

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年6月8日提出
【計算期間】	第6期中(自 2022年9月13日至 2023年3月12日)
【ファンド名】	三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド
【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・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

2023年3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	1,835,862,304	99.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	18,029,784	0.97
合計（純資産総額）		1,853,892,088	100.00

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

(2)【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

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 (2018年 9月10日)	115,063,603	115,063,603	10,051	10,051
第2期 (2019年 9月10日)	295,583,344	295,583,344	10,442	10,442
第3期 (2020年 9月10日)	544,780,618	544,780,618	10,720	10,720
第4期 (2021年 9月10日)	1,014,406,357	1,014,406,357	12,869	12,869
第5期 (2022年 9月12日)	1,634,445,391	1,634,445,391	13,461	13,461
2022年 3月末日	1,336,995,790	-	13,355	-
4月末日	1,345,546,363	-	13,169	-
5月末日	1,375,771,901	-	13,029	-
6月末日	1,420,849,679	-	12,940	-
7月末日	1,495,859,284	-	13,224	-
8月末日	1,592,792,451	-	13,192	-
9月末日	1,556,761,045	-	12,584	-
10月末日	1,665,053,964	-	13,115	-
11月末日	1,691,666,097	-	13,016	-
12月末日	1,660,856,865	-	12,438	-
2023年 1月末日	1,762,639,507	-	12,803	-
2月末日	1,815,355,589	-	12,934	-
3月末日	1,853,892,088	-	12,865	-

【分配の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2017年10月3日～2018年9月10日	0
第2期	2018年9月11日～2019年9月10日	0
第3期	2019年9月11日～2020年9月10日	0
第4期	2020年9月11日～2021年9月10日	0
第5期	2021年9月11日～2022年9月12日	0

【収益率の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	収益率（％）
第1期	0.5
第2期	3.9
第3期	2.7
第4期	20.0
第5期	4.6
第6期（中間期）	4.6

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

（参考）

（1）投資状況

国内債券パッシブ・マザーファンド

2023年3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	95,424,745,860	78.61
地方債証券	日本	9,416,074,500	7.76
特殊債券	日本	9,058,265,310	7.46
社債券	日本	6,384,912,600	5.26
	フランス	200,001,400	0.16
	小計	6,584,914,000	5.42
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	908,199,580	0.75
合計（純資産総額）		121,392,199,250	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2023年3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
国債証券	アメリカ	12,157,360,215	49.01
	フランス	2,083,991,177	8.40

	イタリア	1,886,808,556	7.61
	ドイツ	1,607,889,183	6.48
	スペイン	1,246,995,067	5.03
	イギリス	1,190,842,815	4.80
	中国	1,141,472,814	4.60
	カナダ	503,166,316	2.03
	ベルギー	465,053,401	1.87
	オーストラリア	391,115,506	1.58
	オランダ	385,474,893	1.55
	オーストリア	297,611,781	1.20
	シンガポール	244,067,329	0.98
	メキシコ	213,279,753	0.86
	アイルランド	149,363,276	0.60
	フィンランド	126,180,332	0.51
	ポーランド	115,607,267	0.47
	イスラエル	80,933,970	0.33
	デンマーク	79,380,269	0.32
	ニュージーランド	54,797,202	0.22
	スウェーデン	51,490,214	0.21
	ノルウェー	46,195,997	0.19
	小計	24,519,077,333	98.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	287,275,658	1.16
合計(純資産総額)		24,806,352,991	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	-	133,161,002	0.54
為替予約取引	売建	-	24,276,127,319	97.86

外国債券パッシブ・マザーファンド

2023年3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	75,180,456,556	48.90
	フランス	12,890,262,893	8.38
	イタリア	11,672,729,233	7.59
	ドイツ	9,971,586,084	6.49
	スペイン	7,712,395,517	5.02
	イギリス	7,364,801,089	4.79
	中国	7,033,661,905	4.57
	カナダ	3,106,119,284	2.02
	ベルギー	2,872,869,071	1.87
	オーストラリア	2,407,346,419	1.57
	オランダ	2,345,574,402	1.53
	オーストリア	1,827,671,242	1.19

	メキシコ	1,309,539,922	0.85
	アイルランド	966,778,611	0.63
	マレーシア	835,526,764	0.54
	フィンランド	770,176,538	0.50
	ポーランド	699,415,963	0.45
	シンガポール	685,776,719	0.45
	デンマーク	501,542,889	0.33
	イスラエル	495,616,970	0.32
	ニュージーランド	336,064,258	0.22
	ノルウェー	315,827,829	0.21
	スウェーデン	311,879,817	0.20
	小計	151,613,619,975	98.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,141,779,981	1.39
合計(純資産総額)		153,755,399,956	100.00

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2023年3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	226,486,205,080	97.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	5,538,705,251	2.39
合計(純資産総額)		232,024,910,331	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	5,509,625,000	2.37
合計	買建	-	5,509,625,000	2.37

外国株式インデックス・マザーファンド

2023年3月31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	310,013,211,565	66.38
	イギリス	19,972,845,346	4.28
	カナダ	16,573,229,793	3.55
	フランス	16,131,902,673	3.45
	スイス	15,294,500,917	3.27
	ドイツ	12,083,386,386	2.59
	オーストラリア	9,433,767,446	2.02
	オランダ	9,317,144,909	2.00
	アイルランド	8,338,282,933	1.79
	スウェーデン	4,394,424,167	0.94
	デンマーク	4,332,547,691	0.93
	スペイン	3,745,257,098	0.80
	香港	2,872,269,985	0.62

	イタリア	2,575,366,669	0.55
	ジャージー	1,717,597,560	0.37
	フィンランド	1,717,396,893	0.37
	シンガポール	1,625,358,856	0.35
	ベルギー	1,207,494,537	0.26
	ケイマン諸島	950,827,966	0.20
	イスラエル	940,538,576	0.20
	ノルウェー	926,657,172	0.20
	バミューダ	681,297,040	0.15
	オランダ領キュ ラソー	644,876,677	0.14
	ニュージーラン ド	383,893,926	0.08
	ルクセンブルグ	308,538,153	0.07
	オーストリア	258,327,853	0.06
	ポルトガル	255,348,428	0.05
	リベリア	139,111,265	0.03
	パナマ	94,620,586	0.02
	マン島	87,245,981	0.02
	小計	447,017,269,047	95.72
投資証券	アメリカ	8,509,031,728	1.82
	オーストラリア	903,022,562	0.19
	香港	211,198,881	0.05
	シンガポール	197,313,608	0.04
	イギリス	192,620,536	0.04
	フランス	167,356,383	0.04
	カナダ	53,077,165	0.01
	ベルギー	39,269,400	0.01
	小計	10,272,890,263	2.20
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	9,730,637,677	2.08
合計（純資産総額）		467,020,796,987	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	454,402,598	0.10
株価指数先物取引	買建	ドイツ	1,572,551,952	0.34
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,436,552,760	1.59
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	352,212,630	0.08
合計	買建	-	9,815,719,940	2.10

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	-	2,156,069,519	0.46

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2023年3月31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	5,177,935,828	17.22
	台湾	4,092,459,245	13.61
	インド	3,560,716,679	11.84
	韓国	3,270,540,798	10.88
	中国	1,957,006,799	6.51
	ブラジル	1,317,669,915	4.38
	南アフリカ	948,184,390	3.15
	タイ	588,344,359	1.96
	メキシコ	573,776,041	1.91
	インドネシア	524,972,044	1.75
	マレーシア	401,037,507	1.33
	香港	316,641,320	1.05
	フィリピン	199,273,848	0.66
	ポーランド	177,093,669	0.59
	トルコ	171,532,260	0.57
	チリ	153,627,678	0.51
	アメリカ	139,544,065	0.46
	バミューダ	135,361,005	0.45
	ギリシャ	104,950,637	0.35
	ハンガリー	51,217,573	0.17
	チェコ	48,230,528	0.16
	コロンビア	22,368,825	0.07
	ルクセンブルグ	20,562,338	0.07
	エジプト	18,497,186	0.06
オランダ	17,693,590	0.06	
ペルー	6,567,851	0.02	
シンガポール	6,334,609	0.02	
小計		24,002,140,587	79.81
投資信託受益証券	香港	1,453,933,686	4.83
投資証券	アメリカ	1,946,878,412	6.47
	メキシコ	160,563,065	0.53
	ブラジル	42,853,395	0.14
	南アフリカ	9,314,219	0.03
	小計		2,159,609,091
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,457,681,400	8.18
合計（純資産総額）		30,073,364,764	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	2,511,754,714	8.35
合計	買建	-	2,511,754,714	8.35

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	-	28,489,047	0.09
--------	----	---	------------	------

Jリート・インデックス・マザーファンド

2023年3月31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	10,738,342,650	98.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	194,339,339	1.78
合計(純資産総額)		10,932,681,989	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	35,540,000	0.33
合計	買建	-	35,540,000	0.33

外国リート・インデックス・マザーファンド

2023年3月31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	19,259,740,251	75.78
	オーストラリア	1,650,843,825	6.50
	イギリス	1,205,128,160	4.74
	シンガポール	963,146,627	3.79
	フランス	451,010,601	1.77
	カナダ	449,981,963	1.77
	香港	399,033,507	1.57
	ベルギー	287,761,004	1.13
	スペイン	105,497,690	0.42
	ニュージーランド	103,040,182	0.41
	韓国	57,500,468	0.23
	オランダ	51,367,474	0.20
	ガーンジー	34,943,582	0.14
	イスラエル	31,819,621	0.13
	ドイツ	12,398,615	0.05
	アイルランド	8,573,103	0.03
イタリア	3,282,064	0.01	
小計		25,075,068,737	98.66
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	339,414,165	1.34
合計(純資産総額)		25,414,482,902	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	-	45,387,217	0.18

2【設定及び解約の実績】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	134,068,987	19,587,428
第2期	198,345,231	29,755,343
第3期	284,669,114	59,535,952
第4期	357,578,274	77,546,767
第5期	503,710,231	77,728,393
第6期(中間期)	252,591,718	54,854,259

(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6期中間計算期間(2022年9月13日から2023年3月12日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 (2022年 9月12日現在)	第6期中間計算期間 (2023年 3月12日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	691,882	653,769
コール・ローン	19,446,501	20,742,634
親投資信託受益証券	1,618,812,630	1,794,545,207
未収入金	395,000	-
流動資産合計	1,639,346,013	1,815,941,610
資産合計		
	1,639,346,013	1,815,941,610
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,192,741	1,385,212
未払受託者報酬	158,101	184,532
未払委託者報酬	1,502,342	1,753,473
未払利息	-	48
その他未払費用	47,438	55,394
流動負債合計	4,900,622	3,378,659
負債合計		
	4,900,622	3,378,659
純資産の部		
元本等		
元本	1,214,217,954	1,411,955,413
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	420,227,437	400,607,538
(分配準備積立金)	202,112,152	193,858,799
元本等合計	1,634,445,391	1,812,562,951
純資産合計		
	1,634,445,391	1,812,562,951
負債純資産合計		
	1,639,346,013	1,815,941,610

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期中間計算期間 自 2021年 9月11日 至 2022年 3月10日	第6期中間計算期間 自 2022年 9月13日 至 2023年 3月12日
営業収益		
受取利息	92	77
有価証券売買等損益	37,922,045	74,992,426
営業収益合計	37,921,953	74,992,349
営業費用		
支払利息	3,036	4,747
受託者報酬	124,852	184,532
委託者報酬	1,186,472	1,753,473
その他費用	37,750	55,652
営業費用合計	1,352,110	1,998,404
営業利益又は営業損失（ ）	39,274,063	76,990,753
経常利益又は経常損失（ ）	39,274,063	76,990,753
中間純利益又は中間純損失（ ）	39,274,063	76,990,753
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（ ）	521,872	2,925,253
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	226,170,241	420,227,437
剰余金増加額又は欠損金減少額	66,001,813	73,151,554
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	66,001,813	73,151,554
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,568,389	18,705,953
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,568,389	18,705,953
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（ ）	242,807,730	400,607,538

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第6期中間計算期間 自 2022年9月13日 至 2023年3月12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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当中間計算期間は前期末が休日のため、2022年9月13日から2023年3月12日までとなっております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期 (2022年9月12日現在)	第6期中間計算期間 (2023年3月12日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,214,217,954口	1,411,955,413口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3461円 (1万口当たりの純資産額13,461円)	1口当たり純資産額 1.2837円 (1万口当たりの純資産額12,837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6期中間計算期間 (2023年3月12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5期 (2022年9月12日現在)	第6期中間計算期間 (2023年3月12日現在)
期首元本額	788,236,116円	1,214,217,954円
期中追加設定元本額	503,710,231円	252,591,718円
期中一部解約元本額	77,728,393円	54,854,259円

(参考)

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドは、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「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」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」および「外国リート・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。

国内債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
(単位:円)		
資産の部		
流動資産		
金銭信託	15,404,179	9,693,714
コール・ローン	432,960,001	424,585,251
国債証券	104,003,852,680	94,724,528,290
地方債証券	10,290,112,600	9,358,693,500
特殊債券	9,372,625,977	8,999,510,047
社債券	6,035,333,600	6,554,441,000
未収入金	59,880,900	-
未収利息	361,877,661	342,791,522
前払費用	16,416,621	11,981,319
流動資産合計	130,588,464,219	120,426,224,643
資産合計	130,588,464,219	120,426,224,643
負債の部		
流動負債		
未払解約金	72,957,000	7,466,830
未払利息	-	984
その他未払費用	2,171	1,964
流動負債合計	72,959,171	7,469,778

負債合計	72,959,171	7,469,778
純資産の部		
元本等		
元本	105,070,373,916	98,422,885,457
剰余金		
剰余金又は欠損金()	25,445,131,132	21,995,869,408
元本等合計	130,515,505,048	120,418,754,865
純資産合計	130,515,505,048	120,418,754,865
負債純資産合計	130,588,464,219	120,426,224,643

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月13日 至 2023年3月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	105,070,373,916口	98,422,885,457口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2422円 (1万口当たりの純資産額12,422円)	1口当たり純資産額 1.2235円 (1万口当たりの純資産額12,235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	(2023年3月12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>

(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)

(2022年9月12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	106,912,762,885円
同期中における追加設定元本額	24,077,751,218円
同期中における一部解約元本額	25,920,140,187円
2022年9月12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)	7,405,294,843円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	12,270,168,802円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,846,992,295円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	823,848,056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)	41,070,800円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	188,185,362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)	504,029,049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)	879,417,622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)	450,102,528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)	581,272,184円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	140,807,106円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,924,964,674円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,056,053,003円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	422,825,277円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	57,571,397円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,949,732,234円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	654,426,007円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	970,730,653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	192,969,140円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	283,890,678円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	506,037,343円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	144,781,815円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	8,007,380円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,217,386,473円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	11,436,365,442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>	15,401,942,052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>	526,289,799円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	257,205,778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
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,124,463,694円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,254,065,737円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,157,611,864円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	961,967円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,109,862,458円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	415,038,581円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	499,895,584円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	170,458,356円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,709,085円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,352,499,366円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,036,009,210円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	649,577,213円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	210,001,663円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	20,814,251円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	265,467,132円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,985,334,340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>	1,213,665,167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>	1,185,737,715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>	1,518,563,091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>	5,104,008,838円
合計	105,070,373,916円

(2023年3月12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	105,070,373,916円
同期中における追加設定元本額	10,156,023,388円
同期中における一部解約元本額	16,803,511,847円
2023年3月12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)	8,059,060,040円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	12,929,720,578円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,070,418,190円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	730,535,067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)	41,854,235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)	200,118,070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)	552,449,258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)	955,279,633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)	506,039,972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)	638,606,515円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	140,216,448円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	988,245,910円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	334,157,236円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,049,588円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	69,399,965円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,194,836,813円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	748,365,990円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,143,981,151円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	259,379,179円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	43,469,971円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	223,359,780円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	319,228,609円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	626,452,038円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	186,962,155円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	8,974,314円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	363,085円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	298,337円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	201,623円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	109,828円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	109,828円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,162,297,813円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	10,026,548,513円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,858,337,168円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	14,831,160,710円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	299,804,746円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	474,854,090円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	248,499,049円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	120,221,118円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,728,657,415円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,036,392,293円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,141,556,909円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,669,396,318円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	961,967円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,067,781,928円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	385,918,055円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	476,420,978円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	165,177,003円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	44,327,528円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,258,676,673円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,957,126,760円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	607,683,002円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	203,979,338円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	20,783,621円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	254,841,092円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,723,846,231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>	1,242,330,620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>	1,138,627,175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>	1,455,336,960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>	1,836,096,978円
合計	98,422,885,457円

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	40,066,476	20,353,225
金銭信託	4,633,429	4,706,821
コール・ローン	130,230,195	206,159,025
国債証券	26,458,313,532	20,548,939,446
派生商品評価勘定	-	60,266,625
未収入金	347,174	-
未収利息	122,417,680	126,702,668
前払費用	32,362,060	13,740,286
流動資産合計	26,788,370,546	20,980,868,096
資産合計	26,788,370,546	20,980,868,096
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	677,805,939	2,055,853
未払金	4,017,074	147,324,100
未払解約金	78,399,999	-
未払利息	-	478
その他未払費用	963	754
流動負債合計	760,223,975	149,381,185
負債合計	760,223,975	149,381,185
純資産の部		
元本等		
元本	20,045,986,946	16,820,902,425
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	5,982,159,625	4,010,584,486
元本等合計	26,028,146,571	20,831,486,911
純資産合計	26,028,146,571	20,831,486,911
負債純資産合計	26,788,370,546	20,980,868,096

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年9月13日 至 2023年3月12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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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9月12日現在）	（2023年3月12日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	20,045,986,946口	16,820,902,425口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2984円 （1万口当たりの純資産額12,984円）	1口当たり純資産額 1.2384円 （1万口当たりの純資産額12,384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	（2023年3月12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）</p> <p>「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）</p> <p>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</p> <p>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）

（2022年9月12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		
	為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	13,537,941,900	-	13,863,496,764	325,554,864

市場取引以 外の取引	カナダ・ドル	549,654,508	-	568,885,200	19,230,692
	オーストラリア・ドル	406,652,232	-	418,476,630	11,824,398
	シンガポール・ドル	255,385,269	-	261,701,301	6,316,032
	イギリス・ポンド	1,207,560,495	-	1,239,904,337	32,343,842
	イスラエル・シケル	102,531,296	-	102,966,990	435,694
	デンマーク・クローネ	96,995,512	-	99,744,348	2,748,836
	ノルウェー・クローネ	53,836,115	-	55,665,060	1,828,945
	スウェーデン・クローナ	66,863,394	-	69,104,691	2,241,297
	メキシコ・ペソ	213,210,399	-	222,269,748	9,059,349
	オフショア・人民元	750,597,731	-	766,242,378	15,644,647
	ポーランド・ズロチ	113,156,055	-	117,516,542	4,360,487
	ユーロ	8,771,610,386	-	9,017,827,242	246,216,856
	小計	26,125,995,292	-	26,803,801,231	677,805,939
	合 計	26,125,995,292	-	26,803,801,231	677,805,939

(2023年3月12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	76,812,001	-	76,177,075	634,926
	カナダ・ドル	2,407,761	-	2,384,944	22,817
	オーストラリア・ドル	6,126,191	-	6,063,449	62,742
	ニュージーランド・ドル	842,747	-	827,013	15,734
	イギリス・ポンド	5,618,350	-	5,615,944	2,406
	デンマーク・クローネ	387,116	-	386,362	754
	メキシコ・ペソ	817,942	-	796,566	21,376
	オフショア・人民元	4,002,383	-	3,974,875	27,508
	ポーランド・ズロチ	1,353,343	-	1,346,339	7,004
	ユーロ	83,426,036	-	83,185,527	240,509
	小計	181,793,870	-	180,758,094	1,035,776
	売建				
	アメリカ・ドル	10,320,085,459	-	10,313,563,860	6,521,599
	カナダ・ドル	424,302,989	-	417,557,211	6,745,778
	オーストラリア・ドル	333,109,772	-	325,200,086	7,909,686

シンガポール・ドル	206,610,379	-	205,491,385	1,118,994
ニュージーランド・ドル	44,516,126	-	43,831,689	684,437
イギリス・ポンド	975,444,540	-	960,846,074	14,598,466
イスラエル・シケル	66,865,096	-	67,643,100	778,004
デンマーク・クローネ	66,989,281	-	66,840,626	148,655
ノルウェー・クローネ	42,920,453	-	41,648,355	1,272,098
スウェーデン・クローナ	42,842,176	-	41,672,785	1,169,391
メキシコ・ペソ	181,712,226	-	181,627,728	84,498
オフショア・人民元	986,045,316	-	981,487,368	4,557,948
ポーランド・ズロチ	93,885,096	-	94,119,985	234,889
ユーロ	6,899,309,876	-	6,883,861,985	15,447,891
小計	20,684,638,785	-	20,625,392,237	59,246,548
合計	20,866,432,655	-	20,806,150,331	58,210,772

(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)

(2022年9月12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	17,348,369,874円
同期中における追加設定元本額	10,681,951,147円
同期中における一部解約元本額	7,984,334,075円
2022年9月12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)	3,259,160,926円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,004,157,726円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	812,805,747円
イオン・バランス戦略ファンド	1,038,428,645円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,458,848,150円

三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	922,475,104円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	1,688,186,609円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	414,613,223円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	135,457,382円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	58,264,769円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	509,015,574円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,154,681,049円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	885,316円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	4,427,439,289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>	354,629,080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>	354,304,415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>	452,633,942円
合計	20,045,986,946円

(2023年3月12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	20,045,986,946円
同期中における追加設定元本額	2,514,010,522円
同期中における一部解約元本額	5,739,095,043円
2023年3月12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)	1,907,105,875円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	642,983,521円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,846,374円
イオン・バランス戦略ファンド	667,970,053円
三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)	2,851,209,350円
三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	1,092,216,453円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	2,079,614,543円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	512,425,383円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	170,644,845円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	70,551,897円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	565,234,893円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,116,669,391円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	885,316円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	3,673,662,431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>	466,596,380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>	433,948,468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>	555,337,252円
合計	16,820,902,425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)

(2022年9月12日現在)

(2023年3月12日現在)

資産の部		
流動資産		
預金	216,174,427	152,990,451
金銭信託	51,618,064	11,174,147
コール・ローン	1,450,811,286	489,428,259
国債証券	156,284,273,534	150,509,432,083
派生商品評価勘定	135,775	-
未収利息	895,513,359	967,301,515
前払費用	52,019,452	90,785,416
流動資産合計	158,950,545,897	152,221,111,871
資産合計	158,950,545,897	152,221,111,871
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	551,738	-
未払金	804,434,374	-
未払解約金	235,539,148	39,783,813
未払利息	-	1,134
その他未払費用	2,737	3,391
流動負債合計	1,040,527,997	39,788,338
負債合計	1,040,527,997	39,788,338
純資産の部		
元本等		
元本	76,795,410,154	78,529,125,247
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	81,114,607,746	73,652,198,286
元本等合計	157,910,017,900	152,181,323,533
純資産合計	157,910,017,900	152,181,323,533
負債純資産合計	158,950,545,897	152,221,111,871

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月13日 至 2023年3月12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>

	(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	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. 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	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	76,795,410,154口	78,529,125,247口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.0562円 (1万口当たりの純資産額20,562円)	1口当たり純資産額 1.9379円 (1万口当たりの純資産額19,379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	(2023年3月12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)

(2022年9月12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		
	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	419,826,935	-	419,385,707	441,228
	カナダ・ドル	19,096,753	-	19,096,996	243
	シンガポール・ドル	9,090,504	-	9,085,355	5,149
	イギリス・ポンド	40,962,831	-	41,031,426	68,595
	デンマーク・クローネ	3,622,456	-	3,620,897	1,559

市場取引以外の取引	オフショア・人民元	43,012,952	-	43,078,842	65,890
	ユーロ	277,328,813	-	277,225,882	102,931
	小計	812,941,244	-	812,525,105	416,139
	売建				
	デンマーク・クローネ	2,356	-	2,356	-
	ユーロ	1,229,058	-	1,228,882	176
	小計	1,231,414	-	1,231,238	176
	合計	814,172,658	-	813,756,343	415,963

(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。

(2023年3月12日現在)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2022年9月12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	81,240,238,352円
同期中における追加設定元本額	11,527,343,152円
同期中における一部解約元本額	15,972,171,350円
2022年9月12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	25,304,562,579円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	828,158,382円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,156,635,138円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,175,001,572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)	152,526,311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)	6,250,590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)	28,036,019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)	92,655,686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)	248,930,241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)	175,779,350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)	284,649,148円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,205,142円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	48,841,238円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	71,389,406円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	49,801,190円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	21,503,378円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	77,033,842円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	57,841,285円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	150,738,817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N I S A・世界分散ファンド	158,279,290円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	573,738,813円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	31,891,251円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	90,183,578円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	58,720,361円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,996,394円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	392,532,958円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	16,444,846円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	3,751,614,393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>	33,601,811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>	6,132,655,891円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	4,104,311,686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>	9,462,762,482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>	30,929,407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>	79,724,138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>	658,062,897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>	111,106,124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>	965,401,491円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	1,298,450,320円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	1,386,224,062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>	4,291,532,671円
S M A M・バランスV A株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定>	7,287,566,777円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	314,944,759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>	128,907,845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>	70,531,533円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用>	31,256,873円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	11,647,293円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用>	84,871,500円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L<適格機関投資家専用>	380,180,554円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2<適格機関投資家専用>	90,192,358円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2<適格機関投資家専用>	38,868,189円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2<適格機関投資家専用>	5,501,058円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2<適格機関投資家専用>	925,852,704円
S M A M・グローバルバランスファンド(標準型)V A<適格機関投資家限定>	568,480,944円
S M A M・グローバルバランスファンド(債券重視型)V A<適格機関投資家限定>	801,852,282円
S M A M・世界バランスファンドV A<適格機関投資家限定>	471,632,336円

S M A M・世界バランスファンドV A 2 <適格機関投資家限定>	292,927,346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>	127,771,330円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 <適格機関投資家限定>	98,401,799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>	126,093,242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>	284,951,860円
合 計	76,795,410,154円

(2023年3月12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	76,795,410,154円
同期中における追加設定元本額	7,035,830,084円
同期中における一部解約元本額	5,302,114,991円
2023年3月12日現在の元本の内訳	
三井住友・D C 外国債券インデックスファンドS	26,197,114,106円
三井住友・D C 年金バランス3 0 (債券重点型)	920,605,812円
三井住友・D C 年金バランス5 0 (標準型)	2,309,569,115円
三井住友・D C 年金バランス7 0 (株式重点型)	1,288,856,906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)	164,688,001円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 0 (4資産タイプ)	6,338,663円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 5 (4資産タイプ)	30,005,779円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 0 (4資産タイプ)	104,058,978円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 5 (4資産タイプ)	273,427,860円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 0 (4資産タイプ)	198,862,879円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 5 (4資産タイプ)	315,911,452円
三井住友・D C 年金バランスゼロ(債券型)	23,533,014円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	116,200,545円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	152,445,824円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	95,721,347円
三井住友D S・D C ターゲットイヤーファンド2 0 5 0	29,841,628円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	88,271,146円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	67,071,279円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	179,229,608円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	53,838,460円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	27,132,651円
三井住友・D C つみたてN I S A・世界分散ファンド	187,528,853円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	759,623,778円
三井住友D S・年金バランス3 0 (債券重点型)	36,694,308円
三井住友D S・年金バランス5 0 (標準型)	111,796,513円
三井住友D S・年金バランス7 0 (株式重点型)	78,424,624円
三井住友D S・D C ターゲットイヤーファンド2 0 6 0	3,855,167円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	917,390,648円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	105,557,895円
三井住友D S・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 5	27,622円
三井住友D S・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 0	32,834円
三井住友D S・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 5	40,651円

三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2055	47,947円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2065	47,947円
S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	4,256,856,781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>	30,152,077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>	5,518,731,923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>	3,950,525,621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>	9,244,600,710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>	29,825,111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>	74,453,005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>	637,940,236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>	110,927,414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>	942,176,072円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	1,268,921,919円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	1,323,429,747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>	4,104,174,292円
S M A M ・ バランスV A 株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンドV A <適格機関投資家限定>	7,072,543,934円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	344,567,758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>	118,096,909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>	67,375,516円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	30,968,221円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	11,644,067円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	79,129,938円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	363,615,745円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 <適格機関投資家専用>	87,070,123円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用>	37,478,954円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	5,511,845円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用>	890,605,298円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型)V A <適格機関投資家限定>	536,701,272円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型)V A <適格機関投資家限定>	733,398,496円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	389,506,805円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 <適格機関投資家限定>	266,204,180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>	83,861,394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>	69,615,592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>	89,341,857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>	914,773,879円
合 計	78,529,125,247円

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9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	89,834,626	37,327,371

コール・ローン	2,524,951,156	1,634,940,968
株式	214,676,540,430	230,708,282,750
派生商品評価勘定	67,567,100	-
未収入金	-	22,800
未収配当金	107,003,079	414,748,824
差入委託証拠金	112,590,000	68,040,000
流動資産合計	217,578,486,391	232,863,362,713
資産合計	217,578,486,391	232,863,362,713
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	13,345,800
前受金	53,125,000	21,840,000
未払金	-	711,000
未払解約金	116,384,998	436,226,903
未払利息	-	3,792
その他未払費用	11,209	8,084
流動負債合計	169,521,207	472,135,579
負債合計	169,521,207	472,135,579
純資産の部		
元本等		
元本	64,681,311,514	66,519,584,282
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	152,727,653,670	165,871,642,852
元本等合計	217,408,965,184	232,391,227,134
純資産合計	217,408,965,184	232,391,227,134
負債純資産合計	217,578,486,391	232,863,362,713

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月13日 至 2023年3月12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	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	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	64,681,311,514口	66,519,584,282口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.3612円 (1万口当たりの純資産額33,612円)	1口当たり純資産額 3.4936円 (1万口当たりの純資産額34,936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	(2023年3月12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)

(2022年9月12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 0412月	2,654,052,900	-	2,721,620,000	67,567,100
	小計	2,654,052,900	-	2,721,620,000	67,567,100
合計		2,654,052,900	-	2,721,620,000	67,567,100

(2023年3月12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 0506月	1,577,245,800	-	1,563,900,000	13,345,800
	小計	1,577,245,800	-	1,563,900,000	13,345,800
合計		1,577,245,800	-	1,563,900,000	13,345,800

(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)

(2022年9月12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	60,456,249,906円
同期中における追加設定元本額	12,113,029,153円
同期中における一部解約元本額	7,887,967,545円
2022年9月12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	9,532,155,480円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,024,578,616円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,612,955,175円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,551,056,908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)	122,904,750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)	4,296,896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)	19,400,437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)	62,615,670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)	164,050,569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)	145,160,441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)	260,258,888円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,387,774,054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	21,027,174,341円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	131,058,857円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	212,157,060円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	139,804,903円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2050	38,125,053円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	191,441,180円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	177,791,284円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	646,292,493円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	357,670,813円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	410,137,910円

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	48,149,518円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	752,883,758円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	39,292,044円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	191,390,450円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	181,956,760円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,290,169円
日興FWS・日本株インデックス	1,165,067,037円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	14,503,710円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,659,870,089円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	12,478,245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>	81,298,159円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,595,955,250円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,545,408,479円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	5,856,077,396円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	38,205,939円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	147,542,596円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	694,789,862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>	46,213,392円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	254,234,553円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	801,202,128円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	559,229,424円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,751,291,234円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	372,784円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	38,293,008円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	44,291,667円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	32,479,210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>	104,754,643円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	232,670,128円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	54,509,181円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	40,288,518円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,737,301円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	42,362,287円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	564,856,832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)	178,230,052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>	211,396,741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>	95,343,921円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	113,317,327円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	47,780,927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>	45,022,020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>	33,345,709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>	42,282,418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>	55,774,152円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	18,136,348円
合計	64,681,311,514円

(2023年3月12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	64,681,311,514円
同期中における追加設定元本額	5,682,598,980円
同期中における一部解約元本額	3,844,326,212円

2023年3月12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	9,545,668,036円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,039,151,268円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,612,846,977円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,623,858,126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)	148,533,266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)	4,065,731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)	19,440,050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)	64,738,989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)	168,607,670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)	154,640,923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)	272,495,648円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,301,288,236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	23,103,535,778円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	299,747,190円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	374,945,391円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	236,686,594円
イオン・バランス戦略ファンド	56,211,176円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	46,276,830円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	197,847,379円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	187,140,830円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	702,234,131円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	393,752,742円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	451,673,107円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	53,002,494円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	880,588,245円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	40,285,090円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	220,385,100円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	215,669,797円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,996,391円
日興F W S・日本株インデックス	1,510,978,990円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	24,191,078円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	48,704円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	55,576円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	66,034円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	75,894円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	75,894円
S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,529,871,063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>	14,136,432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>	66,570,035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>	1,298,693,337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>	1,383,954,610円

SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	5,288,189,044円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	35,485,948円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	129,345,747円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	632,234,488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>	43,533,209円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	227,367,598円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	733,752,353円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	510,008,664円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,548,628,503円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	352,709円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	34,600,904円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	39,166,060円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	30,431,766円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,165,009円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	90,085,562円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	217,333,061円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	48,463,668円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	35,298,082円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,431,986円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	38,647,210円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	500,642,771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)	164,454,904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>	195,183,336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>	81,328,537円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	82,473,235円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	40,348,643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>	41,505,716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>	33,840,500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>	43,917,512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>	362,577,705円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	16,759,020円
合 計	66,519,584,282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)

	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,391,761,553	3,857,558,342
金銭信託	59,808,893	4,987,881
コール・ローン	1,681,028,129	218,469,484
株式	418,939,787,808	442,339,061,501
投資証券	11,249,570,387	10,602,523,197
派生商品評価勘定	60,354,105	18,237,307

未収入金	23,211,666	309,364
未収配当金	864,034,421	907,544,304
差入委託証拠金	2,760,184,509	2,132,438,696
流動資産合計	439,029,741,471	460,081,130,076
資産合計	439,029,741,471	460,081,130,076
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	128,889,077	216,618,029
未払解約金	162,621,000	248,781,670
未払利息	-	506
その他未払費用	3,444	3,825
流動負債合計	291,513,521	465,404,030
負債合計	291,513,521	465,404,030
純資産の部		
元本等		
元本	69,094,291,205	75,578,656,846
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	369,643,936,745	384,037,069,200
元本等合計	438,738,227,950	459,615,726,046
純資産合計	438,738,227,950	459,615,726,046
負債純資産合計	439,029,741,471	460,081,130,076

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年9月13日 至 2023年3月12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	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	69,094,291,205口	75,578,656,846口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 6.3498円 (1万口当たりの純資産額63,498円)	1口当たり純資産額 6.0813円 (1万口当たりの純資産額60,813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	(2023年3月12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)

(2022年9月12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 S&P 500 EMINI FUT SEP22	6,690,495,733	-	6,651,129,185	39,366,548

市場取引	SPI 200 FUTURES SEP22	320,502,700	-	319,632,725	869,975
	FTSE 100 IDX FUT SEP22	379,115,789	-	378,834,640	281,149
	EURO STOXX 50 SEP22	1,195,871,658	-	1,176,182,770	19,688,888
	小計	8,585,985,880	-	8,525,779,320	60,206,560
	合 計	8,585,985,880	-	8,525,779,320	60,206,560

(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	1,168,388,166	-	1,160,919,696	7,468,470
	カナダ・ドル	56,159,908	-	55,946,420	213,488
	オーストラリア・ド ル	26,361,720	-	26,388,720	27,000
	香港・ドル	14,277,130	-	14,186,740	90,390
	シンガポール・ドル	7,176,161	-	7,145,785	30,376
	イギリス・ポンド	71,379,692	-	71,314,681	65,011
	イスラエル・シユケ ル	3,768,601	-	3,769,828	1,227
	スイス・フラン	44,594,262	-	44,654,042	59,780
	デンマーク・クロー ネ	10,877,972	-	10,830,024	47,948
	ノルウェー・クロー ネ	3,458,721	-	3,467,570	8,849
	スウェーデン・ク ローナ	13,635,679	-	13,623,593	12,086
	ユーロ	119,899,363	-	119,373,306	526,057
	小計	1,539,977,375	-	1,531,620,405	8,356,970
	売建				
	カナダ・ドル	2,193,644	-	2,193,740	96
	オーストラリア・ド ル	5,160,451	-	5,180,379	19,928
	香港・ドル	4,589,255	-	4,547,150	42,105
	イギリス・ポンド	4,974,837	-	4,975,080	243
	スイス・フラン	1,488,489	-	1,488,450	39
	ノルウェー・クロー ネ	577,684	-	577,880	196
	ユーロ	2,883,412	-	2,876,534	6,878
	小計	21,867,772	-	21,839,213	28,559
	合 計	1,561,845,147	-	1,553,459,618	8,328,411

(2023年3月12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

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				
	S&P 500 EMINI FUT MAR23	5,092,967,555	-	4,878,406,680	214,560,875
	SPI 200 FUTURES MAR23	246,276,191	-	245,924,550	351,641
	FTSE 100 IDX FUT MAR23	306,130,873	-	306,903,373	772,500
	EURO STOXX 50 MAR23	1,035,883,717	-	1,050,556,650	14,672,933
	小計	6,681,258,336	-	6,481,791,253	199,467,083
	合 計	6,681,258,336	-	6,481,791,253	199,467,083

(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	58,849,722	-	58,849,030	692
	小計	58,849,722	-	58,849,030	692
	売建				
	アメリカ・ドル	127,373,383	-	126,286,330	1,087,053
	小計	127,373,383	-	126,286,330	1,087,053
合 計		186,223,105	-	185,135,360	1,086,361

(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)

(2022年9月12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	59,015,956,817円
同期中における追加設定元本額	20,494,529,737円
同期中における一部解約元本額	10,416,195,349円
2022年9月12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	35,123,557,567円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	275,483,003円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,087,497,791円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	775,204,438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)	32,852,387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)	991,074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)	5,203,753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)	16,441,879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)	48,359,688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)	52,502,521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)	102,719,093円
外国株式指数ファンド	912,210,161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	16,360,503,530円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	87,908,136円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	97,508,641円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	63,989,360円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	18,659,575円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	129,836,552円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	115,457,713円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	417,317,703円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	223,443,393円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	259,357,529円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	51,775,463円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	1,286,812,799円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	10,651,413円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	44,388,614円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	39,139,513円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,603,182円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	297,954,594円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	211,751,353円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,158,782,933円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	42,491,244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)	476,572,355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>	3,247,568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>	21,720,183円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	572,483,865円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	732,038,670円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	3,177,896,398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>	52,946,745円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	427,084,701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>	38,301,233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>	440,464,244円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	302,091,664円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	713,165,783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)	198,878,953円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	62,426,977円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	7,719,760円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	6,951,628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>	18,307,293円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	53,269,072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>	113,544,613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>	50,332,592円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	322,507,095円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	82,837,181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>	1,673,632,092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>	14,551,834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>	11,351,913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>	14,541,240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>	44,070,821円
合計	69,094,291,205円

(2023年3月12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	69,094,291,205円
同期中における追加設定元本額	11,226,582,830円
同期中における一部解約元本額	4,742,217,189円
2023年3月12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	37,716,830,813円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	291,250,437円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,110,547,547円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	813,819,301円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	34,796,040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)	984,064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)	5,457,854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)	17,365,378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)	51,449,129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)	57,988,135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)	109,496,632円
外国株式指数ファンド	970,578,901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	18,862,075,943円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	139,776,013円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	173,771,188円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	108,600,174円
イオン・バランス戦略ファンド	23,635,162円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	23,869,007円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	138,725,214円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	125,940,294円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	468,729,224円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	254,756,811円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	295,023,299円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	59,118,836円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	1,905,485,014円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	11,361,775円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	53,005,543円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	48,493,992円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,083,614円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	537,999,804円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	323,464,820円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,760,236,234円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	55,996,112円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	22,505円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	27,108円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	33,586円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	39,724円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	39,724円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	418,412,080円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	4,079,135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>	18,997,417円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	483,887,764円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	678,624,260円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	2,968,447,459円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	9,822,476円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	47,808,223円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	401,254,495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>	35,766,460円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	84,832,561円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	411,687,872円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	285,814,713円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	651,616,409円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	195,290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)	188,524,259円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	58,376,901円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	7,134,203円

SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	6,599,547円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	3,833,026円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	16,578,047円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	51,140,413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>	105,383,191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>	44,957,268円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	248,532,488円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	71,006,432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>	1,416,226,598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>	16,756,227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>	14,013,949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>	17,872,703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>	256,600,029円
合 計	75,578,656,846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)

	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,576,229,216	1,521,213,452
金銭信託	2,158,311	1,574,017
コール・ローン	60,662,910	68,942,048
株式	19,267,678,516	23,896,631,147
投資信託受益証券	1,211,446,537	1,445,976,308
投資証券	1,910,817,739	2,186,976,687
派生商品評価勘定	1,804,422	-
未収配当金	47,894,311	43,748,412
差入委託証拠金	394,092,069	654,507,487
流動資産合計	24,472,784,031	29,819,569,558
資産合計	24,472,784,031	29,819,569,558
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	42,882,179	134,121,423
未払解約金	4,239,510	1,578,129
未払利息	-	158
その他未払費用	597	533
流動負債合計	47,122,286	135,700,243
負債合計	47,122,286	135,700,243
純資産の部		
元本等		
元本	14,201,860,735	18,132,916,892
剰余金		

剰余金又は欠損金()	10,223,801,010	11,550,952,423
元本等合計	24,425,661,745	29,683,869,315
純資産合計	24,425,661,745	29,683,869,315
負債純資産合計	24,472,784,031	29,819,569,558

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月13日 至 2023年3月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、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> <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>(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。</p> <p>(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。</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>
4. 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	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	14,201,860,735口	18,132,916,892口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7199円 (1万口当たりの純資産額17,199円)	1口当たり純資産額 1.6370円 (1万口当たりの純資産額16,370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	(2023年3月12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)

(2022年9月12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 SEP22	2,116,071,821	-	2,075,161,032	40,910,789
	小計	2,116,071,821	-	2,075,161,032	40,910,789
合計		2,116,071,821	-	2,075,161,032	40,910,789

(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	63,000,000	-	62,833,032	166,968
	小計	63,000,000	-	62,833,032	166,968
合計		63,000,000	-	62,833,032	166,968

(2023年3月12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 MAR23	2,262,527,710	-	2,128,586,422	133,941,288
	小計	2,262,527,710	-	2,128,586,422	133,941,288

合計	2,262,527,710	-	2,128,586,422	133,941,288
----	---------------	---	---------------	-------------

(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	23,000,000	-	22,819,865	180,135
	小計	23,000,000	-	22,819,865	180,135
合計		23,000,000	-	22,819,865	180,135

(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)

(2022年9月12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	8,888,051,553円
同期中における追加設定元本額	7,116,611,786円
同期中における一部解約元本額	1,802,802,604円
2022年9月12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	7,759,749,632円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,877,312,344円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	49,002,422円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	236,594,721円

アセットアロケーション・ファンド(成長型)	155,000,946円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	34,122,519円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	94,365,741円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	70,242,472円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	299,371,907円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	243,657,870円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	400,901,356円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	94,046,132円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	4,741,880円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	494,788,425円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,312,279,169円
三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド	11,175,759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>	64,507,440円
合計	14,201,860,735円

(2023年3月12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	14,201,860,735円
同期中における追加設定元本額	4,498,110,309円
同期中における一部解約元本額	567,054,152円
2023年3月12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	9,209,594,790円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,081,867,128円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	327,156,914円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	427,754,439円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	271,706,212円
イオン・バランス戦略ファンド	156,307,775円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	44,166,842円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	103,276,702円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	78,666,022円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	351,106,019円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	286,634,906円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	473,886,463円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	106,676,249円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,714,445円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	899,583,832円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,228,938,673円
三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド	18,998,970円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	39,354円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	47,702円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	59,031円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	69,168円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	69,168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>	60,596,088円
合計	18,132,916,892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)

	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,734,473	976,113
コール・ローン	48,750,235	42,753,806
投資証券	9,847,729,000	11,270,837,600
派生商品評価勘定	283,600	-
未収入金	-	358,785
未収配当金	114,103,009	151,463,640
前払金	-	108,000
差入委託証拠金	2,350,000	2,200,000
流動資産合計	10,014,950,317	11,468,697,944
資産合計	10,014,950,317	11,468,697,944
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	192,400
前受金	208,000	-
未払解約金	729,780	1,067,097
未払利息	-	98
その他未払費用	479	292
流動負債合計	938,259	1,259,887
負債合計	938,259	1,259,887
純資産の部		
元本等		
元本	3,618,768,466	4,527,539,911
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	6,395,243,592	6,939,898,146
元本等合計	10,014,012,058	11,467,438,057
純資産合計	10,014,012,058	11,467,438,057
負債純資産合計	10,014,950,317	11,468,697,944

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年9月13日 至 2023年3月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (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>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p> <p>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</p> <p>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9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,618,768,466口	4,527,539,911口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.7672円 (1万口当たりの純資産額27,672円)	1口当たり純資産額 2.5328円 (1万口当たりの純資産額25,328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	(2023年3月12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(投資証券)</p> <p>「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)</p> <p>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</p> <p>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)

(2022年9月12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		
	リート指数先物取引				

市場取引	買建				
	TREIT 先物 0412月	40,146,400	-	40,430,000	283,600
	小計	40,146,400	-	40,430,000	283,600
	合 計	40,146,400	-	40,430,000	283,600

(2023年3月12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 0506月	36,382,400	-	36,190,000	192,400
	小計	36,382,400	-	36,190,000	192,400
	合 計	36,382,400	-	36,190,000	192,400

(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)

(2022年9月12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	2,675,035,456円
同期中における追加設定元本額	2,538,256,373円
同期中における一部解約元本額	1,594,523,363円
2022年9月12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)	69,933,114円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	138,890,778円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	107,176,523円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,119,488,327円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	16,140,629円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	57,002,092円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	42,983,263円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	148,291,027円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	83,664,634円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	65,470,159円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	28,910,457円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,245,677円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	85,939,337円

日興FWS・Jリートインデックス	305,206,603円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	20,225,759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>	3,493,800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>	63,085,945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>	48,115,503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>	61,060,756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>	151,444,083円
合計	3,618,768,466円

(2023年3月12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	3,618,768,466円
同期中における追加設定元本額	1,421,934,551円
同期中における一部解約元本額	513,163,106円
2023年3月12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)	226,397,249円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	305,708,131円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	146,354,780円
イオン・バランス戦略ファンド	30,645,687円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,344,888,211円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	16,345,622円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	68,293,308円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	51,203,366円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	183,019,784円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	102,954,850円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	82,033,861円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	34,898,429円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,105,549円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	195,798,657円
日興FWS・Jリートインデックス	448,045,672円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	52,050,243円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	10,354円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	13,938円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	20,309円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	26,282円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	26,282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>	3,304,473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>	48,692,628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>	40,824,607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>	51,471,466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>	92,406,173円
合計	4,527,539,911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)

	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	141,283,164	278,584,119
金銭信託	1,988,582	830,112
コール・ローン	55,892,399	36,358,957
投資証券	25,792,800,161	25,717,724,142
派生商品評価勘定	84,452	368,679
未収入金	1,725,836	2,217,998
未収配当金	46,375,941	74,252,366
流動資産合計	26,040,150,535	26,110,336,373
資産合計	26,040,150,535	26,110,336,373
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	343,991	344,278
未払金	7,135,212	-
未払解約金	20,688,744	320,000
未払利息	-	84
その他未払費用	335	363
流動負債合計	28,168,282	664,725
負債合計	28,168,282	664,725
純資産の部		
元本等		
元本	8,375,587,967	9,476,224,426
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	17,636,394,286	16,633,447,222
元本等合計	26,011,982,253	26,109,671,648
純資産合計	26,011,982,253	26,109,671,648
負債純資産合計	26,040,150,535	26,110,336,373

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年9月13日 至 2023年3月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (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>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p> <p>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</p> <p>直近の最終相場等によって時価評価することが適切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. 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>
4. 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9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	8,375,587,967口	9,476,224,426口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.1057円 (1万口当たりの純資産額31,057円)	1口当たり純資産額 2.7553円 (1万口当たりの純資産額27,553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	(2023年3月12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(投資証券)</p> <p>「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)</p> <p>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</p> <p>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)

(2022年9月12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 1年超	時 価	評価損益
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	50,900,000	-	50,566,235	333,765
	オーストラリア・ド ル	2,000,000	-	2,007,723	7,723
	シンガポール・ドル	1,200,000	-	1,193,095	6,905
	イギリス・ボンド	2,100,000	-	2,096,944	3,056
	小計	56,200,000	-	55,863,997	336,003
	売建				
	アメリカ・ドル	11,500,000	-	11,423,536	76,464
小計	11,500,000	-	11,423,536	76,464	
合 計		67,700,000	-	67,287,533	259,539

(2023年3月12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	41,900,000	-	41,588,960	311,040
	イギリス・ボンド	5,500,000	-	5,496,164	3,836
	ユーロ	5,700,000	-	5,670,598	29,402
	小計	53,100,000	-	52,755,722	344,278
	売建				
	カナダ・ドル	25,500,000	-	25,131,321	368,679
	小計	25,500,000	-	25,131,321	368,679
合 計		78,600,000	-	77,887,043	24,401

(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)

(2022年9月12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	5,775,124,200円
同期中における追加設定元本額	3,433,415,780円
同期中における一部解約元本額	832,952,013円
2022年9月12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)	14,980,843円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	10,475,502円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	7,137,094,577円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	5,263,802円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	51,759,489円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	38,646,421円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	134,204,157円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	75,760,513円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	59,288,519円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	79,095,393円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	735,756円
三井住友D S・外国リートインデックス年金ファンド	202,203,903円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	73,572,988円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	313,985,162円
三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド	22,192,438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>	37,778,851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>	30,874,063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>	74,020,828円
合計	8,375,587,967円

(2023年3月12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	8,375,587,967円
同期中における追加設定元本額	1,483,120,473円
同期中における一部解約元本額	382,484,014円
2023年3月12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)	23,413,696円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	31,557,028円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	66,797,802円
イオン・バランス戦略ファンド	78,808,279円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	7,661,329,538円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	6,782,666円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	61,984,484円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	46,265,977円

三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	163,877,247円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	91,944,781円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	73,248,141円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	95,394,016円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	881,315円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	363,158,524円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	98,304,170円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	459,448,180円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	24,087,055円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	7,339円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	7,706円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	9,541円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	11,376円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	11,376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>	35,722,574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>	31,468,138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>	61,703,477円
合計	9,476,224,426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

2023年3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。

2023年3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	704	9,454,549
単位型株式投資信託	96	567,793
追加型公社債投資信託	1	23,746
単位型公社債投資信託	172	279,956
合計	973	10,326,045

(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。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「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。

なお、当中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2 当社は、第37期(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、第38期中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)の中間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 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

		(単位：千円)	
		前事業年度 (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 (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)
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 至 2021年3月31日) (自 2021年4月1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		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	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		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	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いません。

(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	(株)三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,728,851	未払 手数料	863,159
親会社 の 子会社	SMBC日興 証券(株)	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,578,226	未払 手数料	1,070,559

(注) 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

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

第38期中間会計期間 (2022年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	35,409,452
金銭の信託	9,386,865
顧客分別金信託	300,043
前払費用	601,040
未収委託者報酬	11,798,214
未収運用受託報酬	2,759,722
未収投資助言報酬	386,860
未収収益	40,783
その他	307,594
流動資産合計	60,990,577
固定資産	
有形固定資産	1 2,044,583
無形固定資産	
のれん	3,197,680
顧客関連資産	12,501,978
その他	2,865,181
無形固定資産合計	18,564,839
投資その他の資産	
投資有価証券	11,924,303
関係会社株式	11,850,598
その他	1,571,118
貸倒引当金	20,750
投資その他の資産合計	25,325,270
固定資産合計	45,934,694
資産合計	106,925,272
負債の部	
流動負債	
リース債務	2,564
顧客からの預り金	28,648
その他の預り金	93,717
未払金	5,378,614
未払費用	4,957,793
未払法人税等	910,281
前受収益	32,553
賞与引当金	1,973,312
その他	2 482,541
流動負債合計	13,860,025
固定負債	
リース債務	3,243
繰延税金負債	987,563
退職給付引当金	5,137,995
固定負債合計	6,128,802
負債合計	19,988,828
純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	

資本準備金	8,628,984
その他資本剰余金	73,466,962
資本剰余金合計	82,095,946
利益剰余金	
利益準備金	284,245
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	2,489,135
利益剰余金合計	2,773,380
株主資本合計	86,869,326
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	67,117
評価・換算差額等合計	67,117
純資産合計	86,936,444
負債純資産合計	106,925,272

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			31,446,166
運用受託報酬			4,428,746
投資助言報酬			607,317
その他の営業収益			126,597
営業収益計			36,608,828
営業費用			25,074,910
一般管理費	1		9,497,685
営業利益			2,036,233
営業外収益	2		87,533
営業外費用	3		309,096
経常利益			1,814,670
特別損失	4		6,885
税引前中間純利益			1,807,784
法人税、住民税及び事業税			784,532
法人税等調整額			171,342
法人税等合計			613,189
中間純利益			1,194,594

(3)中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			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	利益 準備金	その他利益剰余金 繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,834,794
当中間期変動額						

剰余金の配当						2,540,254
中間純利益						1,194,594
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)						
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	1,345,660
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	2,489,135

	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	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124
当中間期変動額					
剰余金の配当	2,540,254	2,540,254			2,540,254
中間純利益	1,194,594	1,194,594			1,194,594
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)			230,020	230,020	230,020
当中間期変動額 合計	1,345,660	1,345,660	230,020	230,020	1,575,680
当中間期末残高	2,773,380	86,869,326	67,117	67,117	86,936,444

注記事項

(重要な会計方針)

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末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)金銭の信託

運用目的の金銭の信託

時価法

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 8～50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中間会計期間の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職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、当中間会計期間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中間会計期間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）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる当中間財務諸表に与える影響はありません。

（中間貸借対照表関係）

第38期中間会計期間 (2022年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,632,164千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.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。当中間会計期間末における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。	当座借越極度額の総額 10,000,000千円 借入実行残高 - 差引額 10,000,000千円
4.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40,711千円の支払保証を行っております。	

（中間損益計算書関係）

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1. 一般管理費のうち主要なもの	
のれん償却費	152,270千円
減価償却実施額	
有形固定資産	173,639千円
無形固定資産	1,441,546千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
為替差益	7,815千円
受取配当金	1,230千円
投資有価証券償還益	20,660千円
投資有価証券売却益	25,620千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	43,419千円
投資有価証券売却損	152,586千円
金銭の信託運用損	113,089千円
4. 特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	6,885千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1. 発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 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

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）

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1. オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	1,161,545千円
1年超	1,742,317千円
合計	2,903,862千円

（金融商品関係）

1. 金融商品の時価等に関する事項

第38期中間会計期間（2022年9月30日）

2022年9月30日における中間貸借対照表計上額、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、次表には含まれておりません（（注1）参照）。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価格に近似することから、注記を省略しております。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 金銭の信託	9,386,865	9,386,865	-
(2) 投資有価証券 その他有価証券	11,884,494	11,884,494	-
資産計	21,271,360	21,271,360	-

（注1）市場価格のない金融商品

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	39,809
合計	39,809
子会社株式 非上場株式	11,850,598
合計	11,850,598

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日）第5項に従い、1.金融商品の時価等に関する事項及び2.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

（単位：千円）

区分	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
(1)金銭の信託	-	9,386,865	-	9,386,865
(2)投資有価証券 その他有価証券	-	11,884,494	-	11,884,494
資産計	-	21,271,360	-	21,271,360

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

(1) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 投資有価証券 その他有価証券

投資有価証券は、市場での取引頻度が低く、活発な市場における相場価格とは認められないため、公表されている基準価額又は取引金融機関から提示された価格により評価しております。

（有価証券関係）

第38期中間会計期間（2022年9月30日）

1. 子会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 11,850,598千円）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

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	4,799,952	4,484,899	315,053
小計	4,799,952	4,484,899	315,053
(2)中間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	7,084,541	7,290,117	205,575
小計	7,084,541	7,290,117	205,575
合計	11,884,494	11,775,016	109,477

（注）非上場株式等（中間貸借対照表計上額 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。

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（収益認識関係）

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

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）

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30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	31,446,166	4,428,746	607,317	126,597	36,608,828

(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中間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中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、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、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

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

該当事項はありません。

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。

（1株当たり情報）

第38期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
1株当たり純資産額	2,566円76銭
1株当たり中間純利益	35円26銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。	

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11月18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 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、「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2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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アセットマネジメント株式会社の2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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、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、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。

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。

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、企業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、監査役及び監査役会に対して、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

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 . X B R 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

2023年5月30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・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの2022年9月13日から2023年3月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの2023年3月12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9月13日から2023年3月12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。