	1,320,066	1,362,752
流動負債合計	1,224,740,424	1,273,226,989
負債合計	1,224,740,424	1,273,226,989
純資産の部		
元本等		
元本	154,405,890,154	160,112,949,255
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	69,310,295,517	69,357,554,433
(分配準備積立金)	44,187,923,836	42,527,668,544
元本等合計	223,716,185,671	229,470,503,688
純資産合計	223,716,185,671	229,470,503,688
負債純資産合計	224,940,926,095	230,743,730,677

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期中間計算期間 自 2023年 7月11日 至 2024年 1月10日	第13期中間計算期間 自 2024年 7月11日 至 2025年 1月10日
営業収益		
受取利息	13,726	4,135,413
有価証券売買等損益	5,641,755,830	1,331,969,199
営業収益合計	5,641,769,556	1,327,833,786
営業費用		
支払利息	659,375	-
受託者報酬	54,195,056	61,426,975
委託者報酬	867,120,841	982,831,470
その他費用	1,288,598	1,362,752
営業費用合計	923,263,870	1,045,621,197
営業利益又は営業損失（ ）	4,718,505,686	2,373,454,983
経常利益又は経常損失（ ）	4,718,505,686	2,373,454,983
中間純利益又は中間純損失（ ）	4,718,505,686	2,373,454,983
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（ ）	47,970,813	177,391,002
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	43,277,079,987	69,310,295,517
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,263,726,842	4,920,008,287
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,263,726,842	4,920,008,287
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,721,196,782	2,676,685,390
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,721,196,782	2,676,685,390
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	48,490,144,920	69,357,554,433

（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	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)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>(3)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。</p>
-----------------	---

（中間貸借対照表に関する注記）

	第12期 (2024年 7月10日現在)	第13期中間計算期間 (2025年 1月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	154,405,890,154口	160,112,949,255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) 1.4489円 (14,489円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.4332円 (14,332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13期中間計算期間 (2025年 1月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（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12期 自 2023年 7月11日 至 2024年 7月10日	第13期中間計算期間 自 2024年 7月11日 至 2025年 1月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	150,743,580,465円	154,405,890,154円
期中追加設定元本額	18,352,523,646円	11,683,399,899円
期中一部解約元本額	14,690,213,957円	5,976,340,798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

	2025年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,327,372,001
株式	705,274,407,710
派生商品評価勘定	318,350
未収配当金	979,519,098
未収利息	31,520
前払金	63,860,600
差入委託証拠金	244,416,742
流動資産合計	711,889,926,021
資産合計	711,889,926,021
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	64,287,850
未払解約金	693,893,162
流動負債合計	758,181,012
負債合計	758,181,012
純資産の部	
元本等	
元本	249,202,068,293
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	461,929,676,716
元本等合計	711,131,745,009
純資産合計	711,131,745,009
負債純資産合計	711,889,926,021

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2025年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		249,202,068,293口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8536円 (28,536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

		2025年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	233,103,107,390円
期中追加設定元本額	26,251,536,772円
期中一部解約元本額	10,152,575,869円
期末元本額	249,202,068,293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）	258,751,421円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,201,420,217円
SBI資産設計オープン（分配型）	11,636,580円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,256,007,532円
世界経済インデックスファンド	6,973,422,569円
日本株式インデックス・オープン	2,683,211,399円
DCマイセレクション25	4,707,466,476円
DCマイセレクション50	16,108,148,600円
DCマイセレクション75	18,554,809,390円
DC日本株式インデックス・オープン	5,937,943,087円
DCマイセレクションS25	3,663,718,260円
DCマイセレクションS50	11,132,275,330円
DCマイセレクションS75	11,063,559,863円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,615,865,397円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	36,369,940円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	547,044,088円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	455,185,271円
DC世界経済インデックスファンド	3,716,075,924円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	313,498,202円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	3,917,169円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	9,114,691円

区分	2025年 1月10日現在
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)	94,596,097円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	1,792,720円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	10,555,233円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	42,635,748円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	12,497,620円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	39,110,073円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	291,156,137円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	272,938,251円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,870,536,395円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	24,782,917円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	8,074,492円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	270,427,384円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	146,020,980円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	200,458,965円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	15,656,000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)	356,795,299円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,278,170,245円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,859,512,108円
コア投資戦略ファンド(安定型)	503,870,105円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,266,388,442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	6,163,278,838円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	726,993,708円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	427,905,356円
コア投資戦略ファンド(切替型)	525,427,519円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	189,163,823円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,566,976円
SMT インデックスバランス・オープン	45,211,463円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	17,217,748,824円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	184,654,439円
SMT 世界経済インデックス・オープン	61,362,899円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	285,223,254円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	45,439,575円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,421,387円
グローバル経済コア	312,178,987円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	36,294,879円
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	3,224,530,711円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,787,205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	70,005,263円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	72,776,419円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	34,365,922円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	44,833,955円
10資産分散投資ファンド	113,760,161円
グローバル10資産バランスファンド	52,730,845円
DC世界経済インデックスファンド(株式特化型)	6,100,025円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2035	3,939,356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	2,451,774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	4,405,774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	1,480,764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	701,099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	208,740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	125,812円
DCマイセレクションS50(2024-2026リスク抑制型)	766,051,993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)	43,964,593,059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)	216,315,328円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	304,415,366円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	21,527,882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)	52,611,259,620円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	16,409,098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)	235,369,978円

区分	2025年 1月10日現在
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	26,259円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	25,215円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	25,215円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	21,335円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	25,215円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	28,378円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2025年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,449,460,600	-	5,385,600,000	63,860,600
合計		5,449,460,600	-	5,385,600,000	63,860,600

（注）1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	16,143,668
株式	5,467,760,260
未収配当金	11,767,050
未収利息	95
前払金	568,250
差入委託証拠金	1,264,314
流動資産合計	5,497,503,637
資産合計	5,497,503,637
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	569,130
流動負債合計	569,130
負債合計	569,130
純資産の部	
元本等	
元本	3,233,893,638
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,263,040,869
元本等合計	5,496,934,507
純資産合計	5,496,934,507
負債純資産合計	5,497,503,637

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2025年 1月10日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2025年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,233,893,638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 1.6998円 (1万口当たり純資産額) (16,998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

2025年 1月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2025年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	3,168,336,264円
期中追加設定元本額	65,557,374円
期中一部解約元本額	- 円
期末元本額	3,233,893,638円

区分	2025年 1月10日現在
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	702,388,755円
分散投資コア戦略ファンドS	2,531,504,883円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2025年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	27,768,250	-	27,200,000	568,250
合計		27,768,250	-	27,200,000	568,250

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,319,141,477
国債証券	602,151,593,390
地方債証券	36,089,168,507
特殊債券	37,009,691,683
社債券	33,144,324,000
未収入金	98,503,000
未収利息	1,207,727,471
前払費用	90,709,547
流動資産合計	711,110,859,075
資産合計	711,110,859,075
負債の部	
流動負債	
未払金	975,092,980
未払解約金	163,203,542
流動負債合計	1,138,296,522
負債合計	1,138,296,522
純資産の部	
元本等	
元本	548,341,880,020
剰余金	
剰余金又は欠損金()	161,630,682,533
元本等合計	709,972,562,553
純資産合計	709,972,562,553
負債純資産合計	711,110,859,075

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2025年 1月10日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2025年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	548,341,880,020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 98,149,000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 1,2948円 (1万口当たり純資産額) (12,948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

2025年 1月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2025年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	513,531,434,925円
期中追加設定元本額	72,474,821,938円
期中一部解約元本額	37,664,376,843円
期末元本額	548,341,880,020円
期末元本額の内訳	
エマーシング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン(資産成長型)	5,044,643,469円
S B I 資産設計オープン(分配型)	18,849,026円
S M T 国内債券インデックス・オープン	16,858,913,592円
世界経済インデックスファンド	9,722,619,311円
D C マイセレクション 2 5	30,017,555,103円
D C マイセレクション 5 0	38,509,637,167円

区分	2025年 1月10日現在
DCマイセレクション75	13,256,641,443円
DC日本債券インデックス・オープン	398,911,106円
DC日本債券インデックス・オープンS	86,387,012,973円
DC日本債券インデックス・オープンP	62,483,957,930円
DCマイセレクションS25	23,419,334,636円
DCマイセレクションS50	27,164,967,474円
DCマイセレクションS75	8,062,506,220円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	231,414,864円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	3,205,816,524円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	1,343,804,980円
DC世界経済インデックスファンド	6,916,092,698円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,712,261円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	22,705,493円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	9,434,268円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	1,352,237円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	47,709,924円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	78,896,437円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	27,144,287円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	24,781,225円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,463,957,799円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	732,442,999円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,208,556,394円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	67,302,769円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	40,200,657円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	874,899,110円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	937,297,269円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,302,832,140円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	91,013,015円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,123,857,225円
日本債券ファンド・シリーズ1	15,916,574,899円
分散投資コア戦略ファンドA	19,375,412,408円
分散投資コア戦略ファンドS	27,962,841,461円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	376,780,174円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,299,218,533円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	91,767,741円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	49,644,602円
SMT インデックスバランス・オープン	63,729,173円
SMT 世界経済インデックス・オープン	81,084,539円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	182,377,485円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	267,815,053円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	24,379,991円
グローバル経済コア	466,269,195円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	60,006,045円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	44,971,889円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	230,166,490円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	137,231,992円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	43,094,692円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	35,554,382円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	1,513,997,949円
10資産分散投資ファンド	490,099,644円
グローバル10資産バランスファンド	757,815,429円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2035	20,780,104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	10,687,000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	16,589,741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	5,526,370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	3,033,828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	1,936,623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	1,627,682円
DCマイセレクションS50(2024-2026リスク抑制型)	15,134,597,322円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	113,801,014,056円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	54,773,653円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	22,733,221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)	695,296,871円

区分	2025年 1月10日現在
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	72,086円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	73,620円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	81,388円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	54,784円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	108,129円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	58,511円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2025年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	162,504,258
コール・ローン	365,318,726
国債証券	77,241,083,092
派生商品評価勘定	422,481,371
未収入金	983,108,924
未収利息	656,121,940
前払金	4,428,447
前払費用	71,234,521
差入委託証拠金	53,547,273
流動資産合計	79,959,828,552
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	75,472,962
未払金	1,751,026
未払解約金	920,240,980
流動負債合計	997,464,968
負債合計	997,464,968
純資産の部	
元本等	
元本	97,423,571,639
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	18,461,208,055
元本等合計	78,962,363,584
純資産合計	78,962,363,584
負債純資産合計	79,959,828,552

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までには個別法）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>

2025年 1月10日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	(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。 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。 投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2025年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	97,423,571,639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 18,461,208,055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) 0.8105円 (8,105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

2025年 1月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額は、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	2025年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	96,079,020,933円
期中追加設定元本額	10,221,612,362円

区分	2025年 1月10日現在
期中一部解約元本額	8,877,061,656円
期末元本額	97,423,571,639円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	20,905,004,515円
分散投資コア戦略ファンドS	30,890,222,665円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	2,131,282,976円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	972,824,296円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	237,628,510円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	80,655,431円
10資産分散投資ファンド	778,103,185円
グローバル10資産バランスファンド	155,886,499円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	12,376,114,727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）	3,076,878,768円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	340,137円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	315,841円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	303,693円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	242,955円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	303,693円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	302,181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）	2,396,525,360円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2025年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引				
	買建	388,125,109	-	383,696,662	4,428,447
合計		388,125,109	-	383,696,662	4,428,447

（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

（2025年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	79,964,270,590	-	79,612,833,734	351,436,856
	アメリカドル	37,781,297,091	-	37,847,942,105	66,645,014
	カナダドル	1,555,661,309	-	1,557,888,974	2,227,665
	メキシコペソ	603,878,381	-	600,375,535	3,502,846

ユーロ	23,797,107,949	-	23,529,661,998	267,445,951
イギリスポンド	4,148,593,281	-	4,065,420,998	83,172,283
スウェーデンク ローナ	133,101,605	-	131,277,888	1,823,717
ノルウェークロー ネ	122,421,528	-	122,107,394	314,134
デンマーククロー ネ	178,564,300	-	176,505,398	2,058,902
ポーランドズロチ	438,783,959	-	434,348,977	4,434,982
オーストラリアド ル	968,184,702	-	963,199,676	4,985,026
ニュージーランド ドル	220,132,031	-	217,907,351	2,224,680
シンガポールドル	308,212,903	-	305,775,600	2,437,303
マレーシアリン ギット	402,709,136	-	400,885,889	1,823,247
イスラエルシェケ ル	274,392,934	-	275,695,220	1,302,286
オフショア人民元	9,031,229,481	-	8,983,840,731	47,388,750
合計	79,964,270,590	-	79,612,833,734	351,436,856

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	7,187,034,133
コール・ローン	1,458,661,926
株式	828,956,056,527
投資信託受益証券	117,985,559
投資証券	14,631,966,292
派生商品評価勘定	38,584,312
未収配当金	477,401,026
未収利息	8,630
前払金	300,193,649
差入委託証拠金	8,602,889,717
流動資産合計	861,770,781,771
資産合計	861,770,781,771
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	334,787,951
未払解約金	3,629,760,841
流動負債合計	3,964,548,792
負債合計	3,964,548,792

	2025年 1月10日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	117,052,828,079
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	740,753,404,900
元本等合計	857,806,232,979
純資産合計	857,806,232,979
負債純資産合計	861,770,781,771

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、気配相場又は取得価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 投資証券 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>

2025年 1月10日現在	
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(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。

（貸借対照表に関する注記）

2025年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	117,052,828,079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 7.3284円 (1万口当たり純資産額) (73,284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

2025年 1月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	114,681,464,817円
期中追加設定元本額	8,224,961,550円
期中一部解約元本額	5,853,598,288円
期末元本額	117,052,828,079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）	1,278,242,031円
S B I 資産設計オープン（分配型）	4,756,624円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	33,821,200,375円
世界経済インデックスファンド	15,150,139,858円
外国株式インデックス・オープン	851,684,069円
D C マイセクション 2 5	506,850,676円
D C マイセクション 5 0	2,848,549,657円
D C マイセクション 7 5	3,797,178,982円
D C 外国株式インデックス・オープン	13,660,861,800円
D C マイセクション S 2 5	385,683,721円
D C マイセクション S 5 0	1,983,899,479円
D C マイセクション S 7 5	2,276,076,608円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	7,833,629円

区分	2025年 1月10日現在
DCターゲット・イヤール ファンド2035	117,016,713円
DCターゲット・イヤール ファンド2045	97,346,709円
DC世界経済インデックスファンド	8,703,258,204円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	704,210,058円
マイセレクト50VA1(適格機関投資家専用)	1,640,801円
マイセレクト75VA1(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VA1(適格機関投資家専用)	12,035,292円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	4,109,853円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	16,984,247円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	4,961,144円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	15,525,967円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	80,115,603円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	95,886,861円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	745,055,172円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	49,360,042円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	9,649,551円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	81,609,593円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	25,985,019円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	625,276,823円
FOFs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	620,173,894円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,144,201,994円
コア投資戦略ファンド(安定型)	116,406,331円
コア投資戦略ファンド(成長型)	290,563,733円
分散投資コア戦略ファンドA	1,235,176,939円
分散投資コア戦略ファンドS	5,936,472,873円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,561,778,332円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	938,725,779円
コア投資戦略ファンド(切替型)	121,651,695円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	396,952,088円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	20,228,803円
SMT インデックスバランス・オープン	91,645,373円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	67,093,403円
外国株式SMTBセレクト(SMA専用)	5,933,174,506円
SMT 世界経済インデックス・オープン	263,757,131円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	1,324,350,616円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	218,284,613円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,540,802円
My SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	3,356,899,329円
グローバル経済コア	720,984,936円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	14,865,168円
DCターゲット・イヤール ファンド2055	6,564,360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・イヤールファンド(6資産・運用継続型)2030	179,833,053円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型)2040	187,164,438円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型)2050	87,672,732円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型)2060	115,468,867円
10資産分散投資ファンド	57,360,193円
グローバル10資産バランスファンド	21,302,642円
DC世界経済インデックスファンド(株式特化型)	13,638,983円
DCターゲット・イヤールファンド(ライフステージ対応型)2035	2,364,448円
DCターゲット・イヤールファンド(ライフステージ対応型)2040	1,475,258円
DCターゲット・イヤールファンド(ライフステージ対応型)2045	2,639,038円
DCターゲット・イヤールファンド(ライフステージ対応型)2050	888,917円
DCターゲット・イヤールファンド(ライフステージ対応型)2055	424,150円
DCターゲット・イヤールファンド(ライフステージ対応型)2060	125,337円
DCターゲット・イヤールファンド(ライフステージ対応型)2065	76,809円
DCマイセレクト50(2024-2026リスク抑制型)	75,888,211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)	67,602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)	50,351,774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)	378,935,316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)	700,812,150円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,463,470,869円

区分	2025年 1月10日現在
F O F s用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	101,777,684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）	75,767,435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）	92,789,485円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	15,353円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	12,624円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	15,358円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	15,353円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	12,956円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	13,989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）	91,081,058円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2025年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	14,222,103,858	-	13,921,910,209	300,193,649
合計		14,222,103,858	-	13,921,910,209	300,193,649

（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はありません。

通貨関連

（2025年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	2,331,405,500	-	2,327,415,490	3,990,010
	アメリカドル	1,682,952,900	-	1,680,651,170	2,301,730
	カナダドル	110,108,000	-	109,813,900	294,100
	ユーロ	163,198,000	-	162,797,100	400,900
	イギリスポンド	58,674,600	-	58,343,820	330,780
	スイスフラン	121,685,900	-	121,354,450	331,450
	ノルウェークローネ	48,485,500	-	48,557,250	71,750
	デンマーククローネ	48,120,600	-	48,011,700	108,900
	オーストラリアドル	98,180,000	-	97,886,100	293,900
合計		2,331,405,500	-	2,327,415,490	3,990,010

(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取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取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取相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国株式最小分散インデックスマザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	418,301,141
コール・ローン	3,886,622
株式	17,883,701,530
投資信託受益証券	25,593,640
投資証券	272,529,664
未収配当金	12,492,156
未収利息	22
前払金	7,725,142
差入委託証拠金	81,332,736
流動資産合計	18,705,562,653
資産合計	18,705,562,653
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,725,142
流動負債合計	7,725,142
負債合計	7,725,142
純資産の部	
元本等	
元本	7,688,592,873
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	11,009,244,638
元本等合計	18,697,837,511
純資産合計	18,697,837,511
負債純資産合計	18,705,562,653

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2025年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等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</p>

	2025年 1月10日現在
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(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> <p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買取場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買取場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2025年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	7,688,592,873口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.4319円 (24,319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

	2025年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p>

2025年 1月10日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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	2025年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	8,531,672,487円
期中追加設定元本額	459,502,113円
期中一部解約元本額	1,302,581,727円
期末元本額	7,688,592,873円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	1,038,987,477円
分散投資コア戦略ファンドS	4,861,686,579円
マルチ・ストラテジー・ファンド（適格機関投資家専用）	1,787,918,817円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2025年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	342,690,280	-	334,965,138	7,725,142
	合計	342,690,280	-	334,965,138	7,725,142

(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。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

2025年 1月10日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,220,442,617
コール・ローン	2,462,182,866
国債証券	376,477,004,411
派生商品評価勘定	70,213
未収入金	99,130,533

	2025年 1月10日現在
項目	金額（円）
未収利息	3,104,144,251
前払金	32,319,507
前払費用	322,363,676
差入委託証拠金	184,293,968
流動資産合計	385,901,952,042
資産合計	385,901,952,042
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,571,598
未払金	2,790,656,476
未払解約金	168,147,446
流動負債合計	2,991,375,520
負債合計	2,991,375,520
純資産の部	
元本等	
元本	104,153,936,846
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	278,756,639,676
元本等合計	382,910,576,522
純資産合計	382,910,576,522
負債純資産合計	385,901,952,042

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2025年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	104,153,936,846口

		2025年 1月10日現在
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,6764円 (36,764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

		2025年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	97,281,872,398円
期中追加設定元本額	10,764,054,113円
期中一部解約元本額	3,891,989,665円
期末元本額	104,153,936,846円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,052,825,524円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	447,299,418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）	2,331,275,207円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,554,580円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,199,884,871円
世界経済インデックスファンド	26,707,665,381円
DCマイセレクション25	1,784,233,131円
DCマイセレクション50	1,706,104,252円
DCマイセレクション75	1,368,446,033円
DC外国債券インデックス・オープン	2,221,777,410円
DCマイセレクションS25	1,386,109,960円
DCマイセレクションS50	1,181,658,242円
DCマイセレクションS75	823,818,827円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	7,132,532円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	101,628,674円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	57,282,497円
DC世界経済インデックスファンド	16,331,247,684円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	769,340,616円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	1,031,158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）	6,774,706円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	18,953,550円

区分	2025年 1月10日現在
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	33,544,312円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	47,508,372円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	49,564,214円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	504,202,845円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	333,896,416円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	1,414,468,505円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	49,073,677円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	22,386,056円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	302,544,260円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	108,962,635円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	150,649,836円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	598,380,318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）	1,098,758,120円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	601,330,401円
外国債券ファンド・シリーズ1	757,030,561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	1,690,937,945円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	877,773,117円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,660,843,986円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	225,207,188円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	103,703,367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）	1,244,836,476円
SMT インデックスバランス・オープン	158,219,931円
SMT 世界経済インデックス・オープン	521,049,511円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	749,642,337円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,103,163,363円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,926,300円
グローバル経済コア	1,317,623,960円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	25,954,969円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,924,595円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	70,567,721円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	114,091,416円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	60,972,470円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	88,165,801円
My SMT グローバル債券インデックス（ノーロード）	1,038,481,158円
10資産分散投資ファンド	35,937,788円
グローバル10資産バランスファンド	37,010,350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	2,720,034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	1,554,453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	2,617,222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	876,331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	442,141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	196,310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	148,572円
DCマイセレクションS50（2024-2026リスク抑制型）	895,878,866円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	14,563,477,370円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	229,900,418円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	434,727,587円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	142,602,782円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	17,037円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	22,489円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	17,037円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	30,666円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	3,408円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	11,585円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2025年 1月10日現在)

--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引 買建	1,987,871,367	-	1,955,551,860	32,319,507
	合計	1,987,871,367	-	1,955,551,860	32,319,507

(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

(2025年 1月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	2,365,217,856	-	2,365,035,978	181,878
	アメリカドル	1,175,120,088	-	1,175,141,722	21,634
	カナダドル	87,626,720	-	87,628,560	1,840
	ユーロ	683,661,900	-	683,674,109	12,209
	イギリスポンド	127,841,208	-	127,844,838	3,630
	オフショア人民元	290,967,940	-	290,746,749	221,191
	合計	2,365,217,856	-	2,365,035,978	181,878

(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

	2025年 1月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	6,098,501,619
コール・ローン	116,109,299
株式	220,913,388,843
投資信託受益証券	422,711,871
投資証券	191,071,003
派生商品評価勘定	1,004,856
未収配当金	393,903,225
未収利息	686
前払金	254,755,218
差入委託証拠金	1,483,510,063
流動資産合計	229,874,956,683

	2025年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産合計	229,874,956,683
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	254,755,218
未払金	33,235
未払解約金	809,858,011
流動負債合計	1,064,646,464
負債合計	1,064,646,464
純資産の部	
元本等	
元本	48,590,594,817
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	180,219,715,402
元本等合計	228,810,310,219
純資産合計	228,810,310,219
負債純資産合計	229,874,956,683

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 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	(1) 受取配当金

2025年 1月10日現在	
	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。
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(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。

(貸借対照表に関する注記)

2025年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	48,590,594,817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) 4.7089円 (47,089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

2025年 1月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2025年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	45,973,691,996円
期中追加設定元本額	4,050,490,629円
期中一部解約元本額	1,433,587,808円
期末元本額	48,590,594,817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	6,810,856,559円
世界経済インデックスファンド	14,019,587,009円
DC 新興国株式インデックス・オープン	6,430,819,992円
DC 世界経済インデックスファンド	7,923,132,197円
新興国株式インデックス・オープン (SMA専用)	85,076,803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

区分	2025年 1月10日現在
分散投資コア戦略ファンドS	1,285,647,921円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	1,455,347,475円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	828,404,994円
コア投資戦略ファンド（切替型）	62,863,771円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	370,297,486円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,370,709円
SMT インデックスバランス・オープン	85,237,844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）	2,900,869,951円
SMT 世界経済インデックス・オープン	301,144,333円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	1,511,736,074円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	241,284,753円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,202,444円
グローバル経済コア	667,153,810円
My SMT 新興国株式インデックス（ノーロード）	646,837,383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	131,096,730円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	136,325,237円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	63,939,534円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	84,220,119円
10資産分散投資ファンド	18,023,778円
グローバル10資産バランスファンド	30,675,745円
DC世界経済インデックスファンド（株式特化型）	13,210,564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）	12,025円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,625,763,807円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	115,390,901円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	82,626,092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）	15,638,979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）	22,064,175円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	13,176円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	13,176円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	13,176円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	18,514円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	13,176円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	19,500円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2025年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	7,503,840,121	-	7,249,084,903	254,755,218
合計		7,503,840,121	-	7,249,084,903	254,755,218

（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

（2025年 1月10日現在）

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

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	707,735,100	-	706,730,244	1,004,856
	アメリカドル	707,735,100	-	706,730,244	1,004,856
合計		707,735,100	-	706,730,244	1,004,856

(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

項目	2025年 1月10日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	3,676,202,914
コール・ローン	1,436,246,879
国債証券	156,623,976,425
派生商品評価勘定	24,058
未収入金	1,042,430,290
未収利息	2,166,506,871
前払費用	226,504,370
流動資産合計	165,171,891,807
資産合計	165,171,891,807
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,721,758
未払金	4,430,729,418
未払解約金	47,402,251
流動負債合計	4,486,853,427
負債合計	4,486,853,427
純資産の部	
元本等	
元本	68,026,799,765
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	92,658,238,615
元本等合計	160,685,038,380
純資産合計	160,685,038,380
負債純資産合計	165,171,891,807

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2025年 1月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p>

	2025年 1月10日現在
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2025年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	68,026,799,765口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.3621円 (23,621円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2025年 1月10日現在
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	2025年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	64,719,230,900円
期中追加設定元本額	5,581,446,982円
期中一部解約元本額	2,273,878,117円
期末元本額	68,026,799,765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	3,522,160,603円
世界経済インデックスファンド	27,253,221,414円
DC新興国債券インデックス・オープン	6,046,336,709円
DC世界経済インデックスファンド	16,281,444,206円

区分	2025年 1月10日現在
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	3,601,740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	1,334,062,306円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	899,130,474円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	4,806,422,655円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	234,036,182円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	107,450,875円
SMT インデックスバランス・オープン	164,532,029円
SMT 世界経済インデックス・オープン	619,052,435円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	885,359,165円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	1,302,490,173円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	15,785,885円
グローバル経済コア	1,305,877,409円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	141,569,788円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	129,377,994円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	57,558,518円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	72,468,725円
My SMT 新興国債券インデックス（ノーロード）	383,333,382円
10資産分散投資ファンド	57,942,021円
グローバル10資産バランスファンド	57,733,302円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	268,712,091円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	169,412,535円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	26,683円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	26,683円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	26,683円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	26,683円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	26,683円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	22,633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）	140,614,168円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2025年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,634,452,564	-	1,625,795,528	8,657,036
	メキシコペソ	509,104,400	-	505,717,801	3,386,599
	トルコリラ	10,429,757	-	10,324,199	105,558
	チェココルナ	366,059,568	-	364,951,132	1,108,436
	ハンガリーフォリント	115,439,464	-	115,067,229	372,235
	ポーランドズロチ	50,566,600	-	50,471,505	95,095
	マレーシアリングット	70,544,166	-	70,445,676	98,490
	タイバーツ	67,087,860	-	67,011,420	76,440
	南アフリカランド	374,247,729	-	370,887,499	3,360,230
	オフショア人民元	70,973,020	-	70,919,067	53,953
	売建	307,109,410	-	307,150,074	40,664
	ルーマニアレイ	4,604,410	-	4,580,352	24,058

	オフショア人民元	302,505,000	-	302,569,722	64,722
	合計	1,941,561,974	-	1,932,945,602	8,697,700

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

J - R E I Tインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,949,388,042
投資証券	92,156,169,700
派生商品評価勘定	37,576,080
未収入金	21,285,430
未収配当金	1,108,857,679
未収利息	17,450
差入委託証拠金	173,569,893
流動資産合計	96,446,864,274
資産合計	96,446,864,274
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,032,640
前受金	34,968,040
未払金	200,486,959
未払解約金	842,199,025
流動負債合計	1,080,686,664
負債合計	1,080,686,664
純資産の部	
元本等	
元本	47,571,412,508
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	47,794,765,102
元本等合計	95,366,177,610
純資産合計	95,366,177,610
負債純資産合計	96,446,864,274

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2025年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>先物取引</p>

2025年 1月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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)

2025年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	47,571,412,508口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.0047円 (20,047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

2025年 1月10日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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	2025年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	60,803,527,157円
期中追加設定元本額	5,692,632,666円
期中一部解約元本額	18,924,747,315円
期末元本額	47,571,412,508円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,804,167,082円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,616,574円
SMT J-REITインデックス・オープン	15,425,649,908円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	20,646,921,855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

区分	2025年 1月10日現在
分散投資コア戦略ファンドA	1,066,487,955円
分散投資コア戦略ファンドS	2,272,764,047円
コア投資戦略ファンド(切替型)	451,578,256円
SMT インデックスバランス・オープン	21,051,315円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	137,260,651円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	16,967,004円
グローバル経済コア	591,118,841円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	20,666,807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
My SMT J-REITインデックス(ノーロード)	1,278,590,555円
10資産分散投資ファンド	33,342,169円
グローバル10資産バランスファンド	62,970,856円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	210,855,786円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	12,345,283円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	934,732,383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)	66,502,345円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1(適格機関投資家専用)	31,755円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2(適格機関投資家専用)	31,755円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3(適格機関投資家専用)	30,959円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4(適格機関投資家専用)	31,055円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5(適格機関投資家専用)	36,836円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6(適格機関投資家専用)	30,953円
J-REIT パッシブ・ファンド 2018-05(適格機関投資家専用)	486,413,144円

(デリバティブ取引に関する注記)

投資証券関連

(2025年 1月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	3,109,966,960	-	3,144,935,000	34,968,040
	合計	3,109,966,960	-	3,144,935,000	34,968,040

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

貸借対照表

	2025年 1月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	628,733,528
コール・ローン	50,048,551
投資証券	134,565,140,567
未収入金	772,105
未収配当金	523,129,867
未収利息	296
流動資産合計	135,767,824,914

	2025年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産合計	135,767,824,914
負債の部	
流動負債	
未払金	73,743,474
未払解約金	42,965,139
流動負債合計	116,708,613
負債合計	116,708,613
純資産の部	
元本等	
元本	42,551,584,116
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	93,099,532,185
元本等合計	135,651,116,301
純資産合計	135,651,116,301
負債純資産合計	135,767,824,914

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
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）

	2025年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	42,551,584,116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 3.1879円 (1万口当たり純資産額) (31,879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

	2025年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

2025年 1月10日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（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	2025年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	40,061,173,784円
期中追加設定元本額	5,406,794,550円
期中一部解約元本額	2,916,384,218円
期末元本額	42,551,584,116円
期末元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	43,953,883円
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	67,756,498円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,492,102,542円
SBI資産設計オープン（分配型）	5,430,045円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	10,840,815,902円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	19,617,279,037円
コア投資戦略ファンド（安定型）	368,682,503円
コア投資戦略ファンド（成長型）	1,066,751,707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）	463,512,286円
SMT インデックスバランス・オープン	100,415,168円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	137,790,983円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,872,713円
グローバル経済コア	398,306,098円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	16,890,314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）	102,265,939円
My SMT グローバルREITインデックス（ノーロード）	394,319,087円
10資産分散投資ファンド	17,673,805円
グローバル10資産バランスファンド	45,231,265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）	1,378,499,772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）	176,668,607円
FOfs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	96,864,013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）	50,883,862円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	20,773円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	19,234円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	19,234円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	26,928円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	28,466円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	25,851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）	49,725,174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。

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

	2025年 1月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	119,185,303
投資信託受益証券	40,338,496,671
未収入金	1,981,855
未収利息	705
流動資産合計	40,459,664,534
資産合計	40,459,664,534
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	62,943,503
未払解約金	1,018,590
流動負債合計	63,962,093
負債合計	63,962,093
純資産の部	
元本等	
元本	25,807,847,692
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,587,854,749
元本等合計	40,395,702,441
純資産合計	40,395,702,441
負債純資産合計	40,459,664,534

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2025年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		25,807,847,692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)	1.5652円 (15,652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

		2025年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額		貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法		(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明		金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	21,536,876,050円
期中追加設定元本額	5,558,916,424円
期中一部解約元本額	1,287,944,782円
期末元本額	25,807,847,692円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,296,873,791円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,236,379,575円
分散投資コア戦略ファンドA	2,323,923,430円
分散投資コア戦略ファンドS	10,249,548,744円
コア投資戦略ファンド（切替型）	947,389,909円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	239,519,110円
グローバル経済コア	3,252,266,886円
SMT ゴールドインデックス・オープン（為替ヘッジあり）	3,342,346,172円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	639,091,028円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	174,950,264円
グローバル10資産バランスファンド	96,494,280円
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	328,250,401円
SMTAM9資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	604,911,264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）	75,560,320円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN1（適格機関投資家専用）	52,750円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN2（適格機関投資家専用）	65,538円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN3（適格機関投資家専用）	59,144円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN4（適格機関投資家専用）	40,404円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN5（適格機関投資家専用）	59,144円
グローバル10資産バランス・アクティブ型ファンドN6（適格機関投資家専用）	65,538円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2025年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	39,756,409,089	-	39,819,352,592	62,943,503
	アメリカドル	39,756,409,089	-	39,819,352,592	62,943,503
合計		39,756,409,089	-	39,819,352,592	62,943,503

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

HFリターン・ターゲット・マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

項目	2025年 1月10日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	5,907,181
コール・ローン	811,050,360
国債証券	1,196,478,000
投資信託受益証券	445,715,216
派生商品評価勘定	2,465,870
未収利息	4,798
前払金	20,327,205
差入委託証拠金	725,728,188
流動資産合計	3,207,676,818
資産合計	3,207,676,818
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,812,536
未払金	45,523,463
流動負債合計	68,335,999
負債合計	68,335,999
純資産の部	
元本等	
元本	3,443,283,782
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	303,942,963
元本等合計	3,139,340,819
純資産合計	3,139,340,819
負債純資産合計	3,207,676,818

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2025年 1月10日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 国債証券

2025年 1月10日現在	
	<p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引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</p> <p>株価指数先物取引及び債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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）

2025年 1月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,443,283,782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 303,942,963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 0.9117円 (1万口当たり純資産額) (9,117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

2025年 1月10日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>売買目的有価証券</p> <p>「(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</p> <p>「(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>

2025年 1月10日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2025年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	7,238,144,458円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	3,794,860,676円
期末元本額	3,443,283,782円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	1,106,269,888円
分散投資コア戦略ファンドS	2,337,013,894円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2025年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,035,969,313	-	1,014,234,863	21,734,450
	売建	20,254,817	-	20,643,165	388,348
合計		1,056,224,130	-	1,034,878,028	22,122,798

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

債券関連

（2025年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	売建	87,385,802	-	85,590,209	1,795,593
合計		87,385,802	-	85,590,209	1,795,593

(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

(2025年 1月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,082,777,832	-	1,082,797,293	19,461
	アメリカドル	312,525,235	-	312,530,988	5,753
	カナダドル	54,547,633	-	54,548,778	1,145
	ユーロ	426,436,140	-	426,443,755	7,615
	イギリスポンド	143,530,810	-	143,534,886	4,076
	スイスフラン	120,797,348	-	120,801,042	3,694
	スウェーデンクローナ	24,940,666	-	24,937,844	2,822
合計	1,082,777,832	-	1,082,797,293	19,461	

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)

貸借対照表

	2025年 1月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,599,053,995
国債証券	11,690,635,800
派生商品評価勘定	146,701,629
未収入金	274,433,579
未収利息	50,878
差入委託証拠金	1,996,609,375
流動資産合計	22,707,485,256
資産合計	22,707,485,256
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	92,898,874
前受金	52,976,277
未払金	196,838,176
流動負債合計	342,713,327
負債合計	342,713,327
純資産の部	
元本等	
元本	20,144,737,906
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,220,034,023

	2025年 1月10日現在
項目	金額（円）
元本等合計	22,364,771,929
純資産合計	22,364,771,929
負債純資産合計	22,707,485,256

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2025年 1月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日まで個別法)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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段(外貨建先物取引は、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場)によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 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）

	2025年 1月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	20,144,737,906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 1.1102円 (1万口当たり純資産額) (11,102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

	2025年 1月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p>

2025年 1月10日現在	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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	2025年 1月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 7月11日
期首元本額	17,508,251,506円
期中追加設定元本額	7,772,164,894円
期中一部解約元本額	5,135,678,494円
期末元本額	20,144,737,906円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド（安定型）	557,838,252円
コア投資戦略ファンド（成長型）	643,408,736円
分散投資コア戦略ファンドA	2,532,180,367円
分散投資コア戦略ファンドS	6,559,273,906円
コア投資戦略ファンド（切替型）	273,176,119円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	235,793,481円
ヘッジファンドSMTBセレクション（SMA専用）	8,783,722,397円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	122,012,406円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	32,173,083円
SMTAM・FOFs用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド（4%目標コース）（適格機関投資家専用）	173,639,866円
FOFs用GBCAファンドS（ミドルリスク型）（適格機関投資家専用）	231,519,293円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（2025年 1月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	6,118,770,463	-	6,050,435,913	68,334,550
	売建	15,315,746,683	-	15,194,435,856	121,310,827
合計		21,434,517,146	-	21,244,871,769	52,976,277

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

（2025年 1月10日現在）

--	--	--	--

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	11,963,873,127	-	11,964,545,050	671,923
	アメリカドル	5,349,159,242	-	5,349,257,720	98,478
	イギリスポンド	1,043,842,833	-	1,043,872,472	29,639
	ノルウェークローネ	1,955,668,200	-	1,956,078,579	410,379
	オーストラリアドル	3,615,202,852	-	3,615,336,279	133,427
	売建	12,345,404,792	-	12,345,219,547	185,245
	カナダドル	2,370,521,842	-	2,370,571,619	49,777
	ユーロ	314,874,210	-	314,879,833	5,623
	スイスフラン	4,390,125,742	-	4,390,259,996	134,254
	スウェーデンクローナ	3,705,102,889	-	3,704,683,603	419,286
	ニュージーランドドル	1,564,780,109	-	1,564,824,496	44,387
合計	24,309,277,919	-	24,309,764,597	857,168	

(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】

2025年 1月31日現在の資本金の額	20億円
発行可能株式総数	12,000株
発行済株式総数	3,000株

(2)【事業の内容及び営業の状況】

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

2025年1月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	527	15,887,722
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	56	202,010
単位型公社債投資信託	52	168,562
合計	635	16,258,294

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

5【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「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	百万円
器具備品	681	"	823	"
計	866	"	1,044	"

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

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

2024年6月20日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	利益剰余金	981,032	2024年3月31日	2024年6月21日

(リ・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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

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3月24日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 百瀬和政

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドAの2024年7月11日から2025年1月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、分散投資コア戦略ファンドAの2025年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年7月11日から2025年1月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2025年3月24日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 百瀬和政

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている分散投資コア戦略ファンドSの2024年7月11日から2025年1月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、分散投資コア戦略ファンドSの2025年1月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年7月11日から2025年1月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。