

【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11月15日提出
【計算期間】	第4期中(自 2022年2月19日至 2022年8月18日)
【ファンド名】	三井住友D S・年金バランス30(債券重点型) 三井住友D S・年金バランス50(標準型) 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17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・年金バランス30（債券重点型）

2022年8月31日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
親投資信託受益証券	日本	618,539,386	95.16
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	31,481,676	4.84
合計（純資産総額）		650,021,062	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・年金バランス50（標準型）

2022年8月31日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
親投資信託受益証券	日本	1,707,993,999	95.01
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	89,624,019	4.99
合計（純資産総額）		1,797,618,018	100.00

三井住友D S・年金バランス70（株式重点型）

2022年8月31日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
親投資信託受益証券	日本	1,136,724,227	95.00
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	59,785,023	5.00
合計（純資産総額）		1,196,509,250	100.00

(2)【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友D S・年金バランス30（債券重点型）

年月日	純資産総額 （円）		1万口当たりの 純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期（2020年2月18日）	1,036,533	1,036,533	10,365	10,365
第2期（2021年2月18日）	129,349,680	129,349,680	10,869	10,869
第3期（2022年2月18日）	244,216,550	244,216,550	11,031	11,031
2021年8月末日	234,071,577	-	11,186	-

9月末日	238,910,025	-	11,230	-
10月末日	241,494,324	-	11,297	-
11月末日	239,519,804	-	11,213	-
12月末日	247,640,226	-	11,329	-
2022年 1月末日	245,537,156	-	11,075	-
2月末日	245,518,531	-	11,009	-
3月末日	280,994,460	-	11,247	-
4月末日	288,055,096	-	11,130	-
5月末日	515,078,160	-	11,125	-
6月末日	639,959,447	-	11,026	-
7月末日	634,370,155	-	11,197	-
8月末日	650,021,062	-	11,204	-

三井住友DS・年金バランス50(標準型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2020年 2月18日)	2,279,719	2,279,719	10,571	10,571
第2期 (2021年 2月18日)	335,342,429	335,342,429	11,511	11,511
第3期 (2022年 2月18日)	718,044,759	718,044,759	11,845	11,845
2021年 8月末日	632,059,580	-	11,969	-
9月末日	651,115,384	-	12,087	-
10月末日	660,424,293	-	12,182	-
11月末日	676,280,521	-	12,017	-
12月末日	719,340,469	-	12,232	-
2022年 1月末日	707,831,149	-	11,846	-
2月末日	716,168,140	-	11,775	-
3月末日	841,507,528	-	12,173	-
4月末日	829,867,948	-	11,985	-
5月末日	1,449,408,828	-	11,995	-
6月末日	1,671,536,709	-	11,860	-
7月末日	1,738,080,328	-	12,119	-
8月末日	1,797,618,018	-	12,158	-

三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2020年 2月18日)	1,078,471	1,078,471	10,785	10,785
第2期 (2021年 2月18日)	212,907,677	212,907,677	12,154	12,154
第3期 (2022年 2月18日)	476,770,596	476,770,596	12,669	12,669
2021年 8月末日	420,504,395	-	12,765	-
9月末日	437,307,659	-	12,967	-

10月末日	459,750,652	-	13,088	-
11月末日	455,023,591	-	12,830	-
12月末日	490,773,498	-	13,161	-
2022年 1月末日	477,224,845	-	12,622	-
2月末日	476,159,381	-	12,546	-
3月末日	606,093,228	-	13,120	-
4月末日	608,226,834	-	12,850	-
5月末日	955,649,755	-	12,879	-
6月末日	1,098,699,033	-	12,703	-
7月末日	1,152,369,309	-	13,060	-
8月末日	1,196,509,250	-	13,136	-

【分配の推移】

三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0
第2期	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0
第3期	2021年 2月19日～2022年 2月18日	0

三井住友DS・年金バランス50（標準型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0
第2期	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0
第3期	2021年 2月19日～2022年 2月18日	0

三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0
第2期	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0
第3期	2021年 2月19日～2022年 2月18日	0

【収益率の推移】

三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）

	収益率（％）
第1期	3.7
第2期	4.9
第3期	1.5
第4期（中間期）	2.5

(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 ・年金バランス50(標準型)

	収益率(%)
第1期	5.7
第2期	8.9
第3期	2.9
第4期(中間期)	3.9

(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。

三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)

	収益率(%)
第1期	7.9
第2期	12.7
第3期	4.2
第4期(中間期)	5.3

(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。

(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8月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	212,826,926,220	99.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,055,048,521	0.96
合計(純資産総額)		214,881,974,741	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	2,020,860,000	0.94
合計	買建	-	2,020,860,000	0.94

国内債券パッシブ・マザーファンド

2022年8月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	104,719,255,910	79.83
地方債証券	日本	10,219,212,900	7.79
特殊債券	日本	9,418,988,719	7.18

	小計	152,757,232,180	98.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,490,522,395	1.60
合計(純資産総額)		155,247,754,575	100.00

2【設定及び解約の実績】

三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,000,000	0
第2期	129,718,508	11,715,048
第3期	128,773,003	26,390,611
第4期（中間期）	384,621,744	30,665,222

（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 ・年金バランス50（標準型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2,156,528	0
第2期	322,790,706	33,614,202
第3期	361,775,633	46,907,692
第4期（中間期）	896,921,619	42,621,758

（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 ・年金バランス70（株式重点型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,000,000	0
第2期	190,606,278	16,430,623
第3期	241,009,796	39,861,352
第4期（中間期）	544,487,929	24,185,073

（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4期中間計算期間(2022年2月19日から2022年8月18日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2022年2月18日現在)	第4期中間計算期間 (2022年8月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	344,040	1,262,829
コール・ローン	11,409,409	30,152,772
親投資信託受益証券	232,115,670	619,481,425
未収入金	1,100,000	-
流動資産合計	244,969,119	650,897,026
資産合計	244,969,119	650,897,026
負債の部		
流動負債		
未払解約金	557,362	-
未払受託者報酬	26,723	46,967
未払委託者報酬	160,500	281,988
その他未払費用	7,984	14,095
流動負債合計	752,569	343,050
負債合計	752,569	343,050
純資産の部		
元本等		
元本	221,385,852	575,342,374
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	22,830,698	75,211,602
(分配準備積立金)	7,500,302	7,048,867
元本等合計	244,216,550	650,553,976
純資産合計	244,216,550	650,553,976
負債純資産合計	244,969,119	650,897,026

（ 3 ） 【 中間注記表 】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第4期中間計算期間 自 2022年2月19日 至 2022年8月18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3期 (2022年2月18日現在)	第4期中間計算期間 (2022年8月18日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	221,385,852口	575,342,374口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1031円 (1万口当たりの純資産額11,031円)	1口当たり純資産額 1.1307円 (1万口当たりの純資産額11,307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4期中間計算期間 (2022年8月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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3期	第4期中間計算期間
	(2022年2月18日現在)	(2022年8月18日現在)
期首元本額	119,003,460円	221,385,852円
期中追加設定元本額	128,773,003円	384,621,744円
期中一部解約元本額	26,390,611円	30,665,222円

【三井住友D S ・年金バランス50（標準型）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 (2022年 2月18日現在)	第4期中間計算期間 (2022年 8月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,051,821	3,643,407
コール・ローン	34,881,580	86,994,255
親投資信託受益証券	682,691,935	1,708,353,520
未収入金	300,000	-
流動資産合計	718,925,336	1,798,991,182
資産合計	718,925,336	1,798,991,182
負債の部		
流動負債		
未払解約金	332,091	708,981
未払受託者報酬	75,116	129,840
未払委託者報酬	450,836	779,293
その他未払費用	22,534	39,060
流動負債合計	880,577	1,657,174
負債合計	880,577	1,657,174
純資産の部		
元本等		
元本	606,200,973	1,460,500,834
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	111,843,786	336,833,174
（分配準備積立金）	35,793,190	34,149,193
元本等合計	718,044,759	1,797,334,008
純資産合計	718,044,759	1,797,334,008
負債純資産合計	718,925,336	1,798,991,182

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2021年 2月19日 至 2021年 8月18日	第4期中間計算期間 自 2022年 2月19日 至 2022年 8月18日
営業収益		
受取利息	-	321
有価証券売買等損益	13,027,977	59,166,585
営業収益合計	13,027,977	59,166,906
営業費用		
支払利息	10,561	7,804
受託者報酬	53,624	129,840
委託者報酬	321,671	779,293
その他費用	17,331	39,720
営業費用合計	403,187	956,657
営業利益又は営業損失（ ）	12,624,790	58,210,249
経常利益又は経常損失（ ）	12,624,790	58,210,249
中間純利益又は中間純損失（ ）	12,624,790	58,210,249
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（ ）	574,764	512,735
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	44,009,397	111,843,786
剰余金増加額又は欠損金減少額	44,350,442	175,322,861
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	44,350,442	175,322,861
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,859,096	8,030,987
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,859,096	8,030,987
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（ ）	96,550,769	336,833,174

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針の注記）

項目	第4期中間計算期間 自 2022年2月19日 至 2022年8月18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3期 (2022年2月18日現在)	第4期中間計算期間 (2022年8月18日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	606,200,973口	1,460,500,834口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1845円 (1万口当たりの純資産額11,845円)	1口当たり純資産額 1.2306円 (1万口当たりの純資産額12,306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4期中間計算期間 (2022年8月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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3期 (2022年2月18日現在)	第4期中間計算期間 (2022年8月18日現在)
期首元本額	291,333,032円	606,200,973円
期中追加設定元本額	361,775,633円	896,921,619円
期中一部解約元本額	46,907,692円	42,621,758円

【三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2022年 2月18日現在)	第4期中間計算期間 (2022年 8月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	709,318	2,190,957
コール・ローン	23,523,145	52,313,852
親投資信託受益証券	452,603,237	1,136,965,684
未収入金	500,000	5,000,000
流動資産合計	477,335,700	1,196,470,493
資産合計	477,335,700	1,196,470,493
負債の部		
流動負債		
未払解約金	192,592	135,527
未払受託者報酬	51,007	87,932
未払委託者報酬	306,218	527,875
その他未払費用	15,287	26,433
流動負債合計	565,104	777,767
負債合計	565,104	777,767
純資産の部		
元本等		
元本	376,324,099	896,626,955
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	100,446,497	299,065,771
(分配準備積立金)	30,719,562	29,365,912
元本等合計	476,770,596	1,195,692,726
純資産合計	476,770,596	1,195,692,726
負債純資産合計	477,335,700	1,196,470,493

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期中間計算期間 自 2021年 2月19日 至 2021年 8月18日	第4期中間計算期間 自 2022年 2月19日 至 2022年 8月18日
営業収益		
受取利息	-	211
有価証券売買等損益	10,026,184	52,080,447
営業収益合計	10,026,184	52,080,658
営業費用		
支払利息	6,822	5,161
受託者報酬	34,699	87,932
委託者報酬	208,129	527,875
その他費用	11,185	26,855
営業費用合計	260,835	647,823
営業利益又は営業損失()	9,765,349	51,432,835
経常利益又は経常損失()	9,765,349	51,432,835
中間純利益又は中間純損失()	9,765,349	51,432,835
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()	434,872	191,409
期首剰余金又は期首欠損金()	37,732,022	100,446,497
剰余金増加額又は欠損金減少額	40,879,129	153,937,772
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	40,879,129	153,937,772
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,333,495	6,559,924
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,333,495	6,559,924
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()	83,608,133	299,065,771

（ 3 ） 【 中間注記表 】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第4期中間計算期間 自 2022年2月19日 至 2022年8月18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3期 (2022年2月18日現在)	第4期中間計算期間 (2022年8月18日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	376,324,099口	896,626,955口
2. 1 単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2669円 (1 万口当たりの純資産額12,669円)	1口当たり純資産額 1.3335円 (1 万口当たりの純資産額13,335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4期中間計算期間 (2022年8月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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3期	第4期中間計算期間
	(2022年2月18日現在)	(2022年8月18日現在)
期首元本額	175,175,655円	376,324,099円
期中追加設定元本額	241,009,796円	544,487,929円
期中一部解約元本額	39,861,352円	24,185,073円

（参考）

「三井住友D S・年金バランス30（債券重点型）」、「三井住友D S・年金バランス50（標準型）」および「三井住友D S・年金バランス70（株式重点型）」は、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」および「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

（1）貸借対照表

（単位：円）

	(2022年2月18日現在)	(2022年8月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	83,758,164	124,967,528
コール・ローン	2,777,675,310	2,983,870,790
株式	199,369,314,880	215,791,649,780
派生商品評価勘定	30,794,600	56,099,500
未収入金	-	1,586,800
未収配当金	309,642,705	293,819,562
差入委託証拠金	127,995,000	132,825,000
流動資産合計	202,699,180,659	219,384,818,960
資産合計	202,699,180,659	219,384,818,960
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	31,221,600	-
前受金	10,130,000	83,550,000
未払解約金	98,843,866	381,737,610
その他未払費用	4,873	5,186
流動負債合計	140,200,339	465,292,796
負債合計	140,200,339	465,292,796
純資産の部		
元本等		
元本	62,902,449,020	64,812,081,877
剰余金		

剰余金又は欠損金()	139,656,531,300	154,107,444,287
元本等合計	202,558,980,320	218,919,526,164
純資産合計	202,558,980,320	218,919,526,164
負債純資産合計	202,699,180,659	219,384,818,960

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年2月19日 至 2022年8月18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</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、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</p> <p>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	(2022年2月18日現在)	(2022年8月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	62,902,449,020口	64,812,081,877口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.2202円 (1万口当たりの純資産額32,202円)	1口当たり純資産額 3.3778円 (1万口当たりの純資産額33,778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8月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

S M A M・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	41,957,007円
S M A M・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	47,526,234円
S M A M・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	34,199,513円
S M A M・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,944,296円
S M A M・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	112,116,903円
S M A M・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	243,725,102円
S M A M・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	60,760,917円
S M A M・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	39,691,119円
S M A M・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,467,207円
S M A M・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	45,936,567円
S M A M・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	609,118,916円
S M A M・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	180,317,730円
S M A M・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
S M A M・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
S M A M・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	206,061,152円
S M A M・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	60,728,009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>	54,286,476円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	47,217,544円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	60,182,914円
S M A M・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	43,247,408円
S M D A M・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	9,321,771円
合 計	62,902,449,020円

(2022年8月18日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	62,902,449,020円
同期中における追加設定元本額	5,590,245,813円
同期中における一部解約元本額	3,680,612,956円

2022年8月18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	9,526,366,425円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,010,867,864円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,613,216,765円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,541,267,690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)	123,082,418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)	4,343,374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)	19,637,493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)	62,765,654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)	163,740,305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)	144,325,514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)	259,134,699円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,364,717,862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	21,000,412,175円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	248,448,491円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	303,821,509円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	196,873,415円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	36,247,641円

S M A M ・ マルチアセット ・ ダイナミックアロケーション ・ ストラテジー ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	101,723,766円
S M D A M ・ 日米 3 資産 バランス オープン < 適格機関投資家限定 >	16,939,065円
合 計	64,812,081,877円

国内債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年2月18日現在)	(2022年8月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	11,754,192	17,219,102
コール・ローン	389,804,746	411,143,416
国債証券	103,251,731,330	103,405,242,460
地方債証券	9,588,458,300	9,940,096,300
特殊債券	9,447,523,174	9,549,706,056
社債券	5,297,396,900	6,054,889,400
未収入金	508,302,200	100,395,000
未収利息	356,702,726	320,315,614
前払費用	4,632,157	11,036,115
流動資産合計	128,856,305,725	129,810,043,463
資産合計	128,856,305,725	129,810,043,463
負債の部		
流動負債		
未払金	200,000,000	105,602,000
未払解約金	223,632,227	720,000
その他未払費用	753	857
流動負債合計	423,632,980	106,322,857
負債合計	423,632,980	106,322,857
純資産の部		
元本等		
元本	102,053,846,373	103,346,752,168
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	26,378,826,372	26,356,968,438
元本等合計	128,432,672,745	129,703,720,606
純資産合計	128,432,672,745	129,703,720,606
負債純資産合計	128,856,305,725	129,810,043,463

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年2月19日 至 2022年8月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2022年2月18日現在)	(2022年8月18日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	102,053,846,373口	103,346,752,168口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2585円 (1万口当たりの純資産額12,585円)	1口当たり純資産額 1.2550円 (1万口当たりの純資産額12,550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8月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</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)

(2022年2月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	100,129,074,120円
同期中における追加設定元本額	17,663,518,982円
同期中における一部解約元本額	15,738,746,729円
2022年2月18日現在の元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	6,655,940,182円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	11,416,731,765円

SMAM・年金ワリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	997,745,813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＞	1,060,685,582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＞	1,356,845,714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＞	3,805,764,579円
合計	102,053,846,373円

（2022年8月18日現在）

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	102,053,846,373円
同期中における追加設定元本額	16,140,511,246円
同期中における一部解約元本額	14,847,605,451円
2022年8月18日現在の元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	7,314,644,344円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	12,128,838,633円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	2,802,741,535円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	811,849,873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）	41,070,539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）	189,047,529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）	500,821,864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）	868,404,216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）	444,876,795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）	570,486,694円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	136,653,129円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,415,028,409円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	689,803,094円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	207,792,080円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	54,204,980円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	1,928,511,348円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	653,227,349円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	965,929,500円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	217,690,587円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	35,698,724円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	183,629,759円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	283,704,381円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	496,484,059円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	143,211,564円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	6,724,506円
SMAM・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,227,060,772円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	11,615,371,626円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	6,128,242,930円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	15,423,504,866円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	306,310,460円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	537,491,592円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	253,204,817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＞	119,981,072円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	1,802,337,039円

三井住友・資産最適化ファンド(４やや成長型)	190,350,995円
三井住友・資産最適化ファンド(５成長重視型)	221,270,706円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	42,907,633円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	631,760,314円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０(債券重点型)	4,312,302円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０(標準型)	18,997,088円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０(株式重点型)	16,653,445円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	2,126,325円
ＳＭＢＣ・ＤＣインデックスファンド(ＭＳＣＩコクサイ)	135,053,059円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	138,305,233円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	494,524,360円
三井住友ＤＳ・先進国株式インデックス・ファンド	18,407,244円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	547,572,635円
バランスファンドＶＡ(安定運用型)<適格機関投資家限定>	4,050,001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>	28,727,858円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５<適格機関投資家専用>	667,997,195円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７.５<適格機関投資家専用>	802,068,341円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０<適格機関投資家専用>	3,487,539,177円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０<適格機関投資家限定>	11,523,953円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０<適格機関投資家限定>	62,266,508円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５<適格機関投資家専用>	467,481,408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>	39,529,370円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５<適格機関投資家専用>	102,099,408円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０<適格機関投資家専用>	486,937,001円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０<適格機関投資家専用>	339,113,420円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５<適格機関投資家専用>	789,808,587円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ<適格機関投資家限定>	213,357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)	213,566,235円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ<適格機関投資家限定>	73,691,382円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ<適格機関投資家専用>	8,737,379円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ<適格機関投資家専用>	7,741,901円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ<適格機関投資家専用>	4,041,277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>	58,834,436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>	130,885,825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>	61,717,109円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ<適格機関投資家限定>	617,208,199円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２<適格機関投資家限定>	107,877,816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>	49,785,224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>	30,625,590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>	26,421,298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>	33,774,984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>	71,402,336円
合計	61,407,657,975円

(2022年8月18日現在)

開示対象ファンドの

剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	76,687,017,036	79,202,146,064
元本等合計	159,020,475,545	156,998,560,715
純資産合計	159,020,475,545	156,998,560,715
負債純資産合計	159,096,109,066	157,005,230,792

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年2月19日 至 2022年8月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年2月18日現在)	(2022年8月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	82,333,458,509口	77,796,414,651口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9314円 (1万口当たりの純資産額19,314円)	1口当たり純資産額 2.0181円 (1万口当たりの純資産額20,181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8月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

三井住友・ＤＣ年金バランス７０(株式重点型)	1,142,736,546円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	149,556,830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)	6,176,347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)	27,422,279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)	91,330,725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)	241,044,647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)	170,333,334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)	274,180,878円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ(債券型)	22,409,540円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	75,953,533円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	105,895,963円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	71,983,977円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	20,018,494円
三井住友・資産最適化ファンド(１安定重視型)	76,535,163円
三井住友・資産最適化ファンド(２やや安定型)	55,850,224円
三井住友・資産最適化ファンド(３バランス型)	147,743,011円
三井住友・資産最適化ファンド(４やや成長型)	45,415,312円
三井住友・資産最適化ファンド(５成長重視型)	22,253,366円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	150,864,628円
三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド	544,243,404円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０(債券重点型)	31,832,391円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０(標準型)	87,208,375円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０(株式重点型)	58,248,187円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	2,451,947円
日興ＦＷＳ・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	315,275,977円
三井住友ＤＳ・先進国債インデックス・ファンド	15,710,762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>	3,746,213,348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>	33,601,811円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５<適格機関投資家専用>	6,238,590,894円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７.５<適格機関投資家専用>	4,121,395,220円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０<適格機関投資家専用>	9,462,762,482円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０<適格機関投資家限定>	30,929,407円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０<適格機関投資家限定>	82,222,515円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５<適格機関投資家専用>	658,062,897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>	111,106,124円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５<適格機関投資家専用>	965,401,491円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０<適格機関投資家専用>	1,298,450,320円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０<適格機関投資家専用>	1,404,391,557円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５<適格機関投資家専用>	4,326,790,546円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ<適格機関投資家限定>	604,716円
ＳＭＡＭ・外国債券パッシブファンドＶＡ<適格機関投資家限定>	7,297,720,838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)	310,999,696円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ<適格機関投資家限定>	128,907,845円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ<適格機関投資家専用>	74,297,765円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ<適格機関投資家専用>	33,189,008円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ<適格機関投資家専用>	11,647,293円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ<適格機関投資家専用>	86,041,176円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ<適格機関投資家専用>	385,063,894円

SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	90,382,461円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	38,868,189円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,501,058円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	928,125,945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>	568,480,944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>	806,810,632円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	535,796,824円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	305,142,942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>	123,808,776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>	119,246,506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>	152,893,580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>	1,391,071,883円
合 計	77,796,414,651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8月31日現在

資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

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

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	718	9,385,473
単位型株式投資信託	98	472,639
追加型公社債投資信託	1	25,700
単位型公社債投資信託	186	340,648
合計	1,003	10,224,462

(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。

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

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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記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11月1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 公認会計士 菅野 雅子
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 松井 貴志
業務執行社員**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・年金バランス30（債券重点型）の2022年2月19日から2022年8月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）の2022年8月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年2月19日から2022年8月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

独立監査人の中間監査報告書

2022年11月1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・年金バランス50（標準型）の2022年2月19日から2022年8月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・年金バランス50（標準型）の2022年8月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年2月19日から2022年8月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記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11月1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・年金バランス70(株式重点型)の2022年2月19日から2022年8月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)の2022年8月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2022年2月19日から2022年8月18日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の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。