

## 【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8月28日提出
【計算期間】	第3期中(自 2022年12月1日至 2023年5月31日)
【ファンド名】	三井住友D S ・ T O P I X インデックス・ファンド 三井住友D S ・ 日経 2 2 5 インデックス・ファンド 三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド 三井住友D S ・ 新興国株式インデックス・ファンド 三井住友D S ・ 先進国債インデックス・ファンド 三井住友D S ・ 新興国債インデックス・ファンド 三井住友D S ・ 国内リートインデックス・ファンド 三井住友D S ・ 先進国リートインデックス・ファンド 三井住友D S ・ ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）
【発行者名】	三井住友D S アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【電話番号】	03-6205-1649
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【ファンドの運用状況】

## (1)【投資状況】

## 三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	169,920,470	100.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	49,833	0.03
合計（純資産総額）		169,870,637	100.00

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

## 三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	338,389,014	100.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	101,909	0.03
合計（純資産総額）		338,287,105	100.00

## 三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	572,940,498	100.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	211,697	0.04
合計（純資産総額）		572,728,801	100.00

## 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	106,858,333	100.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	39,871	0.04
合計（純資産総額）		106,818,462	100.00

## 三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	313,991,949	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	72,805	0.02
合計(純資産総額)		313,919,144	100.00

## 三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	11,049,180	98.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	181,206	1.61
合計(純資産総額)		11,230,386	100.00

## 三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	150,443,712	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	46,551	0.03
合計(純資産総額)		150,397,161	100.00

## 三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	340,123,846	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	97,190	0.03
合計(純資産総額)		340,026,656	100.00

## 三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	732,276,317	102.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	15,729,077	2.20
合計(純資産総額)		716,547,240	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	-	43,312,740	6.04
為替予約取引	売建	-	762,159,847	106.37

## (2)【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	6,046,349	6,046,349	10,294	10,294
第2期 (2022年11月30日)	61,728,569	61,728,569	10,830	10,830
2022年 6月末日	19,836,530	-	10,113	-
7月末日	34,177,319	-	10,483	-
8月末日	44,818,475	-	10,603	-
9月末日	48,813,534	-	10,016	-
10月末日	57,694,445	-	10,524	-
11月末日	61,728,569	-	10,830	-
12月末日	60,547,572	-	10,332	-
2023年 1月末日	79,728,160	-	10,783	-
2月末日	81,815,138	-	10,881	-
3月末日	104,935,888	-	11,061	-
4月末日	121,671,271	-	11,354	-
5月末日	130,501,091	-	11,760	-
6月末日	169,870,637	-	12,642	-

## 三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	69,516,804	69,516,804	10,362	10,362
第2期 (2022年11月30日)	272,425,967	272,425,967	10,597	10,597
2022年 6月末日	95,590,815	-	9,928	-
7月末日	170,027,443	-	10,455	-
8月末日	207,376,259	-	10,566	-
9月末日	210,108,450	-	9,833	-
10月末日	254,004,157	-	10,453	-
11月末日	272,425,967	-	10,597	-
12月末日	257,789,209	-	9,898	-
2023年 1月末日	269,323,406	-	10,361	-
2月末日	269,799,063	-	10,409	-
3月末日	287,815,631	-	10,735	-
4月末日	297,021,102	-	11,045	-
5月末日	298,879,557	-	11,829	-

6月末日	338,287,105	-	12,724	-
------	-------------	---	--------	---

## 三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	74,584,829	74,584,829	10,652	10,652
第2期 (2022年11月30日)	309,023,748	309,023,748	11,100	11,100
2022年 6月末日	126,561,355	-	10,522	-
7月末日	184,069,131	-	10,929	-
8月末日	242,421,778	-	10,994	-
9月末日	255,478,229	-	10,448	-
10月末日	319,206,849	-	11,442	-
11月末日	309,023,748	-	11,100	-
12月末日	284,543,761	-	10,412	-
2023年 1月末日	324,401,618	-	10,799	-
2月末日	331,799,734	-	11,173	-
3月末日	363,770,293	-	11,111	-
4月末日	452,409,580	-	11,409	-
5月末日	507,297,860	-	11,936	-
6月末日	572,728,801	-	12,870	-

## 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	3,024,503	3,024,503	10,217	10,217
第2期 (2022年11月30日)	22,496,244	22,496,244	9,972	9,972
2022年 6月末日	10,692,756	-	10,366	-
7月末日	12,501,382	-	10,116	-
8月末日	18,792,959	-	10,317	-
9月末日	27,505,993	-	9,533	-
10月末日	27,724,613	-	9,456	-
11月末日	22,496,244	-	9,972	-
12月末日	24,020,869	-	9,567	-
2023年 1月末日	26,133,711	-	10,231	-
2月末日	31,912,428	-	9,922	-
3月末日	31,316,112	-	9,936	-
4月末日	94,122,784	-	9,834	-
5月末日	98,920,896	-	10,249	-
6月末日	106,818,462	-	10,869	-

## 三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	6,787,059	6,787,059	10,037	10,037
第2期 (2022年11月30日)	80,135,860	80,135,860	10,037	10,037
2022年 6月末日	11,764,755	-	10,226	-
7月末日	25,681,595	-	10,286	-
8月末日	32,524,384	-	10,159	-
9月末日	35,150,749	-	10,064	-
10月末日	59,970,450	-	10,349	-
11月末日	80,135,860	-	10,037	-
12月末日	79,902,505	-	9,542	-
2023年 1月末日	84,327,982	-	9,652	-
2月末日	191,756,225	-	9,759	-
3月末日	209,478,882	-	9,878	-
4月末日	281,851,611	-	9,944	-
5月末日	290,938,002	-	10,197	-
6月末日	313,919,144	-	10,599	-

## 三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	1,607,853	1,607,853	9,918	9,918
第2期 (2022年11月30日)	11,569,350	11,569,350	9,187	9,187
2022年 6月末日	6,738,227	-	8,865	-
7月末日	9,260,324	-	9,118	-
8月末日	10,337,423	-	9,293	-
9月末日	10,965,206	-	9,000	-
10月末日	11,387,535	-	9,260	-
11月末日	11,569,350	-	9,187	-
12月末日	12,735,895	-	8,780	-
2023年 1月末日	13,254,529	-	8,840	-
2月末日	9,330,041	-	9,005	-
3月末日	14,448,431	-	9,019	-
4月末日	15,978,577	-	9,150	-
5月末日	10,699,855	-	9,386	-
6月末日	11,230,386	-	9,808	-

## 三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	2,142,283	2,142,283	9,513	9,513
第2期 (2022年11月30日)	118,055,864	118,055,864	9,600	9,600
2022年 6月末日	6,680,661	-	9,485	-
7月末日	27,600,300	-	9,757	-
8月末日	55,184,057	-	9,862	-
9月末日	53,211,128	-	9,453	-
10月末日	78,629,032	-	9,607	-
11月末日	118,055,864	-	9,600	-
12月末日	129,503,608	-	9,259	-
2023年 1月末日	128,023,134	-	8,964	-
2月末日	131,891,486	-	9,102	-
3月末日	130,045,173	-	8,839	-
4月末日	144,748,985	-	9,286	-
5月末日	149,117,185	-	9,343	-
6月末日	150,397,161	-	9,283	-

## 三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	2,304,754	2,304,754	10,763	10,763
第2期 (2022年11月30日)	86,933,845	86,933,845	10,597	10,597
2022年 6月末日	14,800,203	-	10,923	-
7月末日	31,378,532	-	11,486	-
8月末日	62,961,309	-	11,221	-
9月末日	60,685,807	-	9,992	-
10月末日	69,646,483	-	10,862	-
11月末日	86,933,845	-	10,597	-
12月末日	72,935,232	-	9,934	-
2023年 1月末日	80,501,073	-	10,587	-
2月末日	68,062,862	-	10,696	-
3月末日	64,105,282	-	9,958	-
4月末日	122,103,502	-	10,177	-
5月末日	123,970,538	-	10,328	-
6月末日	340,026,656	-	11,061	-

## 三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)

第1期 (2021年11月30日)	37,563,029	37,563,029	9,748	9,748
第2期 (2022年11月30日)	335,482,332	335,482,332	9,277	9,277
2022年 6月末日	98,317,058	-	9,826	-
7月末日	201,552,282	-	9,467	-
8月末日	303,012,975	-	9,277	-
9月末日	317,170,668	-	8,899	-
10月末日	319,678,955	-	8,778	-
11月末日	335,482,332	-	9,277	-
12月末日	370,992,255	-	9,557	-
2023年 1月末日	433,118,317	-	10,039	-
2月末日	450,007,450	-	9,441	-
3月末日	497,083,038	-	10,230	-
4月末日	622,269,346	-	10,217	-
5月末日	678,039,843	-	10,025	-
6月末日	716,547,240	-	9,710	-

## 【分配の推移】

## 三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0

## 三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0

## 三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0

## 三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0

## 三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0

## 三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0

## 三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0

## 三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0

## 三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0

## 【収益率の推移】

## 三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	2.9
第2期	5.2
第3期(中間期)	8.6

(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。

## 三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	3.6
第2期	2.3

第3期(中間期)	11.6
----------	------

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

#### 三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	6.5
第2期	4.2
第3期(中間期)	7.5

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

#### 三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	2.2
第2期	2.4
第3期(中間期)	2.8

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

#### 三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	0.4
第2期	0.0
第3期(中間期)	1.6

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

#### 三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	0.8
第2期	7.4
第3期(中間期)	2.2

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

#### 三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	4.9
第2期	0.9

第3期(中間期)	2.7
----------	-----

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

### 三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	7.6
第2期	1.5
第3期(中間期)	2.5

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

### 三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

	収益率(%)
第1期	2.5
第2期	4.8
第3期(中間期)	8.1

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

(参考)

(1) 投資状況

### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	260,516,878,710	98.35
新株予約権証券	日本	4,583,500	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	4,368,631,266	1.65
合計(純資産総額)		264,890,093,476	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	4,187,040,000	1.58
合計	買建	-	4,187,040,000	1.58

### 2.2.5 マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	142,007,788,700	96.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	5,087,779,009	3.46
合計(純資産総額)		147,095,567,709	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	5,075,010,000	3.45
合計	買建	-	5,075,010,000	3.45

### 外国株式インデックス・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	376,923,470,583	67.74
	イギリス	22,147,978,064	3.98
	カナダ	18,836,698,891	3.39
	フランス	17,938,082,119	3.22
	スイス	17,557,801,195	3.16
	ドイツ	13,472,062,864	2.42
	オランダ	10,606,409,850	1.91
	オーストラリア	10,398,561,564	1.87
	アイルランド	10,168,016,479	1.83
	デンマーク	4,777,567,515	0.86
	スウェーデン	4,767,995,486	0.86
	スペイン	4,051,386,542	0.73
	香港	3,003,311,675	0.54
	イタリア	2,899,228,010	0.52
	ジャージー	1,891,424,138	0.34
	シンガポール	1,754,593,165	0.32
	フィンランド	1,748,969,512	0.31
	ベルギー	1,187,824,223	0.21
	ノルウェー	1,001,835,119	0.18
	イスラエル	998,491,512	0.18
	ケイマン諸島	923,601,937	0.17
	バミューダ	750,504,856	0.13
	オランダ領キュラソー	696,343,243	0.13
	ニュージーランド	446,863,076	0.08
	ルクセンブルグ	300,783,289	0.05
	ポルトガル	286,718,611	0.05
	オーストリア	282,702,958	0.05
	リベリア	237,031,293	0.04
パナマ	173,527,540	0.03	
マン島	95,214,591	0.02	
小計	530,324,999,900	95.31	
投資証券	アメリカ	9,656,921,743	1.74
	オーストラリア	1,031,103,519	0.19
	シンガポール	203,274,071	0.04

	香港	199,563,015	0.04
	イギリス	191,912,967	0.03
	フランス	178,365,792	0.03
	カナダ	59,837,911	0.01
	ベルギー	52,359,397	0.01
	小計	11,573,338,415	2.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	14,548,231,003	2.61
合計(純資産総額)		556,446,569,318	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	629,662,674	0.11
株価指数先物取引	買建	ドイツ	2,181,310,080	0.39
株価指数先物取引	買建	アメリカ	11,190,625,429	2.01
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	496,725,470	0.09
合計	買建	-	14,498,323,653	2.61

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	-	1,936,706,089	0.35

#### エマージング株式インデックス・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	ケイマン諸島	5,167,755,110	14.89
	台湾	4,769,942,888	13.74
	インド	4,546,448,670	13.10
	韓国	3,821,950,290	11.01
	中国	2,132,772,605	6.14
	ブラジル	1,642,213,495	4.73
	南アフリカ	956,643,991	2.76
	メキシコ	674,981,008	1.94
	インドネシア	622,760,615	1.79
	タイ	586,866,420	1.69
	マレーシア	415,100,099	1.20
	香港	320,575,440	0.92
	ポーランド	241,127,719	0.69
	フィリピン	203,416,358	0.59
	トルコ	172,563,936	0.50
	チリ	167,633,151	0.48
	ギリシャ	140,594,116	0.41
	アメリカ	136,745,088	0.39
	バミューダ	135,862,137	0.39
	ハンガリー	73,901,496	0.21
チェコ	46,095,099	0.13	
コロンビア	30,584,144	0.09	

	ルクセンブルグ	29,395,253	0.08
	エジプト	23,754,846	0.07
	オランダ	18,652,116	0.05
	シンガポール	6,996,700	0.02
	ペルー	6,259,702	0.02
	小計	27,091,592,492	78.04
投資信託受益証券	香港	1,518,073,099	4.37
投資証券	アメリカ	2,225,666,215	6.41
	メキシコ	200,997,200	0.58
	ブラジル	68,931,769	0.20
	南アフリカ	8,389,130	0.02
	香港	125,888	0.00
	小計	2,504,110,202	7.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	3,600,421,025	10.38
合計(純資産総額)		34,714,196,818	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,575,231,565	10.30
合計	買建	-	3,575,231,565	10.30

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	-	55,343,744	0.16

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	80,893,762,278	48.52
	フランス	13,588,630,823	8.15
	イタリア	12,501,359,770	7.50
	ドイツ	10,854,599,136	6.51
	中国	8,889,034,406	5.33
	スペイン	8,429,210,705	5.06
	イギリス	7,926,304,084	4.75
	カナダ	3,390,593,709	2.03
	ベルギー	3,118,811,252	1.87
	オランダ	2,627,127,226	1.58
	オーストラリア	2,513,320,457	1.51
	オーストリア	2,125,773,652	1.27
	メキシコ	1,629,536,527	0.98
	アイルランド	965,305,673	0.58
	マレーシア	858,970,854	0.52
	ポーランド	808,762,575	0.49
	フィンランド	805,176,824	0.48
シンガポール	733,073,700	0.44	

	デンマーク	517,196,338	0.31
	イスラエル	485,217,510	0.29
	ニュージーランド	332,633,127	0.20
	スウェーデン	322,096,961	0.19
	ノルウェー	260,265,127	0.16
	小計	164,576,762,714	98.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,152,097,490	1.29
合計(純資産総額)		166,728,860,204	100.00

## 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	サウジアラビア	397,807,903	9.70
	メキシコ	361,827,329	8.83
	アラブ首長国連邦	333,288,513	8.13
	カタール	328,153,547	8.01
	トルコ	307,156,965	7.49
	ブラジル	290,766,570	7.09
	ドミニカ共和国	254,645,937	6.21
	チリ	245,379,046	5.99
	コロンビア	238,561,036	5.82
	パナマ	217,841,240	5.31
	オマーン	205,782,567	5.02
	ペルー	182,868,347	4.46
	中国	141,120,216	3.44
	インドネシア	136,362,515	3.33
	ウルグアイ	113,587,485	2.77
	南アフリカ	99,652,786	2.43
	ポーランド	86,396,641	2.11
	フィリピン	67,933,904	1.66
	小計	4,009,132,547	97.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	89,939,748	2.19
合計(純資産総額)		4,099,072,295	100.00

## Jリート・インデックス・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	12,230,990,700	98.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	132,377,012	1.07
合計(純資産総額)		12,363,367,712	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	36,860,000	0.30
合計	買建	-	36,860,000	0.30

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	22,503,778,857	77.23
	オーストラリア	1,872,012,144	6.42
	イギリス	1,260,765,384	4.33
	シンガポール	1,043,829,491	3.58
	フランス	491,112,891	1.69
	カナダ	482,566,772	1.66
	香港	387,482,777	1.33
	ベルギー	275,847,596	0.95
	ニュージーランド	113,613,377	0.39
	スペイン	109,250,362	0.37
	韓国	66,806,485	0.23
	オランダ	53,248,825	0.18
	イスラエル	35,885,967	0.12
	ガーンジィ	32,214,132	0.11
	ドイツ	11,791,758	0.04
	アイルランド	9,459,449	0.03
イタリア	3,002,584	0.01	
小計		28,752,668,851	98.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	384,700,686	1.32
合計(純資産総額)		29,137,369,537	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	-	34,545,559	0.12

## ゴールド・インデックス・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	5,814,810,625	99.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	46,664,194	0.80
合計(純資産総額)		5,861,474,819	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	-	19,564,767	0.33

## 2【設定及び解約の実績】

## 三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	11,131,313	5,257,925
第2期	52,125,564	1,000,000
第3期(中間期)	60,376,239	6,402,049

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	68,267,713	1,179,562
第2期	221,907,962	31,922,134
第3期(中間期)	62,027,975	66,442,371

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	72,990,426	2,971,998
第2期	270,552,214	62,163,465
第3期(中間期)	219,098,924	72,484,046

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2,960,151	0
第2期	29,976,495	10,377,413
第3期(中間期)	80,987,826	7,026,436

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	6,762,046	0
第2期	86,535,230	13,454,513
第3期(中間期)	212,544,035	7,073,704

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	1,621,093	0
第2期	10,979,714	8,229
第3期(中間期)	11,321,436	12,514,302

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2,350,609	98,727
第2期	132,574,732	11,855,664
第3期(中間期)	42,424,624	5,791,756

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2,141,454	0
第2期	90,161,002	10,267,851
第3期(中間期)	65,043,012	27,039,480

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	38,535,757	0
第2期	379,344,235	56,234,121
第3期(中間期)	403,488,936	88,789,103

(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3期中間計算期間(2022年12月1日から2023年5月31日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

## 【三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	84	22
コール・ローン	519	1,197
親投資信託受益証券	61,811,019	130,673,036
流動資産合計	61,811,622	130,674,255
資産合計	61,811,622	130,674,255
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	4,635	9,718
未払委託者報酬	77,353	161,076
その他未払費用	1,065	2,370
流動負債合計	83,053	173,164
負債合計	83,053	173,164
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	56,998,952	110,973,142
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	4,729,617	19,527,949
(分配準備積立金)	2,721,892	2,529,691
元本等合計	61,728,569	130,501,091
純資産合計	61,728,569	130,501,091
負債純資産合計	61,811,622	130,674,255

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	120,679	10,141,997
営業収益合計	120,679	10,141,997
営業費用		
支払利息	-	9
受託者報酬	1,381	9,718
委託者報酬	23,713	161,076
その他費用	287	2,370
営業費用合計	25,381	173,173
営業利益又は営業損失( )	95,298	9,968,824
経常利益又は経常損失( )	95,298	9,968,824
中間純利益又は中間純損失( )	95,298	9,968,824
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( )	-	241,944
期首剰余金又は期首欠損金( )	172,961	4,729,617
剰余金増加額又は欠損金減少額	302,070	5,594,922
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	302,070	5,594,922
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	523,470
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	523,470
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	570,329	19,527,949

## (3)【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期中間計算期間	
	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期中間計算期間
	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	56,998,952口	110,973,142口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0830円 (1万口当たりの純資産額10,830円)	1口当たり純資産額 1.1760円 (1万口当たりの純資産額11,760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3期中間計算期間	
	(2023年5月31日現在)	
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	---

## (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2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	5,873,388円	56,998,952円
期中追加設定元本額	52,125,564円	60,376,239円
期中一部解約元本額	1,000,000円	6,402,049円

## 【三井住友D S ・日経225インデックス・ファンド】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	177	25
コール・ローン	1,094	1,350
親投資信託受益証券	272,785,410	299,420,898
流動資産合計	272,786,681	299,422,273
資産合計	272,786,681	299,422,273
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	20,288	30,527
未払委託者報酬	335,423	504,635
その他未払費用	5,003	7,554
流動負債合計	360,714	542,716
負債合計	360,714	542,716
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	257,073,979	252,659,583
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	15,351,988	46,219,974
(分配準備積立金)	4,052,087	3,148,340
元本等合計	272,425,967	298,879,557
純資産合計	272,425,967	298,879,557
負債純資産合計	272,786,681	299,422,273

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	288,991	33,249,948
営業収益合計	288,991	33,249,948
営業費用		
支払利息	-	113
受託者報酬	9,794	30,527
委託者報酬	162,419	504,635
その他費用	2,364	7,554
営業費用合計	174,577	542,829
営業利益又は営業損失（ ）	114,414	32,707,119
経常利益又は経常損失（ ）	114,414	32,707,119
中間純利益又は中間純損失（ ）	114,414	32,707,119
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,654	1,290,540
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,428,653	15,351,988
剰余金増加額又は欠損金減少額	256,655	3,227,463
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	256,655	3,227,463
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,997	3,776,056
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,997	3,776,056
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,792,071	46,219,974

## (3)【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期中間計算期間
	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期中間計算期間
	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	257,073,979口	252,659,583口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0597円 (1万口当たりの純資産額10,597円)	1口当たり純資産額 1.1829円 (1万口当たりの純資産額11,829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3期中間計算期間
	(2023年5月31日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	---

## (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2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	67,088,151円	257,073,979円
期中追加設定元本額	221,907,962円	62,027,975円
期中一部解約元本額	31,922,134円	66,442,371円

## 【三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第2期 ( 2022年11月30日現在 )	第3期中間計算期間 ( 2023年 5月31日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	189	30
コール・ローン	1,163	1,607
親投資信託受益証券	309,573,888	508,180,142
流動資産合計	309,575,240	508,181,779
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	25,267	40,511
未払委託者報酬	518,715	831,335
その他未払費用	7,510	12,073
流動負債合計	551,492	883,919
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	278,407,177	425,022,055
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	30,616,571	82,275,805
( 分配準備積立金 )	9,686,410	7,617,703
元本等合計	309,023,748	507,297,860
純資産合計	309,023,748	507,297,860
負債純資産合計	309,575,240	508,181,779

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	2,768,479	34,120,164
営業収益合計	2,768,479	34,120,164
営業費用		
受託者報酬	12,022	40,511
委託者報酬	247,352	831,335
その他費用	3,526	12,073
営業費用合計	262,900	883,919
営業利益又は営業損失（ ）	2,505,579	33,236,245
経常利益又は経常損失（ ）	2,505,579	33,236,245
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,505,579	33,236,245
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	261,943	2,139,023
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,566,401	30,616,571
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,646,206	24,061,859
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,646,206	24,061,859
剰余金減少額又は欠損金増加額	354,818	7,777,893
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	354,818	7,777,893
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	10,101,425	82,275,805

## (3)【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期中間計算期間	
	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期中間計算期間
	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	278,407,177口	425,022,055口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1100円 (1万口当たりの純資産額11,100円)	1口当たり純資産額 1.1936円 (1万口当たりの純資産額11,936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3期中間計算期間	
	(2023年5月31日現在)	
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

## (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2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	70,018,428円	278,407,177円
期中追加設定元本額	270,552,214円	219,098,924円
期中一部解約元本額	62,163,465円	72,484,046円

## 【三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第2期 ( 2022年11月30日現在 )	第3期中間計算期間 ( 2023年 5月31日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	80	22
コール・ローン	494	1,183
親投資信託受益証券	22,536,778	99,036,889
流動資産合計	22,537,352	99,038,094
資産合計	22,537,352	99,038,094
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	1,839	5,311
未払委託者報酬	38,694	110,098
その他未払費用	575	1,789
流動負債合計	41,108	117,198
負債合計	41,108	117,198
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	22,559,233	96,520,623
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	62,989	2,400,273
( 分配準備積立金 )	273,906	218,193
元本等合計	22,496,244	98,920,896
純資産合計	22,496,244	98,920,896
負債純資産合計	22,537,352	99,038,094

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	140,659	3,026,861
営業収益合計	140,659	3,026,861
営業費用		
受託者報酬	975	5,311
委託者報酬	20,526	110,098
その他費用	286	1,789
営業費用合計	21,787	117,198
営業利益又は営業損失（ ）	162,446	2,909,663
経常利益又は経常損失（ ）	162,446	2,909,663
中間純利益又は中間純損失（ ）	162,446	2,909,663
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	322	102,930
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	64,352	62,989
剰余金増加額又は欠損金減少額	236,924	44,581
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	44,581
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	236,924	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,359	593,912
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,359	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	593,912
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	137,793	2,400,273

## （ 3 ）【中間注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項 目	第3期中間計算期間 自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## （中間貸借対照表に関する注記）

項 目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	22,559,233口	96,520,623口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	<p>元本の欠損</p> <p style="text-align: right;">62,989円</p>	元本の欠損
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 0.9972円</p> <p>(1万口当たりの純資産額9,972円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.0249円</p> <p>(1万口当たりの純資産額10,249円)</p>

## （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3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

	(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (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2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	2,960,151円	22,559,233円
期中追加設定元本額	29,976,495円	80,987,826円
期中一部解約元本額	10,377,413円	7,026,436円

## 【三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第2期 ( 2022年11月30日現在 )	第3期中間計算期間 ( 2023年 5月31日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	89	22
コール・ローン	549	1,168
親投資信託受益証券	80,186,585	291,205,933
流動資産合計	80,187,223	291,207,123
資産合計	80,187,223	291,207,123
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	3,703	19,547
未払委託者報酬	46,809	244,764
その他未払費用	851	4,810
流動負債合計	51,363	269,121
負債合計	51,363	269,121
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	79,842,763	285,313,094
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	293,097	5,624,908
( 分配準備積立金 )	472,369	446,368
元本等合計	80,135,860	290,938,002
純資産合計	80,135,860	290,938,002
負債純資産合計	80,187,223	291,207,123

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	290,712	10,455,318
営業収益合計	290,712	10,455,318
営業費用		
受託者報酬	1,188	19,547
委託者報酬	15,092	244,764
その他費用	243	4,810
営業費用合計	16,523	269,121
営業利益又は営業損失（ ）	307,235	10,186,197
経常利益又は経常損失（ ）	307,235	10,186,197
中間純利益又は中間純損失（ ）	307,235	10,186,197
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	276,960	85,637
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	25,013	293,097
剰余金増加額又は欠損金減少額	36,970	39,886
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	39,886
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	36,970	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	36,138	4,979,909
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	36,138	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	4,979,909
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	4,430	5,624,908

## (3)【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期中間計算期間
	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期中間計算期間
	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	79,842,763口	285,313,094口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0037円 (1万口当たりの純資産額10,037円)	1口当たり純資産額 1.0197円 (1万口当たりの純資産額10,197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3期中間計算期間
	(2023年5月31日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

## (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2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	6,762,046円	79,842,763円
期中追加設定元本額	86,535,230円	212,544,035円
期中一部解約元本額	13,454,513円	7,073,704円

## 【三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第2期 ( 2022年11月30日現在 )	第3期中間計算期間 ( 2023年 5月31日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	29,399	3,006
コール・ローン	181,396	162,815
親投資信託受益証券	11,381,577	10,563,501
流動資産合計	11,592,372	10,729,322
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	1,024	1,311
未払委託者報酬	21,590	27,853
その他未払費用	408	303
流動負債合計	23,022	29,467
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	12,592,578	11,399,712
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	1,023,228	699,857
( 分配準備積立金 )	302,215	114,826
元本等合計	11,569,350	10,699,855
純資産合計	11,569,350	10,699,855
負債純資産合計	11,592,372	10,729,322

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	818,107	396,924
営業収益合計	818,107	396,924
営業費用		
受託者報酬	554	1,311
委託者報酬	11,911	27,853
その他費用	146	303
営業費用合計	12,611	29,467
営業利益又は営業損失( )	830,718	367,457
経常利益又は経常損失( )	830,718	367,457
中間純利益又は中間純損失( )	830,718	367,457
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	286	24,092
期首剰余金又は期首欠損金( )	13,240	1,023,228
剰余金増加額又は欠損金減少額	35,167	1,115,279
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,115,279
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	35,167	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	62	1,183,457
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	62	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	1,183,457
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	808,567	699,857

## (3)【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期中間計算期間	
	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期中間計算期間
	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	12,592,578口	11,399,712口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 1,023,228円	元本の欠損 699,857円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9187円 (1万口当たりの純資産額9,187円)	1口当たり純資産額 0.9386円 (1万口当たりの純資産額9,386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3期中間計算期間	
	(2023年5月31日現在)	
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>	

	(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (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2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	1,621,093円	12,592,578円
期中追加設定元本額	10,979,714円	11,321,436円
期中一部解約元本額	8,229円	12,514,302円

## 【三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第2期 ( 2022年11月30日現在 )	第3期中間計算期間 ( 2023年 5月31日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	91	21
コール・ローン	565	1,112
親投資信託受益証券	118,143,132	149,373,199
流動資産合計	118,143,788	149,374,332
資産合計	118,143,788	149,374,332
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	4,927	14,454
未払委託者報酬	81,852	239,153
その他未払費用	1,145	3,540
流動負債合計	87,924	257,147
負債合計	87,924	257,147
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	122,970,950	159,603,818
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	4,915,086	10,486,633
( 分配準備積立金 )	995,182	958,747
元本等合計	118,055,864	149,117,185
純資産合計	118,055,864	149,117,185
負債純資産合計	118,143,788	149,374,332

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	464,380	2,496,103
営業収益合計	464,380	2,496,103
営業費用		
支払利息	-	32
受託者報酬	708	14,454
委託者報酬	12,569	239,153
その他費用	61	3,540
営業費用合計	13,338	257,179
営業利益又は営業損失（ ）	477,718	2,753,282
経常利益又は経常損失（ ）	477,718	2,753,282
中間純利益又は中間純損失（ ）	477,718	2,753,282
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	547,333	181,299
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	109,599	4,915,086
剰余金増加額又は欠損金減少額	369,739	279,407
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	369,739	279,407
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	539,760	3,278,971
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	539,760	3,278,971
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	210,005	10,486,633

## (3)【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期中間計算期間	
	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期中間計算期間
	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	122,970,950口	159,603,818口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 4,915,086円	元本の欠損 10,486,633円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9600円 (1万口当たりの純資産額9,600円)	1口当たり純資産額 0.9343円 (1万口当たりの純資産額9,343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3期中間計算期間	
	(2023年5月31日現在)	
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>	

	(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (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2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	2,251,882円	122,970,950円
期中追加設定元本額	132,574,732円	42,424,624円
期中一部解約元本額	11,855,664円	5,791,756円

## 【三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第2期 ( 2022年11月30日現在 )	第3期中間計算期間 ( 2023年 5月31日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	93	22
コール・ローン	571	1,170
親投資信託受益証券	87,051,905	124,179,275
流動資産合計	87,052,569	124,180,467
資産合計	87,052,569	124,180,467
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	5,407	9,592
未払委託者報酬	111,767	197,534
その他未払費用	1,550	2,803
流動負債合計	118,724	209,929
負債合計	118,724	209,929
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	82,034,605	120,038,137
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	4,899,240	3,932,401
( 分配準備積立金 )	988,236	683,375
元本等合計	86,933,845	123,970,538
純資産合計	86,933,845	123,970,538
負債純資産合計	87,052,569	124,180,467

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	313,370	259,270
営業収益合計	313,370	259,270
営業費用		
受託者報酬	978	9,592
委託者報酬	20,986	197,534
その他費用	209	2,803
営業費用合計	22,173	209,929
営業利益又は営業損失( )	335,543	49,341
経常利益又は経常損失( )	335,543	49,341
中間純利益又は中間純損失( )	335,543	49,341
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	267,035	325,411
期首剰余金又は期首欠損金( )	163,300	4,899,240
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,979,426	856,805
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,979,426	856,805
剰余金減少額又は欠損金増加額	754,742	1,547,574
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	754,742	1,547,574
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,319,476	3,932,401

## (3)【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期中間計算期間
	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期中間計算期間
	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	82,034,605口	120,038,137口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0597円 (1万口当たりの純資産額10,597円)	1口当たり純資産額 1.0328円 (1万口当たりの純資産額10,328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3期中間計算期間
	(2023年5月31日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

## (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2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	2,141,454円	82,034,605円
期中追加設定元本額	90,161,002円	65,043,012円
期中一部解約元本額	10,267,851円	27,039,480円

## 【三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第2期 ( 2022年11月30日現在 )	第3期中間計算期間 ( 2023年 5月31日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	14,969	3,124
コール・ローン	92,363	169,199
親投資信託受益証券	334,057,286	684,386,642
派生商品評価勘定	1,316,791	416,575
未収入金	1,069,582	917,765
流動資産合計	336,550,991	685,893,305
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	6,921,973
未払解約金	572,472	-
未払受託者報酬	27,736	52,301
未払委託者報酬	458,109	863,577
その他未払費用	10,342	15,611
流動負債合計	1,068,659	7,853,462
負債合計	1,068,659	7,853,462
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	361,645,871	676,345,704
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	26,163,539	1,694,139
( 分配準備積立金 )	-	-
元本等合計	335,482,332	678,039,843
純資産合計	335,482,332	678,039,843
負債純資産合計	336,550,991	685,893,305

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
受取利息	-	1
有価証券売買等損益	9,383,003	59,299,908
為替差損益	11,768,414	31,828,079
営業収益合計	2,385,411	27,471,830
営業費用		
支払利息	-	43
受託者報酬	7,374	52,301
委託者報酬	122,467	863,577
その他費用	2,111	15,611
営業費用合計	131,952	931,532
営業利益又は営業損失( )	2,517,363	26,540,298
経常利益又は経常損失( )	2,517,363	26,540,298
中間純利益又は中間純損失( )	2,517,363	26,540,298
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	994,489	4,919,484
期首剰余金又は期首欠損金( )	972,728	26,163,539
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,321,170	6,236,864
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	4,010,451
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,321,170	2,226,413
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,489,535	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,489,535	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	347,055	1,694,139

## （ 3 ）【中間注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項 目	第3期中間計算期間 自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</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>

## （中間貸借対照表に関する注記）

項 目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	361,645,871口	676,345,704口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 26,163,539円	元本の欠損
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9277円 (1万口当たりの純資産額9,277円)	1口当たり純資産額 1.0025円 (1万口当たりの純資産額10,025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3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はあります。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

	(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。
	(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## （デリバティブ取引に関する注記）

第2期（2022年11月30日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	327,357,536	-	326,040,745	1,316,791
	小計	327,357,536	-	326,040,745	1,316,791
合 計		327,357,536	-	326,040,745	1,316,791

第3期中間計算期間（2023年5月31日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	41,330,550	-	41,739,600	409,050
	小計	41,330,550	-	41,739,600	409,050
	売建				
	アメリカ・ドル	711,090,151	-	718,004,599	6,914,448
	小計	711,090,151	-	718,004,599	6,914,448
合 計		752,420,701	-	759,744,199	6,505,398

## （注）1．時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

#### (その他の注記)

項目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	38,535,757円	361,645,871円
期中追加設定元本額	379,344,235円	403,488,936円
期中一部解約元本額	56,234,121円	88,789,103円

#### (参考)

「三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド」、「三井住友D S・日経225インデックス・ファンド」、「三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド」、「三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド」、「三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド」、「三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド」、「三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド」、「三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド」および「三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「225マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」および「ゴールド・インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

##### (1)貸借対照表

(単位:円)

	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	456,457,514	31,900,278
コール・ローン	2,816,383,083	1,727,717,014
株式	218,143,627,430	239,706,118,000
派生商品評価勘定	205,303,100	176,583,500
未収入金	209,436,600	551,408,184
未収配当金	1,741,212,622	2,520,222,820
差入委託証拠金	186,390,000	172,200,000
流動資産合計	223,758,810,349	244,886,149,796

資産合計	223,758,810,349	244,886,149,796
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	12,306,200
前受金	210,290,000	237,529,000
未払金	124,125,858	83,975,614
未払解約金	605,043,303	324,899,662
その他未払費用	10,581	6,390
流動負債合計	939,469,742	658,716,866
負債合計	939,469,742	658,716,866
純資産の部		
元本等		
元本	65,393,298,021	65,848,946,989
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	157,426,042,586	178,378,485,941
元本等合計	222,819,340,607	244,227,432,930
純資産合計	222,819,340,607	244,227,432,930
負債純資産合計	223,758,810,349	244,886,149,796

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</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>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	65,393,298,021口	65,848,946,989口

2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3,4074円 (1万口当たりの純資産額34,074円)	1口当たり純資産額 3,7089円 (1万口当たりの純資産額37,089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5月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0412月	4,351,796,900	-	4,557,100,000	205,303,100
	小計	4,351,796,900	-	4,557,100,000	205,303,100
合計		4,351,796,900	-	4,557,100,000	205,303,100

(2023年5月31日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0506月	4,470,402,700	-	4,634,680,000	164,277,300
	小計	4,470,402,700	-	4,634,680,000	164,277,300
合計		4,470,402,700	-	4,634,680,000	164,277,300

(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11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	61,173,269,127円
同期中における追加設定元本額	11,653,465,066円
同期中における一部解約元本額	7,433,436,172円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,574,760,676円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,036,137,254円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,637,683,641円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,605,989,911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)	147,542,223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)	4,234,860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)	19,508,324円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	63,979,125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)	165,870,052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)	149,775,143円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	266,593,539円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,398,015,768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	22,016,808,347円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	179,974,667円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	253,617,658円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	167,938,880円
イオン・バランス戦略ファンド	20,272,782円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	41,931,085円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	191,067,731円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	178,416,019円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	669,872,498円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	375,434,831円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	427,891,807円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	49,851,584円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	813,757,842円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	39,664,361円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	202,349,704円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	191,586,051円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,500,206円
日興F W S・日本株インデックス	1,276,658,198円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	18,140,230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)	2,564,092,115円

バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	11,882,906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 >	74,050,540円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	1,456,182,387円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,446,188,375円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	5,623,103,466円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	37,493,396円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	135,694,110円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	684,565,549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 >	44,118,775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 >	796,235,497円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	533,449,238円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	1,657,079,267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 >	36,667,207円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	39,482,192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 >	16,795,425円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	95,429,547円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	219,105,114円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	52,522,560円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 >	38,723,328円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 < 適格機関投資家専用 >	7,680,964円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 < 適格機関投資家専用 >	41,326,285円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	542,525,688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)	167,317,059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 >	202,591,112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 >	85,721,825円
SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	94,168,528円
SMAM・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	44,811,453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 >	42,807,427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 >	5,577,900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 >	7,187,543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 >	92,673,351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	65,393,298,021円

(2023年5月31日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	65,393,298,021円
同期中における追加設定元本額	5,589,967,001円
同期中における一部解約元本額	5,134,318,033円
2023年5月31日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,567,186,669円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,035,647,235円

三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,601,182,134円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,649,411,691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)	143,531,151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)	3,824,083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)	16,754,303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)	59,427,415円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	161,248,195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)	148,660,880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)	267,774,706円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,248,375,843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	24,113,104,157円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	145,148,701円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	199,269,005円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	123,450,488円
イオン・バランス戦略ファンド	48,529,697円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	46,590,437円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	199,377,487円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	187,131,173円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	700,277,235円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	394,498,949円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	455,544,836円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	52,378,195円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	967,956,856円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	40,689,597円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	228,104,464円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	223,888,356円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	6,216,055円
日興F W S・日本株インデックス	1,659,084,279円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	35,232,289円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	45,997円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	52,024円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	62,482円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	74,595円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	74,595円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	34,887円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	50,851円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	61,664円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	71,690円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	81,799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)	2,274,493,308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>	10,721,415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>	60,971,681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>	1,185,406,892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>	1,301,469,691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>	4,938,430,674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>	33,895,607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>	121,806,136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>	615,602,816円

SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	39,924,165円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	213,971,032円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	698,767,712円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	485,970,203円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,443,960,978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>	32,955,479円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	37,753,776円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	29,039,696円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	15,809,789円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	82,914,695円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	212,166,342円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	44,449,154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>	7,165,738円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	37,466,256円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	464,356,594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)	155,535,252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>	173,296,382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>	73,144,007円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	69,531,049円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	34,552,675円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	57,902,358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>	49,698,889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>	64,224,712円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	15,833,900円
合計	65,848,946,989円

## 2.2.5 マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	368,069,569	42,929,454
コール・ローン	2,271,021,676	2,325,056,466
株式	125,784,079,960	133,984,603,830
派生商品評価勘定	51,424,400	105,340,200
未収入金	-	24,889,000
未収配当金	787,322,520	1,108,192,752
差入委託証拠金	39,102,000	155,940,000
流動資産合計	129,301,020,125	137,746,951,702
資産合計	129,301,020,125	137,746,951,702
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,759,700	27,260,000

前受金	49,720,000	160,590,000
未払解約金	2,826,312	390,243,852
その他未払費用	8,270	5,359
流動負債合計	55,314,282	578,099,211
負債合計	55,314,282	578,099,211
純資産の部		
元本等		
元本	34,776,887,242	32,986,407,062
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	94,468,818,601	104,182,445,429
元本等合計	129,245,705,843	137,168,852,491
純資産合計	129,245,705,843	137,168,852,491
負債純資産合計	129,301,020,125	137,746,951,702

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</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>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 担保資産	<p>デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 808,100,000円</p>	
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	34,776,887,242口	32,986,407,062口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.7164円 (1万口当たりの純資産額37,164円)	1口当たり純資産額 4.1583円 (1万口当たりの純資産額41,583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5月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## （デリバティブ取引に関する注記）

(2022年11月30日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	NK225 先物 0412月	3,400,255,300	-	3,448,920,000	48,664,700
	小計	3,400,255,300	-	3,448,920,000	48,664,700
合計		3,400,255,300	-	3,448,920,000	48,664,700

(2023年5月31日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	NK225 先物 0506月	3,099,469,800	-	3,177,550,000	78,080,200
	小計	3,099,469,800	-	3,177,550,000	78,080,200
合計		3,099,469,800	-	3,177,550,000	78,080,200

## (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11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	28,339,379,860円
同期中における追加設定元本額	16,323,741,365円
同期中における一部解約元本額	9,886,233,983円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・225オープン	31,600,774,848円
三井住友・DC年金日本株式225ファンド	2,357,385,245円
SMB C・DCインデックスファンド(日経225)	658,797,360円
三井住友DS・日経225インデックス・ファンド	73,400,444円
日本株式225ファンドVA<適格機関投資家専用>	86,529,345円
合計	34,776,887,242円

(2023年5月31日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	34,776,887,242円
同期中における追加設定元本額	6,464,313,150円
同期中における一部解約元本額	8,254,793,330円
2023年5月31日現在の元本の内訳	
三井住友・225オープン	29,683,929,844円
三井住友・DC年金日本株式225ファンド	2,258,628,002円
SMB C・DCインデックスファンド(日経225)	901,470,527円
三井住友DS・日経225インデックス・ファンド	72,005,603円
日本株式225ファンドVA<適格機関投資家専用>	70,373,086円
合計	32,986,407,062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11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	12,344,954,615	4,013,651,232
金銭信託	306,406,160	60,091,244
コール・ローン	1,890,553,005	3,254,537,955
株式	411,677,365,126	487,417,819,287
投資証券	10,072,502,218	10,688,271,086

派生商品評価勘定	487,638,687	97,242,883
未収入金	1,756,879	33,588,201
未収配当金	582,453,884	809,292,868
差入委託証拠金	5,033,061,489	2,406,221,890
流動資産合計	442,396,692,063	508,780,716,646
資産合計	442,396,692,063	508,780,716,646
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	34,123,826	37,839,841
未払金	-	63,857,220
未払解約金	161,000,409	125,861,765
その他未払費用	6,376	3,272
流動負債合計	195,130,611	227,562,098
負債合計	195,130,611	227,562,098
純資産の部		
元本等		
元本	72,186,242,919	76,927,211,095
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	370,015,318,533	431,625,943,453
元本等合計	442,201,561,452	508,553,154,548
純資産合計	442,201,561,452	508,553,154,548
負債純資産合計	442,396,692,063	508,780,716,646

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	72,186,242,919口	76,927,211,095口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 6.1258円 (1万口当たりの純資産額61,258円)	1口当たり純資産額 6.6108円 (1万口当たりの純資産額66,108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5月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(株式、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
	株価指数先物取引 買建 S&P 500 EMINI FUT DEC22	15,697,974,160	-	15,983,395,407	285,421,247

市場取引	SPI 200 FUTURES DEC22	734,736,737	-	757,862,325	23,125,588
	FTSE 100 IDX FUT DEC22	934,911,597	-	963,434,172	28,522,575
	EURO STOXX 50 DEC22	2,969,277,474	-	3,089,695,148	120,417,674
	小計	20,336,899,968	-	20,794,387,052	457,487,084
	合 計	20,336,899,968	-	20,794,387,052	457,487,084

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	2,099,249,487	-	2,098,826,011	423,476
	カナダ・ドル	106,801,796	-	105,519,193	1,282,603
	オーストラリア・ド ル	34,202,370	-	33,957,955	244,415
	イギリス・ボンド	87,718,707	-	87,086,511	632,196
	スイス・フラン	91,286,164	-	90,606,304	679,860
	デンマーク・クロー ネ	24,504,100	-	24,483,812	20,288
	スウェーデン・ク ローナ	30,621,024	-	30,535,733	85,291
	ユーロ	171,328,650	-	170,699,141	629,509
	小計	2,645,712,298	-	2,641,714,660	3,997,638
	売建				
	オーストラリア・ド ル	72,454,928	-	72,740,539	285,611
	イギリス・ボンド	89,625,998	-	89,588,968	37,030
	ユーロ	305,223,048	-	304,949,052	273,996
	小計	467,303,974	-	467,278,559	25,415
	合 計	3,113,016,272	-	3,108,993,219	3,972,223

(2023年5月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT JUN23	7,834,202,845	-	7,923,805,898	89,603,053
	SPI 200 FUTURES JUN23	363,112,027	-	361,689,059	1,422,968

	FTSE 100 IDX FUT JUN23	469,742,868	-	457,547,225	12,195,643
	EURO STOXX 50 JUN23	1,603,202,907	-	1,598,166,064	5,036,843
	小計	10,270,260,647	-	10,341,208,246	70,947,599
	合計	10,270,260,647	-	10,341,208,246	70,947,599

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	2,258,945,361	-	2,249,414,774	9,530,587
	カナダ・ドル	89,959,118	-	89,424,879	534,239
	オーストラリア・ドル	51,137,854	-	50,804,784	333,070
	イギリス・ポンド	125,624,426	-	125,726,778	102,352
	スイス・フラン	91,591,626	-	91,037,178	554,448
	ユーロ	296,813,374	-	296,118,812	694,562
	小計	2,914,071,759	-	2,902,527,205	11,544,554
	合計	2,914,071,759	-	2,902,527,205	11,544,554

## (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。

3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額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11月30日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	60,650,874,522円
同期中における追加設定元本額	22,050,143,482円
同期中における一部解約元本額	10,514,775,085円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	36,369,253,618円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	284,736,068円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,090,013,037円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	785,999,194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）	33,400,233円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	1,017,107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）	5,342,658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）	16,884,192円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	49,323,143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）	54,445,231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）	105,113,958円
外国株式指数ファンド	936,693,371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	17,542,779,547円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	90,349,697円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	117,821,294円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	75,689,448円
イオン・バランス戦略ファンド	20,982,589円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	21,006,539円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	130,889,105円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	118,201,443円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	437,684,453円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	238,781,337円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	274,840,665円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	54,612,889円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	1,637,991,448円
三井住友D S・年金バランス30（債券重点型）	10,892,390円
三井住友D S・年金バランス50（標準型）	47,697,547円
三井住友D S・年金バランス70（株式重点型）	42,074,552円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,714,893円
S M B C・DCインデックスファンド（M S C Iコクサイ）	397,450,005円
日興F W S・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）	250,037,372円
日興F W S・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）	1,466,576,467円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	50,536,075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）	449,296,410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＞	3,279,377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＞	20,004,315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＞	536,704,870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＞	702,957,041円
S M A M・バランスファンドV A 5 0＜適格機関投資家専用＞	3,074,190,088円

SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	9,972,101円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	49,989,232円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	423,311,736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>	36,093,954円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	90,939,599円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	427,001,205円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	293,567,068円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	687,726,675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)	194,459,687円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	59,953,329円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	7,255,976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>	3,833,026円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	17,103,227円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	51,782,752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>	110,286,434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>	46,890,632円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	281,352,925円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	80,381,144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>	1,662,845,853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>	17,217,947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>	1,803,118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>	2,321,567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>	74,738,213円
合計	72,186,242,919円

(2023年5月31日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	72,186,242,919円
同期中における追加設定元本額	9,859,556,115円
同期中における一部解約元本額	5,118,587,939円
2023年5月31日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	38,582,274,413円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	298,331,944円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,134,665,113円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	833,771,125円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	34,543,381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)	938,529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)	4,812,521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)	15,372,068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)	45,120,868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)	54,203,219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)	111,221,632円
外国株式指数ファンド	976,065,483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	19,935,617,916円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	40,690,139円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	93,686,532円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	58,091,459円
イオン・バランス戦略ファンド	27,530,798円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	24,520,121円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	145,661,721円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	129,100,682円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	477,570,781円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	261,237,315円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	305,422,020円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	60,495,916円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	2,041,181,824円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	11,462,726円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	55,745,915円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	50,633,033円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,271,256円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	686,615,864円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	319,107,510円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,964,671,276円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	76,871,202円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	20,612円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	24,584円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	30,826円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	38,462円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	38,462円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	10,556円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	15,546円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	18,945円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	21,986円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	25,027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)	396,913,387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>	3,138,154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>	17,251,454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>	450,615,602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>	660,139,700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>	2,840,207,442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>	9,822,476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>	47,046,851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>	401,018,478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>	34,829,973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>	82,996,154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>	402,565,881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>	279,468,374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>	628,735,242円
S M A M・バランスV A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・V A S(適格機関投資家専用)	182,897,059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>	55,095,802円

SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	7,051,860円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	6,575,296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>	16,103,258円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	49,557,783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>	98,602,474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>	41,885,860円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	214,600,360円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	64,044,913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>	874,878,756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>	21,466,696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>	18,041,655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>	23,156,771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>	133,723,760円
合計	76,927,211,095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11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,890,895,302	2,102,630,374
金銭信託	31,231,738	1,207,944
コール・ローン	192,702,578	65,422,194
株式	18,551,125,070	24,734,980,146
投資信託受益証券	1,080,935,590	1,397,105,670
投資証券	1,751,546,641	2,348,396,241
派生商品評価勘定	150,967,660	16,046,528
未収入金	-	57,818
未収配当金	34,213,350	54,154,485
差入委託証拠金	977,033,005	873,399,450
流動資産合計	26,660,650,934	31,593,400,850
資産合計	26,660,650,934	31,593,400,850
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	83,196,904	28,080,492
未払解約金	26,843,066	8,268,536
その他未払費用	543	455
流動負債合計	110,040,513	36,349,483
負債合計	110,040,513	36,349,483
純資産の部		
元本等		
元本	16,108,126,428	18,542,842,800
剰余金		

剰余金又は欠損金（ ）	10,442,483,993	13,014,208,567
元本等合計	26,550,610,421	31,557,051,367
純資産合計	26,550,610,421	31,557,051,367
負債純資産合計	26,660,650,934	31,593,400,850

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資信託受益証券、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. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<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11月30日現在 )	( 2023年5月31日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	16,108,126,428口	18,542,842,800口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6483円 ( 1万口当たりの純資産額16,483円 )	1口当たり純資産額 1.7018円 ( 1万口当たりの純資産額17,018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5月31日現在 )
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT DEC22	5,203,165,884	-	5,271,112,198	67,946,314
	小計	5,203,165,884	-	5,271,112,198	67,946,314
合計		5,203,165,884	-	5,271,112,198	67,946,314

(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	262,300,000	-	262,124,442	175,558
	小計	262,300,000	-	262,124,442	175,558
合計		262,300,000	-	262,124,442	175,558

(2023年5月31日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT JUN23	3,183,641,226	-	3,171,604,932	12,036,294
	小計	3,183,641,226	-	3,171,604,932	12,036,294
合計		3,183,641,226	-	3,171,604,932	12,036,294

## (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	105,000,000	-	105,002,330	2,330
	小計	105,000,000	-	105,002,330	2,330
合 計		105,000,000	-	105,002,330	2,330

## (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。

- 3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額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11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	10,481,267,749円
同期中における追加設定元本額	7,656,711,181円
同期中における一部解約元本額	2,029,852,502円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	8,414,992,973円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,960,029,922円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	183,852,090円

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	291,047,771円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	194,328,149円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	40,006,969円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	100,172,461円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	75,036,325円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	334,887,158円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	274,169,234円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	448,887,023円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	103,796,383円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,268,543円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	706,099,778円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,907,693,075円
三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド	13,672,741円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	54,185,833円
合計	16,108,126,428円

(2023年5月31日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	16,108,126,428円
同期中における追加設定元本額	3,520,212,913円
同期中における一部解約元本額	1,085,496,541円
2023年5月31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	9,750,140,387円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,166,864,973円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	83,189,969円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	244,057,854円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	151,199,837円
イオン・バランス戦略ファンド	140,424,295円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	46,843,931円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	110,736,647円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	82,376,348円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	365,848,809円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	301,605,521円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	506,058,821円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	116,203,423円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	6,224,003円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	850,086,906円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,478,120,423円
三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド	58,195,375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	59,639円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	73,424円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	73,424円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	28,947円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	41,344円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	48,275円

三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル4 (成長型)	57,693円
三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル5 (積極成長型)	67,186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>	84,128,290円
合 計	18,542,842,800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11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	444,208,536	472,387,916
金銭信託	152,609,385	12,639,051
コール・ローン	941,613,352	684,530,222
国債証券	151,679,008,052	155,215,441,836
未収利息	973,583,208	1,030,775,262
前払費用	46,285,888	59,454,705
流動資産合計	154,237,308,421	157,475,228,992
資産合計	154,237,308,421	157,475,228,992
負債の部		
流動負債		
未払解約金	27,774,541	92,199,311
その他未払費用	3,600	950
流動負債合計	27,778,141	92,200,261
負債合計	27,778,141	92,200,261
純資産の部		
元本等		
元本	77,181,314,549	77,320,552,136
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	77,028,215,731	80,062,476,595
元本等合計	154,209,530,280	157,383,028,731
純資産合計	154,209,530,280	157,383,028,731
負債純資産合計	154,237,308,421	157,475,228,992

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p>

	<p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</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礎となる事項	<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11月30日現在）	（2023年5月31日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	77,181,314,549口	77,320,552,136口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9980円 （1万口当たりの純資産額19,980円）	1口当たり純資産額 2.0355円 （1万口当たりの純資産額20,355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5月31日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## （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11月30日現在）
開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	81,104,632,252円
同期中における追加設定元本額	11,875,698,156円
同期中における一部解約元本額	15,799,015,859円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	25,756,264,406円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	840,993,972円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,169,853,266円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,201,023,285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)	153,754,294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)	6,205,170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)	28,041,920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)	96,060,756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)	254,625,421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)	182,408,320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)	295,713,172円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	22,875,033円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	180,504,559円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	196,065,249円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	127,100,213円
イオン・バランス戦略ファンド	150,083,028円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	24,330,578円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	81,016,637円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	61,389,948円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	162,182,842円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	49,154,614円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	24,004,429円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	167,708,487円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	632,445,610円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	32,709,599円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	98,399,536円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	65,027,461円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,130,696円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	766,936,458円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	40,133,426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>	3,677,884,570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>	5,820,669,217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>	3,997,274,168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>	9,331,565,400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>	30,338,011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>	75,478,804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>	631,815,767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>	109,386,082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>	949,869,564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>	1,336,489,741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>	4,160,020,552円

SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	7,097,718,053円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	315,261,191円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	122,294,061円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	67,641,422円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	31,256,873円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,592,229円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	79,935,071円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	365,865,953円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	87,335,608円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,410,392円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,460,174円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	898,659,693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>	557,262,211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>	740,186,895円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	424,473,864円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	280,587,013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>	110,869,714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>	14,708,323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>	19,121,369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>	623,061,467円
合計	77,181,314,549円

(2023年5月31日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	77,181,314,549円
同期中における追加設定元本額	6,119,505,714円
同期中における一部解約元本額	5,980,268,127円
2023年5月31日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	26,429,145,385円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	927,837,713円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,323,254,511円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,342,566,678円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	163,301,249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)	6,252,899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)	26,830,645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)	97,360,030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)	284,892,741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)	207,820,493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)	330,160,491円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,831,780円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	49,557,018円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	74,402,445円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	47,371,586円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	31,136,529円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	91,758,592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)	182,716,101円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	55,835,528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・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	194,723,379円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	804,962,934円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	37,671,051円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	120,492,311円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	83,072,586円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,159,681円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	1,023,660,936円
三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド	143,063,588円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	26,867円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	31,324円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	39,141円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	47,947円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	47,947円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	46,616円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	54,445円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	59,419円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	62,438円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	64,457円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	4,415,187,094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>	27,366,360円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	5,172,060,261円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,898,391,661円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	9,131,210,461円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	29,825,111円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	71,393,142円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	650,416,907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>	110,475,622円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	939,572,337円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,260,343,854円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,323,429,747円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,006,432,759円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	6,869,762,447円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	323,630,431円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	116,969,160円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	67,375,516円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	30,693,061円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,644,067円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	76,144,588円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	363,615,745円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	82,408,034円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,643,421円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,511,845円

SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	859,886,030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>	523,017,070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>	704,490,561円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	343,107,820円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	238,845,058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>	110,487,675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>	88,441,206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>	112,892,679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>	114,752,279円
合計	77,320,552,136円

## 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	78,573,387	66,988,178
金銭信託	2,587,805	140,723
コール・ローン	15,966,983	7,621,527
国債証券	2,894,688,630	3,657,746,937
派生商品評価勘定	21,511	-
未収利息	25,080,637	39,579,129
前払費用	6,190,809	4,705,565
流動資産合計	3,023,109,762	3,776,782,059
資産合計	3,023,109,762	3,776,782,059
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	2,223,847
その他未払費用	59	34
流動負債合計	59	2,223,881
負債合計	59	2,223,881
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,247,890,526	3,944,271,519
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	224,780,823	169,713,341
元本等合計	3,023,109,703	3,774,558,178
純資産合計	3,023,109,703	3,774,558,178
負債純資産合計	3,023,109,762	3,776,782,059

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
----	------------------------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<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11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,247,890,526口	3,944,271,519口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	<p>元本の欠損</p> <p>224,780,823円</p>	<p>元本の欠損</p> <p>169,713,341円</p>
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 0.9308円</p> <p>(1万口当たりの純資産額9,308円)</p>	<p>1口当たり純資産額 0.9570円</p> <p>(1万口当たりの純資産額9,570円)</p>

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年5月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>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。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	9,698,080	-	9,719,591	21,511
	小計	9,698,080	-	9,719,591	21,511
合 計		9,698,080	-	9,719,591	21,511

(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。

3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額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5月31日現在)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2022年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,047,048,040円
同期中における追加設定元本額	2,892,281,882円
同期中における一部解約元本額	691,439,396円
2022年11月30日現在の元本の内訳	

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)	391,617,618円
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)	1,945,147,099円
三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド	12,227,737円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	176,545,209円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	425,820,622円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	296,532,241円
合計	3,247,890,526円

(2023年5月31日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,247,890,526円
同期中における追加設定元本額	889,795,711円
同期中における一部解約元本額	193,414,718円
2023年5月31日現在の元本の内訳	
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)	455,624,327円
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)	2,567,261,224円
三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド	11,038,142円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	175,964,287円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	416,026,038円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	273,900,114円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	38,763,762円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,239,330円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	34,762円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	40,409円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	49,379円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	60,552円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	60,552円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	12,291円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	29,950円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	42,472円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	56,019円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	67,909円
合計	3,944,271,519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11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	16,783,253	1,622,173
コール・ローン	103,554,152	87,856,777
投資証券	10,443,009,900	11,503,493,400
派生商品評価勘定	-	1,227,600
未収配当金	61,307,439	75,180,949
前払金	592,000	-

差入委託証拠金	2,300,000	2,220,000
流動資産合計	10,627,546,744	11,671,600,899
資産合計	10,627,546,744	11,671,600,899
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	746,400	-
前受金	-	1,002,000
未払金	60,516,485	37,602,717
未払解約金	2,127,632	2,959,338
その他未払費用	441	269
流動負債合計	63,390,958	41,564,324
負債合計	63,390,958	41,564,324
純資産の部		
元本等		
元本	3,913,179,470	4,416,471,961
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,650,976,316	7,213,564,614
元本等合計	10,564,155,786	11,630,036,575
純資産合計	10,564,155,786	11,630,036,575
負債純資産合計	10,627,546,744	11,671,600,899

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	( 2022年11月30日現在 )	( 2023年5月31日現在 )
-----	-------------------	------------------

1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,913,179,470口	4,416,471,961口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6996円 (1万口当たりの純資産額26,996円)	1口当たり純資産額 2.6333円 (1万口当たりの純資産額26,333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5月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT先物 0412月	40,146,400	-	39,400,000	746,400
	小計	40,146,400	-	39,400,000	746,400
合計		40,146,400	-	39,400,000	746,400

(2023年5月31日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT先物 0506月	36,382,400	-	37,610,000	1,227,600
	小計	36,382,400	-	37,610,000	1,227,600

合計	36,382,400	-	37,610,000	1,227,600
----	------------	---	------------	-----------

## (注) 1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (その他の注記)

(2022年11月30日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,284,744,165円
同期中における追加設定元本額	2,347,844,703円
同期中における一部解約元本額	1,719,409,398円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	123,734,117円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	226,924,020円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	145,809,464円
イオン・バランス戦略ファンド	20,352,708円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,243,436,891円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	18,736,291円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	60,011,376円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	46,032,543円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	162,453,627円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	92,074,182円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	72,660,790円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	30,209,555円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,455,740円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	167,299,338円
日興FWS・Jリートインデックス	374,896,546円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	43,763,199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>	3,324,665円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	28,778,069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>	3,208,159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>	4,273,982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>	42,744,208円
合計	3,913,179,470円

(2023年5月31日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,913,179,470円
同期中における追加設定元本額	1,300,815,031円

同期中における一部解約元本額	797,522,540円
2023年5月31日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	66,281,427円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	109,362,961円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	95,579,663円
イオン・バランス戦略ファンド	44,262,348円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,438,247,172円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	17,584,270円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	70,705,563円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	53,980,201円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	190,138,469円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	109,210,593円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	85,936,082円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	37,427,523円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,373,419円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	209,068,192円
日興FWS・Jリートインデックス	498,270,984円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	56,724,718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	12,774円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	19,339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
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	11,008円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	24,086円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	32,318円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	40,162円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	48,935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WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	56,934,013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>	53,871,731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>	68,587,736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>	148,368,883円
合計	4,416,471,961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11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	179,631,581	154,140,049
金銭信託	25,566,164	760,929
コール・ローン	157,745,488	41,211,889

投資証券	24,586,639,159	26,803,867,926
派生商品評価勘定	1,047	135
未収入金	1,170,969	1,099,040
未収配当金	39,192,137	39,521,077
流動資産合計	24,989,946,545	27,040,601,045
資産合計	24,989,946,545	27,040,601,045
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	170,425	162,581
未払金	78,556,684	-
未払解約金	31,589,177	3,000,000
その他未払費用	371	125
流動負債合計	110,316,657	3,162,706
負債合計	110,316,657	3,162,706
純資産の部		
元本等		
元本	8,860,732,746	9,841,825,258
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	16,018,897,142	17,195,613,081
元本等合計	24,879,629,888	27,037,438,339
純資産合計	24,879,629,888	27,037,438,339
負債純資産合計	24,989,946,545	27,040,601,045

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<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11月30日現在）	（2023年5月31日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	8,860,732,746口	9,841,825,258口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.8079円 （1万口当たりの純資産額28,079円）	1口当たり純資産額 2.7472円 （1万口当たりの純資産額27,472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5月31日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## （デリバティブ取引に関する注記）

（2022年11月30日現在）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	130,100,000	-	130,003,672	96,328
	オーストラリア・ドル	14,300,000	-	14,243,620	56,380
	シンガポール・ドル	2,300,000	-	2,300,972	972
	イギリス・債券	1,800,000	-	1,782,358	17,642
	小計	148,500,000	-	148,330,622	169,378
合計		148,500,000	-	148,330,622	169,378

（2023年5月31日現在）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	29,900,000	-	29,737,554	162,446
	小計	29,900,000	-	29,737,554	162,446
合 計		29,900,000	-	29,737,554	162,446

## (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。

- 3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額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11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	6,336,539,299円
同期中における追加設定元本額	3,494,346,976円
同期中における一部解約元本額	970,153,529円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	12,940,527円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	17,073,331円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	12,567,990円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	7,380,775,925円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	6,434,883円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	58,606,602円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	44,014,413円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	153,929,966円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	87,821,388円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	69,286,976円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	89,559,984円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	845,457円

三井住友D S ・外国リートインデックス年金ファンド	325,259,559円
日興F W S ・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	78,592,105円
日興F W S ・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	387,230,766円
三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド	31,002,495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>	36,000,406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>	31,377,238円
S M D A M ・リスクコントロール型バランスファンド2 0 2 1 0 5 (リスク3%)	
<適格機関投資家限定>	37,412,735円
合 計	8,860,732,746円

(2023年5月31日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	8,860,732,746円
同期中における追加設定元本額	1,392,976,882円
同期中における一部解約元本額	411,884,370円
2023年5月31日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	13,398,410円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	17,518,661円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	11,017,650円
イオン・バランス戦略ファンド	104,984,034円
三井住友・D C 外国リートインデックスファンド	7,903,607,639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	7,808,383円
三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)	67,747,695円
三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	50,706,295円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	178,973,156円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	103,596,659円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	82,343,925円
三井住友・D C つみたてN I S A ・世界分散ファンド	107,329,841円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド2 0 6 0	1,034,851円
三井住友D S ・外国リートインデックス年金ファンド	361,893,166円
日興F W S ・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	97,179,330円
日興F W S ・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	515,053,046円
三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド	45,202,124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	7,339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	7,706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	9,541円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド2 0 5 5	11,376円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド2 0 6 5	11,376円
三井住友D S ・F W 専用ポートフォリオ・レベル1 (保守型)	2,761円
三井住友D S ・F W 専用ポートフォリオ・レベル2 (安定型)	4,369円
三井住友D S ・F W 専用ポートフォリオ・レベル3 (安定成長型)	5,602円
三井住友D S ・F W 専用ポートフォリオ・レベル4 (成長型)	6,885円
三井住友D S ・F W 専用ポートフォリオ・レベル5 (積極成長型)	7,844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>	35,722,574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>	38,360,696円
S M D A M ・リスクコントロール型バランスファンド2 0 2 1 0 5 (リスク3%)	
<適格機関投資家限定>	98,272,324円

## ゴールド・インデックス・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	44,944,694	38,837,473
金銭信託	4,242,207	775,566
コール・ローン	26,174,794	42,004,616
投資信託受益証券	3,754,431,327	5,489,106,870
派生商品評価勘定	1,728	1,301
流動資産合計	3,829,794,750	5,570,725,826
資産合計	3,829,794,750	5,570,725,826
負債の部		
流動負債		
未払金	53,523,970	36,956,586
未払解約金	1,069,582	917,765
その他未払費用	122	125
流動負債合計	54,593,674	37,874,476
負債合計	54,593,674	37,874,476
純資産の部		
元本等		
元本	3,178,413,029	4,141,921,122
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	596,788,047	1,390,930,228
元本等合計	3,775,201,076	5,532,851,350
純資産合計	3,775,201,076	5,532,851,350
負債純資産合計	3,829,794,750	5,570,725,826

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

	(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礎となる事項	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11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,178,413,029口	4,141,921,122口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1878円 (1万口当たりの純資産額11,878円)	1口当たり純資産額 1.3358円 (1万口当たりの純資産額13,358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5月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	39,987,446	-	39,989,174	1,728
	小計	39,987,446	-	39,989,174	1,728

合 計	39,987,446	-	39,989,174	1,728
-----	------------	---	------------	-------

(2023年5月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	27,529,055	-	27,530,356	1,301
	小計	27,529,055	-	27,530,356	1,301
合 計		27,529,055	-	27,530,356	1,301

(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。

3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額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11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	864,264,346円
同期中における追加設定元本額	2,632,159,819円
同期中における一部解約元本額	318,011,136円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)	316,496,322円
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)	2,580,676,358円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)	281,240,349円
合 計	3,178,413,029円

(2023年5月31日現在)
----------------

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,178,413,029円
同期中における追加設定元本額	1,151,382,766円
同期中における一部解約元本額	187,874,673円
2023年5月31日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)	362,611,697円
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)	3,266,684,024円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)	512,342,149円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	25,537円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	46,487円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	62,044円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	70,666円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	78,518円
合計	4,141,921,122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6月30日現在

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

最近5年間における資本金の額の増減  
該当ありません。

## (2)【事業の内容及び営業の状況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2023年6月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	704	10,457,929
単位型株式投資信託	96	573,616
追加型公社債投資信託	1	25,933
単位型公社債投資信託	171	279,100
合計	972	11,336,579

## (3)【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

該当ありません。

(ロ) その他の重要事項

該当ありません。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

## 5【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
- 2 当社は、当事業年度(2022年4月1日から2023年3月31日まで)の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	49,008,279	37,742,400
金銭の信託	-	12,645,575
顧客分別金信託	300,041	300,046
前払費用	475,266	546,900
未収入金	103,809	437,880
未収委託者報酬	12,125,117	11,563,662
未収運用受託報酬	2,437,063	2,138,030
未収投資助言報酬	388,639	344,586
未収収益	36,700	35,477
その他の流動資産	18,458	8,423
流動資産合計	64,893,375	65,762,982
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	1,433,442	1,361,305
器具備品	653,985	559,057
土地	710	710
リース資産	7,357	4,114
建設仮勘定	5,500	81,240
有形固定資産合計	2,100,996	2,006,427
無形固定資産		
ソフトウェア	2,766,476	2,414,295
ソフトウェア仮勘定	100,616	508,956
のれん	3,349,950	3,045,409
顧客関連資産	13,558,615	11,445,340
電話加入権	12,716	12,706
商標権	42	36
無形固定資産合計	19,788,417	17,426,744
投資その他の資産		
投資有価証券	14,212,354	9,222,276
関係会社株式	11,246,398	11,850,598
長期差入保証金	1,414,646	1,388,987
長期前払費用	77,936	80,207
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	27,021,065	22,611,799
固定資産合計	48,910,479	42,044,971

資産合計	113,803,855	107,807,953
------	-------------	-------------

(単位：千円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
リース債務	3,567	2,564
顧客からの預り金	6,045	11,094
その他の預り金	196,515	128,069
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	1,969	2,013
未払償還金	152	1,312
未払手数料	5,545,582	5,194,011
その他未払金	48,893	259,542
<b>未払費用</b>		
未払消費税等	7,379,404	6,370,986
未払法人税等	1,133,332	406,770
賞与引当金	2,455,291	333,009
資産除去債務	2,100,323	1,801,492
資産除去債務	7,192	13,940
その他の流動負債	40,396	73,657
<b>流動負債合計</b>	<b>18,918,667</b>	<b>14,598,465</b>
<b>固定負債</b>		
リース債務	4,525	1,960
繰延税金負債	1,279,409	550,493
退職給付引当金	5,084,506	5,027,832
その他の固定負債	4,620	-
<b>固定負債合計</b>	<b>6,373,062</b>	<b>5,580,287</b>
<b>負債合計</b>	<b>25,291,730</b>	<b>20,178,752</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,000	2,000,000
<b>資本剰余金</b>		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	73,466,962	73,466,962
<b>資本剰余金合計</b>	<b>82,095,946</b>	<b>82,095,946</b>
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	284,245	284,245
<b>その他利益剰余金</b>		
繰越利益剰余金	3,834,794	3,391,568
<b>利益剰余金合計</b>	<b>4,119,040</b>	<b>3,675,814</b>
<b>株主資本計</b>	<b>88,214,986</b>	<b>87,771,760</b>
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	297,138	142,558
<b>評価・換算差額等合計</b>	<b>297,138</b>	<b>142,558</b>
<b>純資産合計</b>	<b>88,512,124</b>	<b>87,629,201</b>
<b>負債・純資産合計</b>	<b>113,803,855</b>	<b>107,807,953</b>

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
--	-------	-------

	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	66,139,024	61,471,271
運用受託報酬	9,652,634	8,978,419
投資助言報酬	1,256,334	1,273,386
その他営業収益		
サービス支 hands 手数料	199,046	208,222
その他	32,936	22,995
営業収益計	77,279,976	71,954,296
営業費用		
支払手数料	30,522,133	28,036,456
広告宣伝費	330,161	294,588
調査費		
調査費	3,196,921	3,749,357
委託調査費	12,192,048	11,455,987
営業雑経費		
通信費	67,600	61,068
印刷費	494,834	452,951
協会費	34,433	38,701
諸会費	30,488	33,447
情報機器関連費	4,767,504	5,067,617
販売促進費	31,930	29,621
その他	181,301	197,696
営業費用合計	51,849,358	49,417,495
一般管理費		
給料		
役員報酬	263,893	219,872
給料・手当	8,664,828	7,807,797
賞与	991,916	1,042,472
賞与引当金繰入額	2,100,323	1,798,492
交際費	12,301	27,713
寄付金	29,273	25,518
事務委託費	1,422,189	1,727,189
旅費交通費	16,863	99,733
租税公課	476,729	352,030
不動産賃借料	1,289,256	1,268,303
退職給付費用	632,559	624,551
固定資産減価償却費	3,133,951	3,247,869
のれん償却費	304,540	304,540
諸経費	256,994	200,758
一般管理費合計	19,595,622	18,746,845
営業利益	5,834,995	3,789,956

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	7,666	1,755
受取利息	1,836	1,373
時効成立分配金・償還金	43,406	521
原稿・講演料	2,587	2,281
投資有価証券償還益	383,608	119,033

投資有価証券売却益		911,268	25,848
為替差益		4,673	5,816
雑収入		81,640	91,814
営業外収益合計		1,436,686	248,443
営業外費用			
金銭の信託運用損		-	454,339
投資有価証券償還損		146,219	83,598
投資有価証券売却損		81,384	152,691
雑損失		2,866	-
営業外費用合計		230,470	690,629
経常利益		7,041,212	3,347,770
特別損失			
固定資産除却損	1	83,651	13,203
システム統合関連費用	2	375,636	-
早期退職費用	3	260,075	126,832
支払補償費	4	-	30,075
その他特別損失		67,000	-
特別損失合計		786,362	170,111
税引前当期純利益		6,254,849	3,177,659
法人税、住民税及び事業税		3,101,482	1,622,064
法人税等調整額		965,673	541,433
法人税等合計		2,135,809	1,080,631
当期純利益		4,119,040	2,097,028

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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		
					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	
--	------	----------	--

	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
	利益剰余金 合計				
当期首残高	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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31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
当期変動額						
剰余金の配当						2,540,254
当期純利益						2,097,028
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	443,225
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,391,568

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金 合計	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124
当期変動額					
剰余金の配当	2,540,254	2,540,254			2,540,254
当期純利益	2,097,028	2,097,028			2,097,028
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			439,697	439,697	439,697
当期変動額合計	443,225	443,225	439,697	439,697	882,923
当期末残高	3,675,814	87,771,760	142,558	142,558	87,629,201

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 重要な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

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)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

## (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

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。）等を当事業年度の期首から適用し、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。これによる当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。なお、時価算定会計基準適用指針27-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項」注記については記載しておりません。

#### (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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
建物	210,548千円	301,463千円
器具備品	1,309,352千円	1,499,284千円
リース資産	6,073千円	7,493千円

##### 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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	57,356千円	12,514千円

#### (損益計算書関係)

##### 1 固定資産除却損

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
建物	- 千円	2,482千円
器具備品	0千円	4,273千円
リース資産	- 千円	532千円
ソフトウェア	83,651千円	5,915千円

##### 2 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。

##### 3 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

##### 4 支払補償費

受益者や販売会社に生じた損失の補償に伴い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 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. 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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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
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

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
2023年6月28日 定時株主総会	普通株式	1,591,892	47.00	2023年 3月31日	2023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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
1年以内	1,166,952	1,161,545
1年超	2,323,090	1,161,545
合計	3,490,042	2,323,090

(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おり、当社が設定する投資信託の事業推進等を目的として、直接または特定金外信託を通じて当該投資信託を保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、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、資金調達はありません。

## (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おります。

金銭の信託及び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。

金銭の信託、投資有価証券及び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

金銭の信託及び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。

また、特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、市場価格の変動リスクについて為替予約、株価指数先物、債券先物、スワップ取引などのデリバティブ取引により一部リスクヘッジしております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

当事業年度における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、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。

前事業年度（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)金銭の信託	-	-	-
(2)投資有価証券 その他有価証券	14,172,545	14,172,545	-
資産計	14,172,545	14,172,545	-

当事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	12,645,575	12,645,575	-
(2)投資有価証券 その他有価証券	9,182,466	9,182,466	-
資産計	21,828,042	21,828,042	-

(注1)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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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	11,850,598
合計	11,246,398	11,850,598

## 3. 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。なお、時価算定会計基準適用指針27-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項」については記載しておりません。

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。

## 時価で貸借対照表に計上している金融商品

（単位：千円）

区分	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1)金銭の信託	-	12,645,575	-	12,645,575
(2)投資有価証券 その他有価証券	-	9,182,466	-	9,182,466
資産計	-	21,828,042	-	21,828,042

## 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)

## 1. 子会社株式

前事業年度（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。

当事業年度（2023年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式11,850,598千円）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

前事業年度（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。

当事業年度（2023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	3,144,004	3,054,367	89,637
小計	3,144,004	3,054,367	89,637
(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	6,038,462	6,295,278	256,815
小計	6,038,462	6,295,278	256,815
合計	9,182,466	9,349,645	167,178

（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 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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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
1,675,637	25,848	152,691

(単位:千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
6,449,143	119,033	83,598

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	5,258,448	5,084,506
勤務費用	454,611	429,188
利息費用	1,013	6,502
数理計算上の差異の発生額	34,553	12,781
退職給付の支払額	595,013	479,583
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	5,084,506	5,027,832

## (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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	5,084,506	5,027,832
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	5,084,506	5,027,832

## (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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	454,611	429,188
利息費用	1,013	6,502
数理計算上の差異の費用処理額	34,553	12,781
その他	211,487	201,641
確定給付制度に係る退職給付費用	632,559	624,551

(注) 其他は、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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.130%	0.230%

## 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237,296千円、当事業年度241,556千円であります。

(税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

（単位：千円）

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,556,876	1,539,522
賞与引当金	643,119	551,617
調査費	279,809	473,972
未払金	284,070	211,439
未払事業税	139,522	39,995
ソフトウェア償却	107,998	105,506
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	93,946	120,350
その他	28,056	21,158
繰延税金資産小計	3,248,274	3,178,439
評価性引当額	189,102	193,662
繰延税金資産合計	3,059,171	2,984,776
繰延税金負債		
無形固定資産	4,151,648	3,504,563
資産除去債務	825	3,201
その他有価証券評価差額金	186,107	27,506
繰延税金負債合計	4,338,581	3,535,270
繰延税金資産（負債）の純額	1,279,409	550,493

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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.6	3.0
のれん償却費	1.4	2.9
所得税額控除による税額控除	-	1.3
その他	0.3	1.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.1	34.0

（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 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。

当事業年度(自 2022年4月1日 至2023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	61,471,271	8,978,419	1,273,386	231,218	71,954,296

## (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 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)

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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	5,279,199	未払 手数料	1,265,651
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	7,030,381	未払 手数料	1,288,749

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	2,613.28円	2,587.21円
1株当たり当期純利益	121.61円	61.91円

(注) 1. 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の算定上の基礎は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり当期純利益		
当期純利益(千円)	4,119,040	2,097,028
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(千円)	4,119,040	2,097,028
期中平均株式数(株)	33,870,060	33,870,060

**独立監査人の監査報告書**

2023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

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2023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

2023年8月16日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンドの2023年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2022年12月1日から2023年5月31日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する

内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

（注）１．上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

２．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年8月16日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・日経225インデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・日経225インデックス・ファンドの2023年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2022年12月1日から2023年5月31日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に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．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年8月16日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンドの2023年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2022年12月1日から2023年5月31日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する

内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

（注）１．上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

２．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年8月16日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンドの2023年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2022年12月1日から2023年5月31日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する

内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

（注）１．上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

２．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2023年8月16日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC あらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・先進国債インデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・先進国債インデックス・ファンドの2023年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年12月1日から2023年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する

内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

（注）１．上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

２．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年8月16日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・新興国債インデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・新興国債インデックス・ファンドの2023年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2022年12月1日から2023年5月31日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する

内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

（注）１．上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

２．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年8月16日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・国内リートインデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・国内リートインデックス・ファンドの2023年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2022年12月1日から2023年5月31日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する

内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

（注）１．上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

２．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年8月16日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC あらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンドの2023年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年12月1日から2023年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に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. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年8月16日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)の2022年12月1日から2023年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)の2023年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2022年12月1日から2023年5月31日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。