

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年10月20日提出
【計算期間】	第8期中(自 平成28年1月21日至 平成28年7月20日)
【ファンド名】	世界経済インデックスファンド
【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】	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3番1号
【事務連絡者氏名】	投信業務部長 橋詰 廣志
【連絡場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【電話番号】	03-6737-0522
【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、平成28年 8月31日現在の状況について記載してあります。

【世界経済インデックスファンド】

（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	19,409,010,652	98.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		346,227,376	1.75
合計(純資産総額)		19,755,238,028	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）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末（平成22年 1月20日）	473,632,486	473,632,486	13,329	13,329
第2期計算期間末（平成23年 1月20日）	1,022,019,787	1,022,019,787	12,972	12,972
第3期計算期間末（平成24年 1月20日）	1,737,011,301	1,737,011,301	12,000	12,000
第4期計算期間末（平成25年 1月21日）	2,751,494,290	2,755,095,142	15,282	15,302
第5期計算期間末（平成26年 1月20日）	4,684,090,831	4,689,249,062	18,162	18,182
第6期計算期間末（平成27年 1月20日）	10,344,646,326	10,354,724,017	20,530	20,550
第7期計算期間末（平成28年 1月20日）	16,216,119,873	16,216,119,873	18,276	18,276
平成27年 8月末日	14,835,828,128		20,009	
9月末日	14,910,480,976		19,163	
10月末日	16,376,258,082		20,319	
11月末日	16,855,308,135		20,352	
12月末日	17,113,664,519		19,847	
平成28年 1月末日	17,092,978,255		19,011	
2月末日	16,852,224,402		18,170	
3月末日	18,348,399,406		19,190	
4月末日	18,460,817,613		18,937	
5月末日	18,873,315,751		18,854	
6月末日	18,174,653,909		17,751	
7月末日	19,335,301,576		18,463	
8月末日	19,755,238,028		18,449	

【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21年 1月16日～平成22年 1月20日	0
第2期計算期間	平成22年 1月21日～平成23年 1月20日	0
第3期計算期間	平成23年 1月21日～平成24年 1月20日	0
第4期計算期間	平成24年 1月21日～平成25年 1月21日	20
第5期計算期間	平成25年 1月22日～平成26年 1月20日	20
第6期計算期間	平成26年 1月21日～平成27年 1月20日	20
第7期計算期間	平成27年 1月21日～平成28年 1月20日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	平成21年 1月16日～平成22年 1月20日	33.3
第2期計算期間	平成22年 1月21日～平成23年 1月20日	2.7
第3期計算期間	平成23年 1月21日～平成24年 1月20日	7.5
第4期計算期間	平成24年 1月21日～平成25年 1月21日	27.5
第5期計算期間	平成25年 1月22日～平成26年 1月20日	19.0
第6期計算期間	平成26年 1月21日～平成27年 1月20日	13.1
第7期計算期間	平成27年 1月21日～平成28年 1月20日	11.0
第8期中間計算期間	平成28年 1月21日～平成28年 7月20日	2.0

(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	257,390,140,400	81.79
	ポーランド	201,060,000	0.06
	小計	257,591,200,400	81.85
地方債証券	日本	18,096,203,625	5.75
特殊債券	日本	23,788,756,219	7.56
社債券	日本	12,076,304,000	3.84
	オーストラリア	402,687,000	0.13

	フランス	301,172,000	0.10
	オランダ	201,118,000	0.06
	スウェーデン	200,565,000	0.06
	アメリカ	100,571,000	0.03
	小計	13,282,417,000	4.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,938,237,383	0.62
合計(純資産総額)		314,696,814,627	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	日本	605,640,000	0.19

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

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

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	148,459,992,190	98.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,704,271,949	1.13
合計(純資産総額)		150,164,264,139	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	1,596,600,000	1.06

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

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

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	85,985,758,579	41.88
	フランス	20,185,974,607	9.83
	イタリア	19,704,359,263	9.60
	イギリス	16,570,207,482	8.07
	ドイツ	14,927,148,007	7.27
	スペイン	11,088,998,628	5.40
	ベルギー	5,229,379,115	2.55
	オランダ	4,734,118,818	2.31
	カナダ	4,202,807,754	2.05
	オーストラリア	3,841,188,311	1.87
	オーストリア	3,152,451,674	1.54
	メキシコ	1,752,356,674	0.85
	アイルランド	1,636,978,161	0.80
	デンマーク	1,403,235,159	0.68
	フィンランド	1,239,594,787	0.60
	ポーランド	1,168,347,257	0.57
	スウェーデン	1,009,263,487	0.49
	マレーシア	982,711,402	0.48
	南アフリカ	934,569,838	0.46
	シンガポール	769,870,868	0.37
ノルウェー	515,665,302	0.25	
スイス	476,167,719	0.23	
	小計	201,511,152,892	98.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,800,169,757	1.85
合計(純資産総額)		205,311,322,649	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	561,308,890	0.27
	買建	ドイツ	899,113,036	0.44

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		1,902,693,200	0.93

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

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

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	148,625,771,623	58.16
	イギリス	18,287,092,468	7.16
	スイス	9,819,597,762	3.84
	カナダ	9,539,787,176	3.73
	ドイツ	9,116,903,662	3.57
	フランス	8,827,256,986	3.45
	オーストラリア	6,303,066,469	2.47
	オランダ	4,361,511,947	1.71
	アイルランド	4,133,237,780	1.62
	スペイン	2,944,324,240	1.15
	スウェーデン	2,751,316,293	1.08
	香港	2,254,102,058	0.88
	デンマーク	1,843,640,175	0.72
	イタリア	1,750,971,257	0.69
	シンガポール	1,692,892,381	0.66
	ベルギー	1,347,920,529	0.53
	ジャージー	1,320,572,916	0.52
	バミューダ	1,058,196,303	0.41
	フィンランド	972,759,678	0.38
	キュラソー	917,935,373	0.36
	イスラエル	675,782,461	0.26
	ノルウェー	623,295,344	0.24
	ケイマン	619,558,153	0.24
	ルクセンブルク	266,262,466	0.10
	ニュージーランド	211,519,473	0.08
	パナマ	163,159,890	0.06
ポルトガル	161,415,738	0.06	
オーストリア	157,685,656	0.06	

	リベリア	94,733,887	0.04
	英ヴァージン諸島	70,736,081	0.03
	パプアニューギニア	54,590,584	0.02
	マン島	23,309,656	0.01
	モーリシャス	11,252,559	0.00
	小計	241,002,159,024	94.31
投資信託受益証券	オーストラリア	199,725,840	0.08
	香港	48,219,283	0.02
	シンガポール	21,225,312	0.01
	小計	269,170,435	0.11
投資証券	アメリカ	5,047,036,584	1.98
	オーストラリア	678,769,800	0.27
	フランス	402,361,862	0.16
	イギリス	275,572,159	0.11
	香港	131,123,370	0.05
	シンガポール	107,863,434	0.04
	カナダ	55,865,166	0.02
	小計	6,698,592,375	2.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,571,321,564	2.96
合計(純資産総額)		255,541,243,398	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	4,847,842,137	1.90
	買建	カナダ	431,296,742	0.17
	買建	ドイツ	1,215,779,866	0.48
	買建	イギリス	791,969,571	0.31
	買建	オーストラリア	275,032,608	0.11

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

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

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		223,644,600	0.09

(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	ブラジル	2,222,769,070	10.14
	インドネシア	2,189,061,111	9.99
	ポーランド	2,177,146,069	9.94
	メキシコ	2,174,938,129	9.93
	トルコ	2,130,326,900	9.72
	南アフリカ	2,064,533,280	9.42
	マレーシア	2,019,621,716	9.22
	タイ	1,724,343,745	7.87
	コロンビア	1,620,139,331	7.39
	ハンガリー	1,210,338,528	5.52
	ロシア	1,196,097,261	5.46
	ペルー	419,314,292	1.91
	フィリピン	99,331,458	0.45
	チリ	24,418,321	0.11
		小計	21,272,379,211
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		637,776,471	2.91
合計(純資産総額)		21,910,155,682	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		349,499,620	1.60
	売建		8,752,000	0.04

(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	韓国	4,117,972,468	14.35
	台湾	3,342,879,282	11.65
	ケイマン	3,218,728,656	11.22
	中国	2,925,094,063	10.20
	インド	2,425,484,850	8.45
	ブラジル	2,024,525,526	7.06
	南アフリカ	1,729,941,331	6.03
	香港	1,198,375,710	4.18
	メキシコ	1,049,804,611	3.66
	ロシア	1,006,273,813	3.51
	マレーシア	768,873,371	2.68
	インドネシア	757,906,620	2.64
	タイ	654,511,313	2.28
	フィリピン	398,789,322	1.39
	ポーランド	328,934,440	1.15
	トルコ	322,987,887	1.13
	チリ	321,652,450	1.12
	バミューダ	262,413,649	0.91
	カタール	253,621,093	0.88
	アラブ首長国連邦	238,215,965	0.83
	コロンビア	146,039,176	0.51
	オランダ	126,248,584	0.44
	ハンガリー	87,518,982	0.31
	ギリシャ	72,680,250	0.25
	チェコ	59,525,364	0.21
	エジプト	47,339,310	0.16
	アメリカ	24,660,437	0.09
	マン島	22,593,340	0.08
ペルー	22,569,139	0.08	
マルタ共和国	16,798,289	0.06	
	小計	27,972,959,291	97.50
投資信託受益証券	ブラジル	70,524,786	0.25
投資証券	南アフリカ	84,907,464	0.30
	メキシコ	28,377,149	0.10
	トルコ	13,593,381	0.05
	小計	126,877,994	0.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		520,858,968	1.82
合計(純資産総額)		28,691,221,039	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	547,033,533	1.91

(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		46,838,005	0.16
	売建		10,744,096	0.04

(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】

【世界経済インデックスファンド】

	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	平成21年 1月16日～平成22年 1月20日	440,530,128	85,183,261	355,346,867
第2期計算期間	平成22年 1月21日～平成23年 1月20日	627,431,255	194,904,418	787,873,704
第3期計算期間	平成23年 1月21日～平成24年 1月20日	911,791,372	252,161,321	1,447,503,755
第4期計算期間	平成24年 1月21日～平成25年 1月21日	907,508,119	554,585,762	1,800,426,112
第5期計算期間	平成25年 1月22日～平成26年 1月20日	1,918,803,387	1,140,113,813	2,579,115,686
第6期計算期間	平成26年 1月21日～平成27年 1月20日	3,411,351,368	951,621,550	5,038,845,504
第7期計算期間	平成27年 1月21日～平成28年 1月20日	5,409,151,344	1,574,902,402	8,873,094,446
第8期中間計算期間	平成28年 1月21日～平成28年 7月20日	2,148,926,315	623,583,773	10,398,436,988

(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、「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8期中間計算期間(平成28年 1月21日から平成28年 7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。

【世界経済インデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 (平成28年 1月20日現在)	第8期中間計算期間 (平成28年 7月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	337,962,521	419,257,640
親投資信託受益証券	15,941,264,767	19,050,528,365
未収入金	-	1,250,000
未収利息	509	-
流動資産合計	16,279,227,797	19,471,036,005
資産合計	16,279,227,797	19,471,036,005
負債の部		
流動負債		
未払解約金	19,031,787	37,368,284
未払受託者報酬	4,330,588	4,793,630
未払委託者報酬	38,975,221	43,142,646
未払利息	-	644
その他未払費用	770,328	480,076
流動負債合計	63,107,924	85,785,280
負債合計	63,107,924	85,785,280
純資産の部		
元本等		
元本	8,873,094,446	10,398,436,988
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	7,343,025,427	8,986,813,737
(分配準備積立金)	1,403,825,005	1,316,855,665
元本等合計	16,216,119,873	19,385,250,725
純資産合計	16,216,119,873	19,385,250,725
負債純資産合計	16,279,227,797	19,471,036,005

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期中間計算期間 自 平成27年 1月21日 至 平成27年 7月20日	第8期中間計算期間 自 平成28年 1月21日 至 平成28年 7月20日
営業収益		
受取利息	63,367	12,375
有価証券売買等損益	633,024,443	409,473,598
営業収益合計	633,087,810	409,485,973
営業費用		
支払利息	-	66,953
受託者報酬	3,373,896	4,793,630
委託者報酬	30,364,954	43,142,646
その他費用	337,329	501,610
営業費用合計	34,076,179	48,504,839
営業利益又は営業損失（ ）	599,011,631	360,981,134
経常利益又は経常損失（ ）	599,011,631	360,981,134
中間純利益又は中間純損失（ ）	599,011,631	360,981,134
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（ ）	52,393,408	1,636,315
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,305,800,822	7,343,025,427
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,064,398,979	1,800,923,301
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,064,398,979	1,800,923,301
剰余金減少額又は欠損金増加額	908,013,409	516,479,810
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	908,013,409	516,479,810
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	8,008,804,615	8,986,813,737

(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7期 (平成28年 1月20日現在)	第8期中間計算期間 (平成28年 7月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	8,873,094,446口	10,398,436,988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) 1.8276円 (18,276円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8642円 (18,642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8期中間計算期間 (平成28年 7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。 (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。

	第8期中間計算期間 (平成28年 7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	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。

（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7期 自 平成27年 1月21日 至 平成28年 1月20日	第8期中間計算期間 自 平成28年 1月21日 至 平成28年 7月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	5,038,845,504円	8,873,094,446円
期中追加設定元本額	5,409,151,344円	2,148,926,315円
期中一部解約元本額	1,574,902,402円	623,583,773円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成28年 7月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,216,126,382
国債証券	258,720,055,450

	平成28年 7月20日現在
項目	金額（円）
地方債証券	18,028,342,310
特殊債券	24,201,748,080
社債券	13,777,443,390
未収利息	692,725,731
前払金	490,000
前払費用	4,790,853
差入委託証拠金	640,000
流動資産合計	316,642,362,196
資産合計	316,642,362,196
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	491,296
未払解約金	236,600,824
未払利息	1,868
その他未払費用	6,219
流動負債合計	237,100,207
負債合計	237,100,207
純資産の部	
元本等	
元本	222,111,397,825
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	94,293,864,164
元本等合計	316,405,261,989
純資産合計	316,405,261,989
負債純資産合計	316,642,362,196

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成28年 7月20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、社債券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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</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28年 7月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	222,111,397,825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 106,804,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.4245円 (1万口当たり純資産額) (14,245円)

（注）担保資産の有価証券は、「国債証券」であります。上記金額には、約定未受渡債券を含んでおります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 7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。

（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	平成28年 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 1月21日
期首元本額	246,359,831,966円
期中追加設定元本額	20,773,594,910円
期中一部解約元本額	45,022,029,051円
期末元本額	222,111,397,825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）	2,897,001,024円
S B I 資産設計オープン（分配型）	23,136,300円
S M T 国内債券インデックス・オープン	7,980,580,781円
世界経済インデックスファンド	611,345,399円
マイセレクション25	67,613,785円
マイセレクション50	65,780,722円
マイセレクション75	18,094,536円
D Cマイセレクション25	13,792,332,431円
D Cマイセレクション50	15,377,579,026円
D Cマイセレクション75	4,412,881,101円
D C日本債券インデックス・オープン	427,657,950円
D C日本債券インデックス・オープンS	64,840,808,726円
D C日本債券インデックス・オープンP	27,580,280,304円
D CマイセレクションS25	5,572,059,511円
D CマイセレクションS50	5,921,136,596円
D CマイセレクションS75	1,163,837,177円
D Cターゲット・イヤー ファンド2025	1,253,234,520円
D Cターゲット・イヤー ファンド2035	736,380,839円
D Cターゲット・イヤー ファンド2045	195,170,600円
D C世界経済インデックスファンド	722,676,829円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	1,040,413,752円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	11,917,219円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	111,202,765円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	19,703,021円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	857,124円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	453,622,554円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	634,345,116円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	128,153,794円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	230,125,328円

区分	平成28年 7月20日現在
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	6,772,356,335円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,248,309,589円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,603,412,300円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,086,490,113円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	1,661,160,881円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,669,373,682円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,541,633,229円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,888,878,262円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,662,203,917円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	203,667,064円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,859,110,334円
日本債券ファンド・シリーズ1	8,548,998,583円
コア投資戦略ファンド(安定型)	3,410,179,078円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,060,633,081円
分散投資コア戦略ファンドA	1,072,784,332円
分散投資コア戦略ファンドS	447,206,591円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	18,164,545円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	267,595,287円
国内債券SMTBセレクション(SMA専用)	16,331,459,862円
コア投資戦略ファンド(切替型)	793,538,118円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	57,731,625円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	33,818,285円
SMT インデックスバランス・オープン	78,043,771円
債券コア戦略ファンド	1,658,569円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	698,407,489円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	4,802,426,833円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(平成28年 7月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建	613,611,296	-	613,120,000	491,296
	合計	613,611,296	-	613,120,000	491,296

(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。

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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成28年 7月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,304,266,753
株式	149,889,575,440
派生商品評価勘定	57,521,180
未収入金	600,486,083
未収配当金	202,946,409
差入委託証拠金	50,501,000
流動資産合計	152,105,296,865
資産合計	152,105,296,865
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	957,700
前受金	56,584,000
未払解約金	451,238,950
未払利息	2,003
その他未払費用	5,585
流動負債合計	508,788,238
負債合計	508,788,238
純資産の部	
元本等	
元本	132,187,497,596
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,409,011,031
元本等合計	151,596,508,627
純資産合計	151,596,508,627
負債純資産合計	152,105,296,865

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成28年 7月20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> <p>先物取引</p>

平成28年 7月20日現在	
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 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 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。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

平成28年 7月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	132,187,497,596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 1.1468円 (1万口当たり純資産額) (11,468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28年 7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	<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>

	平成28年 7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>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>

（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	平成28年 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 1月21日
期首元本額	117,031,123,296円
期中追加設定元本額	21,686,206,802円
期中一部解約元本額	6,529,832,502円
期末元本額	132,187,497,596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）	1,076,137,146円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,885,371,739円
SBI資産設計オープン（分配型）	30,386,062円
SMT TOPIXインデックス・オープン	8,391,904,993円
世界経済インデックスファンド	868,767,056円
マイセクション25	30,080,268円
マイセクション50	76,812,251円
マイセクション75	72,198,303円
日本株式インデックス・オープン	16,795,853,830円
DCマイセクション25	6,135,911,237円
DCマイセクション50	18,481,175,306円
DCマイセクション75	15,774,349,746円
DC日本株式インデックス・オープン	4,894,526,602円
DCマイセクションS25	2,542,445,706円
DCマイセクションS50	7,121,380,716円
DCマイセクションS75	4,208,415,330円

区分	平成28年 7月20日現在
DC日本株式インデックス・オープンS	3,642,280,281円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	520,657,737円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	592,223,740円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	312,598,946円
DC世界経済インデックスファンド	1,136,075,537円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	376,193,095円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	44,326,787円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	129,658,360円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	79,690,549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）	829,650,193円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	3,113,947円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	301,076,653円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	1,025,535,647円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	177,841,664円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	1,094,692,672円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,675,937,719円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,320,589,193円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	6,918,087,428円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,205,913,956円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,005,818,075円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,480,458,439円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,688,155,490円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	808,548,505円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,131,973,418円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	91,779,807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）	1,856,299,579円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,302,064,956円
日本株式ファンド・シリーズ2	910,028,488円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	69,988,869円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	102,283,300円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	205,809,462円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	13,089,610円
SMT インデックスバランス・オープン	84,366,714円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	3,664,972,489円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成28年 7月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)

市場取引	株価指数先物取引 買建	1,248,306,520	-	1,304,870,000	56,563,480
合計		1,248,306,520	-	1,304,870,000	56,563,480

(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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成28年 7月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	271,663,372
コール・ローン	1,703,440,053
国債証券	204,358,027,499
派生商品評価勘定	15,690,616
未収入金	2,866,642
未収利息	1,671,308,863
前払金	2,757,005
前払費用	56,920,842
差入委託証拠金	109,860,789
流動資産合計	208,192,535,681
資産合計	208,192,535,681
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,434,521
未払金	119,915
未払解約金	163,379,926
未払利息	2,616
その他未払費用	5,315
流動負債合計	166,942,293
負債合計	166,942,293
純資産の部	
元本等	
元本	80,555,468,092
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	127,470,125,296
元本等合計	208,025,593,388
純資産合計	208,025,593,388
負債純資産合計	208,192,535,681

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成28年 7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

平成28年 7月20日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(1)先物取引 債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成28年 7月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	80,555,468,092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 2.5824円 (1万口当たり純資産額) (25,824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28年 7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	<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>

(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	平成28年 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 1月21日
期首元本額	79,917,600,176円
期中追加設定元本額	6,148,729,923円
期中一部解約元本額	5,510,862,007円
期末元本額	80,555,468,092円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,771,889,938円

区分	平成28年 7月20日現在
外国債券オープン（3ヶ月決算型）	152,574,959円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	1,038,758,768円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	702,351,901円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,668,626,128円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,955,062円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	5,300,865,246円
世界経済インデックスファンド	2,019,019,436円
マイセレクション25	6,213,673円
マイセレクション50	4,536,462円
マイセレクション75	3,087,668円
DCマイセレクション25	1,269,927,396円
DCマイセレクション50	1,129,153,526円
DCマイセレクション75	654,409,523円
DC外国債券インデックス・オープン	1,488,541,778円
DCマイセレクションS25	545,290,145円
DCマイセレクションS50	434,861,024円
DCマイセレクションS75	172,292,569円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	53,724,268円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	41,435,569円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	16,334,276円
DC世界経済インデックスファンド	2,546,725,637円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	459,032,181円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	183,478,318円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	7,650,652円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	3,410,752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）	98,378,177円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	300,600,170円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	438,555,800円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	367,666,169円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	754,417,757円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,648,894,593円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	918,036,433円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,917,451,601円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,298,096,601円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	1,515,806,887円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	950,011,626円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	2,117,401,267円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	343,895,774円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	477,990,605円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,629,113,636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）	929,134,061円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	613,185,507円
外国債券ファンド・シリーズ1	497,241,251円

区分	平成28年 7月20日現在
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,807,608,076円
コア投資戦略ファンド(成長型)	6,990,979,209円
分散投資コア戦略ファンドA	821,735,857円
分散投資コア戦略ファンドS	1,383,164,507円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	53,999,765円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	737,242,710円
コア投資戦略ファンド(切替型)	619,159,630円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	161,902,338円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	92,984,494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)	421,975,660円
SMT インデックスバランス・オープン	205,275,304円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	22,021,541,608円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	974,199,936円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	759,674,228円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(平成28年 7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	1,125,287,925	-	1,122,530,920	2,757,005
	合計	1,125,287,925	-	1,122,530,920	2,757,005

(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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(平成28年 7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	1,432,539,400	-	1,447,552,500	15,013,100
	アメリカドル	652,317,120	-	660,940,800	8,623,680
	カナダドル	53,632,830	-	54,471,000	838,170
	ユーロ	616,899,530	-	622,544,000	5,644,470

	イギリスポンド	109,689,920	-	109,596,700	93,220
	合計	1,432,539,400	-	1,447,552,500	15,013,100

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成28年 7月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	6,572,349,392
コール・ローン	139,173,846
株式	244,214,305,779
投資信託受益証券	276,720,069
投資証券	7,025,554,671
派生商品評価勘定	374,798,658
未収入金	12,705,338
未収配当金	251,819,084
差入委託証拠金	1,400,755,838
流動資産合計	260,268,182,675
資産合計	260,268,182,675
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	168,159
前受金	374,589,789
未払解約金	132,655,028
未払利息	213
その他未払費用	1,206
流動負債合計	507,414,395
負債合計	507,414,395
純資産の部	
元本等	
元本	141,181,052,134
剰余金	
剰余金又は欠損金()	118,579,716,146
元本等合計	259,760,768,280
純資産合計	259,760,768,280
負債純資産合計	260,268,182,675

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成28年 7月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	平成28年 7月20日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	平成28年 7月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	141,181,052,134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 1.8399円 (1万口当たり純資産額) (18,399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28年 7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。

	平成28年 7月20日現在

（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	平成28年 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 1月21日
期首元本額	132,735,037,669円
期中追加設定元本額	14,729,906,549円
期中一部解約元本額	6,283,892,084円
期末元本額	141,181,052,134円
期末元本額の内訳	
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	2,473,638,371円
S B I 資産設計オープン（分配型）	19,436,410円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	27,016,604,443円
世界経済インデックスファンド	2,892,037,109円
マイセレクション25	4,555,059円
マイセレクション50	19,950,460円
マイセレクション75	22,938,633円
外国株式インデックス・オープン	1,119,780,994円
D C マイセレクション25	931,100,016円
D C マイセレクション50	4,777,708,816円
D C マイセレクション75	5,045,080,084円
D C 外国株式インデックス・オープン	6,604,479,863円
D C マイセレクションS25	384,358,985円
D C マイセレクションS50	1,839,889,426円
D C マイセレクションS75	1,332,633,362円
D C ターゲット・イヤー ファンド2025	162,033,505円
D C ターゲット・イヤー ファンド2035	184,304,249円
D C ターゲット・イヤー ファンド2045	97,289,117円
D C 世界経済インデックスファンド	3,691,625,658円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,795,972,370円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	33,662,573円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	24,000,115円

区分	平成28年 7月20日現在
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	123,761,704円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	181,310,713円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	660,683,803円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	114,231,965円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	703,196,350円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,502,599,450円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	695,795,174円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,413,927,760円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	3,861,389,174円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	1,933,770,129円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	668,366,041円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	662,832,756円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	215,643,076円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,727,343,546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)	3,588,009,091円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,088,578,526円
コア投資戦略ファンド(安定型)	4,949,302,045円
コア投資戦略ファンド(成長型)	12,272,510,312円
分散投資コア戦略ファンドA	1,484,844,588円
分散投資コア戦略ファンドS	2,435,476,457円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	238,919,509円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	352,720,654円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,103,284,783円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	695,150,566円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	44,522,721円
SMT インデックスバランス・オープン	292,211,099円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	3,852,699,824円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	29,042,653,110円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,802,237,590円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(平成28年 7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	7,416,359,822	-	7,790,949,611	374,589,789
合計		7,416,359,822	-	7,790,949,611	374,589,789

(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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

（平成28年 7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	415,289,210	-	415,248,500	40,710
	アメリカドル	252,327,600	-	252,327,600	-
	カナダドル	21,970,170	-	21,969,900	270
	ユーロ	63,067,140	-	63,072,000	4,860
	イギリスポンド	38,873,240	-	38,875,200	1,960
	スイスフラン	21,562,600	-	21,516,000	46,600
	オーストラリアドル	17,488,460	-	17,487,800	660
合計		415,289,210	-	415,248,500	40,710

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成28年 7月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	152,649,227
コール・ローン	101,826,232
国債証券	20,870,734,717
未収利息	279,311,733
前払費用	48,536,141
流動資産合計	21,453,058,050
資産合計	21,453,058,050
負債の部	
流動負債	
未払金	38,504,416
未払解約金	7,095,851

	平成28年 7月20日現在
項目	金額（円）
未払利息	156
その他未払費用	1,175
流動負債合計	45,601,598
負債合計	45,601,598
純資産の部	
元本等	
元本	14,275,857,271
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,131,599,181
元本等合計	21,407,456,452
純資産合計	21,407,456,452
負債純資産合計	21,453,058,050

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成28年 7月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
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</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>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</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28年 7月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	14,275,857,271口
2. 1口当たり純資産額	1.4996円

	平成28年 7月20日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額)	(14,996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28年 7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。

（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	平成28年 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 1月21日
期首元本額	11,182,201,829円
期中追加設定元本額	3,419,257,860円
期中一部解約元本額	325,602,418円
期末元本額	14,275,857,271円
期末元本額の内訳	

区分	平成28年 7月20日現在
S M T 新興国債券インデックス・オープン	3,227,749,905円
世界経済インデックスファンド	2,168,939,952円
D C 新興国債券インデックス・オープン	2,855,736,589円
D C 世界経済インデックスファンド	2,832,369,874円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,761,108,632円
新興国債券インデックス・オープン（S M A 専用）	20,755,053円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	59,749,371円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	830,004,894円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	175,034,179円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	103,874,943円
新興国債券インデックス・オープン	10,837,247円
S M T インデックスバランス・オープン	229,696,632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。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	平成28年 7月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	926,111,342
コール・ローン	27,875,899
株式	27,108,018,369
投資信託受益証券	64,608,707
投資証券	135,960,771
派生商品評価勘定	29,060,727
未収入金	1,717,516
未収配当金	190,442,127
差入委託証拠金	213,512,850
流動資産合計	28,697,308,308
資産合計	28,697,308,308
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	484,742
前受金	28,721,936
未払金	803,088,353
未払株式払込金	1,468,130
未払解約金	9,587,153
未払利息	42
その他未払費用	207
流動負債合計	843,350,563
負債合計	843,350,563

	平成28年 7月20日現在
項目	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	13,199,375,194
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,654,582,551
元本等合計	27,853,957,745
純資産合計	27,853,957,745
負債純資産合計	28,697,308,308

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成28年 7月20日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>

平成28年 7月20日現在	
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)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)

平成28年 7月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	13,199,375,194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 2.1102円 (1万口当たり純資産額) (21,102円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

平成28年 7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ぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

	平成28年 7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>

（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	平成28年 7月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 1月21日
期首元本額	11,448,031,282円
期中追加設定元本額	1,844,916,606円
期中一部解約元本額	93,572,694円
期末元本額	13,199,375,194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	5,924,367,456円
世界経済インデックスファンド	1,609,253,894円
DC 新興国株式インデックス・オープン	2,675,762,940円
DC 世界経済インデックスファンド	2,037,034,972円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	16,002,906円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	134,602,222円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	192,243,129円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	405,049,513円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	22,687,175円

区分	平成28年 7月20日現在
新興国株式インデックス・オープン	15,906,313円
SMT インデックスバランス・オープン	166,464,674円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(平成28年 7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	495,509,469	-	524,231,405	28,721,936
	合計	495,509,469	-	524,231,405	28,721,936

(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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(平成28年 7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	270,312,573	-	270,161,170	151,403
	アメリカドル	18,183,331	-	18,180,870	2,461
	メキシコペソ	20,003,550	-	19,950,000	53,550
	ハンガリーフォリ ント	5,557,950	-	5,557,500	450
	ポーランドズロチ	9,849,622	-	9,856,800	7,178
	香港ドル	169,511,720	-	169,384,000	127,720
	南アフリカランド	47,206,400	-	47,232,000	25,600
	売建	247,201,491	-	247,196,039	5,452
	アメリカドル	245,973,360	-	245,966,400	6,960
	ブラジルリアル	1,228,131	-	1,229,639	1,508
	合計	517,514,064	-	517,357,209	145,951

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

平成28年 8月31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28年8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	470	8,112,326
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	37	161,948
単位型公社債投資信託	0	0
合計	507	8,274,274

(3)【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、平成28年6月30日に社外取締役との責任限定契約に係る規定を追加しました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成28年10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。

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27年4月1日至平成28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27年3月31日現在）	当事業年度 （平成28年3月31日現在）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	12,314,170	16,534,066
前払費用	125,306	102,445
未収委託者報酬	4,518,944	5,528,610
繰延税金資産	116,728	121,367
その他	8,789	5,566
流動資産合計	17,083,939	22,292,056
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 57,461	1 55,487
器具備品	1 116,879	1 90,924
その他	-	1 3,748
有形固定資産合計	174,341	150,160
無形固定資産		
ソフトウェア	197,641	215,175
その他	7,648	5,886
無形固定資産合計	205,290	221,062
投資その他の資産		
投資有価証券	60,277	63,797
長期前払費用	5,425	8,021
長期貸付金	25,838	22,838
会員権	25,000	25,000
繰延税金資産	114,415	123,235
その他	463	235
貸倒引当金	25,838	22,838
投資その他の資産合計	205,581	220,289
固定資産合計	585,213	591,512
資産合計	17,669,152	22,883,569

（単位：千円）

	前事業年度 （平成27年3月31日現在）	当事業年度 （平成28年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	13,868	14,543
未払金	2,578,595	3,057,975
未払手数料	1,896,826	2,223,498
その他未払金	681,769	834,477
未払費用	52,291	64,411
未払法人税等	924,882	1,445,329
未払消費税等	354,256	246,748
賞与引当金	94,769	98,630
その他	56,222	3,100
流動負債合計	4,074,887	4,930,740
固定負債		
資産除去債務	12,707	12,926
退職給付引当金	342,831	389,941
その他	-	3,056
固定負債合計	355,538	405,924
負債合計	4,430,425	5,336,665
純資産の部		
株主資本		
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	65,500	68,500
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	10,419,991	14,729,555
利益剰余金合計	12,585,491	16,898,055
株主資本合計	13,235,491	17,548,055
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	3,235	1,151
評価・換算差額等合計	3,235	1,151
純資産合計	13,238,726	17,546,904
負債・純資産合計	17,669,152	22,883,569

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	28,159,652	32,163,066
運用受託報酬	8,732	-
営業収益合計	28,168,384	32,163,066
営業費用		
支払手数料	12,922,655	14,102,687
広告宣伝費	130,384	126,914
公告費	880	2,765
調査費	5,994,577	6,758,898
調査費	279,702	331,886
委託調査費	5,712,946	6,425,175
図書費	1,928	1,836
営業雑経費	1,299,065	1,399,773
通信費	17,456	17,552
印刷費	330,921	349,902
協会費	23,182	26,659
諸会費	105	105
情報機器関連費	857,009	927,524
その他営業雑経費	70,390	78,029
営業費用合計	20,347,563	22,391,039
一般管理費		
給料	2,185,555	2,123,392
役員報酬	89,055	89,280
給料・手当	1,839,000	1,759,320
賞与	257,499	274,792
退職給付費用	71,270	73,742
福利費	212,286	222,276
交際費	4,491	6,004
旅費交通費	55,788	67,392
租税公課	42,868	73,989
不動産賃借料	130,938	125,339
減価償却費	129,285	126,985
業務委託費	1 45,054	1 209,510
諸経費	167,290	217,580
一般管理費合計	3,044,830	3,246,214
営業利益	4,775,990	6,525,812

	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		6,802		8,092
収益分配金		4,617		2,026
投資有価証券売却益		1,846		350
貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		1,936		5,272
営業外収益合計		18,203		18,742
営業外費用				
長期前払費用償却	1	27,866	1	27,866
支払補償費		7,656		1,893
投資有価証券売却損		117		365
その他		3,283		14
営業外費用合計		38,924		30,139
経常利益		4,755,269		6,514,415
特別損失				
外国税関連費用	2	56,222		-
特別損失合計		56,222		-
税引前当期純利益		4,699,047		6,514,415
法人税、住民税及び事業税		1,667,610		2,183,255
法人税等調整額		30,739		11,403
法人税等合計		1,698,349		2,171,851
当期純利益		3,000,697		4,342,563

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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	
	利益剰余金	その他利益剰余金

	利益準備金	別途積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	株主資本合計
当期首残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,000,697	3,000,697	3,000,697
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	-	2,967,697	2,970,697	2,970,697
当期末残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491

	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	2,715	2,715	10,267,508
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,000,697
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	520	520	520
当期変動額合計	520	520	2,971,217
当期末残高	3,235	3,235	13,238,726

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,342,563	4,342,563	4,342,563
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	-	4,309,563	4,312,563	4,312,563

当期末残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
-------	--------	-----------	------------	------------	------------

	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	3,235	3,235	13,238,726
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,342,563
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	4,386	4,386	4,386
当期変動額合計	4,386	4,386	4,308,177
当期末残高	1,151	1,151	17,546,904

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。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定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。

会計方針の変更

(企業結合に関する会計基準等の適用)

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成25年9月13日。以下「企業結合会計基準」という。）及び「事業分離等に関する会計基準」（企業会計基準第7号 平成25年9月13日。以下「事業分離等会計基準」という。）等を当事業年度から適用し、取得関連費用を発生した事業年度の費用として計上する方法に変更しております。また、当事業年度期首以後実施される企業結合については、暫定的な会計処理の確定による取得原価の配分額の見直しを企業結合日の属する事業年度の財務諸表に反映させる方法に変更しております。

企業結合会計基準等の適用については、企業結合会計基準第58 - 2項（4）及び事業分離等会計基準第57 - 4項（4）に定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首時点から将来にわたって適用しております。

なお、これによる損益及び1株当たり情報に与える影響はありません。

未適用の会計基準等

・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

(1)概要

繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いについて、監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」の枠組み、すなわち企業を5つに分類し、当該分類に応じて繰延税金資産の計上額を見積もる枠組みを基本的に踏襲した上で、以下の取扱いについて必要な見直しが行われております。

(分類1)から(分類5)に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い

(分類2)及び(分類3)に係る分類の要件

(分類2)に該当する企業におけるスケジュールリング不能な将来減算一時差異に関する取扱い

(分類3)に該当する企業における将来の一時差異等加減算前課税所得の合理的な見積可能期間に関する取扱い

(分類4)に係る分類の要件を満たす企業が(分類2)又は(分類3)に該当する場合の取扱い

(2)適用予定日

平成29年3月期の期首より適用予定であります。

(3)当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

表示方法の変更

(損益計算書関係)

前事業年度において、「一般管理費」の「諸経費」に含めていた「業務委託費」は、重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「一般管理費」の「諸経費」に表示していた212,345千円は、「業務委託費」45,054千円、「諸経費」167,290千円として組み替えております。

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27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
建 物	45,415	千円	54,302	千円
器具備品	218,270	"	263,257	"
そ の 他	-	"	841	"
計	263,685	"	318,401	"

(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26年4月1日 至平成27年3月31日)		当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	
業務委託費	37,614	千円	39,733	千円
長期前払費用償却	27,866	"	27,866	"

2外国税関連費用

外国税関連費用56,222千円は、中国税務当局等が平成26年10月31日付に発した「通達79号」に基づき、平成22年3月23日から平成26年11月16日までのQFII(Qualified Foreign Institutional Investors)口座を通じて取得した中

国A株の譲渡所得に対して税率10%で遡及課税される金額を合理的に計算した当社の負担額であります。中国A株に投資している当社の対象ファンドは「中国A株SRIマザーファンド」であり、ファンドの当時の受益者に負担を求めることが事実上不可能であるため、当社等が負担しております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成26年4月1日 至平成27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26年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成26年3月31日	平成26年6月30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27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27年3月31日	平成27年6月30日

当事業年度(自平成27年4月1日 至平成28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27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30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28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28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28年3月31日	平成28年6月30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、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27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	12,314,170	12,314,170	-
(2) 未収委託者報酬	4,518,944	4,518,944	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	60,274	60,274	-
(4) 未払金	(2,578,595)	(2,578,595)	-
(5) 未払法人税等	(924,882)	(924,882)	-

(*) 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28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	16,534,066	16,534,066	-

(2) 未収委託者報酬	5,528,610	5,528,610	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	63,794	63,794	-
(4) 未払金	(3,057,975)	(3,057,975)	-
(5) 未払法人税等	(1,445,329)	(1,445,329)	-

(*) 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) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	平成27年3月31日	平成28年3月31日
非上場株式	3	3

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(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(平成27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	12,314,170	-	-	-
未収委託者報酬	4,518,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,576	16,038	-

当事業年度(平成28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	16,534,066	-	-	-
未収委託者報酬	5,528,610	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	6,265	17,912	-

(有価証券関係)

1. 其他有価証券

前事業年度(平成27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	58,207	53,306	4,901

小計	58,207	53,306	4,901
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,066	2,186	120
小計	2,066	2,186	120
合計	60,274	55,492	4,781

当事業年度(平成28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	10,329	9,998	330
小計	10,329	9,998	330
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	53,465	55,455	1,989
小計	53,465	55,455	1,989
合計	63,794	65,453	1,659

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額3千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

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26年4月1日 至平成27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
34,635	1,846	117

当事業年度(自平成27年4月1日 至平成28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
20,015	350	365

(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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
(1) 退職給付債務	342,831	389,941
(2) 退職給付引当金	342,831	389,941

(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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
(1) 退職給付費用	71,270	73,742

(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14,089千円、当事業年度で14,434千円であります。

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27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	64,846	千円	86,931	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	8,356	"	6,993	"
賞与引当金損金算入限度超過額	31,368	"	30,437	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	110,871	"	119,400	"
外国税関連費用損金不算入額	18,609	"	-	"
その他	5,855	"	7,674	"
繰延税金資産 合計	239,908	"	251,436	"
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	1,546	"	-	"
投資有価証券売却益益金不算入額	7,217	"	6,833	"
繰延税金負債 合計	8,763	"	6,833	"
繰延税金資産の純額	231,144	"	244,602	"

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28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。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する法定実効税率は従来の33.06%から、平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29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30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この税率変更により、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15,263千円、その他有価証券評価差額金が27千円、それぞれ減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が15,236千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26年4月1日 至 平成27年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,363,914千円
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）	3,178,319千円

（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あります。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,979,867千円

（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あります。

（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

重要性がないため、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

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26年4月1日 至 平成27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	8,852,826	未払手数料	1,374,578
							投資助言費用の支払	3,428,200	その他未払金	381,755

（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27年4月1日 至 平成28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	10,100,152	未払手数料	1,682,049
							投資助言費用の支払	4,834,722	その他未払金	460,620

(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27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（平成28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 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	4,412,908円85銭	5,848,968円06銭
1株当たり当期純利益金額	1,000,232円56銭	1,447,521円33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いません。

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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益	3,000,697千円	4,342,563千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,000,697千円	4,342,563千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

独立監査人の監査報告書

平成28年 6 月 3 日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内 知明
--------------------	-------	-------

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27年4月1日から平成28年3月31日までの第30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28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

1. 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。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年9月20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」に掲げられている世界経済インデックスファンドの平成28年1月21日から平成28年7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。

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、世界経済インデックスファンドの平成28年7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（平成28年1月21日から平成28年7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。

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. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。