

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年11月15日提出
【発行者名】	三井住友D S 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 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）

（愛称として「マイパッケージZERO」という名称を用いることがあります。）

以下「当ファンド」といいます。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

* ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友D Sアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

当初元本は1口当たり1円です。委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

2兆5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「DCマゼロ」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

（５）【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2021年11月16日から2022年5月12日まで

申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

販売会社の詳細につきましては、前記「(4) 発行(売出) 価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額(取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数)を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

販売会社において払込みを取り扱います。(販売会社は前記「(4) 発行(売出) 価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。)

(11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

ハ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用

ありません。

ニ 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則に従って取り扱われるものとし、ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および当該振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

(参考：投資信託振替制度)

- ・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われます。
- ・受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます(原則として受益証券を保有することはできません。)
- ・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。
- ・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、「国内債券パッシブ・マザーファンド」および「外国債券パッシブ・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券の組入れを通じて、日本を含む世界各国の公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。
- ロ 当ファンドの運用にあたっては、債券、短期金融資産を基本資産配分の比率により独自に作成した合成指数をベンチマークとして、中長期的にベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。
- ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

(イ) 当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書または信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	債券	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

(ロ) 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（債券、短期金融資産））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「債券」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数 (合成指数)	目論見書または信託約款において、委託会社が定める合成指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
		不動産投信	
		その他資産 ()	特殊型
	内外	資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル (日本を含む)			
一般	年2回	日本			日経225
大型株	年4回	北米			
中小型株	年6回(隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり	
債券	年12回(毎月)	アジア			
一般	日々	オセアニア			TOPIX
公債	その他	中南米			
社債	()	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他債券					
クレジット属性 ()					
不動産投信					
その他資産 (投資信託証券 (債券、短期 金融資産))		中近東(中東)			その他 (合成指数)
資産複合 ()		エマージング			
資産配分固定型					
資産配分変更型					

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

2014年12月15日 信託契約締結、設定、運用開始。

（３）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

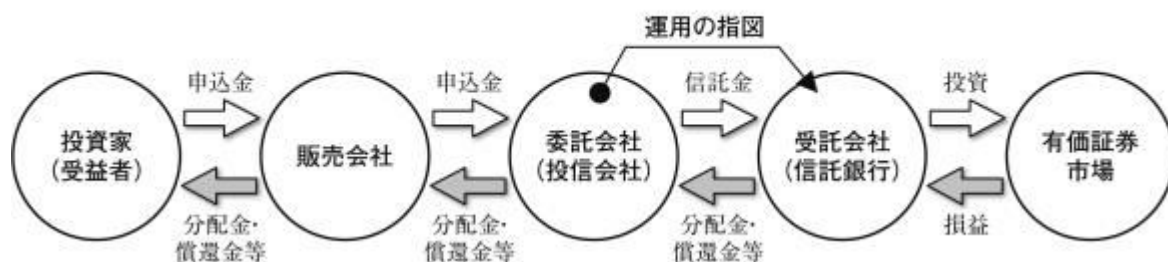
（ロ）受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

（ハ）販売会社

委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

（イ）資本金の額

20億円（2021年8月31日現在）

（ロ）会社の沿革

1985年7月15日	三生投資顧問株式会社設立
1987年2月20日	証券投資顧問業の登録
1987年6月10日	投資一任契約にかかる業務の認可
1999年1月1日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
1999年2月5日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
2000年1月27日	証券投資信託委託業の認可取得

- 2002年12月1日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2013年4月1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併
- 2019年4月1日 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

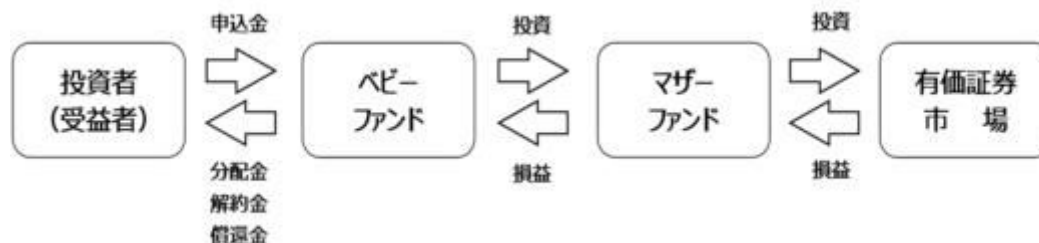
(八) 大株主の状況

(2021年8月31日現在)

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	16,977,897	50.1
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	7,946,406	23.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	5,080,509	15.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528,000	10.4
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	337,248	1.0

八 ファンドの運用形態（ファミリーファンド方式による運用）

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。



2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

イ 基本方針

内外の公社債に投資する2つのマザーファンドの組入れを通じて、日本を含む世界各国の公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

国内債券	国内債券パッシブ・マザーファンド
外国債券	外国債券パッシブ・マザーファンド

ロ 投資態度

(イ) マザーファンド受益証券への投資を通じて行う各資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとします。

ただし、それぞれの資産の時価変動等に伴う各資産比率の変化については、一定の範囲(±3%)を設けて調整を行います。

債券	95%
----	-----

国内債券	75%
外国債券	20%
短期金融資産	5%

(ロ) 当ファンドの運用は、以下の比率により委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、中長期的にベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

NOMURA - B P I (総合)	75%
FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	20%
有担保コール翌日物	5%

(ハ) 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないことを基本とします。

(ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

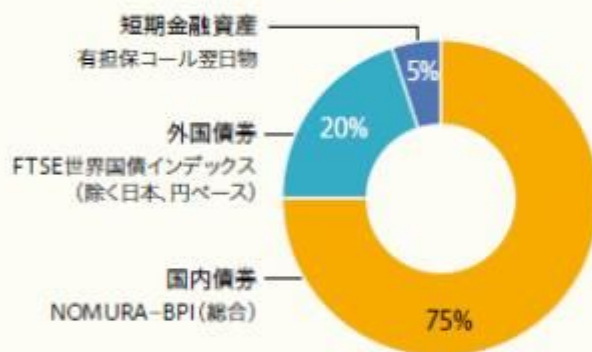
ファンドの特色

1 内外の公社債に投資する2つのマザーファンドの組入れを通じて、日本を含む世界各国の公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

2 国内債券、外国債券および短期金融資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとします。

- それぞれの資産の時価変動等に伴う各資産比率の変化については、一定の範囲(±3%)を設けて調整を行います。

[基本資産配分イメージ]



NOMURA-BPI(総合)、FTSE世界国債インデックスは、それぞれ野村證券株式会社、FTSE Fixed Income LLCが公表している指数で各社の知的財産です。

※指数を公表する各社は当ファンドの運用と何ら関係ありません。

*「有担保コール翌日物」、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」、「NOMURA-BPI(総合)」は、各資産の代表的な指数等であり、当ファンドの合成指数を構成するものです。

※上図はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

3 運用にあたっては、委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、中長期的にベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

- ベンチマークの資産別合成比率は、**NOMURA-BPI(総合) 75%**、**FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) 20%**、**有担保コール翌日物 5%**となります。

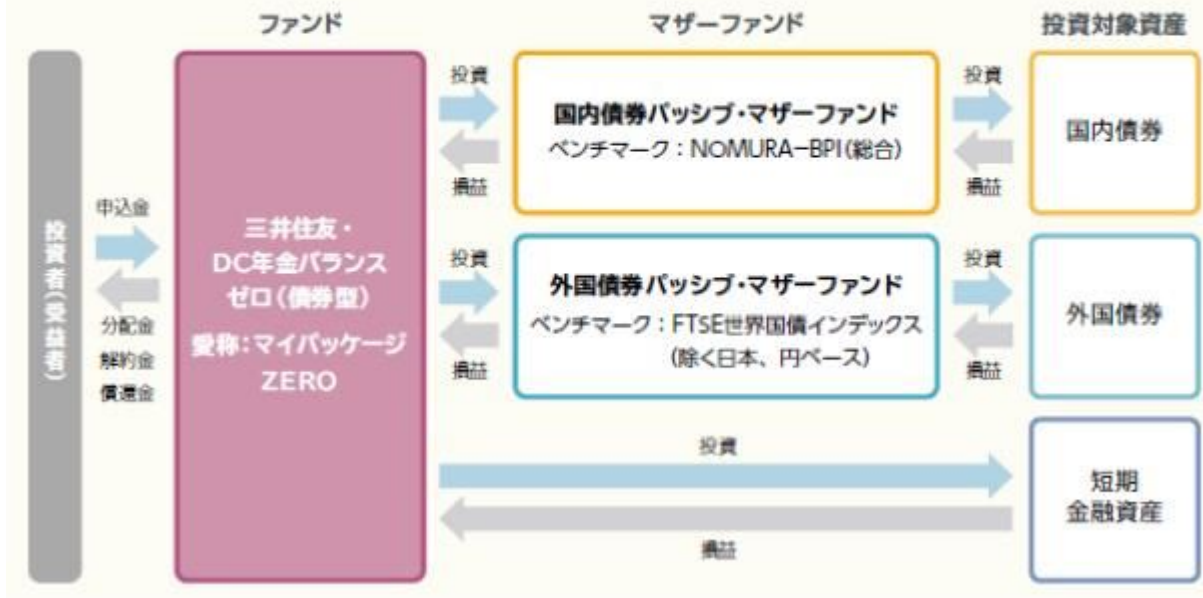
4 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないことを基本とします。

※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドのしくみ

■ファミリーファンド方式で運用を行います。

■各マザーファンドは、それぞれのベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。



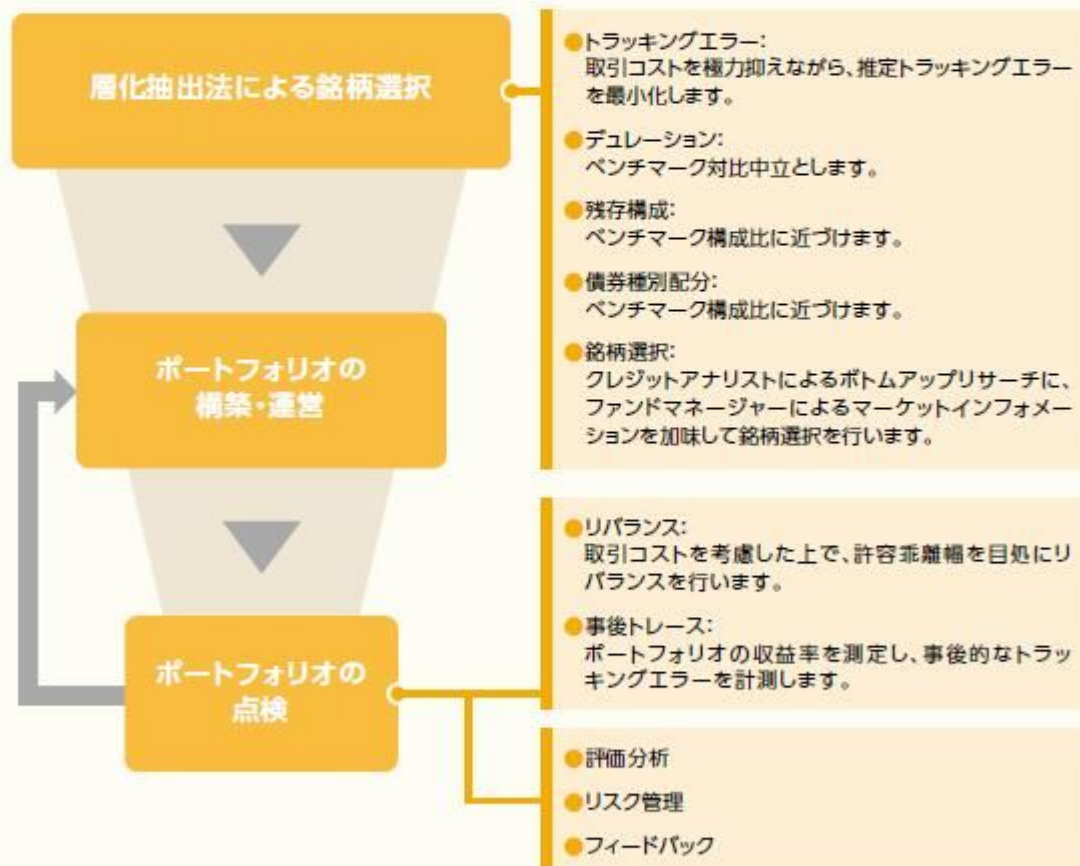
各マザーファンドの投資方針等

▶国内債券パッシブ・マザーファンド

[投資方針]

- 日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、層化抽出法により、ファンド規模に応じデュレーション、満期構成、セクター(債券種別)配分、事業債の格付け構成および業種を可能な限りNOMURA-BPI(総合)に近づけたポートフォリオを構築します。なお、事業債の銘柄選択については、委託会社クレジットアナリストの調査結果に基づき、将来的に格下げによりNOMURA-BPI(総合)から外れる可能性が高い銘柄については、組入対象から除外することがあります。

[運用プロセス]



層化抽出法とは

指数を構成する銘柄をいくつかのグループ(層)に分け、それぞれのグループから代表銘柄を抽出してファンドを構築する方法です。指数を構成するすべての銘柄を保有する完全法に比べて、少ない銘柄数でポートフォリオを構築することができるため、銘柄入替に伴う取引コストの抑制や、低流動性銘柄の組入れを避けることができるというメリットがあり、債券パッシブ運用に適しています。

トラッキングエラーとは

ポートフォリオとベンチマークのリターンの乖離のことをいいます。

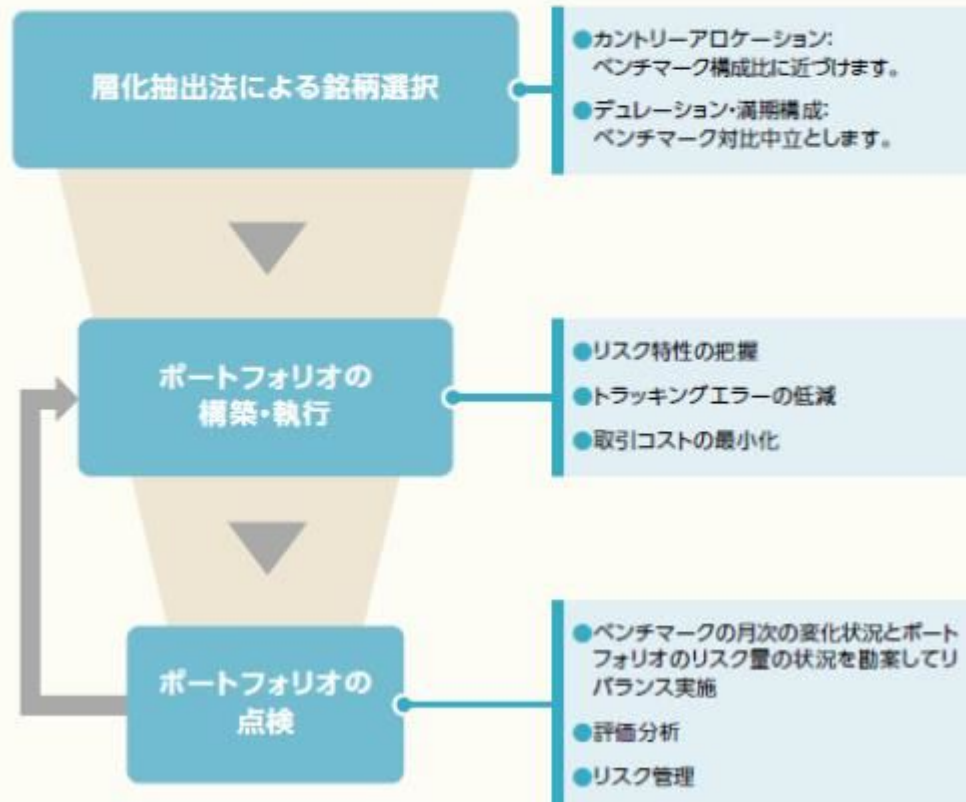
※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。

▶ 外国債券パッシブ・マザーファンド

〔投資方針〕

- 主として日本を除く世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、層化抽出法により、通貨配分、国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限りFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に近づけたポートフォリオを構築します。

〔運用プロセス〕



※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。

(2) 【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

(イ) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

1. 有価証券
2. デリバティブ取引にかかる権利
3. 金銭債権
4. 約束手形

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、マザーファンドの受益証券または次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
20. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券(ただし、投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

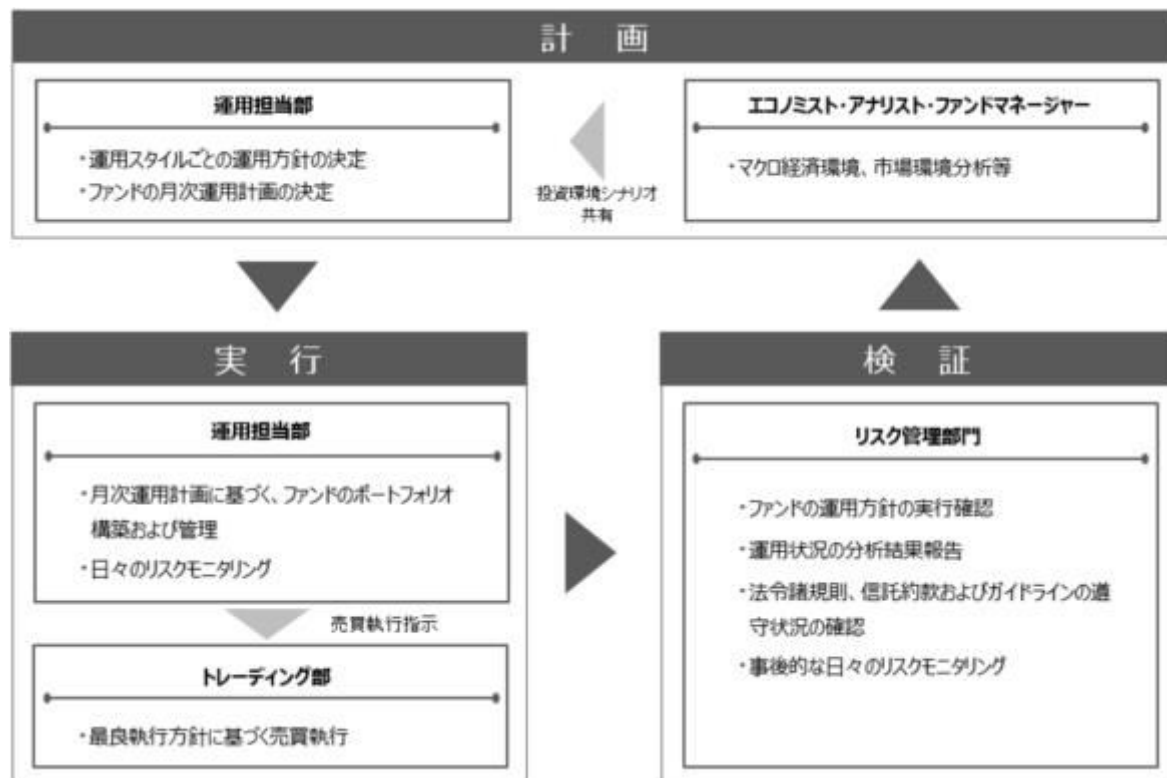
八 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記の有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

（３）【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

（４）【分配方針】

年1回（原則として毎年2月18日、ただし休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子、配当収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。
- ロ 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には委託会社の判断により収益分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、前記「（１）投資方針」と同一の運用を行います。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。

（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率(「組入比率」といいます。)と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます(以下同じ。)
- ロ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ 投資する株式等の範囲

- (イ) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- (ロ) 上記(イ)にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ハ 信用取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ニ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

ニ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)

- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、日本の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ホ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ヘ 金利先渡取引および為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産

の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- (ホ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (チ) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

ト 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
 - 1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

チ 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

リ 有価証券の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
 - (ロ) 上記(イ)の借入れの指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
 - (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- (二) 借入れにかかる品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

ヌ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

ル 外国為替予約取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
 - (ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
 - (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (二) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ヲ 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
 - (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
 1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
 3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
 - (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (二) 借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

イ 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をする

ことができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

ロ デリバティブ取引にかかる投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

ハ 信用リスク集中回避のための投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2)

委託会社は、運用財産に関し、信用リスク(保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。)を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

(参考情報: マザーファンドの投資方針等)

(国内債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA - B P I (総合)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) NOMURA - B P I (総合)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

(ロ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

(ハ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号(第1号から第20号まで)に掲げるものに投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、信託財産の純資

産総額の10%以内とします。

- (ロ) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ハ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ニ) 外貨建資産への投資は行いません。
- (ホ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ヘ) デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(外国債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- (ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。
- (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- (ニ) 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号（第1号から第20号まで）に掲げるものに投資します（ただし、投資法人債券を除きます。）。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ロ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ハ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

- (二) 同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ホ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ヘ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ト) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (チ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資者の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

運用の結果として信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。また、一定の投資成果を保証するものではありません。

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

(イ) 債券市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により債券相場が下落(金利が上昇)した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、ファンドが保有する個々の債券については、下記「信用リスク」を負うことにもなります。

(ロ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

(ハ) 為替変動リスク

外貨建資産への投資は、円建資産に投資する場合の通常のリスクのほかに、為替変動による影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落(円高)する場合、円ベースでの評価額は下落することがあります。為替の変動(円高)は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ニ) カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

(ホ) 市場流動性リスク

ファンドの資金流入に伴い、有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあ

ります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ヘ) 合成指数の動きと連動しない要因

ファンドは、委託会社が独自に作成した合成指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。以下の要因等により、合成指数の動きに連動しないことがあります。

- ・有価証券売買時のコスト、信託報酬やその他のファンド運営にかかる費用を負担すること
- ・追加設定・一部解約により組入有価証券の売買のタイミング差が生じること
- ・インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差が影響すること

(ト) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

(チ) 換金制限等に関する留意点

投資資産の市場流動性が低下することにより投資資産の取引等が困難となった場合は、ファンドの換金申込みの受け付けを中止すること、および既に受け付けた換金申込みを取り消すことがあります。

(リ) 収益分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

□ 投資リスクの管理体制

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、リスク管理部において信託約款等に定める各種投資制限・リスク指標のモニタリング等、コンプライアンス部において法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行っています。当該モニタリングおよび確認結果等は、運用評価会議、リスク管理会議およびコンプライアンス会議に報告されます。

（参考情報）投資リスクの定量的比較

〔 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 〕

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

〔 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 〕

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	TOPIX(配当込み) 株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場している株式を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。
※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額に年0.242%（税抜き0.22%）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

< 信託報酬の配分（税抜き） >

支払先	料率	役務の内容
委託会社	年0.09%	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	年0.1%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年0.03%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

(4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0055%（税抜き0.005%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、各計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

上記(1)～(4)にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的な金額を認識するものがあつたりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

(5) 【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

- (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあつた

ります。

- (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には、各販売会社毎に個別元本の算出が行われま
す。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受
取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本
の算出が行われることがあります。
- (ハ) 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から
当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。
（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参
照。）

ロ 一部解約時および償還時の課税について

個人の受益者については、一部解約時および償還時の譲渡益が課税対象となり、法人の受益者につ
いては、一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

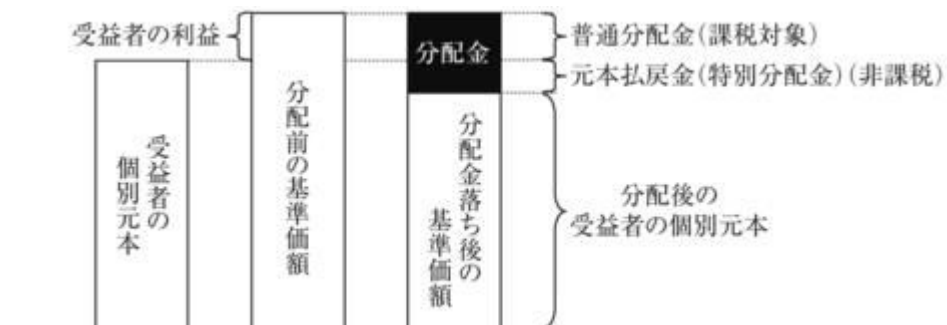
ハ 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる
「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分がありま
す。

収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元
本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。



収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部
分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配
金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け
取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した
額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



上記の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を
示唆するものではありません。

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および

地方税5%)の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

・一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（上場株式、公募株式投資信託、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募公社債投資信託および特定公社債をいいます。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り）および利子所得の金額との損益通算が可能です。

（ロ）法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAでの取扱い対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

※NISA、ジュニアNISAをご利用になる場合、各制度の違いにご留意ください。
また、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

	少額投資非課税制度 NISA	未成年者少額投資非課税制度 ジュニアNISA
対象となる投資信託	公募株式投資信託(新たに購入が必要)	
非課税対象	公募株式投資信託から生じる配当所得および譲渡所得	
利用対象となる方	20歳以上の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)	0~19歳の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)
非課税の期間	最長5年間(投資期間は2023年まで)	
利用できる限度額	120万円/年 (最大600万円)	80万円/年 (最大400万円)

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2021年8月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）

2021年 8月31日現在

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	230,046,703	94.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,349,004	5.09
合計(純資産総額)		242,395,707	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。以下同じ。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）

イ 主要投資銘柄

2021年 8月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	141,333,076	1.2741	180,073,070	1.2847	181,570,602	74.91
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	24,522,512	1.9144	46,946,411	1.9768	48,476,101	20.00

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

2021年 8月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	94.91
合計	94.91

【投資不動産物件】

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）

該当事項はありません。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）

年月日	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 (2016年 2月18日)	8,827,175	8,827,175	10,118	10,118
第2期 (2017年 2月20日)	71,065,592	71,065,592	10,036	10,036
第3期 (2018年 2月19日)	98,926,917	98,926,917	10,150	10,150
第4期 (2019年 2月18日)	144,681,371	144,681,371	10,285	10,285
第5期 (2020年 2月18日)	207,878,797	207,878,797	10,484	10,484
第6期 (2021年 2月18日)	229,857,007	229,857,007	10,400	10,400
2020年 8月末日	224,062,492		10,423	
9月末日	224,457,742		10,453	
10月末日	225,585,483		10,407	
11月末日	236,871,737		10,437	
12月末日	248,220,130		10,452	
2021年 1月末日	250,538,746		10,428	
2月末日	228,575,650		10,342	
3月末日	237,116,298		10,441	
4月末日	234,641,589		10,452	
5月末日	235,598,250		10,481	
6月末日	233,717,897		10,480	

7月末日	240,627,748		10,531	
8月末日	242,395,707		10,523	

【分配の推移】

三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2014年12月15日～2016年2月18日	0
第2期	2016年2月19日～2017年2月20日	0
第3期	2017年2月21日～2018年2月19日	0
第4期	2018年2月20日～2019年2月18日	0
第5期	2019年2月19日～2020年2月18日	0
第6期	2020年2月19日～2021年2月18日	0

【収益率の推移】

三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)

	収益率(%)
第1期	1.2
第2期	0.8
第3期	1.1
第4期	1.3
第5期	1.9
第6期	0.8
第7期(中間期)	1.1

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

(4) 【設定及び解約の実績】

三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	10,149,579	1,424,968
第2期	73,536,464	11,450,065
第3期	42,262,197	15,608,091
第4期	62,741,787	19,541,180
第5期	83,181,723	25,565,313
第6期	129,604,307	106,865,853
第7期(中間期)	29,838,942	22,726,831

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

(1) 投資状況

国内債券パッシブ・マザーファンド

2021年 8月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	111,780,135,270	81.38
地方債証券	日本	8,539,635,250	6.22
特殊債券	日本	11,491,048,119	8.37
社債券	日本	4,453,965,000	3.24
	フランス	201,164,000	0.15
	小計	4,655,129,000	3.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		895,911,812	0.64
合計(純資産総額)		137,361,859,451	100.00

外国債券パッシブ・マザーファンド

2021年 8月31日現在

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	71,876,780,041	44.73
	フランス	16,234,496,364	10.10

	イタリア	15,320,037,594	9.53
	ドイツ	11,769,817,461	7.33
	イギリス	10,135,762,395	6.31
	スペイン	9,597,132,559	5.97
	ベルギー	3,820,439,406	2.38
	カナダ	3,192,668,961	1.99
	オランダ	3,032,510,014	1.89
	オーストラリア	3,027,461,608	1.88
	オーストリア	2,368,030,331	1.47
	アイルランド	1,346,440,542	0.84
	メキシコ	1,149,978,591	0.72
	フィンランド	1,005,066,244	0.63
	ポーランド	925,439,203	0.58
	デンマーク	815,804,901	0.51
	マレーシア	775,612,234	0.48
	イスラエル	744,507,931	0.46
	シンガポール	709,644,096	0.44
	スウェーデン	471,961,122	0.29
	ノルウェー	397,327,234	0.25
	小計	158,716,918,832	98.78
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	1,961,476,654	1.22
	合計(純資産総額)	160,678,395,486	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年 8月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第427回利付国債(2年)	3,300,000,000	100.27	3,309,170,500	100.26	3,308,844,000	0.005	2023/8/1	2.41

日本	国債証券	第425回利付国債(2年)	2,220,000,000	100.23	2,225,196,300	100.24	2,225,439,000	0.005	2023/6/1	1.62
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	1,740,000,000	100.82	1,754,285,600	100.78	1,753,606,800	0.100	2031/6/20	1.28
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	1,700,000,000	100.50	1,708,623,500	100.59	1,710,098,000	0.005	2026/3/20	1.24
日本	国債証券	第146回利付国債(5年)	1,690,000,000	100.96	1,706,224,000	100.99	1,706,798,600	0.100	2025/12/20	1.24
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	1,560,000,000	100.51	1,567,956,000	101.17	1,578,392,400	0.100	2030/9/20	1.15
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	1,310,000,000	100.95	1,322,510,500	100.93	1,322,261,600	0.100	2025/9/20	0.96
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	102.17	1,312,961,600	101.91	1,309,582,050	0.800	2023/9/20	0.95
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	1,250,000,000	100.89	1,261,237,500	100.87	1,260,975,000	0.100	2025/6/20	0.92
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	1,100,000,000	100.70	1,107,744,000	101.33	1,114,641,000	0.100	2030/3/20	0.81
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	1,070,000,000	100.92	1,079,932,400	101.41	1,085,161,900	0.100	2029/9/20	0.79
日本	国債証券	第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	106.28	1,084,137,600	105.68	1,078,007,400	2.100	2024/3/20	0.78
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	1,060,000,000	100.67	1,067,207,300	101.28	1,073,578,600	0.100	2030/6/20	0.78
日本	国債証券	第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	104.72	1,073,421,000	104.17	1,067,804,000	1.900	2023/9/20	0.78
日本	国債証券	第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	105.22	1,073,244,000	104.67	1,067,664,600	1.900	2023/12/20	0.78
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	1,050,000,000	100.87	1,059,230,300	101.37	1,064,458,500	0.100	2029/12/20	0.77
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	990,000,000	100.38	993,762,000	101.02	1,000,137,600	0.100	2030/12/20	0.73
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	950,000,000	101.93	968,335,000	101.66	965,846,000	0.800	2023/6/20	0.70
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	930,000,000	100.24	932,280,800	100.90	938,425,800	0.100	2031/3/20	0.68
日本	国債証券	第84回利付国債(20年)	850,000,000	109.69	932,373,500	109.18	928,106,500	2.000	2025/12/20	0.68
日本	国債証券	第14回利付国債(30年)	692,000,000	128.05	886,112,920	128.18	887,033,280	2.400	2034/3/20	0.65
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	835,000,000	100.93	842,765,500	101.48	847,374,700	0.100	2029/3/20	0.62

日本	国債証券	第70回利付国債 (20年)	780,000,000	107.77	840,660,600	107.10	835,450,200	2.400	2024/6/20	0.61
日本	国債証券	第333回利付国債 (10年)	815,000,000	102.07	831,927,550	101.86	830,207,900	0.600	2024/3/20	0.60
日本	国債証券	第88回利付国債 (20年)	742,000,000	112.19	832,501,740	111.68	828,687,860	2.300	2026/6/20	0.60
日本	国債証券	第355回利付国債 (10年)	810,000,000	100.88	817,128,000	101.45	821,761,200	0.100	2029/6/20	0.60
日本	国債証券	第92回利付国債 (20年)	734,000,000	112.22	823,753,520	111.81	820,714,760	2.100	2026/12/20	0.60
日本	国債証券	第338回利付国債 (10年)	805,000,000	102.01	821,204,650	101.88	820,206,450	0.400	2025/3/20	0.60
日本	国債証券	第344回利付国債 (10年)	811,000,000	101.01	819,231,650	101.11	820,066,980	0.100	2026/9/20	0.60
日本	国債証券	第347回利付国債 (10年)	800,000,000	101.09	808,792,100	101.28	810,272,000	0.100	2027/6/20	0.59

□ 種類別の投資比率

2021年 8月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	81.38
地方債証券	6.22
特殊債券	8.37
社債券	3.39
合計	99.35

外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年 8月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	14,950,000	11,516.63	1,721,737,360	11,431.74	1,709,046,094	1.625	2026/5/15	1.06
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	13,300,000	11,797.93	1,569,126,015	11,744.27	1,561,988,517	2.250	2026/3/31	0.97

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	9,000,000	12,504.39	1,125,395,438	12,310.08	1,107,907,912	2.875	2028/5/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	8,500,000	11,896.02	1,011,162,041	11,860.61	1,008,152,195	2.500	2026/2/28	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.125	8,500,000	10,461.47	889,225,628	10,865.93	923,604,325	1.125	2031/2/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	8,800,000	10,704.26	941,974,880	10,418.17	916,799,537	0.625	2030/8/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.125	8,000,000	10,980.55	878,444,442	10,968.53	877,482,817	0.125	2023/8/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	7,700,000	11,014.89	848,147,244	10,998.58	846,891,117	0.250	2023/6/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.125	7,700,000	10,929.22	841,550,349	10,942.77	842,593,860	0.125	2024/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.375	7,800,000	10,805.36	842,818,704	10,620.80	828,422,766	0.375	2027/9/30	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	7,500,000	10,734.99	805,124,829	10,454.23	784,067,813	0.625	2030/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	7,200,000	10,609.26	763,866,797	10,743.15	773,507,107	0.625	2027/12/31	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	6,500,000	11,684.60	759,499,156	11,499.57	747,472,402	2.125	2024/3/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.875	7,000,000	10,569.47	739,863,005	10,638.83	744,718,465	0.875	2030/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	5,400,000	14,402.05	777,710,785	13,583.38	733,502,649	3.000	2048/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,300,000	11,843.44	746,136,857	11,622.35	732,208,318	2.250	2024/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.75	6,700,000	10,533.91	705,772,305	10,816.56	724,709,792	0.750	2028/1/31	0.45
イタリア	国債証券	BTPS 3.5	4,400,000	16,574.38	729,272,808	16,322.52	718,191,057	3.500	2030/3/1	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	6,200,000	11,581.26	718,038,244	11,417.15	707,863,325	1.750	2024/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,700,000	11,848.59	675,369,844	11,622.35	662,474,193	2.500	2024/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	5,600,000	11,848.59	663,521,250	11,633.51	651,476,898	2.375	2024/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	5,800,000	10,322.90	598,728,606	10,905.85	632,539,753	1.875	2051/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.125	5,700,000	10,975.40	625,598,025	10,962.52	624,863,925	0.125	2023/10/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	2,600,000	24,551.61	638,341,961	23,138.12	601,591,187	4.500	2041/4/25	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	3,850,000	15,967.97	614,767,043	15,602.22	600,685,692	2.750	2027/10/25	0.37

フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0	4,500,000	13,441.07	604,848,222	13,266.63	596,998,735	0.000	2029/11/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	5,100,000	11,880.36	605,898,450	11,648.97	594,097,507	2.750	2024/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	4,800,000	12,599.00	604,752,225	12,203.19	585,753,265	2.750	2028/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	4,900,000	12,250.41	600,270,366	11,908.69	583,526,070	2.375	2027/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,000,000	11,949.04	597,452,464	11,655.41	582,770,511	2.000	2026/11/15	0.36

□ 種類別の投資比率

2021年 8月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.78
合計	98.78

投資不動産物件

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

参考情報

基準日:2021年8月31日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

基準価額・純資産の推移



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

決算期	分配金
2021年2月	0円
2020年2月	0円
2019年2月	0円
2018年2月	0円
2017年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

主要な資産の状況

■三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	94.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5.09
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	74.91
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	20.00

■国内債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	81.38
特殊債券	日本	8.37
地方債証券	日本	6.22
社債券	日本	3.24
	フランス	0.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.64
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	第427回利付国債(2年)	0.005	2023/08/01	2.41
日本	国債証券	第425回利付国債(2年)	0.005	2023/06/01	1.62
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	0.100	2031/06/20	1.28
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	0.005	2026/03/20	1.24
日本	国債証券	第146回利付国債(5年)	0.100	2025/12/20	1.24
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	0.100	2030/09/20	1.15
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	0.100	2025/09/20	0.96
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	0.800	2023/09/20	0.95
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	0.100	2025/06/20	0.92
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	0.100	2030/03/20	0.81

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※[主要投資銘柄(上位10銘柄)]は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

■外国債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	44.73
	フランス	10.10
	イタリア	9.53
	ドイツ	7.33
	イギリス	6.31
	スペイン	5.97
	ベルギー	2.38
	その他	12.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.22
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1.625	2026/05/15	1.06
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2026/03/31	0.97
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	2.875	2028/05/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	2.500	2026/02/28	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.125	1.125	2031/02/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	0.625	2030/08/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.125	0.125	2023/08/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	0.250	2023/06/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.125	0.125	2024/02/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.375	0.375	2027/09/30	0.52

※比率は、マザーファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※換金時に費用・税金などがかかる場合があります。したがって、ファンドの収益率は実際の投資家利回りとは異なります。

※2014年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2014年12月15日)から年末までの騰落率を表示しています。

※2021年の収益率は、年初から2021年8月31日までの騰落率を表示しています。

※ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

イ 申込方法

(イ) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(ロ) 原則として午後3時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。

なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受け付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

(ハ) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(二) 定時定額で取得申込みをする「定時定額購入サービス」（販売会社によっては、名称が異なる場合があります。）を利用する場合は、販売会社との間で「定時定額購入サービス」に関する契約を締結します。詳細については、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

ハ 申込手数料

ありません。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求（一部解約の実行請求）により換金することができます。

お買付けの販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。

解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

解約単位の詳細および一部解約価額につきましては、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとし、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「DCマゼロ」として掲載されます。委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター	ホームページ
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

(2)【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2014年12月15日から下記「(5)その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4)【計算期間】

毎年2月19日から翌年2月18日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b~dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b~dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。
- (ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令
委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。
- (ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い
委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。
- (二) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い
- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ロ 収益分配金、償還金の支払い
- (イ) 収益分配金
- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。
分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払われます。
ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（ロ）償還金

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。

八 信託約款の変更等

- （イ）委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- （ロ）委託会社は、上記（イ）の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- （ハ）上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- （ニ）書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います（書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。）。
- （ホ）上記（ロ）から（ニ）までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- （ヘ）上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあつても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの）は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれから、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。

ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.smd-am.co.jp>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

チ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は毎決算後、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書(全体版)および運用報告書(全体版)の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。

交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。なお、運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページで閲覧できます。

4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ハ 一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金(解約)手続等」の記載をご参照ください。

ニ 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。)または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行行使することができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「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)ならびに同規則第2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、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6期(2020年2月19日から2021年2月18日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 (2020年 2月18日現在)	第6期 (2021年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	9,974,029	-
コール・ローン	643,278	11,758,631
親投資信託受益証券	197,561,303	218,497,140
未収入金	1,030,000	160,000
流動資産合計	209,208,610	230,415,771
資産合計	209,208,610	230,415,771
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,100,153	268,484
未払受託者報酬	30,621	38,715
未払委託者報酬	193,877	245,150
未払利息	1	34
その他未払費用	5,161	6,381
流動負債合計	1,329,813	558,764
負債合計	1,329,813	558,764
純資産の部		
元本等		
元本	198,282,133	221,020,587
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	9,596,664	8,836,420
元本等合計	207,878,797	229,857,007
純資産合計	207,878,797	229,857,007
負債純資産合計	209,208,610	230,415,771

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第5期		第6期	
	自	2019年 2月19日	自	2020年 2月19日
	至	2020年 2月18日	至	2021年 2月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		3,535,954		1,444,163
営業収益合計		3,535,954		1,444,163
営業費用				
支払利息		5,216		7,552
受託者報酬		55,407		73,827
委託者報酬		350,742		467,483
その他費用		11,617		15,557
営業費用合計		422,982		564,419
営業利益又は営業損失()		3,112,972		2,008,582
経常利益又は経常損失()		3,112,972		2,008,582
当期純利益又は当期純損失()		3,112,972		2,008,582
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		294,717		518,916
期首剰余金又は期首欠損金()		4,015,648		9,596,664
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,554,837		5,820,997
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,554,837		5,820,997
剰余金減少額又は欠損金増加額		792,076		5,091,575
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		792,076		5,091,575
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		9,596,664		8,836,420

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第6期
	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	第5期	第6期
	(2020年 2月18日現在)	(2021年 2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	198,282,133口	221,020,587口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0484円 (10,000口当たりの純資産額 10,484円)	1口当たり純資産額 1.0400円 (10,000口当たりの純資産額 10,400円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第5期	第6期
	自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,892,865円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,100円)、収益調整金(5,579,364円)、および分配準備積立金(2,123,335円)より、分配対象収益は9,596,664円(1万口当たり483.96円)ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,052,489円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(7,849,836円)、および分配準備積立金(2,465,479円)より、分配対象収益は12,367,804円(1万口当たり559.56円)ですが、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第6期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4.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委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
---------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期 (2021年 2月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 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、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第5期(自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	3,355,370円
合計	3,355,370円

第6期(自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	802,704円
合計	802,704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。

（関連当事者との取引に関する注記）

<p>第6期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日</p>
<p>市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。</p>

（その他の注記）

項 目	第5期 (2020年 2月18日現在)	第6期 (2021年 2月18日現在)
期首元本額	140,665,723円	198,282,133円
期中追加設定元本額	83,181,723円	129,604,307円
期中一部解約元本額	25,565,313円	106,865,853円

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	24,233,080	46,299,722	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	135,162,809	172,197,418	
合計		159,395,889	218,497,140	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）は、「国内債券パッシブ・マザーファンド」および「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	（2020年 2月18日現在）	（2021年 2月18日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	478,901,879	-
コール・ローン	30,886,932	2,728,345,705
国債証券	107,923,204,140	102,126,845,070
地方債証券	8,574,266,640	8,642,456,560
特殊債券	14,874,562,019	12,556,759,175
社債券	6,837,231,000	4,039,898,000
未収入金	116,611,400	507,203,000
未収利息	420,107,736	376,676,876
前払費用	4,543,049	4,039,280
流動資産合計	139,260,314,795	130,982,223,666
資産合計	139,260,314,795	130,982,223,666
負債の部		
流動負債		
未払金	-	1,104,493,400
未払解約金	99,011,550	2,317,953,000
未払利息	91	7,914
その他未払費用	6,316	-
流動負債合計	99,017,957	3,422,454,314
負債合計	99,017,957	3,422,454,314
純資産の部		
元本等		
元本	107,405,246,912	100,129,074,120
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	31,756,049,926	27,430,695,232
元本等合計	139,161,296,838	127,559,769,352
純資産合計	139,161,296,838	127,559,769,352
負債純資産合計	139,260,314,795	130,982,223,666

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
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、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2020年 2月18日現在)	(2021年 2月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	107,405,246,912口	100,129,074,120口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2957円 (10,000口当たりの純資産額 12,957円)	1口当たり純資産額 1.2740円 (10,000口当たりの純資産額 12,740円)

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1) 金融商品の内容

リスク	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.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委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2021年 2月18日現在)
----	-----------------

1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 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、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2020年 2月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	140,556,463,902円
同期中における追加設定元本額	21,270,367,331円
同期中における一部解約元本額	54,421,584,321円
2020年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	5,200,488,591円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	8,973,645,381円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,935,830,418円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	625,719,043円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	52,869,460円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	188,105,232円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	361,976,149円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	350,151,880円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	141,140,207円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	264,626,940円

三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	120,218,313円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,773,898,437円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	510,411,078円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	23,338,429円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2050	14,905,538円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,051,182,559円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	353,693,767円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	463,109,615円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	83,984,752円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	7,138,094円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	47,682,561円
三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)	442,976円
三井住友D S ・年金バランス50(標準型)	620,981円
三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	126,573円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	3,213,875円
S M A M ・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,855,107,812円
S M A M ・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	16,578,099,929円
S M A M ・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	7,134,235,811円
S M A M ・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	17,510,036,902円
S M A M ・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	337,602,291円
S M A M ・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	584,000,853円
世界6資産バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	2,857,949円
S M A M ・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	263,178,696円
S M A M ・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	114,381,750円
S M A M ・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	1,976,884,869円
S M A M ・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,195,429,901円
S M A M ・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	2,671,616,453円
S M A M ・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	10,029,580,964円
S M A M ・バランスV A 株40T<適格機関投資家限定>	2,314,139円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,422,913,818円
S M A M ・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	488,613,431円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	645,327,491円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	181,670,894円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	45,425,323円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	1,816,743,594円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	2,381,697,831円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 <適格機関投資家専用>	952,715,786円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用>	245,199,667円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	19,479,316円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 <適格機関投資家専用>	326,867,434円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用>	5,969,464,326円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 <適格機関投資家専用>	268,464,600円
S M A M ・年金Wリスクリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	194,699,554円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	705,362,167円
S M A M ・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	663,872,246円
S M A M ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	3,272,880,266円

合計	107,405,246,912円
----	------------------

(2021年 2月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	107,405,246,912円
同期中における追加設定元本額	31,312,880,290円
同期中における一部解約元本額	38,589,053,082円
2021年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	5,849,125,873円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	10,277,305,275円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,281,609,671円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	557,497,100円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	42,772,936円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	195,547,502円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	416,828,870円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	506,152,768円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	222,180,703円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	359,091,057円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	135,162,809円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,290,177,379円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	405,171,755円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,590,257円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	30,166,475円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,117,329,028円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	356,713,253円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	509,322,266円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	104,902,299円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	29,345,283円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	84,760,569円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	55,942,355円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	92,132,794円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	25,221,489円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	4,051,909円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,635,333,683円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	14,645,125,243円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	6,716,300,176円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	16,758,553,795円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	324,470,878円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	584,749,121円
世界6資産バランスファンドV A<適格機関投資家限定>	1,828,677円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	269,243,070円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	120,304,219円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,906,397,650円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	2,164,794,277円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	2,519,848,740円

SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	9,294,363,282円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,106,276円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,295,938,945円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	467,586,621円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	599,719,035円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	177,900,320円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	46,646,093円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,629,572,303円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,241,285,586円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	821,846,833円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	212,410,596円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	18,427,405円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	302,971,200円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	5,582,241,420円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	288,586,835円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	885,855,263円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	742,864,411円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	2,910,700,492円
合計	100,129,074,120円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第419回利付国債(2年)	3,280,000,000	3,293,448,000	
	第420回利付国債(2年)	510,000,000	512,193,000	
	第421回利付国債(2年)	330,000,000	331,448,700	
	第133回利付国債(5年)	48,000,000	48,174,720	
	第134回利付国債(5年)	110,000,000	110,454,300	
	第135回利付国債(5年)	190,000,000	190,870,200	

第136回利付国債(5年)	500,000,000	502,570,000	
第137回利付国債(5年)	100,000,000	100,570,000	
第138回利付国債(5年)	600,000,000	603,834,000	
第139回利付国債(5年)	260,000,000	261,765,400	
第140回利付国債(5年)	600,000,000	604,314,000	
第141回利付国債(5年)	15,000,000	15,113,250	
第142回利付国債(5年)	680,000,000	685,358,400	
第143回利付国債(5年)	770,000,000	776,306,300	
第144回利付国債(5年)	1,250,000,000	1,260,600,000	
第145回利付国債(5年)	1,310,000,000	1,321,750,700	
第146回利付国債(5年)	930,000,000	938,342,100	
第1回利付国債(40年)	40,000,000	57,576,800	
第2回利付国債(40年)	242,000,000	337,887,660	
第3回利付国債(40年)	185,000,000	259,895,400	
第4回利付国債(40年)	247,000,000	349,033,230	
第5回利付国債(40年)	215,000,000	294,229,650	
第6回利付国債(40年)	240,000,000	323,930,400	
第7回利付国債(40年)	255,000,000	331,505,100	
第8回利付国債(40年)	300,000,000	364,809,000	
第9回利付国債(40年)	483,000,000	439,713,540	
第10回利付国債(40年)	460,000,000	490,737,200	
第11回利付国債(40年)	320,000,000	331,369,600	
第12回利付国債(40年)	390,000,000	364,899,600	
第13回利付国債(40年)	310,000,000	289,639,200	
第326回利付国債(10年)	77,000,000	78,159,620	
第327回利付国債(10年)	25,000,000	25,422,250	
第328回利付国債(10年)	130,000,000	131,950,000	
第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	2,073,421,700	
第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	1,315,467,350	
第332回利付国債(10年)	793,000,000	809,113,760	
第333回利付国債(10年)	815,000,000	833,003,350	
第334回利付国債(10年)	315,000,000	322,478,100	
第335回利付国債(10年)	50,000,000	51,088,000	
第336回利付国債(10年)	340,000,000	347,847,200	
第337回利付国債(10年)	120,000,000	121,846,800	
第338回利付国債(10年)	805,000,000	821,317,350	

第339回利付国債(10年)	785,000,000	801,893,200	
第340回利付国債(10年)	770,000,000	787,540,600	
第341回利付国債(10年)	557,000,000	567,404,760	
第342回利付国債(10年)	350,000,000	353,213,000	
第343回利付国債(10年)	890,000,000	898,330,400	
第344回利付国債(10年)	811,000,000	818,720,720	
第345回利付国債(10年)	938,000,000	947,061,080	
第346回利付国債(10年)	640,000,000	646,246,400	
第347回利付国債(10年)	540,000,000	545,313,600	
第348回利付国債(10年)	145,000,000	146,387,650	
第349回利付国債(10年)	250,000,000	252,397,500	
第350回利付国債(10年)	420,000,000	423,872,400	
第351回利付国債(10年)	290,000,000	292,554,900	
第352回利付国債(10年)	790,000,000	796,588,600	
第353回利付国債(10年)	640,000,000	645,011,200	
第354回利付国債(10年)	965,000,000	972,005,900	
第355回利付国債(10年)	870,000,000	875,420,100	
第356回利付国債(10年)	850,000,000	854,726,000	
第357回利付国債(10年)	35,000,000	35,169,050	
第358回利付国債(10年)	1,020,000,000	1,024,141,200	
第359回利付国債(10年)	780,000,000	782,168,400	
第360回利付国債(10年)	1,910,000,000	1,913,629,000	
第361回利付国債(10年)	280,000,000	280,271,600	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	617,411,100	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	381,852,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	351,590,200	
第7回利付国債(30年)	474,000,000	587,034,780	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	114,201,000	
第10回利付国債(30年)	555,000,000	615,001,050	
第11回利付国債(30年)	430,000,000	508,234,200	
第12回利付国債(30年)	590,000,000	728,042,300	
第14回利付国債(30年)	712,000,000	910,491,360	
第16回利付国債(30年)	465,000,000	604,035,000	
第18回利付国債(30年)	450,000,000	575,464,500	
第19回利付国債(30年)	470,000,000	602,474,200	
第21回利付国債(30年)	345,000,000	444,246,150	

第22回利付国債(30年)	315,000,000	415,875,600	
第23回利付国債(30年)	329,000,000	435,408,470	
第24回利付国債(30年)	310,000,000	411,224,300	
第25回利付国債(30年)	300,000,000	389,805,000	
第26回利付国債(30年)	363,000,000	478,463,040	
第27回利付国債(30年)	440,000,000	589,195,200	
第28回利付国債(30年)	386,000,000	519,328,260	
第29回利付国債(30年)	177,000,000	236,125,080	
第30回利付国債(30年)	472,000,000	623,724,400	
第31回利付国債(30年)	315,000,000	412,363,350	
第32回利付国債(30年)	390,000,000	519,971,400	
第33回利付国債(30年)	378,000,000	485,193,240	
第34回利付国債(30年)	457,000,000	605,950,010	
第35回利付国債(30年)	390,000,000	503,876,100	
第36回利付国債(30年)	60,000,000	77,755,200	
第37回利付国債(30年)	355,000,000	454,030,800	
第38回利付国債(30年)	320,000,000	403,923,200	
第39回利付国債(30年)	190,000,000	243,923,900	
第40回利付国債(30年)	270,000,000	341,571,600	
第41回利付国債(30年)	270,000,000	336,395,700	
第42回利付国債(30年)	260,000,000	324,222,600	
第43回利付国債(30年)	305,000,000	380,676,600	
第44回利付国債(30年)	300,000,000	374,757,000	
第45回利付国債(30年)	245,000,000	295,597,400	
第46回利付国債(30年)	295,000,000	356,103,350	
第47回利付国債(30年)	280,000,000	344,568,000	
第48回利付国債(30年)	345,000,000	409,390,800	
第49回利付国債(30年)	355,000,000	421,388,550	
第50回利付国債(30年)	355,000,000	372,096,800	
第51回利付国債(30年)	335,000,000	311,529,900	
第52回利付国債(30年)	353,000,000	344,404,450	
第53回利付国債(30年)	247,000,000	246,446,720	
第54回利付国債(30年)	45,000,000	47,029,500	
第55回利付国債(30年)	315,000,000	328,951,350	
第56回利付国債(30年)	300,000,000	313,038,000	
第57回利付国債(30年)	295,000,000	307,567,000	

第58回利付国債(30年)	350,000,000	364,605,500	
第59回利付国債(30年)	400,000,000	406,528,000	
第60回利付国債(30年)	400,000,000	425,880,000	
第61回利付国債(30年)	345,000,000	349,474,650	
第62回利付国債(30年)	105,000,000	100,899,750	
第63回利付国債(30年)	380,000,000	354,722,400	
第64回利付国債(30年)	235,000,000	218,989,450	
第65回利付国債(30年)	355,000,000	330,238,750	
第66回利付国債(30年)	310,000,000	288,225,600	
第67回利付国債(30年)	310,000,000	303,933,300	
第68回利付国債(30年)	400,000,000	392,116,000	
第69回利付国債(30年)	80,000,000	80,496,000	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,503,640,650	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,243,358,100	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,078,515,250	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,078,405,200	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,089,819,000	
第70回利付国債(20年)	780,000,000	845,457,600	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	812,720,430	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	720,200,960	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	534,046,100	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	641,052,700	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	682,489,800	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	935,773,500	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	716,530,500	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	836,107,860	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	22,429,400	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	653,613,600	
第92回利付国債(20年)	734,000,000	826,799,620	
第93回利付国債(20年)	632,000,000	711,221,200	
第95回利付国債(20年)	305,000,000	350,524,300	
第97回利付国債(20年)	677,000,000	777,101,220	
第99回利付国債(20年)	693,000,000	794,337,390	
第100回利付国債(20年)	207,000,000	239,747,400	
第101回利付国債(20年)	355,000,000	416,198,450	
第102回利付国債(20年)	457,000,000	538,199,760	

第105回利付国債(20年)	390,000,000	452,450,700	
第106回利付国債(20年)	370,000,000	432,056,400	
第107回利付国債(20年)	378,000,000	440,177,220	
第108回利付国債(20年)	390,000,000	448,039,800	
第109回利付国債(20年)	340,000,000	391,873,800	
第111回利付国債(20年)	386,000,000	455,800,380	
第113回利付国債(20年)	427,000,000	502,455,170	
第114回利付国債(20年)	363,000,000	428,626,770	
第116回利付国債(20年)	200,000,000	238,756,000	
第118回利付国債(20年)	200,000,000	235,894,000	
第119回利付国債(20年)	295,000,000	342,471,400	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	228,474,000	
第121回利付国債(20年)	255,000,000	299,280,750	
第122回利付国債(20年)	330,000,000	384,162,900	
第123回利付国債(20年)	80,000,000	95,719,200	
第124回利付国債(20年)	190,000,000	225,478,700	
第125回利付国債(20年)	205,000,000	248,082,800	
第126回利付国債(20年)	180,000,000	214,234,200	
第127回利付国債(20年)	145,000,000	171,129,000	
第128回利付国債(20年)	215,000,000	254,312,750	
第129回利付国債(20年)	190,000,000	222,801,600	
第130回利付国債(20年)	155,000,000	182,213,350	
第131回利付国債(20年)	380,000,000	442,745,600	
第132回利付国債(20年)	450,000,000	525,469,500	
第133回利付国債(20年)	190,000,000	223,894,100	
第134回利付国債(20年)	200,000,000	236,220,000	
第135回利付国債(20年)	155,000,000	181,379,450	
第136回利付国債(20年)	120,000,000	139,113,600	
第137回利付国債(20年)	25,000,000	29,317,500	
第139回利付国債(20年)	70,000,000	81,309,200	
第140回利付国債(20年)	530,000,000	622,824,200	
第141回利付国債(20年)	230,000,000	270,818,100	
第142回利付国債(20年)	110,000,000	130,797,700	
第143回利付国債(20年)	170,000,000	198,537,900	
第144回利付国債(20年)	30,000,000	34,681,500	
第145回利付国債(20年)	110,000,000	130,013,400	

第146回利付国債(20年)	105,000,000	124,331,550	
第147回利付国債(20年)	230,000,000	269,948,700	
第148回利付国債(20年)	59,000,000	68,601,070	
第149回利付国債(20年)	635,000,000	739,311,450	
第150回利付国債(20年)	221,000,000	254,722,390	
第151回利付国債(20年)	770,000,000	867,220,200	
第152回利付国債(20年)	245,000,000	276,090,500	
第153回利付国債(20年)	247,000,000	281,906,040	
第154回利付国債(20年)	580,000,000	654,303,800	
第155回利付国債(20年)	410,000,000	450,754,000	
第156回利付国債(20年)	380,000,000	384,370,000	
第157回利付国債(20年)	155,000,000	151,948,050	
第158回利付国債(20年)	360,000,000	368,521,200	
第159回利付国債(20年)	318,000,000	330,173,040	
第160回利付国債(20年)	315,000,000	331,528,050	
第161回利付国債(20年)	260,000,000	269,209,200	
第162回利付国債(20年)	80,000,000	82,745,600	
第163回利付国債(20年)	670,000,000	692,223,900	
第164回利付国債(20年)	215,000,000	218,435,700	
第165回利付国債(20年)	650,000,000	659,464,000	
第166回利付国債(20年)	295,000,000	308,776,500	
第167回利付国債(20年)	500,000,000	505,375,000	
第168回利付国債(20年)	150,000,000	148,746,000	
第169回利付国債(20年)	400,000,000	388,848,000	
第170回利付国債(20年)	255,000,000	247,589,700	
第171回利付国債(20年)	525,000,000	509,113,500	
第172回利付国債(20年)	500,000,000	493,435,000	
第173回利付国債(20年)	515,000,000	507,707,600	
第174回利付国債(20年)	660,000,000	649,961,400	
国債証券合計	93,847,000,000	102,126,845,070	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,558,000
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	123,004,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,092,000
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	516,368,000
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	631,575,000
	第705回東京都公募公債	100,000,000	101,125,000

第710回東京都公募公債	100,000,000	101,060,000	
平成24年度第1回北海道公募公債	100,000,000	101,138,000	
平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	101,560,000	
平成26年度第15回北海道公募公債	100,000,000	101,623,000	
平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	300,000,000	299,910,000	
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	108,452,000	
第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	109,074,000	
第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	112,843,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	202,412,000	
第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,055,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,883,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	102,328,000	
平成29年度第12回京都府公募公債	300,000,000	300,153,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	325,365,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	128,330,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	109,940,000	
平成29年度第2回埼玉県公募公債(5年)	200,000,000	199,986,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	102,050,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	101,760,000	
平成25年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	101,810,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	101,388,000	
第111回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,352,000	
第112回共同発行市場公募地方債	150,000,000	151,768,500	
第113回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,143,000	
第114回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,281,000	
第115回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,640,000	
第118回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,595,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,866,000	
第172回共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,665,000	
第183回共同発行市場公募地方債	400,000,000	402,180,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	211,196,000	
第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	108,727,000	
第5回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	112,364,000	
第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	133,525,000	
第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	116,861,000	
平成29年度第5回京都市公募公債	100,000,000	100,052,000	

	平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	101,043,000	
	第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	108,214,000	
	第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	112,079,000	
	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	115,477,000	
	第47回横浜市公募公債(5年)	100,000,000	100,048,000	
	平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,753,000	
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	101,751,000	
	平成24年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,267,000	
	平成23年度第9回福岡市公募公債	147,000,000	148,614,060	
	平成29年度第11回福岡市公募公債(5年)	300,000,000	300,153,000	
地方債証券合計		8,097,000,000	8,642,456,560	
特殊債券	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	211,894,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,698,000	
	第34回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,081,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	113,343,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,188,000	
	第9回道路債券	100,000,000	128,708,000	
	第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	149,210,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	434,574,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,798,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	349,521,000	
	第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	235,890,000	
	第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	232,552,000	
	第88回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,522,000	
	第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	350,301,000	
	第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,206,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	405,828,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,706,000		
第176回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,913,000		

第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,230,000	
第210回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	231,384,000	
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,894,000	
第231回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	305,553,000	
第288回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	189,000,000	188,523,720	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	117,066,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	102,118,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	105,417,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	111,829,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	800,000,000	800,208,000	
第20回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,121,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,995,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	230,574,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	301,359,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,982,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,413,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,144,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,267,000	
第62回地方公共団体金融機構債券	400,000,000	408,460,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,994,000	
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,759,000	
第101回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,897,000	
第106回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,208,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	103,174,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	103,247,000	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	10,385,000	10,474,830	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,426,000	12,788,963	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	10,800,000	10,912,320	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,978,000	14,560,183	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,690,000	24,292,199	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,137,000	14,836,074	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	36,882,000	37,947,889	

第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,910,000	14,466,678	
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,935,000	15,732,827	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,599,000	9,615,318	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	9,676,000	9,694,964	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	24,358,000	24,662,231	
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,082,000	19,191,149	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,068,000	39,502,626	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,286,000	59,656,405	
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	20,733,000	22,010,152	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,434,000	23,871,346	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,316,000	11,513,464	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,330,000	27,137,295	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,872,000	26,646,865	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,608,000	12,907,313	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,158,000	52,230,375	
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,505,000	13,972,948	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,606,000	27,223,274	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,152,000	26,617,355	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,197,000	12,496,070	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,221,000	13,716,655	
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,040,000	25,931,674	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,708,000	34,688,142	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,586,000	30,418,362	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,054,000	57,423,726	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,975,000	28,552,767	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,147,000	12,514,082	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,916,000	63,355,777	
第52回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,598,000	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,917,000	13,361,215	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,040,000	84,569,463	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,903,000	40,014,955	
第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,691,000	42,954,233	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,482,000	82,950,765	

	第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	122,076,000	128,541,144	
	第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,421,000	41,348,686	
	第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,928,000	46,827,555	
	第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,358,000	96,121,406	
	第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,276,000	83,083,626	
	第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,185,000	47,576,190	
	第95回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,142,000	
	第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,844,000	69,105,332	
	第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,822,000	85,551,469	
	第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,585,000	85,078,976	
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,880,000	85,372,304	
	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,213,000	86,570,783	
	第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,545,000	86,027,473	
	第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,904,000	87,607,053	
	第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	233,314,000	
	第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,883,000	90,708,125	
	第226回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,847,000	
	第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,926,000	24,588,271	
	第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,658,000	27,597,427	
	第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,876,000	13,288,418	
	第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	12,367,000	12,695,838	
	第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	26,966,000	27,925,450	
	い第810号農林債	300,000,000	300,450,000	
	第12回国際協力機構債券	100,000,000	101,196,000	
	第35回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,014,000	
	第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,410,000	
	第85回中日本高速道路株式会社社債	300,000,000	300,255,000	
	第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,898,000	
	第23回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,857,000	
	特殊債券合計	11,735,516,000	12,556,759,175	
社債券	第2回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	200,000,000	200,590,000	
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,784,000	
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
	第56回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,814,000	
	第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,042,000	

第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,067,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	101,916,000	
第22回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	99,571,000	
第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	112,788,000	
第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	114,467,000	
株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保社債	100,000,000	101,155,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,288,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	111,702,000	
第1回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債	100,000,000	101,373,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,408,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	111,284,000	
第17回NTTファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	200,954,000	
第93回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	400,000,000	399,740,000	
野村ホールディングス株式会社第1回無担保社債	100,000,000	99,860,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	125,266,000	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,238,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	120,493,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,013,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,522,000	
第45回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	99,394,000	
第27回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,710,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	102,550,000	
第508回東北電力株式会社社債	200,000,000	202,230,000	
第37回東京電力パワーグリッド株式会社社債	200,000,000	200,616,000	
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,052,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,011,000	
社債券合計	3,900,000,000	4,039,898,000	
合計		127,365,958,805	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	（2020年 2月18日現在）	（2021年 2月18日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	658,479,599	564,581,811
金銭信託	251,210,849	-
コール・ローン	16,201,925	74,747,376
国債証券	168,803,691,286	161,033,197,180
派生商品評価勘定	-	1,645,127
未収入金	-	1,858,749,942
未収利息	1,350,042,152	966,326,020
前払費用	47,930,201	13,435,006
流動資産合計	171,127,556,012	164,512,682,462
資産合計	171,127,556,012	164,512,682,462
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	5,061,835
未払金	-	1,323,659,485
未払解約金	160,434,330	188,195,974
未払利息	47	216
その他未払費用	15,491	-
流動負債合計	160,449,868	1,516,917,510
負債合計	160,449,868	1,516,917,510
純資産の部		
元本等		
元本	92,850,628,728	85,310,011,496
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	78,116,477,416	77,685,753,456
元本等合計	170,967,106,144	162,995,764,952
純資産合計	170,967,106,144	162,995,764,952
負債純資産合計	171,127,556,012	164,512,682,462

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2020年 2月18日現在)		(2021年 2月18日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	92,850,628,728口		85,310,011,496口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.8413円	1口当たり純資産額	1.9106円
	(10,000口当たりの純資産額)	18,413円)	(10,000口当たりの純資産額)	19,106円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1) 金融商品の内容

リスク	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 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委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・ 金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2021年 2月18日現在)
-----	-----------------

1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 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、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年 2月18日現在)

該当事項はありません。

(2021年 2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,332,734,038	-	1,327,984,352	4,749,686
	米ドル	665,806,534	-	664,418,628	1,387,906
	ユーロ	606,880,090	-	603,683,614	3,196,476
	英ポンド	60,047,414	-	59,882,110	165,304
	売建	525,389,746	-	524,056,768	1,332,978
	米ドル	257,373,062	-	257,682,112	309,050
	ユーロ	267,973,664	-	266,331,761	1,641,903
	英ポンド	43,020	-	42,895	125
合計		1,858,123,784	-	1,852,041,120	3,416,708

(注) 1.時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

1)計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

- ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
- ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。

2)計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2020年 2月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	94,756,321,868円
同期中における追加設定元本額	18,725,464,837円
同期中における一部解約元本額	20,631,157,977円
2020年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	21,534,751,681円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	664,752,688円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,805,039,664円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	904,627,912円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	102,371,639円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	9,195,766円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	32,751,972円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	93,743,791円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	132,988,962円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	74,508,384円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	158,082,820円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	22,698,330円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	198,310,140円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	215,945,347円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	167,467,429円
イオン・バランス戦略ファンド	54,374,494円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	6,620,827円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	55,973,419円

三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	60,740,528円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	115,914,254円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	44,168,094円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	20,348,679円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	44,682,823円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	578,915円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	56,364円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	124,199円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	59,106円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,345,111円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,695,045,476円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	66,234,760円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	10,180,484,834円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,428,874,945円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	12,285,103,255円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	39,245,451円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	101,496,233円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	572,400円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	744,253,727円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	121,214,505円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,233,947,890円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,543,643,762円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,877,296,919円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,043,606,193円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,627,146円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	9,979,645,464円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	406,885,833円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	171,273,388円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	104,471,771円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	38,632,744円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,885,160円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	128,196,997円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	505,626,030円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	154,651,371円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	51,439,144円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,809,310円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,272,010,412円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	19,121,083円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	2,401,949,169円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	1,365,567,210円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,716,314,439円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	582,852,083円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	58,758,346円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	77,534,671円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	254,148,937円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	238,480,125円

S M A M ・ マルチアセット ・ ダイナミックアロケーション ・ ストラテジー ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	1,418,504,207円
合計	92,850,628,728円

(2021年 2月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	92,850,628,728円
同期中における追加設定元本額	12,353,840,879円
同期中における一部解約元本額	19,894,458,111円
2021年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友 ・ D C 外国債券インデックスファンドS	23,244,502,535円
三井住友 ・ D C 年金バランス30(債券重点型)	710,157,374円
三井住友 ・ D C 年金バランス50(標準型)	1,958,794,306円
三井住友 ・ D C 年金バランス70(株式重点型)	1,005,548,820円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	142,748,560円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,951,183円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	31,512,688円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	99,066,057円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	170,376,094円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	108,781,695円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	199,736,211円
三井住友 ・ D C 年金バランスゼロ(債券型)	24,233,080円
アセットアロケーション ・ ファンド(安定型)	87,727,566円
アセットアロケーション ・ ファンド(安定成長型)	127,038,109円
アセットアロケーション ・ ファンド(成長型)	68,476,615円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2050	11,846,262円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド(1安定重視型)	64,816,122円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド(2やや安定型)	39,042,933円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド(3バランス型)	95,085,277円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド(4やや成長型)	29,864,584円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド(5成長重視型)	19,560,013円
三井住友 ・ D C つみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	71,850,656円
三井住友D S ・ 外国債券インデックス年金ファンド	109,843,469円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	6,805,603円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	17,506,667円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	11,099,081円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2060	1,626,248円
S M A M ・ 年金外国債券パッシブ ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	2,043,593,613円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	53,057,364円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	8,531,760,680円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	4,860,208,256円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	11,164,801,965円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	35,450,962円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	95,266,461円

世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	344,673円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	718,669,331円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	120,185,798円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,122,042,188円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,453,491,138円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,679,976,562円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	5,316,768,149円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	734,643円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,809,268,355円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	352,953,733円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	156,272,027円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	91,137,314円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	35,246,062円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	12,901,519円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	110,101,987円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	452,050,893円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	125,311,405円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	41,682,415円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,169,886円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,120,491,404円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	899,220,307円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	1,115,496,800円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,187,233,763円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	494,516,397円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	77,084,706円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	57,990,730円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	188,235,066円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	157,799,081円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	1,158,898,055円
合計	85,310,011,496円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.125	1,800,000.00	1,800,140.63	
		US TREASURY N/B 0.125	4,300,000.00	4,296,304.70	
		US TREASURY N/B 0.125	8,000,000.00	7,991,875.04	
		US TREASURY N/B 0.125	5,700,000.00	5,691,539.09	
		US TREASURY N/B 0.25	5,000,000.00	5,012,109.40	
		US TREASURY N/B 0.25	7,700,000.00	7,716,242.22	
		US TREASURY N/B 0.25	3,000,000.00	3,004,921.89	
		US TREASURY N/B 0.25	2,400,000.00	2,378,250.00	
		US TREASURY N/B 0.25	3,300,000.00	3,267,773.45	
		US TREASURY N/B 0.25	2,000,000.00	1,976,718.76	
		US TREASURY N/B 0.375	1,500,000.00	1,504,335.94	
		US TREASURY N/B 0.375	3,000,000.00	2,993,203.14	
		US TREASURY N/B 0.375	2,000,000.00	1,984,687.50	
		US TREASURY N/B 0.375	4,700,000.00	4,558,265.62	
		US TREASURY N/B 0.375	9,100,000.00	8,800,695.35	
		US TREASURY N/B 0.5	1,500,000.00	1,505,390.62	
		US TREASURY N/B 0.5	3,000,000.00	2,944,687.50	
		US TREASURY N/B 0.5	3,000,000.00	2,940,468.75	
		US TREASURY N/B 0.5	4,400,000.00	4,308,562.50	
		US TREASURY N/B 0.625	1,500,000.00	1,485,117.19	
		US TREASURY N/B 0.625	1,000,000.00	980,859.38	
		US TREASURY N/B 0.625	7,500,000.00	7,100,976.60	
		US TREASURY N/B 0.625	9,800,000.00	9,241,859.42	
		US TREASURY N/B 0.875	3,400,000.00	3,273,296.89	
		US TREASURY N/B 1.125	4,000,000.00	4,041,875.00	
		US TREASURY N/B 1.125	1,500,000.00	1,543,593.75	
		US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	2,041,250.00	
		US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,079,218.75	
		US TREASURY N/B 1.25	5,100,000.00	4,170,445.33	
		US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,083,125.00	
		US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,074,296.89	
		US TREASURY N/B 1.375	500,000.00	514,335.94	
		US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,575,585.95	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,093,515.64			

US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	1,038,906.25	
US TREASURY N/B 1.375	2,600,000.00	2,698,515.63	
US TREASURY N/B 1.375	4,900,000.00	4,139,734.37	
US TREASURY N/B 1.5	3,500,000.00	3,576,015.62	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,083,203.14	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,086,250.00	
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,085,781.26	
US TREASURY N/B 1.5	1,500,000.00	1,567,031.25	
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	1,043,281.25	
US TREASURY N/B 1.5	4,500,000.00	4,617,421.87	
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,045,156.26	
US TREASURY N/B 1.625	3,400,000.00	3,478,093.75	
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,591,601.58	
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,110,000.00	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,097,500.00	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,101,015.64	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,116,250.00	
US TREASURY N/B 1.625	2,400,000.00	2,523,937.51	
US TREASURY N/B 1.625	6,050,000.00	6,361,480.49	
US TREASURY N/B 1.625	3,900,000.00	4,099,265.62	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,153,046.89	
US TREASURY N/B 1.625	4,450,000.00	4,626,609.37	
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	900,546.87	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,050,625.00	
US TREASURY N/B 1.75	1,800,000.00	1,832,765.63	
US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,447,062.51	
US TREASURY N/B 1.75	1,600,000.00	1,632,750.00	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,062,578.14	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,067,031.25	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,078,984.39	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,094,921.89	
US TREASURY N/B 1.75	2,700,000.00	2,796,609.37	
US TREASURY N/B 1.75	11,800,000.00	12,377,093.75	
US TREASURY N/B 1.75	850,000.00	892,632.81	
US TREASURY N/B 1.75	2,400,000.00	2,539,500.00	

US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	4,198,125.00	
US TREASURY N/B 1.875	2,400,000.00	2,440,312.51	
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	2,039,218.76	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,063,281.25	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,067,734.39	
US TREASURY N/B 1.875	1,700,000.00	1,743,296.87	
US TREASURY N/B 1.875	4,800,000.00	4,928,625.02	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,089,062.50	
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,899,000.00	
US TREASURY N/B 1.875	1,400,000.00	1,491,109.38	
US TREASURY N/B 1.875	3,200,000.00	3,408,250.01	
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,158,851.57	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,081,796.89	
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,611,289.08	
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,167,187.50	
US TREASURY N/B 2	3,800,000.00	3,941,015.64	
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,110,937.50	
US TREASURY N/B 2	3,300,000.00	3,485,625.00	
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,643,554.70	
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,724,218.75	
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,591,929.70	
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,360,546.90	
US TREASURY N/B 2	2,800,000.00	2,762,812.50	
US TREASURY N/B 2.125	2,500,000.00	2,562,304.70	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,082,265.64	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,149,062.52	
US TREASURY N/B 2.125	3,100,000.00	3,266,140.62	
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,114,062.50	
US TREASURY N/B 2.125	6,500,000.00	6,878,828.12	
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,718,750.00	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,258,125.00	
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,918,687.50	
US TREASURY N/B 2.125	4,900,000.00	5,249,125.00	
US TREASURY N/B 2.125	900,000.00	970,171.87	
US TREASURY N/B 2.25	4,300,000.00	4,406,156.25	

US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,175,546.89	
US TREASURY N/B 2.25	2,200,000.00	2,331,656.25	
US TREASURY N/B 2.25	3,800,000.00	4,041,062.50	
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,605,351.57	
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,745,429.71	
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	3,324,265.62	
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,323,125.00	
US TREASURY N/B 2.25	2,700,000.00	2,924,859.37	
US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,783,281.27	
US TREASURY N/B 2.25	4,200,000.00	4,571,437.50	
US TREASURY N/B 2.25	4,400,000.00	4,790,843.77	
US TREASURY N/B 2.25	2,850,000.00	2,976,914.06	
US TREASURY N/B 2.25	3,500,000.00	3,652,304.70	
US TREASURY N/B 2.375	3,600,000.00	3,687,187.50	
US TREASURY N/B 2.375	1,200,000.00	1,252,500.00	
US TREASURY N/B 2.375	3,700,000.00	3,939,343.75	
US TREASURY N/B 2.375	5,600,000.00	6,003,812.52	
US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,369,328.12	
US TREASURY N/B 2.375	4,900,000.00	5,389,234.37	
US TREASURY N/B 2.375	1,900,000.00	2,034,929.69	
US TREASURY N/B 2.5	3,500,000.00	3,583,125.00	
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,290,234.40	
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	6,112,359.37	
US TREASURY N/B 2.5	3,400,000.00	3,683,687.50	
US TREASURY N/B 2.5	1,400,000.00	1,533,218.75	
US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	4,493,664.08	
US TREASURY N/B 2.5	2,900,000.00	3,179,125.00	
US TREASURY N/B 2.5	4,100,000.00	4,493,343.75	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,201,875.00	
US TREASURY N/B 2.625	2,300,000.00	2,507,898.44	
US TREASURY N/B 2.625	4,400,000.00	4,838,968.77	
US TREASURY N/B 2.625	2,700,000.00	2,971,687.50	
US TREASURY N/B 2.625	4,700,000.00	5,257,757.83	
US TREASURY N/B 2.75	2,900,000.00	3,065,617.20	
US TREASURY N/B 2.75	1,000,000.00	1,059,296.88	

US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,126,406.26	
US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	4,047,000.00	
US TREASURY N/B 2.75	4,200,000.00	4,493,671.89	
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,485,289.08	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,188,281.26	
US TREASURY N/B 2.75	4,600,000.00	5,057,125.00	
US TREASURY N/B 2.75	2,100,000.00	2,312,789.07	
US TREASURY N/B 2.75	4,800,000.00	5,391,000.00	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,292,500.00	
US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	343,710.93	
US TREASURY N/B 2.75	3,800,000.00	4,367,328.14	
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,724,296.87	
US TREASURY N/B 2.875	1,000,000.00	1,072,343.75	
US TREASURY N/B 2.875	2,000,000.00	2,148,906.26	
US TREASURY N/B 2.875	2,200,000.00	2,423,609.38	
US TREASURY N/B 2.875	1,100,000.00	1,213,695.31	
US TREASURY N/B 2.875	2,500,000.00	2,776,171.87	
US TREASURY N/B 2.875	5,000,000.00	5,666,015.65	
US TREASURY N/B 2.875	5,500,000.00	6,242,070.34	
US TREASURY N/B 2.875	2,400,000.00	2,807,062.51	
US TREASURY N/B 2.875	3,700,000.00	4,331,312.50	
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	4,224,937.50	
US TREASURY N/B 2.875	1,400,000.00	1,652,984.38	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,456,562.52	
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,457,226.57	
US TREASURY N/B 3	800,000.00	953,750.00	
US TREASURY N/B 3	3,500,000.00	4,176,210.95	
US TREASURY N/B 3	3,000,000.00	3,585,234.39	
US TREASURY N/B 3	2,700,000.00	3,232,406.25	
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	3,003,710.95	
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,644,640.63	
US TREASURY N/B 3	3,100,000.00	3,731,867.20	
US TREASURY N/B 3	5,400,000.00	6,513,750.00	
US TREASURY N/B 3	3,800,000.00	4,587,312.50	
US TREASURY N/B 3.125	4,200,000.00	4,851,656.25	

	US TREASURY N/B 3.125	1,100,000.00	1,335,640.62	
	US TREASURY N/B 3.125	1,000,000.00	1,215,781.25	
	US TREASURY N/B 3.125	2,300,000.00	2,794,679.69	
	US TREASURY N/B 3.125	3,300,000.00	4,016,718.75	
	US TREASURY N/B 3.125	2,400,000.00	2,956,125.00	
	US TREASURY N/B 3.375	3,000,000.00	3,792,187.50	
	US TREASURY N/B 3.375	3,100,000.00	3,997,062.50	
	US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	1,018,187.50	
	US TREASURY N/B 3.625	2,400,000.00	3,143,437.51	
	US TREASURY N/B 3.625	3,600,000.00	4,722,750.00	
	US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	1,984,921.87	
	US TREASURY N/B 3.75	700,000.00	933,460.94	
	US TREASURY N/B 3.875	500,000.00	669,335.94	
	US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,392,656.25	
	US TREASURY N/B 4.25	600,000.00	842,156.25	
	US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	700,390.62	
	US TREASURY N/B 4.375	700,000.00	991,921.87	
	US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,989,859.38	
	US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	429,187.50	
	US TREASURY N/B 4.5	750,000.00	1,044,667.97	
	US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	284,359.37	
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,434,531.25	
	US TREASURY N/B 4.625	600,000.00	876,750.00	
	US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	2,239,570.32	
	US TREASURY N/B 5	500,000.00	741,093.75	
	US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	658,046.87	
	US TREASURY N/B 5.375	320,000.00	444,950.00	
	US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	663,750.00	
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,269,062.50	
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,345,078.13	
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	921,562.50	
	米ドル 小計	615,670,000.00	657,197,177.72	(69,492,029,572)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	2,007,100.00	
	CANADA-GOV'T 0.5	600,000.00	597,840.00	

	CANADA-GOV'T 1	3,000,000.00	3,038,070.00	
	CANADA-GOV'T 1	1,300,000.00	1,321,203.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	3,400,000.00	3,460,078.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,057,400.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,038,540.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,900,000.00	3,031,805.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	1,100,000.00	1,134,166.00	
	CANADA-GOV'T 2	1,200,000.00	1,252,416.00	
	CANADA-GOV'T 2	1,900,000.00	2,056,351.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,058,480.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	1,400,000.00	1,504,454.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,215,291.00	
	CANADA-GOV'T 2.5	2,100,000.00	2,249,037.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	1,800,000.00	1,859,400.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	1,100,000.00	1,363,560.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	662,450.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	1,300,000.00	1,792,453.00	
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	2,141,385.00	
	CANADA-GOV'T 5	1,450,000.00	2,207,378.50	
	CANADA-GOV'T 5.75	250,000.00	345,412.50	
	CANADA-GOV'T 5.75	500,000.00	754,910.00	
	カナダドル 小計	34,400,000.00	38,149,180.00	(3,177,445,202)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	32,000,000.00	38,195,840.00	
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	20,858,000.00	
	MEXICAN BONOS 6.5	28,000,000.00	28,880,194.00	
	MEXICAN BONOS 7.5	25,000,000.00	28,354,130.00	
	MEXICAN BONOS 7.75	6,000,000.00	6,954,042.00	
	MEXICAN BONOS 7.75	18,000,000.00	20,835,333.00	
	MEXICAN BONOS 8	27,000,000.00	29,647,350.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	23,000,000.00	27,790,996.60	
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	48,358,192.00	
	メキシコペソ 小計	219,000,000.00	249,874,077.60	(1,309,340,166)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	500,000.00	727,540.00	
	BELGIAN 0.1	1,300,000.00	1,333,904.00	

BELGIAN 0.4	300,000.00	300,903.00	
BELGIAN 0.8	800,000.00	848,376.00	
BELGIAN 0.8	1,000,000.00	1,078,570.00	
BELGIAN 0.8	1,000,000.00	1,085,620.00	
BELGIAN 0291 5.5	1,100,000.00	1,567,225.00	
BELGIAN 0304 5	1,400,000.00	2,364,124.00	
BELGIAN 0308 4	700,000.00	736,295.00	
BELGIAN 0320 4.25	1,200,000.00	2,091,480.00	
BELGIAN 0324 4.5	700,000.00	882,217.00	
BELGIAN 0325 4.25	1,700,000.00	1,836,085.00	
BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,603,545.00	
BELGIAN 0332 2.6	2,300,000.00	2,551,183.00	
BELGIAN 0333 3	700,000.00	971,684.00	
BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,041,310.00	
BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	741,735.00	
BELGIAN 0344 1.45	400,000.00	476,848.00	
BELGIAN 0347 0.9	1,300,000.00	1,427,426.00	
BELGIAN 0348 1.7	500,000.00	640,700.00	
BELGIAN 1	1,400,000.00	1,514,100.00	
BELGIAN 1	1,000,000.00	1,114,620.00	
BELGIAN 1.25	400,000.00	460,668.00	
BELGIAN 1.6	850,000.00	1,056,720.00	
BELGIAN 1.9	1,000,000.00	1,272,820.00	
BELGIAN 2.15	500,000.00	751,760.00	
BELGIAN 3.75	800,000.00	1,387,424.00	
BTPS 0.35	2,700,000.00	2,752,353.00	
BTPS 0.5	1,000,000.00	1,024,650.00	
BTPS 0.65	2,000,000.00	2,050,580.00	
BTPS 0.85	1,700,000.00	1,772,505.00	
BTPS 0.9	2,250,000.00	2,291,715.00	
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,052,300.00	
BTPS 0.95	2,000,000.00	2,053,340.00	
BTPS 0.95	800,000.00	838,576.00	
BTPS 0.95	1,800,000.00	1,873,170.00	
BTPS 1	1,000,000.00	1,019,740.00	

BTPS 1.2	1,000,000.00	1,017,860.00	
BTPS 1.25	1,600,000.00	1,706,896.00	
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,040,240.00	
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,057,700.00	
BTPS 1.45	1,800,000.00	1,908,666.00	
BTPS 1.45	1,000,000.00	1,065,250.00	
BTPS 1.45	600,000.00	642,252.00	
BTPS 1.5	2,700,000.00	2,884,275.00	
BTPS 1.6	1,200,000.00	1,299,480.00	
BTPS 1.65	1,200,000.00	1,325,220.00	
BTPS 1.65	1,800,000.00	1,989,252.00	
BTPS 1.7	500,000.00	524,155.00	
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,067,080.00	
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,083,970.00	
BTPS 2	1,300,000.00	1,426,932.00	
BTPS 2	1,600,000.00	1,793,088.00	
BTPS 2.05	1,500,000.00	1,679,025.00	
BTPS 2.1	1,000,000.00	1,110,480.00	
BTPS 2.2	2,300,000.00	2,593,388.00	
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,422,648.00	
BTPS 2.45	1,100,000.00	1,317,767.00	
BTPS 2.45	900,000.00	1,108,269.00	
BTPS 2.5	600,000.00	660,240.00	
BTPS 2.5	2,100,000.00	2,353,260.00	
BTPS 2.7	1,550,000.00	1,988,991.00	
BTPS 2.8	300,000.00	356,571.00	
BTPS 2.8	900,000.00	1,185,156.00	
BTPS 2.95	1,300,000.00	1,686,815.00	
BTPS 3	3,500,000.00	4,251,940.00	
BTPS 3.1	900,000.00	1,194,192.00	
BTPS 3.25	1,500,000.00	2,101,710.00	
BTPS 3.35	850,000.00	1,124,813.50	
BTPS 3.45	1,400,000.00	2,038,162.00	
BTPS 3.5	4,900,000.00	6,212,024.00	
BTPS 3.75	1,500,000.00	1,708,140.00	

BTPS 3.85	900,000.00	1,403,739.00	
BTPS 4	2,600,000.00	3,739,866.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,545,203.00	
BTPS 4.5	1,000,000.00	1,143,860.00	
BTPS 4.5	1,800,000.00	2,207,196.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,813,300.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,657,300.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	2,706,784.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,111,700.00	
BTPS 5	1,000,000.00	1,207,000.00	
BTPS 5	2,070,000.00	3,164,346.90	
BTPS 5	1,800,000.00	2,966,490.00	
BTPS 5	1,700,000.00	2,828,290.00	
BTPS 5.5	1,200,000.00	1,307,916.00	
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,198,800.00	
BTPS 5.75	1,700,000.00	2,675,358.00	
BTPS 6	2,200,000.00	3,375,834.00	
BTPS 6.5	1,700,000.00	2,407,370.00	
BTPS 7.25	400,000.00	563,268.00	
BTPS 9	300,000.00	375,591.00	
BUNDESOBL-120 0	3,500,000.00	3,601,920.00	
BUNDESOBL-176 0	2,000,000.00	2,022,860.00	
BUNDESOBL-177 0	1,900,000.00	1,929,526.00	
BUNDESOBL-178 0	1,600,000.00	1,631,280.00	
BUNDESOBL-179 0	1,300,000.00	1,329,744.00	
BUNDESOBL-182 0	1,800,000.00	1,857,330.00	
BUNDESSCHATZANW 0	2,100,000.00	2,114,973.00	
DEUTSCHLAND REP 0	2,400,000.00	2,487,456.00	
DEUTSCHLAND REP 0	3,500,000.00	3,643,710.00	
DEUTSCHLAND REP 0	1,300,000.00	1,352,520.00	
DEUTSCHLAND REP 0	300,000.00	307,401.00	
DEUTSCHLAND REP 0	2,300,000.00	2,211,082.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	3,800,000.00	4,003,908.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	2,900,000.00	3,075,160.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	1,900,000.00	2,017,477.00	

DEUTSCHLAND REP 0.5	2,500,000.00	2,622,275.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,900,000.00	2,013,107.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	3,400,000.00	3,648,336.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	4,100,000.00	4,414,265.00	
DEUTSCHLAND REP 1	1,300,000.00	1,379,235.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,050,000.00	2,208,014.00	
DEUTSCHLAND REP 1.25	1,650,000.00	2,164,189.50	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,100,000.00	2,193,576.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,300,000.00	1,365,234.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,145,760.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,273,964.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,200,000.00	2,365,418.00	
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,137,160.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,489,420.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,600,000.00	4,217,590.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,200,000.00	2,052,528.00	
DEUTSCHLAND REP 4	1,800,000.00	3,012,858.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	950,000.00	1,721,998.50	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,600,000.00	2,243,648.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,000,000.00	3,374,720.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,650,000.00	3,217,351.50	
DEUTSCHLAND REP 5.5	900,000.00	1,440,225.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,000,000.00	1,438,500.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,444,236.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	500,000.00	807,365.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,464,560.00	
FINNISH GOV'T 0	400,000.00	403,088.00	
FINNISH GOV'T 0.25	300,000.00	301,215.00	
FINNISH GOV'T 0.5	400,000.00	426,540.00	
FINNISH GOV'T 0.5	800,000.00	854,272.00	
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	547,945.00	
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	229,572.00	
FINNISH GOV'T 1.375	300,000.00	381,042.00	
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,047,460.00	
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,036,620.00	

FINNISH GOV'T 2	600,000.00	651,138.00	
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	750,860.00	
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	741,876.00	
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,205,500.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,013,120.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,200,000.00	2,218,304.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,027,520.00	
FRANCE O.A.T. 0	4,000,000.00	4,077,360.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,200,000.00	1,227,888.00	
FRANCE O.A.T. 0	4,500,000.00	4,585,905.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,900,000.00	1,924,092.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	4,100,000.00	4,270,314.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	900,000.00	773,451.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,900,000.00	3,032,617.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	4,500,000.00	4,740,345.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,800,000.00	2,977,968.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	2,500,000.00	2,701,775.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	3,200,000.00	3,466,112.00	
FRANCE O.A.T. 0.75	1,000,000.00	1,024,430.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,050,000.00	2,201,823.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,500,000.00	2,726,675.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,700,000.00	3,113,640.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,400,000.00	2,784,216.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	3,850,000.00	4,488,907.50	
FRANCE O.A.T. 1.5	2,400,000.00	2,969,472.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,200,000.00	4,431,588.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	2,600,000.00	2,832,206.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	2,400,000.00	3,025,848.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	800,000.00	1,094,408.00	
FRANCE O.A.T. 2	2,200,000.00	2,997,918.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	1,900,000.00	1,993,746.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,400,000.00	3,722,014.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	4,381,720.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	3,850,000.00	4,673,900.00	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,216,850.00	

FRANCE O.A.T. 3.25	2,200,000.00	3,602,588.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	2,500,000.00	3,028,425.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,000,000.00	3,301,600.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,762,742.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,400,000.00	2,962,414.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	4,533,000.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	2,600,000.00	4,707,586.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	2,200,000.00	3,648,832.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	2,750,000.00	4,077,617.50	
FRANCE O.A.T. 5.75	2,100,000.00	3,533,334.00	
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	3,937,950.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	720,948.00	
IRISH GOVT 0	400,000.00	404,096.00	
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	710,402.00	
IRISH GOVT 0.9	700,000.00	762,363.00	
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,077,440.00	
IRISH GOVT 1.1	1,600,000.00	1,776,416.00	
IRISH GOVT 1.3	600,000.00	692,634.00	
IRISH GOVT 1.35	500,000.00	573,655.00	
IRISH GOVT 1.5	400,000.00	495,340.00	
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	369,900.00	
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,350,090.00	
IRISH GOVT 2.4	600,000.00	743,232.00	
IRISH GOVT 3.4	500,000.00	561,850.00	
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	547,340.00	
IRISH GOVT 5.4	800,000.00	995,312.00	
NETHERLANDS GOVT 0	1,000,000.00	1,020,090.00	
NETHERLANDS GOVT 0	1,900,000.00	1,955,043.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,000,000.00	1,038,740.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	500,000.00	526,510.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,700,000.00	1,799,943.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	800,000.00	868,888.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,300,000.00	1,406,301.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,000,000.00	1,089,740.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,694,944.00	

NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,092,090.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,561,845.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,000,000.00	1,325,800.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,200,000.00	2,001,180.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	700,000.00	759,794.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,300,000.00	2,299,817.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,600,000.00	2,642,768.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	995,036.00	
REP OF AUSTRIA 0	1,100,000.00	1,116,874.00	
REP OF AUSTRIA 0	500,000.00	510,425.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	800,000.00	849,944.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	850,000.00	906,346.50	
REP OF AUSTRIA 0.75	900,000.00	965,448.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	700,000.00	757,785.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	800,000.00	874,928.00	
REP OF AUSTRIA 0.85	150,000.00	156,784.50	
REP OF AUSTRIA 1.2	1,000,000.00	1,084,350.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	290,086.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	700,000.00	900,725.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	1,100,000.00	1,192,895.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,064,100.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	900,000.00	1,189,791.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	600,000.00	992,496.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	1,100,000.00	1,178,573.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,050,260.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	700,000.00	1,553,699.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,000,000.00	1,653,350.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	500,000.00	639,835.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,437,730.00	
SPANISH GOV'T 0	1,000,000.00	1,013,900.00	
SPANISH GOV'T 0.25	1,000,000.00	1,022,730.00	
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,022,680.00	
SPANISH GOV'T 0.45	500,000.00	508,225.00	
SPANISH GOV'T 0.5	1,000,000.00	1,029,950.00	
SPANISH GOV'T 0.8	400,000.00	423,416.00	

SPANISH GOV'T 1	300,000.00	290,859.00	
SPANISH GOV'T 1.2	500,000.00	532,050.00	
SPANISH GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,196,160.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,700,000.00	2,933,766.00	
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,207,240.00	
SPANISH GOV'T 1.4	1,600,000.00	1,768,928.00	
SPANISH GOV'T 1.45	2,600,000.00	2,867,202.00	
SPANISH GOV'T 1.45	2,900,000.00	3,228,251.00	
SPANISH GOV'T 1.5	1,200,000.00	1,323,744.00	
SPANISH GOV'T 1.6	1,700,000.00	1,840,046.00	
SPANISH GOV'T 1.85	2,400,000.00	2,825,424.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,600,000.00	2,900,014.00	
SPANISH GOV'T 1.95	1,700,000.00	1,980,976.00	
SPANISH GOV'T 2.15	2,400,000.00	2,679,312.00	
SPANISH GOV'T 2.35	1,300,000.00	1,601,665.00	
SPANISH GOV'T 2.7	1,550,000.00	2,158,824.50	
SPANISH GOV'T 2.75	2,100,000.00	2,345,196.00	
SPANISH GOV'T 2.9	1,400,000.00	1,998,640.00	
SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,837,473.00	
SPANISH GOV'T 3.8	1,400,000.00	1,591,184.00	
SPANISH GOV'T 4.2	1,650,000.00	2,550,322.50	
SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,265,180.00	
SPANISH GOV'T 4.65	1,800,000.00	2,201,544.00	
SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,589,480.00	
SPANISH GOV'T 4.8	1,500,000.00	1,734,600.00	
SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,618,025.00	
SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,092,170.00	
SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	2,272,908.00	
SPANISH GOV'T 5.4	2,250,000.00	2,509,402.50	
SPANISH GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,411,805.00	
SPANISH GOV'T 5.85	2,200,000.00	2,333,518.00	
SPANISH GOV'T 5.9	500,000.00	667,825.00	
SPANISH GOV'T 6	2,200,000.00	3,241,942.00	
ユーロ 小計	435,790,000.00	523,592,709.40	(66,710,947,104)

英bond	UK TSY GILT 0.125	700,000.00	701,561.00	
	UK TSY GILT 0.125	1,500,000.00	1,496,250.00	
	UK TSY GILT 0.375	1,000,000.00	979,670.00	
	UK TSY GILT 0.5	1,800,000.00	1,814,292.00	
	UK TSY GILT 0.625	2,000,000.00	2,044,700.00	
	UK TSY GILT 0.625	500,000.00	479,645.00	
	UK TSY GILT 0.75	2,650,000.00	2,698,786.50	
	UK TSY GILT 0.875	1,000,000.00	1,031,350.00	
	UK TSY GILT 1	1,600,000.00	1,649,472.00	
	UK TSY GILT 1.25	1,000,000.00	1,061,400.00	
	UK TSY GILT 1.25	400,000.00	411,572.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,000,000.00	1,070,870.00	
	UK TSY GILT 1.5	1,700,000.00	1,838,431.00	
	UK TSY GILT 1.625	550,000.00	688,160.00	
	UK TSY GILT 1.625	2,000,000.00	2,187,360.00	
	UK TSY GILT 1.625	500,000.00	568,200.00	
	UK TSY GILT 1.75	1,200,000.00	1,233,492.00	
	UK TSY GILT 1.75	2,400,000.00	2,679,600.00	
	UK TSY GILT 1.75	750,000.00	859,327.50	
	UK TSY GILT 2	1,100,000.00	1,193,907.00	
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,854,953.00	
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,405,040.00	
	UK TSY GILT 2.75	1,300,000.00	1,424,826.00	
	UK TSY GILT 3.25	1,600,000.00	2,290,704.00	
	UK TSY GILT 3.5	1,650,000.00	2,471,502.00	
	UK TSY GILT 3.5	1,450,000.00	2,767,049.50	
	UK TSY GILT 3.75	1,600,000.00	2,707,200.00	
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,563,780.00	
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	3,268,471.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,100,000.00	1,393,084.00	
	UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,247,841.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,050,000.00	1,545,148.50	
	UK TSY GILT 4.25	1,450,000.00	2,245,934.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,300,000.00	2,045,238.00	
UK TSY GILT 4.25	1,500,000.00	2,544,930.00		

	UK TSY GILT 4.25	900,000.00	1,588,221.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	3,232,431.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,100,000.00	1,620,432.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,350,000.00	2,245,482.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,150,000.00	1,607,343.50	
	UK TSY GILT 4.75	1,200,000.00	1,942,368.00	
	UK TSY GILT 5	1,300,000.00	1,557,946.00	
	UK TSY GILT 6	650,000.00	928,050.50	
	英bond 小計	57,100,000.00	74,186,021.00 (10,882,347,420)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	4,000,000.00	4,197,280.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	4,000,000.00	4,197,320.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1	6,400,000.00	6,789,568.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,344,400.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,571,850.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	8,000,000.00	8,393,040.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	4,600,000.00	6,853,264.00	
	スウェーデンクローナ 小計	39,000,000.00	43,346,722.00 (551,370,303)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.375	2,000,000.00	2,020,260.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.5	3,500,000.00	3,609,970.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	3,000,000.00	3,122,730.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	2,700,000.00	2,821,473.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	6,000,000.00	6,209,220.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	9,000,000.00	9,563,760.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,294,520.00	
	ノルウェークローネ 小計	30,200,000.00	31,641,933.00 (394,258,485)	
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	1,300,000.00	1,284,140.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	11,100,000.00	11,739,360.00	
	DENMARK - BULLET 0.5	4,000,000.00	4,258,000.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,277,000.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	6,000,000.00	6,633,000.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	10,500,000.00	19,080,600.00	
	デンマーククローネ 小計	37,900,000.00	48,272,100.00 (826,901,073)	

ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND	6,000,000.00	5,998,714.47	
	POLAND GOVT BOND 2.25	3,000,000.00	3,079,950.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	1,000,000.00	1,070,310.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	3,289,830.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	3,000,000.00	3,308,220.00	
	POLAND GOVT BOND 2.75	4,500,000.00	5,082,570.00	
	POLAND GOVT BOND 3.25	6,900,000.00	7,732,209.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,400,000.00	2,619,864.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,700,000.00	3,701,781.00	
ポーランドズロチ 小計		32,500,000.00	35,883,448.47	(1,017,295,764)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 0.25	900,000.00	891,727.20	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.5	3,300,000.00	3,333,660.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	600,000.00	516,993.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	1,500,000.00	1,556,640.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	3,000,000.00	3,273,000.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.5	1,350,000.00	1,495,665.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,708,705.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,600,000.00	4,048,740.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,800,000.00	2,029,681.80	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	4,300,000.00	4,854,700.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	900,240.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,400,000.00	1,588,622.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,900,000.00	2,129,710.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,100,000.00	2,450,700.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,550,000.00	3,018,180.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,511,568.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,650,000.00	3,154,030.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,400,000.00	1,862,700.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	6,100,000.00	7,581,080.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,000,000.00	2,232,600.00	
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,500,000.00	2,698,500.00		
オーストラリアドル 小計		47,450,000.00	53,837,442.00	(4,416,285,367)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,105,285.00	

	SINGAPORE GOV'T 2.625	400,000.00	445,800.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,200,000.00	1,266,960.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	476,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	700,000.00	849,100.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	461,528.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	700,000.00	760,900.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	800,000.00	834,356.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	650,000.00	795,275.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,732,500.00	
	シンガポールドル 小計	7,750,000.00	8,727,704.00	(695,336,177)
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	7,000,000.00	7,165,652.20	
	MALAYSIA GOVT 3.502	7,900,000.00	8,319,424.43	
	MALAYSIA GOVT 3.955	5,300,000.00	5,687,851.35	
	MALAYSIA GOVT 4.498	5,000,000.00	5,603,835.00	
	MALAYSIA GOVT 4.736	4,500,000.00	4,960,516.95	
	マレーシアリングgit 小計	29,700,000.00	31,737,279.93	(831,834,106)
イスラエルシュケル	ISRAEL FIXED 0.75	6,200,000.00	6,253,940.00	
	ISRAEL FIXED 1.5	2,900,000.00	3,004,951.00	
	ISRAEL FIXED 2.25	1,500,000.00	1,662,600.00	
	ISRAEL FIXED 3.75	3,700,000.00	4,931,656.00	
	ISRAEL FIXED 6.25	5,000,000.00	6,616,950.00	
	イスラエルシュケル 小計	19,300,000.00	22,470,097.00	(727,806,441)
	合計		161,033,197,180	(161,033,197,180)

(注) 金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 205銘柄	42.6%	43.2%
カナダドル	国債証券 23銘柄	1.9%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 9銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 280銘柄	40.9%	41.4%
英ポンド	国債証券 43銘柄	6.7%	6.8%

スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券	7銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	6銘柄	0.5%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券	9銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	21銘柄	2.7%	2.7%
シンガポールドル	国債証券	10銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	5銘柄	0.5%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	5銘柄	0.4%	0.5%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【中間財務諸表】

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)ならびに同規則第38条の3、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7期中間計算期間(2021年 2月19日から2021年 8月18日まで)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。

【三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 (2021年 2月18日現在)	第7期中間計算期間 (2021年 8月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	12,189,337
コール・ローン	11,758,631	426,697
親投資信託受益証券	218,497,140	227,633,879
未収入金	160,000	390,000
流動資産合計	230,415,771	240,639,913
資産合計	230,415,771	240,639,913
負債の部		
流動負債		
未払解約金	268,484	414,640
未払受託者報酬	38,715	38,557
未払委託者報酬	245,150	244,173
未払利息	34	1
その他未払費用	6,381	6,480
流動負債合計	558,764	703,851
負債合計	558,764	703,851
純資産の部		
元本等		
元本	221,020,587	228,132,698
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	8,836,420	11,803,364
元本等合計	229,857,007	239,936,062
純資産合計	229,857,007	239,936,062
負債純資産合計	230,415,771	240,639,913

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第6期中間計算期間 自 2020年 2月19日 至 2020年 8月18日	第7期中間計算期間 自 2021年 2月19日 至 2021年 8月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	727,064	2,926,739
営業収益合計	727,064	2,926,739
営業費用		
支払利息	2,588	5,089
受託者報酬	35,112	38,557
委託者報酬	222,333	244,173
その他費用	8,344	6,981
営業費用合計	268,377	294,800
営業利益又は営業損失()	995,441	2,631,939
経常利益又は経常損失()	995,441	2,631,939
中間純利益又は中間純損失()	995,441	2,631,939
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()	259,489	145,939
期首剰余金又は期首欠損金()	9,596,664	8,836,420
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,834,610	1,395,748
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,834,610	1,395,748
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,070,265	914,804
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,070,265	914,804
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	9,625,057	11,803,364

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第7期中間計算期間 自 2021年 2月19日 至 2021年 8月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第6期 (2021年 2月18日現在)	第7期中間計算期間 (2021年 8月18日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	221,020,587口	228,132,698口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0400円 (10,000口当たりの純資産額 10,400円)	1口当たり純資産額 1.0517円 (10,000口当たりの純資産額 10,517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

項目	第7期中間計算期間 (2021年 8月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 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、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第6期 (2021年 2月18日現在)	第7期中間計算期間 (2021年 8月18日現在)
期首元本額	198,282,133円	221,020,587円
期中追加設定元本額	129,604,307円	29,838,942円
期中一部解約元本額	106,865,853円	22,726,831円

(参考)

三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)は、「国内債券パッシブ・マザーファンド」および「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要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た「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	(2021年 2月18日現在)	(2021年 8月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	393,938,089
コール・ローン	2,728,345,705	13,790,101

国債証券	102,126,845,070	112,111,965,850
地方債証券	8,642,456,560	8,543,712,170
特殊債券	12,556,759,175	11,497,661,635
社債券	4,039,898,000	4,658,826,000
未収入金	507,203,000	66,473,600
未収利息	376,676,876	368,345,696
前払費用	4,039,280	7,883,392
流動資産合計	130,982,223,666	137,662,596,533
資産合計	130,982,223,666	137,662,596,533
負債の部		
流動負債		
未払金	1,104,493,400	-
未払解約金	2,317,953,000	2,649,769
未払利息	7,914	40
その他未払費用	-	3,929
流動負債合計	3,422,454,314	2,653,738
負債合計	3,422,454,314	2,653,738
純資産の部		
元本等		
元本	100,129,074,120	107,089,273,564
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	27,430,695,232	30,570,669,231
元本等合計	127,559,769,352	137,659,942,795
純資産合計	127,559,769,352	137,659,942,795
負債純資産合計	130,982,223,666	137,662,596,533

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年 2月19日 至 2021年 8月18日
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、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年 2月18日現在)	(2021年 8月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	100,129,074,120口	107,089,273,564口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2740円 (10,000口当たりの純資産額 12,740円)	1口当たり純資産額 1.2855円 (10,000口当たりの純資産額 12,855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

項目	(2021年 8月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 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、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2021年 2月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	107,405,246,912円
同期中における追加設定元本額	31,312,880,290円
同期中における一部解約元本額	38,589,053,082円
2021年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	5,849,125,873円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	10,277,305,275円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,281,609,671円
S M A M ・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	557,497,100円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	42,772,936円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	195,547,502円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	416,828,870円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	506,152,768円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	222,180,703円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	359,091,057円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	135,162,809円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,290,177,379円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	405,171,755円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,590,257円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	30,166,475円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,117,329,028円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	356,713,253円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	509,322,266円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	104,902,299円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	29,345,283円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	84,760,569円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	55,942,355円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	92,132,794円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	25,221,489円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	4,051,909円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,635,333,683円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	14,645,125,243円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	6,716,300,176円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	16,758,553,795円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	324,470,878円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	584,749,121円
世界6資産バランスファンドV A<適格機関投資家限定>	1,828,677円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	269,243,070円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	120,304,219円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,906,397,650円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	2,164,794,277円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	2,519,848,740円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	9,294,363,282円
S M A M・バランスV A 株4 0 T<適格機関投資家限定>	1,106,276円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	1,295,938,945円
S M A M・グローバルバランス4 0 V A<適格機関投資家限定>	467,586,621円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用>	599,719,035円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用>	177,900,320円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	46,646,093円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用>	1,629,572,303円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L<適格機関投資家専用>	2,241,285,586円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2<適格機関投資家専用>	821,846,833円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2<適格機関投資家専用>	212,410,596円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2<適格機関投資家専用>	18,427,405円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 0 L 2<適格機関投資家専用>	302,971,200円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2<適格機関投資家専用>	5,582,241,420円
S M A M・年金Wリスクリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	288,586,835円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	885,855,263円

S M A M ・ マルチアセットストラテジー ・ オープン < 適格機関投資家限定 >	742,864,411円
S M A M ・ マルチアセット ・ ダイナミックアロケーション ・ ストラテジー ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	2,910,700,492円
合計	100,129,074,120円

(2021年 8月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	100,129,074,120円
同期中における追加設定元本額	11,360,927,674円
同期中における一部解約元本額	4,400,728,230円
2021年 8月18日現在における元本の内訳	
三井住友 ・ D C 年金バランス30（債券重点型）	6,326,691,281円
三井住友 ・ D C 年金バランス50（標準型）	11,144,522,376円
三井住友 ・ D C 年金バランス70（株式重点型）	2,512,683,615円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	775,929,485円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	44,429,024円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	194,481,599円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	463,327,239円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	660,206,635円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	308,731,527円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	449,650,297円
三井住友 ・ D C 年金バランスゼロ（債券型）	140,080,377円
アセットアロケーション ・ ファンド（安定型）	2,523,302,649円
アセットアロケーション ・ ファンド（安定成長型）	1,185,930,120円
アセットアロケーション ・ ファンド（成長型）	494,355,889円
三井住友 D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2050	38,446,648円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド（1安定重視型）	1,559,369,474円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド（2やや安定型）	516,629,365円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド（3バランス型）	788,501,318円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド（4やや成長型）	170,880,621円
三井住友 ・ 資産最適化ファンド（5成長重視型）	62,706,222円
三井住友 ・ D C つみたて N I S A ・ 世界分散ファンド	116,394,162円
三井住友 D S ・ 年金バランス30（債券重点型）	99,108,919円
三井住友 D S ・ 年金バランス50（標準型）	168,967,397円
三井住友 D S ・ 年金バランス70（株式重点型）	48,014,479円
三井住友 D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2060	5,304,089円
S M A M ・ 年金グローバル債券ファンド < 適格機関投資家限定 >	1,580,848,669円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	13,871,460,687円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	6,700,717,653円
S M A M ・ バランスファンド V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	16,729,619,718円
S M A M ・ バランスファンド V L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	331,211,562円
S M A M ・ バランスファンド V L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	596,752,040円
S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	273,591,100円
S M A M ・ バランスファンド V L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	120,352,684円
S M A M ・ インデックス ・ バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,879,386,729円

S M A M ・ インデックス ・ バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	2,201,700,349円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	2,480,236,085円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	9,052,860,821円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	964,528円
三井住友 ・ 国内債券インデックスファンド ・ V A S （ 適格機関投資家専用 ）	1,247,188,746円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	470,885,039円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	581,423,021円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	178,863,776円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	43,132,304円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	1,561,837,873円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	2,238,994,848円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	756,092,513円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	210,029,376円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	19,071,373円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	290,229,645円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	5,474,169,897円
S M A M ・ 年金 W リスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	454,657,638円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	835,230,203円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー ・ オープン < 適格機関投資家限定 >	907,198,427円
S M A M ・ マルチアセット ・ ダイナミックアロケーション ・ ストラテジー ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	5,201,921,453円
合計	107,089,273,564円

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	(2021年 2月18日現在)	(2021年 8月18日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	564,581,811	318,304,067
金銭信託	-	487,478,102
コール・ローン	74,747,376	17,064,540
国債証券	161,033,197,180	158,513,945,277
派生商品評価勘定	1,645,127	-
未収入金	1,858,749,942	-
未収利息	966,326,020	815,142,668
前払費用	13,435,006	25,900,452
流動資産合計	164,512,682,462	160,177,835,106
資産合計	164,512,682,462	160,177,835,106
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,061,835	-
未払金	1,323,659,485	-
未払解約金	188,195,974	106,210,438
未払利息	216	50
その他未払費用	-	3,192
流動負債合計	1,516,917,510	106,213,680
負債合計	1,516,917,510	106,213,680
純資産の部		

元本等		
元本	85,310,011,496	81,409,140,906
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	77,685,753,456	78,662,480,520
元本等合計	162,995,764,952	160,071,621,426
純資産合計	162,995,764,952	160,071,621,426
負債純資産合計	164,512,682,462	160,177,835,106

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 2021年 2月19日 至 2021年 8月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</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、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2021年 2月18日現在)	(2021年 8月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	85,310,011,496口	81,409,140,906口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9106円 (10,000口当たりの純資産額 19,106円)	1口当たり純資産額 1.9663円 (10,000口当たりの純資産額 19,663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

項目	(2021年 8月18日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 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、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年 2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,332,734,038	-	1,327,984,352	4,749,686
	米ドル	665,806,534	-	664,418,628	1,387,906
	ユーロ	606,880,090	-	603,683,614	3,196,476
	英ポンド	60,047,414	-	59,882,110	165,304
	売建	525,389,746	-	524,056,768	1,332,978
	米ドル	257,373,062	-	257,682,112	309,050
	ユーロ	267,973,664	-	266,331,761	1,641,903
	英ポンド	43,020	-	42,895	125
合計		1,858,123,784	-	1,852,041,120	3,416,708

(注) 1.時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

1)計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物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で評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。
- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(2021年 8月18日現在)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2021年 2月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	92,850,628,728円
同期中における追加設定元本額	12,353,840,879円
同期中における一部解約元本額	19,894,458,111円
2021年 2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	23,244,502,535円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	710,157,374円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,958,794,306円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,005,548,820円
S M A M ・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	142,748,560円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,951,183円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	31,512,688円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	99,066,057円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	170,376,094円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	108,781,695円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	199,736,211円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	24,233,080円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	87,727,566円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	127,038,109円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	68,476,615円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2050	11,846,262円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	64,816,122円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	39,042,933円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	95,085,277円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	29,864,584円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	19,560,013円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	71,850,656円
三井住友D S ・外国債券インデックス年金ファンド	109,843,469円

三井住友D S ・年金バランス3 0 (債券重点型)	6,805,603円
三井住友D S ・年金バランス5 0 (標準型)	17,506,667円
三井住友D S ・年金バランス7 0 (株式重点型)	11,099,081円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 6 0	1,626,248円
S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,043,593,613円
S M A M ・バランスファンドV A 安定成長型<適格機関投資家限定>	53,057,364円
S M A M ・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	8,531,760,680円
S M A M ・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	4,860,208,256円
S M A M ・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	11,164,801,965円
S M A M ・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	35,450,962円
S M A M ・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	95,266,461円
世界6資産バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	344,673円
S M A M ・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	718,669,331円
S M A M ・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	120,185,798円
S M A M ・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	1,122,042,188円
S M A M ・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	1,453,491,138円
S M A M ・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	1,679,976,562円
S M A M ・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	5,316,768,149円
S M A M ・バランスV A 株4 0 T <適格機関投資家限定>	734,643円
S M A M ・外国債券パッシブファンドV A <適格機関投資家限定>	8,809,268,355円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	352,953,733円
S M A M ・グローバルバランス4 0 V A <適格機関投資家限定>	156,272,027円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	91,137,314円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	35,246,062円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	12,901,519円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	110,101,987円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	452,050,893円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 <適格機関投資家専用>	125,311,405円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用>	41,682,415円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	5,169,886円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用>	1,120,491,404円
S M A M ・グローバルバランスファンド(標準型)V A <適格機関投資家限定>	899,220,307円
S M A M ・グローバルバランスファンド(債券重視型)V A <適格機関投資家限定>	1,115,496,800円
S M A M ・世界バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	4,187,233,763円
S M A M ・世界バランスファンドV A 2 <適格機関投資家限定>	494,516,397円
S M A M ・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	77,084,706円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	57,990,730円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 <適格機関投資家限定>	188,235,066円
S M A M ・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	157,799,081円
S M A M ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	1,158,898,055円
合計	85,310,011,496円

(2021年 8月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	85,310,011,496円
同期中における追加設定元本額	4,269,878,003円
同期中における一部解約元本額	8,170,748,593円
2021年 8月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	24,266,934,257円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	750,533,837円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,081,465,620円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,086,144,068円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	110,339,977円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	7,016,735円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	30,310,569円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	98,753,134円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	202,980,564円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	135,314,148円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	232,518,921円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	24,187,843円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	60,371,045円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	81,937,511円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	57,232,091円
イオン・バランス戦略ファンド	83,897,464円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	14,986,643円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	56,745,466円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	41,224,341円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	104,100,384円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	27,675,437円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	12,991,584円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	100,128,340円
三井住友D S ・ 外国債券インデックス年金ファンド	193,893,324円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	11,669,660円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	31,086,324円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	20,783,899円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	2,071,709円
日興F W S ・ 先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	504,541円
S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,317,461,774円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型<適格機関投資家限定>	48,438,996円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	7,869,174,142円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	4,714,163,189円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	10,868,896,444円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	35,901,694円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	95,696,295円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	727,266,783円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	117,631,749円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	1,068,564,548円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	1,431,714,372円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	1,607,249,044円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	5,041,314,007円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T <適格機関投資家限定>	622,437円

S M A M ・ 外国債券パッシブファンドV A < 適格機関投資家限定 >	8,429,152,918円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	340,733,819円
S M A M ・ グローバルバランス40V A < 適格機関投資家限定 >	152,793,668円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20 A < 適格機関投資家専用 >	86,188,490円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 35 A < 適格機関投資家専用 >	34,472,321円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 50 A < 適格機関投資家専用 >	11,926,289円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20 L < 適格機関投資家専用 >	102,727,880円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 25 L < 適格機関投資家専用 >	439,024,085円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20 A 2 < 適格機関投資家専用 >	112,773,770円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 35 A 2 < 適格機関投資家専用 >	40,689,411円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 50 A 2 < 適格機関投資家専用 >	5,263,229円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 25 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,074,689,777円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	663,795,946円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,002,177,440円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	1,675,217,654円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	456,690,105円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	26,287,320円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	87,629,976円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04 < 適格機関投資家限定 >	240,289,200円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	260,969,129円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	293,753,569円
合計	81,409,140,906円

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）

2021年 8月31日現在

資産総額	242,435,076円
負債総額	39,369円
純資産総額（ - ）	242,395,707円
発行済口数	230,355,851口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0523円
（1万口当たり純資産額）	（10,523円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券は発行されません。

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

- a. 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記aの申請のある場合には、上記aの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記aの振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記aの振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなけれ

ば、委託会社および受託会社に対抗することができません。

ホ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議の上、社振法に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

ヘ 償還金

償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	2021年8月31日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

八 会社の機構

委託会社の取締役は8名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名を選定することができます。

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

「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投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2021年8月31日現在、委託会社が運用を行っている投資信託(親投資信託は除きます)は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	754	9,416,712
単位型株式投資信託	106	626,302
追加型公社債投資信託	1	29,102
単位型公社債投資信託	193	437,178
合計	1,054	10,509,296

3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、「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条の規定により、「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)に基づいて作成しております。
- 2 当社は、当事業年度(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	33,264,545	33,048,142
顧客分別金信託	300,021	300,036
前払費用	515,226	449,748
未収入金	602,605	132,419
未収委託者報酬	8,404,880	9,936,096
未収運用受託報酬	2,199,785	2,247,156
未収投資助言報酬	299,826	398,108
未収収益	37,702	39,975
その他の流動資産	40,119	6,981
流動資産合計	45,664,712	46,558,665
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	101,609	1,509,450
器具備品	783,224	870,855
土地	710	710
リース資産	968	13,483

建設仮勘定	66,498	-
有形固定資産合計	953,010	2,394,500
無形固定資産		
ソフトウェア	909,133	1,347,889
ソフトウェア仮勘定	508,733	1,029,033
のれん	34,397,824	3,654,491
顧客関連資産	17,785,166	15,671,890
電話加入権	12,739	12,727
商標権	54	48
無形固定資産合計	53,613,651	21,716,080
投資その他の資産		
投資有価証券	19,436,480	22,866,282
関係会社株式	11,246,398	11,246,398
長期差入保証金	2,523,637	1,409,091
長期前払費用	113,852	116,117
会員権	90,479	90,479
貸倒引当金	20,750	20,750
投資その他の資産合計	33,390,098	35,707,619
固定資産合計	87,956,760	59,818,200
資産合計	133,621,473	106,376,866

(単位：千円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	1,064	5,153
顧客からの預り金	14,285	20,077
その他の預り金	146,200	169,380
未払金		
未払収益分配金	1,629	1,646
未払償還金	131,338	43,523
未払手数料	3,776,873	4,480,697
その他未払金	502,211	270,290
未払費用	3,935,582	5,940,121
未払消費税等	305,513	235,647
未払法人税等	489,151	762,648
賞与引当金	1,716,321	1,516,622
その他の流動負債	30,951	9,710
流動負債合計	11,051,125	13,455,519
固定負債		
リース債務	-	9,678
繰延税金負債	2,963,538	2,566,958
退職給付引当金	5,299,814	5,258,448
賞与引当金	14,767	-
その他の固定負債	172,918	40,950
固定負債合計	8,451,038	7,876,035
負債合計	19,502,164	21,331,554
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	81,927,000	81,927,000

資本剰余金合計	90,555,984	90,555,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	19,364,265	10,281,242
利益剰余金合計	21,185,470	8,460,037
株主資本計	113,741,454	84,095,946
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	377,855	949,365
評価・換算差額等合計	377,855	949,365
純資産合計	114,119,309	85,045,311
負債・純資産合計	133,621,473	106,376,866

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	2019年4月1日	(自	2020年4月1日
	至	2020年3月31日)	至	2021年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		54,615,133		50,610,457
運用受託報酬		9,389,058		9,450,169
投資助言報酬		1,303,595		1,270,584
その他営業収益				
サービス支 hands 手数料		181,061		200,807
その他		32,421		32,820
営業収益計		65,521,269		61,564,839
営業費用				
支払手数料		24,888,040		22,784,919
広告宣伝費		447,024		365,317
調査費				
調査費		3,214,679		3,061,987
委託調査費		7,702,309		7,810,157
営業雑経費				
通信費		70,007		95,163
印刷費		612,249		554,920
協会費		45,117		40,044
諸会費		32,199		29,473
情報機器関連費		4,349,174		4,562,612
販売促進費		68,688		23,614
その他		154,201		163,332
営業費用合計		41,583,691		39,491,542
一般管理費				
給料				
役員報酬		264,325		277,027
給料・手当		9,789,691		9,280,730
賞与		914,702		950,630
賞与引当金繰入額		1,726,013		1,501,855
交際費		30,898		11,815
寄付金		2,022		949
事務委託費		956,931		844,255
旅費交通費		249,359		21,023

租税公課	389,032	389,819
不動産賃借料	1,121,553	1,639,529
退職給付費用	797,158	790,144
固定資産減価償却費	3,044,658	3,040,894
のれん償却費	2,645,986	2,645,986
諸経費	482,324	608,206
一般管理費合計	22,414,658	22,002,869
営業利益	1,522,919	70,426

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	778,113	13,164
受取利息	947	2,736
時効成立分配金・償還金	1,041	88,335
原稿・講演料	2,061	2,603
投資有価証券償還益	6,398	57,388
投資有価証券売却益	24,206	162,941
雑収入	53,484	72,933
営業外収益合計	866,254	400,104
営業外費用		
為替差損	72,457	766
投資有価証券償還損	129,006	11,762
投資有価証券売却損	12,906	34,473
雑損失	8,334	1,240
営業外費用合計	222,704	48,243
経常利益	2,166,469	422,288
特別損失		
固定資産除却損	1 110,668	54,493
減損損失	2 46,417	28,097,346
合併関連費用	42,800	-
早期退職費用	3 -	216,200
本社移転費用	4 133,168	127,044
その他特別損失	-	5,460
特別損失合計	333,054	28,500,544
税引前当期純利益又は 税引前当期純損失()	1,833,414	28,078,256
法人税、住民税及び事業税	1,874,278	1,549,173
法人税等調整額	619,676	693,192
法人税等合計	1,254,602	855,980
当期純利益又は 当期純損失()	578,811	28,934,237

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	-	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054
当期変動額								
剰余金の配当								2,469,600
当期純利益								578,811
合併による増加			81,927,000	81,927,000				
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）								
当期変動額合計	-	-	81,927,000	81,927,000	-	-	-	1,890,788
当期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
	利益剰余金合計				
当期首残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304
当期変動額					
剰余金の配当	2,469,600	2,469,600			2,469,600
当期純利益	578,811	578,811			578,811
合併による増加		81,927,000			81,927,000
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			216,206	216,206	216,206
当期変動額合計	1,890,788	80,036,211	216,206	216,206	79,820,005
当期末残高	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265
当期変動額								
剰余金の配当								711,271
当期純損失（ ）								28,934,237
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）								
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	29,645,508
当期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242

	株主資本	評価・換算差額等
--	------	----------

	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
	利益剰余金 合計				
当期首残高	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309
当期変動額					
剰余金の配当	711,271	711,271		-	711,271
当期純損失（ ）	28,934,237	28,934,237		-	28,934,237
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	571,510	571,510	571,510
当期変動額合計	29,645,508	29,645,508	571,510	571,510	29,073,997
当期末残高	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311

[注記事項]

(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

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外

決算日の市場価格等に基づく時価法

（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）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	4～15年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア（自社利用分）	5年（社内における利用可能期間）

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の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

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、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

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度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。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定

式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

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

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(会計方針の変更)

当社は「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準第31号 2019年7月4日)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。

(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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
建物	466,875千円	102,329千円
器具備品	1,225,261千円	1,153,649千円
リース資産	1,452千円	2,830千円

2 当座借越契約

当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	-千円	-千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	132,559千円	93,374千円

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
建物	879千円	18,278千円
器具備品	119千円	28,604千円
リース資産	5,377千円	-千円
ソフトウェア	1,596千円	7,610千円
ソフトウェア仮勘定	102,695千円	-千円

2 減損損失

前事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

(単位：千円)

場所	用途	種類	減損損失
千代田区	事業用資産	建物	46,417

当社は、資産と対応して継続的に収支の把握ができる単位が全社のみであることから全社資産の単一グループとしております。

上記事業用資産については、霞ヶ関オフィスの移転に係る意思決定をしたことに伴い将来の使用が見込めなくなった資産につき、回収可能額を零と見積もり、当該減少額を減損損失に計上しております。その内訳は、建物に計上した資産除去債務に対応する原状回復費用相当額であります。

当事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

(単位：千円)

場所	用途	種類	減損損失
-	その他	のれん	28,097,346

当社は、資産と対応して継続的に収支の把握ができる単位が全社のみであることから全社資産の単一グループとしております。

当社は、当社を存続会社とし、大和住銀投信投資顧問株式会社を消滅会社とする吸収合併に伴って発生したのれんを計上しております。当該のれんについて下期以降の業績は上向いているものの、通期では業績計画を下回る結果となったことを踏まえて将来キャッシュ・フローを見直した結果、のれんの帳簿価額の回収が見込まれなくなったため、帳簿価額を回収可能価額まで減損し、当該減少額を減損損失として計上しております。

なお、回収可能価額は使用価値としており、将来キャッシュ・フローを9.2%で割り引いて算出しております。

3 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

4 本社移転費用

前事業年度の本社移転費用は、本社事務所移転に伴い解約日までに賃貸期間の残存分(2020年7月13日から2020年9月30日まで)の賃料及び共益費相当額として133,168千円支払うものであります。

当事業年度の本社移転費用は、本社移転に伴うものであり、主に設備撤去費用、引越費用などであります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

合併に伴う普通株式の発行により16,230,060株増加しております。

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640,000株	16,230,060株	-	33,870,060株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月24日 臨時株主総会	普通株式	2,469,600	140.00	2019年 3月28日	2019年 6月25日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	711,271	21.00	2020年 3月31日	2020年 6月30日

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

2. 剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	711,271	21.00	2020年 3月31日	2020年 6月30日

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

（単位：千円）

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
1年以内	1,618,641	1,194,699
1年超	5,844,934	3,497,258
合計	7,463,576	4,691,958

(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、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っています。そのため、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っていません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬及び未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。未収委託者報酬は、信託財産中から支弁されるものであり、信託財産については受託者である信託銀行において分別管理されているため、リスクは僅少となっています。

投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて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

信用リスクの管理

当社は、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、営業債権について、取引先毎の期日管理及び残高管理を行うとともに、その状況について取締役会に報告しています。

投資有価証券、子会社株式は発行体の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

長期差入保証金についても、差入先の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

市場リスクの管理

投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、経営企画部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。

なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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、市場価格のないものは、次表には含まれていません（注2）参照）。

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	33,264,545	33,264,545	-
(2)顧客分別金信託	300,021	300,021	-
(3)未収委託者報酬	8,404,880	8,404,880	-
(4)未収運用受託報酬	2,199,785	2,199,785	-
(5)未収投資助言報酬	299,826	299,826	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	19,391,111	19,391,111	-
(7)長期差入保証金	2,523,637	2,523,637	-
資産計	66,383,807	66,383,807	-
(1)顧客からの預り金	14,285	14,285	-
(2)未払手数料	3,776,873	3,776,873	-
負債計	3,791,158	3,791,158	-

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	33,048,142	33,048,142	-
(2)顧客分別金信託	300,036	300,036	-
(3)未収委託者報酬	9,936,096	9,936,096	-
(4)未収運用受託報酬	2,247,156	2,247,156	-
(5)未収投資助言報酬	398,108	398,108	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	22,826,472	22,826,472	-
(7)長期差入保証金	1,409,091	1,409,091	-
資産計	70,165,105	70,165,105	-
(1)顧客からの預り金	20,077	20,077	-
(2)未払手数料	4,480,697	4,480,697	-
負債計	4,500,774	4,500,774	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

(1)現金及び預金、(2)顧客分別金信託、(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬及び(5)未収投資助言報酬

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います。

(6)投資有価証券

これらの時価について、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

(7)長期差入保証金

これらの時価については、敷金の性質及び賃貸借契約の期間から帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

負債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

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います。

(注2)市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

区分	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
その他有価証券		
非上場株式	45,369	39,809
合計	45,369	39,809
子会社株式		
非上場株式	11,246,398	11,246,398
合計	11,246,398	11,246,398

その他有価証券については、市場価格がないため、「(6) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式については、市場価格がないため、時価開示の対象とはしておりません。

また時価をもって貸借対照表計上額としている「(6) その他有価証券」は、全て投資信託で構成されております。そのため、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」第26項の経過措置を適用し、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項は記載しておりません。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：千円）

区分	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	33,264,545	-	-	-
顧客分別金信託	300,021	-	-	-
未収委託者報酬	8,404,880	-	-	-
未収運用受託報酬	2,199,785	-	-	-
未収投資助言報酬	299,826	-	-	-
長期差入保証金	1,125,292	1,398,345	-	-
合計	45,594,350	1,398,345	-	-

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

区分	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	33,048,142	-	-	-
顧客分別金信託	300,036	-	-	-
未収委託者報酬	9,936,096	-	-	-
未収運用受託報酬	2,247,156	-	-	-
未収投資助言報酬	398,108	-	-	-
長期差入保証金	42,007	1,367,084	-	-
合計	45,971,548	1,367,084	-	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度(2020年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円)は、市場価格がないことから、記載しておりませ
ん。

当事業年度(2021年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円)は、市場価格がないことから、記載しておりませ
ん。

2. その他有価証券

前事業年度(2020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
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	12,411,812	13,327,652	915,839
小計	12,411,812	13,327,652	915,839
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,413,317	6,063,458	349,858
小計	6,413,317	6,063,458	349,858
合計	18,825,130	19,391,111	565,980

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 45,369千円)については、市場価格がないことから、記載しておりませ
ん。

当事業年度(2021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
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	14,397,606	16,097,433	1,699,827
小計	14,397,606	16,097,433	1,699,827
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,994,762	6,729,039	265,723
小計	6,994,762	6,729,039	265,723
合計	21,392,369	22,826,472	1,434,103

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 39,809千円)については、市場価格がないことから、記載しておりませ
ん。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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
1,814,360	24,206	12,906

(単位:千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
3,631,425	6,398	129,006

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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
1,978,622	162,941	34,473

(単位:千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
1,630,219	57,388	11,762

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

当事業年度において、投資有価証券について1,560千円（その他有価証券1,560千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

(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、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)	当事業年度 (自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,418,601	5,299,814
勤務費用	523,396	476,308
利息費用	-	-
数理計算上の差異の発生額	195	67,476
退職給付の支払額	349,050	585,151
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による発生額	1,707,062	-
退職給付債務の期末残高	5,299,814	5,258,448

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (2020年 3月31日)	当事業年度 (2021年 3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	5,299,814	5,258,448
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	5,299,814	5,258,448

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)	当事業年度 (自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月31日)
勤務費用	492,511	476,308
利息費用	-	-
数理計算上の差異の費用処理額	195	67,476
その他	304,842	246,359
確定給付制度に係る退職給付費用	797,158	790,144

(注) その他は、その他の関係会社等からの出向者の年金掛金負担分及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金並びに確定拠出年金への拠出額であります。

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

	前事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)	当事業年度 (自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月31日)
割引率	0.000%	0.020%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度248,932千円、当事業年度239,162千円であります。

(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

(単位：千円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,622,803	1,610,136
賞与引当金	530,059	464,389
調査費	178,573	247,208
未払金	162,557	206,090
未払事業税	46,423	66,891
ソフトウェア償却	91,937	90,431
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	150,771	131,391
その他	88,250	35,930
繰延税金資産小計	2,986,254	2,967,346
評価性引当額（注）	193,485	218,966
繰延税金資産合計	2,792,768	2,748,380
繰延税金負債		
無形固定資産	5,445,817	4,798,732
その他有価証券評価差額金	310,488	516,605
繰延税金負債合計	5,756,306	5,315,338
繰延税金資産（負債）の純額	2,963,538	2,566,958

（注）評価性引当額が25,480千円増加しております。この増加の内容は、主としてその他有価証券評価差額金に係る評価性引当額を追加的に認識したことに伴うものであります。

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
法定実効税率	30.6%	税引前当期純損失のため記載を省略しております。
（調整）		
評価性引当額の増減	3.5	
受取配当等永久に益金に算入されない項目	13.9	
交際費等永久に損金に算入されない項目	7.3	
住民税均等割等	0.5	
所得税額控除による税額控除	0.5	
のれん償却費	44.1	
その他	3.3	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	68.4	

（セグメント情報等）

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	54,615,133	9,389,058	1,303,595	213,482	65,521,269

(2) 地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、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。

3. 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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

4. 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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5. 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。

当事業年度(自 2020年4月1日 至2021年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報**(1) 製品及びサービスごとの情報**

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	50,610,457	9,450,169	1,270,584	233,628	61,564,839

(2) 地域ごとの情報**営業収益**

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、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。

3. 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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

4. 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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5. 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)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引**(1) 兄弟会社等**

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
親会社の 子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,703,669	未払 手数料	644,246
親会社の 子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	6,265,593	未払 手数料	890,935

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、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

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ(東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場)

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
親会社の 子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,728,851	未払 手数料	863,159
親会社の 子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,578,226	未払 手数料	1,070,559

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、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

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ(東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場)

(1) 株当たり情報

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	3,369.33円	2,510.93円
1株当たり当期純利益又は 1株当たり当期純損失()	17.09円	854.27円

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

当事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、1株当たり当期純損失であり、また、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又は1株当たり当期純損失の算定上の基礎は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり当期純利益又は当期純損失		
当期純利益又は当期純損失()(千円)	578,811	28,934,237
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益又は 当期純損失()(千円)	578,811	28,934,237
期中平均株式数(株)	33,870,060	33,870,060

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- イ 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
 - (イ) 定款の変更
該当ありません。
 - (ロ) その他の重要事項
当社を存続会社とし、大和住銀投信投資顧問株式会社を消滅会社とする吸収合併(2019年4月1日付)に伴って発生したのれんについて、2021年3月期決算において28,097,346千円の減損損失を計上しました。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

- イ 受託会社
 - (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
 - (ロ) 資本金の額 342,037百万円(2021年3月末現在)
 - (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

[参考情報：再信託受託会社の概要]

- ・ 名称 株式会社日本カストディ銀行

- ・ 資本金の額 51,000百万円（2021年3月末現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

□ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

資本金の額は、2021年3月末現在。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

□ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、一部解約の実行の請求の受付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）
該当ありません。

第3【その他】

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

- (1) 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。
- (2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。
- (3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス（これらのアドレスをコード化した図形等も含む）を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
- (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨を記載することがあります。
- (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
- (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
- (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
- (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。

2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。

- 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」と称して使用することがあります。
- 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
- 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書(交付目論見書)で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)および投資信託説明書(請求目論見書)を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2021年6月15日

三井住友DS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

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 羽 太 典 明 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕 印**監査意見**

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DSアセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36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。

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DSアセットマネジメント株式会社の2021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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年3月23日

三井住友DS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

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志 印

監査意見

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」に掲げられている三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）の2020年2月19日から2021年2月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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・DC年金バランスゼロ（債券型）の2021年2月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DS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. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年9月28日

三井住友DS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

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志 印

中間監査意見

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」に掲げられている三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）の2021年2月19日から2021年8月18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。

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・DC年金バランスゼロ（債券型）の2021年8月18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（2021年2月19日から2021年8月18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。

中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間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、監査人は、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。
- ・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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DS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。