

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年3月10日提出
【計算期間】	第3期中(自 2019年6月11日至 2019年12月10日)
【ファンド名】	SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【ファンドの運用状況】

以下は、2019年12月30日現在の状況について記載してあります。

【SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）】

（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	1,075,998,847	99.24
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		8,270,828	0.76
合計（純資産総額）		1,084,269,675	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 （2018年 6月11日）	545,359,273	545,359,273	10,037	10,037
第2期計算期間末 （2019年 6月10日）	823,199,920	823,199,920	10,104	10,104
2018年12月末日	686,798,825		9,729	
2019年 1月末日	731,202,461		9,937	
2月末日	765,353,822		10,181	
3月末日	814,599,859		10,181	
4月末日	773,493,865		10,284	
5月末日	787,724,550		9,970	
6月末日	849,103,025		10,251	
7月末日	861,287,345		10,352	
8月末日	879,774,806		10,075	
9月末日	917,330,528		10,261	
10月末日	962,240,483		10,531	
11月末日	990,372,808		10,561	
12月末日	1,084,269,675		10,808	

【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	2017年 8月25日～2018年 6月11日	0

第2期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	0
---------	-------------------------	---

【収益率の推移】

	期 間	収益率(%)
第1期計算期間	2017年 8月25日～2018年 6月11日	0.4
第2期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	0.7
第3期中間計算期間	2019年 6月11日～2019年12月10日	4.0

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	320,001,386,770	98.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,485,312,658	1.08
合計(純資産総額)		323,486,699,428	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	3,407,580,000	1.05

(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	460,185,126,850	83.67

地方債証券	日本	29,483,497,946	5.36
特殊債券	日本	37,953,079,480	6.90
社債券	日本	20,142,019,600	3.66
	フランス	1,799,737,000	0.33
	オーストラリア	400,116,000	0.07
	アメリカ	208,530,000	0.04
	イギリス	100,311,000	0.02
	小計	22,650,713,600	4.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		278,466,303	0.05
合計(純資産総額)		549,993,951,573	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

外国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	252,110,287,569	63.32
	イギリス	23,255,087,003	5.84
	フランス	14,724,653,499	3.70
	カナダ	14,620,654,157	3.67
	スイス	14,587,698,022	3.66
	ドイツ	12,368,143,903	3.11
	オーストラリア	8,778,844,958	2.20
	オランダ	7,614,744,354	1.91
	アイルランド	7,321,203,828	1.84
	スペイン	4,093,760,943	1.03
	スウェーデン	3,536,615,220	0.89
	香港	3,323,083,989	0.83
	イタリア	2,751,079,139	0.69
	デンマーク	2,617,519,020	0.66
	シンガポール	1,659,294,963	0.42
	フィンランド	1,579,063,449	0.40
	バミューダ	1,538,642,539	0.39
	ベルギー	1,424,515,670	0.36
	ジャージー	1,090,314,992	0.27
	ノルウェー	909,763,727	0.23
	ケイマン	908,069,459	0.23
	イスラエル	806,031,990	0.20
	キュラソー	539,131,613	0.14
ニュージーランド	400,480,219	0.10	

	ルクセンブルク	385,682,462	0.10
	オーストリア	316,008,351	0.08
	ポルトガル	224,386,766	0.06
	リベリア	223,365,344	0.06
	パナマ	197,538,606	0.05
	パプアニューギニア	67,441,286	0.02
	マン島	53,393,212	0.01
	英ヴァージン諸島	47,478,802	0.01
	小計	384,073,979,054	96.46
投資信託受益証券	オーストラリア	215,480,271	0.05
	香港	82,678,415	0.02
	小計	298,158,686	0.07
投資証券	アメリカ	8,471,964,517	2.13
	オーストラリア	666,767,095	0.17
	フランス	443,222,474	0.11
	イギリス	276,141,477	0.07
	香港	206,338,660	0.05
	シンガポール	202,206,577	0.05
	カナダ	91,979,224	0.02
	小計	10,358,620,024	2.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,441,893,043	0.86
合計(純資産総額)		398,172,650,807	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	8,211,570,206	2.06
	買建	カナダ	563,078,854	0.14
	買建	ドイツ	1,902,589,910	0.48
	買建	イギリス	794,613,044	0.20
	買建	オーストラリア	464,445,792	0.12

(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		8,573,172,500	2.15

売建		15,912,500	0.00
----	--	------------	------

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

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

外国債券インデックス マザーファンド

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	186,820,306,659	47.48
	フランス	38,520,629,612	9.79
	イタリア	34,823,469,268	8.85
	イギリス	25,218,587,197	6.41
	ドイツ	24,746,767,064	6.29
	スペイン	22,015,724,693	5.60
	ベルギー	9,259,642,038	2.35
	オーストラリア	7,683,283,981	1.95
	カナダ	7,476,981,948	1.90
	オランダ	7,278,283,134	1.85
	オーストリア	5,428,747,621	1.38
	メキシコ	3,446,597,590	0.88
	アイルランド	2,752,641,484	0.70
	南アフリカ	2,401,697,413	0.61
	ポーランド	2,306,779,277	0.59
	フィンランド	2,191,884,699	0.56
	デンマーク	1,941,401,031	0.49
	マレーシア	1,818,820,899	0.46
	シンガポール	1,657,272,680	0.42
	スウェーデン	1,359,179,442	0.35
ノルウェー	951,342,849	0.24	
	小計	390,100,040,579	99.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,360,100,350	0.85
合計(純資産総額)		393,460,140,929	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	3,051,550,713	0.78
	買建	ドイツ	3,485,358,654	0.89

(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		8,887,170,900	2.26

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

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

新興国株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	ケイマン	11,654,313,465	17.69
	中国	8,002,217,087	12.14
	韓国	7,594,343,240	11.53
	台湾	7,523,586,682	11.42
	インド	5,608,464,996	8.51
	ブラジル	4,602,682,206	6.99
	南アフリカ	2,911,815,086	4.42
	ロシア	2,467,503,240	3.74
	香港	1,958,799,087	2.97
	サウジアラビア	1,667,845,600	2.53
	タイ	1,629,639,155	2.47
	メキシコ	1,424,674,825	2.16
	インドネシア	1,263,786,127	1.92
	マレーシア	1,171,865,807	1.78
	カタール	598,738,377	0.91
	フィリピン	596,104,048	0.90
	ポーランド	564,464,725	0.86
	バミューダ	537,093,928	0.82
	チリ	495,675,901	0.75
	アラブ首長国連邦	394,535,363	0.60
	トルコ	314,719,892	0.48
	コロンビア	236,439,259	0.36

	アメリカ	202,755,363	0.31
	ギリシャ	188,308,042	0.29
	ハンガリー	183,355,237	0.28
	チェコ	91,567,351	0.14
	エジプト	80,845,186	0.12
	ルクセンブルク	62,463,320	0.09
	アルゼンチン	60,050,746	0.09
	ジャージー	45,568,745	0.07
	シンガポール	35,598,859	0.05
	マン島	31,826,103	0.05
	ペルー	28,008,247	0.04
	パキスタン	23,052,694	0.03
	小計	64,252,707,989	97.52
投資信託受益証券	ブラジル	187,104,979	0.28
	メキシコ	29,000,850	0.04
	小計	216,105,829	0.33
投資証券	南アフリカ	112,370,554	0.17
	メキシコ	53,649,202	0.08
	小計	166,019,756	0.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,254,351,130	1.90
合計(純資産総額)		65,889,184,704	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	5,661,930,423	8.59

(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		4,476,231,000	6.79
	売建		10,950,000	0.02

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

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

新興国債券インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	ブラジル	5,509,716,529	10.04
	メキシコ	5,470,460,641	9.97
	インドネシア	5,434,643,733	9.91
	タイ	5,184,952,664	9.45
	南アフリカ	5,055,178,272	9.21
	ポーランド	4,888,049,312	8.91
	ロシア	4,847,805,864	8.84
	マレーシア	3,373,943,364	6.15
	コロンビア	3,351,050,183	6.11
	ハンガリー	2,222,391,551	4.05
	チェコ	2,066,915,011	3.77
	ペルー	1,920,787,415	3.50
	トルコ	1,912,946,135	3.49
	チリ	1,563,674,900	2.85
	フィリピン	150,349,716	0.27
	ドミニカ共和国	95,261,529	0.17
	ウルグアイ	90,378,048	0.16
	小計	53,138,504,867	96.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,727,186,276	3.15
合計(純資産総額)		54,865,691,143	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
為替予約取引	買建		4,224,789,160	7.70

(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】

【SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）】

	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	2017年 8月25日～2018年 6月11日	755,925,234	212,584,152	543,341,082
第2期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	566,171,068	294,755,895	814,756,255
第3期中間計算期間	2019年 6月11日～2019年12月10日	261,543,895	131,901,421	944,398,729

(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3期中間計算期間(2019年6月11日から2019年12月10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せん。

【SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 （2019年 6月10日現在）	第3期中間計算期間 （2019年12月10日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,635,642	8,861,961
親投資信託受益証券	816,435,940	984,704,310
未収入金	1,980,000	4,232,125
流動資産合計	825,051,582	997,798,396
資産合計	825,051,582	997,798,396
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	2,891,738
未払受託者報酬	203,494	245,780
未払委託者報酬	1,627,861	1,966,171
未払利息	13	2
その他未払費用	20,294	24,517
流動負債合計	1,851,662	5,128,208
負債合計	1,851,662	5,128,208
純資産の部		
元本等		
元本	814,756,255	944,398,729
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	8,443,665	48,271,459
（分配準備積立金）	25,549,910	22,051,643
元本等合計	823,199,920	992,670,188
純資産合計	823,199,920	992,670,188
負債純資産合計	825,051,582	997,798,396

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 自 2018年 6月12日 至 2018年12月11日	第3期中間計算期間 自 2019年 6月11日 至 2019年12月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	6,819,350	39,045,739
営業収益合計	6,819,350	39,045,739
営業費用		
支払利息	3,145	2,536
受託者報酬	182,992	245,780
委託者報酬	1,463,864	1,966,171
その他費用	18,372	24,517
営業費用合計	1,668,373	2,239,004
営業利益又は営業損失()	8,487,723	36,806,735
経常利益又は経常損失()	8,487,723	36,806,735
中間純利益又は中間純損失()	8,487,723	36,806,735
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()	665,432	3,411,080
期首剰余金又は期首欠損金()	2,018,191	8,443,665
剰余金増加額又は欠損金減少額	881,034	7,998,835
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	881,034	7,998,835
剰余金減少額又は欠損金増加額	363,434	1,566,696
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	363,434	1,566,696
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	6,617,364	48,271,459

（ 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2期 (2019年 6月10日現在)	第3期中間計算期間 (2019年12月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	814,756,255口	944,398,729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) 1.0104円 (10,104円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.0511円 (10,511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3期中間計算期間 (2019年12月10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3期中間計算期間 (2019年12月10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2期 自 2018年 6月12日 至 2019年 6月10日	第3期中間計算期間 自 2019年 6月11日 至 2019年12月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	543,341,082円	814,756,255円
期中追加設定元本額	566,171,068円	261,543,895円
期中一部解約元本額	294,755,895円	131,901,421円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,356,340,477
株式	324,318,317,420

	2019年12月10日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	2,621,450
未収入金	218,726,210
未収配当金	102,020,420
流動資産合計	327,998,025,977
資産合計	327,998,025,977
負債の部	
流動負債	
前受金	2,622,000
未払金	133,987,103
未払解約金	308,071,572
未払利息	1,131
その他未払費用	272
流動負債合計	444,682,078
負債合計	444,682,078
純資産の部	
元本等	
元本	204,526,518,638
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	123,026,825,261
元本等合計	327,553,343,899
純資産合計	327,553,343,899
負債純資産合計	327,998,025,977

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年12月10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>

	2019年12月10日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2019年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	204,526,518,638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	1.6015円 (1万口当たり純資産額) (16,015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

	2019年12月10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	2019年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	193,692,560,770円
期中追加設定元本額	28,581,612,931円
期中一部解約元本額	17,747,655,063円
期末元本額	204,526,518,638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）	572,940,433円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,025,945,960円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,505,790円
S M T T O P I X インデックス・オープン	9,234,715,131円
世界経済インデックスファンド	2,075,913,850円
日本株式インデックス・オープン	4,765,580,706円
D C マイセレクション 2 5	6,788,555,480円
D C マイセレクション 5 0	19,203,948,203円
D C マイセレクション 7 5	17,407,249,904円
D C 日本株式インデックス・オープン	5,676,794,913円
D C マイセレクション S 2 5	2,720,691,749円
D C マイセレクション S 5 0	7,800,801,826円
D C マイセレクション S 7 5	5,064,054,022円
D C 日本株式インデックス・オープン S	6,600,426,189円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	391,735,815円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	711,711,623円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	470,521,477円
D C 世界経済インデックスファンド	1,898,335,609円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,071,134,292円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	15,112,186円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	36,456,712円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	40,943,720円
日本株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	280,661,201円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,582,381円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	79,766,504円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	320,137,924円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	57,796,949円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	424,001,215円
バランス A（25）V A 1（適格機関投資家専用）	1,678,404,448円
バランス B（37.5）V A 1（適格機関投資家専用）	698,733,277円

区分	2019年12月10日現在
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,011,274,626円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	611,022,719円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	39,825,696円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	765,787,163円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	35,821,422円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	432,645,921円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	563,455,717円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	54,574,955円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	839,374,782円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,011,550,659円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,752,647,795円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,151,588,282円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,293,297,705円
分散投資コア戦略ファンドA	5,961,437,227円
分散投資コア戦略ファンドS	15,951,269,188円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	270,203,963円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	287,165,346円
コア投資戦略ファンド(切替型)	753,826,857円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	213,250,818円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,084,325円
SMT インデックスバランス・オープン	70,744,182円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	13,524,402,894円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	576,233,517円
SMT 世界経済インデックス・オープン	16,950,997円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	62,547,987円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	9,371,465円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,629,306円
グローバル経済コア	280,154,351円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	13,378,599円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	42,190,081円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,114,607円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	353,247,293円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	26,581,000円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	17,365円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	19,408円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	21,791円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	23,834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)	47,812,230,414円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	584,708,715円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	7,686,177円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

（2019年12月10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	2,729,793,000	-	2,732,415,000	2,622,000
合計		2,729,793,000	-	2,732,415,000	2,622,000

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

国内債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

項目	2019年12月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	972,625,679
国債証券	454,880,462,950
地方債証券	29,372,025,983
特殊債券	38,050,157,903
社債券	22,725,264,980
未収入金	101,188,000
未収利息	1,221,890,928
前払費用	84,963,421
流動資産合計	547,408,579,844
資産合計	547,408,579,844
負債の部	
流動負債	
未払金	400,006,000
未払解約金	327,377,621
未払利息	328
その他未払費用	41
流動負債合計	727,383,990
負債合計	727,383,990
純資産の部	
元本等	
元本	385,016,208,220
剰余金	
剰余金又は欠損金()	161,664,987,634
元本等合計	546,681,195,854
純資産合計	546,681,195,854
負債純資産合計	547,408,579,844

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年12月10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）

	2019年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	385,016,208,220口
2. 担保資産	<p>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。</p> <p>有価証券 101,625,000円</p>
3. 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 1.4199円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,199円)</p>

（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

	2019年12月10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</p> <p>売買目的有価証券</p> <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>

	2019年12月10日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)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>

(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	2019年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	325,773,760,165円
期中追加設定元本額	68,911,237,892円
期中一部解約元本額	9,668,789,837円
期末元本額	385,016,208,220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)	3,866,866,566円
S B I 資産設計オープン(分配型)	13,819,856円
S M T 国内債券インデックス・オープン	16,467,532,413円
世界経済インデックスファンド	1,865,323,012円
D C マイセレクション 2 5	20,949,901,482円
D C マイセレクション 5 0	22,806,302,002円
D C マイセレクション 7 5	6,185,637,150円
D C 日本債券インデックス・オープン	462,277,131円
D C 日本債券インデックス・オープン S	87,958,786,644円
D C 日本債券インデックス・オープン P	69,096,521,862円
D C マイセレクション S 2 5	8,552,809,454円
D C マイセレクション S 5 0	9,329,272,009円
D C マイセレクション S 7 5	1,799,416,207円

区分	2019年12月10日現在
DCターゲット・イヤーフンド2025	1,104,947,844円
DCターゲット・イヤーフンド2035	1,336,147,390円
DCターゲット・イヤーフンド2045	450,702,131円
DC世界経済インデックスファンド	1,702,644,287円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	68,578,300円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	5,467,901円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	43,537,426円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	14,180,873円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	936,306円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	163,688,329円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	277,598,390円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	61,875,854円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	132,387,293円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	4,141,460,947円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	929,572,591円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,513,549,258円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	817,587,757円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	97,719,287円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,213,168,528円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	28,776,954円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,384,301,058円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,775,905,195円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	162,422,413円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,283,800,135円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,749,040,883円
分散投資コア戦略ファンドA	11,259,503,725円
分散投資コア戦略ファンドS	9,345,984,241円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	71,253,431円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	834,752,284円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	48,176,232円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	32,269,625円
SMT インデックスバランス・オープン	59,609,290円
SMT 世界経済インデックス・オープン	12,651,110円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	12,663,953円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	25,937,460円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,532,703円
グローバル経済コア	197,638,686円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	12,679,947円
DCターゲット・イヤーフンド2055	954,255円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	18,784円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	14,886円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	10,633円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	7,089円

区分	2019年12月10日現在
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)	77,282,859,528円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年12月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,278,216,579
コール・ローン	303,949,039
株式	368,199,519,893
投資信託受益証券	286,754,026
投資証券	10,271,739,880
派生商品評価勘定	253,076,474
未収入金	979,466
未収配当金	621,121,801
差入委託証拠金	2,752,207,713
流動資産合計	386,967,564,871
資産合計	386,967,564,871
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,263,066
前受金	247,892,208
未払解約金	350,550,293
未払利息	102
その他未払費用	40
流動負債合計	603,705,709
負債合計	603,705,709
純資産の部	
元本等	
元本	140,041,257,500
剰余金	
剰余金又は欠損金()	246,322,601,662
元本等合計	386,363,859,162
純資産合計	386,363,859,162
負債純資産合計	386,967,564,871

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>

	2019年12月10日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
	(3)為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2019年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	140,041,257,500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 2.7589円 (1万口当たり純資産額) (27,589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

	2019年12月10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。

	2019年12月10日現在

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	137,917,434,727円
期中追加設定元本額	12,518,319,372円
期中一部解約元本額	10,394,496,599円
期末元本額	140,041,257,500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）	2,412,657,861円
S B I 資産設計オープン（分配型）	8,851,605円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	25,898,650,942円
世界経済インデックスファンド	7,530,877,525円
外国株式インデックス・オープン	776,707,472円
D C マイセレクション 2 5	1,099,375,395円
D C マイセレクション 5 0	4,852,816,593円
D C マイセレクション 7 5	5,091,914,878円
D C 外国株式インデックス・オープン	8,733,995,397円
D C マイセレクション S 2 5	441,752,925円
D C マイセレクション S 5 0	1,979,558,778円
D C マイセレクション S 7 5	1,472,749,668円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	109,765,839円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	195,409,363円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	129,233,209円
D C 世界経済インデックスファンド	6,819,195,615円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,882,036,324円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	8,939,124円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	11,144,782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）	38,622,763円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	45,004,127円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	183,911,140円

区分	2019年12月10日現在
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	32,907,808円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	241,379,087円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	657,004,977円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	355,096,202円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,301,893,565円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	1,733,444,923円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	67,779,797円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	335,848,489円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	8,278,264円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	109,202,175円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,861,275,742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）	1,995,826,919円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,000,019,900円
コア投資戦略ファンド（安定型）	2,367,450,752円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,866,404,752円
分散投資コア戦略ファンドA	2,495,025,733円
分散投資コア戦略ファンドS	7,027,832,626円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	965,666,367円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	1,066,046,089円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,589,751,454円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	768,252,019円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	42,490,460円
SMT インデックスバランス・オープン	256,411,061円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	1,444,295,660円
外国株式SMTBセレクション（SMA専用）	31,899,372,784円
SMT 世界経済インデックス・オープン	91,844,541円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	340,878,157円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	53,767,502円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,545,646円
i-SMT グローバル株式インデックス（ノーロード）	51,788,356円
グローバル経済コア	934,112,314円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	7,910,476円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	588,323円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	867,457,720円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	63,964,907円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	58,867円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	66,613円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	74,359円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	81,330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）	1,250,348,695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）	768,695,918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）	355,860,982円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	40,083,864円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2019年12月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,142,564,669	-	7,390,456,877	247,892,208
合計		7,142,564,669	-	7,390,456,877	247,892,208

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2019年12月10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	242,502,600	-	242,581,400	78,800
	アメリカドル	194,414,200	-	194,493,400	79,200
	ユーロ	48,088,400	-	48,088,000	400
合計		242,502,600	-	242,581,400	78,800

(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。

外国債券インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2019年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	204,845,300
コール・ローン	1,832,331,983
国債証券	385,875,619,164
派生商品評価勘定	2,549,366
未収入金	6,558,030
未収利息	2,429,034,389
前払金	4,753,133
前払費用	144,468,627
差入委託証拠金	224,747,058
流動資産合計	390,724,907,050
資産合計	390,724,907,050
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,275,082
未払金	1,021,440
未払解約金	307,109,238
未払利息	617
その他未払費用	202
流動負債合計	314,406,579
負債合計	314,406,579
純資産の部	
元本等	
元本	138,413,913,899
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	251,996,586,572
元本等合計	390,410,500,471
純資産合計	390,410,500,471
負債純資産合計	390,724,907,050

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年12月10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>

	2019年12月10日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<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> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2019年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	138,413,913,899口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 2.8206円
	(1万口当たり純資産額) (28,206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

	2019年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<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</p>

	2019年12月10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	2019年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	114,007,040,111円
期中追加設定元本額	31,588,241,694円
期中一部解約元本額	7,181,367,906円
期末元本額	138,413,913,899円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン(毎月決算型)	1,709,912,535円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	696,176,822円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	476,264,879円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,010,279,661円
SBI資産設計オープン(分配型)	7,129,493円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,375,066,106円
世界経済インデックスファンド	6,674,717,449円
DCマイセレクション25	1,702,076,585円
DCマイセレクション50	1,294,867,794円
DCマイセレクション75	829,581,175円

区分	2019年12月10日現在
D C外国債券インデックス・オープン	1,927,543,812円
D CマイセレクションS 2 5	685,950,481円
D CマイセレクションS 5 0	531,262,675円
D CマイセレクションS 7 5	241,074,427円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 2 5	48,367,798円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 3 5	67,855,010円
D Cターゲット・イヤー ファンド2 0 4 5	32,418,266円
D C世界経済インデックスファンド	6,034,104,195円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	614,799,542円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	31,851,323円
マイセレクション5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	2,758,571円
マイセレクション7 5 V A 1(適格機関投資家専用)	2,138,242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)	48,089,768円
バランス3 0 V A 1(適格機関投資家専用)	94,089,537円
バランス5 0 V A 1(適格機関投資家専用)	166,490,835円
バランス2 5 V A 2(適格機関投資家専用)	155,323,687円
バランス5 0 V A 2(適格機関投資家専用)	379,803,330円
バランスA(2 5)V A 1(適格機関投資家専用)	2,045,041,395円
バランスB(3 7. 5)V A 1(適格機関投資家専用)	597,521,344円
バランスC(5 0)V A 1(適格機関投資家専用)	2,127,942,240円
世界バランスV A 1(適格機関投資家専用)	855,134,990円
世界バランスV A 2(適格機関投資家専用)	78,043,093円
バランスD(3 5)V A 1(適格機関投資家専用)	602,186,480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)	36,228,296円
バランスE(2 5)V A 1(適格機関投資家専用)	222,625,306円
バランスF(2 5)V A 1(適格機関投資家専用)	292,272,453円
F O F s用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	942,947,164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)	2,057,508,362円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	845,689,534円
外国債券ファンド・シリーズ1	562,242,332円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,233,227,473円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,245,074,481円
分散投資コア戦略ファンドA	1,695,587,483円
分散投資コア戦略ファンドS	5,859,781,668円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	282,013,813円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,778,609,754円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,067,919,695円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	224,890,734円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	109,873,579円
S M T グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,029,808,291円
S M T インデックスバランス・オープン	218,093,888円
外国債券S M T Bセレクション(SMA専用)	23,080,795,262円
S M T 世界経済インデックス・オープン	82,339,504円

区分	2019年12月10日現在
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	100,700,526円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	141,195,964円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,463,646円
グローバル経済コア	859,060,402円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	6,906,470円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	116,997円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	232,287,581円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	18,294,857円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	16,800円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	22,219円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	27,638円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	32,515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)	759,124,972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)	11,043,478,899円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	347,657,588円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	39,890,134,213円

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(2019年12月10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	1,103,217,200	-	1,098,464,067	4,753,133
	合計	1,103,217,200	-	1,098,464,067	4,753,133

(注)1.時価の算定方法

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

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2019年12月10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	1,277,199,883	-	1,278,227,300	1,027,417

	アメリカドル	642,860,036	-	641,885,100	974,936
	カナダドル	74,719,017	-	74,638,200	80,817
	ユーロ	468,504,950	-	468,858,000	353,050
	イギリスポンド	91,115,880	-	92,846,000	1,730,120
	合計	1,277,199,883	-	1,278,227,300	1,027,417

(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取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取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取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

	2019年12月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,136,057,840
コール・ローン	73,194,092
株式	59,752,967,475
投資信託受益証券	199,671,776
投資証券	159,358,862
派生商品評価勘定	29,776,096
未収入金	502,448
未収配当金	31,870,087
前払金	441,504
差入委託証拠金	188,393,288
流動資産合計	61,572,233,468
資産合計	61,572,233,468
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,641,636
前受金	25,107,660
未払解約金	24,065,550
未払利息	24
その他未払費用	7
流動負債合計	53,814,877
負債合計	53,814,877
純資産の部	
元本等	
元本	21,740,105,578
剰余金	
剰余金又は欠損金()	39,778,313,013
元本等合計	61,518,418,591
純資産合計	61,518,418,591
負債純資産合計	61,572,233,468

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年12月10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。 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。 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>

	2019年12月10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）

	2019年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	21,740,105,578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) 2.8297円 (28,297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

	2019年12月10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>

	2019年12月10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	2019年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	19,516,351,824円
期中追加設定元本額	2,887,854,259円
期中一部解約元本額	664,100,505円
期末元本額	21,740,105,578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	7,267,903,559円
世界経済インデックスファンド	3,334,488,295円
DC 新興国株式インデックス・オープン	4,266,661,208円
DC 世界経済インデックスファンド	3,020,701,087円
新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	208,832,811円
分散投資コア戦略ファンドA	343,089,679円
分散投資コア戦略ファンドS	1,121,980,051円
DC 世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	437,777,336円
DC 世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	467,370,910円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	348,124,475円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	18,607,236円
SMT インデックスバランス・オープン	110,894,836円
SMT 世界経済インデックス・オープン	59,271,562円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	222,972,983円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	33,498,496円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,417,077円

区分	2019年12月10日現在
グローバル経済コア	433,912,689円
i-SMT 新興国株式インデックス(ノーロード)	15,264,549円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	26,252円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	29,706円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	33,160円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	36,269円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	27,211,352円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2019年12月10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	1,312,288,596	-	1,337,396,256	25,107,660
	合計	1,312,288,596	-	1,337,396,256	25,107,660

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

(2019年12月10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	41,260,400	-	41,290,800	30,400
	アメリカドル 売建	41,260,400	-	41,290,800	30,400
	マレーシアリン ギット	7,826,400	-	7,830,000	3,600
	マレーシアリン ギット	7,826,400	-	7,830,000	3,600
	合計	49,086,800	-	49,120,800	26,800

(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取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

	2019年12月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	561,034,796
コール・ローン	389,227,726
国債証券	51,586,714,261
未収利息	966,269,169
前払費用	51,247,299
流動資産合計	53,554,493,251
資産合計	53,554,493,251
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	17,459
前受収益	45,271
未払金	59,393,723
未払解約金	38,981,565
未払利息	131
その他未払費用	31
流動負債合計	98,438,180
負債合計	98,438,180
純資産の部	
元本等	
元本	30,602,833,677
剰余金	
剰余金又は欠損金()	22,853,221,394
元本等合計	53,456,055,071
純資産合計	53,456,055,071
負債純資産合計	53,554,493,251

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年12月10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> <p>為替予約取引</p>

2019年12月10日現在	
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4.収益及び費用の計上基準	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)

2019年12月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	30,602,833,677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 1.7468円 (1万口当たり純資産額) (17,468円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2019年12月10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

	2019年12月10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> <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	2019年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	29,218,077,103円
期中追加設定元本額	2,757,057,499円
期中一部解約元本額	1,372,300,925円
期末元本額	30,602,833,677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	4,177,380,078円
世界経済インデックスファンド	5,556,033,509円
DC新興国債券インデックス・オープン	4,357,702,723円
DC世界経済インデックスファンド	5,025,967,612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）	1,824,646,078円
コア投資戦略ファンド（安定型）	138,847,350円
コア投資戦略ファンド（成長型）	463,349,849円
新興国債券インデックス・オープン（SMA専用）	98,361,423円
分散投資コア戦略ファンドA	235,054,582円
分散投資コア戦略ファンドS	1,045,456,060円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	235,535,553円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	2,326,987,140円
コア投資戦略ファンド（切替型）	144,618,229円

区分	2019年12月10日現在
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	192,316,991円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	91,339,383円
SMT インデックスバランス・オープン	189,127,355円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	3,275,501,023円
SMT 世界経済インデックス・オープン	98,290,785円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	120,397,073円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	166,865,193円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,305,193円
グローバル経済コア	701,677,354円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	28,048,658円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	2,567,889円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	22,339円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	23,809円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	25,278円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	26,454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)	104,358,714円

(デリバティブ取引に関する注記)

通貨関連

(2019年12月10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	37,954,702	-	37,972,161	17,459
	マレーシアリン ギット	37,954,702	-	37,972,161	17,459
合計		37,954,702	-	37,972,161	17,459

(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】

2019年12月30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。

2019年12月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	539	12,804,006
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	87	326,953
単位型公社債投資信託	17	140,733
合計	643	13,271,692

(3)【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、2019年6月27日に運用多様化のための投資対象資産拡大を図る（商品先物等投資を可能とする）べく事業目的の追加を行いました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2020年3月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

5【委託会社等の経理状況】

(1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は、「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条及び第57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。

(2) 委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第34期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第33期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第34期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(3) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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。

また、第34期事業年度の中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日現在)		当事業年度 (2019年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		23,973,152		23,830,484
有価証券		-		2,268,127
前払費用		157,614		197,843
未収委託者報酬		5,373,307		6,351,590
未収運用受託報酬		-		5,525,778
未収収益		896		212,722
その他		8,946		2,261,900
流動資産合計		29,513,917		40,648,447
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	36,782	1	282,407
器具備品	1	79,655	1	564,981
その他	1	1,912	1	14,462
有形固定資産合計		118,350		861,851
無形固定資産				
ソフトウェア		210,679		1,487,265
その他		4,377		7,256
無形固定資産合計		215,056		1,494,522
投資その他の資産				
投資有価証券		42,802		11,334,053
関係会社株式		-		4,663,000

長期貸付金	17,088	-
繰延税金資産	248,633	141,789
その他	32,880	32,492
貸倒引当金	17,088	-
投資その他の資産合計	324,317	16,171,335
固定資産合計	657,724	18,527,709
資産合計	30,171,641	59,176,157

(単位：千円)

	前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	24,591	38,118
未払金	2,950,503	5,327,037
未払収益分配金	45	115
未払手数料	2,160,863	2,718,199
その他未払金	789,595	2,608,722
未払費用	74,279	178,529
未払法人税等	838,596	1,992,137
賞与引当金	106,177	132,159
その他	74,131	395,910
流動負債合計	4,068,279	8,063,893
固定負債		
退職給付引当金	496,696	537,798
資産除去債務	13,374	131,970
その他	1,074	82
固定負債合計	511,145	669,852
負債合計	4,579,425	8,733,745
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	2,000,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	17,239,438
資本剰余金合計	350,000	17,239,438
利益剰余金		
利益準備金	74,500	75,000
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	22,767,534	28,501,567

利益剰余金合計	24,942,034	30,676,567
株主資本合計	25,592,034	49,916,006
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	182	393,355
繰延ヘッジ損益	-	133,049
評価・換算差額等合計	182	526,404
純資産合計	25,592,216	50,442,411
負債・純資産合計	30,171,641	59,176,157

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	29,206,178	30,551,851
運用受託報酬	-	5,464,685
その他営業収益	-	283,013
営業収益合計	29,206,178	36,299,550
営業費用		
支払手数料	12,544,178	13,423,932
広告宣伝費	175,296	276,617
公告費	-	1,401
調査費	6,008,380	5,508,097
調査費	396,842	567,136
委託調査費	5,609,496	4,935,847
図書費	2,041	5,113
営業雑経費	1,474,361	2,315,373
通信費	33,158	45,767
印刷費	368,414	449,571
協会費	36,616	38,658
諸会費	105	5,270
情報機器関連費	942,093	1,657,735
その他営業雑経費	93,973	118,370
営業費用合計	20,202,216	21,525,421
一般管理費		
給料	2,006,157	3,931,172
役員報酬	84,130	161,977
給料・手当	1,649,268	3,425,725
賞与	272,758	343,470
退職給付費用	84,944	98,748
福利費	239,702	297,753
交際費	5,831	9,851

旅費交通費	73,807	141,173
租税公課	102,158	270,353
不動産賃借料	124,629	219,292
寄付金	-	8,000
減価償却費	119,300	152,281
業務委託費	484,841	657,473
諸経費	246,326	433,138
一般管理費合計	3,487,699	6,219,240
営業利益	5,516,262	8,554,888

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
受取利息	2,136	11,327
収益分配金	116	8,610
投資有価証券売却益	499	46,789
デリバティブ利益	-	250,343
貸倒引当金戻入	2,750	17,088
その他	4,351	6,090
営業外収益合計	9,854	340,249
営業外費用		
投資有価証券売却損	2,224	34,437
固定資産除却損	7,891	7,868
為替差損	-	198,670
その他	1,182	4,509
営業外費用合計	11,298	245,485
経常利益	5,514,818	8,649,651
特別損失		
統合関連費用	51,569	335,911
特別損失合計	51,569	355,911
税引前当期純利益	5,463,248	8,313,740
法人税、住民税及び事業税	1,739,837	2,674,603
法人税等調整額	50,178	125,397
法人税等合計	1,689,659	2,549,206
当期純利益	3,773,589	5,764,533

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本
	資本剰余金

	資本金	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			
その他資本剰余金から 資本金への振替			
会社分割による増加			
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	71,500	2,100,000	19,026,944	21,198,444	21,848,444
当期変動額					
その他資本剰余金 から 資本金への振替					-
会社分割による増加					-
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			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,134	-	1,134	21,847,309
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				-
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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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			
その他資本剰余金から 資本金への振替	1,700,000	1,700,000	1,700,000
会社分割による増加		18,589,438	18,589,438
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	1,700,000	16,889,438	16,889,438
当期末残高	2,000,000	17,239,438	17,239,438

	株主資本				
	利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		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	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034
当期変動額					
その他資本剰余金 から 資本金への振替					-
会社分割による増加					18,589,438
剰余金の配当	500		30,500	30,000	30,000
当期純利益			5,764,533	5,764,533	5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純 額）					
当期変動額合計	500	-	5,734,033	5,734,533	24,323,972
当期末残高	75,000	2,100,000	28,501,567	30,676,567	49,916,006

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	182	-	182	25,592,216
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				18,589,438
剰余金の配当				30,000
当期純利益				5,764,533
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393,172	133,049	526,222	526,222
当期変動額合計	393,172	133,049	526,222	24,850,194
当期末残高	393,355	133,049	526,404	50,442,411

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

- (1) 子会社株式
移動平均法による原価法によっております。
- (2) 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. デリバティブの評価基準及び評価方法
時価法によっております。
3. 固定資産の減価償却の方法
(1) 有形固定資産
定額法によっております。
(2) 無形固定資産
定額法によっております。
ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、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。
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準
外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。
5. 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。
6. ヘッジ会計の会計処理
(1) ヘッジ会計の方法
繰延ヘッジ処理によっております。
(2) ヘッジ手段とヘッジ対象
ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。
(3) ヘッジ方針
自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。
(4) ヘッジ有効性評価の方法
ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。
7. 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。

会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更

（有形固定資産の減価償却方法の変更）

有形固定資産（リース資産を除く。）の減価償却方法は、従来、定率法（ただし、2016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）を採用していましたが、当事業年度より定額法へ変更しております。

この変更は、三井住友信託銀行株式会社の運用事業の統合予定、拠点の移転及びシステムの統合など大型の設備投資が計画されていることを契機に、有形固定資産の減価償却方法を検討した結果、有形固定資産は長期安定的に使用されると見込まれ、使用実態に即して耐用年数の全期間にわたり均等に費用按分する定額法が期間損益をより適正に示すとの判断に至ったものです。なお、この変更による当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に及ぼす影響は軽微であります。

表示方法の変更

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」94,211千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」248,633千円に含めて表示しております。

（貸借対照表関係）

三井住友信託銀行株式会社の運用事業との統合を機に表示方法の見直しを行なった結果、以下の表示方法の変更を行なっております。

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めて表示しておりました「未収収益」は、当事業年度より独立掲記しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた9,842千円は、「流動資産」の「未収収益」896千円、「その他」8,946千円として組替えております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「投資その他の資産」の「長期前払費用」及び「会員権」は、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「投資その他の資産」の「長期前払費用」7,810千円及び「会員権」25,000千円は、「投資その他の資産」の「その他」32,880千円に含めて表示しております。

前事業年度において、独立掲記しておりました「流動負債」の「未払消費税等」は、当事業年度より「流動負債」の「その他」に含めて表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行なっております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「未払消費税等」72,890千円は、「流動負債」の「その他」74,131千円に含めて表示しております。

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 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
建 物	63,830	千円	53,521	千円
器具備品	325,834	"	351,328	"
そ の 他	2,677	"	3,595	"
計	392,342	"	408,445	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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
2017年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2017年3月31日	2017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
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益 剰余金	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

4. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2019年6月27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
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305,812	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

(リ - ス取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全

性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため有価証券及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(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極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針6.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

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（2018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) 未収運用受託報酬	-	-	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	42,799	42,799	-
(5) 未払金	(2,950,503)	(2,950,503)	-
(6) 未払法人税等	(838,596)	(838,596)	-
(7) デリバティブ取引			

ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	-	-	-
デリバティブ取引計	-	-	-

(*) 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(2019年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額 (*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金及び預金	23,830,484	23,830,484	-
(2) 未収委託者報酬	6,351,590	6,351,590	-
(3) 未収運用受託報酬	5,525,778	5,525,778	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	13,602,178	13,602,178	-
(5) 未払金	(5,327,037)	(5,327,037)	-
(6) 未払法人税等	(1,992,137)	(1,992,137)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(850)	(850)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82,081	82,081	-
デリバティブ取引計	81,231	81,231	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、及び(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 有価証券及び投資有価証券

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。

(5) 未払金、及び(6) 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。

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(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	前事業年度 2018年3月31日	当事業年度 2019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、「(4)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」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(2018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	-	-	-
未収運用受託報酬	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	-	12,846	21,065	496

当事業年度（2019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	23,830,484	-	-	-
未収委託者報酬	6,351,590	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525,778	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268,127	491,940	7,800,848	508

（有価証券関係）

1. 子会社株式

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、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子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663,000

2. その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

（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

当事業年度（2019年3月31日）

（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	4,405,802	3,432,259	973,543

小計	4,405,802	3,432,259	973,543
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9,196,375	9,602,961	406,585
小計	9,196,375	9,602,961	406,585
合計	13,602,178	13,035,220	566,957

(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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2018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

当事業年度(2019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
1,538,203	46,789	34,437

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2018年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(2019年3月31日)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類	契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)	
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	887,121	-	3,257	3,257
	英ポンド	66,467	-	1,275	1,275
	カナダドル	3,344	-	42	42
	スイスフラン	7,802	-	6	6
	香港ドル	183,640	-	645	645
	ユーロ	183,228	-	2,601	2,601
	買建				
	米ドル	10,985	-	90	90
スイスフラン	1,110	-	5	5	
香港ドル	560	-	4	4	
ユーロ	2,492	-	0	0	
合計	1,346,753	-	7,916	7,916	

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)	評価損益 (千円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	6,739,103	-	8,766	8,766
合計		6,739,103	-	8,766	8,766

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (千円)	契約額等の うち1年超 (千円)	時価 (千円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	有価証券 投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		3,432,867	-	13,731
	英ポンド		2,575,513	-	50,256
	カナダドル		40,963	-	566
	スイスフラン		34,448	-	132
	香港ドル		566,113	-	2,528
	人民元		1,725,146	-	9,137
	ユーロ		262,583	-	6,080
	買建 ユーロ		6,313	-	86
	合計			8,643,951	-

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付債務	496,696	537,798
(2) 退職給付引当金	496,696	537,798

(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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) 退職給付費用	84,944	98,748

(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15,458千円、当事業年度で19,024千円であります。

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 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	42,041	千円	125,592	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	5,232	"	-	"
賞与引当金損金算入限度超過額	32,511	"	40,467	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	152,088	"	164,674	"
その他	23,674	"	82,358	"
繰延税金資産 合計	255,547	"	413,091	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	6,833	"	-	"
有価証券評価差額	-	"	173,602	"
繰延ヘッジ損益	-	"	58,719	"
その他	80	"	38,979	"
繰延税金負債 合計	6,913	"	271,302	"
繰延税金資産の純額	248,633	"	141,789	"

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。

（企業結合等関係）

共通支配下の取引等

(1)取引の概要

対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：三井住友信託銀行株式会社の運用事業

事業の内容：法人・機関投資家向けの資産運用サービスの提供

企業結合日

2018年10月1日

企業結合の法的形式

三井住友信託銀行株式会社（当社の親会社の連結子会社）を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする吸収分割

結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（当社）

その他取引の概要に関する事項

三井住友トラスト・グループの成長事業と位置づける資産運用ビジネスの強化を目的として、法人・機関投資家向けサービスを提供し、高いノウハウ・品質を有する三井住友信託銀行株式会社の運用機能を分割し、確定拠出年金・ファンドラップ・インデックス投信等を中心に個人顧客向けに業容拡大を図ってきた当社に発展的に統合するものであります。

(2)実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（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 2017年4月1日 至 2018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いません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679,437千円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(持分法損益等)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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	9,571,581	未払手数料	1,568,277
							投資助言費用	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。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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	運用受託報酬	4,540,311	未収運用受託報酬	4,903,536
							投信販売代行手数料等	9,564,223	未払手数料	1,774,045
							投資助言費用	3,357,115	その他未払金	182,885
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	18,603,427 13,907,536 4,663,000 13,989 18,589,438 無対価	-	-

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

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。

吸収分割

共通支配下の取引に該当するため、承継資産及び承継負債は、分割会社の適正な帳簿価額によって引き継いでおります。また、当該会社分割は、無対価取引であるため、差引純資産と同額のその他資本剰余金を増額しております。

（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（2018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（2019年3月31日）

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

（1株当たり情報）

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	8,530,738円79銭	16,814,137円07銭
1株当たり当期純利益金額	1,257,863円25銭	1,921,511円21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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,773,589千円	5,764,533千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

（単位：百万円）

第34期中間会計期間末

（2019年9月30日）

資産の部

流動資産

現金及び預金		25,294
金銭の信託		3,373
未収委託者報酬		6,890
未収運用受託報酬		5,509
その他		2,758
流動資産合計		43,826

固定資産

有形固定資産	1	881
無形固定資産		2,539
投資その他の資産		
投資有価証券		10,344
関係会社株式		4,663
繰延税金資産		319
その他		32
投資その他の資産合計		15,358
固定資産合計		18,780

資産合計

資産合計		62,606
------	--	--------

負債の部

流動負債

未払金		7,726
未払法人税等		688
賞与引当金		146
その他	2	655
流動負債合計		9,216

固定負債	
退職給付引当金	582
資産除去債務	132
その他	3
固定負債合計	718
負債合計	9,935

(単位：百万円)

第34期中間会計期間末

(2019年9月30日)

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	305
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	30,860
利益剰余金合計	33,266
株主資本合計	52,505
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	120
繰延ヘッジ損益	286
評価・換算差額等合計	165
純資産合計	52,671
負債・純資産合計	62,606

中間損益計算書

(単位：百万円)

第34期中間会計期間

(自 2019年4月1日

至 2019年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	16,961
運用受託報酬	5,393
その他営業収益	253
営業収益合計	22,608
営業費用	11,776
一般管理費	1
営業利益	4,411
営業外収益	6,421
営業外収益	2
営業外費用	1,110
営業外費用	3
	456

経常利益	7,075
税引前中間純利益	7,075
法人税、住民税及び事業税	2,197
法人税等調整額	18
法人税等合計	2,179
中間純利益	4,895

中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				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	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当中間期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
中間純利益			4,895	4,895	4,895
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	230	-	2,359	2,589	2,589
当中間期末残高	305	2,100	30,860	33,266	52,505

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,305
中間純利益				4,895
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	513	152	360	360
当中間期変動額合計	513	152	360	2,229
当中間期末残高	120	286	165	52,671

重要な会計方針

第34期中間会計期間
(自 2019年4月1日
至 2019年9月30日)

1. 資産の評価基準及び評価方法

有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間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. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6. 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中間会計期間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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

7. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

- (2) ヘッジ手段とヘッジ対象
ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。
- (3) ヘッジ方針
自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。
- (4) ヘッジ有効性評価の方法
ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。
8. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項
- (1) 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。
- (2) 連結納税制度の適用
当中間会計期間より、連結納税制度を適用しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第34期中間会計期間末 (2019年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 470百万円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1	減価償却実施額 有形固定資産 62百万円 無形固定資産 42百万円
2	営業外収益の主要項目 投資有価証券売却益 481百万円 投資有価証券償還益 309百万円 為替差益 181百万円
3	営業外費用の主要項目 デリバティブ費用 456百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第34期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30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	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	3,000	-	-	3,000

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

(金融商品関係)

第34期中間会計期間末(2019年9月30日)

2019年9月30日における貸借対照表計上額、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、次表には含まれておりません(注2)を参照ください。)

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	25,294	25,294	-
(2)金銭の信託	3,373	3,373	
(3)未収委託者報酬	6,890	6,890	-
(4)未収運用受託報酬	5,509	5,509	
(5)投資有価証券 その他有価証券	10,344	10,344	-
(6)未払金	(7,726)	(7,726)	-
(7)デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(51)	(51)	
ヘッジ会計が適用されているもの	48	48	
デリバティブ取引計	(3)	(3)	

(*)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並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1)現金及び預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2)金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3)未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5)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。

(6)未払金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(7)デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額：投資有価証券0百万円、関係会社株式4,663百万円）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ため、「(5)投資有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第34期中間会計期間末（2019年9月30日）

1. 子会社株式

時価のある子会社株式はありません。なお、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子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

2. その他有価証券

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	6,576	6,415	160
小計	6,576	6,415	160
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,767	4,101	334
小計	3,767	4,101	334
合計	10,344	10,517	173

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額0百万円）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。

(デリバティブ取引関係)

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	872	-	1	1
	英ポンド	52	-	0	0
	カナダドル	2	-	0	0
	スイスフラン	6	-	0	0
	香港ドル	195	-	0	0
ユーロ	155	-	2	2	
合計		1,285	-	5	5

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	6,493	-	57	57
合計		6,493	-	57	57

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	有価証券	2,500	-	5
	英ポンド	投資有価証券	2,259	-	41
	カナダドル	子会社株式	22	-	0
	スイスフラン		53	-	0
	香港ドル		96	-	0
ユーロ		113	-	1	
合計			5,046	-	48

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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

（関連情報）

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,706百万円

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第34期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第34期中間会計期間 （自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）	
1株当たり純資産額	17,557,176円40銭
1株当たり中間純利益	1,631,928円83銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第34期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
中間純利益	4,895百万円
普通株式に係る中間純利益	4,895百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

2019年6月5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2018年4月1日から2019年3月31日までの第33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2019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

2019年12月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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に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、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年2月10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

中島紀子

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SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）の2019年6月11日から2019年12月10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に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、SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）の2019年12月10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（2019年6月11日から2019年12月10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。