

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2018年10月22日提出
【計算期間】	第10期中(自 2018年1月23日至 2018年7月22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】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 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、2018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	57,782,799,479	99.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		554,676,986	0.95
合計(純資産総額)		58,337,476,465	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 (2010年 1月20日)	473,632,486	473,632,486	13,329	13,329
第2期計算期間末 (2011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 (2012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 (2013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 (2014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 (2015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 (2016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 (2017年 1月20日)	22,647,406,597	22,647,406,597	20,148	20,148
第9期計算期間末 (2018年 1月22日)	54,410,632,155	54,410,632,155	23,375	23,375
2017年 8月末日	50,268,927,021		21,623	
9月末日	53,815,037,321		22,110	
10月末日	53,033,364,418		22,401	
11月末日	53,767,849,641		22,531	
12月末日	53,827,257,298		23,004	
2018年 1月末日	53,851,823,611		23,076	
2月末日	53,404,723,871		22,342	
3月末日	53,821,267,300		21,912	
4月末日	55,415,665,450		22,327	
5月末日	55,108,821,207		21,893	
6月末日	56,209,382,346		21,835	
7月末日	58,086,266,859		22,410	

8月末日	58,337,476,465		22,236	
------	----------------	--	--------	--

【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	2009年 1月16日～2010年 1月20日	0
第2期計算期間	2010年 1月21日～2011年 1月20日	0
第3期計算期間	2011年 1月21日～2012年 1月20日	0
第4期計算期間	2012年 1月21日～2013年 1月21日	20
第5期計算期間	2013年 1月22日～2014年 1月20日	20
第6期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	20
第7期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	0
第8期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	0
第9期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率(%)
第1期計算期間	2009年 1月16日～2010年 1月20日	33.3
第2期計算期間	2010年 1月21日～2011年 1月20日	2.7
第3期計算期間	2011年 1月21日～2012年 1月20日	7.5
第4期計算期間	2012年 1月21日～2013年 1月21日	27.5
第5期計算期間	2013年 1月22日～2014年 1月20日	19.0
第6期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	13.1
第7期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	11.0
第8期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	10.2
第9期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	16.0
第10期中間計算期間	2018年 1月23日～2018年 7月22日	3.5

(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	335,238,537,450	82.60
地方債証券	日本	22,806,795,770	5.62

特殊債券	日本	29,118,951,895	7.17
社債券	日本	14,758,729,560	3.64
	フランス	1,098,432,000	0.27
	オーストラリア	500,520,000	0.12
	オランダ	200,788,000	0.05
	アメリカ	107,149,000	0.03
	イギリス	100,550,000	0.02
	スウェーデン	100,190,000	0.02
	小計		16,866,358,560
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,827,770,565	0.45
合計(純資産総額)		405,858,414,240	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	300,760,000	0.07

(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	218,807,465,970	98.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,428,840,444	1.10
合計(純資産総額)		221,236,306,414	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	2,617,585,000	1.18

(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	111,704,317,237	43.57
	フランス	26,042,534,216	10.16
	イタリア	22,485,835,057	8.77
	ドイツ	17,460,051,449	6.81
	イギリス	16,687,636,470	6.51
	スペイン	14,689,524,303	5.73
	ベルギー	6,441,276,596	2.51
	オーストラリア	5,275,493,233	2.06
	カナダ	5,240,506,067	2.04
	オランダ	5,231,592,019	2.04
	オーストリア	3,832,276,140	1.49
	メキシコ	2,091,421,815	0.82
	アイルランド	2,018,576,096	0.79
	デンマーク	1,535,970,123	0.60
	ポーランド	1,529,978,538	0.60
	フィンランド	1,521,168,039	0.59
	南アフリカ	1,340,551,729	0.52
	マレーシア	1,181,563,150	0.46
	シンガポール	988,512,986	0.39
	スウェーデン	929,646,999	0.36
ノルウェー	593,596,689	0.23	
スイス	338,226,390	0.13	
	小計	249,160,255,341	97.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,243,184,651	2.82
合計(純資産総額)		256,403,439,992	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。

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	1,336,468,302	0.52

買建	ドイツ	1,771,441,490	0.69
----	-----	---------------	------

(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		4,287,815,600	1.67

(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	216,534,749,332	60.71
	イギリス	21,417,359,084	6.00
	フランス	12,982,129,642	3.64
	カナダ	12,790,296,025	3.59
	ドイツ	12,505,781,428	3.51
	スイス	11,800,004,658	3.31
	オーストラリア	8,034,532,302	2.25
	オランダ	6,488,901,274	1.82
	アイルランド	4,980,445,398	1.40
	スペイン	3,836,033,539	1.08
	スウェーデン	3,418,260,287	0.96
	香港	3,086,656,647	0.87
	イタリア	2,380,638,811	0.67
	デンマーク	2,245,033,255	0.63
	バミューダ	1,554,302,984	0.44
	シンガポール	1,550,241,385	0.43
	ジャージー	1,541,405,569	0.43
	フィンランド	1,422,680,218	0.40
	ベルギー	1,368,156,015	0.38
	ノルウェー	959,972,276	0.27
	ケイマン	835,753,759	0.23
	キュラソー	803,058,301	0.23
イスラエル	726,390,098	0.20	

	ルクセンブルク	457,849,818	0.13
	ニュージーランド	305,781,975	0.09
	オーストリア	291,902,543	0.08
	パナマ	240,229,341	0.07
	ポルトガル	210,444,154	0.06
	リベリア	189,535,590	0.05
	英ヴァージン諸島	92,487,396	0.03
	パプアニューギニア	86,344,498	0.02
	マン島	68,196,180	0.02
	モーリシャス	9,356,270	0.00
	小計	335,214,910,052	93.98
投資信託受益証券	オーストラリア	196,098,749	0.05
	香港	63,208,545	0.02
	小計	259,307,294	0.07
投資証券	アメリカ	6,064,555,320	1.70
	オーストラリア	579,205,713	0.16
	フランス	464,675,439	0.13
	イギリス	270,528,496	0.08
	香港	197,987,153	0.06
	シンガポール	139,763,064	0.04
	カナダ	64,837,507	0.02
	小計	7,781,552,692	2.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		13,419,236,147	3.76
合計(純資産総額)		356,675,006,185	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	8,508,617,568	2.39
	買建	カナダ	549,096,886	0.15
	買建	ドイツ	2,258,751,068	0.63
	買建	イギリス	1,063,578,516	0.30
	買建	オーストラリア	611,581,392	0.17

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
為替予約取引	売建		337,540,200	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	メキシコ	4,452,431,257	10.27
	ポーランド	4,136,996,192	9.54
	ブラジル	4,094,599,057	9.44
	インドネシア	4,066,644,396	9.38
	タイ	3,764,825,225	8.68
	南アフリカ	3,457,631,712	7.97
	コロンビア	3,424,468,825	7.90
	ロシア	3,099,219,256	7.15
	マレーシア	2,498,490,365	5.76
	チェコ	2,052,604,830	4.73
	ハンガリー	2,051,865,036	4.73
	トルコ	1,408,479,757	3.25
	ペルー	1,368,307,065	3.16
	チリ	1,134,969,928	2.62
	フィリピン	122,323,338	0.28
ウルグアイ	104,557,809	0.24	
	小計	41,238,414,048	95.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,123,802,618	4.90
合計(純資産総額)		43,362,216,666	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	8,194,538,178	16.06
	韓国	7,265,811,401	14.24

	台湾	6,046,648,924	11.85
	中国	5,158,763,280	10.11
	インド	4,720,381,180	9.25
	南アフリカ	2,916,975,283	5.72
	ブラジル	2,754,610,059	5.40
	香港	1,803,881,723	3.53
	ロシア	1,622,765,809	3.18
	メキシコ	1,482,268,594	2.90
	マレーシア	1,221,740,042	2.39
	タイ	1,173,672,907	2.30
	インドネシア	1,001,537,033	1.96
	ポーランド	606,804,294	1.19
	フィリピン	512,024,944	1.00
	チリ	511,410,475	1.00
	バミューダ	493,760,246	0.97
	カタール	457,850,375	0.90
	アラブ首長国連邦	335,493,272	0.66
	トルコ	233,080,497	0.46
	コロンビア	220,027,342	0.43
	アメリカ	168,522,804	0.33
	ギリシャ	162,111,972	0.32
	ハンガリー	150,476,755	0.29
	チェコ	90,211,917	0.18
	エジプト	66,939,069	0.13
	ルクセンブルク	36,840,279	0.07
	パキスタン	34,399,690	0.07
	マン島	31,992,234	0.06
	ペルー	23,653,492	0.05
	シンガポール	6,981,964	0.01
	小計	49,506,176,034	97.01
投資信託受益証券	ブラジル	67,597,012	0.13
投資証券	南アフリカ	141,232,511	0.28
	メキシコ	44,633,837	0.09
	トルコ	4,011,121	0.01
	小計	189,877,469	0.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,267,990,865	2.48
合計(純資産総額)		51,031,641,380	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	1,234,567,393	2.42

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

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

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		11,505,574	0.02
	売建		403,330	0.00

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

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

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	2009年 1月16日～2010年 1月20日	440,530,128	85,183,261	355,346,867
第2期計算期間	2010年 1月21日～2011年 1月20日	627,431,255	194,904,418	787,873,704
第3期計算期間	2011年 1月21日～2012年 1月20日	911,791,372	252,161,321	1,447,503,755
第4期計算期間	2012年 1月21日～2013年 1月21日	907,508,119	554,585,762	1,800,426,112
第5期計算期間	2013年 1月22日～2014年 1月20日	1,918,803,387	1,140,113,813	2,579,115,686
第6期計算期間	2014年 1月21日～2015年 1月20日	3,411,351,368	951,621,550	5,038,845,504
第7期計算期間	2015年 1月21日～2016年 1月20日	5,409,151,344	1,574,902,402	8,873,094,446
第8期計算期間	2016年 1月21日～2017年 1月20日	4,258,831,911	1,891,370,889	11,240,555,468
第9期計算期間	2017年 1月21日～2018年 1月22日	30,368,454,269	18,331,594,089	23,277,415,648
第10期中間計算期間	2018年 1月23日～2018年 7月22日	6,538,956,157	3,940,838,924	25,875,532,881

(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10期中間計算期間(2018年1月23日から2018年7月22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9期 (2018年 1月22日現在)	第10期中間計算期間 (2018年 7月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,319,535,553	934,354,636
親投資信託受益証券	53,807,218,162	57,782,092,447
未収入金	290,570,000	453,936,878
流動資産合計	55,417,323,715	59,170,383,961
負債の部		
流動負債		
未払解約金	862,960,474	669,519,671
未払受託者報酬	14,213,205	14,717,567
未払委託者報酬	127,918,793	132,458,096
未払利息	2,186	7,209
その他未払費用	1,596,902	873,843
流動負債合計	1,006,691,560	817,576,386
負債合計	1,006,691,560	817,576,386
純資産の部		
元本等		
元本	23,277,415,648	25,875,532,881
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	31,133,216,507	32,477,274,694
(分配準備積立金)	4,948,910,172	4,219,903,695
元本等合計	54,410,632,155	58,352,807,575
純資産合計	54,410,632,155	58,352,807,575
負債純資産合計	55,417,323,715	59,170,383,961

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期中間計算期間 自 2017年 1月21日 至 2017年 7月20日	第10期中間計算期間 自 2018年 1月23日 至 2018年 7月22日
営業収益		
受取利息	185	132
有価証券売買等損益	2,415,819,503	1,660,105,715
営業収益合計	2,415,819,688	1,660,105,583
営業費用		
支払利息	206,548	329,536
受託者報酬	7,772,282	14,717,567
委託者報酬	69,950,482	132,458,096
その他費用	714,348	891,911
営業費用合計	78,643,660	148,397,110
営業利益又は営業損失（ ）	2,337,176,028	1,808,502,693
経常利益又は経常損失（ ）	2,337,176,028	1,808,502,693
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,337,176,028	1,808,502,693
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（ ）	269,622,457	317,480,391
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	11,406,851,129	31,133,216,507
剰余金増加額又は欠損金減少額	13,653,639,563	8,054,065,917
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	13,653,639,563	8,054,065,917
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,048,855,257	5,218,985,428
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,048,855,257	5,218,985,428
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	23,079,189,006	32,477,274,694

（ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年1月21日から翌年1月20日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第10期中間計算期間は2018年 1月23日から2018年 7月22日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

	第9期 (2018年 1月22日現在)	第10期中間計算期間 (2018年 7月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	23,277,415,648口	25,875,532,881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) 2.3375円 (23,375円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.2551円 (22,551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10期中間計算期間 (2018年 7月22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

	第10期中間計算期間 (2018年 7月22日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、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>

（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9期 自 2017年 1月21日 至 2018年 1月22日	第10期中間計算期間 自 2018年 1月23日 至 2018年 7月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	11,240,555,468円	23,277,415,648円
期中追加設定元本額	30,368,454,269円	6,538,956,157円
期中一部解約元本額	18,331,594,089円	3,940,838,924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

	2018年 7月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,255,457,607
国債証券	328,307,130,900
地方債証券	22,101,857,061
特殊債券	27,819,518,802
社債券	15,711,355,500
未収入金	77,408
未収利息	713,476,433
前払費用	28,396,199
流動資産合計	395,937,269,910
資産合計	395,937,269,910
負債の部	
流動負債	
未払金	499,437,400
未払解約金	178,584,419
未払利息	3,229
その他未払費用	11,739
流動負債合計	678,036,787
負債合計	678,036,787
純資産の部	
元本等	
元本	283,010,685,278
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	112,248,547,845
元本等合計	395,259,233,123
純資産合計	395,259,233,123
負債純資産合計	395,937,269,910

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 7月22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）

	2018年 7月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	283,010,685,278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 103,204,000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 1.3966円 (1万口当たり純資産額) (13,966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

	2018年 7月22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	2018年 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	256,411,785,507円
期中追加設定元本額	34,331,874,946円
期中一部解約元本額	7,732,975,175円
期末元本額	283,010,685,278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）	3,564,059,246円
S B I 資産設計オープン（分配型）	16,154,042円
S M T 国内債券インデックス・オープン	12,836,911,672円
世界経済インデックスファンド	1,682,342,321円
D C マイセレクション 2 5	19,347,236,858円
D C マイセレクション 5 0	22,044,740,856円
D C マイセレクション 7 5	6,058,572,125円
D C 日本債券インデックス・オープン	450,365,447円
D C 日本債券インデックス・オープン S	76,699,663,730円
D C 日本債券インデックス・オープン P	35,099,244,298円
D C マイセレクション S 2 5	7,664,388,167円
D C マイセレクション S 5 0	8,709,176,113円
D C マイセレクション S 7 5	1,725,942,809円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	1,261,053,387円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	1,121,853,893円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	360,963,392円
D C 世界経済インデックスファンド	1,313,736,541円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	100,193,027円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,919,619円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	97,338,518円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	15,668,118円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	995,042円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	317,789,852円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	443,823,548円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	77,324,367円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	202,025,121円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	5,352,829,574円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,131,200,298円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	4,291,095,238円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	889,192,775円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	151,895,662円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,497,318,926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）	587,069,922円
バランス E（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	1,670,626,175円

区分	2018年 7月22日現在
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,160,422,462円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	180,314,540円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,805,663,836円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,555,651,471円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	52,461,116円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	642,916,305円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	68,611,248円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	36,016,677円
SMT インデックスバランス・オープン	79,539,247円
SMT 世界経済インデックス・オープン	2,868,714円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	16,501,059円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	20,009,266円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	838,521円
グローバル経済コア	273,819,559円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	4,877,637円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	67,485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)	45,316,168,216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	2018年 7月22日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,609,233,834
株式	212,866,063,560
派生商品評価勘定	31,102,380
未収入金	9,564,980
未収配当金	259,698,922
差入委託証拠金	53,560,000
流動資産合計	215,829,223,676
資産合計	215,829,223,676
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	60,760
前受金	31,067,000
未払解約金	200,527,071
未払利息	6,711
その他未払費用	25,184
流動負債合計	231,686,726

	2018年 7月22日現在
項目	金額（円）
負債合計	231,686,726
純資産の部	
元本等	
元本	137,314,504,810
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	78,283,032,140
元本等合計	215,597,536,950
純資産合計	215,597,536,950
負債純資産合計	215,829,223,676

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 7月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>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</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）

	2018年 7月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	137,314,504,810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 1.5701円 (1万口当たり純資産額) (15,701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

	2018年 7月22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	2018年 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	121,805,661,791円
期中追加設定元本額	20,524,795,635円
期中一部解約元本額	5,015,952,616円
期末元本額	137,314,504,810円

区分	2018年 7月22日現在
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)	656,110,120円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,596,565,691円
SBI資産設計オープン(分配型)	15,705,078円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,263,564,644円
世界経済インデックスファンド	1,954,479,545円
日本株式インデックス・オープン	5,922,745,643円
DCマイセレクション25	5,769,001,375円
DCマイセレクション50	16,911,964,614円
DCマイセレクション75	16,053,925,599円
DC日本株式インデックス・オープン	5,199,538,324円
DCマイセレクションS25	2,279,149,918円
DCマイセレクションS50	6,724,538,004円
DCマイセレクションS75	4,560,585,238円
DC日本株式インデックス・オープンS	5,397,409,958円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	375,114,726円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	562,968,978円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	356,037,049円
DC世界経済インデックスファンド	1,521,071,445円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	451,630,934円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	23,987,825円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	76,027,341円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	40,621,993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)	350,397,999円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,635,767円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	135,002,873円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	474,934,152円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	72,255,065円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	647,321,870円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,011,068,557円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	773,237,185円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,388,943,215円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	664,797,049円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	61,968,502円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	858,417,880円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	756,821,467円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	501,596,303円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	628,934,521円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	59,719,761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)	985,724,004円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,831,996,941円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,553,811,574円

区分	2018年 7月22日現在
D C 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	168,384,275円
D C 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	207,804,478円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	231,341,260円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	12,546,292円
S M T インデックスバランス・オープン	85,323,793円
S M T 世界経済インデックス・オープン	3,818,776円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	44,995,497円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	5,952,042円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	808,941円
グローバル経済コア	325,996,151円
S B I 資産設計オープン(つみたてN I S A対応型)	4,747,829円
i - S M T T O P I Xインデックス(ノーロード)	35,487,033円
D C ターゲット・イヤール ファンド2055	149,100円
F O F s 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)	28,714,820,616円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2018年 7月22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	2,467,883,380	-	2,498,925,000	31,041,620
合計		2,467,883,380	-	2,498,925,000	31,041,620

(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	2018年 7月22日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	254,445,826
コール・ローン	1,935,878,934
国債証券	252,785,929,966
派生商品評価勘定	18,032,565
未収入金	4,423,678
未収利息	1,972,821,400

	2018年 7月22日現在
項目	金額（円）
前払費用	116,841,275
差入委託証拠金	138,161,988
流動資産合計	257,226,535,632
資産合計	257,226,535,632
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	878,498
前受金	2,204,038
未払金	11,343
未払解約金	252,868,819
未払利息	4,979
その他未払費用	14,896
流動負債合計	255,982,573
負債合計	255,982,573
純資産の部	
元本等	
元本	93,009,092,554
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	163,961,460,505
元本等合計	256,970,553,059
純資産合計	256,970,553,059
負債純資産合計	257,226,535,632

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 7月22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>

2018年 7月22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) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 (2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2018年 7月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	93,009,092,554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 2.7629円 (1万口当たり純資産額) (27,629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

2018年 7月22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。

	2018年 7月22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	2018年 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	94,509,771,464円
期中追加設定元本額	10,483,045,506円
期中一部解約元本額	11,983,724,416円
期末元本額	93,009,092,554円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	2,050,554,034円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	854,950,313円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	552,338,378円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,001,736,324円
SBI資産設計オープン(分配型)	9,341,222円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,036,002,093円
世界経済インデックスファンド	6,239,051,936円
DCマイセレクション25	1,585,140,712円
DCマイセレクション50	1,382,403,270円
DCマイセレクション75	913,670,191円
DC外国債券インデックス・オープン	1,742,330,681円
DCマイセレクションS25	622,733,397円
DCマイセレクションS50	548,044,982円
DCマイセレクションS75	259,058,530円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	54,653,354円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	59,841,891円

区分	2018年 7月22日現在
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	27,802,053円
D C世界経済インデックスファンド	4,918,073,859円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	578,074,936円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	50,370,524円
マイセクション5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	6,000,917円
マイセクション7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	2,271,349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）	61,848,636円
バランス3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	186,428,919円
バランス5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	265,885,351円
バランス2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	201,338,566円
バランス5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	601,014,471円
バランスA（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	2,632,736,735円
バランスB（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	708,697,864円
バランスC（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,574,578,604円
世界バランスV A 1（適格機関投資家専用）	964,512,975円
世界バランスV A 2（適格機関投資家専用）	125,838,093円
バランスD（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	726,150,056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）	758,125,646円
バランスE（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	286,604,970円
バランスF（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	351,033,370円
F O F s用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	1,142,302,436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）	978,430,209円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	912,264,322円
外国債券ファンド・シリーズ1	642,334,681円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,447,993,655円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,673,724,403円
分散投資コア戦略ファンドA	1,011,921,448円
分散投資コア戦略ファンドS	2,876,971,685円
D C世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	186,700,405円
D C世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,014,030,280円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,210,304,516円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	232,516,896円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	116,966,046円
S M T グローバル債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	942,499,878円
S M T インデックスバランス・オープン	253,952,468円
外国債券S M T Bセクション（SMA専用）	24,229,752,210円
S M T 世界経済インデックス・オープン	20,130,873円
S M T 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	75,921,717円
S M T 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	92,695,883円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	460,002円
グローバル経済コア	1,163,116,013円
S B I資産設計オープン（つみたてN I S A対応型）	2,783,207円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 5 5	9,345円

区分	2018年 7月22日現在
F O F s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)	1,007,344,794円
F O F s用 外国債券インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)	6,475,368,093円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	359,357,887円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2018年 7月22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	1,221,262,602	-	1,223,466,640	2,204,038
合計		1,221,262,602	-	1,223,466,640	2,204,038

(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

(2018年 7月22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	1,574,810,971	-	1,589,761,000	14,950,029
	アメリカドル	744,263,553	-	754,338,200	10,074,647
	カナダドル	68,287,725	-	68,679,900	392,175
	ユーロ	646,121,717	-	651,000,000	4,878,283
	イギリスポンド	116,137,976	-	115,742,900	395,076
合計		1,574,810,971	-	1,589,761,000	14,950,029

(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

	2018年 7月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	11,145,752,819
コール・ローン	614,936,543
株式	332,205,519,320
投資信託受益証券	262,838,975
投資証券	7,807,229,786
派生商品評価勘定	189,912,027
未収入金	1,272,819
未収配当金	312,418,563
差入委託証拠金	2,404,658,961
流動資産合計	354,944,539,813
資産合計	354,944,539,813
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,984,419
前受金	186,255,528
未払解約金	927,841,193
未払利息	1,581
その他未払費用	2,622
流動負債合計	1,117,085,343
負債合計	1,117,085,343
純資産の部	
元本等	
元本	137,317,936,606
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	216,509,517,864
元本等合計	353,827,454,470
純資産合計	353,827,454,470
負債純資産合計	354,944,539,813

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 7月22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>

	2018年 7月22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）

	2018年 7月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		137,317,936,606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)	2.5767円 (25,767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

	2018年 7月22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	2018年 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	133,409,705,614円
期中追加設定元本額	11,201,611,462円
期中一部解約元本額	7,293,380,470円
期末元本額	137,317,936,606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）	2,387,489,443円
S B I 資産設計オープン（分配型）	10,232,050円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,149,179,978円
世界経済インデックスファンド	7,147,197,889円
外国株式インデックス・オープン	889,606,850円
D C マイセレクション 2 5	1,017,451,429円
D C マイセレクション 5 0	4,710,201,208円
D C マイセレクション 7 5	5,178,543,302円
D C 外国株式インデックス・オープン	7,642,426,517円
D C マイセレクション S 2 5	391,276,934円
D C マイセレクション S 5 0	1,881,961,343円
D C マイセレクション S 7 5	1,472,620,838円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	121,436,453円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	182,416,543円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	115,486,961円
D C 世界経済インデックスファンド	5,646,825,976円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,718,905,979円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	20,692,823円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	13,166,847円
外国株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	62,473,154円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	87,989,099円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	300,693,970円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	46,145,585円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	413,168,246円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	878,793,761円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	438,160,789円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,858,079,899円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	2,099,680,803円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	117,454,786円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	421,619,405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）	185,961,221円

区分	2018年 7月22日現在
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	139,365,890円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,101,299,425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)	2,419,237,485円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,447,703,678円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,970,451,711円
コア投資戦略ファンド(成長型)	6,687,901,456円
分散投資コア戦略ファンドA	2,022,313,048円
分散投資コア戦略ファンドS	4,213,127,565円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	635,485,482円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	789,896,037円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,736,786,986円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	876,945,162円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	45,392,074円
SMT インデックスバランス・オープン	306,804,419円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	2,075,435,289円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	29,664,683,732円
SMT 世界経済インデックス・オープン	22,573,865円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	266,051,539円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	35,358,954円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	519,707円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	24,486,460円
グローバル経済コア	1,264,882,159円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	3,061,107円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	48,752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)	1,625,425,168円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,335,158,286円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	201,089円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2018年 7月22日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	13,321,377,558	-	13,507,633,086	186,255,528
	合計	13,321,377,558	-	13,507,633,086	186,255,528

(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

(2018年 7月22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	338,023,280	-	337,351,200	672,080
	アメリカドル	236,733,000	-	236,418,000	315,000
	カナダドル	15,411,240	-	15,278,400	132,840
	ユーロ	42,032,640	-	41,996,800	35,840
	イギリスポンド	29,483,400	-	29,318,000	165,400
	香港ドル	14,363,000	-	14,340,000	23,000
合計		338,023,280	-	337,351,200	672,080

(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	2018年 7月22日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	674,354,819
コール・ローン	305,662,150
国債証券	43,452,422,892
派生商品評価勘定	606,678
未収入金	153,012
未収利息	566,282,049
前払費用	105,954,453
流動資産合計	45,105,436,053
資産合計	45,105,436,053
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,898,407
未払金	485,624,279
未払解約金	73,632,691
未払利息	786
その他未払費用	4,248
流動負債合計	561,160,411

	2018年 7月22日現在
項目	金額（円）
負債合計	561,160,411
純資産の部	
元本等	
元本	26,962,144,339
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	17,582,131,303
元本等合計	44,544,275,642
純資産合計	44,544,275,642
負債純資産合計	45,105,436,053

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 7月22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）

	2018年 7月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	26,962,144,339口

		2018年 7月22日現在
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6521円 (16,521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

		2018年 7月22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	2018年 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況 期首	2018年 1月23日

区分	2018年 7月22日現在
期首元本額	19,505,694,501円
期中追加設定元本額	8,001,855,575円
期中一部解約元本額	545,405,737円
期末元本額	26,962,144,339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	3,858,123,272円
世界経済インデックスファンド	4,942,421,422円
DC新興国債券インデックス・オープン	3,656,451,853円
DC世界経済インデックスファンド	3,928,078,247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）	1,874,740,342円
コア投資戦略ファンド（安定型）	200,114,352円
コア投資戦略ファンド（成長型）	657,518,583円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	110,433,898円
分散投資コア戦略ファンドA	126,499,407円
分散投資コア戦略ファンドS	387,564,927円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	142,118,253円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,633,162,046円
コア投資戦略ファンド（切替型）	129,073,783円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	189,464,256円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	94,419,598円
SMT インデックスバランス・オープン	210,966,593円
外国債券SMTBセレクション（SMA専用）	3,524,251,006円
SMT 世界経済インデックス・オープン	23,119,811円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	85,983,995円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	105,462,501円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	728,603円
グローバル経済コア	944,782,105円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	136,665,486円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2018年 7月22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	316,864,125	-	315,338,839	1,525,286
	メキシコペソ	23,872,000	-	23,640,000	232,000
	ブラジルリアル	47,710,652	-	48,083,773	373,121
	トルコリラ	35,170,500	-	35,055,000	115,500

チェココルナ	24,934,646	-	24,835,938	98,708
ハンガリーフォリント	23,327,251	-	23,080,641	246,610
ポーランドズロチ	30,480,000	-	30,170,000	310,000
マレーシアリングット	24,275,561	-	24,195,231	80,330
タイバーツ	40,667,781	-	40,258,561	409,220
インドネシアルピア	57,933,734	-	57,719,695	214,039
南アフリカランド	8,492,000	-	8,300,000	192,000
売建	146,312,167	-	146,078,610	233,557
アメリカドル	146,312,167	-	146,078,610	233,557
合計	463,176,292	-	461,417,449	1,291,729

(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

	2018年 7月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,411,141,471
コール・ローン	157,670,926
株式	49,313,707,628
投資信託受益証券	70,379,970
投資証券	214,095,909
派生商品評価勘定	4,462,169
未収入金	16,462,346
未収配当金	323,697,313
差入委託証拠金	231,949,049
流動資産合計	51,743,566,781
資産合計	51,743,566,781
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,662,714
前受金	801,782
未払金	1,191,297,238
未払解約金	54,591,385
未払利息	405
その他未払費用	1,146
流動負債合計	1,251,354,670
負債合計	1,251,354,670
純資産の部	
元本等	

	2018年 7月22日現在
項目	金額（円）
元本	17,614,269,212
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	32,877,942,899
元本等合計	50,492,212,111
純資産合計	50,492,212,111
負債純資産合計	51,743,566,781

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2018年 7月22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>

2018年 7月22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)

2018年 7月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	17,614,269,212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 2.8666円 (1万口当たり純資産額) (28,666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

2018年 7月22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

	2018年 7月22日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、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	2018年 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 1月23日
期首元本額	16,271,676,908円
期中追加設定元本額	1,860,715,934円
期中一部解約元本額	518,123,630円
期末元本額	17,614,269,212円
期末元本額の内訳	
S M T 新興国株式インデックス・オープン	6,677,213,339円
世界経済インデックスファンド	2,980,663,157円
D C 新興国株式インデックス・オープン	3,668,664,290円
D C 世界経済インデックスファンド	2,366,786,423円
新興国株式インデックス・オープン（S M A 専用）	94,897,665円
D C 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	263,716,572円
D C 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	322,744,128円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	368,959,137円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,529,351円
S M T インデックスバランス・オープン	126,995,225円

区分	2018年 7月22日現在
S M T 世界経済インデックス・オープン	13,197,542円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	154,460,795円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	20,268,371円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	422,094円
グローバル経済コア	527,908,388円
i - S M T 新興国株式インデックス(ノーロード)	8,842,735円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2018年 7月22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	846,621,124	-	847,422,906	801,782
合計		846,621,124	-	847,422,906	801,782

(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

(2018年 7月22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	182,483,643	-	181,330,093	1,153,550
	ブラジルリアル	76,418,850	-	77,016,481	597,631
	マレーシアリンギット	15,569,120	-	15,517,600	51,520
	インドネシアルピア	18,313,673	-	18,246,012	67,661
	南アフリカランド	72,182,000	-	70,550,000	1,632,000
	売建	94,732,523	-	94,581,300	151,223
	アメリカドル	94,732,523	-	94,581,300	151,223
合計		277,216,166	-	275,911,393	1,002,327

(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】

2018年10月1日現在の資本金の額	20億円
発行可能株式総数	12,000株
発行済株式総数	3,000株

(2)【事業の内容及び営業の状況】

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

2018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	497	10,106,666
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	67	230,389
単体型公社債投資信託	0	0
合計	564	10,337,055

(3)【その他】

(1)定款の変更

当社は2018年10月1日付けで監査等委員会の設置等に関し、定款の変更を行いました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2018年10月22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29年4月1日至平成30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29年3月31日現在)	当事業年度 (平成30年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,260,630	23,973,152
前払費用	143,622	157,614
未収委託者報酬	5,252,944	5,373,307
繰延税金資産	61,677	94,211
その他	5,474	9,842
流動資産合計	25,724,348	29,608,128
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 47,993	1 36,782
器具備品	1 73,765	1 79,655
その他	1 2,830	1 1,912
有形固定資産合計	124,589	118,350
無形固定資産		
ソフトウェア	221,499	210,679
その他	6,656	4,377
無形固定資産合計	228,156	215,056
投資その他の資産		
投資有価証券	71,153	42,802
長期前払費用	9,828	7,810
長期貸付金	19,838	17,088
会員権	25,000	25,000
繰延税金資産	137,359	154,422
その他	145	70
貸倒引当金	19,838	17,088
投資その他の資産合計	243,485	230,105
固定資産合計	596,231	563,512
資産合計	26,320,580	30,171,641

（単位：千円）

	前事業年度 （平成29年3月31日現在）	当事業年度 （平成30年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	13,630	24,591
未払金	2,883,924	2,950,503
未払収益分配金	45	45
未払手数料	2,099,678	2,160,863
その他未払金	784,201	789,595
未払費用	67,780	74,279
未払法人税等	863,230	838,596
未払消費税等	91,120	72,890
賞与引当金	98,072	106,177
その他	3,100	1,241
流動負債合計	4,020,860	4,068,279
固定負債		
資産除去債務	13,148	13,374
退職給付引当金	437,197	496,696
その他	2,065	1,074
固定負債合計	452,411	511,145
負債合計	4,473,271	4,579,425
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	71,500	74,500
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	19,026,944	22,767,534
利益剰余金合計	21,198,444	24,942,034
株主資本合計	21,848,444	25,592,034
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,134	182
評価・換算差額等合計	1,134	182
純資産合計	21,847,309	25,592,216
負債・純資産合計	26,320,580	30,171,641

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度		当事業年度	
	（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）		（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬		30,245,448		29,206,178
営業収益合計		30,245,448		29,206,178
営業費用				
支払手数料		12,880,325		12,544,178
広告宣伝費		95,688		175,296
公告費		3,094		-
調査費		6,239,223		6,008,380
調査費		360,520		396,842
委託調査費		5,876,937		5,609,496
図書費		1,766		2,041
営業雑経費		1,460,885		1,474,361
通信費		24,920		33,158
印刷費		370,785		368,414
協会費		30,665		36,616
諸会費		105		105
情報機器関連費		943,725		942,093
その他営業雑経費		90,684		93,973
営業費用合計		20,679,217		20,202,216
一般管理費				
給料		1,874,710		2,006,157
役員報酬		89,520		84,130
給料・手当		1,526,244		1,649,268
賞与		258,946		272,758
退職給付費用		76,106		84,944
福利費		221,018		239,702
交際費		5,612		5,831
旅費交通費		61,961		73,807
租税公課		106,691		102,158
不動産賃借料		113,697		124,629
減価償却費		134,710		119,300
業務委託費	1	486,690	1	484,841
諸経費		223,685		246,326
一般管理費合計		3,304,885		3,487,699
営業利益		6,261,346		5,516,262

（単位：千円）

	前事業年度		当事業年度	
	（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）		（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）	

営業外収益				
受取利息		4,669		2,136
収益分配金		129		116
投資有価証券売却益		307		499
貸倒引当金戻入		3,000		2,750
その他		1,591		4,351
営業外収益合計		9,697		9,854
営業外費用				
長期前払費用償却	1	4,644	1	-
投資有価証券売却損		604		2,224
固定資産除却損		-		7,891
その他		0		1,182
営業外費用合計		5,249		11,298
経常利益		6,265,794		5,514,818
特別損失				
統合関連費用		-		51,569
特別損失合計		-		51,569
税引前当期純利益		6,265,794		5,463,248
法人税、住民税及び事業税		1,889,846		1,739,837
法人税等調整額		45,558		50,178
法人税等合計		1,935,405		1,689,659
当期純利益		4,330,389		3,773,589

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,773,589	3,773,589	3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	3,740,589	3,743,589	3,743,589
当期末残高	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034

	評価・換算差額等	
--	----------	--

	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,134	1,134	21,847,309
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,773,589
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,317	1,317	1,317
当期変動額合計	1,317	1,317	3,744,907
当期末残高	182	182	25,592,216

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。

未適用の会計基準等

・「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日）

・「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30年2月16日）

(1) 概要

個別財務諸表における子会社株式等に係る将来加算一時差異が見直され、また（分類1）に該当する企業における繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いの明確化が行われております。

(2) 適用予定日

平成31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、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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29年3月31日)		当事業年度 (平成30年3月31日)	
建 物	62,231	千円	63,830	千円
器具備品	298,576	"	325,834	"
そ の 他	1,759	"	2,677	"
計	362,567	"	392,342	"

（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28年4月1日 至 平成29年3月31日)		当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
業務委託費	39,286	千円	30,081	千円
長期前払費用償却	4,644	"	-	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

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

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

当事業年度(平成30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	23,973,152	23,973,152	-
(2)未収委託者報酬	5,373,307	5,373,307	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	42,799	42,799	-
(4)未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	-
(5)未払法人税等	(838,596)	(838,596)	-

(*)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29年3月31日	平成30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、「(3)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
----------------	---	--------	--------	-------

当事業年度(平成30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	23,973,152	-	-	-
未収委託者報酬	5,373,307	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	12,846	21,065	496

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(平成30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	19,223	17,499	1,723
小計	19,223	17,499	1,723
貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの			
その他	23,576	25,037	1,461
小計	23,576	25,037	1,461
合計	42,799	42,536	262

(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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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
62,968	499	2,224

（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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
(1) 退職給付債務	437,197	496,696
(2) 退職給付引当金	437,197	496,696

（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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
(1) 退職給付費用	76,106	84,944

（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14,321千円、当事業年度で15,458千円であります。

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29年3月31日)		当事業年度 (平成30年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	28,688	千円	42,041	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	6,074	"	5,232	"
賞与引当金損金算入限度超過額	30,265	"	32,511	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	133,869	"	152,088	"
その他	6,972	"	23,674	"
繰延税金資産 合計	205,870	"	255,547	"
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	"
その他	-	"	80	"
繰延税金負債 合計	6,833	"	6,913	"
繰延税金資産の純額	199,037	"	248,633	"

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おります。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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）	2,945,175千円

（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おります。

（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。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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	9,571,581	未払手数料	1,568,277
							投資助言費用の支払	4,809,206	その他未払金	424,421

(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）

当事業年度（平成30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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	7,282,436円46銭	8,530,738円79銭
1株当たり当期純利益金額	1,443,463円05銭	1,257,863円25銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	4,330,389千円	3,773,589千円
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30年6月1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 藤 澤 孝 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29年4月1日から平成30年3月31日までの第32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30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

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年9月21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

松崎雅則

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2018年1月23日から2018年7月22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2018年7月22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（2018年1月23日から2018年7月22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

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

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。