

【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29年10月20日提出
【計算期間】	第9期中(自 平成29年1月21日至 平成29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 平木 秀樹
【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29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	49,662,958,777	98.79
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		605,968,244	1.21
合計（純資産総額）		50,268,927,021	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
第8期計算期間末（平成29年 1月20日）	22,647,406,597	22,647,406,597	20,148	20,148
平成28年 8月末日	19,755,238,028		18,449	
9月末日	19,908,070,472		18,193	
10月末日	20,613,911,183		18,511	
11月末日	21,779,210,637		19,303	
12月末日	22,562,314,298		20,136	
平成29年 1月末日	22,699,090,568		20,056	
2月末日	23,244,926,341		20,260	
3月末日	24,218,285,600		20,440	
4月末日	26,569,204,572		20,557	
5月末日	33,896,817,554		20,897	
6月末日	41,317,717,482		21,228	
7月末日	43,992,136,566		21,423	
8月末日	50,268,927,021		21,623	

【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
第8期計算期間	平成28年 1月21日～平成29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期計算期間	平成28年 1月21日～平成29年 1月20日	10.2
第9期中間計算期間	平成29年 1月21日～平成29年 7月20日	7.3

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(参考)

国内債券インデックス 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	262,315,432,250	82.20
	ポーランド	200,422,000	0.06
	小計	262,515,854,250	82.27
地方債証券	日本	18,366,851,265	5.76
特殊債券	日本	23,243,704,069	7.28

社債券	日本	11,944,924,750	3.74
	フランス	703,004,000	0.22
	オーストラリア	401,541,000	0.13
	オランダ	201,326,000	0.06
	スウェーデン	199,967,000	0.06
	イギリス	100,901,000	0.03
	小計	13,551,663,750	4.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,426,409,768	0.45
合計(純資産総額)		319,104,483,102	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	151,120,000	0.05

(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	169,212,722,820	98.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,163,622,959	1.26
合計(純資産総額)		171,376,345,779	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	2,253,190,000	1.31

(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	96,618,650,098	41.84
	フランス	23,232,131,143	10.06
	イタリア	22,267,449,608	9.64
	ドイツ	16,377,661,820	7.09
	イギリス	15,487,145,832	6.71
	スペイン	12,914,242,627	5.59
	ベルギー	5,745,139,419	2.49
	オランダ	4,938,300,109	2.14
	オーストラリア	4,923,769,985	2.13
	カナダ	4,800,767,866	2.08
	オーストリア	3,481,646,826	1.51
	メキシコ	1,985,301,901	0.86
	アイルランド	1,889,428,555	0.82
	ポーランド	1,448,486,469	0.63
	デンマーク	1,434,353,513	0.62
	フィンランド	1,427,322,950	0.62
	南アフリカ	1,224,635,805	0.53
	スウェーデン	1,095,905,529	0.47
	マレーシア	967,045,805	0.42
	シンガポール	881,227,758	0.38
ノルウェー	680,828,317	0.29	
スイス	408,027,301	0.18	
	小計	224,229,469,236	97.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,671,213,653	2.89
合計(純資産総額)		230,900,682,889	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
債券先物取引	買建	アメリカ	1,271,802,044	0.55
	買建	ドイツ	1,816,258,174	0.79

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		4,346,913,700	1.88

(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	178,050,357,684	57.38
	イギリス	20,671,167,745	6.66
	フランス	11,676,181,010	3.76
	カナダ	11,645,666,695	3.75
	ドイツ	11,563,541,567	3.73
	スイス	11,055,431,035	3.56
	オーストラリア	7,710,108,487	2.48
	オランダ	5,854,206,775	1.89
	アイルランド	4,357,104,001	1.40
	スペイン	4,302,984,567	1.39
	スウェーデン	3,540,322,178	1.14
	香港	2,910,556,663	0.94
	イタリア	2,474,536,201	0.80
	シンガポール	2,300,028,430	0.74
	デンマーク	2,273,395,704	0.73
	ジャージー	1,536,770,047	0.50
	バミューダ	1,485,751,630	0.48
	ベルギー	1,480,905,353	0.48
	フィンランド	1,279,778,861	0.41
	ノルウェー	843,850,753	0.27
	ケイマン	807,947,035	0.26
	キュラソー	773,699,363	0.25
	イスラエル	573,861,776	0.18
	ルクセンブルク	418,876,948	0.13
オーストリア	296,577,175	0.10	

	ニュージーランド	225,202,476	0.07
	パナマ	205,567,090	0.07
	ポルトガル	198,076,593	0.06
	リベリア	178,140,621	0.06
	パプアニューギニア	71,153,679	0.02
	英ヴァージン諸島	64,663,542	0.02
	マン島	40,974,930	0.01
	モーリシャス	13,465,487	0.00
	小計	290,880,852,101	93.74
投資信託受益証券	オーストラリア	189,191,160	0.06
	香港	60,407,308	0.02
	シンガポール	23,759,016	0.01
	小計	273,357,484	0.09
投資証券	アメリカ	5,793,362,231	1.87
	オーストラリア	677,580,098	0.22
	フランス	413,482,171	0.13
	イギリス	286,377,247	0.09
	香港	161,842,405	0.05
	シンガポール	123,687,865	0.04
	カナダ	64,697,595	0.02
	小計	7,521,029,612	2.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,641,397,683	3.75
合計(純資産総額)		310,316,636,880	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,972,381,418	2.57
	買建	カナダ	496,545,600	0.16
	買建	ドイツ	1,937,827,712	0.62
	買建	イギリス	987,787,908	0.32
	買建	オーストラリア	457,035,562	0.15

(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	928,930,400	0.30
--------	----	-------------	------

(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	メキシコ	3,100,231,261	9.98
	ブラジル	3,079,651,400	9.91
	インドネシア	2,937,455,465	9.45
	ポーランド	2,839,532,543	9.14
	南アフリカ	2,574,391,849	8.29
	トルコ	2,429,568,354	7.82
	タイ	2,344,217,434	7.55
	コロンビア	2,200,108,126	7.08
	ロシア	2,051,273,843	6.60
	マレーシア	1,994,097,739	6.42
	ハンガリー	1,457,412,589	4.69
	チェコ	1,197,953,832	3.86
	ペルー	854,037,127	2.75
	チリ	615,585,412	1.98
	フィリピン	92,233,080	0.30
	小計	29,767,750,054	95.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,301,307,938	4.19
合計(純資産総額)		31,069,057,992	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。

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	ケイマン	6,307,043,166	14.36
	韓国	6,246,027,449	14.22
	台湾	5,015,329,700	11.42
	中国	4,151,541,362	9.45
	インド	3,717,430,712	8.46

	ブラジル	2,977,416,113	6.78
	南アフリカ	2,568,180,086	5.85
	メキシコ	1,477,738,756	3.36
	香港	1,465,626,370	3.34
	ロシア	1,356,664,766	3.09
	インドネシア	974,160,341	2.22
	マレーシア	954,598,610	2.17
	タイ	908,896,552	2.07
	ポーランド	585,805,603	1.33
	チリ	518,019,402	1.18
	トルコ	500,281,615	1.14
	フィリピン	466,977,044	1.06
	バミューダ	432,567,842	0.98
	アラブ首長国連邦	329,915,462	0.75
	カタール	251,658,128	0.57
	コロンビア	191,039,559	0.43
	ギリシャ	162,895,250	0.37
	ハンガリー	153,539,182	0.35
	アメリカ	136,242,559	0.31
	オランダ	124,161,513	0.28
	チェコ	82,613,076	0.19
	エジプト	47,846,360	0.11
	マン島	31,689,198	0.07
	ペルー	25,610,925	0.06
	マルタ共和国	10,079,734	0.02
	小計	42,171,596,435	96.00
投資信託受益証券	ブラジル	87,426,747	0.20
投資証券	南アフリカ	107,497,030	0.24
	メキシコ	37,816,785	0.09
	トルコ	12,696,799	0.03
	小計	158,010,614	0.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,513,268,112	3.44
合計(純資産総額)		43,930,301,908	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	1,516,659,555	3.45

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資 比率 （%）
為替予約取引	買建		202,048,700	0.46

(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期計算期間	平成28年 1月21日～平成29年 1月20日	4,258,831,911	1,891,370,889	11,240,555,468
第9期中間計算期間	平成29年 1月21日～平成29年 7月20日	12,515,624,359	3,906,278,354	19,849,901,473

(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9期中間計算期間(平成29年 1月21日から平成29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8期 (平成29年 1月20日現在)	第9期中間計算期間 (平成29年 7月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,096,333	-
コール・ローン	450,040,608	1,624,415,473
親投資信託受益証券	22,346,107,349	42,411,346,852
未収入金	25,210,000	-
流動資産合計	22,823,454,290	44,035,762,325
資産合計	22,823,454,290	44,035,762,325
負債の部		
流動負債		
未払解約金	118,723,151	1,028,233,537
未払受託者報酬	5,628,158	7,772,282
未払委託者報酬	50,653,351	69,950,482
未払利息	971	3,656
その他未払費用	1,042,062	711,889
流動負債合計	176,047,693	1,106,671,846
負債合計	176,047,693	1,106,671,846
純資産の部		
元本等		
元本	11,240,555,468	19,849,901,473
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	11,406,851,129	23,079,189,006
(分配準備積立金)	1,709,126,623	1,340,068,359
元本等合計	22,647,406,597	42,929,090,479
純資産合計	22,647,406,597	42,929,090,479
負債純資産合計	22,823,454,290	44,035,762,325

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	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	第9期中間計算期間 自 平成29年 1月21日 至 平成29年 7月20日
営業収益		
受取利息	12,375	185
有価証券売買等損益	409,473,598	2,415,819,503
営業収益合計	409,485,973	2,415,819,688
営業費用		
支払利息	66,953	206,548
受託者報酬	4,793,630	7,772,282
委託者報酬	43,142,646	69,950,482
その他費用	501,610	714,348
営業費用合計	48,504,839	78,643,660
営業利益又は営業損失（ ）	360,981,134	2,337,176,028
経常利益又は経常損失（ ）	360,981,134	2,337,176,028
中間純利益又は中間純損失（ ）	360,981,134	2,337,176,028
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（ ）	1,636,315	269,622,457
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	7,343,025,427	11,406,851,129
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,800,923,301	13,653,639,563
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,800,923,301	13,653,639,563
剰余金減少額又は欠損金増加額	516,479,810	4,048,855,257
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	516,479,810	4,048,855,257
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	8,986,813,737	23,079,189,006

(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8期 (平成29年 1月20日現在)	第9期中間計算期間 (平成29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	11,240,555,468口	19,849,901,473口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.0148円 (20,148円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.1627円 (21,627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9期中間計算期間 (平成29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9期中間計算期間 (平成29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8期 自 平成28年 1月21日 至 平成29年 1月20日	第9期中間計算期間 自 平成29年 1月21日 至 平成29年 7月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	8,873,094,446円	11,240,555,468円
期中追加設定元本額	4,258,831,911円	12,515,624,359円
期中一部解約元本額	1,891,370,889円	3,906,278,354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29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	1,013,134,897
国債証券	254,593,294,350

項目	平成29年 7月20日現在
	金額（円）
地方債証券	17,655,985,329
特殊債券	22,608,806,458
社債券	12,714,075,700
未収入金	97,446,704
未収利息	622,092,987
前払費用	14,410,029
流動資産合計	309,319,246,454
資産合計	309,319,246,454
負債の部	
流動負債	
未払金	593,077,200
未払解約金	62,034,553
未払利息	2,280
流動負債合計	655,114,033
負債合計	655,114,033
純資産の部	
元本等	
元本	223,804,524,703
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	84,859,607,718
元本等合計	308,664,132,421
純資産合計	308,664,132,421
負債純資産合計	309,319,246,454

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29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>
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29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	223,804,524,703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 104,338,000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 1.3792円 (1万口当たり純資産額) (13,792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29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29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29年 1月21日

区分	平成29年 7月20日現在
期首元本額	231,388,249,721円
期中追加設定元本額	22,735,576,712円
期中一部解約元本額	30,319,301,730円
期末元本額	223,804,524,703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）	2,983,295,868円
S B I 資産設計オープン（分配型）	21,896,098円
S M T 国内債券インデックス・オープン	9,858,513,850円
世界経済インデックスファンド	1,168,301,694円
D C マイセレクション 2 5	16,146,428,080円
D C マイセレクション 5 0	18,776,761,941円
D C マイセレクション 7 5	5,174,414,945円
D C 日本債券インデックス・オープン	446,194,987円
D C 日本債券インデックス・オープン S	70,789,486,673円
D C 日本債券インデックス・オープン P	31,526,264,559円
D C マイセレクション S 2 5	6,598,782,777円
D C マイセレクション S 5 0	7,463,741,978円
D C マイセレクション S 7 5	1,435,038,847円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,295,664,723円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	902,606,255円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	266,504,125円
D C 世界経済インデックスファンド	928,245,739円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	178,509,060円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,315,597円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	99,113,666円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	16,188,882円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	929,660円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	375,791,057円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	574,830,961円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	105,300,242円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	239,561,716円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	6,094,225,687円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,221,242,204円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	4,522,690,394円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	1,025,286,228円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	407,667,430円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,619,893,926円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	1,579,082,946円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,822,138,071円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,550,616,802円
国内バランス 2 5 V A 1（適格機関投資家専用）	189,497,110円

区分	平成29年 7月20日現在
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,780,042,460円
日本債券ファンド・シリーズ1	9,932,308,273円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	31,896,042円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	425,486,103円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	60,494,207円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	35,620,936円
S M T インデックスバランス・オープン	84,711,636円
S M T 日米インデックスバランス・オープン	2,971,978円
F O F s 用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	10,035,741,050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。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	平成29年 7月20日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,678,452,529
株式	167,039,508,580
派生商品評価勘定	24,987,260
未収入金	21,179,080
未収配当金	190,996,274
差入委託証拠金	62,770,000
流動資産合計	169,017,893,723
資産合計	169,017,893,723
負債の部	
流動負債	
前受金	25,014,800
未払解約金	134,010,849
未払利息	3,778
流動負債合計	159,029,427
負債合計	159,029,427
純資産の部	
元本等	
元本	117,411,625,238
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	51,447,239,058
元本等合計	168,858,864,296
純資産合計	168,858,864,296
負債純資産合計	169,017,893,723

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年 7月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	平成29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	117,411,625,238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 1.4382円 (1万口当たり純資産額) (14,382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29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

	平成29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>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、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29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29年 1月21日
期首元本額	117,889,777,095円
期中追加設定元本額	9,177,465,834円
期中一部解約元本額	9,655,617,691円
期末元本額	117,411,625,238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)	780,112,042円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,964,295,224円
SBI資産設計オープン(分配型)	23,822,198円
SMT TOPIXインデックス・オープン	8,187,691,339円
世界経済インデックスファンド	1,478,412,921円
日本株式インデックス・オープン	8,482,097,745円
DCマイセレクション25	5,531,797,507円

区分	平成29年 7月20日現在
DCマイセレクション50	16,710,098,723円
DCマイセレクション75	15,594,591,565円
DC日本株式インデックス・オープン	4,904,972,002円
DCマイセレクションS25	2,253,466,872円
DCマイセレクションS50	6,630,227,376円
DCマイセレクションS75	4,343,912,452円
DC日本株式インデックス・オープンS	4,204,235,727円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	440,448,124円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	584,203,830円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	324,439,790円
DC世界経済インデックスファンド	1,219,722,215円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	327,233,542円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	25,675,783円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	87,511,047円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	49,447,239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)	550,675,671円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,806,754円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	191,465,936円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	718,275,462円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	106,020,140円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	826,909,140円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,615,712,883円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	986,084,161円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	5,581,504,563円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	825,722,823円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	179,050,475円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,083,995,839円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,200,471,782円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	614,796,425円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	848,062,283円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	68,618,422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)	1,301,774,085円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,910,654,429円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,416,203,131円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	111,127,152円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	142,609,739円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	205,387,913円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	12,454,623円
SMT インデックスバランス・オープン	90,159,814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)	6,672,666,330円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

（平成29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	1,767,462,740	-	1,792,450,000	24,987,260
合計		1,767,462,740	-	1,792,450,000	24,987,260

(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

項目	平成29年 7月20日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	223,084,495
コール・ローン	1,341,191,137
国債証券	222,370,289,508
派生商品評価勘定	1,596,312
未収入金	147,690
未収利息	1,803,223,955
前払金	386,316
前払費用	89,839,938
差入委託証拠金	133,683,474
流動資産合計	225,963,442,825
資産合計	
225,963,442,825	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,625,514
未払金	2,575,770
未払解約金	312,494,874
未払利息	3,019
流動負債合計	327,699,177
負債合計	
327,699,177	
純資産の部	
元本等	
元本	82,972,183,109
剰余金	
剰余金又は欠損金()	142,663,560,539
元本等合計	225,635,743,648
純資産合計	
225,635,743,648	
負債純資産合計	
225,963,442,825	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29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>(1)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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)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29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	82,972,183,109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	<p>1口当たり純資産額 2.7194円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (27,194円)</p>

（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29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29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29年 1月21日
期首元本額	82,975,491,740円
期中追加設定元本額	6,806,264,864円
期中一部解約元本額	6,809,573,495円
期末元本額	82,972,183,109円

区分	平成29年 7月20日現在
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	2,292,440,363円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	899,048,144円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	634,528,720円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	1,817,961,695円
S B I 資産設計オープン（分配型）	12,652,164円
S M T グローバル債券インデックス・オープン	5,583,410,133円
世界経済インデックスファンド	4,560,665,551円
D C マイセレクション 2 5	1,386,363,790円
D C マイセレクション 5 0	1,182,308,328円
D C マイセレクション 7 5	728,933,435円
D C 外国債券インデックス・オープン	1,600,925,782円
D C マイセレクション S 2 5	564,548,356円
D C マイセレクション S 5 0	467,080,016円
D C マイセレクション S 7 5	197,021,976円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	57,123,938円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	52,074,938円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	21,880,265円
D C 世界経済インデックスファンド	3,686,509,580円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	516,488,323円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	79,527,963円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,479,573円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,481,290円
外国債券インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	74,694,127円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	220,354,792円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	362,639,347円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	267,432,125円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	695,356,061円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	3,069,201,723円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	798,108,241円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,808,158,568円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	1,085,037,825円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	329,480,592円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	811,582,405円
グローバルバランスファンド V A 3 5（適格機関投資家専用）	2,068,117,227円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	307,556,526円
バランス F（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	428,334,463円
F O F s 用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,368,922,271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）	906,951,363円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	678,955,757円
外国債券ファンド・シリーズ 1	587,412,347円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,133,397,503円

区分	平成29年 7月20日現在
コア投資戦略ファンド（成長型）	6,088,738,626円
分散投資コア戦略ファンドA	920,765,672円
分散投資コア戦略ファンドS	2,110,694,478円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	107,714,569円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,319,061,707円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,017,644,400円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	199,469,381円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	112,987,276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）	681,780,332円
SMT インデックスバランス・オープン	263,913,820円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	21,836,603,852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）	1,158,157,738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）	1,420,006,293円
外国債券インデックス・ファンド（適格機関投資家専用）	382,497,379円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（平成29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	841,583,308	-	841,196,992	386,316
合計		841,583,308	-	841,196,992	386,316

（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29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	1,112,699,326	-	1,102,055,100	10,644,226
	アメリカドル	512,018,630	-	505,245,600	6,773,030
	カナダドル	46,932,040	-	47,026,900	94,860
	ユーロ	460,043,286	-	456,553,800	3,489,486

イギリスポンド	93,705,370	-	93,228,800	476,570
売建	7,070,540	-	7,069,200	1,340
オーストラリアドル	5,341,140	-	5,341,200	60
南アフリカランド	1,729,400	-	1,728,000	1,400
合計	1,119,769,866	-	1,109,124,300	10,642,886

(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29年 7月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,534,612,632
コール・ローン	259,331,792
株式	297,281,916,919
投資信託受益証券	280,631,465
投資証券	7,600,560,360
派生商品評価勘定	59,822,087
未収入金	21,363,853
未収配当金	296,184,878
差入委託証拠金	1,460,469,923
流動資産合計	310,794,893,909
資産合計	310,794,893,909
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,868,088
前受金	44,752,359
未払金	2,343
未払株式払込金	72,551,648
未払解約金	416,069,044
未払利息	583
流動負債合計	548,244,065
負債合計	548,244,065
純資産の部	
元本等	
元本	135,260,934,519
剰余金	
剰余金又は欠損金()	174,985,715,325
元本等合計	310,246,649,844
純資産合計	310,246,649,844
負債純資産合計	310,794,893,909

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29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</p>

	平成29年 7月20日現在
	<p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	平成29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	135,260,934,519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 2.2937円 (1万口当たり純資産額) (22,937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29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29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29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29年 1月21日
期首元本額	142,760,709,644円
期中追加設定元本額	7,143,018,476円
期中一部解約元本額	14,642,793,601円
期末元本額	135,260,934,519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）	2,483,513,560円
S B I 資産設計オープン（分配型）	15,150,273円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,389,860,954円
世界経済インデックスファンド	5,616,898,939円
外国株式インデックス・オープン	889,855,613円
D C マイセレクション 2 5	911,238,037円
D C マイセレクション 5 0	4,608,219,643円
D C マイセレクション 7 5	4,991,100,246円
D C 外国株式インデックス・オープン	6,972,445,611円
D C マイセレクション S 2 5	371,075,764円
D C マイセレクション S 5 0	1,819,160,619円
D C マイセレクション S 7 5	1,391,781,028円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	138,228,715円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	186,260,148円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	101,804,728円
D C 世界経済インデックスファンド	4,605,917,845円

区分	平成29年 7月20日現在
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,686,940,618円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	24,697,191円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	15,817,085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）	96,623,620円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	118,503,838円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	444,950,577円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	66,817,600円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	521,151,419円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,110,687,161円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	542,190,304円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	3,486,837,191円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	2,602,384,731円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	338,691,597円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	519,372,144円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	550,202,258円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	171,821,057円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,621,592,406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）	2,857,991,176円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,406,817,007円
コア投資戦略ファンド（安定型）	4,161,848,359円
コア投資戦略ファンド（成長型）	9,928,135,998円
分散投資コア戦略ファンドA	1,791,665,101円
分散投資コア戦略ファンドS	3,461,923,205円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	419,955,473円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	557,007,295円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,661,663,301円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	787,995,206円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	47,288,923円
SMT インデックスバランス・オープン	338,090,736円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	3,057,830,425円
外国株式SMTBセクション（SMA専用）	28,304,495,304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）	2,066,434,490円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成29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	4,834,099,152	-	4,878,851,511	44,752,359

合計	4,834,099,152	-	4,878,851,511	44,752,359
----	---------------	---	---------------	------------

(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29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	348,716,940	-	348,515,300	201,640
	アメリカドル	208,173,500	-	208,123,700	49,800
	カナダドル	9,751,830	-	9,768,000	16,170
	ユーロ	85,245,090	-	85,107,000	138,090
	イギリスポンド	34,999,780	-	34,970,400	29,380
	スイスフラン	10,546,740	-	10,546,200	540
合計		348,716,940	-	348,515,300	201,640

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

新興国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	平成29年 7月20日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	706,610,751
コール・ローン	142,041,305
国債証券	28,502,302,877
派生商品評価勘定	17,340
未収利息	371,037,988
前払費用	53,631,416
流動資産合計	29,775,641,677
資産合計	29,775,641,677
負債の部	
流動負債	

	平成29年 7月20日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	45,419
未払金	477,938,531
未払解約金	4,549,822
未払利息	319
流動負債合計	482,534,091
負債合計	482,534,091
純資産の部	
元本等	
元本	17,161,151,039
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	12,131,956,547
元本等合計	29,293,107,586
純資産合計	29,293,107,586
負債純資産合計	29,775,641,677

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成29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> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</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29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		17,161,151,039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)	1.7069円 (17,069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29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29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29年 1月21日
期首元本額	14,621,557,846円
期中追加設定元本額	2,877,266,669円
期中一部解約元本額	337,673,476円
期末元本額	17,161,151,039円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	3,376,282,886円
世界経済インデックスファンド	3,771,782,819円
DC新興国債券インデックス・オープン	3,217,675,725円
DC世界経済インデックスファンド	3,106,103,455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）	1,967,914,157円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	18,815,136円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	92,107,405円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,108,133,180円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	169,567,698円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	94,547,497円
新興国債券インデックス・オープン	14,752,969円
SMT インデックスバランス・オープン	223,468,112円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（平成29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	24,269,901	-	24,224,482	45,419
	ロシアルーブル	24,269,901	-	24,224,482	45,419
	売建	24,269,901	-	24,252,561	17,340
	アメリカドル	24,269,901	-	24,252,561	17,340
合計		48,539,802	-	48,477,043	28,079

(注)時価の算定方法

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

新興国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	平成29年 7月20日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,416,014,427
コール・ローン	175,937,123
株式	40,407,163,505
投資信託受益証券	85,261,635
投資証券	166,448,045
派生商品評価勘定	21,586,036
未収入金	38,946,715
未収配当金	267,279,228
差入委託証拠金	98,203,493
流動資産合計	42,676,840,207
資産合計	42,676,840,207
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	284,041
前受金	21,540,436
未払金	1,321,853,776
未払解約金	107,336,503
未払利息	396
流動負債合計	1,451,015,152
負債合計	1,451,015,152
純資産の部	
元本等	
元本	14,821,600,781
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	26,404,224,274
元本等合計	41,225,825,055
純資産合計	41,225,825,055
負債純資産合計	42,676,840,207

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29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</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)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</p>

	平成29年 7月20日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(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</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	平成29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		14,821,600,781口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.7815円 (27,815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29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29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29年 1月21日
期首元本額	13,041,313,502円
期中追加設定元本額	2,057,737,726円
期中一部解約元本額	277,450,447円
期末元本額	14,821,600,781円
期末元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	6,188,530,517円
世界経済インデックスファンド	2,498,637,644円
DC新興国株式インデックス・オープン	3,065,938,750円
DC世界経済インデックスファンド	2,075,017,259円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	12,298,242円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	188,019,379円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	240,442,785円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	360,179,871円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	21,617,841円
新興国株式インデックス・オープン	14,210,687円
SMT インデックスバランス・オープン	156,707,806円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（平成29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	507,882,832	-	529,423,268	21,540,436
	合計	507,882,832	-	529,423,268	21,540,436

(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

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	560,405,941	-	560,159,100	246,841
	アメリカドル	63,817,200	-	63,783,000	34,200
	メキシコペソ	55,410,300	-	55,332,000	78,300
	ユーロ	12,121,441	-	12,121,300	141
	トルコリラ	13,349,700	-	13,339,200	10,500
	ハンガリーフォリ ント	14,981,000	-	14,952,600	28,400
	香港ドル	265,160,500	-	265,105,000	55,500
	マレーシアリン ギット	40,448,800	-	40,486,000	37,200
	南アフリカランド	95,117,000	-	95,040,000	77,000
	売建	469,988,400	-	469,980,000	8,400
	アメリカドル	469,988,400	-	469,980,000	8,400
合計	1,030,394,341	-	1,030,139,100	238,441	

(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29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29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	484	9,108,727
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	56	218,550
単位型公社債投資信託	0	0
合計	540	9,327,277

（３）【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成29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28年4月1日至平成29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28年3月31日現在)	当事業年度 (平成29年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	16,534,066	20,260,630
前払費用	102,445	143,622
未収委託者報酬	5,528,610	5,252,944
繰延税金資産	121,367	61,677
その他	5,566	5,474
流動資産合計	22,292,056	25,724,348
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 55,487	1 47,993
器具備品	1 90,924	1 73,765
その他	1 3,748	1 2,830
有形固定資産合計	150,160	124,589
無形固定資産		
ソフトウェア	215,175	221,499
その他	5,886	6,656
無形固定資産合計	221,062	228,156
投資その他の資産		
投資有価証券	63,797	71,153
長期前払費用	8,021	9,828
長期貸付金	22,838	19,838
会員権	25,000	25,000
繰延税金資産	123,235	137,359
その他	235	145
貸倒引当金	22,838	19,838
投資その他の資産合計	220,289	243,485
固定資産合計	591,512	596,231
資産合計	22,883,569	26,320,580

（単位：千円）

	前事業年度 （平成28年3月31日現在）	当事業年度 （平成29年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	14,543	13,630
未払金	3,057,975	2,883,924
未払収益分配金	-	45
未払手数料	2,223,498	2,099,678
その他未払金	834,477	784,201
未払費用	64,411	67,780
未払法人税等	1,445,329	863,230
未払消費税等	246,748	91,120
賞与引当金	98,630	98,072
その他	3,100	3,100
流動負債合計	4,930,740	4,020,860
固定負債		
資産除去債務	12,926	13,148
退職給付引当金	389,941	437,197
その他	3,056	2,065
固定負債合計	405,924	452,411
負債合計	5,336,665	4,473,271
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	68,500	71,500
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	14,729,555	19,026,944
利益剰余金合計	16,898,055	21,198,444
株主資本合計	17,548,055	21,848,444
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,151	1,134
評価・換算差額等合計	1,151	1,134
純資産合計	17,546,904	21,847,309
負債・純資産合計	22,883,569	26,320,580

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	32,163,066	30,245,448
営業収益合計	32,163,066	30,245,448
営業費用		
支払手数料	14,102,687	12,880,325
広告宣伝費	126,914	95,688
公告費	2,765	3,094
調査費	6,758,898	6,239,223
調査費	331,886	360,520
委託調査費	6,425,175	5,876,937
図書費	1,836	1,766
営業雑経費	1,399,773	1,460,885
通信費	17,552	24,920
印刷費	349,902	370,785
協会費	26,659	30,665
諸会費	105	105
情報機器関連費	927,524	943,725
その他営業雑経費	78,029	90,684
営業費用合計	22,391,039	20,679,217
一般管理費		
給料	2,123,392	1,874,710
役員報酬	89,280	89,520
給料・手当	1,759,320	1,526,244
賞与	274,792	258,946
退職給付費用	73,742	76,106
福利費	222,276	221,018
交際費	6,004	5,612
旅費交通費	67,392	61,961
租税公課	73,989	106,691
不動産賃借料	125,339	113,697
減価償却費	126,985	134,710
業務委託費	1 209,510	1 486,690
諸経費	217,580	223,685
一般管理費合計	3,246,214	3,304,885
営業利益	6,525,812	6,261,346

（単位：千円）

	前事業年度		当事業年度	
	（自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）		（自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		8,092		4,669
収益分配金		2,026		129
投資有価証券売却益		350		307
貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		5,272		1,591
営業外収益合計		18,742		9,697
営業外費用				
長期前払費用償却	1	27,866	1	4,644
支払補償費		1,893		-
投資有価証券売却損		365		604
その他		14		0
営業外費用合計		30,139		5,249
経常利益		6,514,415		6,265,794
税引前当期純利益		6,514,415		6,265,794
法人税、住民税及び事業税		2,183,255		1,889,846
法人税等調整額		11,403		45,558
法人税等合計		2,171,851		1,935,405
当期純利益		4,342,563		4,330,389

（ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,330,389	4,330,389	4,330,389
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	-	4,297,389	4,300,389	4,300,389
当期末残高	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444

	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	1,151	1,151	17,546,904
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,330,389
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	16	16	16
当期変動額合計	16	16	4,300,405
当期末残高	1,134	1,134	21,847,309

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。

ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

(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

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ28千円増加しております。

追加情報

「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）を当事業年度から適用しております。

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28年3月31日)		当事業年度 (平成29年3月31日)	
	建 物	54,302	千円	62,231
器具備品	263,257	"	298,576	"
そ の 他	841	"	1,759	"
計	318,401	"	362,567	"

（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27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
	業務委託費	39,733	千円	39,286
長期前払費用償却	27,866	"	4,644	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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28年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成28年3月31日	平成28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29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29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29年3月31日	平成29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。

当事業年度（平成29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	20,260,630	20,260,630	-
(2) 未収委託者報酬	5,252,944	5,252,944	-
(3) 投資有価証券 其他有価証券	71,149	71,149	-
(4) 未払金	(2,883,924)	(2,883,924)	-
(5) 未払法人税等	(863,230)	(863,230)	-

（*）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28年3月31日	平成29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	-

当事業年度(平成29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	20,260,630	-	-	-
未収委託者報酬	5,252,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	10,402	18,313	2,499

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(平成29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	15,551	14,322	1,228
小計	15,551	14,322	1,228
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	55,598	58,463	2,864
小計	55,598	58,463	2,864
合計	71,149	72,785	1,635

(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

当事業年度(自平成28年4月1日 至平成29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
-----	---------	---------

12,699	307	604
--------	-----	-----

(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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
(1) 退職給付債務	389,941	437,197
(2) 退職給付引当金	389,941	437,197

(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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
(1) 退職給付費用	73,742	76,106

(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14,434千円、当事業年度で14,321千円であります。

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28年3月31日)		当事業年度 (平成29年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	86,931	千円	28,688	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	6,993	"	6,074	"
賞与引当金損金算入限度超過額	30,437	"	30,265	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	119,400	"	133,869	"
その他	7,674	"	6,972	"
繰延税金資産 合計	251,436	"	205,870	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	6,833	"
繰延税金負債 合計	6,833	"	6,833	"
繰延税金資産の純額	244,602	"	199,037	"

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。

(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いません。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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）	3,568,158千円

（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

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。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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	9,520,775	未払手数料	1,563,065
							投資助言費用の支払	4,979,747	その他未払金	455,942

(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）

当事業年度（平成29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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	5,848,968円06銭	7,282,436円46銭
1株当たり当期純利益金額	1,447,521円33銭	1,443,463円05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27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
当期純利益	4,342,563千円	4,330,389千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,342,563千円	4,330,389千円

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29年 6 月 2 日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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 竹内 知明 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28年4月1日から平成29年3月31日までの第31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29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. X B R 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29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29年1月21日から平成29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29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29年1月21日から平成29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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。