

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年8月17日提出
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	大和住銀DC年金設計ファンド30 大和住銀DC年金設計ファンド50 大和住銀DC年金設計ファンド70
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	大和住銀DC年金設計ファンド30 5兆円を上限とします。 大和住銀DC年金設計ファンド50 5兆円を上限とします。 大和住銀DC年金設計ファンド70 5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

## (1)【ファンドの名称】

大和住銀DC年金設計ファンド30

大和住銀DC年金設計ファンド50

大和住銀DC年金設計ファンド70

以下、上記3ファンドを総称して「大和住銀DC年金設計ファンド」または「当ファンド」ということがあり、それぞれを「各ファンド」ということがあります。

また、「大和住銀DC年金設計ファンド30」を「年金設計30」、「大和住銀DC年金設計ファンド50」を「年金設計50」、「大和住銀DC年金設計ファンド70」を「年金設計70」という略称でいうことがあります。

## (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

## (3)【発行（売出）価額の総額】

各ファンド5兆円を上限とします。

## (4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「年金設計30」は「大住DC30」、「年金設計50」は「大住DC50」、「年金設計70」は「大住DC70」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

## (5)【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2023年8月18日から2024年2月15日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

ハ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用

ありません。

ニ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われます。

- ・ 受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます(原則として受益証券を保有することはできません。 )。
- ・ ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。
- ・ 振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

###### ファンドの目的

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて世界各国の株式および公社債へバランス運用を行うことにより、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

###### 信託金の限度額

信託金の限度額は、各ファンド1兆円とします。委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

###### ファンドの基本的性格

当ファンドにおける一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は以下の通りです。

###### <商品分類表>

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式
	海外	債券
		不動産投信
<b>追加型</b>	<b>内外</b>	その他資産 ( )
		<b>資産複合</b>

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

###### 商品分類表の各項目の定義について

追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

資産複合...目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投信(リート)およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

上記以外の各区分の定義の詳細については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

###### <属性区分表>

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
--------	------	--------	------	-------

株式 一般 大型株 中小型株	<b>年1回</b>	<b>グローバル (日本を含む)</b>		
	年2回	日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年4回	北米	<b>ファミリーファンド</b>	あり ( )
	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
不動産投信	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	<b>なし</b>
<b>その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式、債券)、 資産配分固定型))</b>		アフリカ		
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)		
		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

属性区分表の各項目の定義について

その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）、資産配分固定型））

...目論見書又は投資信託約款において、投資信託証券（マザーファンド）を通じて実質的に複数資産（株式、債券）を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

グローバル（日本を含む）...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界（日本を含む）の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

上記以外の各区分の定義の詳細については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

## （2）【ファンドの沿革】

2001年9月21日 信託契約締結

2001年9月21日 当ファンドの設定・運用開始

2007年1月4日 投資信託振替制度へ移行

2019年4月1日 ファンドの委託会社としての業務を大和住銀投信投資顧問株式会社から三井住友D

## Sアセットマネジメント株式会社へ承継

## (3) 【ファンドの仕組み】

## イ 当ファンドの関係法人とその役割

## (イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

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

## (ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

## (ハ) 販売会社

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

## (ニ) 投資顧問会社（運用の委託先）

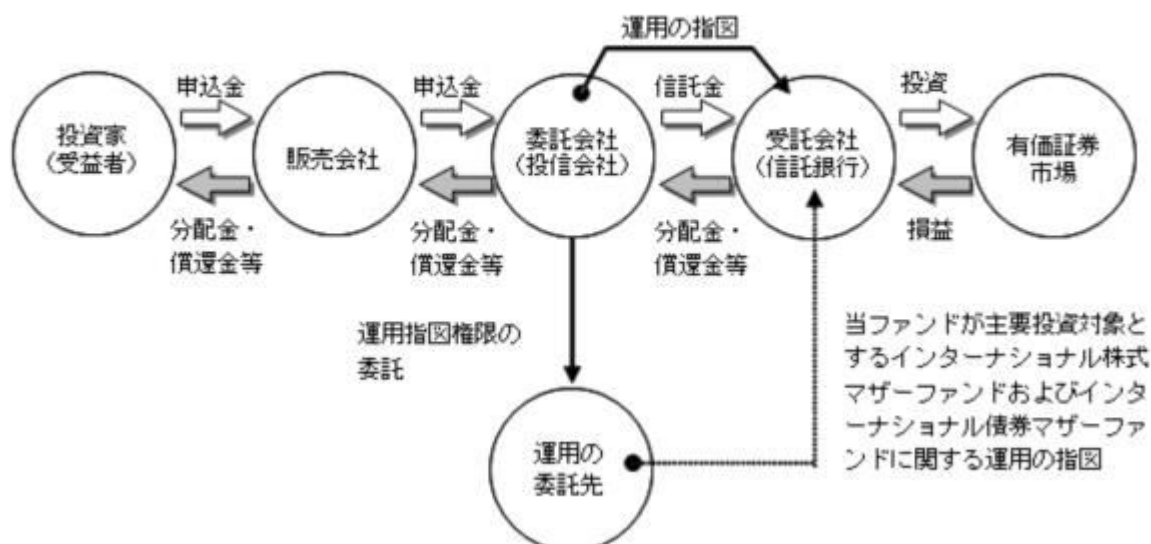
名称：ティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インク

役割：委託会社との間で締結される投資一任契約（運用委託契約）に基づき、国際ナショナル株式マザーファンドの運用指図に関する権限の委託を受け、信託財産の運用を行います。

名称：ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド

役割：委託会社との間で締結される投資一任契約（運用委託契約）に基づき、国際ナショナル債券マザーファンドの運用指図に関する権限の委託を受け、信託財産の運用を行います。

## 運営の仕組み



## ロ 委託会社の概況

## (イ) 資本金の額

20億円（2023年6月30日現在）

## (ロ) 会社の沿革

- 1985年 7月15日 三生投資顧問株式会社設立
- 1987年 2月20日 証券投資顧問業の登録
- 1987年 6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可

1999年1月1日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
1999年2月5日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
2000年1月27日	証券投資信託委託業の認可取得
2002年12月1日	住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
2013年4月1日	トヨタアセットマネジメント株式会社と合併
2019年4月1日	大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

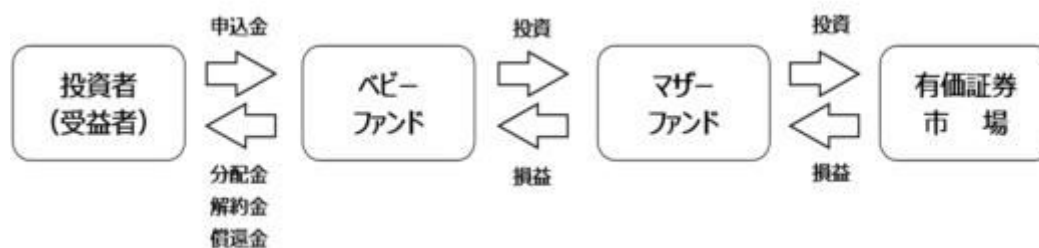
#### （八）大株主の状況

（2023年6月30日現在）

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

#### 八 ファンドの運用形態（ファミリーファンド方式による運用）

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



## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

主として、国内株式、国内債券、海外株式、海外債券へ分散投資を行う各マザーファンドへ投資を行うことにより、リスクの低減を図りつつ、信託財産の中長期的な成長を目指します。

年金日本株式マザーファンド、年金日本債券マザーファンド、国際株式マザーファンドおよび国際債券マザーファンドを主要投資対象とします。なお、株式・公社債等に直接投資することがあります。



各資産(マザーファンド)への基本的な投資比率(「基本資産配分」)は、以下の通りです。投資期間やリスクに応じて、資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

資産	国内株式	国内債券	海外株式	海外債券
投資対象 マザーファンド	年金日本株式 マザーファンド	年金日本債券 マザーファンド	インターナショナル 株式マザーファンド	インターナショナル 債券マザーファンド
年金設計30	25%	60%	5%	10%
年金設計50	35%	40%	15%	10%
年金設計70	50%	20%	20%	10%

\* 資産配分は、基本資産配分より、原則としてそれぞれ±5%の範囲内で行います。

	株式の実質組入比率の上限	外貨建資産の実質組入比率の上限
年金設計30	40%	25%
年金設計50	60%	35%
年金設計70	80%	40%

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

資金動向、市況動向によっては上記のような運用ができない場合があります。

## ファンドの特色

1

主として国内株式、国内債券、海外株式、海外債券へ分散投資を行う各マザーファンドへ投資を行うことにより、リスクの低減を図りつつ、信託財産の中長期的な成長を目指します。

□年金日本株式マザーファンド、年金日本債券マザーファンド、インターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンドを主要投資対象とします。

※株式・公社債等に直接投資することがあります。

2

資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

### ▶基本資産配分

資産	国内株式	国内債券	海外株式	海外債券
投資対象マザーファンド	年金日本株式マザーファンド	年金日本債券マザーファンド	インターナショナル株式マザーファンド	インターナショナル債券マザーファンド
年金設計30	25%	60%	5%	10%
年金設計50	35%	40%	15%	10%
年金設計70	50%	20%	20%	10%

※資産配分は、基本資産配分より、原則としてそれぞれ±5%の範囲内で行います。

3

海外資産の運用は、ティー・ロウ・プライス・グループが行います。

□インターナショナル株式マザーファンドにおける運用指図にかかる権限をティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクへ委託します。

□インターナショナル債券マザーファンドにおける運用指図にかかる権限をティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドへ委託します。

4

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

5

各マザーファンドの運用は、各資産のベンチマーク（下記参照）を中長期的に上回る投資成果を目指して運用を行います。

マザーファンド	投資対象資産	ベンチマーク
年金日本株式マザーファンド	国内株式	TOPIX（東証株価指数、配当込み）
年金日本債券マザーファンド	国内債券	NOMURA-BPI（総合）
国際ナショナル株式マザーファンド	海外株式	MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）*1
国際ナショナル債券マザーファンド	海外債券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）*2

\*1 米ドルベースのMSCIコクサイ・インデックス（配当込み）を委託会社が円換算したものです。

\*2 米ドルベースのFTSE世界国債インデックス（除く日本）を委託会社が円換算したものです。

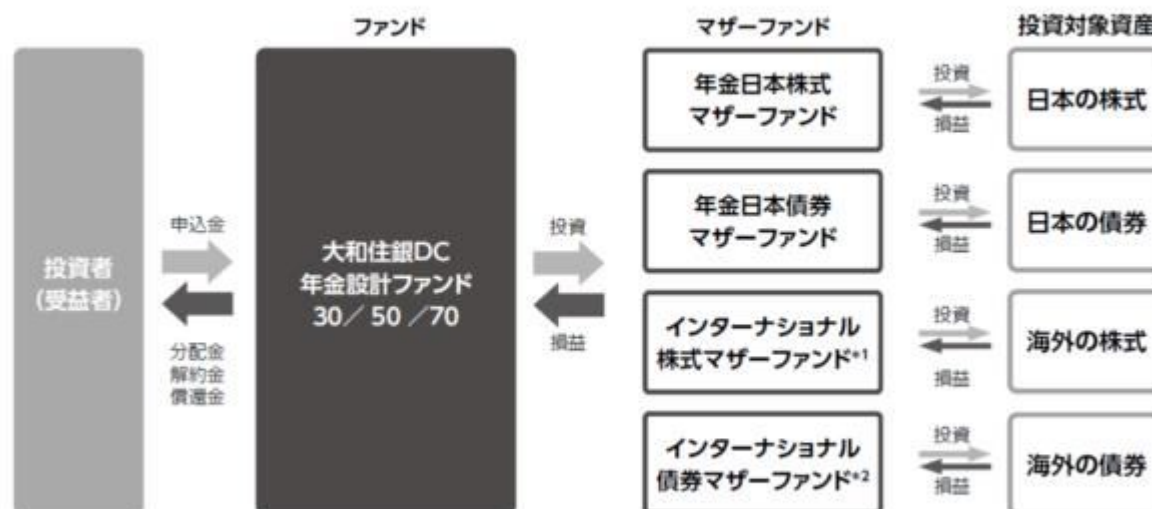
※資金動向、市況動向によっては上記のような運用ができない場合があります。

#### 指数の著作権など

- TOPIX（東証株価指数）は株式会社JPX総研、NOMURA-BPIは野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社、MSCIコクサイ・インデックスはMSCI Inc.、FTSE世界国債インデックスはFTSE Fixed Income LLCが、それぞれ公表している指数です。
- 各インデックスに関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は、指数を公表および許諾する各社に帰属します。また、当該各社は当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

## ファンドのしくみ

■ファミリーファンド方式を採用し、マザーファンドの組入れを通じて、実際の運用を行います。



\*1 国際ナショナル株式マザーファンドの運用にあたっては、ティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクに運用指図に関する権限を委託します。

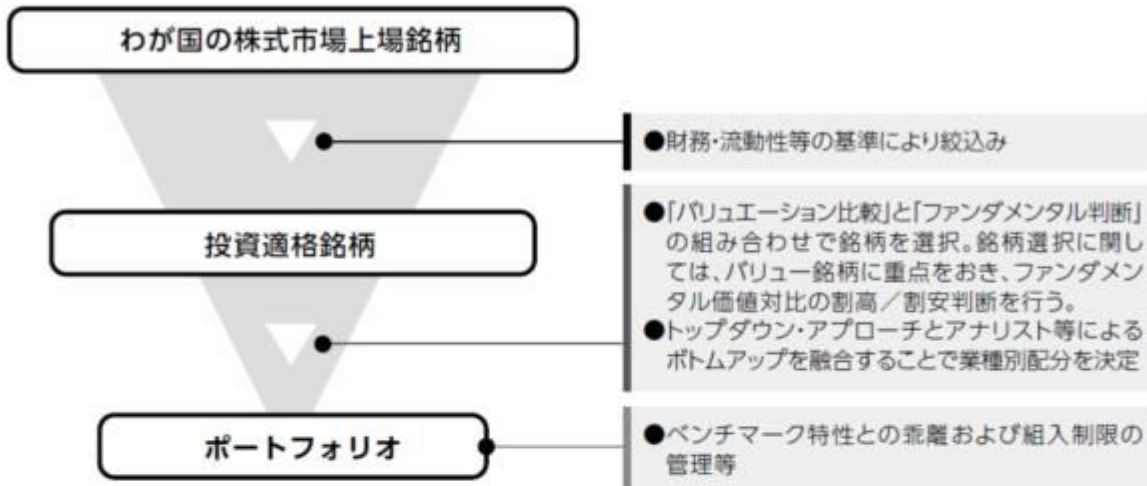
\*2 国際ナショナル債券マザーファンドの運用にあたっては、ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。

## 各マザーファンドの投資方針等

### ▶ 年金日本株式マザーファンド

- わが国の株式を主要投資対象とし、ファンダメンタル価値比割安性(バリュー)を重視し、収益性・成長性を勘案したアクティブ運用により信託財産の長期的な成長を目指します。
- TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとし、バリュー・アプローチを基本としたアクティブ運用により中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。

#### [ 運用プロセス ]



### ▶ 年金日本債券マザーファンド

- わが国の公社債を主要投資対象とし、金利予測(デュレーション・コントロール等)等を重視したアクティブ運用により信託財産の長期的な成長を目指します。
- NOMURA-BPI（総合）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。

#### [ 運用プロセス ]

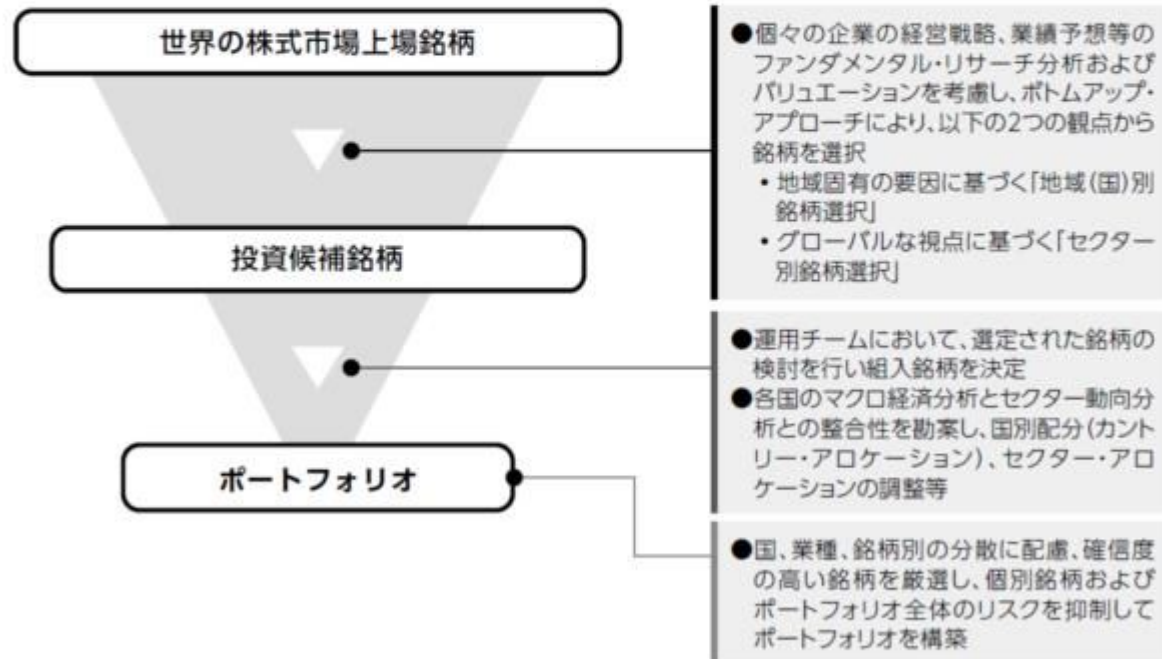


※上記の運用プロセスは2023年6月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

## ▶ インターナショナル株式マザーファンド

- 海外の株式へ分散投資を行い、リスクの低減とグローバルな投資機会の獲得により信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
- MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。また、ベンチマーク構成国以外の国の株式へ投資を行うこともあります。
- 運用の指図に関する権限をティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクに委託します。

### [ 運用プロセス ]



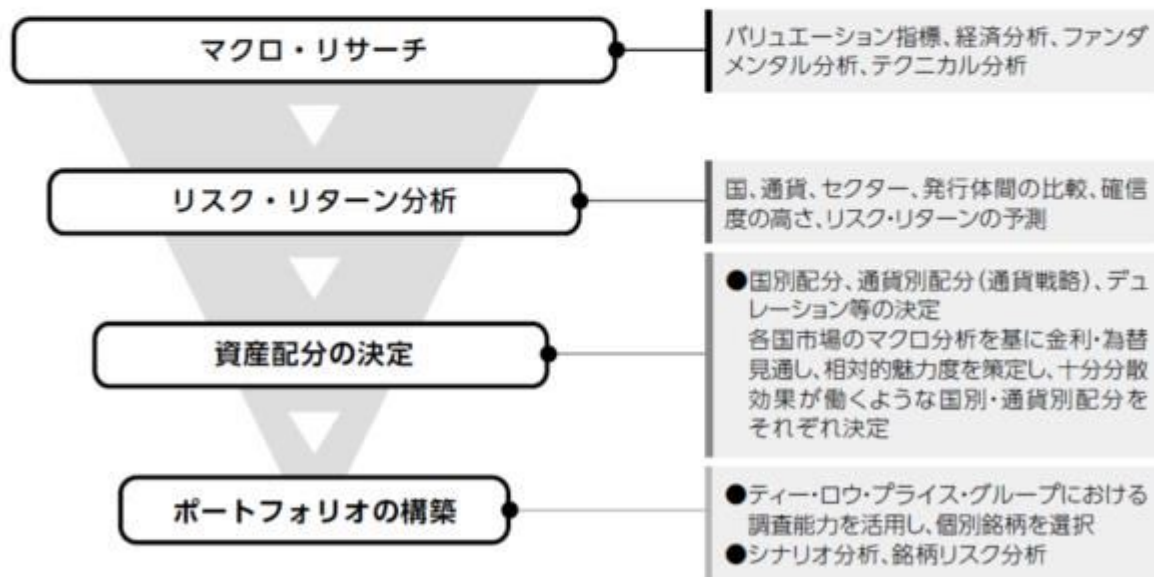
※ 上記の運用プロセスは2023年6月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

(出所)ティー・ロウ・プライス・グループの情報を基に委託会社作成

## ▶ インターナショナル債券マザーファンド

- 海外の公社債へ分散投資を行い、リスクの低減とグローバルな投資機会の獲得により信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
- FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。また、ベンチマーク構成国以外の国の債券へ投資を行うこともあります。
- 債券と為替の運用に関しては、異なる資産としてそれぞれ独立した運用を行い、世界債券および通貨の分散投資を図ります。
- 運用の指図に関する権限をティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドに委託します。

### [ 運用プロセス ]



※上記の運用プロセスは2023年6月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

(出所)ティー・ロウ・プライス・グループの情報を基に委託会社作成

### マザーファンドの実質的な運用を行う運用会社について

- インターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンドの実質的な運用は、ティー・ロウ・プライス・グループが行います。

### [ ティー・ロウ・プライス・グループの概要 ]

会社概要	<ul style="list-style-type: none"> <li>● ティー・ロウ・プライス・グループは、1937年に設立された独立系の資産運用会社であり、グローバルに資産運用業務を行っています。</li> <li>● ティー・ロウ・プライス・グループ・インクは、米国の上場会社であり、また、S&amp;P500インデックスの採用銘柄です。</li> </ul>
拠 点	世界16カ国に25拠点を展開
従 業 員 数	7,837名(うち運用プロフェッショナル938名)
運用資産残高	約178兆円(約1兆3,417億米ドル)

(注)2023年3月末現在、運用資産残高は1米ドル=133.09円で円換算  
(出所)ティー・ロウ・プライス・グループの情報を基に委託会社作成

- ティー・ロウ・プライス・グループはTCFD(気候関連財務情報開示タスクフォース)への賛同を表明し、SASB Allianceに加入しております。

## (2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)
  - イ. 有価証券
  - ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定めるものに限ります。)
  - ハ. 金銭債権
  - ニ. 約束手形(金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。)
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

#### 運用の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として三井住友DSアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三井住友信託銀行株式会社を受託会社として締結された年金日本株式マザーファンド、年金日本債券マザーファンド、インターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

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

## 22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、1の証券または証書、12ならびに17の証券または証書のうち1の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2から6までの証券および12ならびに17の証券または証書のうち2から6までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13の証券および14の証券を以下「投資信託証券」といいます。

## その他の金融商品の運用の指図

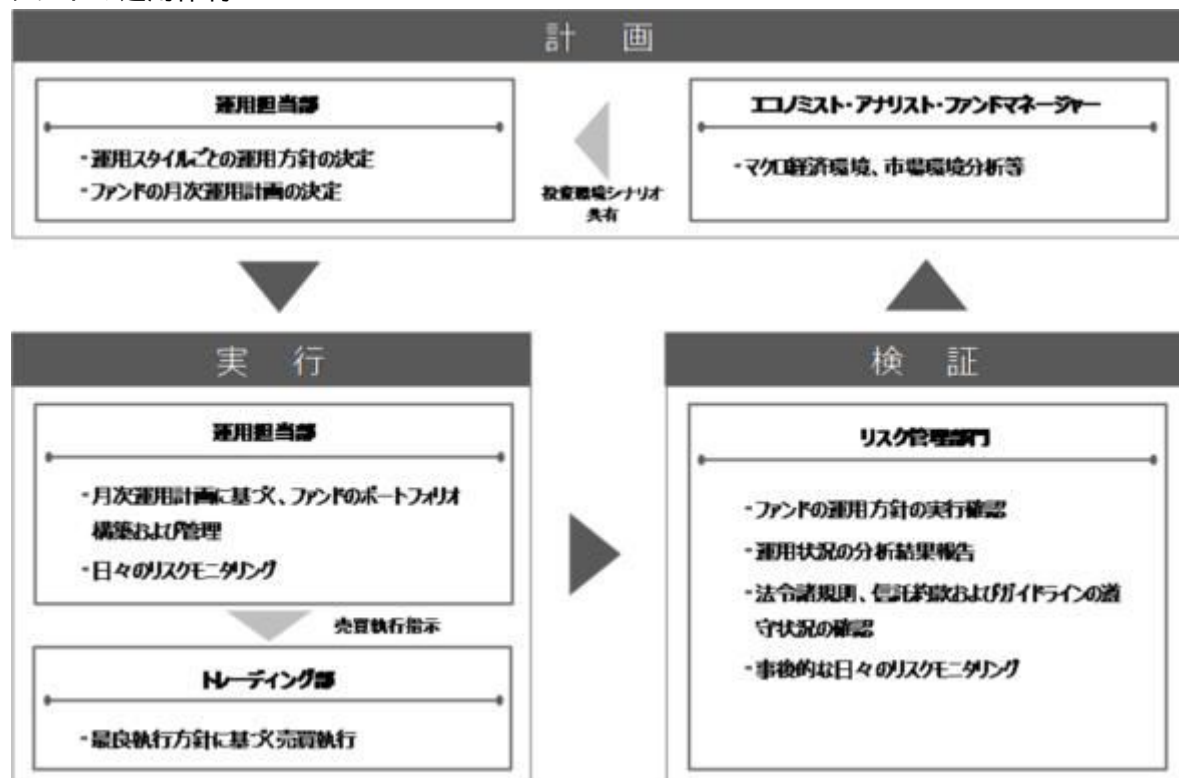
委託会社は、信託金を、前記の有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

また、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、主として前記の1から6までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

## (3) 【運用体制】

## イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約40名です。

当ファンドが主要投資対象とするインターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンドの運用の主要部分は、委託会社からそれぞれマザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けたティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクおよびティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドが、投資一任契約（運用委託契約）およびそれに付随するガイドラインに従って行います。

インターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンドについて、委託会社においては、追加設定・一部解約に伴う資金の流出入の管理、運用委託先への委



託資産の増減の指示、余裕資金の運用等および運用委託先の運用状況(ガイドライン等の遵守状況、運用パフォーマンスなど)のモニタリング等を行います。

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人(販売会社を除く)に対する管理体制

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

運用委託先は、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上、選定しています。また、定性・定量面における評価を継続的に実施するとともに、運用委託契約の継続可否を定期的に判断します。

**【参考情報】ティー・ロウ・プライスの運用体制**

ティー・ロウ・プライスでは、戦略ごとに、ポートフォリオ・マネジャーおよびアナリストにより構成される専門運用チームが設けられており、運用チームは、他戦略の運用プロフェッショナルや、マクロエコノミスト等と適宜情報共有し、相互に支援します。また、運用部門では運用戦略に応じて、適宜、専門委員会が設けられております。ファンドの運用に関する社内規則として、一括発注および約定結果の配分にかかる方針のほか、最良執行にかかる方針を定め、売買執行における最良執行に努めるとともに、売買執行にあたって使用する金融商品取引業者についても方針を定め、取引コストや各金融商品取引業者との取引量等についてモニタリングを行っております。また全社員が遵守すべき社内規則において、利益相反管理にかかる方針や従業員取引にかかる規則等が定められております。ファンドの保有する有価証券等の評価に関しては、評価方法その他を管理するための専門委員会を設け、保有有価証券等が一般社団法人投資信託協会の規則にそって適正に評価されるよう担保しています。また、ティー・ロウ・プライスは、環境、社会、ガバナンス(ESG)に関する諸要素を運用プロセスに取り入れ、ポートフォリオの組入銘柄のパフォーマンスに重大な影響を与えると判断するESG要素を考慮した投資を行っています。なお、投資判断を行う際に、結果としてESG要素よりも他の投資に関する要素を優先する場合があります。

(4) 【分配方針】

毎決算時(毎年11月19日。ただし、休業日の場合は翌営業日)に、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

イ. 分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。

ロ. 収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額な場合等には分配を行わないことがあります。

ハ. 留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

(基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)

(5) 【投資制限】

当ファンドは、委託会社による当ファンドの運用に関して以下のような一定の制限および限度を定めています。

信託約款に定める投資制限

イ. 株式等への投資制限

(イ)委託会社は、取得時において信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドに属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、下記の割合を超えることとな

る投資の指図をしません。

大和住銀DC年金設計ファンド30.....信託財産の純資産総額の100分の40

大和住銀DC年金設計ファンド50.....信託財産の純資産総額の100分の60

大和住銀DC年金設計ファンド70.....信託財産の純資産総額の100分の80

\* 信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。以下同じです。

(ロ)委託会社は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。

## ロ．投資する株式等の範囲

(イ)委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場(上場予定を含みます。)されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じです。

(ロ)前記にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

## ハ．同一銘柄の株式等への投資制限

(イ)委託会社は、取得時において信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

(ロ)委託会社は、取得時において信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

## ニ．投資信託証券への投資制限

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券(マザーファンドを除きます。)の時価総額とマザーファンドに属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

## ホ．信用取引の運用指図

(イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(ロ)前項の信用取引の指図は、当該売付にかかる建玉の時価総額とマザーファンドに属する当該売付にかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ)信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付にかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

## ヘ．先物取引等の運用指図

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

## ト．スワップ取引の運用指図

- (イ)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下、「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (ロ)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

## チ．金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図

- (イ)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ)金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ)金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ)委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ホ)金利先渡取引とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (ヘ)為替先渡取引とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本項において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本項において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日にお

る当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### リ．同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債等への投資制限

委託会社は、取得時において信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

#### ヌ．有価証券の貸付の指図および範囲

- (イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- a．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  - b．公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- (ロ)前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ)委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### ル．公社債の空売りの指図

- (イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、公社債(信託財産により借入れた公社債を含みます。)の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- (ロ)前項の売付の指図は、当該売付にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ)信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

#### ヲ．公社債の借入れ

- (イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認められたときは、担保の提供の指図を行うことができます。
- (ロ)前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ)信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ)上記(イ)の借入れにかかる品借料は信託財産から支弁するものとします。

## ワ．外貨建資産への投資制限

外貨建資産への実質投資割合は、取得時において下記のとおりとします。

大和住銀D C年金設計ファンド30.....信託財産の純資産総額の100分の25以内

大和住銀D C年金設計ファンド50.....信託財産の純資産総額の100分の35以内

大和住銀D C年金設計ファンド70.....信託財産の純資産総額の100分の40以内

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

## カ．外国為替予約の指図および範囲

(イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

(ロ)前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

(ハ)前項の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

## コ．デリバティブ取引等に係る投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。)については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

## ク．信用リスク集中回避のための投資制限

一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## ケ．資金の借入れ

(イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(ロ)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%の範囲内とします。

(ハ)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(ニ)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

## ソ．受託会社による資金の立替え

- (イ)信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株主割当がある場合で、委託会社の申し出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。
- (ロ)信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- (ハ)上記(イ)および(ロ)の立替金の決済および利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

## 法令に基づく投資制限

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

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

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

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

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

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

(参考情報：マザーファンドの投資方針等)

(年金日本株式マザーファンド)

### (1)運用の基本方針

当ファンドは、わが国の株式へ投資を行うことにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

### (2)運用方法

投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

イ．T O P I X（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとし、バリュース・アプローチを基本としたアクティブ運用により中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。

ロ．マクロ経済動向および産業動向等の分析により、業種・規模別配分等を行います。

- ハ．デリバティブ取引(法人税法第61条の5第1項で定めるものをいいます。)は、価格変動リスクを減じる目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- 二．資金動向、市況動向によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3)運用の指図

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1．次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)
  - イ．有価証券
  - ロ．デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定めるものに限ります。)
  - ハ．金銭債権
  - ニ．約束手形(金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。)
- 2．次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ．為替手形

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

- 1．株券又は新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、転換社債型新株予約権付社債に限ります。)
- 6．特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9．特別目的会社にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10．コマーシャル・ペーパー
- 11．新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
- 12．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前各号の証券の性質を有するもの
- 13．証券投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 14．投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 15．外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 16．オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 17．預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 18．指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 19．抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- 20．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、1の証券または証書、12ならびに17の証券または証書のうち1の証券または証書の性質を有

するものを以下「株式」といい、2から6までの証券および12ならびに17の証券または証書のうち2から6までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13の証券および14の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

前記にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、主として前記1から5までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

#### (4) 主な投資制限

株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は、以下の範囲で行います。

イ. 委託会社は、わが国の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)

ロ. 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引は、以下の範囲で行います。

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。



- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。

一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## (年金日本債券マザーファンド)

### (1)運用の基本方針

当ファンドは、わが国の公社債へ投資を行うことにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

### (2)運用方法

#### 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### 投資態度

- イ．NOMURA - B P I (総合)をベンチマークとし、デュレーション・コントロールを重視したアクティブ運用により中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。
- ロ．資金動向、市況動向によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3)運用の指図

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1．次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)
  - イ．有価証券
  - ロ．デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定めるものに限りません。)

## 八．金銭債権

二．約束手形(金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。)

## 2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

- 1．国債証券
- 2．地方債証券
- 3．特別の法律により法人の発行する債券
- 4．社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、転換社債型新株予約権付社債に限ります。)
- 5．特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 6．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 7．協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 8．特別目的会社にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 9．転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使により取得した株券
- 10．コマーシャル・ペーパー
- 11．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前各号の証券の性質を有するもの
- 12．証券投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 13．投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 14．外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 15．オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
- 16．預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 17．指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 18．抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- 19．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、9の証券または証書、11ならびに16の証券または証書のうち9の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、1から5までの証券および11ならびに16の証券または証書のうち1から5までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、12の証券および13の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

- 1．預金
- 2．指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形
- 5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

前記にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用

上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、主として前記 1 から 5 までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

#### (4) 主な投資制限

株式への投資割合には、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使により取得したものに限り、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、わが国の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)
- ロ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。

一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## (インターナショナル株式マザーファンド)

### (1)運用の基本方針

当ファンドは、世界各国の株式へ投資することにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

### (2)運用方法

#### 投資対象

世界各国の株式を主要投資対象とします。

#### 投資態度

- イ．MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。
- ロ．運用の指図に関する権限をティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクに委託します。
- ハ．国別資産配分に関しては、各国の経済成長率、金利、為替レート、金融政策、資金需給や各市場間の企業の相対的魅力度分析により決定されます。
- ニ．銘柄選択については、個々の企業の経営戦略、業績予想等のファンダメンタル分析およびバリュエーションを考慮し、ボトムアップ・アプローチにより行います。
- ホ．外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ヘ．資金動向、市況動向によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3)運用の指図

委託会社(委託会社から運用の指図に係る権限を委託されたものを含みます。)は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

- 1．株券または新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6．特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9．特別目的会社にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10．コマーシャル・ペーパー
- 11．新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および

## 新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
  13. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  14. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
  15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
  17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
  21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、1の証券または証書、12ならびに17の証券または証書のうち1の証券または証書の性質を有するものおよび14の証券のうちクローズド・エンド型のものを以下「株式」といい、2から6までの証券および12ならびに17の証券または証書のうち2から6までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13の証券および14の証券のうちクローズド・エンド型以外のものを以下「投資信託証券」といいます。

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

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

前記にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、主として前記1から6までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

## (4) 主な投資制限

株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
- ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。

一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(インターナショナル債券マザーファンド)

### (1) 運用の基本方針

当ファンドは、日本を除く世界各国の公社債を中心に投資することにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

### (2) 運用方法

#### 投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

#### 投資態度

イ．FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。

ロ．債券と為替の運用に関しては、異なる資産としてそれぞれ独立した運用を行い、世界債券および通貨の分散投資を図ります。

ハ．運用の指図に関する権限をティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドに委託します。

ニ．外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

ホ．資金動向、市況動向によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 運用の指図

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定めるものに限りません。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形（金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。）

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社（委託会社から運用の指図に係る権限を委託されたものを含みます。）は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1．国債証券

2．地方債証券

3．特別の法律により法人の発行する債券

4．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、転換社債型新株予約権付社債に限りません。）

5．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

6．転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使により取得した株券

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．特別目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。)および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、6の証券または証書、12ならびに17の証券または証書のうち6の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、1から5までの証券および12ならびに17の証券または証書のうち1から5までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13の証券および14の証券を「投資信託証券」といいます。

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

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

前記にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、主として前記1から6までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

#### (4) 主な投資制限

株式への投資割合には、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使により取得したものに限り、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。



有価証券先物取引等は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
- ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
  - ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
  - ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - ハ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。

一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### 3【投資リスク】

#### イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

(イ) 株式市場リスク

内外の経済動向や株式市場での需給動向等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況等によって変動し、株価が下落した場合はファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ロ) 債券市場リスク

一般に債券は内外の経済情勢等の影響による金利の変動を受けて価格が変動します。通常、金利が上昇すると債券価格は下落します。また、格付けが引き下げられる場合も債券価格が下落するおそれがあります。債券価格の下落はファンドの基準価額が下落する要因となります。なお、価格の変動幅は、債券の種類、格付け、残存期間、利払いのしくみの違い等により、債券ごとに異なります。

(ハ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品において債務不履行が発生あるいは懸念される場合、またはその発行体が経営不安や倒産等に陥った場合には、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ニ) 為替変動リスク

外貨建資産への投資は為替変動の影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落する(円高となる)場合、円ベースでの評価額が下落し、基準価額が下落することがあります。

(ホ) カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化、取引規制や税制の変更等によって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券等の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

(ヘ) 流動性リスク

有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等に、十分な数量の売買ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

ロ その他の留意点

(イ) ファンド固有の留意点

資産および投資先の配分について

当ファンドの実質的な資産配分は、基本的な資産配分比率と乖離を生じる場合があります。この結果、運用成果は、基本資産配分で運用を行った場合を上回ったり下回ったりすることがありますので、ご留意ください。

(ロ) 投資信託に関する留意点

- ・当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。
- ・ファンドのお申込みに関しては、クーリング・オフ制度の適用はありません。
- ・ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金申込みの受け付けが中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延す

る可能性等があります。

#### （八）分配金に関する留意事項

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



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

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

#### 八 投資リスクの管理体制

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、運用リスク管理を行っています。

リスク管理担当部は、信託約款等に定める各種投資制限やリスク指標のモニタリングを実施し、制限に対する抵触等があった場合には運用部門に対処要請等を行い、結果をリスク管理会議へ報告します。

また、ファンドのパフォーマンスの分析・評価を行い、結果を運用評価会議等へ報告することで、運用方針等との整合性を維持するよう適切に管理しています。

さらに、流動性リスク管理について規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングやストレステストを実施するとともに、緊急時対応策等の策定や有効性の検証等を行います。なお、当該流動性リスクの適切な管理の実施等について、定期的にはリスク管理会議へ報告します。

コンプライアンス担当部は、法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行い、結果をコンプライアンス会議に報告します。

#### 【参考情報】ティー・ロウ・プライスのリスク管理体制

ティー・ロウ・プライスでは、グループ全体で包括的に運用リスクを管理する体制としています。リスクをさまざまな側面から捉え、内在するリスクの種類を識別・把握し、多面的に管理するため、運用部門から独立したリスク管理部門を組織しております。リスク管理部門には運用リスク担当の専門チームを配置し、運用チームを主にデータ分析面でサポートし、さらに流動性リスク等の運用リスクのモニタリングも行っています。法令、規則および運用ガイドライン等の遵守にあたっては、インベストメント・コンプライアンスが運用部門から独立したモニタリングを行っています。

さらに、ティー・ロウ・プライス・グループ組織全体のリスク管理に関する方針設定および実態の把握のために、リスクを監督する委員会を設置しています。当該委員会は、ティー・ロウ・プライス・グループのリスク管理部門の責任者であるチーフ・リスク・オフィサー他、主要部門の責任者で構成され、運用にかかるリスク（流動性リスクを含みます。）、オペレーショナル・リスク、ビジネス・リスク等について、全社的な観点から監督します。

受託会社や業務委託先の選定にあたっては、選定にかかる方針を定めており、必要に応じて面談や質問票への回答を求めるなどして選考を行うとともに、社内の管理担当者を定めて継続モニタリングを行います。

## （参考情報）投資リスクの定量的比較

### 【ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移】

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

#### ■年金設計30



#### ■年金設計50

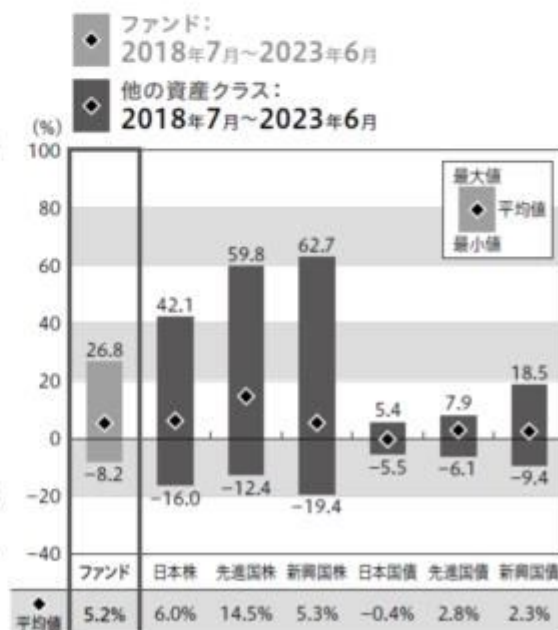
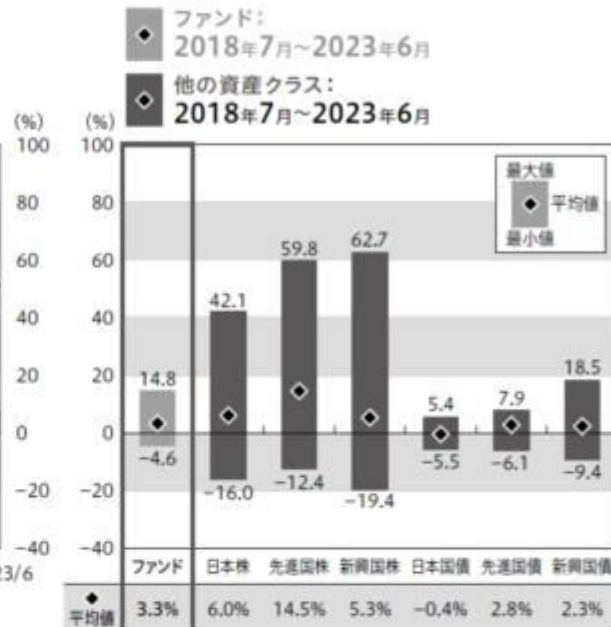


※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

### 【ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較】

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



※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 【 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 】

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

### ■年金設計70

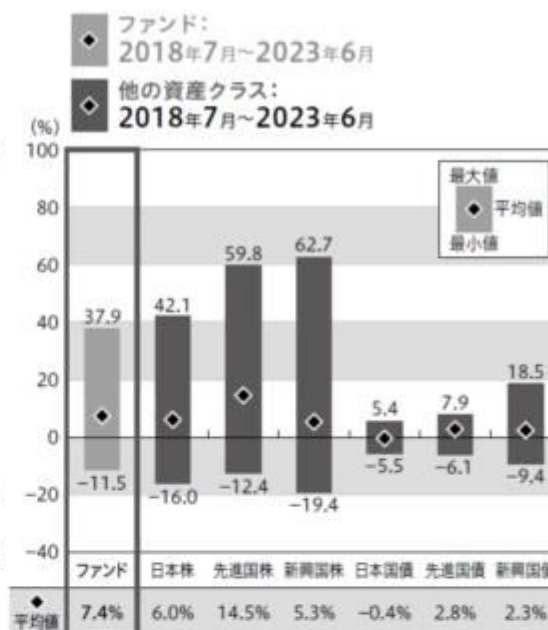


※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

## 【 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 】

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



※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 各資産クラスの指数

日本株	TOPIX(東証株価指数、配当込み) 株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社が算出、公表する指数で、日本の株式を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが開発した指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

※上記各指数に関する知的財産権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

ありません。

### (2)【換金(解約)手数料】

解約手数料はありません。

### （３）【信託報酬等】

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

信託報酬の配分は以下の通りです。

< 信託報酬率およびその配分 >

ファンド	信託報酬率	配分（税抜き）		
		委託会社	販売会社	受託会社
年金設計30	年0.99% (税抜き0.90%)	年0.42%	年0.40%	年0.08%
年金設計50	年1.21% (税抜き1.10%)	年0.52%	年0.50%	年0.08%
年金設計70	年1.43% (税抜き1.30%)	年0.62%	年0.60%	年0.08%

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

委託会社の報酬には、以下の運用の指図の委託先への報酬の合計額が含まれます。

- ・ インターナショナル株式マザーファンドの組入評価額に対して年0.51%を乗じた額
- ・ インターナショナル債券マザーファンドの組入評価額に対して年0.36%を乗じた額

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

### （４）【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0088%（税抜き0.0080%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

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

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

## (5) 【課税上の取扱い】

## イ 個別元本について

- (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
- (ハ) 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）

## ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

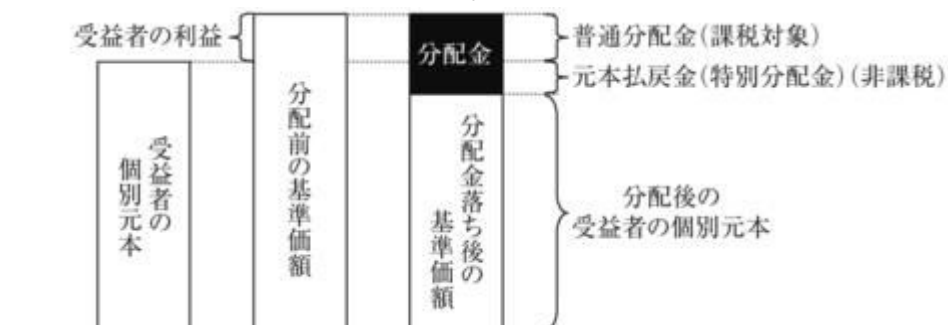
## ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



上記、の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を

示唆するものではありません。

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・ 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

#### ・ 一部解約時および償還時

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

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

### (ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

上記「(5) 課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2023年6月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

## 5 【運用状況】

### (1) 【投資状況】

大和住銀DC年金設計ファンド30

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	4,222,605,688	100.16
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	6,684,292	0.16
合計（純資産総額）		4,215,921,396	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。

大和住銀DC年金設計ファンド50



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	9,892,165,569	100.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	11,739,453	0.12
合計(純資産総額)		9,880,426,116	100.00

## 大和住銀DC年金設計ファンド70

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	10,214,956,324	100.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	15,973,981	0.16
合計(純資産総額)		10,198,982,343	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 大和住銀DC年金設計ファンド30

## イ 主要投資銘柄

2023年6月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	年金日本債券マ ザーファンド	1,917,929,529	1.2447	2,387,245,492	1.2595	2,415,632,241	57.30
日本	親投資 信託受 益証券	年金日本株式マ ザーファンド	271,155,088	3.5367	958,984,485	4.2420	1,150,239,883	27.28
日本	親投資 信託受 益証券	インターナショ ナル債券マザー ファンド	134,320,032	3.0335	407,466,076	3.1839	427,661,549	10.14
日本	親投資 信託受 益証券	インターナショ ナル株式マザー ファンド	24,153,778	7.9807	192,763,439	9.4839	229,072,015	5.43

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.16
合計	100.16

## 大和住銀DC年金設計ファンド50

## イ 主要投資銘柄

2023年6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	年金日本株式マ ザーファンド	886,496,629	3.5370	3,135,504,672	4.2420	3,760,518,700	38.06
日本	親投資 信託受 益証券	年金日本債券マ ザーファンド	2,826,467,766	1.2462	3,522,230,505	1.2595	3,559,936,151	36.03
日本	親投資 信託受 益証券	インターナシヨ ナル株式マザー ファンド	170,638,242	7.9800	1,361,695,708	9.4839	1,618,316,023	16.38
日本	親投資 信託受 益証券	インターナシヨ ナル債券マザー ファンド	299,442,412	3.0359	909,092,006	3.1839	953,394,695	9.65

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.12
合計	100.12

## 大和住銀DC年金設計ファンド70

## イ 主要投資銘柄

2023年6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	年金日本株式マ ザーファンド	1,207,833,684	3.5360	4,270,903,121	4.2420	5,123,630,487	50.24
日本	親投資 信託受 益証券	インターナシヨ ナル株式マザー ファンド	220,272,933	8.0691	1,777,401,115	9.4839	2,089,046,469	20.48
日本	親投資 信託受 益証券	年金日本債券マ ザーファンド	1,571,176,047	1.2475	1,959,964,619	1.2595	1,978,896,231	19.40
日本	親投資 信託受 益証券	インターナシヨ ナル債券マザー ファンド	321,424,397	3.0375	976,312,430	3.1839	1,023,383,137	10.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.16
合計	100.16

## 【投資不動産物件】

大和住銀DC年金設計ファンド30

該当事項はありません。

大和住銀DC年金設計ファンド50

該当事項はありません。

大和住銀DC年金設計ファンド70

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

大和住銀DC年金設計ファンド30

該当事項はありません。

大和住銀DC年金設計ファンド50

該当事項はありません。

大和住銀DC年金設計ファンド70

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

大和住銀DC年金設計ファンド30

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12期 (2013年11月19日)	2,655,292,612	2,655,292,612	13,476	13,476
第13期 (2014年11月19日)	2,972,260,536	2,972,260,536	14,656	14,656
第14期 (2015年11月19日)	3,078,782,579	3,078,782,579	15,402	15,402
第15期 (2016年11月21日)	3,200,694,792	3,200,694,792	15,197	15,197

第16期 (2017年11月20日)	3,443,277,170	3,443,277,170	16,550	16,550
第17期 (2018年11月19日)	3,339,411,732	3,339,411,732	16,297	16,297
第18期 (2019年11月19日)	3,542,052,292	3,542,052,292	17,123	17,123
第19期 (2020年11月19日)	3,723,266,105	3,723,266,105	17,826	17,826
第20期 (2021年11月19日)	4,117,876,215	4,117,876,215	19,632	19,632
第21期 (2022年11月21日)	3,978,962,987	3,978,962,987	19,228	19,228
2022年 6月末日	3,990,679,721	-	19,089	-
7月末日	4,021,147,983	-	19,300	-
8月末日	4,023,381,390	-	19,335	-
9月末日	3,925,344,053	-	18,802	-
10月末日	3,965,275,783	-	19,167	-
11月末日	3,982,205,702	-	19,230	-
12月末日	3,906,987,661	-	18,731	-
2023年 1月末日	3,957,309,437	-	19,003	-
2月末日	3,980,531,830	-	19,245	-
3月末日	4,023,438,990	-	19,391	-
4月末日	4,041,306,590	-	19,579	-
5月末日	4,094,985,609	-	19,857	-
6月末日	4,215,921,396	-	20,486	-

## 大和住銀DC年金設計ファンド50

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12期 (2013年11月19日)	4,971,461,387	4,971,461,387	15,159	15,159
第13期 (2014年11月19日)	5,937,653,630	5,937,653,630	17,053	17,053
第14期 (2015年11月19日)	6,353,543,009	6,353,543,009	18,305	18,305
第15期 (2016年11月21日)	6,489,688,868	6,489,688,868	17,757	17,757
第16期 (2017年11月20日)	7,205,526,822	7,205,526,822	20,382	20,382
第17期 (2018年11月19日)	7,065,208,811	7,065,208,811	19,860	19,860
第18期 (2019年11月19日)	7,464,387,467	7,464,387,467	21,086	21,086
第19期 (2020年11月19日)	7,990,761,978	7,990,761,978	22,458	22,458
第20期 (2021年11月19日)	9,181,898,872	9,181,898,872	26,226	26,226
第21期 (2022年11月21日)	8,971,783,889	8,971,783,889	25,550	25,550
2022年 6月末日	8,845,862,077	-	25,159	-
7月末日	8,950,928,136	-	25,557	-
8月末日	9,012,033,848	-	25,656	-
9月末日	8,673,292,029	-	24,709	-
10月末日	8,959,564,404	-	25,465	-
11月末日	8,989,506,282	-	25,562	-
12月末日	8,712,273,753	-	24,743	-
2023年 1月末日	8,913,942,359	-	25,320	-
2月末日	9,017,350,641	-	25,673	-
3月末日	9,091,607,521	-	25,770	-

4月末日	9,175,765,276	-	26,135	-
5月末日	9,422,474,514	-	26,825	-
6月末日	9,880,426,116	-	28,126	-

## 大和住銀DC年金設計ファンド70

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12期 (2013年11月19日)	4,337,024,979	4,337,024,979	17,515	17,515
第13期 (2014年11月19日)	5,292,336,762	5,292,336,762	20,329	20,329
第14期 (2015年11月19日)	5,782,844,185	5,782,844,185	22,272	22,272
第15期 (2016年11月21日)	5,606,043,967	5,606,043,967	20,638	20,638
第16期 (2017年11月20日)	6,553,268,444	6,553,268,444	24,796	24,796
第17期 (2018年11月19日)	6,353,963,052	6,353,963,052	23,947	23,947
第18期 (2019年11月19日)	6,778,366,283	6,778,366,283	25,784	25,784
第19期 (2020年11月19日)	7,299,998,600	7,299,998,600	27,923	27,923
第20期 (2021年11月19日)	9,073,172,179	9,073,172,179	34,548	34,548
第21期 (2022年11月21日)	9,007,950,257	9,007,950,257	33,848	33,848
2022年 6月末日	8,735,775,681	-	32,982	-
7月末日	8,878,283,915	-	33,603	-
8月末日	8,981,096,286	-	33,846	-
9月末日	8,564,807,204	-	32,229	-
10月末日	8,943,212,273	-	33,602	-
11月末日	9,064,765,706	-	33,967	-
12月末日	8,767,350,540	-	32,684	-
2023年 1月末日	8,984,706,771	-	33,750	-
2月末日	9,124,028,270	-	34,250	-
3月末日	9,175,150,818	-	34,261	-
4月末日	9,290,926,920	-	34,911	-
5月末日	9,603,478,217	-	36,128	-
6月末日	10,198,982,343	-	38,455	-

## 【分配の推移】

## 大和住銀DC年金設計ファンド30

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第12期	2012年11月20日～2013年11月19日	0
第13期	2013年11月20日～2014年11月19日	0
第14期	2014年11月20日～2015年11月19日	0
第15期	2015年11月20日～2016年11月21日	0
第16期	2016年11月22日～2017年11月20日	0
第17期	2017年11月21日～2018年11月19日	0
第18期	2018年11月20日～2019年11月19日	0

第19期	2019年11月20日～2020年11月19日	0
第20期	2020年11月20日～2021年11月19日	0
第21期	2021年11月20日～2022年11月21日	0

## 大和住銀DC年金設計ファンド50

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第12期	2012年11月20日～2013年11月19日	0
第13期	2013年11月20日～2014年11月19日	0
第14期	2014年11月20日～2015年11月19日	0
第15期	2015年11月20日～2016年11月21日	0
第16期	2016年11月22日～2017年11月20日	0
第17期	2017年11月21日～2018年11月19日	0
第18期	2018年11月20日～2019年11月19日	0
第19期	2019年11月20日～2020年11月19日	0
第20期	2020年11月20日～2021年11月19日	0
第21期	2021年11月20日～2022年11月21日	0

## 大和住銀DC年金設計ファンド70

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第12期	2012年11月20日～2013年11月19日	0
第13期	2013年11月20日～2014年11月19日	0
第14期	2014年11月20日～2015年11月19日	0
第15期	2015年11月20日～2016年11月21日	0
第16期	2016年11月22日～2017年11月20日	0
第17期	2017年11月21日～2018年11月19日	0
第18期	2018年11月20日～2019年11月19日	0
第19期	2019年11月20日～2020年11月19日	0
第20期	2020年11月20日～2021年11月19日	0
第21期	2021年11月20日～2022年11月21日	0

## 【収益率の推移】

## 大和住銀DC年金設計ファンド30

	収益率(%)
第12期	21.2
第13期	8.8
第14期	5.1
第15期	1.3
第16期	8.9
第17期	1.5
第18期	5.1
第19期	4.1

第20期	10.1
第21期	2.1
第22期(中間期)	3.5

(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。

#### 大和住銀DC年金設計ファンド50

	収益率(%)
第12期	33.2
第13期	12.5
第14期	7.3
第15期	3.0
第16期	14.8
第17期	2.6
第18期	6.2
第19期	6.5
第20期	16.8
第21期	2.6
第22期(中間期)	5.1

(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。

#### 大和住銀DC年金設計ファンド70

	収益率(%)
第12期	46.2
第13期	16.1
第14期	9.6
第15期	7.3
第16期	20.1
第17期	3.4
第18期	7.7
第19期	8.3
第20期	23.7
第21期	2.0
第22期(中間期)	7.0

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

#### (4) 【設定及び解約の実績】

#### 大和住銀DC年金設計ファンド30

	設定口数(口)	解約口数(口)
--	---------	---------

第12期	317,138,297	262,519,434
第13期	312,565,077	254,961,384
第14期	309,826,201	338,796,477
第15期	246,561,526	139,449,347
第16期	190,729,547	216,357,431
第17期	177,042,330	208,423,587
第18期	196,902,639	177,424,115
第19期	245,058,103	225,002,927
第20期	217,980,831	209,133,099
第21期	179,913,990	208,021,969
第22期(中間期)	79,020,986	87,751,365

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 大和住銀DC年金設計ファンド50

	設定口数(口)	解約口数(口)
第12期	381,945,305	371,607,208
第13期	498,211,684	295,867,385
第14期	476,375,260	487,502,605
第15期	387,981,906	204,065,383
第16期	285,008,907	404,550,713
第17期	275,769,053	253,513,096
第18期	280,300,218	297,760,580
第19期	315,558,978	297,549,523
第20期	282,153,008	339,151,882
第21期	267,539,496	257,050,361
第22期(中間期)	119,589,579	118,890,410

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 大和住銀DC年金設計ファンド70

	設定口数(口)	解約口数(口)
第12期	419,578,520	360,743,160
第13期	465,045,301	337,942,409
第14期	468,485,032	475,360,148
第15期	345,149,754	225,264,310
第16期	291,843,926	365,295,752
第17期	287,709,097	277,289,617
第18期	258,694,020	283,051,401
第19期	325,599,540	340,250,275
第20期	340,307,488	328,348,522
第21期	302,998,070	267,970,527
第22期(中間期)	141,383,410	147,887,674

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。



(参考)

## (1) 投資状況

## 年金日本株式マザーファンド

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	106,087,020,550	98.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,546,630,028	1.44
合計(純資産総額)		107,633,650,578	100.00

## 年金日本債券マザーファンド

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	日本	29,669,088,100	63.34
地方債証券	日本	585,502,700	1.25
特殊債券	日本	1,073,122,284	2.29
社債券	日本	12,943,510,000	27.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,569,755,192	5.49
合計(純資産総額)		46,840,978,276	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 (%)
債券先物取引	買建	日本	2,079,700,000	4.44
合計	買建	-	2,079,700,000	4.44

## インターナショナル株式マザーファンド

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	131,466,770,174	62.07
	オランダ	12,258,136,121	5.79
	イギリス	8,922,734,128	4.21
	カナダ	7,708,991,046	3.64
	ドイツ	7,198,491,918	3.40
	香港	6,893,019,155	3.25
	インド	5,821,381,500	2.75
	スイス	5,129,606,423	2.42
	スペイン	4,559,675,559	2.15
	台湾	4,425,817,505	2.09
	ケイマン諸島	3,121,672,873	1.47
	イタリア	2,524,477,440	1.19
	アイルランド	2,269,705,710	1.07
	スウェーデン	2,229,978,723	1.05
	小計		204,530,458,275

投資証券	イギリス	1,684,988,116	0.80
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	5,578,791,609	2.63
合計（純資産総額）		211,794,238,000	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	-	896,696,172	0.42
為替予約取引	売建	-	10,954,344	0.01

## インターナショナル債券マザーファンド

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	3,058,990,868	45.03
	ドイツ	815,736,876	12.01
	イギリス	382,009,592	5.62
	ニュージーランド	351,405,140	5.17
	メキシコ	270,771,794	3.99
	スペイン	144,585,369	2.13
	イタリア	85,939,409	1.27
	シンガポール	84,819,760	1.25
	オランダ	68,896,053	1.01
	イスラエル	66,330,058	0.98
	ベルギー	65,150,270	0.96
	インドネシア	57,461,992	0.85
	タイ	46,181,874	0.68
	カナダ	45,652,255	0.67
	オーストラリア	44,796,427	0.66
	オーストリア	38,195,647	0.56
	チリ	30,456,759	0.45
	フィリピン	29,218,674	0.43
	パミューダ	28,455,737	0.42
	ブルガリア	20,356,876	0.30
マレーシア	15,623,512	0.23	
アイルランド	5,538,773	0.08	
スロヴェニア	2,724,803	0.04	
小計		5,759,298,518	84.78
地方債証券	カナダ	24,096,323	0.35
特殊債券	国際機関	154,768,287	2.28
	ドイツ	65,401,072	0.96
	ハンガリー	42,521,941	0.63
	韓国	28,581,878	0.42
	オーストラリア	13,424,709	0.20
小計		304,697,887	4.49
社債券	ケイマン諸島	53,998,915	0.79

	デンマーク	45,155,967	0.66
	メキシコ	30,199,532	0.44
	アメリカ	29,130,837	0.43
	アラブ首長国連邦	24,585,664	0.36
	アイスランド	13,422,319	0.20
	ノルウェー	12,789,397	0.19
	小計	209,282,631	3.08
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	496,056,931	7.30
合計（純資産総額）		6,793,432,290	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（％）
債券先物取引	買建	ドイツ	1,248,555,268	18.38
債券先物取引	買建	カナダ	93,047,246	1.37
債券先物取引	買建	アメリカ	1,555,380,242	22.90
債券先物取引	買建	オーストラリア	101,102,147	1.49
合計	買建	-	2,998,084,903	44.13
債券先物取引	売建	イギリス	384,941,436	5.67
債券先物取引	売建	ドイツ	131,287,104	1.93
債券先物取引	売建	イタリア	18,294,208	0.27
債券先物取引	売建	アメリカ	1,562,829,086	23.00
合計	売建	-	2,097,351,834	30.87

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建	-	6,110,059,157	89.94
為替予約取引	売建	-	5,851,306,083	86.13

## （２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

年金日本株式マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2023年6月30日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（％）
日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	7,684,000	976.84	7,506,011,398	1,065.00	8,183,460,000	7.60
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	26,892,500	155.14	4,171,998,955	170.50	4,585,171,250	4.26
日本	株式	小松製作所	機械	1,052,100	3,176.00	3,341,469,600	3,881.00	4,083,200,100	3.79
日本	株式	T D K	電気機器	704,000	4,610.64	3,245,889,673	5,567.00	3,919,168,000	3.64
日本	株式	豊田自動織機	輸送用機器	342,200	7,970.00	2,727,334,000	10,255.00	3,509,261,000	3.26
日本	株式	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	1,230,700	1,457.87	1,794,197,462	2,701.50	3,324,736,050	3.09
日本	株式	富士電機	電気機器	512,300	5,422.55	2,777,973,493	6,290.00	3,222,367,000	2.99

日本	株式	スズキ	輸送用機器	568,900	4,839.00	2,752,907,100	5,201.00	2,958,848,900	2.75
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	201,400	11,630.00	2,342,282,000	12,965.00	2,611,151,000	2.43
日本	株式	B I P R O G Y	情報・通信業	733,100	3,365.00	2,466,881,500	3,533.00	2,590,042,300	2.41
日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	923,700	3,105.00	2,868,088,500	2,738.00	2,529,090,600	2.35
日本	株式	J F Eホールディングス	鉄鋼	1,186,400	1,782.30	2,114,525,327	2,050.00	2,432,120,000	2.26
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	550,800	3,544.91	1,952,536,760	4,341.00	2,391,022,800	2.22
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	982,100	1,951.56	1,916,628,670	2,308.50	2,267,177,850	2.11
日本	株式	パンダイナムコホールディングス	その他製品	515,200	2,968.34	1,529,289,428	3,321.00	1,710,979,200	1.59
日本	株式	東洋水産	食料品	262,600	5,315.44	1,395,835,478	6,503.00	1,707,687,800	1.59
日本	株式	東京建物	不動産業	912,200	1,610.90	1,469,462,235	1,850.50	1,688,026,100	1.57
日本	株式	東映	情報・通信業	88,600	17,340.00	1,536,324,000	18,330.00	1,624,038,000	1.51
日本	株式	セーレン	繊維製品	628,300	2,325.00	1,460,797,500	2,460.00	1,545,618,000	1.44
日本	株式	丸紅	卸売業	601,300	1,618.00	972,903,400	2,440.00	1,467,172,000	1.36
日本	株式	パナソニックホールディングス	電気機器	801,900	1,197.11	959,966,502	1,753.50	1,406,131,650	1.31
日本	株式	三和ホールディングス	金属製品	753,100	1,258.00	947,399,800	1,865.50	1,404,908,050	1.31
日本	株式	長谷工コーポレーション	建設業	788,800	1,545.65	1,219,210,839	1,773.00	1,398,542,400	1.30
日本	株式	D M G 森精機	機械	561,200	2,040.64	1,145,207,105	2,488.00	1,396,265,600	1.30
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	245,200	4,207.91	1,031,779,577	5,687.00	1,394,452,400	1.30
日本	株式	ニチレイ	食料品	441,600	2,711.91	1,197,578,439	3,081.00	1,360,569,600	1.26
日本	株式	三井物産	卸売業	251,300	3,917.00	984,342,100	5,411.00	1,359,784,300	1.26
日本	株式	A D E K A	化学	484,800	2,179.39	1,056,568,822	2,735.50	1,326,170,400	1.23
日本	株式	北國フィナンシャルホールディングス	銀行業	312,200	4,239.68	1,323,627,313	4,150.00	1,295,630,000	1.20
日本	株式	デンソー	輸送用機器	133,700	8,017.69	1,071,965,009	9,645.00	1,289,536,500	1.20

□ 種別・業種別投資比率

2023年6月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	鉱業	0.82
	建設業	2.20
	食料品	4.48
	繊維製品	1.44
	化学	3.76
	医薬品	0.84
	ゴム製品	0.36

ガラス・土石製品	0.63
鉄鋼	2.26
非鉄金属	0.44
金属製品	1.31
機械	6.24
電気機器	19.56
輸送用機器	13.40
精密機器	0.53
その他製品	1.89
陸運業	1.20
海運業	0.96
空運業	0.57
情報・通信業	8.54
卸売業	5.32
小売業	1.40
銀行業	11.54
証券、商品先物取引業	0.37
保険業	3.83
その他金融業	0.63
不動産業	3.21
サービス業	0.86
合 計	98.56

## 年金日本債券マザーファンド

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単 価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債 証券	4 4 9 2年国債	7,010,000,000	100.15	7,020,286,600	100.16	7,021,356,200	0.005	2025/06/01	14.99
日本	国債 証券	4 4 7 2年国債	2,800,000,000	100.08	2,802,346,100	100.16	2,804,396,000	0.005	2025/04/01	5.99
日本	国債 証券	1 4 9 20年国 債	990,000,000	108.24	1,071,580,500	110.68	1,095,751,800	1.500	2034/06/20	2.34
日本	国債 証券	3 7 0 10年国 債	1,050,000,000	100.81	1,058,484,000	100.98	1,060,311,000	0.500	2033/03/20	2.26
日本	国債 証券	1 8 4 20年国 債	1,010,000,000	100.42	1,014,197,100	101.73	1,027,473,000	1.100	2043/03/20	2.19
日本	国債 証券	3 6 2 10年国 債	900,000,000	98.10	882,891,000	98.87	889,785,000	0.100	2031/03/20	1.90
日本	国債 証券	3 6 3 10年国 債	900,000,000	97.89	880,965,000	98.67	888,066,000	0.100	2031/06/20	1.90

日本	国債証券	158 5年国債	850,000,000	100.15	851,243,000	100.21	851,793,500	0.100	2028/03/20	1.82
日本	国債証券	783 0年国債	760,000,000	102.10	775,972,500	103.47	786,402,400	1.400	2053/03/20	1.68
日本	国債証券	179 20年国債	850,000,000	91.07	774,093,000	92.35	784,975,000	0.500	2041/12/20	1.68
日本	国債証券	164 20年国債	750,000,000	93.97	704,800,000	96.62	724,672,500	0.500	2038/03/20	1.55
日本	国債証券	356 10年国債	720,000,000	99.30	714,960,000	99.85	718,884,000	0.100	2029/09/20	1.53
日本	国債証券	168 20年国債	660,000,000	91.77	605,689,200	94.02	620,551,800	0.400	2039/03/20	1.32
日本	国債証券	154 0年国債	670,000,000	87.49	586,180,300	88.95	595,978,400	1.000	2062/03/20	1.27
日本	国債証券	161 20年国債	570,000,000	97.32	554,715,600	98.73	562,743,900	0.600	2037/06/20	1.20
日本	国債証券	603 0年国債	560,000,000	90.35	505,968,800	94.10	526,965,600	0.900	2048/09/20	1.13
日本	社債券	1 東北 電力劣後 FR	500,000,000	100.56	502,814,400	102.22	511,114,000	1.545	2057/09/14	1.09
日本	社債券	385 北海道電力	500,000,000	100.00	500,000,000	100.48	502,419,500	1.030	2033/05/25	1.07
日本	社債券	448 中国電力	500,000,000	100.00	500,000,000	99.54	497,723,500	0.920	2033/05/25	1.06
日本	国債証券	167 20年国債	490,000,000	93.68	459,013,500	95.81	469,444,500	0.500	2038/12/20	1.00
日本	国債証券	183 20年国債	430,000,000	105.05	451,717,600	107.22	461,028,800	1.400	2042/12/20	0.98
日本	国債証券	155 20年国債	430,000,000	103.90	446,770,000	104.88	450,992,600	1.000	2035/12/20	0.96
日本	国債証券	182 20年国債	430,000,000	95.63	411,209,000	102.11	439,051,500	1.100	2042/09/20	0.94
日本	国債証券	115 20年国債	370,000,000	112.48	416,176,000	113.24	418,973,200	2.200	2029/12/20	0.89
日本	国債証券	157 5年国債	400,000,000	100.26	401,040,000	100.71	402,820,000	0.200	2028/03/20	0.86
日本	社債券	2 東京 センチュ リー劣FR	400,000,000	100.73	402,920,000	100.66	402,640,400	1.380	2080/07/30	0.86

日本	社債 券	1 1 2 住友不動 産	400,000,000	100.00	400,000,000	100.36	401,446,800	0.490	2028/08/09	0.86
日本	社債 券	1 S O M P O H D	400,000,000	100.00	400,000,000	100.00	400,014,800	0.479	2028/04/27	0.85
日本	社債 券	1 2 日 本航空	400,000,000	100.00	400,000,000	98.05	392,218,800	1.200	2033/06/17	0.84
日本	国債 証券	1 5 6 2 0 年国 債	395,000,000	95.63	377,721,200	97.41	384,757,650	0.400	2036/03/20	0.82

## □ 種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	63.34
地方債証券	1.25
特殊債券	2.29
社債券	27.63
合 計	94.51

## インターナショナル株式マザーファンド

### イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2023年6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリ カ	株式	APPLE INC	テクノ ロ ジー・ ハード ウェア および 機器	371,028	22,294.31	8,271,814,907	27,488.65	10,199,060,353	4.82
アメリ カ	株式	AMAZON.COM INC	一般消 費財・ サービ ス流 通・小 売り	540,807	15,542.07	8,405,262,656	18,544.22	10,028,844,526	4.74
アメリ カ	株式	ELI LILLY & CO	医薬 品・バ イオテ クノロ ジー・ ライフ サイエ ンス	139,585	49,401.38	6,895,691,446	67,346.41	9,400,547,955	4.44

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	177,085	38,028.74	6,734,318,830	48,578.90	8,602,594,417	4.06
イギリス	株式	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	金融サービス	465,649	13,711.32	6,384,664,058	15,221.44	7,087,848,314	3.35
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	162,557	27,148.77	4,413,222,370	40,819.03	6,635,419,823	3.13
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	100,230	29,247.34	2,931,461,166	59,187.82	5,932,394,978	2.80
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	322,865	16,221.03	5,237,201,330	15,470.43	4,994,861,350	2.36
スペイン	株式	AMADEUS IT GROUP SA	消費者サービス	417,609	8,151.78	3,404,258,531	10,918.53	4,559,675,559	2.15
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,657,000	2,179.94	3,612,164,215	2,670.98	4,425,817,505	2.09
カナダ	株式	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	運輸	345,345	10,981.93	3,792,556,322	11,502.06	3,972,177,771	1.88
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	253,453	7,421.28	1,880,946,371	15,621.22	3,959,245,731	1.87
香港	株式	AIA GROUP LTD	保険	2,623,400	1,303.71	3,420,155,928	1,474.45	3,868,072,130	1.83
オランダ	株式	FERRARI NV	自動車・自動車部品	82,773	27,877.40	2,307,496,071	46,493.94	3,848,443,168	1.82
オランダ	株式	AIRBUS SE	資本財	185,155	14,531.00	2,690,486,500	20,592.02	3,812,714,722	1.80
アメリカ	株式	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	メディア・娯楽	348,619	8,928.43	3,112,619,900	10,861.20	3,786,420,996	1.79
アメリカ	株式	T-MOBILE US INC	電気通信サービス	180,130	20,151.50	3,629,889,322	19,840.43	3,573,856,944	1.69
ドイツ	株式	SARTORIUS AG-VORZUG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	73,900	56,894.55	4,204,507,022	47,863.12	3,537,084,568	1.67



アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	218,754	11,473.53	2,509,879,826	16,128.69	3,528,214,927	1.67
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	50,629	73,096.85	3,700,820,492	69,079.04	3,497,402,493	1.65
スイス	株式	CHUBB LTD	保険	121,558	31,138.79	3,785,168,968	27,417.61	3,332,829,714	1.57
アメリカ	株式	MORGAN STANLEY	金融サービス	269,347	12,773.38	3,440,470,788	12,358.95	3,328,845,459	1.57
アメリカ	株式	COLGATE-PALMOLIVE CO	家庭用品・パーソナル用品	298,000	11,303.79	3,368,529,794	11,100.43	3,307,929,451	1.56
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CLASS A	メディア・娯楽	187,746	15,403.16	2,891,882,036	17,268.31	3,242,055,941	1.53
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	56,535	46,741.00	2,642,502,235	56,208.27	3,177,734,731	1.50
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	29,571	70,553.92	2,086,350,029	105,339.84	3,115,004,408	1.47
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	1,024,420	2,534.08	2,595,962,932	2,983.55	3,056,405,217	1.44
アメリカ	株式	TRIMBLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	396,119	7,432.77	2,944,263,036	7,651.12	3,030,754,914	1.43
香港	株式	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	資本財	1,903,500	1,543.42	2,937,908,605	1,589.15	3,024,947,025	1.43
アメリカ	株式	SCHWAB (CHARLES) CORP	金融サービス	350,578	8,534.49	2,992,003,513	8,284.73	2,904,443,583	1.37

□ 種別・業種別投資比率

2023年6月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式（外国）	エネルギー	5.89
	素材	2.82
	資本財	5.96
	運輸	2.45
	自動車・自動車部品	2.62

	耐久消費財・アパレル	2.04
	消費者サービス	2.94
	一般消費財・サービス流通・小売り	5.32
	食品・飲料・タバコ	1.12
	家庭用品・パーソナル用品	3.38
	ヘルスケア機器・サービス	3.22
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.11
	銀行	2.75
	金融サービス	8.81
	保険	3.40
	ソフトウェア・サービス	11.61
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.25
	半導体・半導体製造装置	9.36
	電気通信サービス	1.69
	メディア・娯楽	8.83
投資証券	-	0.80
合計		97.37

## インターナショナル債券マザーファンド

### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年6月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8,059,000	14,322.41	1,154,243,149	14,294.42	1,151,987,233	3.875	2027/11/30	16.96
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	4,033,000	14,556.28	587,054,681	14,089.98	568,249,021	3.500	2033/02/15	8.36
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	3,551,000	13,574.11	482,016,603	13,624.13	483,792,868	2.625	2027/05/31	7.12
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	3,430,000	13,671.98	468,948,812	13,762.60	472,057,035	3.125	2029/08/31	6.95
ニュージーランド	国債 証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	3,633,000	8,256.02	299,941,230	8,047.36	292,360,624	3.500	2033/04/14	4.30
ドイツ	国債 証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,890,000	15,277.74	288,749,361	15,091.15	285,222,651	1.000	2025/08/15	4.20
ドイツ	国債 証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,670,000	14,384.31	240,217,970	14,468.00	241,615,519	0.500	2027/08/15	3.56
ドイツ	国債 証券	DEUTSCHLAND I/L BOND	1,170,000	19,002.02	222,323,643	19,061.35	223,017,750	0.100	2026/04/15	3.28
イギリス	国債 証券	TSY 0 1/8% 2026 I/L GILT	838,000	25,569.79	214,274,821	25,519.18	213,850,688	0.125	2026/03/22	3.15
メキシコ	国債 証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	20,604,000	772.20	159,105,010	785.11	161,763,109	7.500	2033/05/26	2.38
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,080,000	13,122.03	141,717,922	13,229.18	142,875,116	2.375	2029/03/31	2.10

イギリス	国債証券	UK GILT	667,000	16,011.97	106,799,819	16,275.41	108,557,017	3.750	2053/10/22	1.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	711,000	14,564.67	103,554,789	14,737.94	104,786,778	4.000	2052/11/15	1.54
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	700,000	14,313.25	100,192,765	14,413.89	100,897,236	0.000	2023/08/10	1.49
シンガポール	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	880,000	9,474.88	83,378,979	9,638.61	84,819,760	1.625	2031/07/01	1.25
イスラエル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND	1,776,000	3,729.11	66,229,079	3,734.80	66,330,058	3.750	2047/03/31	0.98
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	483,000	13,201.84	63,764,871	13,488.67	65,150,270	1.250	2033/04/22	0.96
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	655,000	8,986.82	58,863,702	9,441.82	61,843,894	1.700	2051/09/01	0.91
イギリス	国債証券	UK GILT	1,034,000	5,603.24	57,937,498	5,764.21	59,601,886	0.500	2061/10/22	0.88
ニュージーランド	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	963,000	6,349.05	61,141,316	6,131.31	59,044,516	2.750	2051/05/15	0.87
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	330,000	17,379.66	57,352,862	17,503.06	57,760,084	3.250	2042/07/04	0.85
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,375,000	723.54	53,361,082	762.96	56,268,336	7.750	2042/11/13	0.83
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000	10,112.25	50,561,232	10,430.28	52,151,416	1.900	2052/10/31	0.77
カナダ	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	538,000	8,199.73	44,114,572	8,485.55	45,652,255	2.000	2051/12/01	0.67
オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	785,000	5,755.20	45,178,338	5,706.55	44,796,427	1.750	2051/06/21	0.66
インドネシア	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	290,000	14,281.52	41,416,393	14,412.88	41,797,340	4.550	2028/01/11	0.62
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	230,000	17,701.79	40,714,116	17,534.42	40,329,162	5.500	2028/01/15	0.59
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	266,000	14,334.19	38,128,952	14,433.95	38,394,316	1.400	2028/07/30	0.57
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	240,000	14,272.79	34,254,699	14,310.66	34,345,579	0.000	2023/09/28	0.51
国際機関	特殊債券	ASIAN DEVELOPMENT BANK	193,000	18,115.34	34,962,612	17,518.56	33,810,821	3.875	2026/02/10	0.50

□ 種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	84.78
地方債証券	0.35
特殊債券	4.49
社債券	3.08
合計	92.70

## 投資不動産物件

年金日本株式マザーファンド

該当事項はありません。

年金日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

インターナショナル株式マザーファンド

該当事項はありません。

インターナショナル債券マザーファンド

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

年金日本株式マザーファンド

該当事項はありません。

年金日本債券マザーファンド

2023年6月30日現在

種類	国/ 地域	取引所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
債券先物 取引	日本	大阪取引 所	長国 先 0.5 09月 202 3年9月	買建	14	日本・円	2,073,841,560	2,079,700,000	4.44

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

インターナショナル株式マザーファンド

2023年6月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	6,112,455.28	883,100,000	885,749,425	0.42
	スウェーデン・クローナ	買建	819,661.88	10,910,942	10,946,747	0.01
	アメリカ・ドル	売建	75,586.72	10,910,942	10,954,344	0.01

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

インターナショナル債券マザーファンド

2023年6月30日現在

種類	国/ 地域	取引 所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
債券先物 取引	ドイツ	EU RE X	EURO - SCH ATZ FUT SEP 2 3 2023年 9月	買建	5	ユーロ	527,530.00	83,138,728	524,425.00	82,649,380	1.22

ドイツ	EU RE X	EURO - BOB L FU TUR E SE P 23 2023年9月	買建	57	ユーロ	6,651,389.85	1,048,259,040	6,596,040.00	1,039,535,904	15.30
ドイツ	EU RE X	EURO - BUN D FU TUR E SE P 23 2023年9月	買建	6	ユーロ	798,832.62	125,896,020	801,840.00	126,369,984	1.86
カナダ	モン トリ オール	CAN 10Y R BO ND F UT S EP 23 2023年9月	買建	7	カナ ダ・ド ル	865,354.14	94,617,821	850,990.00	93,047,246	1.37
アメリカ	シカ ゴ取 引所	US 5 YR N OTE (CB T) S EP 23 2023年9月	買建	36	アメリ カ・ド ル	3,928,882.68	569,648,699	3,855,375.00	558,990,821	8.23
アメリカ	シカ ゴ取 引所	US 1 0YR NOT E (C BT) SEP 2 3 2023年 9月	買建	18	アメリ カ・ド ル	2,052,189.60	297,546,970	2,018,250.00	292,626,067	4.31
アメリカ	シカ ゴ取 引所	US L ONG BOND (CB T) S EP 23 2023年9月	買建	16	アメリ カ・ド ル	2,029,897.76	294,314,876	2,018,500.00	292,662,315	4.31
アメリカ	シカ ゴ取 引所	US 1 0yr Ultr a Fu t SE P 23 2023年9月	買建	24	アメリ カ・ド ル	2,876,854.32	417,115,107	2,835,375.12	411,101,038	6.05
オーストラリア	シド ニー 先物 取引	AUS T 10 Y BO ND F	買建	9	オース トラリ ア・ド ル	1,050,090.39	100,567,156	1,055,676.60	101,102,147	1.49

所	UT S EP 23 2023年9月									
イギリス	ICE - EU	LONDON GILTF UTUR ESEP 23 2023年9月	売建	22	イギリス・ポンド	2,091,327.33	382,608,335	2,104,080.00	384,941,436	5.67
ドイツ	EU REX	EURO BOU XL 3 OY B ND S EP 23 2023年9月	売建	6	ユーロ	816,865.68	128,738,031	833,040.00	131,287,104	1.93
イタリア	EU REX	EURO - BT P FU TUR E SEP 23 2023年9月	売建	1	ユーロ	114,329.35	18,018,305	116,080.00	18,294,208	0.27
アメリカ	シカゴ取引所	US 2 YRN OTE (CB T) S EP 23 2023年9月	売建	53	アメリカ・ドル	10,929,011.08	1,584,597,316	10,778,875.00	1,562,829,086	23.00

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2023年6月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	22,337,012.51	3,025,705,306	3,227,458,604	47.51
	ユーロ	買建	7,732,291.53	1,151,155,546	1,216,239,190	17.90
	イギリス・ポンド	買建	2,809,096.39	497,358,436	512,514,976	7.54
	オフショア・人民元	買建	18,662,016.75	363,698,060	370,812,405	5.46
	カナダ・ドル	買建	2,295,897.24	232,704,944	250,386,188	3.69
	ハンガリー・フォリント	買建	371,829,100.00	148,417,239	156,426,641	2.30
	イスラエル・シェケル	買建	2,564,000.00	94,393,692	100,194,197	1.47
	ニュージーランド・ドル	買建	588,900.00	49,389,567	51,589,170	0.76
	スウェーデン・クローナ	買建	3,546,336.85	46,187,296	47,270,541	0.70
	ノルウェー・クローネ	買建	3,412,000.00	43,902,165	45,561,459	0.67
	オーストラリア・ドル	買建	385,000.00	37,266,111	36,655,080	0.54
	ポーランド・ズロチ	買建	957,000.00	30,877,945	33,565,626	0.49
メキシコ・ペソ	買建	3,021,078.13	24,374,818	25,391,555	0.37	

マレーシア・リングギット	買建	609,851.01	18,543,050	18,842,017	0.28
タイ・バーツ	買建	4,224,509.60	17,155,007	17,151,508	0.25
アメリカ・ドル	売建	22,066,623.07	3,007,151,143	3,188,009,564	46.93
イギリス・ポンド	売建	3,590,379.52	603,634,170	655,055,406	9.64
ニュージーランド・ドル	売建	5,635,242.57	471,678,496	493,661,899	7.27
メキシコ・ペソ	売建	34,187,061.37	259,110,504	287,335,412	4.23
ユーロ	売建	1,643,948.44	244,008,409	258,583,469	3.81
オフショア・人民元	売建	10,106,000.00	197,952,385	200,805,208	2.96
ハンガリー・フォリント	売建	371,829,100.00	147,504,082	156,426,641	2.30
イスラエル・シケル	売建	3,702,453.49	136,117,740	144,681,885	2.13
カナダ・ドル	売建	970,000.00	99,182,500	105,786,357	1.56
スイス・フラン	売建	435,000.00	62,004,900	70,048,311	1.03
スウェーデン・クローナ	売建	5,059,000.00	66,335,840	67,433,433	0.99
タイ・バーツ	売建	15,805,819.47	63,302,036	64,171,627	0.94
オーストラリア・ドル	売建	667,000.00	60,755,670	63,503,736	0.93
シンガポール・ドル	売建	518,027.67	52,677,204	55,080,482	0.81
ノルウェー・クローネ	売建	2,570,000.00	34,155,300	34,317,981	0.51
デンマーク・クローネ	売建	304,000.00	6,019,200	6,404,672	0.09

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 参考情報

基準日:2023年6月30日

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

## 基準価額・純資産の推移

### ■年金設計30

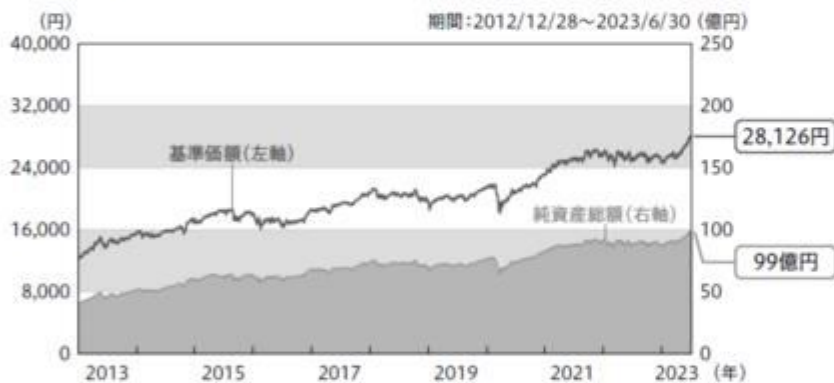


## 分配の推移

決算期	分配金
2022年11月	0円
2021年11月	0円
2020年11月	0円
2019年11月	0円
2018年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

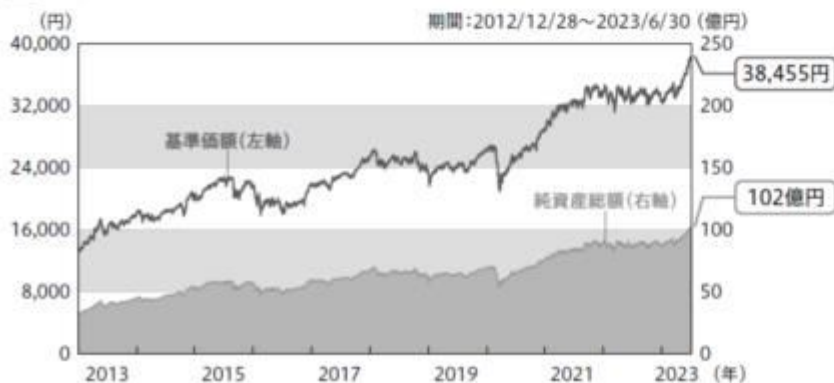
### ■年金設計50



決算期	分配金
2022年11月	0円
2021年11月	0円
2020年11月	0円
2019年11月	0円
2018年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

### ■年金設計70



決算期	分配金
2022年11月	0円
2021年11月	0円
2020年11月	0円
2019年11月	0円
2018年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

※基準価額は、1万円当たり、信託報酬控除後です。



## 主要な資産の状況

### ■年金設計30

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.16
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	年金日本債券マザーファンド	57.30
日本	親投資信託受益証券	年金日本株式マザーファンド	27.28
日本	親投資信託受益証券	インターナショナル債券マザーファンド	10.14
日本	親投資信託受益証券	インターナショナル株式マザーファンド	5.43

### ■年金設計50

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.12
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	年金日本株式マザーファンド	38.06
日本	親投資信託受益証券	年金日本債券マザーファンド	36.03
日本	親投資信託受益証券	インターナショナル株式マザーファンド	16.38
日本	親投資信託受益証券	インターナショナル債券マザーファンド	9.65

### ■年金設計70

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.16
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	年金日本株式マザーファンド	50.24
日本	親投資信託受益証券	インターナショナル株式マザーファンド	20.48
日本	親投資信託受益証券	年金日本債券マザーファンド	19.40
日本	親投資信託受益証券	インターナショナル債券マザーファンド	10.03

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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

## □年金日本株式マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.44
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7.60
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4.26
日本	株式	小松製作所	機械	3.79
日本	株式	TDK	電気機器	3.64
日本	株式	豊田自動織機	輸送用機器	3.26
日本	株式	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	3.09
日本	株式	富士電機	電気機器	2.99
日本	株式	スズキ	輸送用機器	2.75
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.43
日本	株式	BIPROGY	情報・通信業	2.41

## □年金日本債券マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	63.34
社債券	日本	27.63
特殊債券	日本	2.29
地方債証券	日本	1.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5.49
合計(純資産総額)		100.00

※債券先物取引の買建て 4.44%

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	449 2年国債	0.005	2025/06/01	14.99
日本	国債証券	447 2年国債	0.005	2025/04/01	5.99
日本	国債証券	149 20年国債	1.500	2034/06/20	2.34
日本	国債証券	370 10年国債	0.500	2033/03/20	2.26
日本	国債証券	184 20年国債	1.100	2043/03/20	2.19
日本	国債証券	362 10年国債	0.100	2031/03/20	1.90
日本	国債証券	363 10年国債	0.100	2031/06/20	1.90
日本	国債証券	158 5年国債	0.100	2028/03/20	1.82
日本	国債証券	78 30年国債	1.400	2053/03/20	1.68
日本	国債証券	179 20年国債	0.500	2041/12/20	1.68

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## □国際証券株式マザーファンド

### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	62.07
	オランダ	5.79
	イギリス	4.21
	カナダ	3.64
	ドイツ	3.40
	香港	3.25
	その他	14.20
投資証券	イギリス	0.80
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.63
合計(純資産総額)		100.00

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.82
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	4.74
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4.44
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.06
イギリス	株式	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	金融サービス	3.35
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	3.13
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	2.80
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	2.36
スペイン	株式	AMADEUS IT GROUP SA	消費者サービス	2.15
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2.09

## □国際証券債券マザーファンド

### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	45.03
	ドイツ	12.01
	イギリス	5.62
	ニュージーランド	5.17
	その他	16.95
特殊債券	国際機関・その他	4.49
社債券	ケイマン諸島・その他	3.08
地方債証券	カナダ	0.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7.30
合計(純資産総額)		100.00

※債券先物取引の買建て 44.13%  
債券先物取引の売建て △30.87%

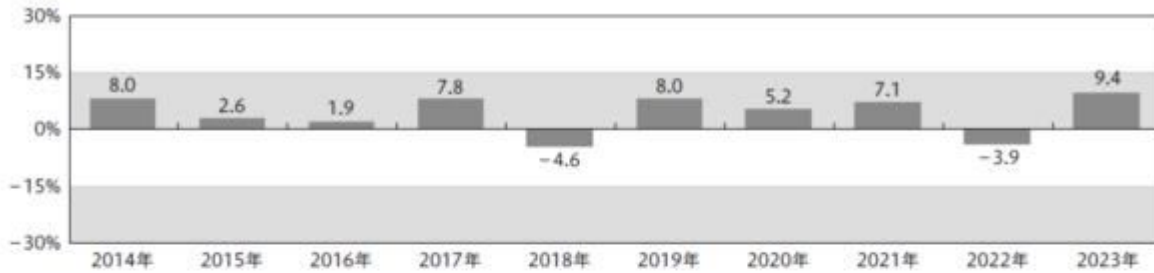
### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.875	2027/11/30	16.96
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2033/02/15	8.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2027/05/31	7.12
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2029/08/31	6.95
ニュージーランド	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.500	2033/04/14	4.30
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.000	2025/08/15	4.20
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.500	2027/08/15	3.56
ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND I/L BOND	0.100	2026/04/15	3.28
イギリス	国債証券	TSY 0 1/8% 2026 I/L GILT	0.125	2026/03/22	3.15
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.500	2033/05/26	2.38

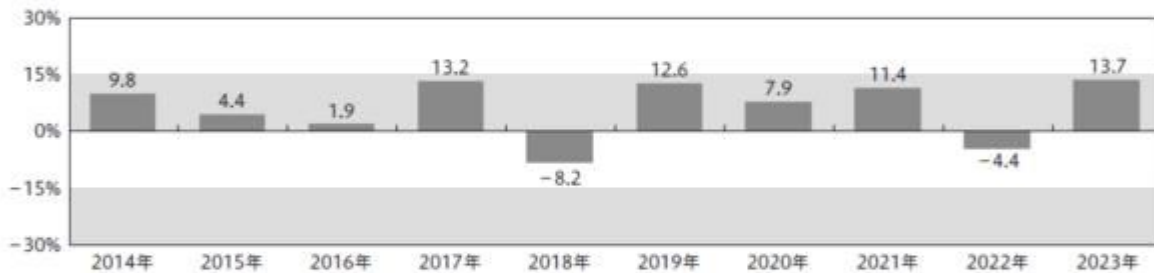
※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)

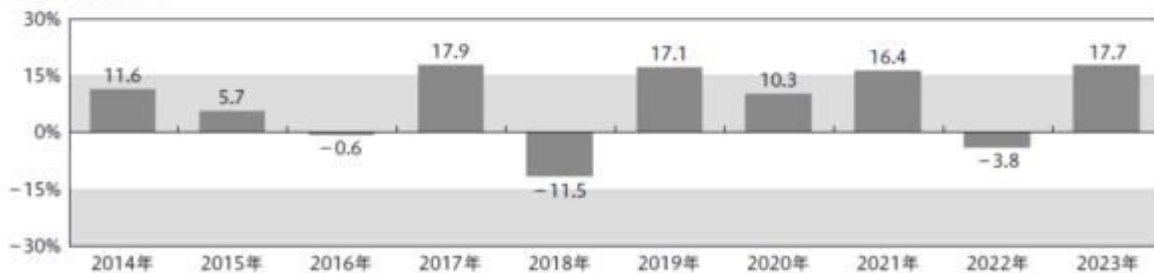
### ■年金設計30



### ■年金設計50



### ■年金設計70



※収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

※2023年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ファンドにはベンチマークはありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### イ 申込方法

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

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

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

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

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

ありません。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### イ 基準価額の算出方法

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

<主要投資対象の評価方法>

主要投資対象	有価証券等の評価方法
株式、投資証券、債券等	(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の最終相場で評価します。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 原則として、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、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ます。
市場デリバティブ取引	原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の発表する清算値段または最終相場で評価します。

国内で取引される資産については原則として基準価額計算日の値、外国で取引される資産については原則として基準価額計算日に知りうる直近の日の値で評価します。

##### ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「年金設計30」は「大住DC30」、「年金設計50」は「大住DC50」、「年金設計70」は「大住DC70」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

#### (2)【保管】

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

#### (3)【信託期間】

2001年9月21日から下記「(5)その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

#### (4) 【計算期間】

毎年11月20日から翌年11月19日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

#### (5) 【その他】

##### イ 信託の終了

##### (イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、各ファンドの純資産総額が30億円を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 上記bの公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記cの一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、信託契約の解約をしません。
- e. 委託会社は、当ファンドの信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- f. 上記c～eまでの取扱いは、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記cの一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

##### (ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

##### (ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

##### (ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないとき、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

##### ロ 収益分配金、償還金の支払い

##### (イ) 収益分配金

- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。委託会社の判

断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

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

#### (ロ) 償還金

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

### 八 信託約款の変更

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- (ハ) 上記(ロ)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (ニ) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、(イ)の信託約款の変更をしません。
- (ホ) 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

### 二 反対者の買取請求権

当ファンドの信託契約の解約または重大な信託約款の変更が行われる場合において、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間内に委託会社に異議を述べた受益者は、自己に帰属する受益権を、受託会社に信託財産をもって買い取るよう請求をすることができます。

### ホ 販売会社との契約の更改等

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

### へ 投資顧問会社(運用の委託先)との契約の更改等

委託会社と投資顧問会社との間の運用委託契約には期限の定めがありません。投資一任契約の内容は、必要に応じて、委託会社と投資顧問会社との合意により変更されることがあります。

### ト 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い



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

#### チ 公告

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

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

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

#### リ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

### 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

#### イ 分配金請求権

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

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

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

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

#### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

#### ハ 一部解約実行請求権

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

#### ニ 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。)または重大な信託約款の変更を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に関する異議のある受益者は、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間中に異議を申し立てることができます。

す。異議を申し立てた受益者の受益権の口数が、受益権の総口数の過半数となるときは、当該解約または信託約款変更は行われません。

当該解約または信託約款変更が行われる場合において、前述の異議を申し立てた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期(2021年11月20日から2022年11月21日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【大和住銀DC年金設計ファンド30】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第20期 (2021年11月19日現在)	第21期 (2022年11月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	62,980	33,875
コール・ローン	1,255,706	824,868
親投資信託受益証券	4,117,574,910	3,978,453,197
未収入金	21,073,234	20,503,760
流動資産合計	4,139,966,830	3,999,815,700
資産合計	4,139,966,830	3,999,815,700
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,587,160	370,102
未払受託者報酬	1,791,542	1,789,056
未払委託者報酬	18,363,630	18,338,144
その他未払費用	348,283	355,411
流動負債合計	22,090,615	20,852,713
負債合計	22,090,615	20,852,713
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,097,493,885	2,069,385,906
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,020,382,330	1,909,577,081
(分配準備積立金)	1,057,425,350	957,122,308
元本等合計	4,117,876,215	3,978,962,987
純資産合計	4,117,876,215	3,978,962,987
負債純資産合計	4,139,966,830	3,999,815,700

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第20期		第21期	
	自	2020年11月20日	自	2021年11月20日
	至	2021年11月19日	至	2022年11月21日
営業収益				
受取利息		43		31
有価証券売買等損益		417,410,268		45,144,391
営業収益合計		417,410,311		45,144,360
営業費用				
支払利息		454		327
受託者報酬		3,484,681		3,555,860
委託者報酬		35,718,648		36,448,265
その他費用		348,283		355,415
営業費用合計		39,552,066		40,359,867
営業利益又は営業損失( )		377,858,245		85,504,227
経常利益又は経常損失( )		377,858,245		85,504,227
当期純利益又は当期純損失( )		377,858,245		85,504,227
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		21,407,418		8,426,416
期首剰余金又は期首欠損金( )		1,634,619,952		2,020,382,330
剰余金増加額又は欠損金減少額		193,799,889		166,329,773
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		193,799,889		166,329,773
剰余金減少額又は欠損金増加額		164,488,338		200,057,211
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		164,488,338		200,057,211
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		2,020,382,330		1,909,577,081

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第21期	
	自 2021年11月20日 至 2022年11月21日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、2021年11月20日から2022年11月21日までとなっております。</p>	

## ( 重要な会計上の見積りに関する注記 )

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第20期	第21期
	( 2021年11月19日現在 )	( 2022年11月21日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,097,493,885口	2,069,385,906口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9632円 ( 1万口当たりの純資産額19,632円 )	1口当たり純資産額 1.9228円 ( 1万口当たりの純資産額19,228円 )

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第20期	第21期
	自 2020年11月20日 至 2021年11月19日	自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
1. 委託者報酬	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 2,508,320円	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 2,479,285円

2. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（356,451,081円）、収益調整金（962,957,390円）、および分配準備積立金（700,974,269円）より、分配対象収益は2,020,382,740円（1万口当たり9,632.37円）であります、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（952,455,453円）、および分配準備積立金（957,122,308円）より、分配対象収益は1,909,577,761円（1万口当たり9,227.75円）であります、分配を行っておりません。
-------------	---	---

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項 目	第21期 自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第21期 (2022年11月21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（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>

#### （有価証券に関する注記）

##### 売買目的有価証券

第20期（自 2020年11月20日 至 2021年11月19日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	367,835,667円



合計	367,835,667円
----	--------------

## 第21期(自2021年11月20日 至 2022年11月21日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	39,233,393円
合計	39,233,393円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第21期 自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項目	第20期 (2021年11月19日現在)	第21期 (2022年11月21日現在)
期首元本額	2,088,646,153円	2,097,493,885円
期中追加設定元本額	217,980,831円	179,913,990円
期中一部解約元本額	209,133,099円	208,021,969円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	インターナショナル債券マザーファンド	132,676,671	402,912,514	
	年金日本株式マザーファンド	328,596,774	1,160,406,647	
	年金日本債券マザーファンド	1,785,326,422	2,224,873,787	
	インターナショナル株式マザーファンド	23,863,967	190,260,249	
	親投資信託受益証券 小計		3,978,453,197	
合計			3,978,453,197	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【大和住銀DC年金設計ファンド50】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第20期 (2021年11月19日現在)	第21期 (2022年11月21日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	133,998	78,456
コール・ローン	2,671,697	1,910,409
親投資信託受益証券	9,182,835,674	8,970,351,656
未収入金	56,265,926	55,732,957
<b>流動資産合計</b>	<b>9,241,907,295</b>	<b>9,028,073,478</b>
<b>資産合計</b>	<b>9,241,907,295</b>	<b>9,028,073,478</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	4,935,131	616,422
未払受託者報酬	3,949,730	3,991,444
未払委託者報酬	50,359,681	50,891,425
その他未払費用	763,881	790,298
<b>流動負債合計</b>	<b>60,008,423</b>	<b>56,289,589</b>
<b>負債合計</b>	<b>60,008,423</b>	<b>56,289,589</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	3,501,023,322	3,511,512,457
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	5,680,875,550	5,460,271,432
(分配準備積立金)	3,395,126,427	3,155,179,500
<b>元本等合計</b>	<b>9,181,898,872</b>	<b>8,971,783,889</b>
<b>純資産合計</b>	<b>9,181,898,872</b>	<b>8,971,783,889</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>9,241,907,295</b>	<b>9,028,073,478</b>

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第20期		第21期	
	自	2020年11月20日 至 2021年11月19日	自	2021年11月20日 至 2022年11月21日
営業収益				
受取利息		127		50
有価証券売買等損益		1,434,175,332		126,803,744
営業収益合計		1,434,175,459		126,803,694
営業費用				
支払利息		1,037		1,058
受託者報酬		7,640,587		7,904,913
委託者報酬		97,418,679		100,788,561
その他費用		763,882		790,309
営業費用合計		105,824,185		109,484,841
営業利益又は営業損失( )		1,328,351,274		236,288,535
経常利益又は経常損失( )		1,328,351,274		236,288,535
当期純利益又は当期純損失( )		1,328,351,274		236,288,535
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		69,498,242		19,131,091
期首剰余金又は期首欠損金( )		4,432,739,782		5,680,875,550
剰余金増加額又は欠損金減少額		413,718,605		412,949,914
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		413,718,605		412,949,914
剰余金減少額又は欠損金増加額		424,435,869		416,396,588
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		424,435,869		416,396,588
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		5,680,875,550		5,460,271,432

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第21期 自 2021年11月20日 至 2022年11月21日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、2021年11月20日から2022年11月21日までとなっております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第20期 (2021年11月19日現在)	第21期 (2022年11月21日現在)
	1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,501,023,322口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6226円 (1万口当たりの純資産額26,226円)	1口当たり純資産額 2.5550円 (1万口当たりの純資産額25,550円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第20期 自 2020年11月20日 至 2021年11月19日	第21期 自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
	1. 委託者報酬	<p>委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用</p> <p style="text-align: right;">10,191,108円</p>

2. 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,258,853,744円)、収益調整金(2,285,750,027円)、および分配準備積立金(2,136,272,683円)より、分配対象収益は5,680,876,454円(1万口当たり16,226.33円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(2,417,905,345円)、および分配準備積立金(3,155,179,500円)より、分配対象収益は5,573,084,845円(1万口当たり15,870.90円)であります。分配を行っておりません。</p>
-------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	<p style="text-align: center;">第21期 自 2021年11月20日 至 2022年11月21日</p>
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかると、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第21期 (2022年11月21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（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>

#### （有価証券に関する注記）

##### 売買目的有価証券

第20期（自 2020年11月20日 至 2021年11月19日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,309,166,585円

合計	1,309,166,585円
----	----------------

## 第21期(自2021年11月20日 至 2022年11月21日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	135,942,347円
合計	135,942,347円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第21期 自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項目	第20期 (2021年11月19日現在)	第21期 (2022年11月21日現在)
期首元本額	3,558,022,196円	3,501,023,322円
期中追加設定元本額	282,153,008円	267,539,496円
期中一部解約元本額	339,151,882円	257,050,361円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	インターナショナル債券マザーファンド	301,070,606	914,291,216	
	年金日本株式マザーファンド	891,058,143	3,146,682,726	
	年金日本債券マザーファンド	2,842,282,044	3,542,051,883	
	インターナショナル株式マザーファンド	171,500,976	1,367,325,831	
	親投資信託受益証券 小計		8,970,351,656	
合計			8,970,351,656	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【大和住銀DC年金設計ファンド70】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第20期 (2021年11月19日現在)	第21期 (2022年11月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	222,734	60,085
コール・ローン	4,440,952	1,463,085
親投資信託受益証券	9,072,232,537	9,006,523,826
未収入金	62,928,305	65,255,088
流動資産合計	9,139,824,528	9,073,302,084
資産合計	9,139,824,528	9,073,302,084
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,763,037	167,434
未払受託者報酬	3,825,287	3,963,165
未払委託者報酬	58,336,495	60,438,843
その他未払費用	727,530	782,385
流動負債合計	66,652,349	65,351,827
負債合計	66,652,349	65,351,827
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,626,258,885	2,661,286,428
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	6,446,913,294	6,346,663,829
(分配準備積立金)	3,615,548,035	3,266,714,874
元本等合計	9,073,172,179	9,007,950,257
純資産合計	9,073,172,179	9,007,950,257
負債純資産合計	9,139,824,528	9,073,302,084



## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第20期		第21期	
	自	2020年11月20日	自	2021年11月20日
	至	2021年11月19日	至	2022年11月21日
営業収益				
受取利息		102		84
有価証券売買等損益		1,841,723,728		56,841,471
営業収益合計		1,841,723,830		56,841,387
営業費用				
支払利息		1,826		1,595
受託者報酬		7,277,000		7,825,577
委託者報酬		110,975,899		119,341,436
その他費用		727,541		782,417
営業費用合計		118,982,266		127,951,025
営業利益又は営業損失( )		1,722,741,564		184,792,412
経常利益又は経常損失( )		1,722,741,564		184,792,412
当期純利益又は当期純損失( )		1,722,741,564		184,792,412
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		111,702,583		29,946,900
期首剰余金又は期首欠損金( )		4,685,698,681		6,446,913,294
剰余金増加額又は欠損金減少額		743,713,551		710,837,842
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		743,713,551		710,837,842
剰余金減少額又は欠損金増加額		593,537,919		656,241,795
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		593,537,919		656,241,795
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		6,446,913,294		6,346,663,829

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第21期	
	自 2021年11月20日 至 2022年11月21日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、2021年11月20日から2022年11月21日までとなっております。</p>	

## ( 重要な会計上の見積りに関する注記 )

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第20期	第21期
	( 2021年11月19日現在 )	( 2022年11月21日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,626,258,885口	2,661,286,428口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.4548円 ( 1万口当たりの純資産額34,548円 )	1口当たり純資産額 3.3848円 ( 1万口当たりの純資産額33,848円 )

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第20期	第21期
	自 2020年11月20日 至 2021年11月19日	自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
1. 委託者報酬	<p>委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用</p> <p style="text-align: right;">12,295,185円</p>	<p>委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用</p> <p style="text-align: right;">11,748,396円</p>

2. 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,611,040,337円)、収益調整金(2,831,366,933円)、および分配準備積立金(2,004,507,698円)より、分配対象収益は6,446,914,968円(1万口当たり24,547.90円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(3,079,951,943円)、および分配準備積立金(3,266,714,874円)より、分配対象収益は6,346,666,817円(1万口当たり23,848.12円)であります。分配を行っておりません。</p>
-------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	<p style="text-align: center;">第21期 自 2021年11月20日 至 2022年11月21日</p>
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかると、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第21期 (2022年11月21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（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>

#### （有価証券に関する注記）

##### 売買目的有価証券

第20期（自 2020年11月20日 至 2021年11月19日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,615,324,922円

合計	1,615,324,922円
----	----------------

## 第21期(自2021年11月20日 至 2022年11月21日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	39,099,000円
合計	39,099,000円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第21期 自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項目	第20期 (2021年11月19日現在)	第21期 (2022年11月21日現在)
期首元本額	2,614,299,919円	2,626,258,885円
期中追加設定元本額	340,307,488円	302,998,070円
期中一部解約元本額	328,348,522円	267,970,527円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	インターナショナル債券マザーファンド	302,588,405	918,900,468	
	年金日本株式マザーファンド	1,343,664,986	4,745,018,531	
	年金日本債券マザーファンド	1,387,879,789	1,729,575,793	
	インターナショナル株式マザーファンド	202,319,043	1,613,029,034	
	親投資信託受益証券 小計		9,006,523,826	
合計			9,006,523,826	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

「大和住銀DC年金設計ファンド30」、「大和住銀DC年金設計ファンド50」および「大和住銀DC年金設計ファンド70」は、「年金日本株式マザーファンド」、「年金日本債券マザーファンド」、「インターナショナル株式マザーファンド」および「インターナショナル債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 年金日本株式マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年11月19日現在)	(2022年11月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	44,867,246	38,723,843
コール・ローン	894,577,969	942,931,348
株式	78,586,180,200	86,813,630,550
未収入金	238,492,470	-
未収配当金	858,297,150	974,719,800
流動資産合計	80,622,415,035	88,770,005,541
資産合計	80,622,415,035	88,770,005,541
負債の部		
流動負債		
未払金	234,216,298	-
未払解約金	232,318,496	246,156,431
その他未払費用	3,704	1,853
流動負債合計	466,538,498	246,158,284
負債合計	466,538,498	246,158,284
純資産の部		
元本等		
元本	23,972,293,045	25,067,881,054
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	56,183,583,492	63,455,966,203
元本等合計	80,155,876,537	88,523,847,257
純資産合計	80,155,876,537	88,523,847,257
負債純資産合計	80,622,415,035	88,770,005,541

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。  (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

	<p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2021年11月19日現在）	（2022年11月21日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	23,972,293,045口	25,067,881,054口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.3437円 （1万口当たりの純資産額33,437円）	1口当たり純資産額 3.5314円 （1万口当たりの純資産額35,314円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかると、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年11月21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） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

#### （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

#### （関連当事者との取引に関する注記）

自 2021年11月20日

至 2022年11月21日



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

## (その他の注記)

(2021年11月19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	24,552,308,310円
同期中における追加設定元本額	1,679,419,243円
同期中における一部解約元本額	2,259,434,508円
2021年11月19日現在の元本の内訳	
大和住銀DC日本株式ファンド	7,787,577,592円
大和住銀DC年金設計ファンド30	335,530,950円
大和住銀DC年金設計ファンド50	1,033,476,837円
大和住銀DC年金設計ファンド70	1,344,741,536円
大和住銀DC国内株式ファンド	7,442,116,547円
大和住銀年金専用日本株式F-1(適格機関投資家限定)	5,105,888,169円
大和住銀日本株式ファンドVA(適格機関投資家限定)	773,336,304円
大和住銀年金設計ファンド30VA(適格機関投資家専用)	1,484,472円
大和住銀年金設計ファンド50VA(適格機関投資家専用)	10,446,251円
大和住銀年金設計ファンド70VA(適格機関投資家専用)	4,365,709円
大和住銀バランスファンド60(適格機関投資家限定)	131,153,273円
大和住銀世界資産バランスVA(適格機関投資家限定)	2,175,405円
合計	23,972,293,045円

(2022年11月21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	23,972,293,045円
同期中における追加設定元本額	2,426,617,850円
同期中における一部解約元本額	1,331,029,841円
2022年11月21日現在の元本の内訳	
大和住銀DC日本株式ファンド	7,897,881,921円
大和住銀DC年金設計ファンド30	328,596,774円
大和住銀DC年金設計ファンド50	891,058,143円
大和住銀DC年金設計ファンド70	1,343,664,986円
大和住銀DC国内株式ファンド	8,669,487,968円
大和住銀年金専用日本株式F-1(適格機関投資家限定)	5,112,019,166円
大和住銀日本株式ファンドVA(適格機関投資家限定)	695,544,580円
大和住銀年金設計ファンド30VA(適格機関投資家専用)	910,093円
大和住銀年金設計ファンド50VA(適格機関投資家専用)	10,351,051円
大和住銀年金設計ファンド70VA(適格機関投資家専用)	5,045,107円
大和住銀バランスファンド60(適格機関投資家限定)	112,078,647円
大和住銀世界資産バランスVA(適格機関投資家限定)	1,242,618円
合計	25,067,881,054円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
INPEX	864,600	1,506.000	1,302,087,600	
長谷工コーポレーション	575,300	1,505.000	865,826,500	
住友林業	35,900	2,332.000	83,718,800	
アサヒグループホールディングス	103,000	4,304.000	443,312,000	
宝ホールディングス	223,600	1,052.000	235,227,200	
日清オイリオグループ	121,700	3,275.000	398,567,500	
ニチレイ	335,900	2,779.000	933,466,100	
東洋水産	207,200	5,610.000	1,162,392,000	
東洋紡	136,600	1,031.000	140,834,600	
セーレン	628,300	2,587.000	1,625,412,100	
三菱瓦斯化学	369,800	1,942.000	718,151,600	
ダイセル	200,400	983.000	196,993,200	
ADEKA	437,400	2,219.000	970,590,600	
アステラス製薬	747,700	2,104.500	1,573,534,650	
日本新薬	141,900	8,520.000	1,208,988,000	
TOYO TIRE	203,300	1,533.000	311,658,900	
AGC	92,900	4,550.000	422,695,000	
JFEホールディングス	638,700	1,494.000	954,217,800	
三井金属鉱業	141,800	3,140.000	445,252,000	
三和ホールディングス	793,400	1,267.000	1,005,237,800	
DMG森精機	420,600	1,843.000	775,165,800	
小松製作所	986,800	3,098.000	3,057,106,400	
住友重機械工業	192,100	2,860.000	549,406,000	
ミネベアミツミ	181,800	2,214.000	402,505,200	
日立製作所	129,600	7,297.000	945,691,200	
富士電機	363,700	5,870.000	2,134,919,000	
日本電気	75,000	4,865.000	364,875,000	
富士通	128,800	18,530.000	2,386,664,000	
ルネサスエレクトロニクス	1,042,700	1,384.500	1,443,618,150	
ソニーグループ	297,800	11,255.000	3,351,739,000	
TDK	738,900	4,945.000	3,653,860,500	
ローム	48,800	10,790.000	526,552,000	
太陽誘電	153,700	4,395.000	675,511,500	
村田製作所	101,600	7,640.000	776,224,000	
豊田自動織機	397,000	7,690.000	3,052,930,000	
トヨタ自動車	1,290,200	2,003.000	2,584,270,600	
太平洋工業	229,100	1,063.000	243,533,300	
スズキ	402,600	5,048.000	2,032,324,800	
SUBARU	796,600	2,310.000	1,840,146,000	
ヤマハ発動機	597,200	3,395.000	2,027,494,000	
理研計器	84,000	5,070.000	425,880,000	

バンダイナムコホールディングス	138,000	8,855.000	1,221,990,000
フジシールインターナショナル	145,600	1,816.000	264,409,600
丸全昭和運輸	46,400	3,200.000	148,480,000
S Gホールディングス	728,200	2,044.000	1,488,440,800
商船三井	102,800	3,080.000	316,624,000
東映アニメーション	30,000	13,930.000	417,900,000
ネットワンシステムズ	155,900	3,575.000	557,342,500
B I P R O G Y	753,700	3,185.000	2,400,534,500
日本電信電話	1,425,600	3,843.000	5,478,580,800
東映	87,200	17,930.000	1,563,496,000
双日	390,600	2,417.000	944,080,200
ハピネット	41,300	1,833.000	75,702,900
伊藤忠商事	240,600	4,210.000	1,012,926,000
丸紅	938,400	1,494.500	1,402,438,800
三井物産	558,100	3,843.000	2,144,778,300
イエローハット	122,300	1,714.000	209,622,200
良品計画	205,300	1,451.000	297,890,300
ケーズホールディングス	345,500	1,120.000	386,960,000
サンドラッグ	89,400	3,720.000	332,568,000
北國フィナンシャルホールディングス	251,000	4,220.000	1,059,220,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,242,500	719.700	4,492,727,250
七十七銀行	155,000	1,805.000	279,775,000
かんぽ生命保険	228,400	2,197.000	501,794,800
S O M P Oホールディングス	138,400	5,631.000	779,330,400
第一生命ホールディングス	1,365,900	2,369.000	3,235,817,100
イオンフィナンシャルサービス	200,200	1,445.000	289,289,000
オリックス	258,000	2,162.000	557,796,000
野村不動産ホールディングス	359,700	3,225.000	1,160,032,500
三井不動産	289,000	2,671.000	771,919,000
東京建物	855,700	1,924.000	1,646,366,800
アウトソーシング	92,200	1,023.000	94,320,600
日本郵政	2,009,800	1,058.000	2,126,368,400
ベルシステム24ホールディングス	692,300	1,308.000	905,528,400
合 計	35,341,000		86,813,630,550

## (b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 年金日本債券マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年11月19日現在)	(2022年11月21日現在)
資産の部		
流動資産		

金銭信託	14,733,437	31,164,866
コール・ローン	293,760,131	758,869,139
国債証券	16,184,282,738	17,694,781,082
地方債証券	502,632,300	582,030,900
特殊債券	953,728,620	691,968,450
社債券	6,418,008,400	4,915,578,500
派生商品評価勘定	288,460	3,273,840
未収入金	200,298,000	617,844,600
未収利息	30,721,021	34,855,667
前払費用	2,173,692	4,535,016
差入委託証拠金	660,000	5,760,000
流動資産合計	24,601,286,799	25,340,662,060
資産合計	24,601,286,799	25,340,662,060
負債の部		
流動負債		
前受金	200,000	3,160,000
未払金	200,818,000	620,450,000
未払解約金	52,450,466	53,920,715
その他未払費用	5,194	1,818
流動負債合計	253,473,660	677,532,533
負債合計	253,473,660	677,532,533
純資産の部		
元本等		
元本	18,864,868,587	19,790,060,156
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	5,482,944,552	4,873,069,371
元本等合計	24,347,813,139	24,663,129,527
純資産合計	24,347,813,139	24,663,129,527
負債純資産合計	24,601,286,799	25,340,662,060

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

	(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月19日現在)	(2022年11月21日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	18,864,868,587口	19,790,060,156口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2906円 (1万口当たりの純資産額12,906円)	1口当たり純資産額 1.2462円 (1万口当たりの純資産額12,462円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引を行っております。 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 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかると、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<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>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年11月21日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<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>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月19日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

		契 約 額 等		
--	--	---------	--	--

区 分	種 類		うち	時 価	評価損益
			1年超		
市場取引	債券先物取引 買建				
	長国先 0312月	151,331,540	-	151,620,000	288,460
	小計	151,331,540	-	151,620,000	288,460
合 計		151,331,540	-	151,620,000	288,460

(2022年11月21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	債券先物取引 買建				
	長国先 0412月	594,366,160	-	597,640,000	3,273,840
	小計	594,366,160	-	597,640,000	3,273,840
合 計		594,366,160	-	597,640,000	3,273,840

(注) 1. 時価の算定方法

債券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)債券先物取引の残高は、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。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年11月19日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	17,438,698,926円
同期中における追加設定元本額	2,129,439,770円
同期中における一部解約元本額	703,270,109円
2021年11月19日現在の元本の内訳	
大和住銀DC日本債券ファンド	496,883,327円
大和住銀DC年金設計ファンド30	1,830,234,011円
大和住銀DC年金設計ファンド50	2,591,947,920円
大和住銀DC年金設計ファンド70	1,389,534,735円

大和住銀年金専用日本債券F - 1 (適格機関投資家限定)	11,561,180,796円
大和住銀日本債券ファンドV A (適格機関投資家限定)	699,980,531円
大和住銀年金設計ファンド30VA (適格機関投資家専用)	7,524,552円
大和住銀年金設計ファンド50VA (適格機関投資家専用)	27,134,541円
大和住銀年金設計ファンド70VA (適格機関投資家専用)	3,987,119円
大和住銀バランスファンド60 (適格機関投資家限定)	254,091,978円
大和住銀世界資産バランスVA (適格機関投資家限定)	2,369,077円
合 計	18,864,868,587円

(2022年11月21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	18,864,868,587円
同期中における追加設定元本額	2,618,744,489円
同期中における一部解約元本額	1,693,552,920円
2022年11月21日現在の元本の内訳	
大和住銀DC日本債券ファンド	441,040,684円
大和住銀DC年金設計ファンド30	1,785,326,422円
大和住銀DC年金設計ファンド50	2,842,282,044円
大和住銀DC年金設計ファンド70	1,387,879,789円
大和住銀年金専用日本債券F - 1 (適格機関投資家限定)	12,404,297,327円
大和住銀日本債券ファンドV A (適格機関投資家限定)	665,005,220円
大和住銀年金設計ファンド30VA (適格機関投資家専用)	5,737,972円
大和住銀年金設計ファンド50VA (適格機関投資家専用)	26,919,963円
大和住銀年金設計ファンド70VA (適格機関投資家専用)	4,691,549円
大和住銀バランスファンド60 (適格機関投資家限定)	225,051,276円
大和住銀世界資産バランスVA (適格機関投資家限定)	1,827,910円
合 計	19,790,060,156円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	439 2年国債	380,000,000	380,254,600	
	440 2年国債	600,000,000	600,372,000	
	441 2年国債	2,010,000,000	2,011,668,300	
	442 2年国債	460,000,000	460,220,800	
	151 5年国債	350,000,000	349,394,500	
	153 5年国債	100,000,000	99,726,000	
	154 5年国債	640,000,000	640,460,800	
	14 40年国債	195,000,000	149,748,300	
	15 40年国債	140,000,000	117,734,400	
	348 10年国債	220,000,000	220,211,200	
	349 10年国債	270,000,000	270,135,000	



350	10年国債	450,000,000	450,117,000	
351	10年国債	170,000,000	170,000,000	
357	10年国債	1,510,000,000	1,504,699,900	
361	10年国債	200,000,000	198,252,000	
362	10年国債	385,000,000	381,377,150	
363	10年国債	490,000,000	485,051,000	
20	30年国債	40,000,000	49,464,400	
22	30年国債	290,000,000	359,527,500	
39	30年国債	60,000,000	68,803,200	
44	30年国債	240,000,000	265,344,000	
46	30年国債	130,000,000	138,327,800	
47	30年国債	230,000,000	248,995,700	
49	30年国債	20,000,000	20,798,000	
58	30年国債	310,000,000	277,037,700	
60	30年国債	160,000,000	145,513,600	
64	30年国債	110,000,000	86,439,100	
65	30年国債	210,000,000	165,358,200	
69	30年国債	90,000,000	75,551,400	
70	30年国債	220,000,000	184,098,200	
74	30年国債	210,000,000	189,000,000	
75	30年国債	380,000,000	368,964,800	
76	30年国債	220,000,000	217,936,400	
115	20年国債	460,000,000	526,401,000	
140	20年国債	680,000,000	771,976,800	
141	20年国債	160,000,000	181,819,200	
147	20年国債	410,000,000	462,184,800	
149	20年国債	590,000,000	658,156,800	
150	20年国債	200,000,000	220,716,000	
153	20年国債	90,000,000	98,054,100	
155	20年国債	180,000,000	188,958,600	
156	20年国債	95,000,000	92,313,400	
160	20年国債	120,000,000	120,000,000	
164	20年国債	610,000,000	584,221,400	
166	20年国債	100,000,000	97,975,000	
167	20年国債	120,000,000	113,577,600	
168	20年国債	160,000,000	148,401,600	
170	20年国債	770,000,000	696,372,600	
171	20年国債	120,000,000	108,062,400	
173	20年国債	390,000,000	354,490,500	
175	20年国債	190,000,000	174,520,700	
182	20年国債	590,000,000	593,374,800	
21	物価連動国債	140,000,000	152,620,832	
	国債証券 小計		17,694,781,082	
地方債証券	763 東京都公債	200,000,000	199,919,000	
	19 東京都30年	100,000,000	82,221,500	

	498 名古屋市債	200,000,000	199,886,600	
	2022 - 5 福岡市公	100,000,000	100,003,800	
	地方債証券 小計		582,030,900	
特殊債券	138 住宅機構R M B S	80,231,000	78,626,380	
	153 住宅機構R M B S	175,416,000	168,995,774	
	160 住宅機構R M B S	90,947,000	87,754,760	
	161 住宅機構R M B S	91,202,000	87,854,886	
	162 住宅機構R M B S	91,830,000	88,432,290	
	164 住宅機構R M B S	92,802,000	89,294,084	
	170 住宅機構R M B S	94,409,000	91,010,276	
	特殊債券 小計		691,968,450	
社債券	21 首都高速道路	100,000,000	100,000,000	
	65 西日本高速道	200,000,000	198,206,600	
	AFL 0.844 04/14/33	100,000,000	95,376,000	
	16 長谷工コ - ボ	100,000,000	99,065,300	
	1 アサヒグループHD劣FR	200,000,000	200,633,400	
	5 サントリー食品	100,000,000	99,740,400	
	1 不二製油G 劣FR	100,000,000	100,020,400	
	1 横浜冷凍劣後FR	100,000,000	96,793,000	
	13 セブンアンドアイ	200,000,000	199,900,800	
	2 住友化学 劣FR	200,000,000	199,861,000	
	1 武田薬品劣後FR	200,000,000	203,254,200	
	19 ZHD	200,000,000	197,956,200	
	1 ENEOS HD 劣FR	100,000,000	98,937,800	
	14 LIXIL	100,000,000	100,017,200	
	1 パナソニック 劣後FR	200,000,000	195,303,600	
	18 JA三井リース	100,000,000	99,073,900	
	31 いすゞ自動車	100,000,000	98,740,400	
	7 三菱商事劣後FR	200,000,000	197,259,600	
	8 イオン 劣後FR	100,000,000	90,362,200	
	31 芙蓉総合リース	100,000,000	98,608,900	
	34 東京センチュリー	100,000,000	97,937,000	
	69 ホンダファイナンス	100,000,000	99,503,800	
	64 アイフル	200,000,000	200,000,800	
	23 ポケットカード	200,000,000	197,667,000	
	80 アコム	100,000,000	99,349,900	
	30 ジャックス	100,000,000	99,395,300	
	5 アプラスフィナンシャル	100,000,000	100,079,300	
	3 野村HD劣後FR	100,000,000	99,372,700	
	5 三菱地所劣後FR	100,000,000	99,685,700	
	50 東京地下鉄	100,000,000	83,577,200	
	57 東京地下鉄	100,000,000	83,662,400	
	43 日本郵船	100,000,000	99,127,600	
	13 ソフトバンク	200,000,000	190,936,000	
	1 東北電力劣後FR	100,000,000	99,042,600	

5 1 1 九州電力	100,000,000	100,015,800	
3 2 沖縄電力	100,000,000	100,235,800	
4 1 東京電力パワー	100,000,000	99,315,700	
4 9 東京電力P G	200,000,000	197,563,000	
社債券 小計		4,915,578,500	
合 計		23,884,358,932	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## インターナショナル株式マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年11月19日現在)	(2022年11月21日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	3,545,724,608	2,010,648,573
金銭信託	116,073,700	83,490,640
コール・ローン	2,314,315,782	2,033,009,521
株式	173,427,696,516	171,089,188,112
投資証券	7,286,158,513	2,462,706,034
派生商品評価勘定	314,890	452,129
未収入金	1,589,872,577	1,850,092,355
未収配当金	34,922,893	82,286,606
流動資産合計	188,315,079,479	179,611,873,970
資産合計	188,315,079,479	179,611,873,970
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	293,104	337,448
未払金	1,664,365,634	674,682,692
未払解約金	1,014,362,762	831,612,239
その他未払費用	6,030	3,358
流動負債合計	2,679,027,530	1,506,635,737
負債合計	2,679,027,530	1,506,635,737
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	20,086,768,071	22,339,249,887
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	165,549,283,878	155,765,988,346
元本等合計	185,636,051,949	178,105,238,233
純資産合計	185,636,051,949	178,105,238,233
負債純資産合計	188,315,079,479	179,611,873,970

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (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。 (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。 (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. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月19日現在)	(2022年11月21日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	20,086,768,071口	22,339,249,887口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 9.2417円 (1万口当たりの純資産額92,417円)	1口当たり純資産額 7.9727円 (1万口当たりの純資産額79,727円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年11月21日現在)
----	-----------------

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(株式、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月19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	149,836,350	-	150,151,240	314,890
	小計	149,836,350	-	150,151,240	314,890
	売建				
	ユーロ	53,836,350	-	54,129,454	293,104
	小計	53,836,350	-	54,129,454	293,104
合 計		203,672,700	-	204,280,694	21,786

(2022年11月21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	356,782,353	-	356,510,334	272,019
	小計	356,782,353	-	356,510,334	272,019
	売建				
	香港・ドル	3,362,456	-	3,365,832	3,376
	イギリス・ポンド	227,819,897	-	227,429,821	390,076
	小計	231,182,353	-	230,795,653	386,700
合 計		587,964,706	-	587,305,987	114,681

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

( その他の注記 )

( 2021年11月19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	18,155,266,699円
同期中における追加設定元本額	5,065,935,768円
同期中における一部解約元本額	3,134,434,396円
2021年11月19日現在の元本の内訳	
大和住銀DC外国株式ファンド	8,836,550,540円
大和住銀DC年金設計ファンド30	24,478,927円
大和住銀DC年金設計ファンド50	163,796,439円
大和住銀DC年金設計ファンド70	202,767,750円
大和住銀DC海外株式アクティブファンド	8,182,436,747円
インターナショナル株式アクティブファンド(ラップ専用)	16,697,916円
大和住銀グローバルバランスファンドVA	1,680,098円
大和住銀/T・ロウ・プライス外国株式ファンドVA	687,941,858円
大和住銀グローバルバランスファンドSVA	43,411,192円
大和住銀外国株式ファンドMSVA(適格機関投資家限定)	81,698,662円
大和住銀年金設計ファンド30VA(適格機関投資家専用)	112,491円
大和住銀年金設計ファンド50VA(適格機関投資家専用)	1,629,695円
大和住銀年金設計ファンド70VA(適格機関投資家専用)	660,276円
大和住銀バランスファンド60(適格機関投資家限定)	24,703,433円
大和住銀世界資産バランスVA(適格機関投資家限定)	1,176,113円
インターナショナル株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	1,817,025,934円
合 計	20,086,768,071円

( 2022年11月21日現在 )	
開示対象ファンドの	

期首における当該親投資信託の元本額	20,086,768,071円
同期中における追加設定元本額	5,486,985,341円
同期中における一部解約元本額	3,234,503,525円
2022年11月21日現在の元本の内訳	
大和住銀DC外国株式ファンド	8,755,404,666円
大和住銀DC年金設計ファンド30	23,863,967円
大和住銀DC年金設計ファンド50	171,500,976円
大和住銀DC年金設計ファンド70	202,319,043円
大和住銀DC海外株式アクティブファンド	10,200,320,038円
インターナショナル株式アクティブファンド(ラップ専用)	24,452,369円
大和住銀グローバルバランスファンドVA	1,467,998円
大和住銀/T・ロウ・プライス外国株式ファンドVA	580,041,909円
大和住銀グローバルバランスファンドSVA	55,847,296円
大和住銀外国株式ファンドMSVA(適格機関投資家限定)	68,900,036円
大和住銀年金設計ファンド30VA(適格機関投資家専用)	74,054円
大和住銀年金設計ファンド50VA(適格機関投資家専用)	1,614,678円
大和住銀年金設計ファンド70VA(適格機関投資家専用)	765,440円
大和住銀バランスファンド60(適格機関投資家限定)	25,998,722円
大和住銀世界資産バランスVA(適格機関投資家限定)	841,348円
インターナショナル株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	2,225,837,347円
合 計	22,339,249,887円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CONOCOPHILLIPS	155,733	128.590	20,025,706.47	
	EOG RESOURCES INC	142,144	141.020	20,045,146.88	
	HESS CORP	128,498	143.990	18,502,427.02	
	NOV INC	169,284	22.650	3,834,282.60	
	NUTRIEN LTD	251,054	77.800	19,532,001.20	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	114,345	240.040	27,447,373.80	
	GENERAL ELECTRIC CO	409,220	85.480	34,980,125.60	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	43,088	78.510	3,382,838.88	
	FERRARI NV	159,077	216.330	34,413,127.41	
	TESLA INC	10,258	180.190	1,848,389.02	
	BRIGHT HORIZONS FAMILY SOLUT	100,253	72.320	7,250,296.96	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	297,904	37.380	11,135,651.52	
	AMAZON.COM INC	284,143	94.140	26,749,222.02	
	BURLINGTON STORES INC	204,308	157.860	32,252,060.88	
	FRESHPET INC	28,565	64.060	1,829,873.90	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	50,855	233.460	11,872,608.30	
ELEVANCE HEALTH INC	36,144	495.320	17,902,846.08		



INTUITIVE SURGICAL INC	77,546	262.110	20,325,582.06		
UNITEDHEALTH GROUP INC	92,252	530.000	48,893,560.00		
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	80,047	184.080	14,735,051.76		
ASCENDIS PHARMA A/S - ADR	68,514	118.630	8,127,815.82		
ELI LILLY & CO	90,402	361.670	32,695,691.34		
EXACT SCIENCES CORP	196,050	42.530	8,338,006.50		
BANK OF AMERICA CORP	570,700	37.190	21,224,333.00		
SIGNATURE BANK	59,454	132.030	7,849,711.62		
WELLS FARGO & CO	222,211	46.500	10,332,811.50		
WESTERN ALLIANCE BANCORP	372,396	68.050	25,341,547.80		
SCHWAB (CHARLES) CORP	710,108	79.810	56,673,719.48		
ATLISSIAN CORP-CL A	34,740	118.760	4,125,722.40		
BLOCK INC	103,873	65.820	6,836,920.86		
DATADOG INC - CLASS A	20,182	76.520	1,544,326.64		
HUBSPOT INC	13,905	272.600	3,790,503.00		
MASTERCARD INC - A	149,063	343.690	51,231,462.47		
MICROSOFT CORP	181,915	241.220	43,881,536.30		
MONGODB INC	13,476	159.880	2,154,542.88		
SERVICENOW INC	41,506	399.380	16,576,666.28		
SHOPIFY INC - CLASS A	189,599	36.590	6,937,427.41		
SNOWFLAKE INC-CLASS A	30,197	146.200	4,414,801.40		
APPLE INC	288,204	151.290	43,602,383.16		
ADVANCED MICRO DEVICES	272,299	73.570	20,033,037.43		
ANALOG DEVICES INC	46,366	161.850	7,504,337.10		
NVIDIA CORP	50,800	154.090	7,827,772.00		
T-MOBILE US INC	252,613	148.830	37,596,392.79		
ALPHABET INC-CL A	196,963	97.430	19,190,105.09		
KANZHUN LTD - ADR	292,796	15.920	4,661,312.32		
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	357,014	57.610	20,567,576.54		
NETFLIX INC	22,558	287.980	6,496,252.84		
ROBLOX CORP -CLASS A	170,190	31.720	5,398,426.80		
SEA LTD-ADR	3,717	56.940	211,645.98		
SNAP INC - A	541,430	10.520	5,695,843.60		
アメリカ・ドル小計	8,397,959		867,820,804.71 (121,807,328,148)		
香港・ドル	PRADA S.P.A.	3,136,600	40.350	126,561,810.00	
	MEITUAN-CLASS B	350,200	160.400	56,172,080.00	
	AIA GROUP LTD	2,066,000	76.100	157,222,600.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	216,700	287.800	62,366,260.00	
香港・ドル小計	5,769,500		402,322,750.00 (7,221,693,363)		
台湾・ドル	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,149,000	487.000	559,563,000.00	
台湾・ドル小計	1,149,000		559,563,000.00 (2,521,614,702)		

イギリス・ポンド	ASHTREAD GROUP PLC	463,577	50.100	23,225,207.70	
	TRAINLINE PLC	2,541,399	3.080	7,827,508.92	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	471,424	81.220	38,289,057.28	
イギリス・ポンド小計		3,476,400		69,341,773.90 (11,551,646,113)	
スウェーデン・クローナ	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	892,968	138.650	123,810,013.20	
スウェーデン・クローナ小計		892,968		123,810,013.20 (1,631,815,974)	
インド・ルピー	HDFC BANK LIMITED	795,220	1,613.900	1,283,405,558.00	
	ICICI BANK LTD	1,414,776	920.350	1,302,089,091.60	
インド・ルピー小計		2,209,996		2,585,494,649.60 (4,472,905,744)	
ブラジル・リアル	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	7,774,096	11.870	92,278,519.52	
ブラジル・リアル小計		7,774,096		92,278,519.52 (2,405,405,713)	
ユーロ	AIRBUS SE	448,632	114.640	51,431,172.48	
	SARTORIUS AG-VORZUG	71,403	377.300	26,940,351.90	
	ADYEN NV	5,843	1,521.600	8,890,708.80	
	AMADEUS IT GROUP SA	262,049	49.690	13,021,214.81	
	ASML HOLDING NV	44,463	571.400	25,406,158.20	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	274,474	32.095	8,809,243.03	
ユーロ小計		1,106,864		134,498,849.22 (19,476,778,356)	
合計		30,776,783		171,089,188,112 (171,089,188,112)	

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

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	50銘柄	68.4%	71.2%
香港・ドル	株式	4銘柄	4.1%	4.2%
台湾・ドル	株式	1銘柄	1.4%	1.5%
イギリス・ポンド	株式	3銘柄	6.5%	6.8%
スウェーデン・クローナ	株式	1銘柄	0.9%	1.0%
インド・ルピー	株式	2銘柄	2.5%	2.6%
ブラジル・リアル	株式	1銘柄	1.4%	1.4%
ユーロ	株式	6銘柄	10.9%	11.4%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

投資証券	イギリス・ポンド	DERWENT LONDON PLC	613,404.00	14,783,036.40	
	イギリス・ポンド小計		613,404.00	14,783,036.40 (2,462,706,034)	
投資証券合計				2,462,706,034 (2,462,706,034)	
合 計				2,462,706,034 (2,462,706,034)	

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
イギリス・ポンド	投資証券 1銘柄	1.4%	100.0%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

#### 国際ナショナル債券マザーファンド

##### (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年11月19日現在)	(2022年11月21日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	71,103,118	178,313,509
金銭信託	6,108,390	4,650,677
コール・ローン	121,791,089	113,244,688
国債証券	4,939,063,092	5,548,355,898
地方債証券	21,192,361	23,051,632
特殊債券	97,220,562	73,702,171
社債券	602,688,429	284,158,899
派生商品評価勘定	31,223,972	142,009,659
未収入金	117,922,506	151,255,554
未収利息	18,776,694	21,654,079
前払費用	2,695,628	17,206,790
差入委託証拠金	25,216,217	43,235,051
流動資産合計	6,055,002,058	6,600,838,607
資産合計	6,055,002,058	6,600,838,607
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	33,589,815	111,676,349
未払金	56,182,430	131,937,150
未払解約金	40,124,301	50,280,031
その他未払費用	447	326
流動負債合計	129,896,993	293,893,856

負債合計	129,896,993	293,893,856
純資産の部		
元本等		
元本	1,975,527,227	2,076,830,334
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	3,949,577,838	4,230,114,417
元本等合計	5,925,105,065	6,306,944,751
純資産合計	5,925,105,065	6,306,944,751
負債純資産合計	6,055,002,058	6,600,838,607

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
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本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月19日現在)	(2022年11月21日現在)
----	-----------------	-----------------

1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	1,975,527,227口	2,076,830,334口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.9993円 (1万口当たりの純資産額29,993円)	1口当たり純資産額 3.0368円 (1万口当たりの純資産額30,368円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 2021年11月20日 至 2022年11月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<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>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年11月21日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<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>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（2021年11月19日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

		契 約 額 等		
--	--	---------	--	--

区 分	種 類		うち	時 価	評価損益
			1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建				
	US 10YR NOTE (CBT)	76,286,154	-	74,664,575	1,621,579
	DEC21				
	EURO-BOBL FUTURE	370,408,379	-	369,040,310	1,368,069
	DEC21				
	小計	446,694,533	-	443,704,885	2,989,648
	売建				
	US 2YR NOTE(CBT)	175,351,793	-	175,545,278	193,485
	DEC21				
	US 5YR NOTE(CBT)	56,055,859	-	55,600,405	455,454
	DEC21				
	CAN 10YR BOND FUT	91,744,332	-	89,694,478	2,049,854
	DEC21				
	AUST 3Y BOND FUTURE	155,189,179	-	152,147,494	3,041,685
	DEC21				
	LONG GILT FUTURE	413,551,335	-	409,329,459	4,221,876
	DEC21				
	EURO BUXL 30Y BND	190,045,689	-	194,634,027	4,588,338
DEC21					
EURO-BUND FUTURE	112,181,370	-	111,297,438	883,932	
DEC21					
小計	1,194,119,557	-	1,188,248,579	5,870,978	
合 計	1,640,814,090	-	1,631,953,464	2,881,330	

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち		
			1年超		
為替予約取引	買建				
	アメリカ・ドル	1,036,988,870	-	1,041,633,032	4,644,162
	カナダ・ドル	145,965,527	-	144,503,382	1,462,145
	イギリス・ポンド	72,764,885	-	72,500,728	264,157
	イスラエル・シケル	121,213,626	-	126,525,712	5,312,086
	スイス・フラン	61,452,078	-	60,929,870	522,208
	デンマーク・クローネ	2,659,563	-	2,642,004	17,559
	ノルウェー・クローネ	14,640,920	-	14,326,572	314,348
	ロシア・ルーブル	26,487,060	-	25,804,578	682,482
	ポーランド・ズロチ	2,807,198	-	2,743,398	63,800
	ユーロ	574,048,872	-	565,762,650	8,286,222
	小計	2,059,028,599	-	2,057,371,926	1,656,673
	売建				
	アメリカ・ドル	1,111,158,729	-	1,117,138,140	5,979,411
	カナダ・ドル	2,625,660	-	2,630,300	4,640
	オーストラリア・ドル	45,687,357	-	45,646,341	41,016

市場取引以外の取引	シンガポール・ドル	103,464,301	-	103,892,902	428,601
	ニュージーランド・ドル	30,159,472	-	29,880,522	278,950
	イギリス・ポンド	4,158,810	-	4,164,750	5,940
	イスラエル・シケル	94,749,862	-	98,431,679	3,681,817
	スイス・フラン	60,530,540	-	60,929,870	399,330
	スウェーデン・クローナ	44,905,093	-	44,113,327	791,766
	メキシコ・ペソ	110,471,825	-	108,915,968	1,555,857
	チェコ・コルナ	60,969,149	-	60,251,325	717,824
	オフショア・人民元	47,217,208	-	47,521,395	304,187
	ロシア・ルーブル	60,390,722	-	58,861,843	1,528,879
	マレーシア・リンギット	17,162,228	-	17,103,947	58,281
	ユーロ	152,789,592	-	150,548,740	2,240,852
	小計	1,946,440,548	-	1,950,031,049	3,590,501
合 計	4,005,469,147	-	4,007,402,975	5,247,174	

(2022年11月21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	債券先物取引				
	買建				
	US LONG BOND(CBT) DEC22	324,232,691	-	299,308,928	24,923,763
	AUST 10Y BOND FUT DEC22	87,215,572	-	89,573,621	2,358,049
	EURO-BOBL FUTURE DEC22	470,688,404	-	468,676,117	2,012,287
	EURO-BUND FUTURE DEC22	218,770,116	-	223,294,124	4,524,008
	小計	1,100,906,783	-	1,080,852,790	20,053,993
	売建				
	US 2YR NOTE(CBT) DEC22	2,282,331,517	-	2,265,593,498	16,738,019
	CAN 10YR BOND FUT DEC22	164,505,534	-	169,978,208	5,472,674
	AUST 3Y BOND FUTURE DEC22	220,355,541	-	221,592,992	1,237,451
	LONG GILT FUTURE DEC22	128,184,391	-	123,259,941	4,924,450
	EURO-BTP FUTURE DEC22	101,572,794	-	103,602,866	2,030,072



	EURO-SCHATZ FUT DEC22	2,512,454,285	-	2,490,911,564	21,542,721
	小計	5,409,404,062	-	5,374,939,069	34,464,993
	合計	6,510,310,845	-	6,455,791,859	14,411,000

## (注) 1. 時価の算定方法

債券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)債券先物取引の残高は、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	1,153,576,613	-	1,109,887,793	43,688,820	
	カナダ・ドル	89,343,042	-	87,293,889	2,049,153	
	オーストラリア・ドル	33,924,440	-	33,288,243	636,197	
	ニュージーランド・ドル	78,907,969	-	78,433,507	474,462	
	イギリス・ポンド	221,522,030	-	215,028,483	6,493,547	
	イスラエル・シケル	20,631,813	-	20,239,603	392,210	
	スイス・フラン	68,009,443	-	66,712,031	1,297,412	
	ノルウェー・クローネ	16,062,578	-	15,390,939	671,639	
	スウェーデン・クローナ	33,182,309	-	31,776,147	1,406,162	
	メキシコ・ペソ	23,352,886	-	22,844,337	508,549	
	チェコ・コルナ	64,440,123	-	63,060,151	1,379,972	
	オフショア・人民元	157,068,220	-	151,543,815	5,524,405	
	マレーシア・リングギット	19,127,447	-	18,654,914	472,533	
	タイ・バーツ	65,089,171	-	63,589,020	1,500,151	
	ユーロ	758,699,610	-	758,954,177	254,567	
	小計	2,802,937,694	-	2,736,697,049	66,240,645	
		売建				
	アメリカ・ドル	1,834,338,081	-	1,755,831,912	78,506,169	
	オーストラリア・ドル	50,311,351	-	49,737,739	573,612	
	シンガポール・ドル	63,314,464	-	61,347,219	1,967,245	
	ニュージーランド・ドル	99,023,782	-	102,676,438	3,652,656	
イスラエル・シケル	27,639,882	-	27,241,650	398,232		
スイス・フラン	66,660,820	-	66,712,031	51,211		
スウェーデン・クローナ	15,622,681	-	15,841,471	218,790		

	チェコ・コルナ	62,355,299	-	63,060,151	704,852
	タイ・パーツ	63,360,400	-	63,589,020	228,620
	ポーランド・ズロチ	38,136,727	-	36,737,750	1,398,977
	ユーロ	371,134,906	-	366,960,055	4,174,851
	小計	2,691,898,393	-	2,609,735,436	82,162,957
	合計	5,494,836,087	-	5,346,432,485	15,922,312

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年11月20日
至 2022年11月21日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

(2021年11月19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	1,926,224,873円
同期中における追加設定元本額	256,012,759円
同期中における一部解約元本額	206,710,405円
2021年11月19日現在の元本の内訳	
大和住銀DC外国債券ファンド	1,187,388,922円
大和住銀DC年金設計ファンド30	135,809,409円
大和住銀DC年金設計ファンド50	289,492,095円
大和住銀DC年金設計ファンド70	302,926,690円
大和住銀/T・ロウ・プライス外国債券ファンドVA	15,654,075円
大和住銀年金設計ファンド30VA(適格機関投資家専用)	562,306円
大和住銀年金設計ファンド50VA(適格機関投資家専用)	3,019,804円
大和住銀年金設計ファンド70VA(適格機関投資家専用)	883,839円
大和住銀バランスファンド60(適格機関投資家限定)	36,895,043円
大和住銀世界資産バランスVA(適格機関投資家限定)	2,895,044円

合 計

1,975,527,227円

(2022年11月21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	1,975,527,227円
同期中における追加設定元本額	249,481,116円
同期中における一部解約元本額	148,178,009円
2022年11月21日現在の元本の内訳	
大和住銀DC外国債券ファンド	1,286,944,112円
大和住銀DC年金設計ファンド30	132,676,671円
大和住銀DC年金設計ファンド50	301,070,606円
大和住銀DC年金設計ファンド70	302,588,405円
大和住銀/T・ロウ・プライス外国債券ファンドVA	14,632,856円
大和住銀年金設計ファンド30VA(適格機関投資家専用)	416,606円
大和住銀年金設計ファンド50VA(適格機関投資家専用)	2,993,707円
大和住銀年金設計ファンド70VA(適格機関投資家専用)	1,038,384円
大和住銀バランスファンド60(適格機関投資家限定)	32,317,543円
大和住銀世界資産バランスVA(適格機関投資家限定)	2,151,444円
合 計	2,076,830,334円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	B 0 01/26/23	3,293,000.00	3,268,862.31	
		B 0 02/16/23	1,850,000.00	1,831,296.50	
		T 1.875 11/15/51	504,000.00	321,179.04	
		T 2.25 02/15/52	1,134,000.00	795,036.06	
		T 2.375 03/31/29	3,330,000.00	3,033,396.89	
		T 2.375 05/15/51	620,000.00	447,801.19	
		T 2.625 05/31/27	5,231,000.00	4,928,962.06	
		T 2.75 08/15/32	7,173,000.00	6,549,522.84	
		T 3.125 08/31/29	1,930,000.00	1,836,877.50	
		TII 0.375 07/15/23	2,596,000.00	3,269,213.47	
	TII 0.625 07/15/32	1,274,000.00	1,189,711.95		
		アメリカ・ドル小計	28,935,000.00	27,471,859.81 (3,855,950,243)	
	カナダ・ドル	CAN 2 12/01/51	558,000.00	429,788.34	
		カナダ・ドル小計	558,000.00	429,788.34 (45,050,414)	

オーストラリア・ドル	ACGB 1.25 05/21/32	855,000.00	694,969.65	
オーストラリア・ドル小計		855,000.00	694,969.65 (64,917,114)	
シンガポール・ドル	SIGB 1.625 07/01/31	1,020,000.00	907,035.00	
シンガポール・ドル小計		1,020,000.00	907,035.00 (92,581,061)	
ニュージーランド・ドル	NZGB 2.75 05/15/51	591,000.00	424,911.27	
ニュージーランド・ドル小計		591,000.00	424,911.27 (36,631,601)	
イギリス・ポンド	UKT 1.25 07/22/27	319,000.00	291,151.30	
イギリス・ポンド小計		319,000.00	291,151.30 (48,502,894)	
メキシコ・ペソ	MBONO 8 11/07/47	1,050,000.00	919,527.00	
	MUDI 2.75 11/27/31	490,000.00	3,209,901.40	
メキシコ・ペソ小計		1,540,000.00	4,129,428.40 (29,785,980)	
マレーシア・リングgit	MGS 4.065 06/15/50	520,000.00	467,766.00	
マレーシア・リングgit小計		520,000.00	467,766.00 (14,321,732)	
ユーロ	BGARIA 4.125 09/23/29	130,000.00	126,278.10	
	BGB 1.25 04/22/33	483,000.00	427,851.06	
	BTPS 1.7 09/01/51	655,000.00	421,754.50	
	BTPS 3.45 03/01/48	174,000.00	162,164.52	
	CHILE 0.83 07/02/31	245,000.00	188,603.45	
	DBR 0 02/15/32	1,893,000.00	1,579,538.13	
	DBR 0 08/15/52	125,000.00	70,960.00	
	DBR 1.7 08/15/32	1,031,000.00	1,003,183.62	
	DBR 3.25 07/04/42	410,000.00	484,993.10	
	FRTR 0.1 03/01/25	800,000.00	923,839.32	
	FRTR 1.75 06/25/39	1,503,000.00	1,315,125.00	
	ICELND 0 04/15/28	134,000.00	112,286.64	
	ICELND 0.625 06/03/26	200,000.00	183,274.00	
	INDON 3.75 06/14/28	100,000.00	96,291.00	
	IRISH 1.5 05/15/50	50,000.00	38,175.00	
MEX 1.75 04/17/28	100,000.00	89,005.00		

		NETHER 0.5 07/15/32	570,000.00	482,733.00	
		NETHER 0.75 07/15/28	200,000.00	185,470.00	
		NETHER 5.5 01/15/28	230,000.00	267,193.30	
		RAGB 0.85 06/30/20	105,000.00	51,230.55	
		RAGB 3.15 06/20/44	187,000.00	201,094.19	
		REPHUN 5 02/22/27	48,000.00	47,697.60	
		ROMANI 2.124 07/16/31	200,000.00	142,898.00	
		ROMANI 2.625 12/02/40	80,000.00	45,232.00	
		ROMANI 3.375 02/08/38	158,000.00	106,904.38	
		SLOREP 0.4875 10/20/50	36,000.00	17,579.16	
		SPGB 1.4 07/30/28	266,000.00	249,457.46	
		SPGB 2.9 10/31/46	183,000.00	171,880.92	
		SPGB 3.45 07/30/66	202,000.00	203,169.58	
		ユーロ小計	10,498,000.00	9,395,862.58 (1,360,614,859)	
		国債証券合計		5,548,355,898 (5,548,355,898)	
地方債証券	アメリカ・ドル	ONT 1.05 05/21/27	190,000.00	164,232.20	
		アメリカ・ドル小計	190,000.00	164,232.20 (23,051,632)	
		地方債証券合計		23,051,632 (23,051,632)	
特殊債券	オーストラリア・ドル	NSWTC 4 05/20/26	141,000.00	142,569.33	
		オーストラリア・ドル小計	141,000.00	142,569.33 (13,317,402)	
	ユーロ	ASIA 0.35 07/16/25	115,000.00	108,242.60	
		EU 0 07/04/35	51,000.00	35,879.52	
		IBRD 0.125 01/03/51	387,000.00	190,136.97	
		MAGYAR 0.375 06/09/26	100,000.00	82,734.00	
		ユーロ小計	653,000.00	416,993.09 (60,384,769)	
		特殊債券合計		73,702,171 (73,702,171)	
社債券	アメリカ・ドル	ABDPOC 2.5 05/06/31	200,000.00	161,424.00	
		ARAMCO 0.946 06/17/24	200,000.00	187,660.00	
		ARAMCO 1.602 06/17/26	200,000.00	178,328.00	
		AZN 1.75 05/28/28	60,000.00	51,590.40	
		AZN 2.25 05/28/31	10,000.00	8,348.00	
		PEMEX 7.69 01/23/50	80,000.00	54,963.20	
		SBATOW 1.631 11/15/26	45,000.00	37,889.55	
		アメリカ・ドル小計	795,000.00	680,203.15 (95,473,314)	

イギリス・ポンド	DNBNO FL 08/17/27	100,000.00	95,007.00	
	ORSTED 2.125 05/17/27	100,000.00	90,091.00	
イギリス・ポンド小計		200,000.00	185,098.00 (30,835,476)	
デンマーク・クローネ	RDKRE 2 04/01/24	1,400,000.00	1,384,922.00	
デンマーク・クローネ小計		1,400,000.00	1,384,922.00 (26,964,430)	
ユーロ	ARION 0.625 05/27/24	100,000.00	91,068.00	
	AVINOR 0.75 10/01/30	100,000.00	81,813.00	
	C FL 07/06/26	100,000.00	93,624.00	
	HETAR 2.375 12/13/22	200,000.00	200,382.00	
	ISLBAN FL 01/19/24	160,000.00	159,067.20	
	LANBNN 0.75 05/25/26	100,000.00	81,052.00	
	LIBMUT 2.75 05/04/26	100,000.00	96,550.00	
	PEMEX 5.125 03/15/23	100,000.00	100,288.00	
ユーロ小計		960,000.00	903,844.20 (130,885,679)	
社債券合計			284,158,899 (284,158,899)	
合計			5,929,268,600 (5,929,268,600)	

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

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	11銘柄	61.1%	65.0%
	地方債証券	1銘柄	0.4%	0.4%
	社債券	7銘柄	1.5%	1.6%
カナダ・ドル	国債証券	1銘柄	0.7%	0.8%
オーストラリア・ドル	国債証券	1銘柄	1.0%	1.1%
	特殊債券	1銘柄	0.2%	0.2%
シンガポール・ドル	国債証券	1銘柄	1.5%	1.6%
ニュージーランド・ドル	国債証券	1銘柄	0.6%	0.6%
イギリス・ポンド	国債証券	1銘柄	0.8%	0.8%
	社債券	2銘柄	0.5%	0.5%
デンマーク・クローネ	社債券	1銘柄	0.4%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	2銘柄	0.5%	0.5%
マレーシア・リングgit	国債証券	1銘柄	0.2%	0.2%
ユーロ	国債証券	29銘柄	21.6%	22.9%
	特殊債券	4銘柄	1.0%	1.0%
	社債券	8銘柄	2.1%	2.2%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

**【中間財務諸表】**

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第22期中間計算期間(2022年11月22日から2023年5月21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。

## 【大和住銀DC年金設計ファンド30】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第21期 (2022年11月21日現在)	第22期中間計算期間 (2023年5月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	33,875	192,797
コール・ローン	824,868	2,228,071
親投資信託受益証券	3,978,453,197	4,101,942,443
未収入金	20,503,760	25,053,249
流動資産合計	3,999,815,700	4,129,416,560
資産合計		
	3,999,815,700	4,129,416,560
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	370,102	10,270,946
未払受託者報酬	1,789,056	1,735,696
未払委託者報酬	18,338,144	17,791,267
未払利息	-	4
その他未払費用	355,411	173,487
流動負債合計	20,852,713	29,971,400
負債合計		
	20,852,713	29,971,400
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,069,385,906	2,060,655,527
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,909,577,081	2,038,789,633
(分配準備積立金)	957,122,308	917,449,795
元本等合計	3,978,962,987	4,099,445,160
純資産合計		
	3,978,962,987	4,099,445,160
負債純資産合計		
	3,999,815,700	4,129,416,560



## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第21期中間計算期間 自 2021年11月20日 至 2022年 5月19日	第22期中間計算期間 自 2022年11月22日 至 2023年 5月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	21	9
有価証券売買等損益	87,512,351	157,507,009
営業収益合計	87,512,330	157,507,018
<b>営業費用</b>		
支払利息	116	159
受託者報酬	1,766,804	1,735,696
委託者報酬	18,110,121	17,791,267
その他費用	176,597	173,496
営業費用合計	20,053,638	19,700,618
営業利益又は営業損失（ ）	107,565,968	137,806,400
経常利益又は経常損失（ ）	107,565,968	137,806,400
中間純利益又は中間純損失（ ）	107,565,968	137,806,400
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（ ）	3,943,241	108,228
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,020,382,330	1,909,577,081
剰余金増加額又は欠損金減少額	90,264,326	72,457,284
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	90,264,326	72,457,284
剰余金減少額又は欠損金増加額	107,380,237	80,942,904
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	107,380,237	80,942,904
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（ ）	1,899,643,692	2,038,789,633

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第22期中間計算期間 自 2022年11月22日 至 2023年5月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	<p>中間計算期間の取扱い</p> <p>当中間計算期間は前期末が休日のため、2022年11月22日から2023年5月21日までとなっております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第21期 (2022年11月21日現在)	第22期中間計算期間 (2023年5月21日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	2,069,385,906口	2,060,655,527口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9228円 (1万口当たりの純資産額19,228円)	1口当たり純資産額 1.9894円 (1万口当たりの純資産額19,894円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第21期中間計算期間 自 2021年11月20日 至 2022年5月19日	第22期中間計算期間 自 2022年11月22日 至 2023年5月21日
委託者報酬	<p>委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用</p> <p>1,236,028円</p>	<p>委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用</p> <p>1,199,465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	第22期中間計算期間 (2023年5月21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
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21期 (2022年11月21日現在)	第22期中間計算期間 (2023年5月21日現在)
期首元本額	2,097,493,885円	2,069,385,906円
期中追加設定元本額	179,913,990円	79,020,986円
期中一部解約元本額	208,021,969円	87,751,365円

## 【大和住銀DC年金設計ファンド50】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第21期 (2022年11月21日現在)	第22期中間計算期間 (2023年5月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	78,456	314,233
コール・ローン	1,910,409	1,510,612
親投資信託受益証券	8,970,351,656	9,442,494,689
未収入金	55,732,957	54,652,695
流動資産合計	9,028,073,478	9,498,972,229
資産合計	9,028,073,478	9,498,972,229
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	616,422	11,945,801
未払受託者報酬	3,991,444	3,918,315
未払委託者報酬	50,891,425	49,959,071
未払利息	-	4
その他未払費用	790,298	391,754
流動負債合計	56,289,589	66,214,945
負債合計	56,289,589	66,214,945
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,511,512,457	3,512,211,626
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	5,460,271,432	5,920,545,658
(分配準備積立金)	3,155,179,500	3,050,302,591
元本等合計	8,971,783,889	9,432,757,284
純資産合計	8,971,783,889	9,432,757,284
負債純資産合計	9,028,073,478	9,498,972,229

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第21期中間計算期間 自 2021年11月20日 至 2022年 5月19日	第22期中間計算期間 自 2022年11月22日 至 2023年 5月21日
<b>営業収益</b>		
受取利息	34	13
有価証券売買等損益	352,420,885	514,307,366
営業収益合計	352,420,851	514,307,379
<b>営業費用</b>		
支払利息	503	550
受託者報酬	3,913,469	3,918,315
委託者報酬	49,897,136	49,959,071
その他費用	391,261	391,787
営業費用合計	54,202,369	54,269,723
営業利益又は営業損失（ ）	406,623,220	460,037,656
経常利益又は経常損失（ ）	406,623,220	460,037,656
中間純利益又は中間純損失（ ）	406,623,220	460,037,656
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（ ）	9,480,070	195,813
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,680,875,550	5,460,271,432
剰余金増加額又は欠損金減少額	214,048,047	185,262,037
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	214,048,047	185,262,037
剰余金減少額又は欠損金増加額	221,983,138	184,829,654
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	221,983,138	184,829,654
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（ ）	5,275,797,309	5,920,545,658

## （ 3 ）【中間注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項 目	第22期中間計算期間 自 2022年11月22日 至 2023年5月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	<p>中間計算期間の取扱い 当中間計算期間は前期末が休日のため、2022年11月22日から2023年5月21日までとなっております。</p>

## （中間貸借対照表に関する注記）

項 目	第21期 (2022年11月21日現在)	第22期中間計算期間 (2023年5月21日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	3,511,512,457口	3,512,211,626口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.5550円 (1万口当たりの純資産額25,550円)	1口当たり純資産額 2.6857円 (1万口当たりの純資産額26,857円)

## （中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第21期中間計算期間 自 2021年11月20日 至 2022年5月19日	第22期中間計算期間 自 2022年11月22日 至 2023年5月21日
委託者報酬	<p>委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用</p> <p>5,002,184円</p>	<p>委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用</p> <p>5,057,190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	第22期中間計算期間 (2023年5月21日現在)

1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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つた場合、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ぬ。

## (その他の注記)

項 目	第21期 (2022年11月21日現在)	第22期中間計算期間 (2023年5月21日現在)
期首元本額	3,501,023,322円	3,511,512,457円
期中追加設定元本額	267,539,496円	119,589,579円
期中一部解約元本額	257,050,361円	118,890,410円

## 【大和住銀DC年金設計ファンド70】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第21期 (2022年11月21日現在)	第22期中間計算期間 (2023年5月21日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	60,085	2,735,201
コール・ローン	1,463,085	4,740,800
親投資信託受益証券	9,006,523,826	9,626,022,756
未収入金	65,255,088	74,344,115
流動資産合計	9,073,302,084	9,707,842,872
資産合計		
	9,073,302,084	9,707,842,872
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	167,434	28,687,543
未払受託者報酬	3,963,165	3,954,692
未払委託者報酬	60,438,843	60,309,672
未払利息	-	12
その他未払費用	782,385	395,379
流動負債合計	65,351,827	93,347,298
負債合計		
	65,351,827	93,347,298
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,661,286,428	2,654,782,164
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	6,346,663,829	6,959,713,410
(分配準備積立金)	3,266,714,874	3,090,606,881
元本等合計	9,007,950,257	9,614,495,574
純資産合計		
	9,007,950,257	9,614,495,574
負債純資産合計		
	9,073,302,084	9,707,842,872



## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第21期中間計算期間 自 2021年11月20日 至 2022年 5月19日	第22期中間計算期間 自 2022年11月22日 至 2023年 5月21日
営業収益		
受取利息	66	14
有価証券売買等損益	390,224,495	695,823,869
営業収益合計	390,224,429	695,823,883
営業費用		
支払利息	797	905
受託者報酬	3,862,412	3,954,692
委託者報酬	58,902,593	60,309,672
その他費用	386,182	395,404
営業費用合計	63,151,984	64,660,673
営業利益又は営業損失( )	453,376,413	631,163,210
経常利益又は経常損失( )	453,376,413	631,163,210
中間純利益又は中間純損失( )	453,376,413	631,163,210
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( )	18,374,009	3,328,573
期首剰余金又は期首欠損金( )	6,446,913,294	6,346,663,829
剰余金増加額又は欠損金減少額	372,801,553	337,817,240
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	372,801,553	337,817,240
剰余金減少額又は欠損金増加額	389,093,719	352,602,296
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	389,093,719	352,602,296
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( )	5,995,618,724	6,959,713,410

## （ 3 ）【中間注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項 目	第22期中間計算期間 自 2022年11月22日 至 2023年5月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	<p>中間計算期間の取扱い</p> <p>当中間計算期間は前期末が休日のため、2022年11月22日から2023年5月21日までとなっております。</p>

## （中間貸借対照表に関する注記）

項 目	第21期 (2022年11月21日現在)	第22期中間計算期間 (2023年5月21日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	2,661,286,428口	2,654,782,164口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.3848円 (1万口当たりの純資産額33,848円)	1口当たり純資産額 3.6216円 (1万口当たりの純資産額36,216円)

## （中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第21期中間計算期間 自 2021年11月20日 至 2022年5月19日	第22期中間計算期間 自 2022年11月22日 至 2023年5月21日
委託者報酬	<p>委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用</p> <p>5,914,072円</p>	<p>委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用</p> <p>5,696,654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	第22期中間計算期間 (2023年5月21日現在)

1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
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21期 (2022年11月21日現在)	第22期中間計算期間 (2023年5月21日現在)
期首元本額	2,626,258,885円	2,661,286,428円
期中追加設定元本額	302,998,070円	141,383,410円
期中一部解約元本額	267,970,527円	147,887,674円

## (参考)

「大和住銀DC年金設計ファンド30」、「大和住銀DC年金設計ファンド50」および「大和住銀DC年金設計ファンド70」は、「年金日本株式マザーファンド」、「年金日本債券マザーファンド」、「インターナショナル株式マザーファンド」および「インターナショナル債券マザーファンド」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。

## 年金日本株式マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年11月21日現在)	(2023年5月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	38,723,843	31,795,377
コール・ローン	942,931,348	948,968,277
株式	86,813,630,550	97,824,174,820
未収入金	-	1,544,943,659
未収配当金	974,719,800	1,357,480,500
流動資産合計	88,770,005,541	101,707,362,633
資産合計	88,770,005,541	101,707,362,633

負債の部		
流動負債		
未払金	-	1,527,055,344
未払解約金	246,156,431	323,614,915
未払利息	-	2,544
その他未払費用	1,853	2,519
流動負債合計	246,158,284	1,850,675,322
負債合計	246,158,284	1,850,675,322
純資産の部		
元本等		
元本	25,067,881,054	25,485,199,855
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	63,455,966,203	74,371,487,456
元本等合計	88,523,847,257	99,856,687,311
純資産合計	88,523,847,257	99,856,687,311
負債純資産合計	88,770,005,541	101,707,362,633

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年11月22日 至 2023年5月21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>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年11月21日現在)	(2023年5月21日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	25,067,881,054口	25,485,199,855口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.5314円 (1万口当たりの純資産額35,314円)	1口当たり純資産額 3.9182円 (1万口当たりの純資産額39,182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21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)

(2022年11月21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	23,972,293,045円
同期中における追加設定元本額	2,426,617,850円
同期中における一部解約元本額	1,331,029,841円
2022年11月21日現在の元本の内訳	
大和住銀DC日本株式ファンド	7,897,881,921円
大和住銀DC年金設計ファンド30	328,596,774円
大和住銀DC年金設計ファンド50	891,058,143円
大和住銀DC年金設計ファンド70	1,343,664,986円
大和住銀DC国内株式ファンド	8,669,487,968円
大和住銀年金専用日本株式F-1(適格機関投資家限定)	5,112,019,166円
大和住銀日本株式ファンドVA(適格機関投資家限定)	695,544,580円
大和住銀年金設計ファンド30VA(適格機関投資家専用)	910,093円
大和住銀年金設計ファンド50VA(適格機関投資家専用)	10,351,051円
大和住銀年金設計ファンド70VA(適格機関投資家専用)	5,045,107円
大和住銀バランスファンド60(適格機関投資家限定)	112,078,647円
大和住銀世界資産バランスVA(適格機関投資家限定)	1,242,618円
合計	25,067,881,054円

(2023年5月21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	25,067,881,054円
同期中における追加設定元本額	1,272,001,981円
同期中における一部解約元本額	854,683,180円
2023年5月21日現在の元本の内訳	

大和住銀DC日本株式ファンド	7,899,000,383円
大和住銀DC年金設計ファンド30	271,507,581円
大和住銀DC年金設計ファンド50	887,346,431円
大和住銀DC年金設計ファンド70	1,334,065,591円
大和住銀DC国内株式ファンド	9,302,970,685円
大和住銀年金専用日本株式F-1(適格機関投資家限定)	5,000,622,377円
大和住銀日本株式ファンドVA(適格機関投資家限定)	662,581,377円
大和住銀年金設計ファンド30VA(適格機関投資家専用)	916,141円
大和住銀年金設計ファンド50VA(適格機関投資家専用)	9,148,241円
大和住銀年金設計ファンド70VA(適格機関投資家専用)	4,058,088円
大和住銀バランスファンド60(適格機関投資家限定)	111,758,122円
大和住銀世界資産バランスVA(適格機関投資家限定)	1,224,838円
合計	25,485,199,855円

## 年金日本債券マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年11月21日現在)	(2023年5月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	-	94,779,711
金銭信託	31,164,866	76,351,863
コール・ローン	758,869,139	2,278,806,020
国債証券	17,694,781,082	32,183,403,800
地方債証券	582,030,900	584,421,200
特殊債券	691,968,450	1,076,099,600
社債券	4,915,578,500	9,952,703,000
派生商品評価勘定	3,273,840	17,688,440
未収入金	617,844,600	1,015,895,000
未収利息	34,855,667	43,146,265
前払費用	4,535,016	25,565,616
差入委託証拠金	5,760,000	25,620,000
流動資産合計	25,340,662,060	47,374,480,515
資産合計	25,340,662,060	47,374,480,515
負債の部		
流動負債		
前受金	3,160,000	20,650,000
未払金	620,450,000	1,081,935,200
未払解約金	53,920,715	59,728,096
その他未払費用	1,818	6,096
流動負債合計	677,532,533	1,162,319,392
負債合計	677,532,533	1,162,319,392
純資産の部		
元本等		
元本	19,790,060,156	36,739,505,173
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	4,873,069,371	9,472,655,950

元本等合計	24,663,129,527	46,212,161,123
純資産合計	24,663,129,527	46,212,161,123
負債純資産合計	25,340,662,060	47,374,480,515

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年11月22日 至 2023年5月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
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21日現在)	(2023年5月21日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	19,790,060,156口	36,739,505,173口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2462円 (1万口当たりの純資産額12,462円)	1口当たり純資産額 1.2578円 (1万口当たりの純資産額12,578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21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

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21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	債券先物取引 買建				
	長国先 0412月	594,366,160	-	597,640,000	3,273,840
	小計	594,366,160	-	597,640,000	3,273,840
合計		594,366,160	-	597,640,000	3,273,840

(2023年5月21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	債券先物取引 買建				
	長国先 0506月	2,063,411,560	-	2,081,100,000	17,688,440
	小計	2,063,411,560	-	2,081,100,000	17,688,440
合計		2,063,411,560	-	2,081,100,000	17,688,440

## (注) 1. 時価の算定方法

債券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)債券先物取引の残高は、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21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	18,864,868,587円
同期中における追加設定元本額	2,618,744,489円
同期中における一部解約元本額	1,693,552,920円
2022年11月21日現在の元本の内訳	



大和住銀DC日本債券ファンド	441,040,684円
大和住銀DC年金設計ファンド30	1,785,326,422円
大和住銀DC年金設計ファンド50	2,842,282,044円
大和住銀DC年金設計ファンド70	1,387,879,789円
大和住銀年金専用日本債券F-1(適格機関投資家限定)	12,404,297,327円
大和住銀日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	665,005,220円
大和住銀年金設計ファンド30VA(適格機関投資家専用)	5,737,972円
大和住銀年金設計ファンド50VA(適格機関投資家専用)	26,919,963円
大和住銀年金設計ファンド70VA(適格機関投資家専用)	4,691,549円
大和住銀バランスファンド60(適格機関投資家限定)	225,051,276円
大和住銀世界資産バランスVA(適格機関投資家限定)	1,827,910円
合計	19,790,060,156円

(2023年5月21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	19,790,060,156円
同期中における追加設定元本額	18,231,061,078円
同期中における一部解約元本額	1,281,616,061円
2023年5月21日現在の元本の内訳	
大和住銀DC日本債券ファンド	417,292,213円
大和住銀DC年金設計ファンド30	1,920,717,700円
大和住銀DC年金設計ファンド50	2,828,944,482円
大和住銀DC年金設計ファンド70	1,375,674,050円
大和住銀年金専用日本債券F-1(適格機関投資家限定)	11,461,193,898円
大和住銀日本債券ファンドVA(適格機関投資家限定)	612,053,807円
大和住銀年金設計ファンド30VA(適格機関投資家専用)	5,779,844円
大和住銀年金設計ファンド50VA(適格機関投資家専用)	30,273,830円
大和住銀年金設計ファンド70VA(適格機関投資家専用)	4,683,657円
大和住銀バランスファンド60(適格機関投資家限定)	224,302,814円
大和住銀世界資産バランスVA(適格機関投資家限定)	1,798,514円
SMDAM日本債券ファンド(適格機関投資家専用)	17,856,790,364円
合計	36,739,505,173円

## インターナショナル株式マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年11月21日現在)	(2023年5月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	2,010,648,573	249,893,506
金銭信託	83,490,640	72,846,811
コール・ローン	2,033,009,521	2,174,193,836
株式	171,089,188,112	190,498,671,784
投資証券	2,462,706,034	1,694,043,518
派生商品評価勘定	452,129	898,373
未収入金	1,850,092,355	1,710,130,943

未収配当金	82,286,606	286,784,045
流動資産合計	179,611,873,970	196,687,462,816
資産合計	179,611,873,970	196,687,462,816
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	337,448	1,813,946
未払金	674,682,692	1,089,015,884
未払解約金	831,612,239	886,659,651
未払利息	-	5,828
その他未払費用	3,358	2,720
流動負債合計	1,506,635,737	1,977,498,029
負債合計	1,506,635,737	1,977,498,029
純資産の部		
元本等		
元本	22,339,249,887	22,295,663,164
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	155,765,988,346	172,414,301,623
元本等合計	178,105,238,233	194,709,964,787
純資産合計	178,105,238,233	194,709,964,787
負債純資産合計	179,611,873,970	196,687,462,816

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年11月22日 至 2023年5月21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	<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21日現在)	(2023年5月21日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	22,339,249,887口	22,295,663,164口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 7.9727円 (1万口当たりの純資産額79,727円)	1口当たり純資産額 8.7331円 (1万口当たりの純資産額87,331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21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21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	356,782,353	-	356,510,334	272,019
	小計	356,782,353	-	356,510,334	272,019
	売建				
	香港・ドル	3,362,456	-	3,365,832	3,376
	イギリス・ポンド	227,819,897	-	227,429,821	390,076
小計	231,182,353	-	230,795,653	386,700	
合計		587,964,706	-	587,305,987	114,681

(2023年5月21日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

	契約額等		

区 分	種 類		うち 1年超	時 価	評価損益
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	420,810	-	422,528	1,718
	スイス・フラン	120,205,177	-	121,098,090	892,913
	小計	120,625,987	-	121,520,618	894,631
	売建				
	アメリカ・ドル	357,005,177	-	358,812,927	1,807,750
	香港・ドル	420,810	-	423,264	2,454
小計	357,425,987	-	359,236,191	1,810,204	
合 計		478,051,974	-	480,756,809	915,573

## (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21日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	20,086,768,071円
同期中における追加設定元本額	5,486,985,341円
同期中における一部解約元本額	3,234,503,525円
2022年11月21日現在の元本の内訳	
大和住銀DC外国株式ファンド	8,755,404,666円
大和住銀DC年金設計ファンド30	23,863,967円
大和住銀DC年金設計ファンド50	171,500,976円
大和住銀DC年金設計ファンド70	202,319,043円
大和住銀DC海外株式アクティブファンド	10,200,320,038円
インターナショナル株式アクティブファンド(ラップ専用)	24,452,369円
大和住銀グローバルバランスファンドVA	1,467,998円
大和住銀/T・ロウ・プライス外国株式ファンドVA	580,041,909円

大和住銀グローバルバランスファンドSVA	55,847,296円
大和住銀外国株式ファンドMSVA(適格機関投資家限定)	68,900,036円
大和住銀年金設計ファンド30VA(適格機関投資家専用)	74,054円
大和住銀年金設計ファンド50VA(適格機関投資家専用)	1,614,678円
大和住銀年金設計ファンド70VA(適格機関投資家専用)	765,440円
大和住銀バランスファンド60(適格機関投資家限定)	25,998,722円
大和住銀世界資産バランスVA(適格機関投資家限定)	841,348円
インターナショナル株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	2,225,837,347円
合計	22,339,249,887円

(2023年5月21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	22,339,249,887円
同期中における追加設定元本額	1,810,353,101円
同期中における一部解約元本額	1,853,939,824円
2023年5月21日現在の元本の内訳	
大和住銀DC外国株式ファンド	8,683,981,143円
大和住銀DC年金設計ファンド30	24,187,480円
大和住銀DC年金設計ファンド50	170,805,037円
大和住銀DC年金設計ファンド70	200,583,254円
大和住銀DC海外株式アクティブファンド	10,723,650,313円
インターナショナル株式アクティブファンド(ラップ専用)	26,299,696円
大和住銀グローバルバランスファンドVA	1,390,514円
大和住銀/T・ロウ・プライス外国株式ファンドVA	536,339,571円
大和住銀グローバルバランスファンドSVA	61,288,930円
大和住銀外国株式ファンドMSVA(適格機関投資家限定)	57,897,262円
大和住銀年金設計ファンド30VA(適格機関投資家専用)	74,584円
大和住銀年金設計ファンド50VA(適格機関投資家専用)	1,761,306円
大和住銀年金設計ファンド70VA(適格機関投資家専用)	736,679円
大和住銀バランスファンド60(適格機関投資家限定)	25,925,616円
大和住銀世界資産バランスVA(適格機関投資家限定)	829,312円
インターナショナル株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	1,779,912,467円
合計	22,295,663,164円

## インターナショナル債券マザーファンド

### (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年11月21日現在)	(2023年5月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	178,313,509	113,438,416
金銭信託	4,650,677	3,804,568
コール・ローン	113,244,688	113,551,550
国債証券	5,548,355,898	5,532,990,366
地方債証券	23,051,632	23,402,501
特殊債券	73,702,171	266,393,957

社債券	284,158,899	259,483,704
派生商品評価勘定	142,009,659	102,668,229
未収入金	151,255,554	109,487,938
未収利息	21,654,079	44,838,450
前払費用	17,206,790	17,540,146
差入委託証拠金	43,235,051	102,670,836
流動資産合計	6,600,838,607	6,690,270,661
資産合計	6,600,838,607	6,690,270,661
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	111,676,349	120,839,043
未払金	131,937,150	31,158,700
未払解約金	50,280,031	54,376,900
その他未払費用	326	260
流動負債合計	293,893,856	206,374,903
負債合計	293,893,856	206,374,903
純資産の部		
元本等		
元本	2,076,830,334	2,122,112,604
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,230,114,417	4,361,783,154
元本等合計	6,306,944,751	6,483,895,758
純資産合計	6,306,944,751	6,483,895,758
負債純資産合計	6,600,838,607	6,690,270,661

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年11月22日 至 2023年5月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

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21日現在)	(2023年5月21日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,076,830,334口	2,122,112,604口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.0368円 (1万口当たりの純資産額30,368円)	1口当たり純資産額 3.0554円 (1万口当たりの純資産額30,554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21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
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21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		
	債券先物取引 買建 US LONG BOND(CBT) DEC22	324,232,691	-	299,308,928	24,923,763

市場取引	AUST 10Y BOND FUT DEC22	87,215,572	-	89,573,621	2,358,049
	EURO-BOBL FUTURE DEC22	470,688,404	-	468,676,117	2,012,287
	EURO-BUND FUTURE DEC22	218,770,116	-	223,294,124	4,524,008
	小計	1,100,906,783	-	1,080,852,790	20,053,993
	売建				
	US 2YR NOTE(CBT) DEC22	2,282,331,517	-	2,265,593,498	16,738,019
	CAN 10YR BOND FUT DEC22	164,505,534	-	169,978,208	5,472,674
	AUST 3Y BOND FUTURE DEC22	220,355,541	-	221,592,992	1,237,451
	LONG GILT FUTURE DEC22	128,184,391	-	123,259,941	4,924,450
	EURO-BTP FUTURE DEC22	101,572,794	-	103,602,866	2,030,072
	EURO-SCHATZ FUT DEC22	2,512,454,285	-	2,490,911,564	21,542,721
	小計	5,409,404,062	-	5,374,939,069	34,464,993
	合 計	6,510,310,845	-	6,455,791,859	14,411,000

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	1,153,576,613	-	1,109,887,793	43,688,820
	カナダ・ドル	89,343,042	-	87,293,889	2,049,153
	オーストラリア・ドル	33,924,440	-	33,288,243	636,197
	ニュージーランド・ドル	78,907,969	-	78,433,507	474,462
	イギリス・ポンド	221,522,030	-	215,028,483	6,493,547
	イスラエル・シケル	20,631,813	-	20,239,603	392,210
	スイス・フラン	68,009,443	-	66,712,031	1,297,412
	ノルウェー・クローネ	16,062,578	-	15,390,939	671,639
	スウェーデン・クローナ	33,182,309	-	31,776,147	1,406,162
	メキシコ・ペソ	23,352,886	-	22,844,337	508,549
	チェコ・コルナ	64,440,123	-	63,060,151	1,379,972
	オフショア・人民元	157,068,220	-	151,543,815	5,524,405



市場取引以外の取引	マレーシア・リン	19,127,447	-	18,654,914	472,533
	ギット				
	タイ・パーツ	65,089,171	-	63,589,020	1,500,151
	ユーロ	758,699,610	-	758,954,177	254,567
	小計	2,802,937,694	-	2,736,697,049	66,240,645
	売建				
	アメリカ・ドル	1,834,338,081	-	1,755,831,912	78,506,169
	オーストラリア・ドル	50,311,351	-	49,737,739	573,612
	シンガポール・ドル	63,314,464	-	61,347,219	1,967,245
	ニュージーランド・ドル	99,023,782	-	102,676,438	3,652,656
	イスラエル・シケル	27,639,882	-	27,241,650	398,232
	スイス・フラン	66,660,820	-	66,712,031	51,211
	スウェーデン・クローナ	15,622,681	-	15,841,471	218,790
	チェコ・コルナ	62,355,299	-	63,060,151	704,852
	タイ・パーツ	63,360,400	-	63,589,020	228,620
	ポーランド・ズロチ	38,136,727	-	36,737,750	1,398,977
	ユーロ	371,134,906	-	366,960,055	4,174,851
	小計	2,691,898,393	-	2,609,735,436	82,162,957
	合計	5,494,836,087	-	5,346,432,485	15,922,312

(2023年5月21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	債券先物取引				
	買建				
	US 10YR NOTE (CBT) JUN23	297,860,640	-	299,590,621	1,729,981
	US 10yr Ultra Fut JUN23	420,249,217	-	413,229,560	7,019,657
	US 5YR NOTE(CBT) JUN23	925,704,520	-	919,760,402	5,944,118
	US LONG BOND(CBT) JUN23	278,490,487	-	283,256,065	4,765,578
	CAN 10YR BOND FUT JUN23	89,244,033	-	88,097,373	1,146,660
	AUST 10Y BOND FUT JUN23	99,176,397	-	99,988,323	811,926
	EURO-BOBL FUTURE JUN23	991,735,250	-	997,486,862	5,751,612

	EURO-BTP FUTURE JUN23	121,440,850	-	118,875,533	2,565,317
	EURO-BUND FUTURE JUN23	122,647,328	-	119,943,447	2,703,881
	小計	3,346,548,722	-	3,340,228,186	6,320,536
	売建				
	US 2YR NOTE(CBT) JUN23	1,610,972,432	-	1,619,539,735	8,567,303
	AUST 3Y BOND FUTURE JUN23	347,088,088	-	346,802,258	285,830
	LONG GILT FUTURE JUN23	417,450,290	-	408,233,112	9,217,178
	EURO BUXL 30Y BND JUN23	126,076,450	-	119,504,946	6,571,504
	小計	2,501,587,260	-	2,494,080,051	7,507,209
	合 計	5,848,135,982	-	5,834,308,237	1,186,673

## (注) 1. 時価の算定方法

債券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)債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	2,283,071,214	-	2,334,772,731	51,701,517
	カナダ・ドル	184,907,299	-	188,391,766	3,484,467
	ニュージーランド・ドル	5,092,240	-	5,211,822	119,582
	イギリス・ポンド	98,556,089	-	100,670,224	2,114,135
	イスラエル・シケル	94,393,692	-	96,623,058	2,229,366
	ノルウェー・クローネ	10,774,216	-	10,531,648	242,568
	スウェーデン・クローナ	46,187,296	-	46,208,769	21,473
	オフショア・人民元	336,411,912	-	336,823,814	411,902
	マレーシア・リンギット	18,543,050	-	18,479,644	63,406
	タイ・バーツ	17,155,007	-	16,862,130	292,877
	ポーランド・ズロチ	30,877,945	-	30,822,099	55,846

市場取引以 外の取引	ハンガリー・フォリ ント	61,509,043	-	62,210,562	701,519
	ユーロ	910,734,864	-	913,532,934	2,798,070
	小計	4,098,213,867	-	4,161,141,201	62,927,334
	売建				
	アメリカ・ドル	2,045,204,653	-	2,090,682,943	45,478,290
	カナダ・ドル	99,182,500	-	98,697,500	485,000
	オーストラリア・ド ル	54,562,910	-	54,415,855	147,055
	シンガポール・ドル	49,263,764	-	49,423,716	159,952
	ニュージーランド・ ドル	390,993,290	-	403,787,445	12,794,155
	イギリス・ポンド	526,252,916	-	538,593,079	12,340,163
	イスラエル・シユケ ル	136,117,740	-	139,525,108	3,407,368
	スイス・フラン	62,004,900	-	66,398,400	4,393,500
	デンマーク・クロー ネ	6,019,200	-	6,040,206	21,006
	スウェーデン・ク ローナ	32,216,360	-	32,340,460	124,100
	メキシコ・ペソ	206,232,480	-	212,410,402	6,177,922
	ハンガリー・フォリ ント	112,789,932	-	110,415,870	2,374,062
	ユーロ	211,147,921	-	211,542,401	394,480
	小計	3,931,988,566	-	4,014,273,385	82,284,819
	合 計	8,030,202,433	-	8,175,414,586	19,357,485

## (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あります。

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あります。

- ・ 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21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	1,975,527,227円
同期中における追加設定元本額	249,481,116円
同期中における一部解約元本額	148,178,009円
2022年11月21日現在の元本の内訳	
大和住銀DC外国債券ファンド	1,286,944,112円
大和住銀DC年金設計ファンド30	132,676,671円
大和住銀DC年金設計ファンド50	301,070,606円
大和住銀DC年金設計ファンド70	302,588,405円
大和住銀/T・ロウ・プライス外国債券ファンドVA	14,632,856円
大和住銀年金設計ファンド30VA（適格機関投資家専用）	416,606円
大和住銀年金設計ファンド50VA（適格機関投資家専用）	2,993,707円
大和住銀年金設計ファンド70VA（適格機関投資家専用）	1,038,384円
大和住銀バランスファンド60（適格機関投資家限定）	32,317,543円
大和住銀世界資産バランスVA（適格機関投資家限定）	2,151,444円
合計	2,076,830,334円

(2023年5月21日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,076,830,334円
同期中における追加設定元本額	114,773,413円
同期中における一部解約元本額	69,491,143円
2023年5月21日現在の元本の内訳	
大和住銀DC外国債券ファンド	1,334,461,708円
大和住銀DC年金設計ファンド30	134,519,551円
大和住銀DC年金設計ファンド50	299,728,372円
大和住銀DC年金設計ファンド70	300,075,448円
大和住銀/T・ロウ・プライス外国債券ファンドVA	14,522,041円
大和住銀年金設計ファンド30VA（適格機関投資家専用）	419,559円
大和住銀年金設計ファンド50VA（適格機関投資家専用）	3,093,490円
大和住銀年金設計ファンド70VA（適格機関投資家専用）	959,548円
大和住銀バランスファンド60（適格機関投資家限定）	32,215,001円
大和住銀世界資産バランスVA（適格機関投資家限定）	2,117,886円
合計	2,122,112,604円

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 大和住銀DC年金設計ファンド30

2023年6月30日現在

資産総額	4,225,793,591円
負債総額	9,872,195円
純資産総額（ - ）	4,215,921,396円
発行済口数	2,057,956,949口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	2.0486円 (20,486円)

## 大和住銀DC年金設計ファンド50

2023年6月30日現在

資産総額	9,899,861,401円
負債総額	19,435,285円
純資産総額（ - ）	9,880,426,116円
発行済口数	3,512,950,710口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	2.8126円 (28,126円)

## 大和住銀DC年金設計ファンド70

2023年6月30日現在

資産総額	10,237,681,108円
負債総額	38,698,765円
純資産総額（ - ）	10,198,982,343円
発行済口数	2,652,156,669口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	3.8455円 (38,455円)

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

## イ 名義書換

該当事項はありません。

## ロ 受益者名簿

作成しません。

## 八 受益者に対する特典

ありません。

## 二 受益権の譲渡および譲渡制限等

### (イ) 受益権の譲渡

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

### (ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

## ホ 受益権の再分割

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

## ヘ 償還金

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

## ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### イ 資本金の額および株式数

	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

###### ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

##### 八 会社の機構

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

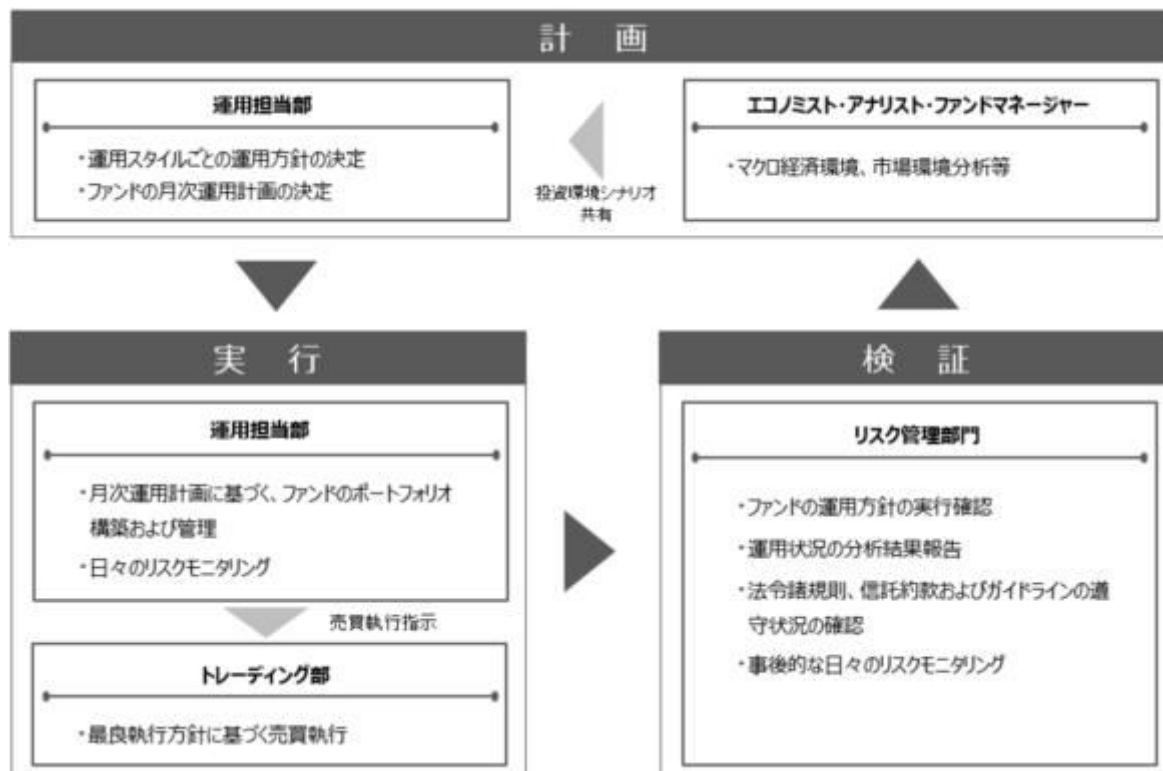
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

##### 二 投資信託の運用の流れ



##### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

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【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
未払金		
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
未払費用	7,379,404	6,370,986
未払消費税等	1,133,332	406,770
未払法人税等	2,455,291	333,009
賞与引当金	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
流動負債合計	18,918,667	14,598,465
固定負債		
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	-
固定負債合計	6,373,062	5,580,287
負債合計	25,291,730	20,178,752
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984

その他資本剰余金	73,466,962	73,466,962
資本剰余金合計	82,095,946	82,095,946
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	3,834,794	3,391,568
利益剰余金合計	4,119,040	3,675,814
株主資本計	88,214,986	87,771,760
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	297,138	142,558
評価・換算差額等合計	297,138	142,558
純資産合計	88,512,124	87,629,201
負債・純資産合計	113,803,855	107,807,953

## (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	(自	2022年4月1日
	至	2022年3月31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		
1 固定資産除却損	83,651	13,203
2 システム統合関連費用	375,636	-
3 早期退職費用	260,075	126,832
4 支払補償費	-	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	
	資本剰余金	利益剰余金

	資本金	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		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311
当期変動額					
剰余金の配当					
欠損填補	8,460,037	-			-
当期純利益	4,119,040	4,119,040			4,119,040
任意積立金の取崩	-	-			-
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			652,227	652,227	652,227
当期変動額合計	12,579,078	4,119,040	652,227	652,227	3,466,812
当期末残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124

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	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124
当期変動額					
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いません。

## (貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (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、資金調達は行っていません。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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)
其他有価証券 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			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
(1) 金銭の信託	-	12,645,575	-	12,645,575
(2) 投資有価証券 其他有価証券	-	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 其他有価証券

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. 其他有価証券

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

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

	前事業年度 (自 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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
  - (イ) 定款の変更  
該当ありません。
  - (ロ) その他の重要事項  
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。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円（2022年3月末現在）
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## 〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 株式会社日本カストディ銀行
- ・ 資本金の額 51,000百万円（2022年3月末現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## ロ 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 2022年3月末現在	事業の内容
株式会社三井住友銀行	1,770,996	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
大和証券株式会社	100,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## ハ 投資顧問会社（運用の委託先）

名称	資本金の額 2023年3月末現在	事業の内容
ティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インク	24.5百万米ドル	投資運用業を営んでいます。
ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド	174.1百万米ドル	投資運用業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

## イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

## ロ 販売会社

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

## ハ 投資顧問会社（運用の委託先）

委託会社との間で締結される投資一任契約（運用委託契約）に基づき、当ファンドの主要投資対象のうちインターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンド

の運用指図に関する権限の委託を受け、信託財産の運用を行います。

### 3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）

該当事項はありません。

### 第3【その他】

- 1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について
  - (1) 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。
  - (2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。
  - (3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス（これらのアドレスをコード化した図形等も含む）を記載することがあります。
  - (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
  - (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
  - (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
  - (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべき旨を記載することがあります。
  - (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
  - (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
  - (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
  - (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
- 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
- 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。
- 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
- 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書（交付目論見書）および投資信託説明書（請求目論見書）を一体のものとして使用することがあります。



**独立監査人の監査報告書**

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。

**独立監査人の監査報告書**

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**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」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド30の2021年11月20日から2022年11月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀DC年金設計ファンド30の2022年11月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）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。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

**財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記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。

**独立監査人の監査報告書**

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**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」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド50の2021年11月20日から2022年11月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀DC年金設計ファンド50の2022年11月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）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。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

**財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記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。

**独立監査人の監査報告書**

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

**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」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド70の2021年11月20日から2022年11月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀DC年金設計ファンド70の2022年11月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）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。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

**財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記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2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」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド30の2022年11月22日から2023年5月21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、大和住銀DC年金設計ファンド30の2023年5月21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11月22日から2023年5月21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21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2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2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」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド50の2022年11月22日から2023年5月21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、大和住銀DC年金設計ファンド50の2023年5月21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11月22日から2023年5月21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21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2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2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」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド70の2022年11月22日から2023年5月21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、大和住銀DC年金設計ファンド70の2023年5月21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11月22日から2023年5月21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21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2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。