

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年8月25日提出
【計算期間】	第2期中(自 2021年12月1日至 2022年5月31日)
【ファンド名】	三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド 三井住友D S・日経2 2 5インデックス・ファンド 三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド 三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド 三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド 三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド 三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)
【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1 7番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目1 7番1号
【電話番号】	03-6205-1649
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【ファンドの運用状況】

(1)【投資状況】

三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド

2022年6月30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	19,841,914	100.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	5,384	0.03
合計（純資産総額）		19,836,530	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。

三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

2022年6月30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	95,621,729	100.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	30,914	0.03
合計（純資産総額）		95,590,815	100.00

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

2022年6月30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	126,615,439	100.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	54,084	0.04
合計（純資産総額）		126,561,355	100.00

三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

2022年6月30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	10,696,167	100.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,411	0.03
合計（純資産総額）		10,692,756	100.00

三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

2022年6月30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	11,766,329	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,574	0.01
合計(純資産総額)		11,764,755	100.00

三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

2022年6月30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	6,672,534	99.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	65,693	0.97
合計(純資産総額)		6,738,227	100.00

三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

2022年6月30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	6,681,992	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,331	0.02
合計(純資産総額)		6,680,661	100.00

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

2022年6月30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	14,804,657	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	4,454	0.03
合計(純資産総額)		14,800,203	100.00

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

2022年6月30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	100,186,686	101.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,869,628	1.90
合計(純資産総額)		98,317,058	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	4,093,449	4.16
為替予約取引	売建	-	131,727,187	133.98

(2)【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

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 (2021年11月30日)	6,046,349	6,046,349	10,294	10,294
2021年 8月末日	1,041,929	-	10,419	-
9月末日	1,943,342	-	10,864	-
10月末日	10,433,478	-	10,694	-
11月末日	6,046,349	-	10,294	-
12月末日	7,859,748	-	10,650	-
2022年 1月末日	10,107,816	-	10,129	-
2月末日	13,550,573	-	10,079	-
3月末日	15,993,321	-	10,508	-
4月末日	17,148,322	-	10,253	-
5月末日	18,019,893	-	10,327	-
6月末日	19,836,530	-	10,113	-

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

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 (2021年11月30日)	69,516,804	69,516,804	10,362	10,362
2021年 8月末日	1,040,355	-	10,404	-
9月末日	32,945,364	-	10,977	-
10月末日	50,879,997	-	10,764	-
11月末日	69,516,804	-	10,362	-
12月末日	79,434,697	-	10,740	-
2022年 1月末日	76,494,806	-	10,067	-
2月末日	80,176,655	-	9,894	-
3月末日	108,835,659	-	10,461	-
4月末日	105,786,864	-	10,092	-
5月末日	111,435,980	-	10,257	-
6月末日	95,590,815	-	9,928	-

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

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 (2021年11月30日)	74,584,829	74,584,829	10,652	10,652
2021年 8月末日	3,046,896	-	10,252	-
9月末日	19,428,857	-	9,989	-
10月末日	48,198,190	-	10,704	-
11月末日	74,584,829	-	10,652	-
12月末日	103,818,923	-	11,078	-
2022年 1月末日	100,669,920	-	10,296	-
2月末日	103,752,165	-	10,222	-
3月末日	128,047,786	-	11,306	-
4月末日	124,108,639	-	10,815	-
5月末日	139,621,891	-	10,780	-
6月末日	126,561,355	-	10,522	-

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

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 (2021年11月30日)	3,024,503	3,024,503	10,217	10,217
2021年 8月末日	1,040,647	-	10,406	-
9月末日	1,128,389	-	10,309	-
10月末日	3,028,457	-	10,717	-
11月末日	3,024,503	-	10,217	-
12月末日	9,613,321	-	10,327	-
2022年 1月末日	9,483,195	-	10,122	-
2月末日	9,434,281	-	10,018	-
3月末日	9,882,827	-	10,448	-
4月末日	9,565,386	-	10,024	-
5月末日	9,786,793	-	10,143	-
6月末日	10,692,756	-	10,366	-

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

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 (2021年11月30日)	6,787,059	6,787,059	10,037	10,037
2021年 8月末日	1,001,711	-	10,017	-
9月末日	6,502,806	-	9,939	-
10月末日	6,804,601	-	10,153	-
11月末日	6,787,059	-	10,037	-
12月末日	16,956,219	-	10,090	-
2022年 1月末日	17,786,215	-	9,914	-
2月末日	7,916,507	-	9,721	-

3月末日	8,289,258	-	10,039	-
4月末日	8,415,328	-	10,058	-
5月末日	8,453,852	-	9,995	-
6月末日	11,764,755	-	10,226	-

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

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 (2021年11月30日)	1,607,853	1,607,853	9,918	9,918
2021年 8月末日	1,006,602	-	10,066	-
9月末日	1,583,148	-	9,923	-
10月末日	1,625,220	-	10,106	-
11月末日	1,607,853	-	9,918	-
12月末日	1,664,115	-	10,123	-
2022年 1月末日	6,510,596	-	9,745	-
2月末日	6,202,436	-	9,096	-
3月末日	6,211,245	-	8,922	-
4月末日	6,208,027	-	8,885	-
5月末日	6,205,131	-	8,847	-
6月末日	6,738,227	-	8,865	-

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

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 (2021年11月30日)	2,142,283	2,142,283	9,513	9,513
2021年 8月末日	1,012,930	-	10,129	-
9月末日	1,657,609	-	9,805	-
10月末日	1,677,320	-	9,922	-
11月末日	2,142,283	-	9,513	-
12月末日	12,863,551	-	9,829	-
2022年 1月末日	12,764,090	-	9,296	-
2月末日	3,583,145	-	8,992	-
3月末日	4,451,396	-	9,601	-
4月末日	5,009,757	-	9,485	-
5月末日	5,752,848	-	9,648	-
6月末日	6,680,661	-	9,485	-

三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

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 (2021年11月30日)	2,304,754	2,304,754	10,763	10,763
2021年 8月末日	1,019,980	-	10,200	-
9月末日	2,086,641	-	9,956	-
10月末日	2,266,945	-	10,816	-
11月末日	2,304,754	-	10,763	-
12月末日	13,257,696	-	11,446	-
2022年 1月末日	13,309,621	-	10,644	-
2月末日	4,868,061	-	10,615	-
3月末日	8,684,683	-	11,911	-
4月末日	10,863,045	-	12,104	-
5月末日	12,370,092	-	11,194	-
6月末日	14,800,203	-	10,923	-

三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

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 (2021年11月30日)	37,563,029	37,563,029	9,748	9,748
2021年 8月末日	2,996,174	-	10,084	-
9月末日	8,405,280	-	9,586	-
10月末日	18,681,068	-	9,848	-
11月末日	37,563,029	-	9,748	-
12月末日	37,547,795	-	9,835	-
2022年 1月末日	37,732,406	-	9,738	-
2月末日	62,137,638	-	10,282	-
3月末日	94,415,667	-	10,488	-
4月末日	98,116,532	-	10,231	-
5月末日	98,249,146	-	10,035	-
6月末日	98,317,058	-	9,826	-

【分配の推移】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0

三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0

三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0

三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0

三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0

【収益率の推移】

三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	2.9
第2期(中間期)	0.3

(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。

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	3.6
第2期(中間期)	1.0

(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。

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	6.5
第2期(中間期)	1.2

(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。

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	2.2
第2期(中間期)	0.7

(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。

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	0.4
第2期(中間期)	0.4

(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。

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	0.8
第2期(中間期)	10.8

(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。

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	4.9

第2期(中間期)	1.4
----------	-----

(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。

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	7.6
第2期(中間期)	4.0

(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。

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

	収益率(%)
第1期	2.5
第2期(中間期)	2.9

(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。

(参考)

(1) 投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2022年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	201,214,917,660	98.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	3,943,874,532	1.92
合計(純資産総額)		205,158,792,192	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,909,345,000	1.91
合計	買建	-	3,909,345,000	1.91

2.2.5 マザーファンド

2022年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	114,154,131,040	97.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,753,435,437	2.36
合計(純資産総額)		116,907,566,477	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
----	-----------	------	---------	-------------

株価指数先物取引	買建	日本	2,743,520,000	2.35
合計	買建	-	2,743,520,000	2.35

外国株式インデックス・マザーファンド

2022年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	253,811,746,968	66.68
	イギリス	16,585,461,237	4.36
	カナダ	14,457,994,066	3.80
	スイス	12,624,223,714	3.32
	フランス	11,318,627,221	2.97
	ドイツ	8,468,600,043	2.22
	オーストラリア	7,679,693,976	2.02
	アイルランド	6,520,713,174	1.71
	オランダ	6,395,751,816	1.68
	スウェーデン	3,471,858,145	0.91
	デンマーク	3,002,906,619	0.79
	スペイン	2,757,195,995	0.72
	香港	2,635,043,717	0.69
	イタリア	1,902,906,917	0.50
	ジャージー	1,385,591,907	0.36
	フィンランド	1,327,299,029	0.35
	シンガポール	1,196,147,326	0.31
	ノルウェー	938,328,344	0.25
	ベルギー	917,362,468	0.24
	ケイマン諸島	846,052,735	0.22
	イスラエル	835,951,334	0.22
	バミューダ	539,816,379	0.14
	オランダ領キュ ラソー	419,387,493	0.11
	ルクセンブルグ	274,695,367	0.07
	ニュージーラン ド	245,474,221	0.06
	オーストラリア	201,453,843	0.05
	ポルトガル	191,960,256	0.05
	マン島	62,450,928	0.02
	リベリア	58,537,009	0.02
	パナマ	58,382,003	0.02
小計	361,131,614,250	94.87	
投資証券	アメリカ	7,938,593,159	2.09
	オーストラリア	839,497,993	0.22
	イギリス	198,687,942	0.05
	香港	185,162,052	0.05
	シンガポール	169,318,100	0.04
	フランス	147,579,948	0.04

	ベルギー	42,768,060	0.01
	カナダ	34,340,825	0.01
	小計	9,555,948,079	2.51
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	9,960,315,267	2.62
合計（純資産総額）		380,647,877,596	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	イギリス	469,158,980	0.12
株価指数先物取引	買建	ドイツ	1,452,678,780	0.38
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,834,326,750	2.06
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	371,618,640	0.10
合計	買建	-	10,127,783,150	2.66

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建	-	3,875,963,304	1.02

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2022年6月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	ケイマン諸島	3,853,493,832	16.94
	台湾	2,706,712,541	11.90
	インド	2,392,367,575	10.52
	韓国	2,141,491,165	9.42
	中国	1,424,338,713	6.26
	ブラジル	895,269,797	3.94
	南アフリカ	653,617,525	2.87
	タイ	360,250,176	1.58
	インドネシア	343,347,922	1.51
	メキシコ	312,899,407	1.38
	マレーシア	273,665,273	1.20
	香港	232,123,389	1.02
	フィリピン	136,316,626	0.60
	ポーランド	110,506,482	0.49
	バミューダ	109,992,734	0.48
	チリ	94,095,089	0.41
	アメリカ	70,682,473	0.31
	トルコ	52,449,281	0.23
	ギリシャ	47,775,404	0.21
	チェコ	31,185,362	0.14
	コロンビア	28,959,609	0.13
	ハンガリー	27,388,350	0.12
	ルクセンブルグ	18,621,381	0.08
エジプト	12,378,879	0.05	
シンガポール	4,058,271	0.02	

	ペルー	3,764,216	0.02
	小計	16,337,751,472	71.83
投資信託受益証券	香港	1,083,697,994	4.76
投資証券	アメリカ	1,374,733,591	6.04
	メキシコ	85,565,661	0.38
	ブラジル	32,149,874	0.14
	南アフリカ	7,733,134	0.03
	小計	1,500,182,260	6.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	3,822,692,337	16.81
合計(純資産総額)		22,744,324,063	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,862,244,667	16.98
合計	買建	-	3,862,244,667	16.98

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	63,249,225	0.28

外国債券パッシブ・マザーファンド

2022年6月30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	80,264,443,616	50.33
	フランス	13,792,255,787	8.65
	イタリア	12,920,427,509	8.10
	ドイツ	10,334,723,396	6.48
	スペイン	8,223,454,286	5.16
	イギリス	7,845,422,378	4.92
	中国	3,247,554,959	2.04
	カナダ	3,238,166,652	2.03
	ベルギー	3,181,357,740	1.99
	オランダ	2,731,015,105	1.71
	オーストラリア	2,372,136,589	1.49
	オーストリア	1,985,948,494	1.25
	メキシコ	1,221,767,093	0.77
	アイルランド	1,134,959,966	0.71
	マレーシア	795,749,935	0.50
	フィンランド	790,696,543	0.50
	シンガポール	693,786,547	0.44
	ポーランド	656,183,715	0.41
	イスラエル	634,795,879	0.40
	デンマーク	602,003,312	0.38
スウェーデン	427,372,463	0.27	
ノルウェー	325,082,069	0.20	
小計		157,419,304,033	98.71

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,056,604,212	1.29
合計(純資産総額)		159,475,908,245	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	907,872	0.00
為替予約取引	売建	-	523,455,726	0.33

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2022年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	メキシコ	155,705,309	12.94
	カタール	108,502,051	9.01
	サウジアラビア	102,357,055	8.50
	ブラジル	97,757,909	8.12
	南アフリカ	97,541,955	8.10
	コロンビア	94,066,456	7.82
	アラブ首長国連邦	92,805,720	7.71
	インドネシア	74,972,807	6.23
	トルコ	70,584,285	5.86
	フィリピン	64,897,850	5.39
	パナマ	63,821,905	5.30
	ペルー	51,122,693	4.25
	中国	48,684,322	4.04
小計		1,122,820,317	93.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	80,788,222	6.71
合計(純資産総額)		1,203,608,539	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	6,833,585	0.57

Jリート・インデックス・マザーファンド

2022年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	9,461,124,100	98.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	117,933,926	1.23
合計(純資産総額)		9,579,058,026	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
リート指数先物取引	買建	日本	38,970,000	0.41
合計	買建	-	38,970,000	0.41

外国リート・インデックス・マザーファンド

2022年6月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	17,262,673,080	75.38
	オーストラリア	1,418,803,178	6.20
	イギリス	1,163,526,118	5.08
	シンガポール	821,012,340	3.58
	カナダ	408,843,278	1.79
	フランス	347,657,392	1.52
	香港	346,799,365	1.51
	ベルギー	278,483,054	1.22
	スペイン	88,337,216	0.39
	ニュージーランド	77,992,936	0.34
	韓国	48,938,277	0.21
	オランダ	44,384,860	0.19
	ガーンジー	36,043,235	0.16
	イスラエル	25,791,366	0.11
	ドイツ	12,769,104	0.06
	アイルランド	9,795,650	0.04
	イタリア	6,879,978	0.03
小計		22,398,730,427	97.80
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	503,353,063	2.20
合計（純資産総額）		22,902,083,490	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	83,273,090	0.36

ゴールド・インデックス・マザーファンド

2022年6月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	2,039,668,559	100.46
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	9,279,900	0.46
合計（純資産総額）		2,030,388,659	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	44,486,638	2.19

2【設定及び解約の実績】

三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	11,131,313	5,257,925
第2期(中間期)	11,576,176	0

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	68,267,713	1,179,562
第2期(中間期)	41,706,400	150,642

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	72,990,426	2,971,998
第2期(中間期)	65,349,425	5,847,387

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2,960,151	0
第2期(中間期)	6,731,713	42,864

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	6,762,046	0
第2期(中間期)	11,676,509	9,980,273

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	1,621,093	0
第2期(中間期)	5,400,834	8,229

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2,350,609	98,727
第2期(中間期)	14,038,349	10,327,378

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2,141,454	0
第2期(中間期)	18,169,611	9,260,449

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	38,535,757	0
第2期(中間期)	100,023,888	40,657,554

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)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2期中間計算期間(2021年12月1日から2022年5月31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DS・TOPIXインデックス・ファンド】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	17
コール・ローン	-	499
親投資信託受益証券	6,051,301	18,044,758
流動資産合計	6,051,301	18,045,274
資産合計	6,051,301	18,045,274
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	268	1,381
未払委託者報酬	4,663	23,713
その他未払費用	21	287
流動負債合計	4,952	25,381
負債合計	4,952	25,381
純資産の部		
元本等		
元本	5,873,388	17,449,564
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	172,961	570,329
(分配準備積立金)	13,736	13,736
元本等合計	6,046,349	18,019,893
純資産合計	6,046,349	18,019,893
負債純資産合計	6,051,301	18,045,274

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	120,679
営業収益合計	120,679
営業費用	
受託者報酬	1,381
委託者報酬	23,713
その他費用	287
営業費用合計	25,381
営業利益又は営業損失()	95,298
経常利益又は経常損失()	95,298
中間純利益又は中間純損失()	95,298
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()	-
期首剰余金又は期首欠損金()	172,961
剰余金増加額又は欠損金減少額	302,070
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	302,070
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
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()	570,329

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期中間計算期間 自 2021年12月1日 至 2022年5月31日
1. 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1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	5,873,388口	17,449,564口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0294円 (1万口当たりの純資産額10,294円)	1口当たり純資産額 1.0327円 (1万口当たりの純資産額10,327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2期中間計算期間 (2022年5月31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	<p>(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。</p> <p>(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。</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 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。</p>

(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1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
期首元本額	1,000,000円	5,873,388円
期中追加設定元本額	10,131,313円	11,576,176円
期中一部解約元本額	5,257,925円	-円

【三井住友D S ・日経225インデックス・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	35
コール・ローン	-	1,057
親投資信託受益証券	69,557,660	111,609,465
流動資産合計	69,557,660	111,610,557
資産合計		
	69,557,660	111,610,557
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	2,295	9,794
未払委託者報酬	38,037	162,419
その他未払費用	524	2,364
流動負債合計	40,856	174,577
負債合計		
	40,856	174,577
純資産の部		
元本等		
元本	67,088,151	108,643,909
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2,428,653	2,792,071
(分配準備積立金)	173,689	173,431
元本等合計	69,516,804	111,435,980
純資産合計		
	69,516,804	111,435,980
負債純資産合計		
	69,557,660	111,610,557

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	288,991
営業収益合計	288,991
営業費用	
受託者報酬	9,794
委託者報酬	162,419
その他費用	2,364
営業費用合計	174,577
営業利益又は営業損失（ ）	114,414
経常利益又は経常損失（ ）	114,414
中間純利益又は中間純損失（ ）	114,414
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（ ）	3,654
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,428,653
剰余金増加額又は欠損金減少額	256,655
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	256,655
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,997
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,997
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（ ）	2,792,071

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期中間計算期間 自 2021年12月1日 至 2022年5月31日
1. 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1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	67,088,151口	108,643,909口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0362円 (1万口当たりの純資産額10,362円)	1口当たり純資産額 1.0257円 (1万口当たりの純資産額10,257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2期中間計算期間 (2022年5月31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	<p>(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。</p> <p>(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。</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 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。</p>

(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1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
期首元本額	1,000,000円	67,088,151円
期中追加設定元本額	67,267,713円	41,706,400円
期中一部解約元本額	1,179,562円	150,642円

【三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年 5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	38
コール・ローン	-	1,135
親投資信託受益証券	74,627,082	139,883,618
流動資産合計	74,627,082	139,884,791
資産合計	74,627,082	139,884,791
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	1,930	12,022
未払委託者報酬	39,784	247,352
その他未払費用	539	3,526
流動負債合計	42,253	262,900
負債合計	42,253	262,900
純資産の部		
元本等		
元本	70,018,428	129,520,466
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	4,566,401	10,101,425
(分配準備積立金)	1,578,993	1,495,303
元本等合計	74,584,829	139,621,891
純資産合計	74,584,829	139,621,891
負債純資産合計	74,627,082	139,884,791

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	2,768,479
営業収益合計	2,768,479
営業費用	
受託者報酬	12,022
委託者報酬	247,352
その他費用	3,526
営業費用合計	262,900
営業利益又は営業損失()	2,505,579
経常利益又は経常損失()	2,505,579
中間純利益又は中間純損失()	2,505,579
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()	261,943
期首剰余金又は期首欠損金()	4,566,401
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,646,206
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	3,646,206
剰余金減少額又は欠損金増加額	354,818
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	354,818
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()	10,101,425

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期中間計算期間 自 2021年12月1日 至 2022年5月31日
1. 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1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	70,018,428口	129,520,466口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0652円 (1万口当たりの純資産額10,652円)	1口当たり純資産額 1.0780円 (1万口当たりの純資産額10,780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2期中間計算期間 (2022年5月31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	<p>(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。</p> <p>(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。</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 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。</p>

(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1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
期首元本額	1,000,000円	70,018,428円
期中追加設定元本額	71,990,426円	65,349,425円
期中一部解約元本額	2,971,998円	5,847,387円

【三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年 5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	17
コール・ローン	-	509
親投資信託受益証券	3,026,951	9,808,054
流動資産合計	3,026,951	9,808,580
資産合計	3,026,951	9,808,580
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	93	975
未払委託者報酬	2,355	20,526
その他未払費用	-	286
流動負債合計	2,448	21,787
負債合計	2,448	21,787
純資産の部		
元本等		
元本	2,960,151	9,649,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	64,352	137,793
(分配準備積立金)	4,096	4,077
元本等合計	3,024,503	9,786,793
純資産合計	3,024,503	9,786,793
負債純資産合計	3,026,951	9,808,580

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	140,659
営業収益合計	140,659
営業費用	
受託者報酬	975
委託者報酬	20,526
その他費用	286
営業費用合計	21,787
営業利益又は営業損失()	162,446
経常利益又は経常損失()	162,446
中間純利益又は中間純損失()	162,446
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()	322
期首剰余金又は期首欠損金()	64,352
剰余金増加額又は欠損金減少額	236,924
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	236,924
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,359
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,359
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()	137,793

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期中間計算期間 自 2021年12月1日 至 2022年5月31日
1. 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1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	2,960,151口	9,649,000口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0217円 (1万口当たりの純資産額10,217円)	1口当たり純資産額 1.0143円 (1万口当たりの純資産額10,143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2期中間計算期間 (2022年5月31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	<p>(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。</p> <p>(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。</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 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。</p>

(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1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
期首元本額	1,000,000円	2,960,151円
期中追加設定元本額	1,960,151円	6,731,713円
期中一部解約元本額	-円	42,864円

【三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年 5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	17
コール・ローン	-	511
親投資信託受益証券	6,791,702	8,469,847
流動資産合計	6,791,702	8,470,375
資産合計	6,791,702	8,470,375
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	339	1,188
未払委託者報酬	4,253	15,092
その他未払費用	51	243
流動負債合計	4,643	16,523
負債合計	4,643	16,523
純資産の部		
元本等		
元本	6,762,046	8,458,282
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	25,013	4,430
(分配準備積立金)	28,398	12,683
元本等合計	6,787,059	8,453,852
純資産合計	6,787,059	8,453,852
負債純資産合計	6,791,702	8,470,375

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	290,712
営業収益合計	290,712
営業費用	
受託者報酬	1,188
委託者報酬	15,092
その他費用	243
営業費用合計	16,523
営業利益又は営業損失 ()	307,235
経常利益又は経常損失 ()	307,235
中間純利益又は中間純損失 ()	307,235
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 ()	276,960
期首剰余金又は期首欠損金 ()	25,013
剰余金増加額又は欠損金減少額	36,970
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	36,970
剰余金減少額又は欠損金増加額	36,138
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	36,138
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 ()	4,430

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第2期中間計算期間 自 2021年12月1日 至 2022年5月31日
1. 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1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	6,762,046口	8,458,282口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	元本の欠損 4,430円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0037円 (1万口当たりの純資産額10,037円)	1口当たり純資産額 0.9995円 (1万口当たりの純資産額9,995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2期中間計算期間 (2022年5月31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	<p>(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。</p> <p>(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。</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

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1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
期首元本額	1,000,000円	6,762,046円
期中追加設定元本額	5,762,046円	11,676,509円
期中一部解約元本額	-円	9,980,273円

【三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年 5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	557	3,470
コール・ローン	16,443	103,616
親投資信託受益証券	1,592,763	6,110,656
流動資産合計	1,609,763	6,217,742
資産合計	1,609,763	6,217,742
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	86	554
未払委託者報酬	1,824	11,911
その他未払費用	-	146
流動負債合計	1,910	12,611
負債合計	1,910	12,611
純資産の部		
元本等		
元本	1,621,093	7,013,698
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	13,240	808,567
(分配準備積立金)	15,495	15,476
元本等合計	1,607,853	6,205,131
純資産合計	1,607,853	6,205,131
負債純資産合計	1,609,763	6,217,742

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	818,107
営業収益合計	818,107
営業費用	
受託者報酬	554
委託者報酬	11,911
その他費用	146
営業費用合計	12,611
営業利益又は営業損失()	830,718
経常利益又は経常損失()	830,718
中間純利益又は中間純損失()	830,718
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()	286
期首剰余金又は期首欠損金()	13,240
剰余金増加額又は欠損金減少額	35,167
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	35,167
剰余金減少額又は欠損金増加額	62
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	62
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()	808,567

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第2期中間計算期間	
	自 2021年12月1日 至 2022年5月31日	
1. 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1期	第2期中間計算期間
	(2021年11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,621,093口	7,013,698口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 13,240円	元本の欠損 808,567円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9918円 (1万口当たりの純資産額9,918円)	1口当たり純資産額 0.8847円 (1万口当たりの純資産額8,847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2期中間計算期間	
	(2022年5月31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	<p>(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。</p> <p>(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。</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

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1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
期首元本額	1,000,000円	1,621,093円
期中追加設定元本額	621,093円	5,400,834円
期中一部解約元本額	-円	8,229円

【三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年 5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	17
コール・ローン	-	496
親投資信託受益証券	2,143,958	5,765,673
流動資産合計	2,143,958	5,766,186
資産合計	2,143,958	5,766,186
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	98	708
未払委託者報酬	1,577	12,569
その他未払費用	-	61
流動負債合計	1,675	13,338
負債合計	1,675	13,338
純資産の部		
元本等		
元本	2,251,882	5,962,853
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	109,599	210,005
(分配準備積立金)	14,855	3,708
元本等合計	2,142,283	5,752,848
純資産合計	2,142,283	5,752,848
負債純資産合計	2,143,958	5,766,186

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	464,380
営業収益合計	464,380
営業費用	
受託者報酬	708
委託者報酬	12,569
その他費用	61
営業費用合計	13,338
営業利益又は営業損失()	477,718
経常利益又は経常損失()	477,718
中間純利益又は中間純損失()	477,718
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()	547,333
期首剰余金又は期首欠損金()	109,599
剰余金増加額又は欠損金減少額	369,739
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	369,739
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	539,760
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	539,760
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金()	210,005

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期中間計算期間 自 2021年12月1日 至 2022年5月31日
1. 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1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	2,251,882口	5,962,853口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 109,599円	元本の欠損 210,005円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9513円 (1万口当たりの純資産額9,513円)	1口当たり純資産額 0.9648円 (1万口当たりの純資産額9,648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2期中間計算期間 (2022年5月31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ぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</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

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1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
期首元本額	1,000,000円	2,251,882円
期中追加設定元本額	1,350,609円	14,038,349円
期中一部解約元本額	98,727円	10,327,378円

【三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年 5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	18
コール・ローン	-	523
親投資信託受益証券	2,307,225	12,391,724
流動資産合計	2,307,225	12,392,265
資産合計	2,307,225	12,392,265
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	96	978
未払委託者報酬	2,375	20,986
その他未払費用	-	209
流動負債合計	2,471	22,173
負債合計	2,471	22,173
純資産の部		
元本等		
元本	2,141,454	11,050,616
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	163,300	1,319,476
(分配準備積立金)	140,653	45,986
元本等合計	2,304,754	12,370,092
純資産合計	2,304,754	12,370,092
負債純資産合計	2,307,225	12,392,265

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	313,370
営業収益合計	313,370
営業費用	
受託者報酬	978
委託者報酬	20,986
その他費用	209
営業費用合計	22,173
営業利益又は営業損失()	335,543
経常利益又は経常損失()	335,543
中間純利益又は中間純損失()	335,543
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()	267,035
期首剰余金又は期首欠損金()	163,300
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,979,426
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	1,979,426
剰余金減少額又は欠損金増加額	754,742
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	754,742
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()	1,319,476

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期中間計算期間 自 2021年12月1日 至 2022年5月31日
1. 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1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	2,141,454口	11,050,616口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0763円 (1万口当たりの純資産額10,763円)	1口当たり純資産額 1.1194円 (1万口当たりの純資産額11,194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2期中間計算期間 (2022年5月31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	<p>(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。</p> <p>(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。</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 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。</p>

(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1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
期首元本額	1,000,000円	2,141,454円
期中追加設定元本額	1,141,454円	18,169,611円
期中一部解約元本額	-円	9,260,449円

【三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年 5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,958	8,553
コール・ローン	57,733	255,386
親投資信託受益証券	37,285,529	97,359,758
派生商品評価勘定	217,702	625,147
未収入金	15,187	132,254
流動資産合計	37,578,109	98,381,098
資産合計	37,578,109	98,381,098
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	829	7,374
未払委託者報酬	14,041	122,467
その他未払費用	210	2,111
流動負債合計	15,080	131,952
負債合計	15,080	131,952
純資産の部		
元本等		
元本	38,535,757	97,902,091
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	972,728	347,055
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	37,563,029	98,249,146
純資産合計	37,563,029	98,249,146
負債純資産合計	37,578,109	98,381,098

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	9,383,003
為替差損益	11,768,414
営業収益合計	2,385,411
営業費用	
受託者報酬	7,374
委託者報酬	122,467
その他費用	2,111
営業費用合計	131,952
営業利益又は営業損失()	2,517,363
経常利益又は経常損失()	2,517,363
中間純利益又は中間純損失()	2,517,363
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()	994,489
期首剰余金又は期首欠損金()	972,728
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,321,170
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	6,321,170
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,489,535
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,489,535
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()	347,055

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第2期中間計算期間	
	自 2021年12月1日 至 2022年5月31日	
1. 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>	
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 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>	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期中間計算期間
	(2021年11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	38,535,757口	97,902,091口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 972,728円	元本の欠損
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9748円 (1万口当たりの純資産額9,748円)	1口当たり純資産額 1.0035円 (1万口当たりの純資産額10,035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2期中間計算期間	
	(2022年5月31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ぬ。	

2. 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</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 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。</p>
------------	--

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2021年11月30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 売建				
	アメリカ・ドル	40,145,441	-	39,927,739	217,702
	小計	40,145,441	-	39,927,739	217,702
合計		40,145,441	-	39,927,739	217,702

第2期中間計算期間(2022年5月31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 売建				
	アメリカ・ドル	96,109,130	-	95,483,983	625,147
	小計	96,109,130	-	95,483,983	625,147
合計		96,109,130	-	95,483,983	625,147

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1) 中間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
に評価しております。

中間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おります。

中間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おります。

- ・ 中間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おります。
- ・ 中間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おります。

2) 中間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、中間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。

(その他の注記)

項目	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期中間計算期間 (2022年5月31日現在)
期首元本額	1,000,000円	38,535,757円
期中追加設定元本額	37,535,757円	100,023,888円
期中一部解約元本額	-円	40,657,554円

(参考)

「三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド」、「三井住友DS・日経225インデックス・ファンド」、「三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド」、「三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド」、「三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド」、「三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド」、「三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド」、「三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド」および「三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「225マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」および「ゴールド・インデックス・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。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	103,624,846	154,706,222
コール・ローン	3,056,237,624	4,619,352,015
株式	192,569,963,990	201,777,267,100
派生商品評価勘定	-	40,810,200
未収入金	-	1,298,464,523
未収配当金	1,330,297,687	2,282,887,515
前払金	133,950,000	-
差入委託証拠金	165,240,000	228,540,000
流動資産合計	197,359,314,147	210,402,027,575
資産合計	197,359,314,147	210,402,027,575
負債の部		

流動負債		
派生商品評価勘定	261,119,400	73,476,000
前受金	-	16,900,000
未払金	19,827,373	2,826,694,788
未払解約金	24,033,101	153,428,686
その他未払費用	14,521	9,022
流動負債合計	304,994,395	3,070,508,496
負債合計	304,994,395	3,070,508,496
純資産の部		
元本等		
元本	61,173,269,127	63,989,525,282
剰余金		
剰余金又は欠損金()	135,881,050,625	143,341,993,797
元本等合計	197,054,319,752	207,331,519,079
純資産合計	197,054,319,752	207,331,519,079
負債純資産合計	197,359,314,147	210,402,027,575

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年12月1日 至 2022年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 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、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	61,173,269,127口	63,989,525,282口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.2212円 (1万口当たりの純資産額32,212円)	1口当たり純資産額 3.2401円 (1万口当たりの純資産額32,401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	(2022年5月31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(株式) 「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11月30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	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0312 月	5,076,959,400	-	4,815,840,000	261,119,400
	小計	5,076,959,400	-	4,815,840,000	261,119,400
合計		5,076,959,400	-	4,815,840,000	261,119,400

(2022年5月31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	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0406 月	5,339,685,800	-	5,307,020,000	32,665,800

	小計	5,339,685,800	-	5,307,020,000	32,665,800
	合計	5,339,685,800	-	5,307,020,000	32,665,800

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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。

(その他の注記)

(2021年11月30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	60,972,880,728円
同期中における追加設定元本額	3,082,168,879円
同期中における一部解約元本額	2,881,780,480円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,444,432,886円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	893,111,379円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,314,610,252円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,302,572,824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)	123,293,850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)	4,679,600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)	20,378,358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)	62,968,056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)	145,617,764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)	123,379,159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)	223,865,395円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,383,108,545円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	18,142,394,620円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	277,082,196円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	326,588,940円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	215,307,143円
イオン・バランス戦略ファンド	14,508,106円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	29,487,863円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	154,290,540円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	142,287,008円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	489,286,600円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	261,074,601円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	295,921,518円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	33,623,909円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	440,586,720円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	14,302,327円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	71,078,321円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	69,299,615円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	4,018,342円

日興FWS・日本株インデックス	300,009,523円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	1,878,586円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,839,797,359円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	12,523,734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 >	108,824,691円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	1,852,669,865円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,648,623,694円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	6,291,332,987円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	41,040,556円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	166,358,728円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	748,263,991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 >	46,344,355円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	259,277,705円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	856,981,897円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	603,670,244円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	1,898,722,676円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	374,931円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	42,261,700円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	47,434,130円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	34,163,089円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	16,669,461円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	115,063,306円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	248,882,682円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	61,933,489円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 >	39,574,438円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 < 適格機関投資家専用 >	7,375,595円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 < 適格機関投資家専用 >	45,508,490円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	613,464,436円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	180,359,966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 >	237,022,466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 >	110,132,461円
SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	259,324,316円
SMAM・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	64,476,018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 >	37,709,634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 >	55,155,389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 >	59,877,017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 >	197,029,085円
合 計	61,173,269,127円

(2022年5月31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	61,173,269,127円
同期中における追加設定元本額	6,291,564,611円
同期中における一部解約元本額	3,475,308,456円
2022年5月31日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,599,609,167円

三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	995,516,913円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,607,440,840円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,511,632,551円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	125,843,304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)	4,863,197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)	20,324,896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)	63,203,974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)	161,621,153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)	140,785,746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)	254,417,415円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,493,969,651円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	20,085,749,456円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	144,761,601円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	231,330,362円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	152,943,467円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	33,540,479円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	181,464,889円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	167,701,831円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	594,392,460円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	323,168,780円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	370,438,645円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	42,620,339円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	668,127,751円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	32,165,016円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	157,626,358円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	147,522,966円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,205,337円
日興FWS・日本株インデックス	630,597,093円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	5,569,198円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,722,169,965円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	12,950,438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>	97,797,524円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,735,460,998円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,635,544,848円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	6,136,650,665円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	40,603,584円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	160,105,696円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	726,192,897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>	46,826,720円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	257,810,451円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	839,187,037円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	607,019,790円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	1,869,418,581円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	374,931円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	42,725,221円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	47,564,568円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	34,436,924円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	16,874,370円

SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	113,224,715円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	245,176,007円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	60,167,696円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	41,090,482円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,593,251円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	44,249,093円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	600,492,742円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	177,889,885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>	219,118,429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>	101,339,489円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	153,343,180円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	55,617,287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>	37,502,365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>	37,168,635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>	47,564,418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>	49,608,242円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	15,509,323円
合計	63,989,525,282円

2.2.5 マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	137,347,416	75,858,521
コール・ローン	4,050,827,173	2,265,049,256
株式	97,883,970,640	114,884,501,240
派生商品評価勘定	-	100,515,500
未収入金	-	22,899,400
未収配当金	527,630,760	881,156,576
前払金	128,810,000	-
差入委託証拠金	47,138,000	65,170,000
流動資産合計	102,775,723,989	118,295,150,493
資産合計	102,775,723,989	118,295,150,493
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	255,324,100	-
前受金	-	138,480,000
未払解約金	6,001,902	694,121,836
その他未払費用	9,485	9,127
流動負債合計	261,335,487	832,610,963
負債合計	261,335,487	832,610,963
純資産の部		

元本等		
元本	28,339,379,860	32,740,578,439
剰余金		
剰余金又は欠損金()	74,175,008,642	84,721,961,091
元本等合計	102,514,388,502	117,462,539,530
純資産合計	102,514,388,502	117,462,539,530
負債純資産合計	102,775,723,989	118,295,150,493

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年12月1日 至 2022年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 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、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
1. 担保資産	<p>デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 674,000,000円</p>	<p>デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 619,500,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	28,339,379,860口	32,740,578,439口

3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.6174円 (1万口当たりの純資産額36,174円)	1口当たり純資産額 3.5877円 (1万口当たりの純資産額35,877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	(2022年5月31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(株式) 「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11月30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	株価指数先物取引 買建				
	NK225 先物 0312 月	4,870,284,100	-	4,614,960,000	255,324,100
	小計	4,870,284,100	-	4,614,960,000	255,324,100
合計		4,870,284,100	-	4,614,960,000	255,324,100

(2022年5月31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	株価指数先物取引 買建				
	NK225 先物 0406 月	2,489,184,500	-	2,589,700,000	100,515,500
	小計	2,489,184,500	-	2,589,700,000	100,515,500
合計		2,489,184,500	-	2,589,700,000	100,515,500

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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。

(その他の注記)

(2021年11月30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	29,682,506,040円
同期中における追加設定元本額	3,707,289,842円
同期中における一部解約元本額	5,050,416,022円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・225オープン	25,535,238,425円
三井住友・DC年金日本株式225ファンド	2,411,662,592円
SMB C・DCインデックスファンド(日経225)	281,684,884円
三井住友DS・日経225インデックス・ファンド	19,228,634円
日本株式225ファンドVA<適格機関投資家専用>	91,565,325円
合計	28,339,379,860円

(2022年5月31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	28,339,379,860円
同期中における追加設定元本額	8,136,551,622円
同期中における一部解約元本額	3,735,353,043円
2022年5月31日現在の元本の内訳	
三井住友・225オープン	29,785,208,918円
三井住友・DC年金日本株式225ファンド	2,384,634,396円
SMB C・DCインデックスファンド(日経225)	442,840,930円
三井住友DS・日経225インデックス・ファンド	31,108,918円
日本株式225ファンドVA<適格機関投資家専用>	96,785,277円
合計	32,740,578,439円

外国株式インデックス・マザーファンド

(1)貸借対照表

(単位:円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,811,427,167	6,305,931,026
金銭信託	42,505,540	129,320,805
コール・ローン	1,253,628,220	3,861,372,302
株式	338,023,942,089	353,819,244,960

投資証券	8,338,643,304	9,275,049,422
派生商品評価勘定	37,540,884	371,221,452
未収入金	12,431,617	7,125,808
未収配当金	378,251,525	583,529,375
差入委託証拠金	2,070,129,203	4,342,113,208
流動資産合計	353,968,499,549	378,694,908,358
資産合計	353,968,499,549	378,694,908,358
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	68,909,977	200,896,489
未払解約金	81,347,754	2,915,877
その他未払費用	5,026	2,669
流動負債合計	150,262,757	203,815,035
負債合計	150,262,757	203,815,035
純資産の部		
元本等		
元本	60,650,874,522	63,893,078,652
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	293,167,362,270	314,598,014,671
元本等合計	353,818,236,792	378,491,093,323
純資産合計	353,818,236,792	378,491,093,323
負債純資産合計	353,968,499,549	378,694,908,358

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年12月1日 至 2022年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資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>

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 先物取引 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、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (2) 為替予約取引 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。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	60,650,874,522口	63,893,078,652口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 5.8337円 (1万口当たりの純資産額58,337円)	1口当たり純資産額 5.9238円 (1万口当たりの純資産額59,238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	(2022年5月31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(株式、投資証券) 「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11月30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		
	株価指数先物取引 買建				

市場取引	S&P 500 EMINI FUT DEC21	5,874,650,474	-	5,899,958,611	25,308,137
	SPI 200 FUTURES DEC21	254,521,022	-	249,231,076	5,289,946
	FTSE 100 IDX FUT DEC21	329,071,619	-	323,504,820	5,566,799
	EURO STOXX 50 DEC21	1,184,808,252	-	1,138,863,154	45,945,098
	小計	7,643,051,367	-	7,611,557,661	31,493,706
合 計		7,643,051,367	-	7,611,557,661	31,493,706

(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					
	アメリカ・ドル	952,169,526	-	952,205,922	36,396	
	カナダ・ドル	41,953,946	-	41,950,840	3,106	
	オーストラリア・ ドル	28,422,056	-	28,450,989	28,933	
	香港・ドル	7,003,200	-	7,002,864	336	
	シンガポール・ド ル	3,321,476	-	3,328,212	6,736	
	ニュージーラン ド・ドル	775,611	-	775,253	358	
	イギリス・ポンド	43,988,230	-	43,952,400	35,830	
	スイス・フラン	30,751,765	-	30,813,540	61,775	
	デンマーク・ク ローネ	7,079,634	-	7,080,999	1,365	
	ノルウェー・ク ローネ	1,893,189	-	1,891,392	1,797	
	スウェーデン・ク ローナ	10,871,469	-	10,901,754	30,285	
	ユーロ	136,120,067	-	136,120,617	550	
	小計	1,264,350,169	-	1,264,474,782	124,613	
	合 計		1,264,350,169	-	1,264,474,782	124,613

(2022年5月31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		
	株価指数先物取引 買建				

市場取引	S&P 500 EMINI FUT JUN22	11,614,382,035	-	11,641,870,259	27,488,224
	SPI 200 FUTURES JUN22	596,642,861	-	603,697,725	7,054,864
	FTSE 100 IDX FUT JUN22	698,750,628	-	712,240,603	13,489,975
	EURO STOXX 50 JUN22	2,204,486,491	-	2,290,563,072	86,076,581
	小計	15,114,262,015	-	15,248,371,659	134,109,644
	合計	15,114,262,015	-	15,248,371,659	134,109,644

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1) 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

- 2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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。

(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					
	アメリカ・ドル	2,931,783,284	-	2,957,607,100	25,823,816	
	カナダ・ドル	158,518,959	-	160,737,807	2,218,848	
	オーストラリア・ドル	118,165,900	-	119,531,010	1,365,110	
	香港・ドル	22,492,841	-	22,698,700	205,859	
	シンガポール・ドル	15,760,731	-	15,907,480	146,749	
	ニュージーランド・ドル	2,484,194	-	2,512,883	28,689	
	イギリス・ポンド	139,533,347	-	140,725,980	1,192,633	
	イスラエル・シケル	7,576,060	-	7,682,774	106,714	
	スイス・フラン	127,255,848	-	128,114,032	858,184	
	デンマーク・クローネ	31,528,208	-	31,854,400	326,192	
	ノルウェー・クローネ	10,027,591	-	10,184,199	156,608	
	スウェーデン・クローナ	37,354,350	-	37,915,313	560,963	
	ユーロ	398,967,269	-	402,264,690	3,297,421	
	小計	4,001,448,582	-	4,037,736,368	36,287,786	
		売建				

カナダ・ドル	46,501,492	-	46,500,020	1,472
香港・ドル	17,572,628	-	17,636,400	63,772
シンガポール・ドル	4,678,280	-	4,678,400	120
ニュージーランド・ドル	837,601	-	837,570	31
イギリス・ポンド	4,851,510	-	4,851,720	210
イスラエル・シケル	1,919,960	-	1,920,675	715
スイス・フラン	36,030,366	-	36,032,580	2,214
デンマーク・クローネ	8,887,680	-	8,889,600	1,920
ノルウェー・クローネ	2,850,435	-	2,851,380	945
スウェーデン・クローナ	12,721,356	-	12,725,430	4,074
小計	136,851,308	-	136,923,775	72,467
合計	4,138,299,890	-	4,174,660,143	36,215,319

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 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おります。

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おります。

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おります。

- ・ 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おります。
- ・ 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おります。

- 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。

(その他の注記)

(2021年11月30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	58,935,911,745円
同期中における追加設定元本額	3,825,327,501円
同期中における一部解約元本額	2,110,364,724円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	31,877,680,130円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	257,237,232円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,092,113,150円

三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	759,876,748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)	63,296,820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)	1,131,648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)	5,750,140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)	17,334,902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)	47,583,616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)	49,206,031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)	93,432,630円
外国株式指数ファンド	762,591,588円
三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	12,154,970,474円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	136,154,453円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	161,478,755円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	106,177,098円
イオン・バランス戦略ファンド	26,039,960円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	15,113,153円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	110,598,046円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	97,319,132円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	330,128,909円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	170,705,412円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	195,254,066円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	38,559,109円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	509,621,059円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	4,097,387円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	17,354,910円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	15,630,593円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,093,613円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	110,450,992円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	67,713,873円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	281,821,366円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	12,792,410円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	591,445,429円
バランスファンドV A(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	3,447,518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 >	32,980,346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 >	704,179,317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 >	824,854,056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 >	3,604,698,411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 >	12,109,077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 >	64,600,386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 >	508,707,107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 >	41,029,721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 >	102,099,408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 >	495,008,013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 >	350,695,262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 >	829,398,471円
S M A M・バランスV A株40T < 適格機関投資家限定 >	218,848円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	218,605,667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 >	75,145,593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 >	8,737,379円

SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	7,911,776円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	4,096,558円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	21,448,701円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	60,189,060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>	139,958,110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>	63,429,174円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	817,767,596円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	118,979,244円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,028,620,924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>	27,233,124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>	37,994,675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>	41,244,635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>	222,731,531円
合計	60,650,874,522円

(2022年5月31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	60,650,874,522円
同期中における追加設定元本額	9,324,906,937円
同期中における一部解約元本額	6,082,702,807円
2022年5月31日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	33,584,093,674円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	272,811,765円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,094,023,796円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	775,509,506円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	49,252,219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)	1,104,286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)	5,682,147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)	17,305,686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)	49,672,580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)	53,170,579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)	102,869,280円
外国株式指数ファンド	874,797,421円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	14,923,674,519円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	94,042,185円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	103,195,277円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	68,329,125円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	17,328,784円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	129,331,449円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	113,342,304円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	400,112,564円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	209,797,657円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	239,919,074円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	46,618,189円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	998,769,234円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	8,940,967円

三井住友DS・年金バランス50(標準型)	37,976,035円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	33,149,339円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,125,649円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	192,150,047円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	170,508,975円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	590,176,445円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	23,613,832円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	512,042,358円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	3,622,924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 >	25,733,245円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	626,582,088円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	761,306,939円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	3,282,197,681円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	10,511,330円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	58,006,272円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	446,117,555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 >	38,436,652円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	93,355,655円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	446,020,881円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	324,413,552円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	752,474,171円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	200,225円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	212,224,821円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	69,019,737円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	8,668,847円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	7,431,222円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	3,930,927円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	20,254,181円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	56,182,302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 >	119,636,449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 >	54,302,922円
SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	475,816,891円
SMAM・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	95,595,584円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA < 適格機関投資家限定 >	13,534,301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 >	16,956,488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 >	16,673,961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 >	21,337,580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 >	37,096,322円
合計	63,893,078,652円

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2021年11月30日現在)

(2022年5月31日現在)

資産の部

流動資産		
預金	526,830,782	3,483,239,996
金銭信託	148,804,249	3,430,329
コール・ローン	4,388,726,863	102,425,724
株式	9,917,488,534	13,914,860,878
新株予約権証券	15,618	-
投資信託受益証券	609,236,472	788,034,960
投資証券	1,160,702,755	1,310,037,272
派生商品評価勘定	95,588,547	296,710,074
未収入金	81,341	62,899
未収配当金	6,023,917	37,217,505
差入委託証拠金	1,095,136,406	1,104,462,396
流動資産合計	17,948,635,484	21,040,482,033
資産合計	17,948,635,484	21,040,482,033
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	399,979,043	71,333,572
その他未払費用	19,220	3,425
流動負債合計	399,998,263	71,336,997
負債合計	399,998,263	71,336,997
純資産の部		
元本等		
元本	10,481,267,749	12,568,163,433
剰余金		
剰余金又は欠損金()	7,067,369,472	8,400,981,603
元本等合計	17,548,637,221	20,969,145,036
純資産合計	17,548,637,221	20,969,145,036
負債純資産合計	17,948,635,484	21,040,482,033

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年12月1日 至 2022年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資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>

	(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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 先物取引 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、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (2) 為替予約取引 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。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	10,481,267,749口	12,568,163,433口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6743円 (1万口当たりの純資産額16,743円)	1口当たり純資産額 1.6684円 (1万口当たりの純資産額16,684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	(2022年5月31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(株式、投資信託受益証券、投資証券) 「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11月30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)

	契 約 額 等	
--	---------	--

区 分	種 類		うち		時 価	評 価 損 益
			1 年超			
市場取引	株価指数先物取引 買建					
	MSCIE 2112	6,380,573,149	-	5,988,815,825	391,757,324	
	小計	6,380,573,149	-	5,988,815,825	391,757,324	
合 計		6,380,573,149	-	5,988,815,825	391,757,324	

(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				
	アメリカ・ドル	7,983,376,975	-	8,071,411,706	88,034,731
	小計	7,983,376,975	-	8,071,411,706	88,034,731
	売建				
	アメリカ・ドル	3,329,000,000	-	3,329,667,903	667,903
	小計	3,329,000,000	-	3,329,667,903	667,903
合 計		11,312,376,975	-	11,401,079,609	87,366,828

(2022年5月31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	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT JUN22	4,945,028,930	-	4,947,900,834	2,871,904
	小計	4,945,028,930	-	4,947,900,834	2,871,904
合 計		4,945,028,930	-	4,947,900,834	2,871,904

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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。

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1 年超		
	為替予約取引 買建				

市場取引 以外の取引	アメリカ・ドル	3,054,900,000	-	3,307,112,238	252,212,238
	小計	3,054,900,000	-	3,307,112,238	252,212,238
	売建				
	アメリカ・ドル	2,955,000,000	-	2,984,707,640	29,707,640
	小計	2,955,000,000	-	2,984,707,640	29,707,640
合 計		6,009,900,000	-	6,291,819,878	222,504,598

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 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おります。

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おります。

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おります。

- ・ 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おります。
- ・ 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おります。

- 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。

(その他の注記)

(2021年11月30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	8,871,955,436円
同期中における追加設定元本額	1,737,420,987円
同期中における一部解約元本額	128,108,674円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	5,579,019,461円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,537,014,239円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	281,123,454円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	347,001,173円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	231,807,511円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	25,823,557円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	75,281,661円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	55,223,465円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	223,853,475円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	174,716,658円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	286,040,332円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	64,850,516円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,488,528円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	188,448,982円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	358,795,181円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	1,807,891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>	46,971,665円
合 計	10,481,267,749円

(2022年5月31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	10,481,267,749円
同期中における追加設定元本額	3,250,542,417円
同期中における一部解約元本額	1,163,646,733円
2022年5月31日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	6,972,387,005円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,772,428,545円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	44,385,580円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	237,701,767円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	157,541,199円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	30,355,780円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	90,118,390円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	66,295,514円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	281,248,937円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	219,343,010円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	361,717,836円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	81,727,704円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,688,580円
日興F W S・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	429,910,675円
日興F W S・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	749,064,746円
三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド	5,878,719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>	64,369,446円
合 計	12,568,163,433円

外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	396,577,581	452,806,050
金銭信託	32,775,079	31,599,488
コール・ローン	966,644,903	943,524,826
国債証券	158,467,947,570	152,952,319,978
未収入金	160,000,000	-
未収利息	923,046,863	932,827,356
前払費用	27,752,110	45,232,105
流動資産合計	160,974,744,106	155,358,309,803
資産合計	160,974,744,106	155,358,309,803
負債の部		

流動負債		
未払解約金	64,889,630	104,105,777
その他未払費用	4,621	1,128
流動負債合計	64,894,251	104,106,905
負債合計	64,894,251	104,106,905
純資産の部		
元本等		
元本	81,104,632,252	78,316,093,812
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	79,805,217,603	76,938,109,086
元本等合計	160,909,849,855	155,254,202,898
純資産合計	160,909,849,855	155,254,202,898
負債純資産合計	160,974,744,106	155,358,309,803

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年12月1日 至 2022年5月31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11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	81,104,632,252口	78,316,093,812口

2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9840円 (1万口当たりの純資産額19,840円)	1口当たり純資産額 1.9824円 (1万口当たりの純資産額19,824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	(2022年5月31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)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2021年11月30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	81,286,495,969円
同期中における追加設定元本額	2,319,084,008円
同期中における一部解約元本額	2,500,947,725円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	24,425,521,726円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	758,942,184円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,105,125,950円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,117,964,664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)	157,128,366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)	6,821,569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)	30,281,532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)	100,943,914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)	215,135,121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)	146,946,116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)	249,088,888円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	25,674,124円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	85,391,716円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	109,913,482円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	77,222,607円
イオン・バランス戦略ファンド	49,411,643円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	16,988,179円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	66,333,551円

三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	48,301,118円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	117,660,697円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	33,967,007円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	16,515,743円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	115,080,948円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	216,500,817円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	12,164,325円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	34,944,842円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	23,626,754円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,299,105円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	127,761,903円
三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド	3,423,237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>	2,393,064,796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>	44,105,389円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	7,457,552,993円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,630,256,069円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	10,737,712,617円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	35,392,217円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	93,650,011円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	726,204,731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>	117,631,749円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,068,564,548円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,446,325,136円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,571,810,158円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,949,497,571円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	632,409円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,245,225,547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)	334,892,322円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	150,359,802円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	81,241,152円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	34,472,321円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,926,289円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	97,489,920円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	426,754,581円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	106,160,593円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	40,181,590円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,252,180円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,054,447,345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>	661,340,146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>	960,695,213円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,204,599,718円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	418,833,625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>	12,768,298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>	141,011,485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>	245,134,628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>	265,817,919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 >	836,545,356円
合計	81,104,632,252円

(2022年5月31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	81,104,632,252円
同期中における追加設定元本額	6,627,782,688円
同期中における一部解約元本額	9,416,321,128円

2022年5月31日現在の元本の内訳

三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	24,636,084,797円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	797,136,312円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,119,967,555円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,142,786,394円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	111,246,462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)	6,858,538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)	28,879,319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)	92,905,185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)	234,031,345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)	163,598,431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)	266,179,121円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,119,667円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	50,990,976円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	75,940,895円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	53,017,014円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	18,375,396円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	72,121,077円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	53,888,072円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	135,410,586円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	39,751,458円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	19,537,692円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	136,173,828円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	437,166,453円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	25,873,542円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	70,168,333円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	45,914,509円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,254,116円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	231,085,682円
三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド	4,272,522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>	3,826,906,617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>	40,032,740円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	6,616,916,201円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,311,315,267円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	9,866,342,502円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	31,983,066円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	87,983,369円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	663,446,371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>	115,704,535円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,014,133,750円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,346,183,499円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,498,185,077円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,528,496,145円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	627,347円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	7,711,582,808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)	314,787,947円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	137,232,983円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	78,444,198円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	33,971,193円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,926,289円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	95,205,741円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	404,375,583円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	96,817,965円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	39,422,989円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,201,986円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	983,584,861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>	577,077,596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>	847,744,078円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	663,214,952円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	328,997,537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>	188,976,076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>	188,538,327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>	241,742,626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>	324,256,314円
合計	78,316,093,812円

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	27,046,991	27,875,560
金銭信託	1,124,192	283,797
コール・ローン	33,156,127	8,473,853
国債証券	1,001,457,353	1,083,665,024
派生商品評価勘定	45,617	60,500
未収利息	5,539,151	9,416,591
前払費用	4,001,235	1,184,072
流動資産合計	1,072,370,666	1,130,959,397
資産合計	1,072,370,666	1,130,959,397
負債の部		
流動負債		

未払金	26,565,295	-
その他未払費用	90	2
流動負債合計	26,565,385	2
負債合計	26,565,385	2
純資産の部		
元本等		
元本	1,047,048,040	1,266,789,857
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,242,759	135,830,462
元本等合計	1,045,805,281	1,130,959,395
純資産合計	1,045,805,281	1,130,959,395
負債純資産合計	1,072,370,666	1,130,959,397

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年12月1日 至 2022年5月31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11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,047,048,040口	1,266,789,857口

2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 1,242,759円	元本の欠損 135,830,462円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9988円 (1万口当たりの純資産額9,988円)	1口当たり純資産額 0.8928円 (1万口当たりの純資産額8,928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	(2022年5月31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11月30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 アメリカ・ドル	32,946,900	-	32,992,517	45,617
	小計	32,946,900	-	32,992,517	45,617
	合計	32,946,900	-	32,992,517	45,617

(2022年5月31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 アメリカ・ドル	6,349,750	-	6,410,250	60,500
	小計	6,349,750	-	6,410,250	60,500
	合計	6,349,750	-	6,410,250	60,500

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 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おります。

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おります。

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おります。

- ・ 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おります。
- ・ 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おります。

- 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。

(その他の注記)

(2021年11月30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	499,583,536円
同期中における追加設定元本額	555,508,748円
同期中における一部解約元本額	8,044,244円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)	639,603,666円
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)	405,849,697円
三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド	1,594,677円
合計	1,047,048,040円

(2022年5月31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	1,047,048,040円
同期中における追加設定元本額	559,985,296円
同期中における一部解約元本額	340,243,479円
2022年5月31日現在の元本の内訳	
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)	508,285,147円
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)	751,660,337円
三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド	6,844,373円
合計	1,266,789,857円

Jリート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2021年11月30日現在)

(2022年5月31日現在)

資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,726,735	2,313,111
コール・ローン	139,406,953	69,066,876
投資証券	8,552,350,950	8,739,372,400
派生商品評価勘定	-	2,915,600
未収配当金	47,699,981	53,357,173
前払金	2,534,000	-
差入委託証拠金	1,930,000	2,330,000
流動資産合計	8,748,648,619	8,869,355,160
資産合計	8,748,648,619	8,869,355,160
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,918,400	-
前受金	-	2,830,000
未払金	69,676,777	37,195,303
未払解約金	9,270,489	2,000,000
その他未払費用	1,079	175
流動負債合計	81,866,745	42,025,478
負債合計	81,866,745	42,025,478
純資産の部		
元本等		
元本	3,284,744,165	3,273,561,133
剰余金		
剰余金又は欠損金()	5,382,037,709	5,553,768,549
元本等合計	8,666,781,874	8,827,329,682
純資産合計	8,666,781,874	8,827,329,682
負債純資産合計	8,748,648,619	8,869,355,160

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年12月1日 至 2022年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資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>

	(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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 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、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,284,744,165口	3,273,561,133口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6385円 (1万口当たりの純資産額26,385円)	1口当たり純資産額 2.6966円 (1万口当たりの純資産額26,966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	(2022年5月31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(投資証券) 「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11月30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	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物 0312 月	42,968,400	-	40,050,000	2,918,400
	小計	42,968,400	-	40,050,000	2,918,400

合計	42,968,400	-	40,050,000	2,918,400
----	------------	---	------------	-----------

(2022年5月31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	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物 0406 月	37,204,400	-	40,120,000	2,915,600
	小計	37,204,400	-	40,120,000	2,915,600
合計		37,204,400	-	40,120,000	2,915,600

(注) 1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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。

(その他の注記)

(2021年11月30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	2,771,760,223円
同期中における追加設定元本額	791,184,769円
同期中における一部解約元本額	278,200,827円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	148,899,827円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	246,919,552円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	162,217,084円
イオン・バランス戦略ファンド	19,849,872円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,775,302,683円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	12,694,289円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	48,810,703円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	35,714,617円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	116,382,487円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	62,651,196円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	48,724,686円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	20,933,583円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,714,624円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	49,584,329円
日興FWS・Jリートインデックス	96,669,288円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	812,567円

SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,569,920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>	23,646,493円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	59,278,592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>	79,044,868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>	85,607,210円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	184,715,695円
合計	3,284,744,165円

(2022年5月31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	3,284,744,165円
同期中における追加設定元本額	1,021,774,165円
同期中における一部解約元本額	1,032,957,197円
2022年5月31日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	74,332,453円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	144,802,192円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	113,294,756円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,991,200,805円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	13,941,560円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	54,772,280円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	40,771,712円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	135,968,837円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	74,606,058円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	58,817,013円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	25,287,650円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,729,162円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	62,699,347円
日興FWS・Jリートインデックス	188,522,272円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	2,138,127円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,536,609円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	50,907,196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>	50,133,910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>	63,706,465円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	122,392,729円
合計	3,273,561,133円

外国リート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2021年11月30日現在)

(2022年5月31日現在)

資産の部
流動資産

預金	99,344,009	155,743,773
金銭信託	2,954,229	3,483,453
コール・ローン	87,129,944	104,011,935
投資証券	17,620,715,349	22,211,943,489
派生商品評価勘定	13,752	910,563
未収入金	865,289	2,067,754
未収配当金	22,724,956	29,372,324
流動資産合計	17,833,747,528	22,507,533,291
資産合計	17,833,747,528	22,507,533,291
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,782	-
その他未払費用	482	250
流動負債合計	4,264	250
負債合計	4,264	250
純資産の部		
元本等		
元本	6,336,539,299	7,627,953,702
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	11,497,203,965	14,879,579,339
元本等合計	17,833,743,264	22,507,533,041
純資産合計	17,833,743,264	22,507,533,041
負債純資産合計	17,833,747,528	22,507,533,291

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年12月1日 至 2022年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資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>

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 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。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	6,336,539,299口	7,627,953,702口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.8144円 (1万口当たりの純資産額28,144円)	1口当たり純資産額 2.9507円 (1万口当たりの純資産額29,507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	(2022年5月31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(投資証券) 「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11月30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	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	69,000,000	-	69,002,662	2,662
	カナダ・ドル	1,500,000	-	1,499,857	143
	オーストラリア・ドル	4,800,000	-	4,806,426	6,426

外の取引	シンガポール・ドル	2,300,000	-	2,304,664	4,664
	イギリス・ポンド	4,300,000	-	4,296,374	3,626
	ユーロ	3,200,000	-	3,199,987	13
	小計	85,100,000	-	85,109,970	9,970
	合計	85,100,000	-	85,109,970	9,970

(2022年5月31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				
	アメリカ・ドル	73,300,000	-	73,987,166	687,166
	カナダ・ドル	2,200,000	-	2,232,564	32,564
	オーストラリア・ドル	6,200,000	-	6,291,711	91,711
	香港・ドル	1,100,000	-	1,110,149	10,149
	シンガポール・ドル	3,300,000	-	3,332,331	32,331
	イギリス・ポンド	4,100,000	-	4,135,302	35,302
	ユーロ	2,000,000	-	2,021,340	21,340
	小計	92,200,000	-	93,110,563	910,563
	合計	92,200,000	-	93,110,563	910,563

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 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おります。

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おります。

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おります。

- ・ 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おります。
- ・ 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おります。

- 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。

(その他の注記)

(2021年11月30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	5,762,256,649円
同期中における追加設定元本額	741,440,225円
同期中における一部解約元本額	167,157,575円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	19,396,868円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	21,022,305円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	15,960,970円
イオン・バランス戦略ファンド	50,669,415円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	5,353,435,552円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	4,309,173円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	47,287,876円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	34,006,806円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	110,231,658円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	59,478,823円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	46,479,633円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	60,151,937円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	593,880円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	105,121,312円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	29,066,138円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	88,855,201円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	819,793円
S M A M・世界リート・インデックスファンドV A <適格機関投資家限定>	49,064,588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>	27,536,734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>	36,234,944円
S M D A M・リスクコントロール型バランスファンド2021 05(リスク3%)<適格機関投資家限定>	176,815,693円
合計	6,336,539,299円

(2022年5月31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	6,336,539,299円
同期中における追加設定元本額	1,887,393,068円
同期中における一部解約元本額	595,978,665円
2022年5月31日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	13,654,762円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	15,848,872円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	10,883,264円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	6,653,389,914円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	4,693,552円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	50,724,245円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	36,847,018円

三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	125,605,082円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	67,585,385円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	52,163,859円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	69,039,904円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	551,319円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	145,055,192円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	66,086,916円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	175,411,572円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	4,199,588円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	37,704,606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>	30,641,662円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	67,866,990円
合計	7,627,953,702円

ゴールド・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	63,327,388	14,325,918
金銭信託	553,062	777,061
コール・ローン	16,311,621	23,202,150
投資信託受益証券	876,932,357	1,807,336,741
派生商品評価勘定	2,425	63
流動資産合計	957,126,853	1,845,641,933
資産合計	957,126,853	1,845,641,933
負債の部		
流動負債		
未払金	95,212,463	9,494,207
未払解約金	15,187	132,254
その他未払費用	55	39
流動負債合計	95,227,705	9,626,500
負債合計	95,227,705	9,626,500
純資産の部		
元本等		
元本	864,264,346	1,577,567,434
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,365,198	258,447,999
元本等合計	861,899,148	1,836,015,433
純資産合計	861,899,148	1,836,015,433
負債純資産合計	957,126,853	1,845,641,933

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年12月1日 至 2022年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>
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 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 「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11月30日現在)	(2022年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	864,264,346口	1,577,567,434口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 2,365,198円	元本の欠損
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9973円 (1万口当たりの純資産額9,973円)	1口当たり純資産額 1.1638円 (1万口当たりの純資産額11,638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	(2022年5月31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(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。

	<p>(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。</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 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。</p>
--	--

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30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 アメリカ・ドル	41,172,236	-	41,174,661	2,425
	小計	41,172,236	-	41,174,661	2,425
	合計	41,172,236	-	41,174,661	2,425

(2022年5月31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 アメリカ・ドル	7,307,622	-	7,307,685	63
	小計	7,307,622	-	7,307,685	63
	合計	7,307,622	-	7,307,685	63

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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おります。

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おります。

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おります。

- ・ 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おります。
- ・ 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おります。

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。

(その他の注記)

(2021年11月30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	2,862,026円
同期中における追加設定元本額	862,353,380円
同期中における一部解約元本額	951,060円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)	138,779,891円
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)	688,097,982円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)	37,386,473円
合計	864,264,346円

(2022年5月31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	864,264,346円
同期中における追加設定元本額	833,275,584円
同期中における一部解約元本額	119,972,496円
2022年5月31日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)	307,062,592円
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)	1,186,848,064円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)	83,656,778円
合計	1,577,567,434円

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

資本金の額および株式数

	2022年6月30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

最近5年間における資本金の額の増減
該当ありません。

(2)【事業の内容及び営業の状況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として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。

2022年6月30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	723	9,010,950
単位型株式投資信託	98	470,379
追加型公社債投資信託	1	25,626
単位型公社債投資信託	187	351,060
合計	1,009	9,858,016

(3)【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

該当ありません。

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。

5【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(2021年4月1日から2022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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	33,048,142	49,008,279
顧客分別金信託	300,036	300,041
前払費用	449,748	475,266
未収入金	132,419	103,809
未収委託者報酬	9,936,096	12,125,117
未収運用受託報酬	2,247,156	2,437,063
未収投資助言報酬	398,108	388,639
未収収益	39,975	36,700
その他の流動資産	6,981	18,458
流動資産合計	46,558,665	64,893,375
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	1,509,450	1,433,442
器具備品	870,855	653,985
土地	710	710
リース資産	13,483	7,357
建設仮勘定	-	5,500
有形固定資産合計	2,394,500	2,100,996
無形固定資産		
ソフトウェア	1,347,889	2,766,476
ソフトウェア仮勘定	1,029,033	100,616
のれん	3,654,491	3,349,950
顧客関連資産	15,671,890	13,558,615
電話加入権	12,727	12,716
商標権	48	42
無形固定資産合計	21,716,080	19,788,417
投資その他の資産		
投資有価証券	22,866,282	14,212,354
関係会社株式	11,246,398	11,246,398
長期差入保証金	1,409,091	1,414,646
長期前払費用	116,117	77,936
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	35,707,619	27,021,065
固定資産合計	59,818,200	48,910,479
資産合計	106,376,866	113,803,855

(単位：千円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	5,153	3,567
顧客からの預り金	20,077	6,045
その他の預り金	169,380	196,515
未払金		
未払収益分配金	1,646	1,969
未払償還金	43,523	152
未払手数料	4,480,697	5,545,582
その他未払金	270,290	48,893
未払費用	5,940,121	7,379,404
未払消費税等	235,647	1,133,332
未払法人税等	762,648	2,455,291
賞与引当金	1,516,622	2,100,323
資産除去債務	-	7,192
その他の流動負債	9,710	40,396
流動負債合計	13,455,519	18,918,667
固定負債		
リース債務	9,678	4,525
繰延税金負債	2,566,958	1,279,409
退職給付引当金	5,258,448	5,084,506
その他の固定負債	40,950	4,620
固定負債合計	7,876,035	6,373,062
負債合計	21,331,554	25,291,730
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	73,466,962
資本剰余金合計	90,555,984	82,095,946
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	-
別途積立金	1,476,959	-
繰越利益剰余金	10,281,242	3,834,794
利益剰余金合計	8,460,037	4,119,040
株主資本計	84,095,946	88,214,986
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	949,365	297,138
評価・換算差額等合計	949,365	297,138
純資産合計	85,045,311	88,512,124
負債・純資産合計	106,376,866	113,803,855

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	2020年4月1日	(自	2021年4月1日
	至	2021年3月31日)	至	2022年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		50,610,457		66,139,024
運用受託報酬		9,450,169		9,652,634
投資助言報酬		1,270,584		1,256,334
その他営業収益				
サービス支援手数料		200,807		199,046
その他		32,820		32,936
営業収益計		61,564,839		77,279,976
営業費用				
支払手数料		22,784,919		30,522,133
広告宣伝費		365,317		330,161
調査費				
調査費		3,061,987		3,196,921
委託調査費		7,810,157		12,192,048
営業雑経費				
通信費		95,163		67,600
印刷費		554,920		494,834
協会費		40,044		34,433
諸会費		29,473		30,488
情報機器関連費		4,562,612		4,767,504
販売促進費		23,614		31,930
その他		163,332		181,301
営業費用合計		39,491,542		51,849,358
一般管理費				
給料				
役員報酬		277,027		263,893
給料・手当		9,280,730		8,664,828
賞与		950,630		991,916
賞与引当金繰入額		1,501,855		2,100,323
交際費		11,815		12,301
寄付金		949		29,273
事務委託費		844,255		1,422,189
旅費交通費		21,023		16,863
租税公課		389,819		476,729
不動産賃借料		1,639,529		1,289,256
退職給付費用		790,144		632,559
固定資産減価償却費		3,040,894		3,133,951
のれん償却費		2,645,986		304,540
諸経費		608,206		256,994
一般管理費合計		22,002,869		19,595,622
営業利益		70,426		5,834,995

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	2020年4月1日	(自	2021年4月1日
	至	2021年3月31日)	至	2022年3月31日)
営業外収益				
受取配当金		13,164		7,666
受取利息		2,736		1,836
時効成立分配金・償還金		88,335		43,406
原稿・講演料		2,603		2,587

投資有価証券償還益		57,388	383,608
投資有価証券売却益		162,941	911,268
為替差益		-	4,673
雑収入		72,933	81,640
営業外収益合計		400,104	1,436,686
営業外費用			
投資有価証券償還損		11,762	146,219
投資有価証券売却損		34,473	81,384
為替差損		766	-
雑損失		1,240	2,866
営業外費用合計		48,243	230,470
経常利益		422,288	7,041,212
特別損失			
固定資産除却損	1	54,493	83,651
減損損失	2	28,097,346	-
システム統合関連費用	3	-	375,636
早期退職費用	4	216,200	260,075
本社移転費用		127,044	-
その他特別損失		5,460	67,000
特別損失合計		28,500,544	786,362
税引前当期純利益又は 税引前当期純損失（ ）		28,078,256	6,254,849
法人税、住民税及び事業税		1,549,173	3,101,482
法人税等調整額		693,192	965,673
法人税等合計		855,980	2,135,809
当期純利益又は 当期純損失（ ）		28,934,237	4,119,040

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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			

	利益剰余金 合計	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
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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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		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	10,281,242
当期変動額								
剰余金の配当								
欠損填補			8,460,037	8,460,037				8,460,037
当期純利益								4,119,040
任意積立金の 取崩						60,000	1,476,959	1,536,959
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）								
当期変動額合計	-	-	8,460,037	8,460,037	-	60,000	1,476,959	14,116,037
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	-	-	3,834,794

	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	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311
当期変動額					
剰余金の配当					
欠損填補	8,460,037	-			-
当期純利益	4,119,040	4,119,040			4,119,040
任意積立金の 取崩	-	-			-
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			652,227	652,227	652,227
当期変動額合計	12,579,078	4,119,040	652,227	652,227	3,466,812
当期末残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124

[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. 収益及び費用の計上基準

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下、「収益認識会計基準」という。)等を適用しており、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び収益を認識する通常の時点は以下のとおりであります。

(1) 委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2)運用受託報酬

運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(3)投資助言報酬

投資助言報酬は、対象顧客との投資助言契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の助言期間にわたり収益として認識しております。

(会計方針の変更)

「収益認識会計基準」等を当事業年度の期首から適用し、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取る見込まれる金額で収益を認識することとしております。当該会計基準等の適用が当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識関係」注記については記載していません。

(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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
建物	102,329千円	210,548千円
器具備品	1,153,649千円	1,309,352千円
リース資産	2,830千円	6,073千円

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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	93,374千円	57,356千円

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

	前事業年度 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)	当事業年度 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)
建物	18,278千円	-千円
器具備品	28,604千円	0千円
リース資産	-千円	-千円
ソフトウェア	7,610千円	83,651千円
ソフトウェア仮勘定	-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
-	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。当事業年度において計上した減損損失はありません。

3 システム統合関連費用

社内システム統合に伴うものであり、主にデータの移行費用などであります。

4 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。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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

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	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月28日 定時株主総会	普通株式	2,540,254	75.00	2022年 3月31日	2022年 6月29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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
1年以内	1,194,699	1,166,952
1年超	3,497,258	2,323,090
合計	4,691,958	3,490,042

(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。

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。

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（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	-

当事業年度（2022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	49,008,279	49,008,279	-
(2)顧客分別金信託	300,041	300,041	-
(3)未収委託者報酬	12,125,117	12,125,117	-
(4)未収運用受託報酬	2,437,063	2,437,063	-
(5)未収投資助言報酬	388,639	388,639	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	14,172,545	14,172,545	-
資産計	78,431,686	78,431,686	-
(1)顧客からの預り金	6,045	6,045	-
(2)未払手数料	5,545,582	5,545,582	-
負債計	5,551,627	5,551,627	-

（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。

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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	39,809	39,809
合計	39,809	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(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	-	-

当事業年度(2022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	49,008,279	-	-	-
顧客分別金信託	300,041	-	-	-
未収委託者報酬	12,125,117	-	-	-
未収運用受託報酬	2,437,063	-	-	-
未収投資助言報酬	388,639	-	-	-
合計	64,259,140	-	-	-

(有価証券関係)

1.子会社株式

前事業年度(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。

当事業年度(2022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(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	16,097,433	14,397,606	1,699,827
小計	16,097,433	14,397,606	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	6,729,039	6,994,762	265,723
小計	6,729,039	6,994,762	265,723
合計	22,826,472	21,392,369	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。

当事業年度（2022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	9,299,062	8,672,725	626,337
小計	9,299,062	8,672,725	626,337
(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	4,873,482	5,039,817	166,335
小計	4,873,482	5,039,817	166,335
合計	14,172,545	13,712,543	460,001

(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 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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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
4,082,976	911,268	81,384

（単位：千円）

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
7,183,410	383,608	146,219

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	5,299,814	5,258,448
勤務費用	476,308	454,611
利息費用	-	1,013
数理計算上の差異の発生額	67,476	34,553
退職給付の支払額	585,151	595,013
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による発生額	-	-

退職給付債務の期末残高	5,258,448	5,084,506
-------------	-----------	-----------

(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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	5,258,448	5,084,506
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	5,258,448	5,084,506

(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2020年4月1日 至2021年3月31日)	当事業年度 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)
勤務費用	476,308	454,611
利息費用	-	1,013
数理計算上の差異の費用処理額	67,476	34,553
その他	246,359	211,487
確定給付制度に係る退職給付費用	790,144	632,559

(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2020年4月1日 至2021年3月31日)	当事業年度 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)
割引率	0.020%	0.130%

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239,162千円、当事業年度237,296千円であります。

(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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,610,136	1,556,876
賞与引当金	464,389	643,119
調査費	247,208	279,809
未払金	206,090	284,070
未払事業税	66,891	139,522
ソフトウェア償却	90,431	107,998
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	131,391	93,946
その他	35,930	28,056
繰延税金資産小計	2,967,346	3,248,274
評価性引当額(注)	218,966	189,102
繰延税金資産合計	2,748,380	3,059,171
繰延税金負債		
無形固定資産	4,798,732	4,151,648
資産除去債務	-	825
その他有価証券評価差額金	516,605	186,107
繰延税金負債合計	5,315,338	4,338,581

繰延税金資産(負債)の純額	2,566,958	1,279,409
---------------	-----------	-----------

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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
法定実効税率	税引前当期純損失のため記載を省略しております。	30.6%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目		1.6
住民税均等割等		0.1
のれん償却費		1.4
その他		0.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率		34.1

(収益認識関係)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「セグメント情報等」注記に記載のとおりであります。

(セグメント情報等)

前事業年度(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。

当事業年度(自 2021年4月1日 至2022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	66,139,024	9,652,634	1,256,334	231,982	77,279,976

(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 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	㈱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㈱	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) 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 2021年4月1日 至 2022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	4,727,024	未払 手数料	1,098,966
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	8,397,864	未払 手数料	1,661,614

(注) 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 2020年 4月 1日 至 2021年 3月 31日)	当事業年度 (自 2021年 4月 1日 至 2022年 3月 31日)
1株当たり純資産額	2,510.93円	2,613.28円
1株当たり当期純利益又は 1株当たり当期純損失()	854.27円	121.61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、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。

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、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 2020年 4月 1日 至 2021年 3月 31日)	当事業年度 (自 2021年 4月 1日 至 2022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)	28,934,237	4,119,040
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)	28,934,237	4,119,040
期中平均株式数(株)	33,870,060	33,870,060

独立監査人の監査報告書

2022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
--------------------	-------	---------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅 野 雅 子
--------------------	-------	---------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	佐 藤 栄 裕
--------------------	-------	---------

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2021年4月1日から2022年3月31日までの第37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2022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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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、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 . 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）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

2022年8月16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

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志

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DS・TOPIXインデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年5月31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DS・TOPIXインデックス・ファンドの2022年5月31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12月1日から2022年5月31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. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。

独立監査人の中間監査報告書

2022年8月16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
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志
--------------------	-------	-------

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DS・日経225インデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年5月31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DS・日経225インデックス・ファンドの2022年5月31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12月1日から2022年5月31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. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。

独立監査人の中間監査報告書

2022年8月16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

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志

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DS・先進国株式インデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年5月31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DS・先進国株式インデックス・ファンドの2022年5月31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12月1日から2022年5月31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. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。

独立監査人の中間監査報告書

2022年8月16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

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志

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DS・新興国株式インデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年5月31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DS・新興国株式インデックス・ファンドの2022年5月31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12月1日から2022年5月31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. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。

独立監査人の中間監査報告書

2022年8月16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

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志

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DS・先進国債インデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年5月31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DS・先進国債インデックス・ファンドの2022年5月31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12月1日から2022年5月31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. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。

独立監査人の中間監査報告書

2022年8月16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	石井 勝也
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	佐藤 栄裕
--------------------	-------	-------

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DS・新興国債インデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年5月31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DS・新興国債インデックス・ファンドの2022年5月31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12月1日から2022年5月31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. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。

独立監査人の中間監査報告書

2022年8月16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

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志

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DS・国内リートインデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年5月31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DS・国内リートインデックス・ファンドの2022年5月31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12月1日から2022年5月31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. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。

独立監査人の中間監査報告書

2022年8月16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

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志

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DS・先進国リートインデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年5月31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DS・先進国リートインデックス・ファンドの2022年5月31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12月1日から2022年5月31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. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。

独立監査人の中間監査報告書

2022年8月16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 石井 勝也

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕

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DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）の2021年12月1日から2022年5月31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DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）の2022年5月31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12月1日から2022年5月31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. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。