

**【表紙】**

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年5月20日提出
【計算期間】	第2期中(自 2018年8月21日至 2019年2月20日)
【ファンド名】	グローバル経済コア
【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 橋詰 廣志
【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3月29日現在の状況について記載してあります。

### 【グローバル経済コア】

#### （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	12,751,795,020	99.20
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		102,551,969	0.80
合計（純資産総額）		12,854,346,989	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 8月20日)	13,643,422,697	13,643,422,697	9,632	9,632
2018年 3月末日	13,425,095,835		9,781	
4月末日	14,012,661,709		9,916	
5月末日	13,722,454,062		9,768	
6月末日	13,581,474,010		9,699	
7月末日	13,856,061,471		9,857	
8月末日	13,685,739,522		9,779	
9月末日	13,441,434,195		9,953	
10月末日	12,637,624,580		9,513	
11月末日	12,899,461,417		9,719	
12月末日	12,251,763,337		9,302	
2019年 1月末日	12,621,788,181		9,643	
2月末日	12,851,332,628		9,890	
3月末日	12,854,346,989		9,894	

##### 【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11月30日～2018年 8月20日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第1期計算期間	2017年11月30日～2018年 8月20日	3.7
第2期中間計算期間	2018年 8月21日～2019年 2月20日	2.4

(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	271,889,555,400	97.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,226,874,620	2.24
合計(純資産総額)		278,116,430,020	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	6,224,720,000	2.24

(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	378,411,258,300	83.31
地方債証券	日本	24,963,573,024	5.50
特殊債券	日本	31,303,289,120	6.89
社債券	日本	16,038,930,420	3.53

	フランス	1,399,658,000	0.31
	オーストラリア	601,653,000	0.13
	オランダ	200,640,000	0.04
	アメリカ	105,910,000	0.02
	イギリス	100,535,000	0.02
	スウェーデン	100,254,000	0.02
	小計	18,547,580,420	4.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		970,588,555	0.21
合計(純資産総額)		454,196,289,419	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	219,185,657,138	61.85
	イギリス	21,889,843,172	6.18
	カナダ	13,334,147,361	3.76
	フランス	13,015,317,998	3.67
	スイス	12,575,567,466	3.55
	ドイツ	11,000,235,078	3.10
	オーストラリア	8,078,909,548	2.28
	オランダ	6,335,057,613	1.79
	アイルランド	5,962,670,358	1.68
	スペイン	3,900,571,534	1.10
	香港	3,525,527,288	0.99
	スウェーデン	3,177,728,422	0.90
	イタリア	2,521,686,286	0.71
	デンマーク	2,314,165,013	0.65
	シンガポール	1,592,585,335	0.45
	フィンランド	1,586,744,169	0.45
	バミューダ	1,416,816,258	0.40
	ベルギー	1,305,314,287	0.37
	ケイマン	974,155,969	0.27
	ノルウェー	927,366,295	0.26
	ジャージー	917,972,743	0.26
	イスラエル	671,665,697	0.19
	キュラソー	576,599,128	0.16
	ルクセンブルク	421,748,140	0.12
	ニュージーランド	314,890,355	0.09

	オーストリア	307,584,292	0.09
	ポルトガル	205,885,311	0.06
	パナマ	196,257,273	0.06
	リベリア	173,296,262	0.05
	パプアニューギニア	73,886,818	0.02
	英ヴァージン諸島	59,786,711	0.02
	マン島	33,457,760	0.01
	モーリシャス	9,606,162	0.00
	小計	338,582,703,240	95.54
投資信託受益証券	オーストラリア	166,042,650	0.05
	香港	91,648,410	0.03
	小計	257,691,060	0.07
投資証券	アメリカ	7,341,609,684	2.07
	オーストラリア	657,135,711	0.19
	フランス	425,716,422	0.12
	イギリス	272,898,296	0.08
	香港	231,731,269	0.07
	シンガポール	152,291,559	0.04
	カナダ	68,523,865	0.02
	小計	9,149,906,806	2.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,383,706,063	1.80
合計(純資産総額)		354,374,007,169	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,336,473,641	1.22
	買建	カナダ	238,474,248	0.07
	買建	ドイツ	1,095,126,580	0.31
	買建	イギリス	467,288,662	0.13
	買建	オーストラリア	242,525,760	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。

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		506,424,440	0.14

(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	130,684,636,926	45.60
	フランス	28,137,836,454	9.82
	イタリア	24,762,485,342	8.64
	イギリス	19,382,347,001	6.76
	ドイツ	18,806,494,632	6.56
	スペイン	15,959,000,292	5.57
	ベルギー	6,961,517,185	2.43
	オーストラリア	5,934,583,858	2.07
	カナダ	5,638,425,081	1.97
	オランダ	5,579,882,578	1.95
	オーストリア	4,128,400,964	1.44
	メキシコ	2,243,254,547	0.78
	アイルランド	2,207,280,323	0.77
	フィンランド	1,786,631,879	0.62
	ポーランド	1,740,816,754	0.61
	南アフリカ	1,537,906,951	0.54
	デンマーク	1,452,144,111	0.51
	マレーシア	1,323,939,756	0.46
	シンガポール	1,124,691,373	0.39
	スウェーデン	1,016,305,195	0.35
ノルウェー	656,863,796	0.23	
	小計	281,065,444,998	98.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,555,049,077	1.94
合計(純資産総額)		286,620,494,075	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	1,017,493,898	0.35

買建	ドイツ	1,208,128,615	0.42
----	-----	---------------	------

(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		3,018,244,300	1.05

(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	9,140,173,179	16.76
	韓国	7,096,983,527	13.01
	中国	6,072,352,517	11.14
	台湾	6,020,782,571	11.04
	インド	5,003,767,507	9.18
	ブラジル	3,789,853,061	6.95
	南アフリカ	2,956,432,377	5.42
	ロシア	2,038,980,576	3.74
	香港	2,019,125,581	3.70
	メキシコ	1,390,366,136	2.55
	タイ	1,281,899,586	2.35
	マレーシア	1,189,772,933	2.18
	インドネシア	1,188,616,520	2.18
	ポーランド	622,961,527	1.14
	フィリピン	582,064,898	1.07
	チリ	563,496,451	1.03
	バミューダ	563,085,867	1.03
	カタール	513,965,175	0.94
	アラブ首長国連邦	396,034,638	0.73
	トルコ	307,748,194	0.56
	コロンビア	239,651,067	0.44
	アメリカ	185,122,833	0.34
ハンガリー	168,311,293	0.31	

	ギリシャ	119,262,559	0.22
	チェコ	95,980,133	0.18
	エジプト	70,728,766	0.13
	ペルー	32,319,844	0.06
	マン島	28,430,864	0.05
	シンガポール	28,285,302	0.05
	パキスタン	23,756,736	0.04
	ルクセンブルク	21,952,266	0.04
	小計	53,752,264,484	98.57
投資信託受益証券	ブラジル	89,550,197	0.16
投資証券	南アフリカ	129,290,788	0.24
	メキシコ	47,164,753	0.09
	小計	176,455,541	0.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		513,756,615	0.94
合計(純資産総額)		54,532,026,837	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	499,878,981	0.92

(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		22,389,063	0.04
	売建		202,668	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。

#### 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	4,926,044,594	10.20
	ブラジル	4,754,067,689	9.84
	インドネシア	4,673,113,458	9.68
	ポーランド	4,426,686,947	9.17
	タイ	4,151,182,305	8.60
	南アフリカ	3,920,731,038	8.12
	ロシア	3,636,627,759	7.53
	コロンビア	3,369,608,898	6.98
	マレーシア	2,928,081,509	6.06
	ハンガリー	2,244,700,431	4.65
	チェコ	2,023,104,143	4.19
	トルコ	1,881,172,443	3.90
	ペルー	1,635,983,611	3.39
	チリ	1,561,578,766	3.23
	フィリピン	138,584,775	0.29
	ウルグアイ	109,683,453	0.23
ドミニカ共和国	44,581,957	0.09	
	小計	46,425,533,776	96.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,864,953,522	3.86
合計(純資産総額)		48,290,487,298	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		10,715,949	0.02
	売建		10,674,300	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。

#### J-REIT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(%)
投資証券	日本	110,662,458,920	97.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,633,706,878	2.32
合計(純資産総額)		113,296,165,798	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 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	2,627,345,000	2.32

(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。

#### グローバルREIT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(%)
投資証券	アメリカ	56,315,684,481	72.28
	オーストラリア	5,346,228,584	6.86
	イギリス	3,881,603,438	4.98
	フランス	3,160,154,138	4.06
	シンガポール	2,906,265,775	3.73
	香港	1,836,830,117	2.36
	カナダ	1,483,864,117	1.90
	ベルギー	674,491,527	0.87
	スペイン	523,974,199	0.67
	ニュージーランド	349,961,322	0.45
	オランダ	234,693,474	0.30
	ドイツ	221,095,744	0.28
	アイルランド	183,091,118	0.23
	ガーンジー	141,666,337	0.18
	イスラエル	50,774,505	0.07
	マン島	33,496,782	0.04
	イタリア	27,315,647	0.04
	韓国	10,135,650	0.01
	小計	77,381,326,955	99.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		530,519,151	0.68
合計(純資産総額)		77,911,846,106	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		166,672,100	0.21

(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。

## ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）

## 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	18,277,662,275	99.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		74,633,369	0.41
合計(純資産総額)		18,352,295,644	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		27,740,000	0.15
	売建		18,560,068,233	101.13

(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】

## 【グローバル経済コア】

	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11月30日～2018年 8月20日	17,310,062,925	3,145,035,108	14,165,027,817
第2期中間計算期間	2018年 8月21日～2019年 2月20日	1,473,494,880	2,598,305,146	13,040,217,551

(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2期中間計算期間(2018年8月21日から2019年2月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【グローバル経済コア】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位：円 )

	第1期 ( 2018年 8月20日現在 )	第2期中間計算期間 ( 2019年 2月20日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	212,814,175	221,502,594
親投資信託受益証券	13,507,669,384	12,742,486,260
未収入金	28,091,481	14,012,055
流動資産合計	13,748,575,040	12,978,000,909
資産合計	13,748,575,040	12,978,000,909
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	76,129,192	59,986,653
未払受託者報酬	1,697,234	3,499,892
未払委託者報酬	27,155,654	55,998,153
未払利息	543	544
その他未払費用	169,720	349,929
流動負債合計	105,152,343	119,835,171
負債合計	105,152,343	119,835,171
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	14,165,027,817	13,040,217,551
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	521,605,120	182,051,813
( 分配準備積立金 )	138,554,922	115,383,395
元本等合計	13,643,422,697	12,858,165,738
純資産合計	13,643,422,697	12,858,165,738
負債純資産合計	13,748,575,040	12,978,000,909

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 自 2017年11月30日 至 2018年 5月29日	第2期中間計算期間 自 2018年 8月21日 至 2019年 2月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	14	25
有価証券売買等損益	347,013,328	373,975,041
営業収益合計	347,013,314	373,975,066
<b>営業費用</b>		
支払利息	53,047	66,727
受託者報酬	2,743,004	3,499,892
委託者報酬	43,888,041	55,998,153
その他費用	277,559	354,700
営業費用合計	46,961,651	59,919,472
営業利益又は営業損失（ ）	393,974,965	314,055,594
経常利益又は経常損失（ ）	393,974,965	314,055,594
中間純利益又は中間純損失（ ）	393,974,965	314,055,594
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（ ）	28,456,822	17,898,231
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	521,605,120
剰余金増加額又は欠損金減少額	132,273,975	96,402,375
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	96,402,375
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	132,273,975	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	23,372,347	53,006,431
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	23,372,347	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	53,006,431
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	256,616,515	182,051,813

## (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1期 (2018年 8月20日現在)	第2期中間計算期間 (2019年 2月20日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	14,165,027,817口	13,040,217,551口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 521,605,120円	元本の欠損 182,051,813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 0.9632円 (1万口当たり純資産額) (9,632円)	1口当たり純資産額 0.9860円 (1万口当たり純資産額) (9,860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2期中間計算期間 (2019年 2月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務



	第2期中間計算期間 (2019年 2月20日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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1期 自 2017年11月30日 至 2018年 8月20日	第2期中間計算期間 自 2018年 8月21日 至 2019年 2月20日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	386,432,484円	14,165,027,817円
期中追加設定元本額	16,923,630,441円	1,473,494,880円
期中一部解約元本額	3,145,035,108円	2,598,305,146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 2月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,089,964,791
株式	273,989,340,060
派生商品評価勘定	133,772,540
未収入金	7,606,300
未収配当金	405,884,942
差入委託証拠金	108,126,700
流動資産合計	277,734,695,333
資産合計	277,734,695,333
負債の部	
流動負債	
前受金	133,799,000
未払金	72,440
未払解約金	167,006,667
未払利息	7,595
その他未払費用	55
流動負債合計	300,885,757
負債合計	300,885,757
純資産の部	
元本等	
元本	189,083,780,945
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	88,350,028,631
元本等合計	277,433,809,576
純資産合計	277,433,809,576
負債純資産合計	277,734,695,333

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

	2019年 2月20日現在
	(2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2019年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	189,083,780,945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 1.4673円 (1万口当たり純資産額) (14,673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 2月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2019年 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	139,526,478,825円
期中追加設定元本額	57,699,063,286円
期中一部解約元本額	8,141,761,166円
期末元本額	189,083,780,945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）	639,077,565円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,924,443,253円
SBI資産設計オープン（分配型）	16,331,758円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,997,699,362円
世界経済インデックスファンド	2,037,543,587円
日本株式インデックス・オープン	5,641,836,033円
DCマイセレクション25	6,746,155,534円
DCマイセレクション50	18,984,137,368円
DCマイセレクション75	17,293,965,945円
DC日本株式インデックス・オープン	5,521,215,872円
DCマイセレクションS25	2,690,312,055円
DCマイセレクションS50	7,634,565,896円
DCマイセレクションS75	5,011,062,988円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,088,779,554円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	404,778,599円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	640,172,415円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	411,689,065円
DC世界経済インデックスファンド	1,675,780,026円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,136,865,305円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	24,901,418円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	48,991,837円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	42,572,583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）	324,078,130円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,765,472円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	117,635,597円

区分	2019年 2月20日現在
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	435,131,328円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	68,405,963円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	603,730,854円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,028,791,790円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	789,614,374円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,496,134,985円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	682,695,609円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	51,688,547円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	895,147,694円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	122,974,183円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	514,018,456円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	660,269,362円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	63,403,986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)	920,697,022円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,163,043,332円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,242,072,614円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,239,424,723円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,610,074,483円
分散投資コア戦略ファンドA	930,943,623円
分散投資コア戦略ファンドS	2,018,121,421円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	209,868,956円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	246,221,325円
コア投資戦略ファンド(切替型)	571,766,575円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	232,604,033円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,243,669円
SMT インデックスバランス・オープン	75,743,864円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	13,051,150,949円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	740,838,148円
SMT 世界経済インデックス・オープン	9,488,273円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	53,487,871円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	7,284,577円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,676,803円
グローバル経済コア	332,954,595円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	8,614,314円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	39,568,005円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	671,368円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	57,471,539円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	16,277,297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)	50,122,266,188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)	700,841,030円

(デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

（2019年 2月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,080,051,000	-	3,213,850,000	133,799,000
合計		3,080,051,000	-	3,213,850,000	133,799,000

## (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 2月20日現在
	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	1,128,988,346
国債証券	367,569,568,600
地方債証券	24,345,332,507
特殊債券	30,664,882,966
社債券	17,826,959,500
未収入金	78,704
未収利息	1,061,419,265
前払費用	33,359,518
流動資産合計	442,630,589,406
資産合計	442,630,589,406
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	604,418,996
未払解約金	119,567,681
未払利息	2,775
その他未払費用	21
流動負債合計	723,989,473
負債合計	723,989,473
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	313,402,130,342
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	128,504,469,591
元本等合計	441,906,599,933
純資産合計	441,906,599,933
負債純資産合計	442,630,589,406

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2019年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	313,402,130,342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 101,691,000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 1.4100円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (14,100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 2月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</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 2月20日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(2)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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	289,379,948,264円
期中追加設定元本額	38,970,228,232円
期中一部解約元本額	14,948,046,154円
期末元本額	313,402,130,342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)	3,849,866,999円
S B I 資産設計オープン(分配型)	16,147,811円
S M T 国内債券インデックス・オープン	14,536,100,762円
世界経済インデックスファンド	1,840,620,925円
D C マイセレクション 2 5	19,517,855,444円
D C マイセレクション 5 0	21,181,586,867円
D C マイセレクション 7 5	5,719,327,813円
D C 日本債券インデックス・オープン	450,583,808円
D C 日本債券インデックス・オープン S	80,524,115,563円
D C 日本債券インデックス・オープン P	37,107,666,298円
D C マイセレクション S 2 5	7,791,520,854円
D C マイセレクション S 5 0	8,511,696,204円
D C マイセレクション S 7 5	1,657,564,433円



区分	2019年 2月20日現在
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,214,634,984円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	1,180,250,739円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	386,117,738円
DC世界経済インデックスファンド	1,518,976,672円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	88,907,714円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	7,759,987円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	54,466,533円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	14,074,459円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	866,233円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	234,507,740円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	347,010,031円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	65,910,481円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	169,704,254円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	4,587,554,331円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	988,418,779円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,716,232,974円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	822,674,002円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	114,205,199円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,335,818,820円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	91,015,905円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,511,772,574円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,942,149,303円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	169,970,087円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,432,200,301円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,087,357,487円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	58,509,761円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	709,857,716円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	61,155,865円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	32,809,274円
SMT インデックスバランス・オープン	67,723,738円
SMT 世界経済インデックス・オープン	7,551,386円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	11,038,421円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	19,733,266円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,627,527円
グローバル経済コア	247,557,808円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	8,283,082円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	279,897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)	72,386,564,253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 2月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	9,771,111,498
コール・ローン	492,423,007
株式	331,909,644,888
投資信託受益証券	234,442,039
投資証券	8,641,845,251
派生商品評価勘定	996,617,413
未収入金	66,002
未収配当金	430,891,376
差入委託証拠金	3,280,446,161
流動資産合計	355,757,487,635
資産合計	355,757,487,635
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	201,240
前受金	996,617,413
未払解約金	492,891,379
未払利息	1,210
その他未払費用	6
流動負債合計	1,489,711,248
負債合計	1,489,711,248
純資産の部	
元本等	
元本	141,830,885,037
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	212,436,891,350
元本等合計	354,267,776,387
純資産合計	354,267,776,387
負債純資産合計	355,757,487,635

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p>

	2019年 2月20日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2019年 2月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		141,830,885,037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)	2.4978円 (24,978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 2月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

## 元本の移動

区分	2019年 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	136,969,669,259円
期中追加設定元本額	10,838,774,785円
期中一部解約元本額	5,977,559,007円
期末元本額	141,830,885,037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）	2,427,908,393円
S B I 資産設計オープン（分配型）	10,115,691円
S M T グローバル株式インデックス・オープン	26,451,333,706円
世界経済インデックスファンド	7,611,757,279円
外国株式インデックス・オープン	1,081,045,392円
D C マイセレクション 2 5	1,013,569,200円
D C マイセレクション 5 0	4,914,360,122円
D C マイセレクション 7 5	5,240,271,517円
D C 外国株式インデックス・オープン	8,161,424,793円
D C マイセレクション S 2 5	404,878,538円
D C マイセレクション S 5 0	1,972,055,716円
D C マイセレクション S 7 5	1,513,317,313円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 2 5	124,876,497円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 3 5	197,709,139円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 4 5	126,923,286円
D C 世界経済インデックスファンド	6,212,328,752円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,816,860,525円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	12,628,032円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	12,927,715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）	57,928,918円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	69,121,395円
バランス 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	258,259,011円
バランス 2 5 V A 2（適格機関投資家専用）	40,960,775円
バランス 5 0 V A 2（適格機関投資家専用）	361,633,934円
バランス A（2 5）V A 1（適格機関投資家専用）	817,743,110円
バランス B（3 7 . 5）V A 1（適格機関投資家専用）	410,532,363円
バランス C（5 0）V A 1（適格機関投資家専用）	2,676,854,173円
世界バランス V A 1（適格機関投資家専用）	2,052,506,739円
世界バランス V A 2（適格機関投資家専用）	93,258,267円
バランス D（3 5）V A 1（適格機関投資家専用）	402,316,686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）	28,979,271円

区分	2019年 2月20日現在
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	132,324,137円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,084,566,379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)	2,307,573,729円
外国株式ファンド・シリーズ1	907,598,360円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,772,153,316円
コア投資戦略ファンド(成長型)	6,221,170,699円
分散投資コア戦略ファンドA	2,224,873,993円
分散投資コア戦略ファンドS	4,630,916,971円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	783,529,921円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	943,185,507円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,241,699,542円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	868,626,968円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	43,690,535円
SMT インデックスバランス・オープン	285,696,747円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	1,888,888,570円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	32,000,318,274円
SMT 世界経済インデックス・オープン	55,010,691円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	307,876,884円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	43,705,828円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,031,440円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	37,062,425円
グローバル経済コア	1,196,746,621円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	5,290,673円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	206,450円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	125,240,442円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	40,153,604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)	1,572,818,295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)	1,350,473,011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)	1,182,068,777円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2019年 2月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	12,357,262,361	-	13,353,879,774	996,617,413
合計		12,357,262,361	-	13,353,879,774	996,617,413

(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 2月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	111,254,730	-	111,455,970	201,240
	アメリカドル	82,936,770	-	82,936,770	-
	オーストラリアドル	28,317,960	-	28,519,200	201,240
合計		111,254,730	-	111,455,970	201,240

### (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 2月20日現在	
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	506,970,374
コール・ローン	1,266,784,248
国債証券	246,356,989,333
派生商品評価勘定	8,420,187
未収入金	1,684,477
未収利息	1,740,125,074
前払費用	78,293,657
差入委託証拠金	153,445,731
流動資産合計	250,112,713,081
資産合計	250,112,713,081
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	31,861
前受金	3,922,983
未払金	1,009,177

	2019年 2月20日現在
項目	金額（円）
未払解約金	79,128,993
未払利息	3,113
その他未払費用	46
流動負債合計	84,096,173
負債合計	84,096,173
純資産の部	
元本等	
元本	91,527,437,208
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	158,501,179,700
元本等合計	250,028,616,908
純資産合計	250,028,616,908
負債純資産合計	250,112,713,081

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	(1)派生商品取引等損益



	2019年 2月20日現在
	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)

	2019年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	91,527,437,208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) 2.7317円 (27,317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 2月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2019年 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	93,887,447,277円
期中追加設定元本額	9,554,984,236円
期中一部解約元本額	11,914,994,305円
期末元本額	91,527,437,208円
期末元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	1,882,381,042円
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	762,510,444円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	511,607,997円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	2,028,516,954円
SBI資産設計オープン（分配型）	8,425,386円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,227,997,631円
世界経済インデックスファンド	6,573,202,261円
DCマイセレクション25	1,669,278,780円
DCマイセレクション50	1,245,247,038円
DCマイセレクション75	796,109,873円
DC外国債券インデックス・オープン	1,797,522,828円
DCマイセレクションS25	666,389,199円
DCマイセレクションS50	504,554,316円
DCマイセレクションS75	231,409,987円
DCターゲット・イヤーフンド2025	50,868,517円
DCターゲット・イヤーフンド2035	57,089,315円
DCターゲット・イヤーフンド2045	25,925,448円
DC世界経済インデックスファンド	5,327,356,070円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	623,092,857円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	45,353,373円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	3,200,210円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	1,938,498円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	60,788,119円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	137,997,966円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	215,247,689円

区分	2019年 2月20日現在
バランス 2 5 V A 2 (適格機関投資家専用)	171,518,521円
バランス 5 0 V A 2 (適格機関投資家専用)	504,687,585円
バランス A ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	2,326,752,408円
バランス B ( 3 7 . 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	635,331,008円
バランス C ( 5 0 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	2,252,358,468円
世界バランス V A 1 (適格機関投資家専用)	868,713,096円
世界バランス V A 2 (適格機関投資家専用)	94,185,434円
バランス D ( 3 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	662,694,318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)	117,818,633円
バランス E ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	253,546,598円
バランス F ( 2 5 ) V A 1 (適格機関投資家専用)	325,641,256円
F O F s 用 外国債券オープン (適格機関投資家専用)	1,052,023,205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)	958,573,490円
グローバル・バランスファンド・シリーズ 1	886,613,594円
外国債券ファンド・シリーズ 1	453,724,883円
コア投資戦略ファンド (安定型)	1,122,708,371円
コア投資戦略ファンド (成長型)	3,562,953,450円
分散投資コア戦略ファンド A	924,495,206円
分散投資コア戦略ファンド S	2,723,907,847円
D C 世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	220,919,281円
D C 世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	2,393,945,777円
コア投資戦略ファンド (切替型)	488,549,502円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	244,869,785円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	111,307,090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)	1,038,200,616円
S M T インデックスバランス・オープン	242,637,532円
外国債券 S M T B セレクション ( S M A 専用)	22,364,947,466円
S M T 世界経済インデックス・オープン	46,358,478円
S M T 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	86,986,694円
S M T 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	111,854,725円
S M T 8 資産インデックスバランス・オープン	875,427円
グローバル経済コア	1,037,600,701円
S B I 資産設計オープン (つみたて N I S A 対応型)	4,469,674円
D C ターゲット・イヤー ファンド 2 0 5 5	33,049円
コア投資戦略ファンド (切替型ワイド)	49,142,188円
コア投資戦略ファンド (積極成長型)	9,121,908円
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)	816,248,070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)	10,551,706,403円
外国債券インデックス・ファンド (適格機関投資家専用)	355,218,391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)	185,282円

(デリバティブ取引に関する注記)

## 債券関連

(2019年 2月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	979,570,106	-	983,493,089	3,922,983
	合計	979,570,106	-	983,493,089	3,922,983

## (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 2月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,236,728,057	-	1,241,193,400	4,465,343
	アメリカドル	644,260,775	-	645,612,000	1,351,225
	カナダドル	54,238,058	-	54,431,000	192,942
	ユーロ	448,473,298	-	450,077,600	1,604,302
	イギリスポンド	89,755,926	-	91,072,800	1,316,874
	合計	1,236,728,057	-	1,241,193,400	4,465,343

## (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

	2019年 2月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	

	2019年 2月20日現在
項目	金額（円）
預金	447,682,410
コール・ローン	49,247,105
株式	52,488,657,180
投資信託受益証券	105,660,189
投資証券	190,344,011
派生商品評価勘定	19,908,974
未収入金	188,499
未収配当金	98,776,522
差入委託証拠金	163,635,019
流動資産合計	53,564,099,909
資産合計	53,564,099,909
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	659,517
前受金	19,249,457
未払金	4,980
未払解約金	39,372,742
未払利息	121
流動負債合計	59,286,817
負債合計	59,286,817
純資産の部	
元本等	
元本	19,240,104,066
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	34,264,709,026
元本等合計	53,504,813,092
純資産合計	53,504,813,092
負債純資産合計	53,564,099,909

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</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)

		2019年 2月20日現在
1.	計算期間の末日における受益権の総数	19,240,104,066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 2.7809円 (1万口当たり純資産額) (27,809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 2月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。
-------------

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2019年 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	17,830,347,012円
期中追加設定元本額	1,821,088,067円
期中一部解約元本額	411,331,013円
期末元本額	19,240,104,066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	7,182,800,613円
世界経済インデックスファンド	3,269,483,228円

D C新興国株式インデックス・オープン	3,897,868,756円
D C世界経済インデックスファンド	2,665,056,575円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	178,272,325円
D C世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	341,828,090円
D C世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	402,303,491円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	379,080,019円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	18,831,738円
S M T インデックスバランス・オープン	123,274,963円
S M T 世界経済インデックス・オープン	33,439,234円
S M T 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	190,911,389円
S M T 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	26,176,116円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	898,173円
グローバル経済コア	518,069,207円
i - S M T 新興国株式インデックス(ノーロード)	11,810,149円

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 株式関連

(2019年 2月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	658,635,234	-	677,884,691	19,249,457
合計		658,635,234	-	677,884,691	19,249,457

## (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 2月20日現在)



区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	22,146,000	-	22,146,000	-
	アメリカドル	22,146,000	-	22,146,000	-
合計		22,146,000	-	22,146,000	-

## (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

	2019年 2月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	390,246,493
コール・ローン	284,290,328
国債証券	46,390,041,099
未収利息	761,986,248
前払費用	53,578,237
流動資産合計	47,880,142,405
資産合計	47,880,142,405
負債の部	
流動負債	
未払解約金	28,246,412
未払利息	698
その他未払費用	8
流動負債合計	28,247,118
負債合計	28,247,118
純資産の部	
元本等	
元本	28,417,370,788
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	19,434,524,499
元本等合計	47,851,895,287
純資産合計	47,851,895,287
負債純資産合計	47,880,142,405

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2019年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	28,417,370,788口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.6839円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (16,839円)</p>

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2019年 2月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>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。</p>
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>

	2019年 2月20日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	27,405,750,667円
期中追加設定元本額	2,724,975,642円
期中一部解約元本額	1,713,355,521円
期末元本額	28,417,370,788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	4,187,150,447円
世界経済インデックスファンド	5,466,757,730円
DC新興国債券インデックス・オープン	3,942,259,968円
DC世界経済インデックスファンド	4,445,984,211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)	1,870,735,487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)	492,238,225円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	98,348,024円
分散投資コア戦略ファンドA	133,261,397円
分散投資コア戦略ファンドS	421,046,377円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	185,497,205円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,012,272,760円

区分	2019年 2月20日現在
コア投資戦略ファンド(切替型)	79,323,611円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	208,574,957円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	92,543,196円
SMT インデックスバランス・オープン	209,057,785円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	3,163,389,778円
SMT 世界経済インデックス・オープン	56,395,259円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	104,344,901円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	132,416,973円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,488,073円
グローバル経済コア	851,249,710円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	6,958,180円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	1,320,316円
F O F s 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)	115,908,868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。

## J-REITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

	2019年 2月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,802,729,294
投資証券	104,120,259,035
派生商品評価勘定	71,041,800
未収入金	106,972,583
未収配当金	867,931,809
差入委託証拠金	47,503,000
流動資産合計	107,016,437,521
資産合計	107,016,437,521
負債の部	
流動負債	
前受金	71,041,800
未払金	117,242,510
未払解約金	52,346,305
未払利息	4,431
その他未払費用	30
流動負債合計	240,635,076
負債合計	240,635,076
純資産の部	
元本等	
元本	60,425,751,784
剰余金	

	2019年 2月20日現在
項目	金額（円）
剰余金又は欠損金（ ）	46,350,050,661
元本等合計	106,775,802,445
純資産合計	106,775,802,445
負債純資産合計	107,016,437,521

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>不動産投信指数先物取引</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>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>(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）

	2019年 2月20日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	60,425,751,784口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.7671円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (17,671円)</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2019年 2月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	63,469,051,269円
期中追加設定元本額	5,033,559,396円
期中一部解約元本額	8,076,858,881円
期末元本額	60,425,751,784円
期末元本額の内訳	

区分	2019年 2月20日現在
S B I 資産設計オープン(資産成長型)	1,649,064,995円
S B I 資産設計オープン(分配型)	6,849,045円
S M T J - R E I T インデックス・オープン	10,889,062,635円
Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	29,622,103,830円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,657,933,743円
コア投資戦略ファンド(成長型)	4,450,428,979円
分散投資コア戦略ファンドA	2,113,380,584円
分散投資コア戦略ファンドS	3,375,438,667円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,142,254,720円
S M T インデックスバランス・オープン	33,230,527円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	676,436,513円
S M T 8資産インデックスバランス・オープン	1,389,326円
グローバル経済コア	356,640,472円
S B I 資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	3,571,197円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	115,624,319円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	21,609,640円
F O F s 用 J - R E I T インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,208,909,482円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018-05(適格機関投資家専用)	1,101,840,926円
J - R E I T パッシブ・ファンド 2018-11(適格機関投資家専用)	999,982,184円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 投資証券関連

(2019年 2月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物 取引 買建	2,530,988,200	-	2,602,030,000	71,041,800
合計		2,530,988,200	-	2,602,030,000	71,041,800

(注)1.時価の算定方法

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

2.不動産投信指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

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。

#### グローバルREITインデックス マザーファンド

#### 貸借対照表

	2019年 2月20日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	112,438,328
コール・ローン	71,184,439
投資証券	77,132,385,990
未収入金	149,315,297
未収配当金	189,031,024
流動資産合計	77,654,355,078
資産合計	77,654,355,078
負債の部	
流動負債	
未払解約金	70,081,196
未払利息	174
流動負債合計	70,081,370
負債合計	70,081,370
純資産の部	
元本等	
元本	41,633,729,396
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	35,950,544,312
元本等合計	77,584,273,708
純資産合計	77,584,273,708
負債純資産合計	77,654,355,078

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2019年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金



	<p>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>(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 2月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		41,633,729,396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)	1.8635円 (18,635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 2月20日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2019年 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	37,293,344,466円
期中追加設定元本額	6,037,871,486円
期中一部解約元本額	1,697,486,556円
期末元本額	41,633,729,396円
期末元本額の内訳	
ワールド・ファイブインカム・ファンド（毎月決算型）	159,090,874円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,668,142,623円
SBI資産設計オープン（分配型）	6,946,131円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	8,725,634,140円
グローバルリートインデックス・オープン（SMA専用）	21,068,363,636円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,223,908,161円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,670,638,018円
分散投資コア戦略ファンドA	891,606,242円
分散投資コア戦略ファンドS	1,977,764,002円
コア投資戦略ファンド（切替型）	536,489,546円
SMT インデックスバランス・オープン	193,803,678円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	585,025,951円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,376,019円
グローバル経済コア	350,548,695円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	3,615,164円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	55,615,053円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	17,008,638円
グローバルリートインデックス・オープン（適格機関投資家専用）	836,714,931円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	661,437,894円

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（2019年 2月20日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	49,717,770	-	49,717,770	-

	アメリカドル	49,717,770	-	49,717,770	-
	合計	49,717,770	-	49,717,770	-

## (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。

## ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

## 貸借対照表

	2019年 2月20日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	12,326,782
コール・ローン	17,587,169
投資信託受益証券	19,095,729,855
流動資産合計	19,125,643,806
資産合計	19,125,643,806
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	329,201,851
未払金	1,338,801
未払解約金	3,023,106
未払利息	43
流動負債合計	333,563,801
負債合計	333,563,801
純資産の部	
元本等	
元本	18,908,979,650
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	116,899,645
元本等合計	18,792,080,005
純資産合計	18,792,080,005
負債純資産合計	19,125,643,806

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2019年 2月20日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券

2019年 2月20日現在	
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
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)

2019年 2月20日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	18,908,979,650口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 116,899,645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 0.9938円 (1万口当たり純資産額) (9,938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 2月20日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

	2019年 2月20日現在
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 2月20日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2018年 8月21日
期首元本額	18,603,798,505円
期中追加設定元本額	1,793,064,342円
期中一部解約元本額	1,487,883,197円
期末元本額	18,908,979,650円
期末元本額の内訳	
コア投資戦略ファンド(安定型)	3,343,215,788円
コア投資戦略ファンド(成長型)	4,785,164,557円
分散投資コア戦略ファンドA	2,571,850,567円
分散投資コア戦略ファンドS	3,426,161,029円

区分	2019年 2月20日現在
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,461,887,201円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	1,137,684,749円
グローバル経済コア	1,935,654,073円
SMT ゴールドインデックス・オープン(為替ヘッジあり)	88,043,540円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	137,365,441円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	21,952,705円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 通貨関連

(2019年 2月20日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	18,445,408,287	-	18,774,610,138	329,201,851
	アメリカドル	18,445,408,287	-	18,774,610,138	329,201,851
	合計	18,445,408,287	-	18,774,610,138	329,201,851

(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 3月29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3月29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	523	11,941,892
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	87	393,318
単体型公社債投資信託	0	0
合計	610	12,335,210

## (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

2019年 5月20日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 5【委託会社等の経理状況】

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

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。

なお、財務諸表及び中間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、第32期事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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33期事業年度の中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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 (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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	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
<b>評価・換算差額等</b>		
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 (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)
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 (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)
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		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	1,134	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
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
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 その他有価証券	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 その他有価証券	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 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(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

## 中間貸借対照表

(単位：千円)

第33期中間会計期間末

(2018年9月30日)

## 資産の部

## 流動資産

現金及び預金		23,034,588
預け金		1,999,987
未収委託者報酬		6,297,689
その他流動資産		160,541
流動資産合計		31,492,806

## 固定資産

## 有形固定資産

建物	1	35,878
器具備品	1	94,797
その他有形固定資産	1	1,967
有形固定資産合計		132,642

## 無形固定資産

476,662

## 投資その他の資産

投資有価証券		37,334
会員権		25,000
繰延税金資産		244,590
その他		4,358
投資その他の資産合計		311,284

## 固定資産合計

920,589

## 資産合計

32,413,396

## 負債の部

流動負債		
未払金		3,522,021
未払費用		119,978
未払法人税等		768,587
賞与引当金		119,869
その他流動負債	2	107,652
流動負債合計		4,638,109
固定負債		
退職給付引当金		530,260
資産除去債務		13,489
その他固定負債		578
固定負債合計		544,327
負債合計		5,182,436

(単位：千円)

第33期中間会計期間末

(2018年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		350,000
資本剰余金合計		350,000
利益剰余金		
利益準備金		75,000
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100,000
繰越利益剰余金		24,405,169
利益剰余金合計		26,580,169
株主資本合計		27,230,169
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		789
評価・換算差額等合計		789
純資産合計		27,230,959
負債・純資産合計		32,413,396

## 中間損益計算書

(単位：千円)

第33期中間会計期間

(自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		14,970,762
営業収益合計		14,970,762
営業費用		10,448,993
一般管理費	1	2,088,498

営業利益		2,433,271
営業外収益	2	23,558
営業外費用		8,748
経常利益		2,448,081
特別損失		49,894
税引前中間純利益		2,398,187
法人税、住民税及び事業税		726,276
法人税等調整額		3,774
法人税等合計		730,051
中間純利益		1,668,135

## 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30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	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	74,500	2,100,000	22,767,534	24,942,034	25,592,034
当中間期変動額					
剰余金の配当	500		30,500	30,000	30,000
中間純利益			1,668,135	1,668,135	1,668,135
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	500	-	1,637,635	1,638,135	1,638,135
当中間期末残高	75,000	2,100,000	24,405,169	26,580,169	27,230,169

	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	182	182	25,592,216
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			1,668,135
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	607	607	607

当中間期変動額合計	607	607	1,638,742
当中間期末残高	789	789	27,230,959

## 重要な会計方針

第33期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
1. 資産の評価基準及び評価方法	
有価証券	
其他有価証券	
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. 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。
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。
4. 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	
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)

第33期中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	



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、当中間会計期間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、この変更による当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間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)

第33期中間会計期間

(自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

「『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)を当中間会計期間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。

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

第33期中間会計期間末

(2018年9月30日)

1 有形固定資産の減価償却累計額

建物 66,454千円

器具備品 342,351千円

その他有形固定資産 3,136千円

計 411,942千円

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「その他流動負債」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第33期中間会計期間

(自 2018年4月1日

至 2018年9月30日)

1 減価償却実施額

有形固定資産 19,715千円

無形固定資産 44,989千円

2 営業外収益の主要項目

受取利息 819千円

貸倒引当金戻入

17,088千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第33期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018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(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

(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)

第33期中間会計期間末(2018年9月30日)

2018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:千円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	23,034,588	23,034,588	-
(2)預け金	1,999,987	1,999,987	-
(3)未収委託者報酬	6,297,689	6,297,689	-
(4)投資有価証券 その他有価証券	37,331	37,331	-
(5)未払金	(3,522,021)	(3,522,021)	-
(6)未払法人税等	(768,587)	(768,587)	-

(\*)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及び有価証券に関する事項

## (1)現金及び預金、(2)預け金、並びに(3)未収委託者報酬

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

## (4)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、並びに(6)未払法人税等

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

(注2) 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ため、「(4)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第33期中間会計期間末(2018年9月30日)

その他有価証券

(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	21,579	19,493	2,085
小計	21,579	19,493	2,085
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	15,752	16,700	947
小計	15,752	16,700	947
合計	37,331	36,193	1,137

(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。

(デリバティブ取引関係)

第33期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

該当事項はありません。

(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)

第33期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018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33期中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018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

外部顧客への売上高のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018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33期中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第33期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）	
1株当たり純資産額	9,076,986円44銭
1株当たり中間純利益	556,045円23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33期中間会計期間 （自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）
中間純利益	1,668,135千円
普通株式に係る中間純利益	1,668,135千円
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）

（共通支配下の取引等）

1. 取引の概要

(1) 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

(2) 企業結合日

2018年10月1日

(3) 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

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（当社）

(5) 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. 実施する会計処理の概要

「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する予定であります。

### (その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加)

当社は、2018年9月28日開催の臨時株主総会において、その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加について決議しており、2018年10月1日付で実行しております。

#### 1. その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加の目的

資本規模の充実を図るため、会社法第450条第1項の規定に基づき、その他資本剰余金の額の減少を行い、その全額を資本金に組み入れることにしました。

#### 2. その他資本剰余金の額の減少及び資本金の額の増加の要領

##### (1) 減少すべきその他資本剰余金の額

その他資本剰余金18,939,438千円のうち1,700,000千円を減少します。

##### (2) その他資本剰余金の額の減少方法

減少すべきその他資本剰余金の額の全額を資本金に組み入れます。

資本金の額は2,000,000千円になります。

## 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12月3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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期事業年度の中間会計期間（2018年4月1日から2018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2018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（2018年4月1日から2018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

2019年4月19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」に掲げられているグローバル経済コアの2018年8月21日から2019年2月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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、グローバル経済コアの2019年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年8月21日から2019年2月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## その他の事項

ファンドの2018年8月20日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表について中間監査は実施されていない。

## 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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。