

## 【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成26年8月11日
【計算期間】	第7期中（自 平成25年11月12日 至 平成26年5月11日）
【ファンド名】	SBI資産設計オープン（資産成長型）
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目33番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポートイング部長 橋詰 廣志
【連絡場所】	東京都港区芝3丁目33番1号
【電話番号】	03-6737-0521
【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】

以下の記載は、平成26年5月30日現在の状況について記載してあります。

## (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	8,952,397,684	96.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		306,111,759	3.31
合計(純資産総額)		9,258,509,443	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間末 (平成20年11月10日)	994,679,991	994,679,991	7,198	7,198
第2期計算期間末 (平成21年11月10日)	1,764,446,119	1,764,446,119	7,679	7,679
第3期計算期間末 (平成22年11月10日)	2,508,787,040	2,508,787,040	7,788	7,788
第4期計算期間末 (平成23年11月10日)	3,227,431,682	3,227,431,682	7,290	7,290
第5期計算期間末 (平成24年11月12日)	4,476,232,662	4,476,232,662	7,995	7,995
第6期計算期間末 (平成25年11月11日)	7,540,466,177	7,554,112,856	11,051	11,071
平成25年 5月末日	6,897,437,027		10,847	
6月末日	6,723,867,727		10,554	
7月末日	6,872,609,023		10,622	
8月末日	6,911,497,767		10,460	
9月末日	7,377,356,987		10,980	
10月末日	7,582,846,444		11,180	
11月末日	7,809,175,488		11,476	
12月末日	7,801,584,822		11,784	
平成26年 1月末日	8,006,408,990		11,455	
2月末日	8,347,642,270		11,593	
3月末日	8,608,564,583		11,634	
4月末日	8,877,133,235		11,669	
5月末日	9,258,509,443		11,841	

## 【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(平成20年 1月 9日～平成20年11月10日)	0
第2期計算期間(平成20年11月11日～平成21年11月10日)	0
第3期計算期間(平成21年11月11日～平成22年11月10日)	0
第4期計算期間(平成22年11月11日～平成23年11月10日)	0

第5期計算期間(平成23年11月11日～平成24年11月12日)	0
第6期計算期間(平成24年11月13日～平成25年11月11日)	20

## 【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第1期計算期間(平成20年 1月 9日～平成20年11月10日)	28.0
第2期計算期間(平成20年11月11日～平成21年11月10日)	6.7
第3期計算期間(平成21年11月11日～平成22年11月10日)	1.4
第4期計算期間(平成22年11月11日～平成23年11月10日)	6.4
第5期計算期間(平成23年11月11日～平成24年11月12日)	9.7
第6期計算期間(平成24年11月13日～平成25年11月11日)	38.5
第7期中間計算期間(平成25年11月12日～平成26年 5月11日)	5.7

(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。

(参考情報)

## 国内債券インデックス マザーファンドの投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	202,294,222,050	78.64
	ポーランド	200,968,000	0.08
	小計	202,495,190,050	78.72
地方債証券	日本	16,201,344,567	6.30
特殊債券	日本	22,218,166,218	8.64
	アメリカ	209,146,000	0.08
	スウェーデン	100,979,000	0.04
	韓国	100,270,000	0.04
	小計	22,628,561,218	8.80
社債券	日本	13,174,415,930	5.12
	オーストラリア	405,859,000	0.16
	オランダ	405,712,000	0.16
	アメリカ	307,293,000	0.12
	スウェーデン	102,660,000	0.04
	イギリス	101,117,000	0.04
	小計	14,497,056,930	5.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,407,220,386	0.55
合計(純資産総額)		257,229,373,151	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## 国内株式インデックス マザーファンドの投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	139,071,461,940	97.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,035,834,467	2.14
合計(純資産総額)		142,107,296,407	100.00

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### 外国債券インデックス マザーファンドの投資状況

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	83,057,823,665	37.30
	フランス	22,632,584,832	10.16
	イタリア	22,529,967,162	10.12
	ドイツ	18,766,748,505	8.43
	イギリス	17,145,726,972	7.70
	スペイン	12,207,304,221	5.48
	ベルギー	6,027,569,311	2.71
	オランダ	6,006,702,436	2.70
	カナダ	5,079,173,728	2.28
	オーストリア	3,804,001,434	1.71
	オーストラリア	3,526,798,864	1.58
	メキシコ	2,418,645,359	1.09
	アイルランド	1,856,287,580	0.83
	デンマーク	1,782,262,226	0.80
	フィンランド	1,489,343,944	0.67
	ポーランド	1,451,374,989	0.65
	スウェーデン	1,239,328,588	0.56
	マレーシア	1,135,698,443	0.51
	南アフリカ	1,096,852,135	0.49
	スイス	871,751,828	0.39
ノルウェー	803,640,781	0.36	
シンガポール	801,282,052	0.36	
	小計	215,730,869,055	96.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,943,910,908	3.12
合計(純資産総額)		222,674,779,963	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 マザーファンドの投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	89,563,408,927	53.05
	イギリス	15,009,024,952	8.89
	スイス	7,299,527,177	4.32
	カナダ	7,280,425,830	4.31
	フランス	6,936,416,903	4.11
	ドイツ	6,707,694,826	3.97
	オーストラリア	5,219,758,943	3.09
	オランダ	2,682,756,587	1.59
	スペイン	2,594,171,181	1.54
	スウェーデン	2,229,517,906	1.32
	イタリア	1,753,570,782	1.04

	香港	1,675,816,882	0.99
	アイルランド	1,458,910,192	0.86
	デンマーク	1,054,644,228	0.62
	シンガポール	1,037,304,261	0.61
	ジャージー	896,474,471	0.53
	ベルギー	880,752,663	0.52
	キュラソー	723,240,362	0.43
	フィンランド	630,217,561	0.37
	バミューダ	618,118,570	0.37
	ノルウェー	538,379,109	0.32
	イスラエル	371,062,633	0.22
	ルクセンブルク	301,944,750	0.18
	オーストリア	195,936,673	0.12
	ケイマン	185,587,684	0.11
	ポルトガル	117,910,615	0.07
	ニュージーランド	100,684,990	0.06
	英ヴァージン諸島	92,864,348	0.06
	パナマ	80,775,128	0.05
	リベリア	48,478,858	0.03
	ガーンジー	39,744,622	0.02
	マン島	34,019,156	0.02
	モーリシャス	13,475,615	0.01
	小計	158,372,617,385	93.80
投資信託受益証券	オーストラリア	87,796,800	0.05
	シンガポール	19,594,965	0.01
	香港	14,588,808	0.01
	小計	121,980,573	0.07
投資証券	アメリカ	2,453,296,917	1.45
	オーストラリア	382,340,860	0.23
	フランス	227,303,393	0.13
	イギリス	222,806,416	0.13
	香港	67,516,500	0.04
	シンガポール	55,484,105	0.03
	カナダ	36,149,514	0.02
	オランダ	17,389,529	0.01
	小計	3,462,287,234	2.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,875,378,145	4.07
合計(純資産総額)		168,832,263,337	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。

#### J-REITインデックス マザーファンドの投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	26,061,032,540	98.72
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		338,992,138	1.28
合計(純資産総額)		26,400,024,678	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。

### グローバルREITインデックス マザーファンドの投資状況

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	21,265,859,080	66.96
	オーストラリア	3,009,095,129	9.47
	イギリス	2,148,965,828	6.77
	フランス	1,648,661,520	5.19
	シンガポール	1,211,561,748	3.81
	カナダ	844,093,309	2.66
	香港	560,301,600	1.76
	オランダ	371,096,499	1.17
	ベルギー	170,485,838	0.54
	ニュージーランド	108,847,607	0.34
	アイルランド	62,410,346	0.20
	ドイツ	50,111,895	0.16
	イタリア	37,636,604	0.12
	マン島	29,481,464	0.09
	イスラエル	10,679,760	0.03
ギリシャ	8,144,178	0.03	
	小計	31,537,432,405	99.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		222,082,286	0.70
合計(純資産総額)		31,759,514,691	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。

### 2【設定及び解約の実績】

期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1期計算期間 (平成20年 1月 9日～平成20年11月10日)	1,620,495,479	238,628,571	1,381,866,908
第2期計算期間 (平成20年11月11日～平成21年11月10日)	1,146,528,947	230,541,088	2,297,854,767
第3期計算期間 (平成21年11月11日～平成22年11月10日)	1,325,647,358	402,047,721	3,221,454,404
第4期計算期間 (平成22年11月11日～平成23年11月10日)	1,745,390,853	539,609,788	4,427,235,469
第5期計算期間 (平成23年11月11日～平成24年11月12日)	1,886,342,012	715,055,600	5,598,521,881
第6期計算期間 (平成24年11月13日～平成25年11月11日)	2,961,482,673	1,736,664,711	6,823,339,843
第7期中間計算期間 (平成25年11月12日～平成26年 5月11日)	2,034,777,811	1,179,638,105	7,678,479,549

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

### 3【ファンドの経理状況】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期中間計算期間(平成25年11月12日から平成26年5月11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。

## SBI資産設計オープン(資産成長型) 中間財務諸表

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 (平成25年11月11日現在)	第7期中間計算期間 (平成26年 5月11日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	243,442,482	351,783,794
親投資信託受益証券	7,351,922,283	8,664,268,823
未収入金	-	7,217,970
未収利息	331	1,408
流動資産合計	7,595,365,096	9,023,271,995
資産合計	7,595,365,096	9,023,271,995
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	13,646,679	-
未払解約金	15,614,303	27,593,356
未払受託者報酬	1,488,500	1,716,986
未払委託者報酬	23,815,970	27,471,697
その他未払費用	333,467	214,568
流動負債合計	54,898,919	56,996,607
負債合計	54,898,919	56,996,607
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,823,339,843	7,678,479,549
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	717,126,334	1,287,795,839
（分配準備積立金）	1,508,410,867	1,272,860,429
元本等合計	7,540,466,177	8,966,275,388
純資産合計	7,540,466,177	8,966,275,388
負債純資産合計	7,595,365,096	9,023,271,995

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期中間計算期間 (自 平成24年11月13日 至 平成25年 5月12日)	第7期中間計算期間 (自 平成25年11月12日 至 平成26年 5月11日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	31,272	71,379
有価証券売買等損益	1,887,023,598	460,746,540
営業収益合計	1,887,054,870	460,817,919
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,180,206	1,716,986
委託者報酬	18,883,182	27,471,697
その他費用	147,466	214,568
営業費用合計	20,210,854	29,403,251
営業利益又は営業損失( )	1,866,844,016	431,414,668
経常利益又は経常損失( )	1,866,844,016	431,414,668
中間純利益又は中間純損失( )	1,866,844,016	431,414,668
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( )	138,725,647	44,446,922
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,122,289,219	717,126,334
剰余金増加額又は欠損金減少額	164,851,597	310,486,915
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	164,851,597	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	310,486,915
剰余金減少額又は欠損金増加額	37,359,636	126,785,156
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	126,785,156
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	37,359,636	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	733,321,111	1,287,795,839

## (3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 第7期中間計算期間(自 平成25年11月12日 至 平成26年 5月11日) 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年11月11日から翌年11月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第7期中間計算期間は平成25年11月12日から平成26年 5月11日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第6期 (平成25年11月11日現在)	第7期中間計算期間 (平成26年 5月11日現在)
1. 期首元本額	5,598,521,881円	6,823,339,843円
期中追加設定元本額	2,961,482,673円	2,034,777,811円
期中一部解約元本額	1,736,664,711円	1,179,638,105円
2. 当該中間計算期間の末日における受益権総数	6,823,339,843口	7,678,479,549口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1051円 (11,051円)	1.1677円 (11,677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

1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	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)親投資信託受益証券 「(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の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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。
------------------------	---

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## &lt;参考&gt;

「SBI資産設計オープン(資産成長型)」は、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「グローバルREITインデックス マザーファンド」の受益証券を主要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」は、各マザーファンドの受益証券であります。

各マザーファンドの平成26年5月11日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 「国内債券インデックス マザーファンド」の状況

## (1)貸借対照表

項目	平成26年 5月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,382,876,736
国債証券	200,086,864,650
地方債証券	15,766,381,024
特殊債券	21,957,451,154
社債券	14,385,697,190
派生商品評価勘定	659,028
未収利息	695,013,835
前払費用	23,771,369
流動資産合計	254,298,714,986
資産合計	254,298,714,986
負債の部	
流動負債	
前受金	690,000
未払解約金	760,568,636
流動負債合計	761,258,636
負債合計	761,258,636
純資産の部	
元本等	

元本	196,747,344,191
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	56,790,112,159
元本等合計	253,537,456,350
純資産合計	253,537,456,350
負債純資産合計	254,298,714,986

## (2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 5月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 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。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益の計上基準 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)

	平成26年 5月11日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	196,768,519,264円
中間計算期間中の追加設定元本額	25,575,895,443円
中間計算期間中の一部解約元本額	25,597,070,516円
計算日の元本額	196,747,344,191円
計算日の元本額の内訳	
エマージング株式オープン	2,227,240円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,084,689,346円
SBI資産設計オープン(分配型)	12,747,660円
SMT 国内債券インデックス・オープン	4,355,225,783円
世界経済インデックスファンド	159,269,294円
マイセレクション25	149,578,207円
マイセレクション50	90,297,660円
マイセレクション75	29,492,417円
DCマイセレクション25	11,816,181,815円

DCマイセレクション50	14,538,228,184円
DCマイセレクション75	4,009,755,597円
DC日本債券インデックス・オープン	392,775,983円
DC日本債券インデックス・オープンS	48,347,322,805円
DC日本債券インデックス・オープンP	16,496,694,203円
DCマイセレクションS25	4,254,541,133円
DCマイセレクションS50	4,775,263,743円
DCマイセレクションS75	870,056,829円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	30,700,270円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	946,392,885円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	488,950,586円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	115,630,897円
DC世界経済インデックスファンド	150,115,691円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	944,840,130円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	38,398,923円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	262,939,055円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	44,689,514円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	6,471,999円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,385,172,422円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	2,019,356,482円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	4,296,197,908円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	539,570,388円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	16,399,542,151円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,836,051,511円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	6,397,381,861円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2,505,856,636円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,152,591,766円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,417,436,991円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,321,953,132円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,698,879,428円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,601,456,665円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	261,823,699円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,983,779,913円
日本債券ファンド・シリーズ1	6,912,549,104円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,724,978,197円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,263,216,410円
分散投資コア戦略ファンドA	191,355,961円
分散投資コア戦略ファンドS	144,966,325円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	19,063円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	58,777円
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	16,109,577,023円
コア投資戦略ファンド(切替型)	153,978,668円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	7,954,288円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	8,161,573円

2. 担保に供している資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。  国債証券 105,898,000円  なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおりません。
3. 計算日における受益権総数	196,747,344,191口
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2886円 (12,886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

	平成26年 5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「(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の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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>

## (有価証券に関する注記)

平成26年 5月11日現在
該当事項はありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの  
債券関連

区分	種類	平成26年 5月11日現在			
		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	434,730,972	-	435,390,000	659,028
	合計	434,730,972	-	435,390,000	659,028

## (注)1. 時価の算定方法

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

- 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 5月11日現在
該当事項はありません。

## 「国内株式インデックス マザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

項目	平成26年 5月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,077,538,688
株式	134,730,881,340
派生商品評価勘定	28,450,860
未収入金	976,085,277
未収配当金	1,369,897,226
未収利息	1,439
差入委託証拠金	89,625,000
流動資産合計	138,272,479,830
資産合計	138,272,479,830
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	339,720
前受金	9,040,000
未払解約金	672,055,797
流動負債合計	681,435,517
負債合計	681,435,517
純資産の部	
元本等	
元本	142,631,424,917
剰余金	

剰余金又は欠損金( )	5,040,380,604
元本等合計	137,591,044,313
純資産合計	137,591,044,313
負債純資産合計	138,272,479,830

## (2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 5月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</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。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益の計上基準</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)

	平成26年 5月11日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	147,700,483,382円
中間計算期間中の追加設定元本額	16,024,223,844円
中間計算期間中の一部解約元本額	21,093,282,309円
計算日の元本額	142,631,424,917円
計算日の元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	1,917,664,369円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,800,446,600円
SBI資産設計オープン(分配型)	20,644,192円
SMT TOPIXインデックス・オープン	6,300,541,631円
世界経済インデックスファンド	305,603,478円
マイセレクション25	63,414,548円
マイセレクション50	102,090,549円
マイセレクション75	112,351,843円

日本株式インデックス・オープン	17,681,557,809円
DCマイセレクション25	5,046,690,856円
DCマイセレクション50	16,503,593,006円
DCマイセレクション75	15,313,468,415円
DC日本株式インデックス・オープン	4,060,810,414円
DCマイセレクションS25	1,827,497,517円
DCマイセレクションS50	5,529,200,009円
DCマイセレクションS75	3,494,743,966円
DC日本株式インデックス・オープンS	1,845,052,887円
DCターゲット・イヤール ファンド2015	13,479,471円
DCターゲット・イヤール ファンド2025	463,519,526円
DCターゲット・イヤール ファンド2035	473,946,659円
DCターゲット・イヤール ファンド2045	227,494,943円
DC世界経済インデックスファンド	265,527,866円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	390,794,702円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	143,408,478円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	294,348,244円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	167,410,361円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	1,724,259,716円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	24,373,558円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	847,567,880円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	3,123,259,271円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	5,999,006,500円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	2,582,724,082円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	8,811,109,237円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,748,860,213円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	10,441,561,266円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2,800,266,009円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	2,530,981,062円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,033,019,773円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	4,347,806,027円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,123,809,867円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,489,517,522円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	119,557,955円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	3,548,486,725円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,426,806,742円
日本株式ファンド・シリーズ2	508,294,020円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	76,821円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	25,607円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	31,293,108円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,459,617円
2. 計算日における受益権総数	142,631,424,917口

3. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 5,040,380,604円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9647円 (9,647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

	平成26年 5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)株式 「(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の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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。

## (有価証券に関する注記)

平成26年 5月11日現在
該当事項はありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの  
株式関連

区分	種類	平成26年 5月11日現在			
		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	2,773,888,860	-	2,802,000,000	28,111,140
	合計	2,773,888,860	-	2,802,000,000	28,111,140

## (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。

. ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 5月11日現在	
該当事項はありません。	

## 「外国債券インデックス マザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

項目	平成26年 5月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	126,007,595
コール・ローン	2,579,506,143
国債証券	216,722,072,160
派生商品評価勘定	10,560,808
未収入金	1,941,491
未収利息	2,111,422,374
前払費用	116,184,054
差入委託証拠金	53,294,649
流動資産合計	221,720,989,274
資産合計	221,720,989,274
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,396,150
前受収益	20,544
未払金	211,244
未払解約金	406,443,513
流動負債合計	416,071,451
負債合計	416,071,451
純資産の部	
元本等	
元本	88,033,748,891
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	133,271,168,932
元本等合計	221,304,917,823
純資産合計	221,304,917,823
負債純資産合計	221,720,989,274

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 5月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)債券先物取引 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 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>派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 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)

	平成26年 5月11日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	96,807,388,714円
中間計算期間中の追加設定元本額	9,116,078,238円
中間計算期間中の一部解約元本額	17,889,718,061円
計算日の元本額	88,033,748,891円
計算日の元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	4,179,128,946円
外国債券オープン(3ヶ月決算型)	207,538,473円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	1,741,756,497円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	1,252,534,917円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	669,739,051円

SBI資産設計オープン(分配型)	8,330,865円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	3,758,150,659円
世界経済インデックスファンド	620,889,654円
マイセレクション25	12,800,154円
マイセレクション50	6,256,169円
マイセレクション75	4,443,191円
DCマイセレクション25	1,063,404,373円
DCマイセレクション50	954,232,198円
DCマイセレクション75	604,828,366円
DC外国債券インデックス・オープン	1,216,713,371円
DCマイセレクションS25	381,339,804円
DCマイセレクションS50	314,471,204円
DCマイセレクションS75	132,910,482円
DCターゲット・イヤール ファンド2015	1,325,846円
DCターゲット・イヤール ファンド2025	42,737,701円
DCターゲット・イヤール ファンド2035	29,820,655円
DCターゲット・イヤール ファンド2045	10,871,958円
DC世界経済インデックスファンド	568,555,954円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	11,829,110,161円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	271,183,338円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	18,055,932円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	6,853,193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)	236,805,875円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	821,769,463円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,258,797,751円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	11,037,478,205円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,584,222,275円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	8,439,309,315円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,179,490,714円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,953,774,893円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	2,682,572,670円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	3,394,624,663円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,247,245,820円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	3,008,199,449円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	471,942,459円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	624,111,225円
F0Fs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	2,773,445,701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)	879,589,128円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	558,867,418円
外国債券ファンド・シリーズ1	151,702,006円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,058,494,837円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,594,534,395円
分散投資コア戦略ファンドA	74,476,070円
分散投資コア戦略ファンドS	181,492,653円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	57,992円

DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	178,807円
コア投資戦略ファンド(切替型)	195,782,125円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	22,817,461円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	23,567,564円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	46,957,702円
FOFs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	10,623,457,143円
2. 計算日における受益権総数	88,033,748,891口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5139円 (25,139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

	平成26年 5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)国債証券 「(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の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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。

## (有価証券に関する注記)

平成26年 5月11日現在
該当事項はありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの  
債券関連

区分	種類	平成26年 5月11日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買 建	1,708,488,527	-	1,717,310,325	8,821,798
	合計	1,708,488,527	-	1,717,310,325	8,821,798

## (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。

## 通貨関連

区分	種類	平成26年 5月11日現在			
		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	958,832,918	-	955,698,000	3,134,918
	カナダドル	95,855,006	-	96,655,200	800,194
	イギリスポンド	185,502,340	-	185,878,800	376,460
	ユーロ	1,118,556,776	-	1,112,857,900	5,698,876
	計	2,358,747,040	-	2,351,089,900	7,657,140
	合計	2,358,747,040	-	2,351,089,900	7,657,140

## (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。

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 5月11日現在
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」の状況

## (1)貸借対照表

項目	平成26年 5月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,272,957,348
コール・ローン	458,814,026

株式	154,686,650,844
投資信託受益証券	117,307,995
投資証券	3,440,299,059
派生商品評価勘定	132,606,099
未収入金	28,804,722
未収配当金	343,927,998
未収利息	612
差入委託証拠金	895,399,015
流動資産合計	165,376,767,718
資産合計	165,376,767,718
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,296,975
未払株式払込金	1,923,386
未払解約金	381,288,926
流動負債合計	384,509,287
負債合計	384,509,287
純資産の部	
元本等	
元本	98,635,357,735
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	66,356,900,696
元本等合計	164,992,258,431
純資産合計	164,992,258,431
負債純資産合計	165,376,767,718

## (2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 5月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券及び投資証券 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>2. デリバティブの評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
<p>3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
<p>4. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>(1)受取配当金 原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券の配当落日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 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)

	平成26年 5月11日現在
<p>1. 中間計算期間の期首元本額</p> <p>中間計算期間中の追加設定元本額</p> <p>中間計算期間中の一部解約元本額</p> <p>計算日の元本額</p>	<p>107,252,940,490円</p> <p>10,105,237,930円</p> <p>18,722,820,685円</p> <p>98,635,357,735円</p>
<p>計算日の元本額の内訳</p> <p>SBI資産設計オープン(資産成長型)</p> <p>SBI資産設計オープン(分配型)</p> <p>SMT グローバル株式インデックス・オープン</p> <p>世界経済インデックスファンド</p> <p>マイセレクション25</p> <p>マイセレクション50</p> <p>マイセレクション75</p> <p>外国株式インデックス・オープン</p>	<p>1,148,770,708円</p> <p>13,455,530円</p> <p>18,757,004,917円</p> <p>987,955,896円</p> <p>10,784,383円</p> <p>27,195,591円</p> <p>33,268,964円</p> <p>1,066,561,085円</p>

DCマイセレクション25	858,782,895円
DCマイセレクション50	4,456,341,227円
DCマイセレクション75	4,650,073,887円
DC外国株式インデックス・オープン	5,629,841,128円
DCマイセレクションS25	315,729,201円
DCマイセレクションS50	1,479,927,414円
DCマイセレクションS75	1,005,093,458円
DCターゲット・イヤールファンド2015	4,036,463円
DCターゲット・イヤールファンド2025	138,947,954円
DCターゲット・イヤールファンド2035	142,099,123円
DCターゲット・イヤールファンド2045	68,199,851円
DC世界経済インデックスファンド	889,616,791円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	13,077,538,182円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	81,323,986円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	51,360,653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)	263,567,110円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	530,441,809円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,885,242,530円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	3,474,441,447円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,495,975,453円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,883,261,662円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	952,584,512円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	5,981,445,212円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	8,081,733,497円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,383,334,998円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	951,375,799円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,022,114,097円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	328,951,951円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,690,953,929円
FOFs用外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	4,784,605,599円
外国株式ファンド・シリーズ1	618,402,749円
コア投資戦略ファンド(安定型)	922,812,107円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,858,615,607円
分散投資コア戦略ファンドA	64,909,044円
分散投資コア戦略ファンドS	212,097,463円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	294,854円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	98,285円
コア投資戦略ファンド(切替型)	233,701,076円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	108,502,020円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,985,638円
2. 計算日における受益権総数	98,635,357,735口

3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6727円 (16,727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

	平成26年 5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「(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の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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つた場合、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。

## (有価証券に関する注記)

平成26年 5月11日現在
該当事項はありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの  
株式関連

区分	種類	平成26年 5月11日現在			
		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	6,551,385,048	-	6,682,797,530	131,412,482
	合計	6,551,385,048	-	6,682,797,530	131,412,482

## (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。

#### 通貨関連

区分	種類	平成26年 5月11日現在			
		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	43,807,368	-	43,718,100	89,268
	オーストラリアドル	7,600,000	-	7,611,200	11,200
	イギリスポンド	10,362,390	-	10,326,600	35,790
	計	61,769,758	-	61,655,900	113,858
	売 建				
	アメリカドル	10,167,800	-	10,167,000	800
	香港ドル	13,119,000	-	13,110,000	9,000
	ユーロ	14,069,700	-	14,069,000	700
計	37,356,500	-	37,346,000	10,500	
合計	99,126,258	-	99,001,900	103,358	

#### (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。

#### ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 5月11日現在
該当事項はありません。

#### 「J-REITインデックス マザーファンド」の状況

##### (1)貸借対照表

項目	平成26年 5月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	431,711,374
投資証券	24,046,368,300
派生商品評価勘定	5,544,700
未収配当金	192,208,084
未収利息	576
差入委託証拠金	10,864,000
流動資産合計	24,686,697,034

資産合計	24,686,697,034
負債の部	
流動負債	
前受金	3,895,700
未払金	340,152,844
未払解約金	5,287,905
流動負債合計	349,336,449
負債合計	349,336,449
純資産の部	
元本等	
元本	20,196,797,093
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,140,563,492
元本等合計	24,337,360,585
純資産合計	24,337,360,585
負債純資産合計	24,686,697,034

## (2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 5月11日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>不動産投信指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益の計上基準 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)

	平成26年 5月11日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	16,019,431,941円
中間計算期間中の追加設定元本額	5,474,745,261円
中間計算期間中の一部解約元本額	1,297,380,109円
計算日の元本額	20,196,797,093円
計算日の元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	773,226,546円
SBI資産設計オープン(分配型)	9,444,698円
SMT J-REITインデックス・オープン	5,497,456,927円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	11,148,106,133円
コア投資戦略ファンド(安定型)	810,223,795円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,477,636,461円
分散投資コア戦略ファンドA	56,299,970円
分散投資コア戦略ファンドS	168,427,741円
コア投資戦略ファンド(切替型)	181,184,946円
J-REITインデックス・オープン	74,789,876円
2. 計算日における受益権総数	20,196,797,093口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2050円 (12,050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

	平成26年 5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)投資証券 「(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の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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。

## (有価証券に関する注記)

平成26年 5月11日現在

該当事項はありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの  
投資証券関連

区分	種類	平成26年 5月11日現在			
		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	284,970,300	-	290,515,000	5,544,700
	合計	284,970,300	-	290,515,000	5,544,700

## (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。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 5月11日現在

該当事項はありません。

## 「グローバルREITインデックス マザーファンド」の状況

## (1)貸借対照表

項目	平成26年 5月11日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	272,822,911
コール・ローン	95,362,828
投資証券	30,190,287,328
派生商品評価勘定	13,300
未収入金	502,220
未収配当金	77,691,971
未収利息	127
流動資産合計	30,636,680,685
資産合計	30,636,680,685
負債の部	
流動負債	

派生商品評価勘定	131,815
未払金	214,887,433
未払解約金	510,302
流動負債合計	215,529,550
負債合計	215,529,550
純資産の部	
元本等	
元本	23,715,925,628
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	6,705,225,507
元本等合計	30,421,151,135
純資産合計	30,421,151,135
負債純資産合計	30,636,680,685

## (2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成26年 5月11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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

(2)為替予約取引による為替差損益の計上基準  
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)

	平成26年 5月11日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	20,717,981,137円
中間計算期間中の追加設定元本額	5,033,278,575円
中間計算期間中の一部解約元本額	2,035,334,084円
計算日の元本額	23,715,925,628円
計算日の元本額の内訳	
ワールド・ファイブインカム・ファンド(毎月決算型)	534,985,845円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	773,917,165円
SBI資産設計オープン(分配型)	9,670,102円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	5,922,756,839円
グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)	13,898,663,055円
コア投資戦略ファンド(安定型)	768,323,405円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,405,628,529円
分散投資コア戦略ファンドA	54,089,009円
分散投資コア戦略ファンドS	159,872,682円
コア投資戦略ファンド(切替型)	176,895,369円
グローバルREITインデックス・オープン	11,123,628円
2. 計算日における受益権総数	23,715,925,628口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2827円 (12,827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

	平成26年 5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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)投資証券 「(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の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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>
------------------------	---

## (有価証券に関する注記)

平成26年 5月11日現在
該当事項はありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

- ・ヘッジ会計が適用されていないもの  
通貨関連

区分	種類	平成26年 5月11日現在			
		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	66,210,700	-	66,085,500	125,200
	カナダドル	3,754,000	-	3,753,600	400
	オーストラリアドル	9,500,700	-	9,514,000	13,300
	イギリスポンド	4,303,075	-	4,302,750	325
	香港ドル	5,247,600	-	5,244,000	3,600
	シンガポールドル	4,891,740	-	4,891,200	540
	ユーロ	35,174,250	-	35,172,500	1,750
	計	129,082,065	-	128,963,550	118,515
	合計	129,082,065	-	128,963,550	118,515

## (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。

- ・ヘッジ会計が適用されているもの

平成26年 5月11日現在
該当事項はありません。

#### 4【委託会社等の概況】

##### (1)【資本金の額】

平成26年5月30日現在の資本金の額	3億円
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。平成26年5月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	374	4,968,020
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	374	4,968,020

##### (3)【その他】

平成26年8月11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条の規定により、「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）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2)委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	8,192,444	10,457,599
前払費用	81,751	114,325
未収委託者報酬	2,210,605	2,735,763
未収運用受託報酬	31,051	15,268
未収入金	676	-
繰延税金資産	61,743	144,183
その他	19,263	3,448
流動資産合計	10,597,535	13,470,589
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 79,281	1 67,359
器具備品	1 103,209	1 87,378
有形固定資産合計	182,491	154,737
無形固定資産		
ソフトウェア	168,561	203,360
その他	1,770	4,686
無形固定資産合計	170,332	208,046
投資その他の資産		
投資有価証券	47,112	69,583
長期前払費用	-	34,773
長期貸付金	31,838	28,838
会員権	25,000	25,000
繰延税金資産	-	117,743
その他	633	553
貸倒引当金	31,838	28,838
投資その他の資産合計	72,746	247,653
固定資産合計	425,570	610,437
資産合計	11,023,105	14,081,027

（単位：千円）

	前事業年度 （平成25年3月31日現在）	当事業年度 （平成26年3月31日現在）
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	19,992	13,353
未払金	1,459,757	1,723,999
未払手数料	942,503	1,169,997
その他未払金	517,254	554,001
未払費用	82,209	44,167
未払法人税等	204,363	1,467,469
未払消費税等	11,940	129,007
賞与引当金	92,832	94,659
その他	21,231	14,376
流動負債合計	1,892,326	3,487,033
<b>固定負債</b>		
資産除去債務	12,281	12,492
退職給付引当金	268,531	313,992
繰延税金負債	303,555	-
固定負債合計	584,368	326,485
負債合計	2,476,694	3,813,518
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	59,500	62,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	5,731,912	7,452,293
利益剰余金合計	7,891,412	9,614,793
株主資本合計	8,541,412	10,264,793
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	4,998	2,715
評価・換算差額等合計	4,998	2,715
純資産合計	8,546,410	10,267,508
負債・純資産合計	11,023,105	14,081,027

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)		(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		19,128,296		22,773,831
運用受託報酬		94,659		55,511
営業収益合計		19,222,955		22,829,342
営業費用				
支払手数料		9,030,246		10,451,296
広告宣伝費		73,287		76,961
公告費		2,244		-
調査費		4,132,154		5,091,105
調査費		207,030		259,236
委託調査費		3,922,394		4,830,390
図書費		2,729		1,479
営業雑経費		1,294,879		1,264,334
通信費		21,905		17,246
印刷費		330,735		327,214
協会費		21,939		22,524
諸会費		757		773
情報機器関連費		874,151		837,859
その他営業雑経費		45,391		58,716
営業費用合計		14,532,812		16,883,698
一般管理費				
給料		2,259,238		2,201,964
役員報酬		78,205		102,330
給料・手当		1,967,177		1,846,450
賞与		213,855		253,183
退職給付費用		64,787		72,029
役員退職慰労金		-		1,070
福利費		190,716		207,122
交際費		879		2,758
旅費交通費		45,160		45,973
租税公課		25,420		42,862
不動産賃借料		129,096		130,938
寄付金		-		3,385
減価償却費		129,966		119,445
諸経費	1	257,947	1	219,615
一般管理費合計		3,103,213		3,047,165
営業利益		1,586,929		2,898,479

（単位：千円）

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	1,919	-
受取利息	6,475	7,464
収益分配金	-	3,234
投資有価証券売却益	924	553
貸倒引当金戻入	3,000	3,000
その他	2,552	1,775
営業外収益合計	14,873	16,027
営業外費用		
長期前払費用償却	-	1 23,222
支払補償費	-	14,648
投資有価証券売却損	14,182	284
その他	361	2,112
営業外費用合計	14,544	40,268
経常利益	1,587,257	2,874,238
特別利益		
投資有価証券売却益	30,000	-
特別利益合計	30,000	-
特別損失		
統合関連損失	484,725	-
特別損失合計	484,725	-
税引前当期純利益	1,132,532	2,874,238
法人税、住民税及び事業税	369,828	1,623,332
法人税等調整額	56,358	502,474
法人税等合計	426,187	1,120,857
当期純利益	706,344	1,753,381

## (3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

（単位：千円）

	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	300,000	-	-
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
合併による増加		350,000	350,000
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	350,000	350,000
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	56,500	2,100,000	2,516,273	4,672,773	4,972,773
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			706,344	706,344	706,344
合併による増加			2,542,294	2,542,294	2,892,294
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	3,215,638	3,218,638	3,568,638
当期末残高	59,500	2,100,000	5,731,912	7,891,412	8,541,412

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	9,859	9,859	4,962,913
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			706,344
合併による増加			2,892,294
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	14,857	14,857	14,857
当期変動額合計	14,857	14,857	3,583,496

当期末残高	4,998	4,998	8,546,410
-------	-------	-------	-----------

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

	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	300,000	350,000	350,000
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	300,000	350,000	350,000

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	59,500	2,100,000	5,731,912	7,891,412	8,541,412
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			1,753,381	1,753,381	1,753,381
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	1,720,381	1,723,381	1,723,381
当期末残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	4,998	4,998	8,546,410
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			1,753,381
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	2,283	2,283	2,283
当期変動額合計	2,283	2,283	1,721,098
当期末残高	2,715	2,715	10,267,508

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

#### 時価のあるもの

決算末日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率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、原則として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) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

#### (2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。

#### (3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度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。

### 4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 注記事項

## （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 （平成25年3月31日）		当事業年度 （平成26年3月31日）	
建 物	23,594	千円	35,517	千円
器具備品	235,212	〃	188,630	〃
計	258,807	〃	224,147	〃

## （損益計算書関係）

## 1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）		当事業年度 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）	
諸経費	97,199	千円	73,276	千円
長期前払費用償却	-	〃	23,222	〃

## （株主資本等変動計算書関係）

## 前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成24年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成24年3月31日	平成24年6月29日

## 4. 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（千円）	配当金の 原資	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28日

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28日

4. 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

平成26年6月30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（千円）	配当金の 原資	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成26年3月31日	平成26年6月30日

（リ - ス取引関係）

該当事項はありません。

## （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、資金運用については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、必要な資金については内部留保を充てております。

## （2）金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクはきわめて低いものと考えております。また、投資有価証券は投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

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

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

売上債権の管理については、社内規程を定め、随時確認を行うなどの管理を行っております。なお、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、信用リスクはきわめて低いものと考えております。

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、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）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。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払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。

## 2. 金融商品の時価に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（注2）を参照ください）。

前事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
（1）現金及び預金	8,192,444	8,192,444	-
（2）未収委託者報酬	2,210,605	2,210,605	-
（3）投資有価証券 その他有価証券	47,112	47,112	-
（4）未払金	(1,459,757)	(1,459,757)	-

（\*）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。

当事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
（1）現金及び預金	10,457,599	10,457,599	-
（2）未収委託者報酬	2,735,763	2,735,763	-
（3）投資有価証券 その他有価証券	69,583	69,583	-
（4）未払金	(1,723,999)	(1,723,999)	-
（5）未払法人税等	(1,467,469)	(1,467,469)	-

（\*）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。

## （注1） 金融商品の時価の算定方法

## （1）現金及び預金、並びに（2）未収委託者報酬

これらは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）投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

## （4）未払金、並びに（5）未払法人税等

これらは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。

## （注2） 金銭債権等の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

	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	8,192,444	-	-	-
未収委託者報酬	2,210,605	-	-	-

当事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

	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	10,457,599	-	-	-
未収委託者報酬	2,735,763	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	7,743	21,044	-

## （有価証券関係）

## 1．その他有価証券

前事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位：千円）

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	45,159	37,315	7,843
小計	45,159	37,315	7,843
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	1,952	2,030	77
小計	1,952	2,030	77
合計	47,112	39,345	7,766

当事業年度（平成26年3月31日現在）

（単位：千円）

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	61,633	57,226	4,406
小計	61,633	57,226	4,406
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	7,950	8,138	188
小計	7,950	8,138	188
合計	69,583	65,365	4,218

## 2．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
114,040	30,924	14,182

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
23,757	553	284

## （デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

## （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．退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成25年3月31日）	当事業年度 （平成26年3月31日）
（1）退職給付債務	268,531	313,992
（2）退職給付引当金	268,531	313,992

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。  
2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

## 3．退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成25年3月31日）	当事業年度 （平成26年3月31日）
（1）退職給付費用	64,787	72,029

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。  
2．金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で13,971千円、当事業年度で13,998千円であります。

## 4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

## （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 （平成25年3月31日）		当事業年度 （平成26年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	16,142	千円	102,368	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	11,347	〃	10,277	〃
賞与引当金損金算入限度超過額	35,285	〃	33,736	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	95,704	〃	111,906	〃
減価償却超過額	1,067	〃	-	〃
その他	11,680	〃	13,094	〃
繰延税金資産 小計	171,228	〃	271,384	〃
評価性引当額	11,347	〃	-	〃
繰延税金資産 合計	159,881	〃	271,384	〃
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	2,767	〃	1,503	〃
投資有価証券売却益益金不算入額	398,925	〃	7,953	〃
繰延税金負債 合計	401,693	〃	9,457	〃
繰延税金資産（負債）の純額	241,812	〃	261,926	〃

## 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．法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）の施行に伴い、「復興特別法人税に関する政令の一部を改正する政令」（平成26年政令第151号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については従来の38.01%から35.64%に変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が9,649千円減少し、当事業年度に費用計上された法人税等の金額が9,649千円増加しております。

## （持分法損益等）

該当事項はありません。

（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 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド （ブラジル・リアルコース）	2,429,898千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載していません。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド （ブラジル・リアルコース）	3,172,592千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載していません。

（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

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	三井住友 トラスト・ ホールディン グス(株)	東京都 千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員の 兼任	経営指導料 の支払	97,199	-	-

- （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りません。  
2．取引条件及び取引条件の決定方針等  
経営指導料  
取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	三井住友 トラスト・ ホールディン グス(株)	東京都 千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員の 兼任	経営指導料 の支払	73,276	-	-

- （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りません。  
2．取引条件及び取引条件の決定方針等  
経営指導料  
取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

## （イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

## (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 平成24年4月1日 至 平成25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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
兄弟 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	投信販売 代行手数料等 の支払	6,006,973	未払手数料	613,819
							投資助言費用 の支払	2,226,006	その他 未払金	221,229

(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

投信販売代行手数料

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。

投資助言費用

各助言案件について、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。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
兄弟 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	投信販売 代行手数料等 の支払	6,745,672	未払手数料	794,830
							投資助言費用 の支払	2,631,233	その他 未払金	239,120

(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

投信販売代行手数料

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。

投資助言費用

各助言案件について、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。

## (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（平成25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、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（平成26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）

## （企業結合等関係）

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

当社は、平成24年1月24日開催の取締役会における決議に基づき、中央三井アセットマネジメント株式会社と平成24年4月1日を効力発生日として合併する旨の「合併契約書」を平成24年1月31日付で締結いたしました。上記契約に基づき、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社は、平成24年4月1日付で合併いたしました。

## 1. 企業結合の概要

## (1) 結合当事企業の名称及び当該事業の内容

## 結合企業

名称 当社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

## 被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

## (2) 企業結合日

平成24年4月1日

## (3) 企業結合の法的形式

当社を吸収合併存続会社、中央三井アセットマネジメント株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

## (4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

## (5) その他取引の概要に関する事項

旧住友信託銀行グループと旧中央三井トラスト・グループは、平成23年4月1日に経営統合を行い、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（平成23年4月1日付で中央三井トラスト・ホールディングス株式会社が商号変更しております。）が誕生しました。今般、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社のグループ会社として、経営統合の目的に鑑み、統合効果を最大化する一環として、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社が合併し「三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社」として発足しました。

## 2. 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成20年12月26日）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成20年12月26日）に基づき、共通支配下の取引として処理いたしました。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	2,848,803円51銭	3,422,502円93銭
1株当たり当期純利益金額	235,448円31銭	584,460円49銭

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

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 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月 1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益	706,344千円	1,753,381千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	706,344千円	1,753,381千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

# 独立監査人の中間監査報告書

平成26年7月11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

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

山田信之

印

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SBI資産設計オープン（資産成長型）の平成25年11月12日から平成26年5月11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。

## 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。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

## 中間監査意見

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、SBI資産設計オープン（資産成長型）の平成26年5月11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（平成25年11月12日から平成26年5月11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。

## 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

1. 上記は、当社が、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. 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成26年6月11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

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	白川 芳樹	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊藤 浩之	印

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平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第28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。

### 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。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

### 監査意見

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平成26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すべ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。

### 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

---

上記は、当社が、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。