

【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5月20日提出
【計算期間】	第2期中(自 2024年8月21日至 2025年2月20日)
【ファンド名】	グローバル10資産バランスファンド
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菊田 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3月31日現在の状況について記載しております。

【グローバル10資産バランスファンド】

(1) 【投資状況】

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	2,428,354,163	99.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		23,136,865	0.94
合計(純資産総額)		2,451,491,028	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)
第1期計算期間末 (2024年 8月20日)	1,915,886,104	1,915,886,104	10,685
2024年 3月末日	1,231,182,799		10,640
4月末日	1,348,554,995		10,656
5月末日	1,515,849,608		10,602
6月末日	1,742,938,869		10,754
7月末日	1,827,685,676		10,650
8月末日	1,969,666,061		10,678
9月末日	2,058,270,579		10,779
10月末日	2,135,517,400		10,922
11月末日	2,186,100,061		10,763
12月末日	2,271,655,273		10,844
2025年 1月末日	2,336,438,353		10,841
2月末日	2,427,859,429		10,726
3月末日	2,451,491,028		10,691

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2023年 9月29日 ~ 2024年 8月20日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（%）
第1期計算期間	2023年 9月29日 ~ 2024年 8月20日	6.9
第2期中間計算期間	2024年 8月21日 ~ 2025年 2月20日	1.0

(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	684,712,360,205	97.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		15,700,844,828	2.24
合計(純資産総額)		700,413,205,033	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	14,907,200,000	2.13

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

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

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	598,825,690,760	84.76
地方債証券	日本	35,397,459,061	5.01
特殊債券	日本	37,567,218,405	5.32
	国際機関	297,129,000	0.04
	小計	37,864,347,405	5.36
社債券	日本	31,085,633,000	4.40
	フランス	1,681,990,000	0.24
	オーストラリア	396,796,000	0.06
	韓国	99,520,000	0.01
	小計	33,263,939,000	4.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,134,218,034	0.16
合計(純資産総額)		706,485,654,260	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	554,473,088,045	70.72
	イギリス	30,579,288,500	3.90

カナダ	25,936,568,940	3.31
スイス	23,106,409,538	2.95
フランス	21,942,329,339	2.80
ドイツ	20,750,485,840	2.65
アイルランド	14,109,688,472	1.80
オランダ	12,885,401,501	1.64
オーストラリア	12,639,581,096	1.61
スウェーデン	6,733,757,039	0.86
スペイン	6,255,799,243	0.80
イタリア	5,285,571,058	0.67
デンマーク	4,975,512,900	0.63
香港	3,018,355,053	0.39
シンガポール	2,657,766,583	0.34
フィンランド	2,096,258,982	0.27
イスラエル	1,911,771,818	0.24
ベルギー	1,597,860,200	0.20
ルクセンブルク	1,417,535,453	0.18
ノルウェー	1,328,734,922	0.17
ケイマン	1,273,577,581	0.16
ジャージー	928,168,507	0.12
バミューダ	879,285,813	0.11
キュラソー	691,451,257	0.09
リベリア	637,445,333	0.08
ニュージーランド	560,487,084	0.07
オーストリア	435,169,282	0.06
ポルトガル	295,118,080	0.04
パナマ	258,051,852	0.03
マン島	58,908,511	0.01
小計	759,719,427,822	96.90
新株予約権証券	カナダ	-
投資信託受益証券	香港	62,359,290
	オーストラリア	62,301,019
	小計	124,660,309
投資証券	アメリカ	12,671,225,348
	オーストラリア	777,769,179
	フランス	305,261,982
	シンガポール	211,420,633
	イギリス	194,678,996
	香港	167,192,858
	小計	14,327,548,996
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,815,276,816
合計(純資産総額)		783,986,913,943
		100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,482,683,544	0.95
	買建	カナダ	217,370,244	0.03
	買建	ドイツ	1,221,993,755	0.16
	買建	イギリス	520,689,677	0.07
	買建	オーストラリア	263,773,790	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		332,171,630	0.04
	売建		13,605,504,655	1.74

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	178,910,427,634	46.32
	中国	42,272,777,921	10.94
	フランス	27,287,180,367	7.06
	イタリア	25,666,484,924	6.65
	ドイツ	21,470,986,602	5.56
	イギリス	19,975,255,321	5.17
	スペイン	16,465,615,912	4.26
	カナダ	7,454,243,263	1.93
	ベルギー	5,855,942,036	1.52
	オランダ	4,761,316,305	1.23
	オーストラリア	4,661,331,660	1.21
	オーストリア	4,225,721,550	1.09
	メキシコ	3,002,672,563	0.78
	ポーランド	2,256,374,233	0.58
	ポルトガル	2,233,610,904	0.58
	マレーシア	1,915,041,381	0.50
	フィンランド	1,903,382,036	0.49
	アイルランド	1,775,419,584	0.46

シンガポール	1,483,895,999	0.38
イスラエル	1,185,362,441	0.31
ニュージーランド	1,061,560,922	0.27
デンマーク	838,978,586	0.22
スウェーデン	674,815,900	0.17
ノルウェー	557,385,248	0.14
小計	377,895,783,292	97.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	8,346,891,381	2.16
合計(純資産総額)	386,242,674,673	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	1,686,370,685	0.44
	買建	ドイツ	1,432,002,732	0.37

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		3,905,327,690	1.01
	売建		2,661,178	0.00

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

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

外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	37,877,285,661	47.42
	中国	8,953,870,874	11.21
	フランス	5,775,779,366	7.23
	イタリア	5,433,195,525	6.80
	ドイツ	4,521,768,049	5.66
	イギリス	4,212,369,584	5.27
	スペイン	3,484,035,650	4.36
	カナダ	1,577,988,181	1.98
	ベルギー	1,240,986,857	1.55
	オランダ	1,008,937,594	1.26
	オーストラリア	987,136,986	1.24
	オーストリア	893,605,645	1.12

メキシコ	636,503,550	0.80
ポーランド	476,535,319	0.60
ポルトガル	472,488,557	0.59
フィンランド	403,422,751	0.51
マレーシア	393,012,009	0.49
アイルランド	374,376,532	0.47
シンガポール	307,723,801	0.39
イスラエル	260,854,037	0.33
ニュージーランド	232,194,868	0.29
デンマーク	179,460,394	0.22
スウェーデン	148,390,123	0.19
ノルウェー	123,008,388	0.15
小計	79,974,930,301	100.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		102,131,350
合計(純資産総額)	79,872,798,951	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建／売建	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	283,908,112	0.36
	買建	ドイツ	234,601,075	0.29

(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		81,602,281,961	102.17

(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	ケイマン	44,023,194,847	18.89
	インド	41,252,255,042	17.70
	台湾	38,374,901,391	16.47
	中国	25,092,058,368	10.77
	韓国	20,641,155,574	8.86
	サウジアラビア	8,994,264,551	3.86
	ブラジル	8,486,020,943	3.64

南アフリカ	6,330,113,664	2.72	
メキシコ	3,851,506,361	1.65	
アラブ首長国連邦	3,123,759,541	1.34	
マレーシア	3,001,271,774	1.29	
インドネシア	2,806,104,012	1.20	
タイ	2,624,281,009	1.13	
ポーランド	2,153,948,720	0.92	
香港	2,021,253,639	0.87	
クウェート	1,810,234,745	0.78	
カタール	1,731,195,062	0.74	
ギリシャ	1,304,727,834	0.56	
トルコ	1,267,234,882	0.54	
フィリピン	1,057,835,226	0.45	
チリ	1,047,839,192	0.45	
バミューダ	926,046,214	0.40	
アメリカ	743,642,747	0.32	
ハンガリー	654,533,228	0.28	
イギリス	540,286,823	0.23	
ルクセンブルク	403,077,326	0.17	
チェコ	377,533,858	0.16	
コロンビア	268,737,447	0.12	
エジプト	111,950,762	0.05	
ペルー	85,532,273	0.04	
シンガポール	81,654,248	0.04	
ロシア	-	-	
英ヴァージン諸島	-	-	
小計	225,188,151,303	96.63	
投資信託受益証券	ブラジル	325,894,950	0.14
	メキシコ	134,680,014	0.06
	小計	460,574,964	0.20
投資証券	メキシコ	213,144,689	0.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,181,050,577	3.08
合計(純資産総額)		233,042,921,533	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,178,319,136	3.08

(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		131,906,867	0.06
	売建		1,843,225	0.00

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

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

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	マレーシア	15,751,380,885	9.70
	中国	15,570,506,715	9.58
	メキシコ	15,552,840,660	9.57
	インドネシア	15,498,139,147	9.54
	インド	14,589,116,273	8.98
	タイ	14,061,986,024	8.66
	南アフリカ	11,805,205,837	7.27
	ポーランド	11,372,284,662	7.00
	ブラジル	10,499,202,370	6.46
	チェコ	7,988,186,836	4.92
	コロンビア	5,904,395,429	3.63
	ルーマニア	5,354,924,833	3.30
	ハンガリー	3,697,074,103	2.28
	ペルー	3,058,998,401	1.88
	チリ	2,908,114,023	1.79
	トルコ	2,092,113,413	1.29
	ドミニカ共和国	467,361,784	0.29
	ウルグアイ	286,466,770	0.18
小計		156,458,298,165	96.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,988,402,320	3.69
合計(純資産総額)		162,446,700,485	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		2,225,563,344	1.37

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

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

J - R E I T インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	96,616,924,650	97.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,956,020,701	2.97
合計(純資産総額)		99,572,945,351	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	2,942,758,000	2.96

(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R E I T インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	106,051,873,926	79.17
	オーストラリア	9,144,259,143	6.83
	イギリス	5,617,181,196	4.19
	シンガポール	4,146,447,804	3.10
	フランス	2,531,237,094	1.89
	カナダ	1,658,381,662	1.24
	ベルギー	1,296,200,919	0.97
	香港	1,202,777,113	0.90
	スペイン	579,948,197	0.43
	韓国	221,236,714	0.17
	ガーンジー	204,752,778	0.15
	オランダ	204,186,121	0.15
	イスラエル	166,746,189	0.12
	ニュージーランド	95,103,744	0.07
	アイルランド	55,277,726	0.04
	ドイツ	51,696,110	0.04
	イタリア	15,608,547	0.01
小計		133,242,914,983	99.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		703,386,900	0.53
合計(純資産総額)		133,946,301,883	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建		77,689,078	0.06

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

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

ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	アメリカ	47,569,139,739	99.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		254,834,186	0.53
合計(純資産総額)		47,823,973,925	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		47,406,027,154	99.13

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

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

2 【設定及び解約の実績】

【グローバル10資産バランスファンド】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間	2023年 9月29日～2024年 8月20日	1,846,968,794	53,857,986	1,793,110,808
第2期中間計算期間	2024年 8月21日～2025年 2月20日	511,498,604	57,505,085	2,247,104,327

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

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

3 【ファンドの経理状況】

- (1)当ファンドの中間財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」並びに同規則第284条及び第307条の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期中間計算期間(2024年8月21日から2025年2月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【グローバル10資産バランスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2024年 8月20日現在)	第2期中間計算期間 (2025年 2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	21,072,789	26,067,961
親投資信託受益証券	1,897,089,073	2,400,439,986
未収入金	1,882,298	6,099,997
未収利息	125	332
流動資産合計	1,920,044,285	2,432,608,276
資産合計	1,920,044,285	2,432,608,276
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	519,717
未払受託者報酬	274,925	481,512
未払委託者報酬	3,848,940	6,739,794
その他未払費用	34,316	60,116
流動負債合計	4,158,181	7,801,139
負債合計	4,158,181	7,801,139
純資産の部		
元本等		
元本	1,793,110,808	2,247,104,327
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	122,775,296	177,702,810
(分配準備積立金)	39,047,346	37,959,147
元本等合計	1,915,886,104	2,424,807,137
純資産合計	1,915,886,104	2,424,807,137
負債純資産合計	1,920,044,285	2,432,608,276

(2) 【中間損益及び剩余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間 自 2023年 9月29日 至 2024年 3月28日	第2期中間計算期間 自 2024年 8月21日 至 2025年 2月20日
営業収益		
受取利息	166	29,322
有価証券売買等損益	34,647,679	27,078,110
営業収益合計	34,647,845	27,107,432
営業費用		
支払利息	157	-
受託者報酬	87,394	481,512
委託者報酬	1,223,420	6,739,794
その他費用	10,860	60,116
営業費用合計	1,321,831	7,281,422
営業利益又は営業損失()	33,326,014	19,826,010
経常利益又は経常損失()	33,326,014	19,826,010
中間純利益又は中間純損失()	33,326,014	19,826,010
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	94,918	604,360
期首剩余金又は期首次損金()	-	122,775,296
剩余金増加額又は欠損金減少額	38,992,654	39,697,178
中間追加信託に伴う剩余金増加額又は欠損金減少額	38,992,654	39,697,178
剩余金減少額又は欠損金増加額	175,598	3,991,314
中間一部解約に伴う剩余金減少額又は欠損金増加額	175,598	3,991,314
分配金	-	-
中間剩余金又は中間欠損金()	72,048,152	177,702,810

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第1期 (2024年 8月20日現在)	第2期中間計算期間 (2025年 2月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,793,110,808口	2,247,104,327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) 1.0685円 (10,685円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0791円 (10,791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2期中間計算期間 (2025年 2月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(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。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

区分	第1期 自 2023年 9月29日 至 2024年 8月20日	第2期中間計算期間 自 2024年 8月21日 至 2025年 2月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	492,951円	1,793,110,808円
期中追加設定元本額	1,846,475,843円	511,498,604円
期中一部解約元本額	53,857,986円	57,505,085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

項目	2025年 2月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	30,745,808,857
株式	715,572,515,740
派生商品評価勘定	23,342,000
未収入金	2,394,500
未収配当金	1,038,843,600
未収利息	391,752
前払金	10,000
その他未収収益	2,810,151
差入委託証拠金	158,091,566
流動資産合計	747,544,208,166
資産合計	747,544,208,166
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	23,432,850
未払解約金	620,413,573
未払利息	1,287,631
受入担保金	26,734,595,704
流動負債合計	27,379,729,758
負債合計	27,379,729,758
純資産の部	
元本等	
元本	250,452,064,004
剰余金	
剰余金又は欠損金()	469,712,414,404
元本等合計	720,164,478,408
純資産合計	720,164,478,408
負債純資産合計	747,544,208,166

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2025年 2月20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 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	250,452,064,004口
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	

2025年 2月20日現在		
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	株式 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	25,017,406,380円 2.8755円 (28,755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 2月20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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 8月21日
期首元本額	242,335,778,336円
期中追加設定元本額	14,993,571,910円
期中一部解約元本額	6,877,286,242円
期末元本額	250,452,064,004円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム＆プラス(毎月決算型)	255,247,309円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,183,979,340円
SBI資産設計オープン(分配型)	11,719,423円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,199,482,313円
世界経済インデックスファンド	7,115,369,888円
日本株式インデックス・オープン	2,675,668,931円
DCマイセレクション25	4,643,896,618円
DCマイセレクション50	15,965,955,862円
DCマイセレクション75	18,565,607,698円
DC日本株式インデックス・オープン	5,941,795,761円
DCマイセレクションS25	3,648,525,618円
DCマイセレクションS50	11,145,787,573円
DCマイセレクションS75	11,144,266,920円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,602,719,008円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	35,949,260円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	546,709,754円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	456,637,199円
DC世界経済インデックスファンド	3,715,843,642円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	313,350,860円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,588,696円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	7,974,931円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	12,727,486円

区分	2025年2月20日現在
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	87,919,891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)	9,387,882円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	38,127,944円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	11,729,429円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	38,891,806円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	278,260,689円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	269,541,294円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,850,473,249円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	24,909,103円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	7,893,176円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	266,857,402円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	145,563,598円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	198,276,728円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	14,456,604円
F OFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	356,689,258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	2,082,624,804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)	732,713,714円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	427,259,169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)	188,896,525円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,527,461円
SMTインデックスバランス・オープン	45,015,097円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	17,646,327,539円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	183,172,100円
SMT世界経済インデックス・オープン	62,532,326円
SMT世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	296,019,494円
SMT世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	45,445,427円
SMT8資産インデックスバランス・オープン	13,710,614円
グローバル経済コア	321,092,592円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	36,797,884円
MySMTTOPIXインデックス(ノーロード)	3,345,427,528円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	31,677,351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)	135,052,904円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	71,118,106円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	74,532,867円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	35,406,755円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	47,906,981円
10資産分散投資ファンド	114,396,101円
グローバル10資産バランスファンド	55,484,163円
DC世界経済インデックスファンド(株式特化型)	6,616,023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	4,439,538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	2,598,547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	4,797,569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	1,577,803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	888,391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	276,629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	136,709円
DCマイセレクションS50(2024-2026リスク抑制型)	760,194,349円
F OFs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)	44,301,797,022円
F OFs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)	203,882,613円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	308,519,227円
F OFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	21,036,798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)	52,845,911,123円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	16,177,531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)	241,935,276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)	26,259円

区分	2025年 2月20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)	28,505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)	39,235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)	35,570円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2025年 2月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超	-	
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,022,665,000	-	4,022,655,000	10,000
	合計	4,022,665,000	-	4,022,655,000	10,000

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2025年 2月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	456,755,207
国債証券	600,034,159,240
地方債証券	35,432,225,519
特殊債券	38,063,442,135
社債券	33,449,981,000
未収入金	891,597,500
未収利息	1,826,826,515
前払費用	107,498,853
流動資産合計	710,262,485,969
資産合計	710,262,485,969
負債の部	
流動負債	
未払金	900,000,000
未払解約金	272,465,482
流動負債合計	1,172,465,482
負債合計	1,172,465,482
純資産の部	
元本等	
元本	553,690,844,140
剰余金	
剰余金又は欠損金()	155,399,176,347
元本等合計	709,090,020,487
純資産合計	709,090,020,487
負債純資産合計	710,262,485,969

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

2025年 2月20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 2月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	553,690,844,140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
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) 97,592,000円 1.2807円 (12,807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)

2025年 2月20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)

区分	2025年 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 8月21日
期首元本額	506,435,479,611円
期中追加設定元本額	61,132,258,692円
期中一部解約元本額	13,876,894,163円
期末元本額	553,690,844,140円
期末元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
S B I 資産設計オープン(資産成長型)	5,011,563,785円
S B I 資産設計オープン(分配型)	18,980,226円
S M T 国内債券インデックス・オープン	16,517,293,250円
世界経済インデックスファンド	10,045,184,927円
D C マイセレクション25	30,010,760,511円

区分	2025年 2月20日現在
D Cマイセレクション50	38,808,277,090円
D Cマイセレクション75	13,273,235,916円
D C日本債券インデックス・オープン	397,425,960円
D C日本債券インデックス・オープンS	85,872,853,908円
D C日本債券インデックス・オープンP	61,895,429,128円
D CマイセレクションS25	23,494,849,672円
D CマイセレクションS50	27,435,386,389円
D CマイセレクションS75	8,123,598,505円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	228,613,190円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	3,203,740,795円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	1,348,430,577円
D C世界経済インデックスファンド	6,916,021,577円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	1,741,162円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	19,813,982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)	42,243,830円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	70,310,758円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	25,409,792円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	24,572,440円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,396,977,558円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	729,185,740円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,201,624,488円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	67,465,157円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	39,196,960円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	866,621,422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)	1,295,073,625円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	93,629,590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	18,310,365,003円
分散投資コア戦略ファンドA	19,514,071,272円
分散投資コア戦略ファンドS	28,425,293,255円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	380,866,084円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,295,291,699円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	91,583,509円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	49,396,196円
S M T インデックスバランス・オープン	63,573,887円
S M T 世界経済インデックス・オープン	82,645,984円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	190,070,415円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	275,251,666円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	24,969,488円
グローバル経済コア	480,467,879円
S B I 資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	60,954,303円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	46,344,282円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	233,999,062円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	140,704,296円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	44,467,150円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	38,127,510円
My S M T 国内債券インデックス(ノーロード)	1,578,352,023円
10資産分散投資ファンド	493,911,170円
グローバル10資産バランスファンド	812,218,692円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2035	23,459,813円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2040	11,335,668円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2045	18,098,107円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2050	5,893,335円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2055	3,874,345円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2060	2,589,087円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2065	1,749,593円
D CマイセレクションS50(2024-2026リスク抑制型)	15,014,739,914円
F O F s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)	116,636,628,601円
F O F s用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	53,402,992円
私募世界経済バランスファンド(適格機関投資家専用)	22,424,522円

区分	2025年 2月20日現在
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	713,580,426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)	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)	98,819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)	35,710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)	66,631円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2025年 2月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	8,439,330,376
コール・ローン	699,167,092
株式	829,037,178,852
投資信託受益証券	112,976,262
投資証券	14,664,882,365
派生商品評価勘定	234,409,036
未収入金	35,945,987
未収配当金	598,730,866
未収利息	8,908
差入委託証拠金	4,826,035,946
流動資産合計	858,648,665,690
資産合計	858,648,665,690
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,037,461
前受金	232,570,267
未払解約金	393,793,335
流動負債合計	629,401,063
負債合計	629,401,063
純資産の部	
元本等	
元本	116,970,619,776
剰余金	
剰余金又は欠損金()	741,048,644,851
元本等合計	858,019,264,627
純資産合計	858,019,264,627
負債純資産合計	858,648,665,690

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2025年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 (2) 新株予約権証券

	2025年 2月20日現在
	<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(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</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> <p>(4)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。</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</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>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。</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 2月20日現在
1. 計算期間の末における受益権の総数	116,970,619,776口
2. 計算期間の末における1単位当たりの純資産額	7.3353円 (1万口当たり純資産額) (73,353円)

(金融商品に関する注記)

	2025年 2月20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

	2025年 2月20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>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 8月21日
期首元本額	115,829,191,319円
期中追加設定元本額	6,791,041,881円
期中一部解約元本額	5,649,613,424円
期末元本額	116,970,619,776円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,258,490,264円
SBI資産設計オープン(分配型)	4,729,828円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	33,874,231,834円
世界経済インデックスファンド	15,178,083,881円
外国株式インデックス・オープン	848,361,233円
DCマイセレクション25	500,652,353円
DCマイセレクション50	2,792,330,353円
DCマイセレクション75	3,737,889,261円
DC外国株式インデックス・オープン	13,791,751,496円
DCマイセレクションS25	384,189,087円
DCマイセレクションS50	1,964,938,329円
DCマイセレクションS75	2,258,047,612円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	7,749,931円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	116,949,524円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	97,632,542円
DC世界経済インデックスファンド	8,702,961,523円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	687,627,311円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	1,430,822円
マイセレクション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)	12,024,335円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	3,645,801円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	15,199,124円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	4,662,834円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	15,462,286円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	73,413,228円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	91,706,854円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	728,685,058円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	49,386,111円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	9,389,993円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	79,943,825円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	25,908,552円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	625,276,823円
F OFs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	598,510,142円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,183,479,255円

区分	2025年2月20日現在
コア投資戦略ファンド(安定型)	114,577,469円
コア投資戦略ファンド(成長型)	285,322,451円
分散投資コア戦略ファンドA	1,132,782,942円
分散投資コア戦略ファンドS	5,553,623,108円
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,545,104,310円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	927,943,415円
コア投資戦略ファンド(切替型)	119,799,666円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	390,942,760円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	20,139,521円
S M T インデックスバランス・オープン	91,067,015円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	65,562,552円
外国株式S M T B セレクション(S M A専用)	6,111,191,414円
S M T 世界経済インデックス・オープン	268,713,130円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	1,354,564,190円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	195,043,812円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	5,653,881円
M y S M T グローバル株式インデックス(ノーロード)	3,593,311,656円
グローバル経済コア	740,233,575円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	15,037,324円
D C ターゲット・イヤー ファンド2055	6,739,053円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	122,686,151円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	33,999,020円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	182,469,521円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	191,305,177円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	90,122,637円
D C ターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	122,738,616円
10資産分散投資ファンド	57,082,901円
グローバル10資産バランスファンド	22,249,023円
D C 世界経済インデックスファンド(株式特化型)	14,755,269円
D C ターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2035	2,658,393円
D C ターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2040	1,561,922円
D C ターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2045	2,871,718円
D C ターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2050	946,588円
D C ターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2055	534,812円
D C ターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2060	165,527円
D C ターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2065	82,405円
D C マイセレクションS50(2024-2026リスク抑制型)	75,311,336円
D C 全世界株式インデックスファンド(オール・カントリー)	4,793,924円
F O F s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)	49,396,064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)	385,950,045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)	708,945,457円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,480,800,821円
F O F s用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	98,471,964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)	54,446,224円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	74,789,668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)	93,923,052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
S M T A M 海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	141,959,661円
S M T A M 海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	140,996,114円
S M T A M 海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	140,479,419円
S M T A M 海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	139,089,349円
S M T A M 海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	137,907,114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)	43,403,909円
S M T A M 海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	89,044,793円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2025年2月20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	13,493,492,833	-	13,726,063,100	232,570,267
	合計	13,493,492,833	-	13,726,063,100	232,570,267

(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2月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超	-	
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカドル 売建 アメリカドル	184,041,000 184,041,000 265,830,400 265,830,400	- - - -	182,846,004 182,846,004 265,834,096 265,834,096	1,194,996 1,194,996 3,696 3,696
	合計	449,871,400	-	448,680,100	1,198,692

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2025年2月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,167,843,344
コール・ローン	3,243,206,149
国債証券	366,911,433,302
派生商品評価勘定	2,406,546
未収利息	2,769,270,846
前払金	538,648
前払費用	262,162,472
差入委託証拠金	194,666,954
流動資産合計	374,551,528,261
資産合計	374,551,528,261
負債の部	

項目	2025年 2月20日現在
流動負債	
派生商品評価勘定	30,673,838
未払解約金	133,578,403
流動負債合計	164,252,241
負債合計	164,252,241
純資産の部	
元本等	
元本	104,824,209,001
剰余金	
剰余金又は欠損金()	269,563,067,019
元本等合計	374,387,276,020
純資産合計	374,387,276,020
負債純資産合計	374,551,528,261

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2025年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (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。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2025年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	104,824,209,001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	3.5716円 (1万口当たり純資産額) (35,716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 2月20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。

	2025年 2月20日現在
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 8月21日
期首元本額	99,892,817,357円
期中追加設定元本額	8,271,504,019円
期中一部解約元本額	3,340,112,375円
期末元本額	104,824,209,001円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	1,046,773,807円
グローバル・インカム＆プラス(毎月決算型)	446,394,760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)	2,320,764,925円
SBI資産設計オープン(分配型)	8,592,811円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,089,792,610円
世界経済インデックスファンド	27,355,371,890円
DCマイセレクション25	1,759,116,269円
DCマイセレクション50	1,700,446,753円
DCマイセレクション75	1,369,295,888円
DC外国債券インデックス・オープン	2,221,789,198円
DCマイセレクションS25	1,380,039,705円
DCマイセレクションS50	1,183,171,834円
DCマイセレクションS75	830,187,602円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	7,088,091円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	101,627,533円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	57,442,648円
DC世界経済インデックスファンド	16,337,808,340円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	772,951,820円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	902,697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)	6,769,474円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	16,758,321円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	29,901,872円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	45,186,155円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	49,940,971円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	481,100,394円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	330,624,261円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,407,318,523円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	49,981,193円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	22,177,520円

区分	2025年2月20日現在
バランスD(35)V A 1(適格機関投資家専用)	299,695,994円
バランスE(25)V A 1(適格機関投資家専用)	108,608,190円
バランスF(25)V A 1(適格機関投資家専用)	148,922,599円
F O F s用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	590,539,419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)	1,086,987,154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	850,091,228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
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	885,459,930円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,654,091,590円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	224,771,012円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	103,108,304円
S M T グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,287,207,212円
S M T インデックスバランス・オープン	157,385,025円
S M T 世界経済インデックス・オープン	529,245,155円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	774,630,315円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	1,125,758,990円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	10,153,742円
グローバル経済コア	1,346,820,633円
S B I資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	26,349,326円
D Cターゲット・イヤー ファンド2055	3,003,155円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	71,630,051円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	116,554,847円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	62,432,251円
D Cターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	93,422,516円
M y S M T グローバル債券インデックス(ノーロード)	1,122,444,637円
10資産分散投資ファンド	36,142,576円
グローバル10資産バランスファンド	39,309,360円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2035	3,045,977円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2040	1,631,537円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2045	2,852,445円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2050	931,070円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2055	561,154円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2060	262,904円
D Cターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2065	159,190円
D CマイセレクションS50(2024-2026リスク抑制型)	890,205,920円
F O F s用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	14,925,083,188円
F O F s用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	226,498,900円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	140,216,921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)	17,292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)	17,102円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2025年2月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)	
			うち1年超			
市場取引	債券先物取引					
		買建	2,369,422,700	-	2,368,884,052	
合計		2,369,422,700		-	2,368,884,052	
(注)1.時価の算定方法					538,648	

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
 3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
 4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
 上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2025年2月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引以外の取引	為替予約取引			
	買建	2,909,643,343	-	2,881,914,699
	アメリカドル	1,435,096,422	-	1,418,492,571
	カナダドル	109,154,240	-	108,158,658
	ユーロ	851,393,620	-	844,927,077
	イギリスポンド	158,041,133	-	157,527,111
	オフショア人民元	355,957,928	-	352,809,282
合計		2,909,643,343	-	2,881,914,699
				27,728,644

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

貸借対照表

	2025年2月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	319,985,614
コール・ローン	2,007,868,133
国債証券	79,020,871,699
派生商品評価勘定	1,531,017,976
未収入金	63,709
未収利息	578,849,657
前払金	102,649
前払費用	73,406,991
差入委託証拠金	56,262,540
流動資産合計	83,588,428,968
資産合計	83,588,428,968
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,303,585
未払金	1,515,420,831
未払解約金	24,997
流動負債合計	1,527,749,413
負債合計	1,527,749,413
純資産の部	
元本等	
元本	100,738,731,253

項目	金額(円)
剰余金	
剰余金又は欠損金()	18,678,051,698
元本等合計	82,060,679,555
純資産合計	82,060,679,555
負債純資産合計	83,588,428,968

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2025年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (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。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2025年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	100,738,731,253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	18,678,051,698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) 0.8146円 (8,146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 2月20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

	2025年 2月20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>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 8月21日
期首元本額	97,429,950,983円
期中追加設定元本額	11,782,743,848円
期中一部解約元本額	8,473,963,578円
期末元本額	100,738,731,253円
期末元本額の内訳	
分散投資コア戦略ファンドA	21,263,459,748円
分散投資コア戦略ファンドS	31,259,704,364円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	2,164,658,104円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	994,927,794円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	243,580,816円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	85,674,595円
10資産分散投資ファンド	782,630,557円
グローバル10資産バランスファンド	165,986,061円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	14,603,614,901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)	2,677,497,692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)	3,076,131,254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)	309,608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)	335,748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)	283,717円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	3,830,018,710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)	3,752,382,115円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	3,720,862,322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)	2,141,488,108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 2月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引	債券先物取引 買建	424,263,490	-	424,160,841 102,649

合計	424,263,490	-	424,160,841	102,649
----	-------------	---	-------------	---------

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

(2025年 2月20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	1年以内	
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,494,670,360	-	1,483,890,617	10,779,743
	アメリカドル	712,436,400	-	707,810,481	4,625,919
	カナダドル	30,213,480	-	29,951,699	261,781
	メキシコペソ	11,818,800	-	11,637,517	181,283
	ユーロ	447,893,996	-	444,241,417	3,652,579
	イギリスポンド	77,343,760	-	76,681,590	662,170
	ノルウェークローネ	5,146,092	-	5,136,377	9,715
	ポーランドズロチ	8,650,602	-	8,522,618	127,984
	オーストラリアドル	18,160,612	-	18,040,348	120,264
	ニュージーランドドル	7,977,504	-	7,931,412	46,092
	イスラエルシェケル	5,351,250	-	5,327,600	23,650
	オフショア人民元	169,677,864	-	168,609,558	1,068,306
	売建	81,583,855,667	-	80,054,258,884	1,529,596,783
	アメリカドル	38,669,617,747	-	37,845,165,711	824,452,036
	カナダドル	1,625,091,930	-	1,616,091,851	9,000,079
	メキシコペソ	631,697,913	-	626,181,254	5,516,659
	ユーロ	24,059,920,858	-	23,609,425,066	450,495,792
	イギリスポンド	4,160,141,969	-	4,125,653,485	34,488,484
	スウェーデンクローナ	131,308,274	-	132,342,672	1,034,398
	ノルウェークローネ	126,186,353	-	125,676,678	509,675
	デンマーククローネ	172,923,878	-	169,699,059	3,224,819
	ポーランドズロチ	460,817,140	-	455,873,965	4,943,175
	オーストラリアドル	983,517,864	-	981,501,102	2,016,762
	ニュージーランドドル	222,844,089	-	220,252,496	2,591,593
	シンガポールドル	301,372,596	-	297,849,439	3,523,157
	マレーシアリンギット	405,623,357	-	396,743,352	8,880,005

イスラエルシェケル	295,355,055	-	292,043,974	3,311,081
オフショア人民元	9,337,436,644	-	9,159,758,780	177,677,864
合計	83,078,526,027	-	81,538,149,501	1,518,817,040

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2025年 2月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	8,151,863,255
コール・ローン	129,403,706
株式	224,898,827,950
投資信託受益証券	458,348,319
投資証券	206,010,922
派生商品評価勘定	319,430,634
未収入金	1,017,199
未収配当金	323,098,112
未収利息	1,648
差入委託証拠金	1,979,691,935
流動資産合計	236,467,693,680
資産合計	236,467,693,680
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	882
前受金	319,430,634
未払金	32,134
未払解約金	163,078,168
流動負債合計	482,541,818
負債合計	482,541,818
純資産の部	
元本等	
元本	49,150,386,266
剰余金	
剰余金又は欠損金()	186,834,765,596
元本等合計	235,985,151,862
純資産合計	235,985,151,862
負債純資産合計	236,467,693,680

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式	2025年 2月20日現在
--------------------	--------	---------------

	2025年 2月20日現在
	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。
	(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。
	(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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。
	(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。
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 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 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	49,150,386,266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	4.8013円 (1万口当たり純資産額) (48,013円)

(金融商品に関する注記)

	2025年 2月20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 2月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によっては、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 2月20日現在	
投資信託財産に係る元本の状況		
期首	2024年 8月21日	
期首元本額	46,618,122,367円	
期中追加設定元本額	3,785,833,581円	
期中一部解約元本額	1,253,569,682円	
期末元本額	49,150,386,266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	6,741,501,559円	
世界経済インデックスファンド	14,324,406,888円	
DC新興国株式インデックス・オープン	6,439,102,647円	
DC世界経済インデックスファンド	7,922,926,738円	
新興国株式インデックス・オープン (SMA専用)	88,646,307円	
コア投資戦略ファンド(安定型)	60,606,383円	
コア投資戦略ファンド(成長型)	149,892,084円	
分散投資コア戦略ファンドA	272,513,881円	
分散投資コア戦略ファンドS	1,285,647,921円	
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,467,660,952円	
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	827,071,695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)	369,734,034円	
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	18,280,554円	
SMT インデックスバランス・オープン	84,799,371円	
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	34,032,360円	
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	3,070,998,243円	
SMT 世界経済インデックス・オープン	307,007,805円	
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	1,565,897,131円	
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	227,124,553円	
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,380,368円	
グローバル経済コア	686,255,008円	
My SMT 新興国株式インデックス(ノーロード)	680,742,245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	133,149,174円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)	2040	139,560,027円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)	2050	65,851,526円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)	2060	89,881,648円
10資産分散投資ファンド		18,121,865円
グローバル10資産バランスファンド		32,371,624円
DC世界経済インデックスファンド(株式特化型)		14,314,197円
DC全世界株式インデックスファンド(オール・カントリー)		850,802円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)		1,646,371,107円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)		111,994,713円

区分	2025年 2月20日現在
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	81,457,012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)	16,400,557円
F OFs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)	22,286,277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)	13,064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)	17,274円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2025年 2月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
			うち1年超	-	
市場取引	株価指数先物取引 買建	10,036,207,036	-	10,355,637,670	319,430,634
	合計	10,036,207,036	-	10,355,637,670	319,430,634

(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 2月20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 アメリカドル	63,436,800 63,436,800	- -	63,437,682 63,437,682	882 882
	合計	63,436,800	-	63,437,682	882

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2025年 2月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	836,916,124
コール・ローン	1,344,154,548

項目	2025年 2月20日現在
国債証券	154,842,613,885
未収利息	2,350,853,693
前払費用	213,507,185
流動資産合計	159,588,045,435
資産合計	159,588,045,435
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,488,962
未払解約金	57,337,319
流動負債合計	68,826,281
負債合計	68,826,281
純資産の部	
元本等	
元本	68,752,005,215
剰余金	
剰余金又は欠損金()	90,767,213,939
元本等合計	159,519,219,154
純資産合計	159,519,219,154
負債純資産合計	159,588,045,435

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2025年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。
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 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	68,752,005,215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) 2,3202円 (23,202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 2月20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

	2025年 2月20日現在
	<p>売買目的有価証券 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 8月21日
期首元本額	66,091,502,911円
期中追加設定元本額	4,674,726,156円
期中一部解約元本額	2,014,223,852円
期末元本額	68,752,005,215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	3,481,618,822円
世界経済インデックスファンド	27,891,941,333円
DC新興国債券インデックス・オープン	6,065,428,552円
DC世界経済インデックスファンド	16,287,558,082円
新興国債券インデックス・オープン (SMA専用)	3,599,316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)	906,702,147円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,799,552,227円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	233,608,040円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	106,864,410円
SMT インデックスバランス・オープン	163,713,882円
SMT 世界経済インデックス・オープン	628,706,451円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	914,806,343円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	1,329,174,829円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	16,138,829円
グローバル経済コア	1,334,706,394円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	143,676,821円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	132,141,207円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	58,919,736円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	76,727,912円
My SMT 新興国債券インデックス(ノーロード)	400,176,232円
10資産分散投資ファンド	58,258,981円
グローバル10資産バランスファンド	61,301,187円
F OFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	264,693,907円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	166,580,825円
グローバル10資産バランス・アクティブライト型ファンド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・アクティブライト型ファンド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・アクティブライト型ファンド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・アクティブライト型ファンドN4(適格機関投資家専用)	15,798円
グローバル10資産バランス・アクティブライト型ファンド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・アクティブライト型ファンドN6(適格機関投資家専用)	26,463円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	220,408,699円

区分	2025年 2月20日現在
SMTAM海外バランスファンド 2020-08 (適格機関投資家専用)	221,022,091円
SMTAM海外バランスファンド 2020-11 (適格機関投資家専用)	220,211,820円
SMTAM海外バランスファンド 2021-04 (適格機関投資家専用)	215,951,894円
SMTAM海外バランスファンド 2021-07 (適格機関投資家専用)	214,116,808円
SMTAM海外バランスファンド 2023-02 (適格機関投資家専用)	139,584,479円

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

(2025年 2月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	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	1,202,968,834	-	11,488,962
	メキシコペソ	191,921,300	-	2,154,924
	トルコリラ	30,222,383	-	421,983
	チェココルナ	100,740,312	-	1,146,894
	ハンガリーフォリ ント	44,580,045	-	542,138
	ポーランドズロチ	134,349,390	-	1,697,285
	マレーシアリン ギット	189,535,262	-	1,428,994
	タイバーツ	174,537,359	-	440,943
	南アフリカランド	149,192,761	-	2,120,388
	オフショア人民元	187,890,022	-	1,535,413
合計		1,202,968,834	-	11,488,962

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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 2月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,398,725,599
投資証券	96,806,250,700
派生商品評価勘定	114,704,640
未収入金	63,611,901
未収配当金	918,123,137
未収利息	30,563
差入委託証拠金	200,461,684
流動資産合計	100,501,908,224
資産合計	100,501,908,224
負債の部	

項目	2025年 2月20日現在
流動負債	
派生商品評価勘定	5,550,960
前受金	109,604,020
未払解約金	113,130,904
流動負債合計	228,285,884
負債合計	228,285,884
純資産の部	
元本等	
元本	48,703,929,515
剰余金	
剰余金又は欠損金()	51,569,692,825
元本等合計	100,273,622,340
純資産合計	100,273,622,340
負債純資産合計	100,501,908,224

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2025年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2025年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	48,703,929,515口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.0588円 (1万口当たり純資産額) (20,588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 2月20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

	2025年 2月20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	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。 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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 8月21日
期首元本額	63,031,274,058円
期中追加設定元本額	4,610,080,600円
期中一部解約元本額	18,937,425,143円
期末元本額	48,703,929,515円
期末元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,791,930,369円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,670,119円
SMT J - REITインデックス・オープン	15,000,783,369円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	21,867,889,963円
コア投資戦略ファンド(安定型)	602,448,365円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,042,334,487円
分散投資コア戦略ファンドA	1,066,487,955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)	437,052,521円
SMT インデックスバランス・オープン	20,915,268円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	133,858,334円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	17,375,834円
グローバル経済コア	609,118,266円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	21,020,109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)	82,292,827円
My SMT J - REITインデックス(ノーロード)	1,228,497,088円
10資産分散投資ファンド	33,564,703円
グローバル10資産バランスファンド	67,351,819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)	197,260,501円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	11,943,895円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	895,743,618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)	68,476,673円
グローバル10資産バランス・アクティビ型ファンド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・アクティビ型ファンド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・アクティビ型ファンド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・アクティビ型ファンド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・アクティビ型ファンド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・アクティビ型ファンドN6(適格機関投資家専用)	45,234円
J - REIT パッシブ・ファンド 2015 - 04(適格機関投資家専用)	442,360,039円
J - REIT パッシブ・ファンド 2018 - 05(適格機関投資家専用)	486,254,183円

(デリバティブ取引に関する注記)

投資証券関連

(2025年 2月20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	3,314,003,480	-	3,423,607,500	109,604,020
	合計	3,314,003,480	-	3,423,607,500	109,604,020

(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R E I T インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2025年 2月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	228,462,014
コール・ローン	100,040,275
投資証券	137,899,351,760
派生商品評価勘定	168
未収入金	10,679,099
未収配当金	172,339,646
未収利息	1,274
流動資産合計	138,410,874,236
資産合計	138,410,874,236
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	548,516
未払金	49,068,947
未払解約金	5,435,527
流動負債合計	55,052,990
負債合計	55,052,990
純資産の部	
元本等	
元本	43,456,600,544
剰余金	
剰余金又は欠損金()	94,899,220,702
元本等合計	138,355,821,246
純資産合計	138,355,821,246
負債純資産合計	138,410,874,236

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2025年 2月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>為替予約取引</p>

	2025年 2月20日現在
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2025年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	43,456,600,544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	3.1838円 (1万口当たり純資産額) (31,838円)

(金融商品に関する注記)

	2025年 2月20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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況		
期首		2024年 8月21日
期首元本額		40,049,449,745円
期中追加設定元本額		5,595,850,411円
期中一部解約元本額		2,188,699,612円
期末元本額		43,456,600,544円
期末元本額の内訳		

区分	2025年2月20日現在
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)	1,484,214,625円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,464,330円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	10,780,240,162円
グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)	20,473,649,599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	3,521,991,676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	99,905,989円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	142,719,243円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,133,184円
グローバル経済コア	409,792,685円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	17,115,858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)	103,831,179円
My-SMT グローバルREITインデックス(ノーロード)	413,864,965円
10資産分散投資ファンド	17,769,855円
グローバル10資産バランスファンド	47,713,893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)	1,390,612,693円
F OFs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)	170,843,222円
F OFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	94,834,353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)	49,065,443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)	54,376,528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)	25,703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)	35,014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)	82,715,355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)	81,037,615円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	80,358,076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)	39,078,356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)

通貨関連

(2025年2月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	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	96,906,700	-	96,358,352 548,348
	アメリカドル	66,839,200	-	66,483,832 355,368
	香港ドル	17,606,700	-	17,485,110 121,590
	シンガポールドル	12,460,800	-	12,389,410 71,390
合計		96,906,700	-	96,358,352 548,348

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

貸借対照表

項目	2025年 2月20日現在
資産の部	
流動資産	
預金	11,127,994
コール・ローン	128,989,297
投資信託受益証券	43,428,987,153
派生商品評価勘定	809,757,410
未収利息	1,643
流動資産合計	44,378,863,497
資産合計	44,378,863,497
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,724
未払解約金	5,609,158
流動負債合計	5,616,882
負債合計	5,616,882
純資産の部	
元本等	
元本	25,892,928,936
剰余金	
剰余金又は欠損金()	18,480,317,679
元本等合計	44,373,246,615
純資産合計	44,373,246,615
負債純資産合計	44,378,863,497

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2025年 2月20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 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数		25,892,928,936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)	1.7137円 (17,137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 2月20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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2024年 8月21日
期首元本額	21,517,807,288円
期中追加設定元本額	5,585,911,024円
期中一部解約元本額	1,210,789,376円
期末元本額	25,892,928,936円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,260,312,710円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,197,142,534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)	922,428,803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	3,342,040,373円
SMT ゴールドインデックス・オープン(為替ヘッジあり)	3,477,541,503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	101,325,598円
F OF s 用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	311,995,794円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	575,320,212円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	77,473,967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)	52,404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)	25,886円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2025年 2月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価	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	42,107,070,104	-	41,297,320,418 809,749,686
	アメリカドル	42,107,070,104	-	41,297,320,418 809,749,686
	合計	42,107,070,104	-	41,297,320,418 809,749,686

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

4 【委託会社等の概況】

（1）【資本金の額】

2025年 3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3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	520	15,551,198
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	52	164,286
単位型公社債投資信託	52	164,357
合計	624	15,879,842

（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 5月20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 あづ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 あづ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】

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)	(単位:百万円)
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
器具備品	1	560	1
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		利益剰余金 合計		
		別途積立金	その他利益剰余金			
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				
	利益準備金	利益剰余金			
		その他利益剰余金	別途積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計
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あります。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によってあります。

(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あります。

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あります。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によってあります。

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 "	
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、内部留保を充ててあります。

(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ますが、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計(繰延ヘッジ)を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価

を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用してあります。

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）	-	3,844	-	3,844
その他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
デリバティブ取引（*4）				
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）	-	4,517	-	4,517
その他有価証券	-	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。

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
	英ポンド	256	-	6
	カナダドル	109	-	1
	スイスフラン	163	-	2
	香港ドル	202	-	0
	ユーロ	651	-	19
	買建 米ドル	152	-	3
	合計	7,458	-	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
	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	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				
	米ドル	投資有価証券	1,729	-	6
	英ポンド	関係会社株式	3,228	-	81
	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	投資有価証券 関係会社株式	2,126 4,586 28 83 63 448	-	1 7 0 0 0 1
	売建				
	米ドル				
	英ポンド				
	イスラエル・ペソ				
	香港ドル				
	ユーロ				
合計			7,337	-	10

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位:百万円)	
	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	820	911
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理計算上の差異の発生額	6	11
退職給付の支払額	57	85
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
退職給付債務の期末残高	911	993

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

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

	(単位:百万円)	
	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	911	993
未認識数理計算上の差異	6	17
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975
退職給付引当金	904	975
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(単位:百万円)	
	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理差異償却	-	0
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
確定給付制度に係る退職給付費用	142	155

(5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度109百万円、当事業年度122百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	58 百万円	63 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	187 "	220 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	277 "	298 "
税務上の費用認識差額	412 "	256 "
繰延ヘッジ損益	225 "	472 "
その他	75 "	78 "
繰延税金資産 合計	1,236 "	1,390 "
繰延税金負債		
有価証券評価差額	21 "	159 "
その他	32 "	35 "
繰延税金負債 合計	54 "	194 "
繰延税金資産の純額	1,181 "	1,196 "

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887百万円

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,223百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

（注）1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行（株）	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,926	未収運用受託報酬	5,520
							投信販売代行手数料等	10,187	未払手数料	2,482

（注）1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度(2023年3月31日)

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

当事業年度(2024年3月31日)

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

(1株当たり情報)

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

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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
流動負債合計	2,306
	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
営業利益	7,504
	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			
	利益準備金	利益剰余金		株主資本合計
		別途積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	500	2,100	45,974	48,574
当中間期変動額				
剰余金の配当			2,943	2,943
中間純利益			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
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あります。	
その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法によってあります。 (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あります。 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あります。	
(2) デリバティブ 時価法によってあります。	
(3) 金銭の信託 時価法によってあります。	
2. 固定資産の減価償却の方法	
(1) 有形固定資産 定額法によってあります。	
(2) 無形固定資産 定額法によってあります。 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、それぞれ発生の翌事業年度から損益処理 なお、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る当中間会計期間末の自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を一部適用しております。	
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」といいます。)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あります。	
(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。	

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	83百万円
有形固定資産	1,211百万円
無形固定資産	
2 営業外収益の主要項目	149百万円
投資有価証券売却益	
3 営業外費用の主要項目	263百万円
金銭の信託運用損	239百万円
投資有価証券償還損	146百万円
為替差損	138百万円
デリバティブ費用	

(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、次表には含まれおりません((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項の取り扱いを適用し、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すこととした額	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
	イスラエル	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 米ドル 英ポンド スイスフラン 香港ドル ユーロ シンガポールドル	投資有価証券 関係会社株式	1,833 4,463 49 95 31 433	- - - - - -	30 137 0 1 0 11
合計			6,906	-	182

(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
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 記載しておりません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第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 あづさ監査法人

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4月28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」に掲げられているグローバル10資産バランスファンドの2024年8月21日から2025年2月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル10資産バランスファンドの2025年2月20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8月21日から2025年2月20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つい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。