

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年12月20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】	三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル1（保守型） 三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル2（安定型） 三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型） 三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル4（成長型） 三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）
【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】	(1)当初自己設定額 三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル1（保守型） 100万円を上限とします。 三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル2（安定型） 100万円を上限とします。 三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型） 100万円を上限とします。 三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル4（成長型） 100万円を上限とします。 三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型） 100万円を上限とします。 (2)継続申込額 三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル1（保守型） 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル2（安定型） 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型） 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル4（成長型） 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型） 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2023年3月8日付をもって提出しました有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について、2023年12月20日に半期報告書を提出したことに伴う関係情報の更新、ファンド情報の更新等を行うため、本訂正届出書により訂正を行うものです。

2【訂正の内容】

<訂正前> および<訂正後> に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新後> に記載している内容は原届出書が更新されます。

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】

（2）【ファンドの沿革】

<更新後>

2023年3月24日 信託契約締結、設定、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

<更新後>

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」

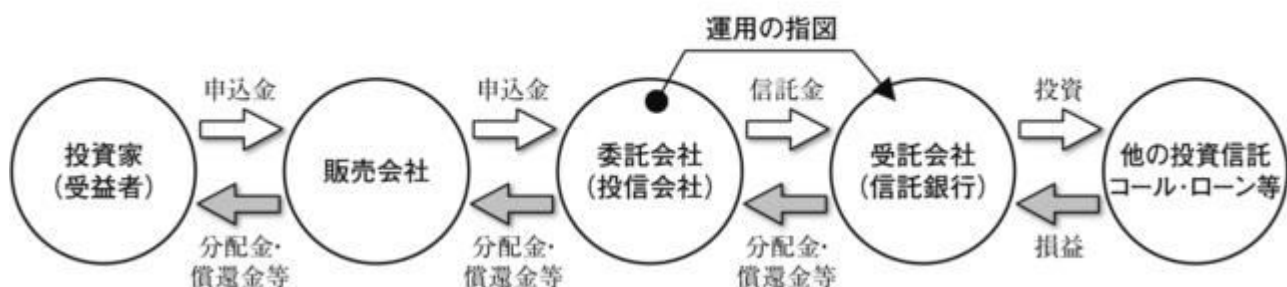
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

（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。

委託会社は販売会社としての役割も有する場合があります。

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10月31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

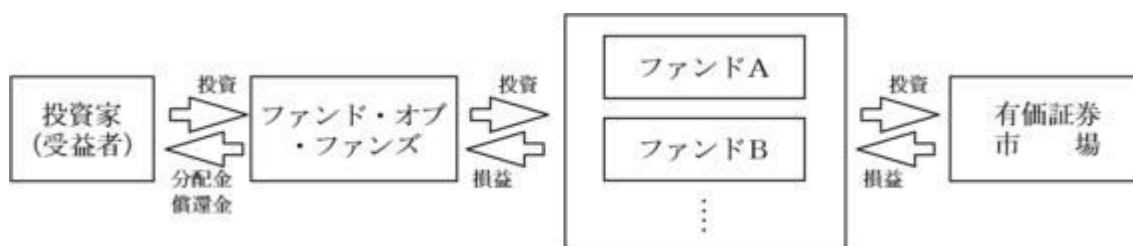
(2023年10月31日現在)

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（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

一般に、「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券などの有価証券に直接投資するのではなく、複数の他の投資信託（ファンド）を組み入れることにより運用を行います（投資信託に投資する投資信託）。また、種々の特長を持った投資信託を購入することにより、効率的に資産配分を行います。

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

<更新後>

イ 基本方針

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式、不動産投資信託（リート）、商品等に分散投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。

□ 投資態度

- (イ) 主として、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式、不動産投資信託（リート）、商品等に分散投資することにより、各ファンド以下の運用を行います。
- レベル1（保守型） 信託財産の安定的な成長を目指して保守的な運用を行います。
- レベル2（安定型） 信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。
- レベル3（安定成長型） 信託財産の成長と安定的な収益の確保をバランスよく目指して運用を行います。
- レベル4（成長型） 信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。
- レベル5（積極成長型） 信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。
- (ロ) マクロ経済見通しおよび定量分析より推計した各資産の中長期的な期待収益率に基づいて、ファンドの期待リターンを設定し、最適な投資配分比率を決定します。
- 期待リターンは市場環境等に応じて見直しを行う場合があります。
- (ハ) 実質外貨建資産に対して対円での為替ヘッジを行うことがあります。
- (ニ) 投資対象とする投資信託証券は、投資対象資産、投資手法および費用等を考慮して選定します。また、継続的にモニタリングを行い必要な場合は見直しを行います。
- (ホ) 投資信託証券への投資は、高位を保つことを原則とします。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等によっては、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

各ファンドは、三井住友DSアセットマネジメント株式会社が提供する投資一任運用サービス「MY GOALS (マイ ゴールズ)」の専用ファンドです。

MY GOALS(マイ ゴールズ)とは

三井住友DSアセットマネジメント株式会社がお客さまとの間で投資一任契約を締結し、アドバイザーである提携金融機関等を通じて、将来の目標(ゴール)を起点とする資産運用プランの策定ならびにゴールの実現に向けた継続的なアフターフォローを行うサービスです。

2

投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式、不動産投資信託（リート）、商品等に分散投資します。

■投資対象とする投資信託証券は、投資対象資産、投資手法および費用等を考慮して選定します。また、継続的にモニタリングを行い必要な場合は見直しを行います。

3

マクロ経済見通しおよび定量分析より推計した各資産の中長期的な期待収益率に基づいて、各ファンドの期待リターン*を設定し、最適な資産配分比率を決定します。

*期待リターンは市場環境等に応じて見直しを行う場合があります。

期待リターンとは

各ファンドが目標とするリターンの目安を示したものであり、一定の収益を得ることができる運用を意味するものではなく、またその達成を示唆あるいは保証するものではありません。

4

実質外貨建資産に対して対円での為替ヘッジを行うことがあります。

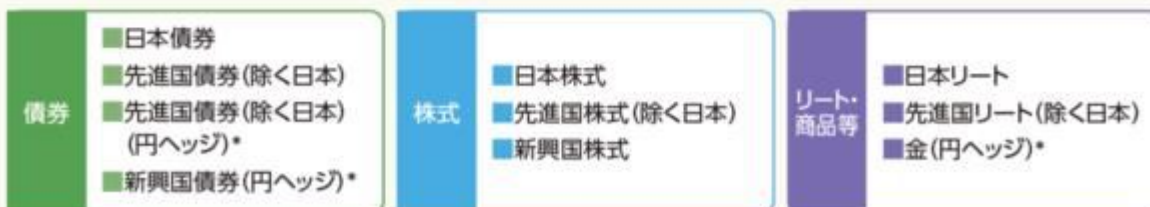
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドのしくみ

■ ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



■ 投資対象資産の詳細は、以下の通りです。ただし、すべての資産に投資するとは限りません。



* 先進国債券(除く日本)(円ヘッジ)、新興国債券(円ヘッジ)および金(円ヘッジ)は、実質的に対円での為替ヘッジを行います。

※上記の投資対象資産は2023年10月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

運用プロセス

- 世界各国の債券、株式、不動産投資信託（リート）および商品等を投資対象とし、マクロ経済見通しおよび定量分析を用いた委託会社独自の手法により、資産配分比率を決定し、ポートフォリオを構築します。



※上記の運用プロセスは2023年10月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

（参考情報）

▶投資一任運用サービス「MY GOALS（マイ ゴールズ）」について

- 「MY GOALS（マイ ゴールズ）」は、将来の目標（ゴール）を起点とする資産運用プランの策定ならびにゴールの実現に向けた継続的なアフターフォローを行う投資一任運用サービスです。

- お客さま（投資者）は、提携金融機関等（アドバイザー）を通じて、投資一任業者である三井住友DSアセットマネジメント株式会社と投資一任契約を締結していただけます。
- 投資一任業者は提携金融機関等（アドバイザー）を通じて、資産運用プランの策定ならびにゴールの実現に向けた継続的なアフターフォローを行います。
- 投資一任業者は、お客さま（投資者）に開設いただいた口座において、契約資産の運用を行います。



（2）【投資対象】

< 更新後 >

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンド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。

(イ) 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいいます。以下同じ。)

1. 有価証券
2. 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。)
3. 金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、投資信託証券および次の有価証券(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. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
3. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
4. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人が発行する債券および社債券(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の新株引受権証券および短期社債等を除きます。)

なお、第4号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引(売戻条件付の買入れ)および債券貸借取引(現金担保付債券借入れ)に限り行うことができます。

ハ 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記ロに掲げる有価証券のほか、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

〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

以下は、2023年10月末現在で知り得る情報に基づくものであり、今後、変更される場合があります。

- すべての投資信託に投資するとは限りません。

▶ 債券

日本債券

ファンド名	国内債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指します。 ● 日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.03%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

先進国債券(除く日本)

ファンド名	外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● 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、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ● ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 ● 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

為替ヘッジ付き先進国債券(除く日本)

ファンド名	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ換算ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ● ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 ● 保有する外貨建資産については、対円での為替のフルヘッジを原則とします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

新興国債券

ファンド名	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。 ● 米ドル建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。 ● 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.2%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

▶ 株式

日本株式

ファンド名	国内株式インデックス・マザーファンド(8号)
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	主としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

先進国株式(除く日本)

ファンド名	外国株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● 主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。 ● 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

新興国株式

ファンド名	エマージング株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として新興国の株式、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券等に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

▶ リート・商品等

日本リート

ファンド名	Jリート・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> 東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目指します。 日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託(リート)を主要投資対象とします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

先進国リート(除く日本)

ファンド名	外国リート・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。 日本を除く世界各国の不動産投資信託(リート)などを主要投資対象とします。 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

金	
ファンド名	ゴールド・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● 金地金価格との連動を目指す投資信託証券*に投資し、LBMA金価格（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。 ● *投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性および運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。 ● *投資対象とする投資信託証券は、以下の通りです。 [iShares Gold Trust] [SPDR Gold MiniShares Trust] ただし、一部の投資信託証券のみの投資となる場合があります。 ● 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	ありません。
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

■ゴールド・インデックス・マザーファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

ファンド名	iShares Gold Trust (iシェアーズ ゴールド・トラスト)	SPDR Gold MiniShares Trust (SPDR® ゴールド・ミニシェアーズ・トラスト)
形態	米国籍上場投資信託(米ドル建て)	米国籍上場投資信託(米ドル建て)
管理会社	iShares デラウェア・トラスト・スポンサー・エルエルシー	WGC USAアセット・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
運用の基本方針	金地金価格の変動に概ね連動することを目標とします。	金地金の価格のパフォーマンスを反映させることを目標とします。
ベンチマーク	LBMA 金価格	LBMA 金価格
管理費用 ^{*1}	年0.25%	年0.10%
購入の可否 ^{*2}	日本において一般投資者の購入が可能です。	日本において一般投資者の購入が可能です。

- *1 管理費用とは各上場投資信託（以下「ETF」といいます。）の運用管理費用およびその他費用を各ETFの平均純資産総額で除いたもので、本書の数値は各ETFの直近の目論見書等で開示されているものです。
- *2 外国籍のETFは、海外の上場有価証券を取り次ぐことのできる証券会社を通じて、日本国内の一般の投資者が、直接、購入することができる場合があります。直接購入される際は、売買委託手数料（証券会社ごとに異なります。）がかかります。また、円貨と外貨を交換する際に、証券会社が別途定める手数料がかかります。



指数の著作権など

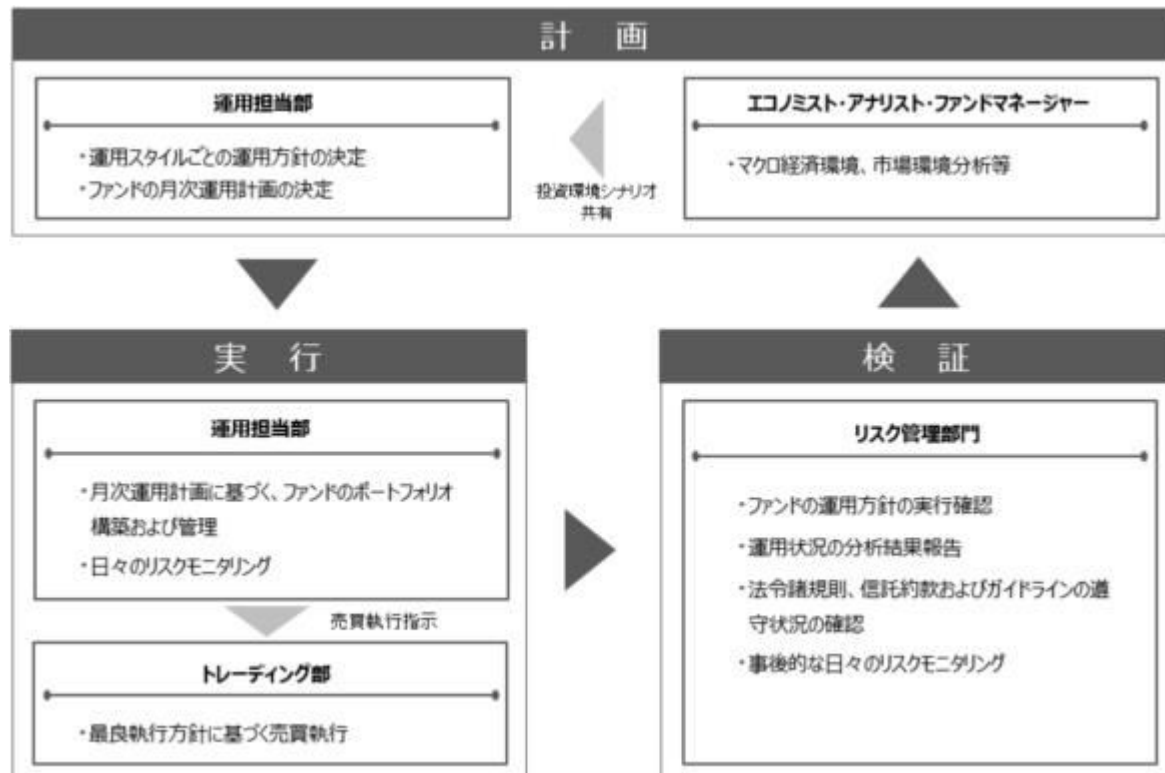
- NOMURA-BPIは野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社、FTSE世界国債インデックスはFTSE Fixed Income LLC、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスはJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー、TOPIX(東証株価指数)および東証REIT指数は株式会社JPX総研、MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスはMSCI Inc.、S&P先進国REIT指数はS&P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLC、LBMA金価格はICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドが、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知的所有権その他一切の権利は、指数を公表する各社に帰属します。また、当該各社は各ファンドの運用に関して責任を負うものではありません。

※上記は、2023年10月末現在における投資対象とする投資信託であり、今後変更となる場合があります。

(3) 【運用体制】

<更新後>

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。

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。

他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）の組入れは、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、投資対象としての適格性を定期的に判断します。

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。

3【投資リスク】

<更新後>

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）不動産投資信託（リート）に関するリスク

リーツの価格は、不動産市況や金利・景気動向、関連法制度の変更等の影響を受け変動します。また、リートに組み入れられている個々の不動産等の市場価値や賃貸収入、個々のリーツの事業活動や財務状況等によっても価格が変動します。これらにより、ファンドが組み入れているリーツの価格が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ニ）商品（コモディティ）に関するリスク

商品市況は、多くの要因により変動します。要因の主なものとしては、対象となる商品の需給、貿易動向、天候、農業生産、商品産出地域の政治・経済情勢、疫病の発生などが挙げられます。商品市況の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ホ）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。

（ヘ）為替変動リスク

ファンドは外貨建資産の一部について、対円で為替ヘッジを行います。

為替ヘッジが行われていない部分について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。

為替ヘッジを行う部分については為替変動の影響を受けますが、原則として対円で為替ヘッジを行うため、その影響は限定的と考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。対円で為替ヘッジ比率は、資産配分の調整に伴い変動します。なお、円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。また、需給要因等によっては金利差相当分以上にヘッジコストがかかる場合があります。

（ト）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。

特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

（チ）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）投資信託に関する留意点**

・当ファンドは一部、実質的に「ファミリーファンド方式」により運用します。そのため、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

により資金の流出が生じた場合、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生じた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。

(ロ) 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）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。

■ レベル1（保守型）

年間騰落率：
該当事項はありません

分配金再投資基準価額：
2023年3月～2023年10月



「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：
該当事項はありません

他の資産クラス：
2018年11月～2023年10月



■ レベル2（安定型）

年間騰落率：
該当事項はありません

分配金再投資基準価額：
2023年3月～2023年10月



ファンド：
該当事項はありません

他の資産クラス：
2018年11月～2023年10月



※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。

※ファンド設定から1年未満のため、ファンドの騰落率はありません。

※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。

■ レベル3 (安定成長型)

年間騰落率：
該当事項はありません

分配金再投資基準価額：
2023年3月～2023年10月



「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：
該当事項はありません

他の資産クラス：
2018年11月～2023年10月



■ レベル4 (成長型)

年間騰落率：
該当事項はありません

分配金再投資基準価額：
2023年3月～2023年10月



※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。

※ファンド設定から1年未満のため、ファンドの騰落率はありません。

※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。

■ レベル5（積極成長型）

年間騰落率：
該当事項はありません

分配金再投資基準価額：
2023年3月～2023年10月



※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：
該当事項はありません

他の資産クラス：
2018年11月～2023年10月



※ファンド設定から1年未満のため、ファンドの騰落率はありません。

※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J P X 総研または株式会社J P X 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が算出、公表する指数で、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所有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】

(3)【信託報酬等】

<更新後>

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。

<信託報酬率およびその配分、実質的な負担>

ファンド名	信託報酬率	配分（税抜き）				投資対象とする投資信託 ^{*1*2}	実質的な負担 ^{*2}	
		委託会社		提携金融機関等 （アドバイザー）	販売会社			受託会社
		運用報酬	投資一任報酬	投資一任報酬				
レベル1 （保守型）	年1.628% （税抜き1.48%）	年0.65%		年0.75%	年0.05%	年0.03%	年0.015% 程度	年1.643% （税抜き1.495%） 程度
		年0.05%	年0.60%					
レベル2 （安定型）	年1.738% （税抜き1.58%）	年0.75%		年0.75%	年0.05%	年0.03%	年0.0175% 程度	年1.7555% （税抜き1.5975%） 程度
		年0.15%	年0.60%					
レベル3 （安定成長型）	年1.793% （税抜き1.63%）	年0.80%		年0.75%	年0.05%	年0.03%	年0.02% 程度	年1.813% （税抜き1.65%） 程度
		年0.20%	年0.60%					
レベル4 （成長型）	年1.793% （税抜き1.63%）	年0.80%		年0.75%	年0.05%	年0.03%	年0.0225% 程度	年1.8155% （税抜き1.6525%） 程度
		年0.20%	年0.60%					
レベル5 （積極成長型）	年1.793% （税抜き1.63%）	年0.80%		年0.75%	年0.05%	年0.03%	年0.025% 程度	年1.818% （税抜き1.655%） 程度
		年0.20%	年0.60%					

* 1 各ファンドが投資対象とする投資信託では、信託報酬は収受されません。ただし、ゴールド・インデックス・マザーファンドが投資対象とする投資信託（以下、ETF）では、管理費用がかかります。

* 2 各ファンドにおいてゴールド・インデックス・マザーファンドを資産配分の上限比率で保有し、かつ管理費用が最大のETFを組み入れた場合の試算です（2023年10月末現在）。なお、管理費用は、今後変更される場合があります。実質的な負担は、資産配分比率の見直し、実際の組入状況および投資対象とする投資信託の変更等により変動します。

提携金融機関等への投資一任報酬は委託会社が拠出する資金に対しては支払われません。

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

委託会社が販売会社として募集の取扱い等をした部分については、販売会社配分相当額も委託会社が収受します。

支払先	役務の内容	
委託会社	運用報酬	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
	投資一任報酬	投資一任契約に基づく契約資産の運用、契約資産の運用状況についての四半期毎の報告等の対価
提携金融機関等 （アドバイザー）	投資一任報酬	委託会社からの業務委託を受けた、投資一任契約の締結の媒介、資産運用プランの策定、ゴールの実現に向けた継続的なアフターフォロー等の対価
販売会社	交付運用報告書等各種書類の送付、投信口座および投資一任口座内のファンド管理等の対価	
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】

<更新後>

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用(消費税等相当額を含みます。)は、原則として、計算期間を通じて毎日、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。
- 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。

上記にかかる費用に関しましては、変更される場合があるものや、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るものがあります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額等を具体的に記載することはできません。

上記(1)~(4)にかかる手数料等および他の投資信託(ファンド)の組入れを通じて間接的に負担す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ったりすることから、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】

<更新後>

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。)

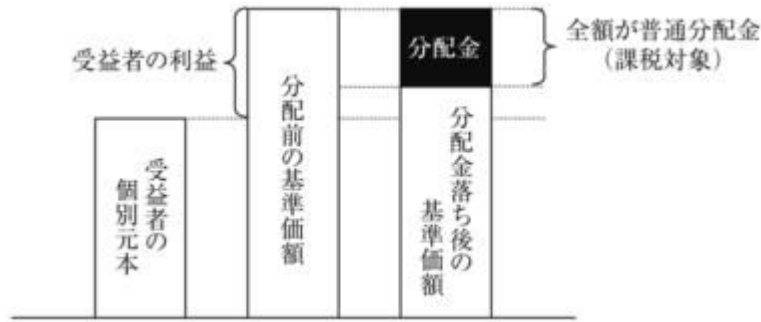
ロ 一部解約時および償還時の課税について

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。

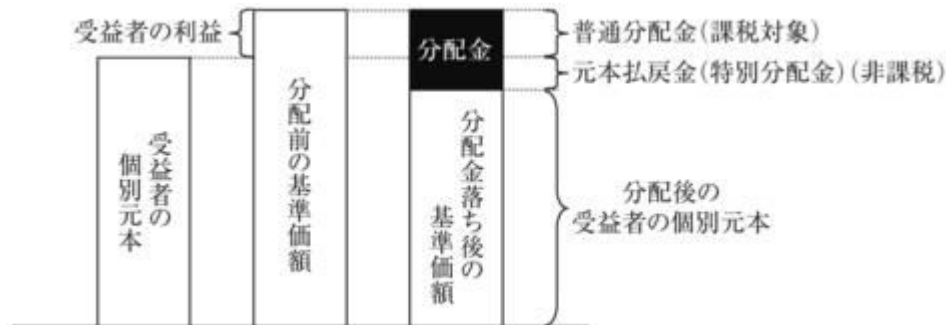
ハ 収益分配金の課税について

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。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。

公募株式投資信託は税法上、NISA（少額投資非課税制度）の適用対象であり、2024年1月1日以降は一定の要件を満たした場合に限りNISAの適用対象となります。当ファンドは、2024年1月1日以降のNISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象となる予定ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

NISA（少額投資非課税制度）、ジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）をご利用になる場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。また、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。

2024年1月1日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした公募株式投資信託等を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。なお、ジュニアNISAで新規の購入ができなくなります。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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10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】

<更新後>

(1)【投資状況】

三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）

2023年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	15,605,413	99.93
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	10,862	0.07
合計（純資産総額）		15,616,275	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。

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	-	146,496	0.94
為替予約取引	売建	-	685,686	4.39

三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）

2023年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	164,984,697	99.88
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	196,415	0.12
合計（純資産総額）		165,181,112	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	売建	-	16,630,703	10.07

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）

2023年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	584,829,896	100.01
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	30,235	0.01
合計（純資産総額）		584,799,661	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	売建	-	81,027,311	13.86

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）

2023年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	231,310,411	99.56
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,031,016	0.44
合計（純資産総額）		232,341,427	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	売建	-	39,212,474	16.88

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）

2023年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	90,129,496	99.76
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	215,631	0.24
合計（純資産総額）		90,345,127	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	売建	-	18,196,562	20.14

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）

イ 主要投資銘柄

2023年10月31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	国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド	4,695,828	1.2196	5,727,000	1.1895	5,585,687	35.77
日本	親投資 信託受 益証券	ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド	4,476,218	1.2211	5,466,044	1.1833	5,296,708	33.92
日本	親投資 信託受 益証券	国内株式イン デックス・マ ザーファンド (B号)	420,971	3.9663	1,669,678	3.9655	1,669,360	10.69
日本	親投資 信託受 益証券	外国債券パッシ ブ・マザーファ ンド	478,910	2.0921	1,001,949	2.0931	1,002,406	6.42
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式イン デックス・マ ザーファンド	107,460	7.0618	758,858	6.9481	746,642	4.78
日本	親投資 信託受 益証券	Jリート・イン デックス・マ ザーファンド	175,864	2.6213	461,000	2.5924	455,909	2.92
日本	親投資 信託受 益証券	ゴールド・イン デックス・マ ザーファンド	282,334	1.3457	379,927	1.4512	409,723	2.62
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	106,708	1.7943	191,467	1.7517	186,920	1.20
日本	親投資 信託受 益証券	米ドル建て新興 国債インデック ス・マザーファ ンド	174,501	0.9860	172,051	0.9808	171,150	1.10
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イン デックス・マ ザーファンド	30,148	2.8678	86,459	2.6837	80,908	0.52

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.93
合計	99.93

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）

イ 主要投資銘柄

2023年10月31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	ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド	31,874,235	1.2101	38,571,709	1.1833	37,716,782	22.83
日本	親投資 信託受 益証券	国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド	31,459,665	1.2155	38,237,962	1.1895	37,421,271	22.65
日本	親投資 信託受 益証券	国内株式イン デックス・マ ザーファンド （B号）	7,114,645	4.0182	28,588,333	3.9655	28,213,124	17.08
日本	親投資 信託受 益証券	Jリート・イン デックス・マ ザーファンド	5,669,694	2.6371	14,951,633	2.5924	14,698,114	8.90
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式イン デックス・マ ザーファンド	1,902,264	7.1457	13,592,946	6.9481	13,217,120	8.00
日本	親投資 信託受 益証券	外国債券パッシ ブ・マザーファ ンド	6,144,893	2.0951	12,874,096	2.0931	12,861,875	7.79
日本	親投資 信託受 益証券	ゴールド・イン デックス・マ ザーファンド	7,163,209	1.3559	9,712,881	1.4512	10,395,248	6.29
日本	親投資 信託受 益証券	米ドル建て新興 国債インデック ス・マザーファ ンド	6,341,154	0.9914	6,286,452	0.9808	6,219,403	3.77
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	1,777,388	1.7982	3,196,151	1.7517	3,113,450	1.88
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イン デックス・マ ザーファンド	420,431	2.8747	1,208,602	2.6837	1,128,310	0.68

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.88
合計	99.88

三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）

イ 主要投資銘柄

2023年10月31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	国内株式イン デックス・マ ザーファンド （B号）	31,458,980	4.0210	126,496,033	3.9655	124,750,585	21.33

日本	親投資 信託受 益証券	ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド	77,217,318	1.2126	93,633,840	1.1833	91,371,252	15.62
日本	親投資 信託受 益証券	国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド	76,202,407	1.2167	92,715,924	1.1895	90,642,763	15.50
日本	親投資 信託受 益証券	Jリート・イン デックス・マ ザーファンド	28,423,198	2.6327	74,829,269	2.5924	73,684,298	12.60
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式イン デックス・マ ザーファンド	8,492,860	7.1713	60,904,956	6.9481	59,009,240	10.09
日本	親投資 信託受 益証券	ゴールド・イン デックス・マ ザーファンド	32,246,424	1.3658	44,042,019	1.4512	46,796,010	8.00
日本	親投資 信託受 益証券	外国債券パッシ ブ・マザーファ ンド	21,228,132	2.0982	44,541,307	2.0931	44,432,603	7.60
日本	親投資 信託受 益証券	米ドル建て新興 国債インデック ス・マザーファ ンド	34,981,273	0.9934	34,750,017	0.9808	34,309,632	5.87
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	7,985,393	1.8089	14,444,979	1.7517	13,988,012	2.39
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イン デックス・マ ザーファンド	2,178,150	2.8827	6,278,973	2.6837	5,845,501	1.00

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10月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）

イ 主要投資銘柄

2023年10月31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	国内株式イン デックス・マ ザーファンド (B号)	14,672,224	4.0381	59,248,366	3.9655	58,182,704	25.04
日本	親投資 信託受 益証券	Jリート・イン デックス・マ ザーファンド	14,544,332	2.6370	38,352,831	2.5924	37,704,726	16.23

日本	親投資 信託受 益証券	外国株式イン デックス・マ ザーファンド	3,998,331	7.1643	28,645,380	6.9481	27,780,803	11.96
日本	親投資 信託受 益証券	ゴールド・イン デックス・マ ザーファンド	14,641,632	1.3574	19,874,447	1.4512	21,247,936	9.15
日本	親投資 信託受 益証券	ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド	17,817,734	1.2152	21,652,891	1.1833	21,083,724	9.07
日本	親投資 信託受 益証券	国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド	17,640,187	1.2176	21,478,098	1.1895	20,983,002	9.03
日本	親投資 信託受 益証券	米ドル建て新興 国債インデック ス・マザーファ ンド	18,825,302	0.9942	18,715,886	0.9808	18,463,856	7.95
日本	親投資 信託受 益証券	外国債券パッシ ブ・マザーファ ンド	7,944,636	2.0954	16,647,053	2.0931	16,628,917	7.16
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	3,776,993	1.8121	6,844,162	1.7517	6,616,158	2.85
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イン デックス・マ ザーファンド	975,737	2.9095	2,838,898	2.6837	2,618,585	1.13

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10月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.56
合計	99.56

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)

イ 主要投資銘柄

2023年10月31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	国内株式イン デックス・マ ザーファンド (B号)	6,576,072	3.9835	26,195,602	3.9655	26,077,413	28.86
日本	親投資 信託受 益証券	Jリート・イン デックス・マ ザーファンド	6,951,595	2.6330	18,303,804	2.5924	18,021,314	19.95
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式イン デックス・マ ザーファンド	1,820,029	7.0969	12,916,627	6.9481	12,645,743	14.00

日本	親投資 信託受 益証券	ゴールド・イン デックス・マ ザーファンド	6,330,237	1.3481	8,533,791	1.4512	9,186,439	10.17
日本	親投資 信託受 益証券	米ドル建て新興 国債インデック ス・マザーファ ンド	9,330,431	0.9881	9,219,058	0.9808	9,151,286	10.13
日本	親投資 信託受 益証券	外国債券パッシ ブ・マザーファ ンド	2,971,889	2.0859	6,198,940	2.0931	6,220,460	6.89
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	1,675,915	1.8048	3,024,758	1.7517	2,935,700	3.25
日本	親投資 信託受 益証券	国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド	1,980,079	1.2196	2,415,000	1.1895	2,355,303	2.61
日本	親投資 信託受 益証券	ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド	1,961,922	1.2187	2,391,000	1.1833	2,321,542	2.57
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イ ンデックス・マ ザーファンド	452,471	2.8990	1,311,699	2.6837	1,214,296	1.34

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.76
合計	99.76

【投資不動産物件】

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)

該当事項はありません。

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)

該当事項はありません。

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)

該当事項はありません。

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)

該当事項はありません。

三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）

2023年10月31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	983.00	146,247	146,496	0.94
	アメリカ・ドル	売建	4,601.00	680,520	685,686	4.39

(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。

三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）

2023年10月31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	売建	111,593.00	16,509,621	16,630,703	10.07

(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。

三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）

2023年10月31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	売建	543,698.00	80,526,178	81,027,311	13.86

(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。

三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）

2023年10月31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	売建	263,118.00	38,936,643	39,212,474	16.88

(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。

三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）

2023年10月31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	売建	122,100.00	18,070,306	18,196,562	20.14

(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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
2023年 3月末日	1,006,643	-	10,066	-
4月末日	1,013,532	-	10,135	-
5月末日	1,013,282	-	10,133	-
6月末日	5,032,008	-	10,309	-
7月末日	5,015,772	-	10,276	-
8月末日	11,055,486	-	10,243	-
9月末日	10,856,987	-	10,059	-
10月末日	15,616,275	-	9,922	-

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
2023年 3月末日	1,012,542	-	10,125	-
4月末日	1,024,988	-	10,250	-
5月末日	1,029,876	-	10,299	-
6月末日	11,593,356	-	10,549	-
7月末日	36,839,894	-	10,554	-
8月末日	85,838,376	-	10,542	-
9月末日	121,986,554	-	10,348	-
10月末日	165,181,112	-	10,207	-

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
2023年 3月末日	1,017,221	-	10,172	-
4月末日	1,032,468	-	10,325	-
5月末日	1,040,682	-	10,407	-

6月末日	79,229,948	-	10,702	-
7月末日	146,820,618	-	10,742	-
8月末日	281,101,545	-	10,746	-
9月末日	422,681,812	-	10,547	-
10月末日	584,799,661	-	10,401	-

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
2023年 3月末日	1,021,362	-	10,214	-
4月末日	1,039,230	-	10,392	-
5月末日	1,050,681	-	10,507	-
6月末日	30,194,904	-	10,859	-
7月末日	64,715,849	-	10,925	-
8月末日	126,590,002	-	10,942	-
9月末日	207,479,223	-	10,739	-
10月末日	232,341,427	-	10,578	-

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
2023年 3月末日	1,026,514	-	10,265	-
4月末日	1,046,394	-	10,464	-
5月末日	1,061,089	-	10,611	-
6月末日	28,357,190	-	11,019	-
7月末日	48,817,695	-	11,118	-
8月末日	76,275,632	-	11,150	-
9月末日	80,671,477	-	10,947	-
10月末日	90,345,127	-	10,775	-

【分配の推移】

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)

該当事項はありません。

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)

該当事項はありません。

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)

該当事項はありません。

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）

該当事項はありません。

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）

該当事項はありません。

【収益率の推移】

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）

	収益率（％）
第1期（中間期）	1.3

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

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）

	収益率（％）
第1期（中間期）	4.3

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

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）

	収益率（％）
第1期（中間期）	6.3

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

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）

	収益率（％）
第1期（中間期）	8.3

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

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）

	収益率（％）
第1期（中間期）	10.3

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

(4) 【設定及び解約の実績】

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	10,793,543	0

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	88,625,506	2,504,706

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	358,494,736	3,007,072

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	157,794,768	2,812,149

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期(中間期)	73,776,837	90,033

(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

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2023年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	264,056,034,550	97.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	5,867,041,389	2.17
合計(純資産総額)		269,923,075,939	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	5,837,860,000	2.16
合計	買建	-	5,837,860,000	2.16

外国株式インデックス・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	388,271,466,902	68.94
	イギリス	22,838,302,537	4.05
	カナダ	18,782,511,110	3.33
	スイス	17,603,068,435	3.13
	フランス	17,520,610,530	3.11
	ドイツ	13,018,365,214	2.31
	オーストラリア	10,224,077,152	1.82
	オランダ	10,076,508,868	1.79
	アイルランド	10,023,306,785	1.78
	デンマーク	5,399,344,910	0.96
	スウェーデン	4,451,344,663	0.79
	スペイン	4,080,277,419	0.72
	イタリア	3,048,936,055	0.54
	香港	2,824,204,986	0.50
	シンガポール	1,857,982,408	0.33
	ジャージー	1,833,131,908	0.33
	フィンランド	1,737,357,768	0.31
	ベルギー	1,204,422,359	0.21
	ノルウェー	1,127,529,976	0.20
	バミューダ	1,027,992,561	0.18
	イスラエル	997,181,287	0.18
	ケイマン諸島	890,359,464	0.16
	オランダ領キュ ラソー	887,059,395	0.16
	ニュージーラン ド	413,332,405	0.07
	オーストリア	307,632,832	0.05
	ポルトガル	287,038,166	0.05
	ルクセンブルグ	274,395,733	0.05
	リベリア	206,636,039	0.04
	パナマ	118,874,354	0.02
	マン島	70,013,481	0.01
小計	541,403,265,702	96.13	
投資証券	アメリカ	9,233,269,395	1.64
	オーストラリア	964,169,934	0.17
	シンガポール	206,764,755	0.04
	フランス	187,581,058	0.03
	イギリス	173,656,748	0.03
	香港	131,816,339	0.02
	カナダ	49,593,337	0.01
	ベルギー	48,624,073	0.01

	ケイマン諸島	42,797,443	0.01
	小計	11,038,273,082	1.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	10,783,213,519	1.91
合計(純資産総額)		563,224,752,303	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	イギリス	480,295,202	0.09
株価指数先物取引	買建	ドイツ	1,570,027,963	0.28
株価指数先物取引	買建	アメリカ	8,479,745,587	1.51
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	338,878,779	0.06
合計	買建	-	10,868,947,531	1.93

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	2,132,883,523	0.38

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	ケイマン諸島	5,667,191,527	16.09
	インド	5,220,562,426	14.82
	台湾	4,833,396,476	13.72
	韓国	3,895,278,370	11.06
	中国	2,206,105,106	6.26
	ブラジル	1,684,250,392	4.78
	南アフリカ	926,354,950	2.63
	タイ	614,455,667	1.74
	インドネシア	612,894,230	1.74
	メキシコ	584,493,407	1.66
	マレーシア	469,519,395	1.33
	香港	336,595,791	0.96
	ポーランド	275,321,747	0.78
	トルコ	225,382,115	0.64
	フィリピン	199,583,212	0.57
	チリ	154,644,262	0.44
	ギリシャ	152,047,016	0.43
	アメリカ	146,873,923	0.42
	バミューダ	134,429,275	0.38
	ハンガリー	82,363,611	0.23
	チェコ	54,394,281	0.15
	イギリス	43,136,686	0.12
	エジプト	33,892,807	0.10
ルクセンブルグ	33,760,680	0.10	
コロンビア	32,995,035	0.09	
オランダ	14,563,196	0.04	

	ペルー	9,233,558	0.03
	シンガポール	5,796,610	0.02
	小計	28,649,515,751	81.32
投資信託受益証券	香港	1,581,188,675	4.49
投資証券	アメリカ	2,298,468,520	6.52
	メキシコ	207,476,131	0.59
	ブラジル	69,892,898	0.20
	南アフリカ	10,374,572	0.03
	小計	2,586,212,121	7.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,412,739,191	6.85
合計(純資産総額)		35,229,655,738	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,434,812,212	6.91
合計	買建	-	2,434,812,212	6.91

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	-	95,215,449	0.27
為替予約取引	売建	-	29,436,110	0.08

国内債券パッシブ・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	99,711,452,070	79.14
地方債証券	日本	9,847,817,900	7.82
特殊債券	日本	9,477,635,852	7.52
社債券	日本	6,291,889,700	4.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	658,778,000	0.53
合計(純資産総額)		125,987,573,522	100.00

外国債券パッシブ・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	79,123,080,945	47.55
	フランス	13,772,358,560	8.28
	イタリア	12,214,688,275	7.34
	中国	11,537,420,810	6.93
	ドイツ	10,739,833,592	6.45
	スペイン	8,095,937,076	4.87
	イギリス	7,982,313,674	4.80
	カナダ	3,272,472,945	1.97
	ベルギー	3,012,267,988	1.81
	オランダ	2,447,823,456	1.47

	オーストラリア	2,359,809,360	1.42
	オーストリア	1,940,874,531	1.17
	メキシコ	1,464,568,583	0.88
	アイルランド	901,838,988	0.54
	マレーシア	880,517,196	0.53
	ポーランド	877,532,674	0.53
	フィンランド	813,953,724	0.49
	シンガポール	718,418,966	0.43
	デンマーク	516,590,128	0.31
	イスラエル	460,905,262	0.28
	ニュージーランド	364,375,676	0.22
	スウェーデン	319,113,559	0.19
	ノルウェー	265,557,670	0.16
	小計	164,082,253,638	98.60
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,324,507,499	1.40
合計（純資産総額）		166,406,761,137	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	10,046,146,712	46.97
	フランス	1,746,804,682	8.17
	イタリア	1,550,200,159	7.25
	中国	1,457,745,722	6.82
	ドイツ	1,363,733,122	6.38
	スペイン	1,032,378,058	4.83
	イギリス	1,016,218,892	4.75
	カナダ	414,843,229	1.94
	ベルギー	381,076,886	1.78
	オランダ	306,682,196	1.43
	オーストラリア	299,216,914	1.40
	オーストリア	248,075,429	1.16
	シンガポール	205,107,198	0.96
	メキシコ	184,797,004	0.86
	アイルランド	120,158,644	0.56
	フィンランド	108,121,728	0.51
	ポーランド	107,938,981	0.50
	デンマーク	66,378,197	0.31
	イスラエル	58,341,436	0.27
	ニュージーランド	47,346,178	0.22
スウェーデン	40,711,887	0.19	
ノルウェー	32,813,615	0.15	
小計	20,834,836,869	97.42	

現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	551,459,448	2.58
合計（純資産総額）		21,386,296,317	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	-	317,630,470	1.49
為替予約取引	売建	-	21,439,873,704	100.25

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	トルコ	578,140,219	9.69
	サウジアラビア	565,796,673	9.49
	メキシコ	536,626,225	9.00
	アラブ首長国連邦	463,646,208	7.77
	コロンビア	400,070,818	6.71
	ブラジル	373,578,842	6.26
	チリ	366,059,386	6.14
	カタール	356,779,749	5.98
	ドミニカ共和国	345,485,764	5.79
	パナマ	278,975,493	4.68
	オマーン	261,589,872	4.39
	ペルー	221,965,237	3.72
	インドネシア	204,086,233	3.42
	中国	203,241,800	3.41
	ハンガリー	199,794,249	3.35
	南アフリカ	179,985,669	3.02
	ウルグアイ	106,383,541	1.78
フィリピン	62,280,782	1.04	
小計		5,704,486,760	95.65
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	259,565,625	4.35
合計（純資産総額）		5,964,052,385	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	-	32,886,920	0.55

Jリート・インデックス・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	13,027,595,110	98.57
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	188,714,575	1.43
合計（純資産総額）		13,216,309,685	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
リート指数先物取引	買建	日本	36,220,000	0.27
合計	買建	-	36,220,000	0.27

外国リート・インデックス・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	20,596,859,296	75.09
	オーストラリア	1,694,412,449	6.18
	イギリス	1,204,053,775	4.39
	シンガポール	941,276,076	3.43
	フランス	457,879,372	1.67
	カナダ	404,725,379	1.48
	香港	335,390,420	1.22
	ベルギー	285,813,611	1.04
	スペイン	106,988,978	0.39
	ニュージーランド	76,447,989	0.28
	韓国	52,779,248	0.19
	オランダ	51,028,686	0.19
	ガーンジー	35,126,285	0.13
	イスラエル	30,685,951	0.11
	ドイツ	10,491,551	0.04
	アイルランド	8,917,329	0.03
イタリア	2,353,137	0.01	
小計		26,295,229,532	95.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,135,253,869	4.14
合計(純資産総額)		27,430,483,401	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	-	30,321,056	0.11
為替予約取引	売建	-	25,045,640	0.09

ゴールド・インデックス・マザーファンド

2023年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	7,283,241,562	98.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	76,158,598	1.03
合計(純資産総額)		7,359,400,160	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	-	21,077,526	0.29

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年10月31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	トヨタ自動車	輸送用機器	4,527,000	2,017.59	9,133,652,048	2,590.00	11,724,930,000	4.34
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	582,300	11,308.79	6,585,109,300	12,425.00	7,235,077,500	2.68
日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	5,084,900	774.41	3,937,777,423	1,257.00	6,391,719,300	2.37
日本	株式	キーエンス	電気機器	82,400	57,360.44	4,726,500,435	58,150.00	4,791,560,000	1.78
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	24,649,100	153.36	3,780,085,509	176.80	4,357,960,880	1.61
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	577,000	4,754.97	2,743,617,001	7,220.00	4,165,940,000	1.54
日本	株式	三菱商事	卸売業	574,000	4,830.99	2,772,986,626	6,955.00	3,992,170,000	1.48
日本	株式	日立製作所	電気機器	404,900	7,362.46	2,981,058,786	9,477.00	3,837,237,300	1.42
日本	株式	三井物産	卸売業	654,400	4,131.38	2,703,576,688	5,417.00	3,544,884,800	1.31
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	174,300	15,233.92	2,655,272,589	19,755.00	3,443,296,500	1.28
日本	株式	信越化学工業	化学	743,100	3,636.97	2,702,633,982	4,468.00	3,320,170,800	1.23
日本	株式	任天堂	その他製品	519,900	5,897.74	3,066,236,198	6,221.00	3,234,297,900	1.20
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	582,800	4,416.11	2,573,709,752	5,373.00	3,131,384,400	1.16
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,010,000	1,132.53	2,276,391,047	1,506.50	3,028,065,000	1.12
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	731,800	4,073.44	2,980,939,857	4,063.00	2,973,303,400	1.10
日本	株式	KDDI	情報・通信業	639,000	4,115.14	2,629,571,397	4,487.00	2,867,193,000	1.06
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,105,300	1,752.79	1,937,353,995	2,545.50	2,813,541,150	1.04
日本	株式	第一三共	医薬品	720,400	4,495.84	3,238,805,809	3,858.00	2,779,303,200	1.03
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	626,600	4,341.12	2,720,147,515	4,333.00	2,715,057,800	1.01
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	802,400	2,842.69	2,280,973,700	3,343.00	2,682,423,200	0.99
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	407,900	5,984.40	2,441,035,916	6,124.00	2,497,979,600	0.93
日本	株式	HOYA	精密機器	164,000	14,125.20	2,316,533,503	14,335.00	2,350,940,000	0.87
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,329,400	1,501.66	1,996,311,960	1,705.00	2,266,627,000	0.84
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	447,500	4,013.56	1,796,066,075	4,857.00	2,173,507,500	0.81

日本	株式	ダイキン工業	機械	99,200	22,608.03	2,242,716,944	21,630.00	2,145,696,000	0.79
日本	株式	村田製作所	電気機器	749,700	2,491.25	1,867,691,639	2,477.50	1,857,381,750	0.69
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	493,400	2,819.77	1,391,276,900	3,521.00	1,737,261,400	0.64
日本	株式	S M C	機械	25,200	62,196.83	1,567,360,117	68,680.00	1,730,736,000	0.64
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	300,400	5,604.67	1,683,641,585	5,493.00	1,650,097,200	0.61
日本	株式	丸紅	卸売業	721,900	1,624.96	1,173,055,687	2,178.00	1,572,298,200	0.58

□ 種類別・業種別投資比率

2023年10月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	水産・農林業	0.09
	鉱業	0.39
	建設業	2.15
	食料品	3.47
	繊維製品	0.40
	パルプ・紙	0.19
	化学	5.82
	医薬品	4.73
	石油・石炭製品	0.46
	ゴム製品	0.69
	ガラス・土石製品	0.68
	鉄鋼	0.96
	非鉄金属	0.65
	金属製品	0.51
	機械	4.99
	電気機器	16.00
	輸送用機器	8.40
	精密機器	2.13
	その他製品	2.23
	電気・ガス業	1.40
	陸運業	2.82
	海運業	0.73
	空運業	0.45
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.70
	卸売業	7.05
	小売業	4.27
銀行業	7.45	
証券、商品先物取引業	0.78	
保険業	2.47	
その他金融業	1.18	
不動産業	1.93	
サービス業	4.53	
合計		97.83

外国株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2023年10月31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	1,178,730	21,644.20	25,512,667,374	25,460.06	30,010,534,048	5.33
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア・ サービス	529,731	37,199.53	19,705,744,903	50,431.22	26,714,979,595	4.74
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消 費財・ サービス 流通・小 売り	692,035	14,375.01	9,948,011,841	19,841.47	13,730,993,144	2.44
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導 体・半 導体製 造装置	185,105	27,005.70	4,998,890,553	61,539.81	11,391,326,733	2.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC- CL A	メディ ア・娛 楽	445,227	14,646.42	6,520,982,526	18,608.01	8,284,790,516	1.47
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディ ア・娛 楽	165,862	18,669.41	3,096,545,257	45,250.70	7,505,371,039	1.33
アメリカ	株式	ALPHABET INC- CL C	メディ ア・娛 楽	396,590	14,602.07	5,791,033,959	18,800.88	7,456,241,990	1.32
アメリカ	株式	TESLA INC	自動 車・自 動車部 品	214,241	28,154.99	6,031,952,200	29,507.29	6,321,672,088	1.12
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルス ケア機 器・ サービ ス	70,017	78,254.37	5,479,136,057	79,238.80	5,548,063,402	0.99

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	60,686	55,252.25	3,353,037,896	84,579.30	5,132,779,527	0.91
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	97,122	47,390.58	4,602,668,275	50,446.17	4,899,432,835	0.87
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	304,036	16,481.26	5,010,897,598	15,830.12	4,812,925,999	0.85
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	219,809	20,567.93	4,521,016,512	20,545.66	4,516,121,902	0.80
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	121,762	31,705.39	3,860,512,285	34,847.79	4,243,136,703	0.75
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	180,442	26,087.42	4,707,266,023	21,982.46	3,966,558,199	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	177,416	21,819.47	3,871,123,062	22,315.86	3,959,191,079	0.70
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	30,906	82,070.93	2,536,484,114	125,775.29	3,887,211,035	0.69
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	245,570	9,533.85	2,341,228,684	14,407.90	3,538,148,494	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	63,063	51,963.22	3,276,956,750	55,680.51	3,511,380,266	0.62
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	200,093	18,401.00	3,681,910,582	16,195.73	3,240,652,002	0.58

アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	75,103	47,323.35	3,554,125,664	42,084.07	3,160,640,269	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	136,457	26,731.80	3,647,740,997	21,841.92	2,980,482,317	0.53
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	191,252	16,242.24	3,106,360,462	15,351.69	2,936,040,803	0.52
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	133,033	23,428.71	3,116,791,438	21,213.97	2,822,158,589	0.50
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	33,432	79,085.45	2,643,984,658	82,960.11	2,773,522,357	0.49
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	111,744	22,856.50	2,554,076,650	24,373.12	2,723,549,943	0.48
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	34,076	50,513.38	1,721,293,816	78,782.80	2,684,602,672	0.48
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	30,212	90,191.81	2,724,875,075	87,580.32	2,645,976,627	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	309,873	9,308.48	2,884,448,063	8,394.99	2,601,379,651	0.46
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	103,827	27,281.68	2,832,574,973	24,262.48	2,519,100,801	0.45

□ 種類別・業種別投資比率

2023年10月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(外国)	エネルギー	5.35
	素材	3.99

資本財	6.47	
商業・専門サービス	1.56	
運輸	1.69	
自動車・自動車部品	1.88	
耐久消費財・アパレル	1.51	
消費者サービス	2.04	
一般消費財・サービス流通・小売り	4.48	
生活必需品流通・小売り	1.75	
食品・飲料・タバコ	3.76	
家庭用品・パーソナル用品	1.75	
ヘルスケア機器・サービス	4.43	
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.23	
銀行	5.13	
金融サービス	6.34	
保険	3.22	
ソフトウェア・サービス	9.81	
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.77	
半導体・半導体製造装置	5.76	
電気通信サービス	1.20	
公益事業	2.75	
メディア・娯楽	5.92	
不動産管理・開発	0.32	
投資証券	-	1.96
合計		98.09

エマージング株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2023年10月31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 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・ 半導体製 造装置	857,000	2,284.45	1,957,770,291	2,453.32	2,102,493,526	5.97
香港	投資信 託受益 証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	2,095,800	810.1733	1,697,961,212	754.4559	1,581,188,675	4.49
アメリカ	投資証 券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	240,096	5,850.05	1,404,574,311	5,570.74	1,337,513,015	3.80
ケイマ ン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディ ア・娯楽	233,200	5,478.93	1,277,686,286	5,648.05	1,317,124,793	3.74
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロ ジー・ ハード ウェアお よび機器	166,216	6,821.77	1,133,887,570	7,470.30	1,241,683,384	3.52

ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	571,500	1,536.48	878,098,952	1,564.97	894,381,498	2.54
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	105,896	4,404.80	466,450,278	4,185.63	443,240,945	1.26
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	204,010	2,287.10	466,591,881	2,027.36	413,600,815	1.17
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	177,060	2,874.04	508,876,774	2,179.68	385,934,140	1.10
ケイマン諸島	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費財・サービス流通・小売り	20,779	12,520.82	260,170,029	15,587.91	323,901,235	0.92
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	179,956	1,698.13	305,588,788	1,674.07	301,258,760	0.86
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI QATAR ETF	-	118,705	2,972.37	352,835,353	2,444.49	290,173,007	0.82
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	116,069	2,900.30	336,635,103	2,492.46	289,297,397	0.82
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,364,000	89.79	302,043,692	85.66	288,152,166	0.82
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	96,928	2,867.76	277,966,539	2,688.03	260,545,468	0.74
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	-	59,959	5,191.14	311,255,621	4,289.29	257,181,682	0.73
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	19,106	9,769.74	186,660,684	13,220.10	252,583,230	0.72
ブラジル	株式	VALE SA	素材	119,188	2,463.69	293,642,628	2,017.62	240,475,693	0.68
ケイマン諸島	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	67,800	2,191.38	148,575,454	3,250.40	220,377,120	0.63
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	53,000	3,253.64	172,442,924	3,952.06	209,458,941	0.59
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	31,793	6,146.95	195,429,910	6,115.18	194,419,774	0.55
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	436,800	464.71	202,984,801	435.79	190,351,652	0.54
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	235,000	917.08	215,512,841	772.45	181,525,280	0.52
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	167,300	773.04	129,329,231	1,038.10	173,674,949	0.49

中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・ 自動車部 品	36,500	3,859.37	140,866,914	4,707.34	171,818,056	0.49
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS- PREF	テクノロ ジー・ ハード ウェアお よび機器	28,599	6,098.96	174,424,079	5,971.80	170,787,508	0.48
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	2,288,000	73.26	167,613,130	71.51	163,612,134	0.46
インド ネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,947,400	84.69	164,926,469	83.19	162,004,206	0.46
ケイマ ン諸島	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディ ア・娯楽	79,050	2,036.02	160,947,222	2,047.75	161,874,795	0.46
ケイマ ン諸島	株式	JD.COM INC- CLASS A	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	82,285	3,708.87	305,184,675	1,936.86	159,374,195	0.45

□ 種類別・業種別投資比率

2023年10月31日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式（外国）	エネルギー	4.34
	素材	5.73
	資本財	3.49
	商業・専門サービス	0.04
	運輸	1.62
	自動車・自動車部品	3.38
	耐久消費財・アパレル	1.21
	消費者サービス	2.53
	一般消費財・サービス流通・小売り	5.25
	生活必需品流通・小売り	1.41
	食品・飲料・タバコ	2.46
	家庭用品・パーソナル用品	0.76
	ヘルスケア機器・サービス	0.73
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイ エンス	2.41
	銀行	11.76
	金融サービス	2.22
	保険	2.40
	ソフトウェア・サービス	2.16
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.95
	半導体・半導体製造装置	8.45
電気通信サービス	1.85	
公益事業	2.02	
メディア・娯楽	6.08	
不動産管理・開発	1.05	

投資信託受益証券	-	4.49
投資証券	-	7.34
合計		93.15

国内債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年10月31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 5 1 2年国債	4,520,000,000	99.97	4,518,596,300	99.89	4,514,847,200	0.005	2025/08/01	3.58
日本	国債 証券	1 4 7 5年国債	1,310,000,000	100.16	1,312,030,500	99.63	1,305,179,200	0.005	2026/03/20	1.04
日本	国債 証券	1 4 9 5年国債	1,240,000,000	100.10	1,241,227,600	99.41	1,232,708,800	0.005	2026/09/20	0.98
日本	国債 証券	1 4 5 5年国債	1,180,000,000	100.37	1,184,377,800	99.99	1,179,882,000	0.100	2025/09/20	0.94
日本	国債 証券	1 6 0 5年国債	1,190,000,000	99.89	1,188,711,300	98.98	1,177,826,300	0.200	2028/06/20	0.93
日本	国債 証券	1 4 8 5年国債	1,180,000,000	100.12	1,181,409,400	99.53	1,174,430,400	0.005	2026/06/20	0.93
日本	国債 証券	3 7 1 10年国 債	1,190,000,000	97.60	1,161,468,300	95.15	1,132,237,400	0.400	2033/06/20	0.90
日本	国債 証券	3 6 1 10年国 債	1,170,000,000	98.33	1,150,452,400	95.92	1,122,299,100	0.100	2030/12/20	0.89
日本	国債 証券	1 5 0 5年国債	1,130,000,000	100.05	1,130,565,000	99.28	1,121,909,200	0.005	2026/12/20	0.89
日本	国債 証券	3 6 2 10年国 債	1,150,000,000	98.43	1,131,991,000	95.55	1,098,871,000	0.100	2031/03/20	0.87
日本	国債 証券	3 5 7 10年国 債	1,120,000,000	99.20	1,111,078,700	97.24	1,089,121,600	0.100	2029/12/20	0.86
日本	国債 証券	3 7 0 10年国 債	1,120,000,000	100.72	1,128,064,000	96.29	1,078,436,800	0.500	2033/03/20	0.86
日本	国債 証券	3 6 9 10年国 債	1,110,000,000	100.92	1,120,223,100	96.54	1,071,616,200	0.500	2032/12/20	0.85
日本	国債 証券	1 5 3 5年国債	1,080,000,000	99.92	1,079,136,000	98.96	1,068,735,600	0.005	2027/06/20	0.85
日本	国債 証券	3 6 4 10年国 債	1,120,000,000	98.09	1,098,663,600	94.81	1,061,849,600	0.100	2031/09/20	0.84
日本	国債 証券	1 5 4 5年国債	1,060,000,000	100.21	1,062,221,600	99.14	1,050,841,600	0.100	2027/09/20	0.83
日本	国債 証券	3 6 0 10年国 債	1,050,000,000	98.65	1,035,825,000	96.28	1,010,940,000	0.100	2030/09/20	0.80

日本	国債証券	359 10年国債	1,040,000,000	98.85	1,028,022,900	96.63	1,004,900,000	0.100	2030/06/20	0.80
日本	国債証券	146 5年国債	1,000,000,000	100.40	1,003,980,000	99.93	999,250,000	0.100	2025/12/20	0.79
日本	国債証券	358 10年国債	1,030,000,000	99.03	1,019,997,400	96.96	998,657,100	0.100	2030/03/20	0.79
日本	国債証券	367 10年国債	1,050,000,000	98.66	1,035,941,900	94.54	992,712,000	0.200	2032/06/20	0.79
日本	国債証券	365 10年国債	1,040,000,000	97.98	1,018,940,600	94.44	982,144,800	0.100	2031/12/20	0.78
日本	国債証券	368 10年国債	980,000,000	97.13	951,849,900	94.24	923,561,800	0.200	2032/09/20	0.73
日本	国債証券	158 5年国債	930,000,000	100.14	931,311,200	98.75	918,375,000	0.100	2028/03/20	0.73
日本	国債証券	156 5年国債	880,000,000	100.52	884,576,000	99.37	874,438,400	0.200	2027/12/20	0.69
日本	国債証券	363 10年国債	910,000,000	98.16	893,224,400	95.17	866,037,900	0.100	2031/06/20	0.69
日本	国債証券	151 20年国債	840,000,000	107.13	899,875,200	101.39	851,709,600	1.200	2034/12/20	0.68
日本	国債証券	344 10年国債	811,000,000	100.42	814,365,650	99.68	808,437,240	0.100	2026/09/20	0.64
日本	国債証券	453 2年国債	800,000,000	99.93	799,464,000	99.76	798,088,000	0.005	2025/10/01	0.63
日本	国債証券	882 0年国債	742,000,000	107.19	795,342,380	105.56	783,218,100	2.300	2026/06/20	0.62

□ 種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	79.14
地方債証券	7.82
特殊債証券	7.52
社債券	4.99
合計	99.48

外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年10月31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	11,450,000	13,897.40	1,591,252,646	13,779.89	1,577,797,195	1.625	2026/05/15	0.95

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,200,000	14,229.61	1,166,828,368	14,041.53	1,151,405,514	2.250	2026/03/31	0.69
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	50,000,000	2,040.48	1,020,238,479	2,054.81	1,027,405,810	2.690	2026/08/12	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,200,000	12,894.64	928,414,041	12,596.67	906,959,954	0.625	2027/12/31	0.55
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	43,000,000	2,062.42	886,839,461	2,090.68	898,991,910	3.020	2031/05/27	0.54
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	38,700,000	2,203.46	852,740,703	2,274.44	880,208,221	3.720	2051/04/12	0.53
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	41,000,000	2,036.24	834,859,957	2,027.65	831,336,995	2.400	2028/07/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	14,835.40	904,959,659	13,418.52	818,529,872	3.500	2033/02/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,308.86	861,620,149	11,451.42	801,599,360	0.875	2030/11/15	0.48
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	39,000,000	2,023.84	789,299,201	2,033.69	793,137,873	2.180	2025/08/25	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	15,667.60	877,385,381	14,118.68	790,645,958	4.125	2032/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	14,902.49	789,831,927	14,601.74	773,892,465	3.875	2026/01/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	12,957.58	764,497,407	12,624.77	744,861,660	0.750	2028/01/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,200,000	14,007.74	728,402,553	14,253.09	741,160,540	0.750	2024/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	14,420.69	735,455,089	14,477.50	738,352,593	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	14,224.38	810,789,739	12,860.10	733,025,851	2.875	2032/05/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	14,320.51	758,986,767	13,755.37	729,034,532	2.750	2028/02/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	14,433.76	793,856,610	13,253.76	728,956,936	3.375	2033/05/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,288.00	764,399,777	14,474.96	723,748,008	4.000	2028/02/29	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,232.60	711,630,222	14,384.51	719,225,330	1.500	2024/10/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	14,307.96	686,781,959	13,865.26	665,532,402	2.625	2027/05/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	12,551.81	715,453,342	11,602.72	661,355,242	1.125	2031/02/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,909.06	695,453,240	13,185.44	659,271,820	2.375	2029/03/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	12,959.38	712,765,750	11,930.30	656,166,497	1.625	2031/05/15	0.39

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	14,480.19	651,608,685	14,412.76	648,574,380	2.625	2025/04/15	0.39
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	31,500,000	2,046.30	644,585,557	2,050.39	645,871,854	2.640	2028/01/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	14,053.94	632,427,300	14,247.11	641,119,811	1.000	2024/12/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,400,000	14,982.10	659,212,315	14,414.86	634,253,714	3.875	2027/12/31	0.38
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	31,000,000	2,023.45	627,269,724	2,036.58	631,340,523	2.240	2025/05/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	13,078.54	693,162,448	11,909.97	631,228,229	1.875	2032/02/15	0.38

□ 種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.60
合計	98.60

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年10月31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	1,950,000	14,730.62	287,247,138	14,741.54	287,459,961	4.125	2025/01/31	1.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,520,000	14,748.09	224,170,982	14,741.24	224,066,809	4.250	2025/05/31	1.05
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,170,000	14,864.92	173,919,609	14,859.80	173,859,647	4.750	2025/07/31	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,160,000	14,128.50	163,890,564	13,910.26	161,359,026	3.625	2030/03/31	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,070,000	14,284.98	152,849,305	14,161.89	151,532,182	3.500	2028/04/30	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,290,000	11,922.59	153,801,355	11,602.72	149,675,133	1.125	2031/02/15	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	950,000	14,826.76	140,854,193	14,831.54	140,899,644	4.625	2025/02/28	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	970,000	13,660.68	132,508,610	13,596.59	131,886,912	1.875	2027/02/28	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	14,533.97	130,805,729	14,414.86	129,733,714	3.875	2027/12/31	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	920,000	13,890.97	127,796,961	13,993.69	128,741,924	0.500	2025/03/31	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	890,000	14,372.10	127,911,665	14,415.90	128,301,543	2.750	2025/05/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	930,000	13,346.69	124,124,194	12,857.86	119,578,098	4.125	2053/08/15	0.56

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	910,000	13,439.45	122,299,030	12,860.10	117,026,934	2.875	2032/05/15	0.55
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	790,000	14,737.33	116,424,882	14,776.48	116,734,206	0.000	2026/02/25	0.55
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	5,600,000	2,041.90	114,346,641	2,033.69	113,886,463	2.180	2025/08/25	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	950,000	12,427.42	118,060,496	11,909.97	113,144,682	1.875	2032/02/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	970,000	11,945.55	115,871,834	11,476.84	111,325,310	1.250	2031/08/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	750,000	14,834.20	111,256,465	14,797.30	110,979,777	4.500	2026/07/15	0.52
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	5,400,000	2,028.79	109,554,435	2,025.39	109,370,943	2.180	2026/08/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	730,000	14,783.85	107,922,089	14,118.68	103,066,348	4.125	2032/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	700,000	14,649.59	102,547,114	14,666.78	102,667,470	3.875	2025/04/30	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	700,000	14,362.83	100,539,793	14,412.76	100,889,348	2.625	2025/04/15	0.47
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	4,800,000	2,043.09	98,068,174	2,035.15	97,687,439	2.280	2025/11/25	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	840,000	11,984.12	100,666,637	11,500.46	96,603,853	1.375	2031/11/15	0.45
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	670,000	14,338.32	96,066,741	14,356.67	96,189,671	0.000	2027/02/25	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	720,000	13,923.12	100,246,455	13,253.76	95,427,089	3.375	2033/05/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	640,000	14,673.74	93,911,949	14,634.94	93,663,589	4.000	2026/02/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	650,000	14,635.53	95,130,970	14,224.38	92,458,479	4.000	2030/02/28	0.43
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000	2,357.51	94,300,462	2,274.44	90,977,594	3.720	2051/04/12	0.43
イギリス	国債証券	UK GILT	510,000	17,595.76	89,738,359	17,746.00	90,504,611	3.500	2025/10/22	0.42

□ 種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.42
合計	97.42

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年10月31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 (%)
ドミ ニカ 共和 国	国債 証券	DOMINICAN REPUBLIC	1,700,000	13,709.84	233,067,251	13,128.32	223,181,501	6.000	2033/02/22	3.74
アラ ブ首 長国 連邦	国債 証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1,700,000	12,296.96	209,048,320	11,648.62	198,026,593	1.875	2031/09/15	3.32
コロ ンビ ア	国債 証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,400,000	14,625.07	204,750,954	13,933.73	195,072,275	7.500	2034/02/02	3.27
トル コ	国債 証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,200,000	15,820.05	189,840,621	15,629.33	187,551,922	9.875	2028/01/15	3.14
サウ ジア ラビ ア	国債 証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,600,000	12,029.72	192,475,585	11,223.87	179,581,843	2.250	2033/02/02	3.01
オマ ーン	国債 証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	1,200,000	15,260.11	183,121,343	14,544.03	174,528,405	6.250	2031/01/25	2.93
カ ター ル	国債 証券	STATE OF QATAR	1,100,000	14,371.50	158,086,491	13,650.86	150,159,471	3.750	2030/04/16	2.52
カ ター ル	国債 証券	STATE OF QATAR	1,300,000	13,333.65	173,337,408	11,430.79	148,600,231	4.400	2050/04/16	2.49
メキ シコ	国債 証券	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000	12,461.06	149,532,725	11,641.15	139,693,771	2.659	2031/05/24	2.34
トル コ	国債 証券	REPUBLIC OF TURKEY	900,000	15,201.71	136,815,404	14,935.15	134,416,367	9.125	2030/07/13	2.25
ハン ガ リー	国債 証券	HUNGARY	900,000	14,389.34	129,504,066	14,363.87	129,274,868	6.250	2032/09/22	2.17
パナ マ	国債 証券	REPUBLIC OF PANAMA	900,000	14,704.01	132,336,085	13,863.17	124,768,487	6.400	2035/02/14	2.09
ペ ルー	国債 証券	REPUBLIC OF PERU	1,000,000	12,705.21	127,052,102	12,010.29	120,102,878	2.783	2031/01/23	2.01
メキ シコ	国債 証券	UNITED MEXICAN STATES	900,000	14,298.89	128,689,984	12,993.17	116,938,498	6.338	2053/05/04	1.96
コロ ンビ ア	国債 証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	800,000	15,393.14	123,145,107	14,564.67	116,517,329	8.000	2033/04/20	1.95
トル コ	国債 証券	REPUBLIC OF TURKEY	800,000	13,913.70	111,309,596	13,529.61	108,236,867	6.125	2028/10/24	1.81
南ア フリ カ	国債 証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	900,000	12,877.40	115,896,563	11,512.12	103,609,084	7.300	2052/04/20	1.74

アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	700,000	14,308.53	100,159,739	14,288.52	100,019,648	2.500	2025/04/16	1.68
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	900,000	12,991.37	116,922,351	10,989.73	98,907,592	5.000	2051/04/27	1.66
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	700,000	14,474.70	101,322,927	13,904.43	97,331,010	4.875	2033/07/18	1.63
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	900,000	11,278.09	101,502,787	10,567.96	95,111,683	5.875	2060/01/30	1.59
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	800,000	12,922.45	103,379,586	11,788.41	94,307,319	5.000	2053/01/18	1.58
中国	国債証券	CHINA GOVT INTL BOND	700,000	13,378.90	93,652,316	13,428.39	93,998,731	1.250	2026/10/26	1.58
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1,000,000	10,915.58	109,155,755	9,175.58	91,755,782	3.125	2049/09/30	1.54
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	600,000	15,505.88	93,035,288	14,956.23	89,737,397	9.375	2033/01/19	1.50
チリ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	800,000	11,922.08	95,376,615	11,165.26	89,322,058	2.550	2033/07/27	1.50
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	800,000	11,462.33	91,698,669	11,060.15	88,481,214	3.125	2031/04/15	1.48
オマーン	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	600,000	14,925.63	89,553,798	14,510.24	87,061,467	6.000	2029/08/01	1.46
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	600,000	14,713.95	88,283,711	14,489.61	86,937,672	4.750	2028/01/18	1.46
ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	600,000	14,267.44	85,604,641	14,220.94	85,325,656	2.875	2025/06/06	1.43

ロ 種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	95.65
合計	95.65

Jリート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年10月31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	投資証券	日本ビルファンド投資法人	1,471	594,228.50	874,110,130	607,000.00	892,897,000	6.76
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,295	588,412.54	761,994,244	561,000.00	726,495,000	5.50
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4,077	171,456.68	699,028,899	166,900.00	680,451,300	5.15
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	2,197	287,633.61	631,931,040	268,800.00	590,553,600	4.47
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	6,045	98,774.33	597,090,819	97,500.00	589,387,500	4.46
日本	投資証券	G L P 投資法人	4,261	139,436.33	594,138,197	135,500.00	577,365,500	4.37
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,901	280,790.39	533,782,531	267,600.00	508,707,600	3.85
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	2,511	182,162.79	457,410,775	173,800.00	436,411,800	3.30
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	2,822	155,528.59	438,901,695	152,400.00	430,072,800	3.25
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,236	353,785.25	437,278,573	328,500.00	406,026,000	3.07
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	6,109	58,931.82	360,014,516	58,100.00	354,932,900	2.69
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	863	363,365.96	313,584,824	354,000.00	305,502,000	2.31
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	3,794	83,657.50	317,396,555	79,600.00	302,002,400	2.29
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,220	74,685.75	315,173,861	68,700.00	289,914,000	2.19
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	662	404,438.46	267,738,261	408,500.00	270,427,000	2.05
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	435	667,765.45	290,477,969	609,000.00	264,915,000	2.00
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	1,926	143,306.52	276,008,360	135,700.00	261,358,200	1.98
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,615	150,062.88	242,351,551	148,200.00	239,343,000	1.81
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	524	486,529.50	254,941,457	456,500.00	239,206,000	1.81
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	1,454	170,826.20	248,381,300	157,600.00	229,150,400	1.73

日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	808	301,435.72	243,560,060	279,900.00	226,159,200	1.71
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,550	146,762.93	227,482,540	144,000.00	223,200,000	1.69
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	468	469,923.93	219,924,401	452,500.00	211,770,000	1.60
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,485	145,077.17	215,439,604	141,500.00	210,127,500	1.59
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	1,824	110,779.11	202,061,102	111,800.00	203,923,200	1.54
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	620	338,811.11	210,062,891	321,000.00	199,020,000	1.51
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	931	224,423.49	208,938,271	208,430.00	194,048,330	1.47
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,180	165,075.08	194,788,592	154,200.00	181,956,000	1.38
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	2,437	74,057.65	180,478,490	73,700.00	179,606,900	1.36
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	260	670,717.15	174,386,459	661,000.00	171,860,000	1.30

□ 種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	98.57
合計	98.57

外国リート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2023年10月31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（％）
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	146,377	18,204.39	2,664,704,257	14,783.55	2,163,971,522	7.89
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	14,834	114,418.00	1,697,276,580	106,948.99	1,586,481,292	5.78
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	82,187	12,048.28	990,211,876	12,240.38	1,006,000,415	3.67
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	25,073	40,932.12	1,026,290,952	35,705.98	895,255,991	3.26
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	48,270	19,064.93	920,263,993	18,252.18	881,032,767	3.21
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	51,911	16,555.37	859,405,682	15,747.89	817,488,629	2.98
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	113,019	8,405.89	950,024,835	6,910.35	781,001,095	2.85

アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	160,568	4,539.42	728,885,004	4,063.68	652,497,259	2.38
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	22,330	27,040.38	603,811,654	24,317.80	543,016,507	1.98
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	274,077	2,137.76	585,911,232	1,949.49	534,310,699	1.95
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	33,751	19,058.37	643,239,184	15,538.57	524,442,421	1.91
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	55,283	9,577.75	529,487,018	8,142.31	450,131,578	1.64
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	91,527	5,023.54	459,789,179	4,376.16	400,536,585	1.46
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	45,585	9,051.34	412,605,124	8,714.94	397,270,444	1.45
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	63,753	6,477.75	412,976,148	6,212.14	396,042,593	1.44
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,599	17,367.08	427,212,840	13,908.92	342,145,407	1.25
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	20,036	18,655.71	373,785,817	16,404.24	328,675,296	1.20
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	18,198	21,405.35	389,534,499	17,568.92	319,719,207	1.17
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,055	35,519.09	357,144,456	31,403.08	315,757,973	1.15
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	30,117	10,075.51	303,444,116	9,824.30	295,878,506	1.08
香港	投資証券	LINK REIT	403,700	740.90	299,101,330	695.97	280,962,281	1.02
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	42,352	6,865.10	290,750,619	6,603.86	279,686,538	1.02
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	33,806	9,655.36	326,408,958	7,886.65	266,616,174	0.97
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	111,435	2,338.34	260,572,516	2,299.46	256,240,748	0.93
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	96,981	2,798.83	271,433,060	2,583.53	250,553,594	0.91
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	51,482	5,295.39	272,617,481	4,814.22	247,845,777	0.90
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	190,440	1,314.71	250,372,831	1,260.19	239,989,661	0.87
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	26,538	9,176.92	243,537,203	8,702.98	230,959,606	0.84
アメリカ	投資証券	UDR INC	48,632	5,789.03	281,531,970	4,727.51	229,908,081	0.84
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	17,305	15,908.10	275,289,638	12,548.37	217,149,617	0.79

□ 種類別投資比率

2023年10月31日現在

種類	投資比率（％）
----	---------

投資証券	95.86
合計	95.86

ゴールド・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄

2023年10月31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 (%)
アメリカ	投資信 託受益 証券	SPDR GOLD MINISHARES TRUST	873,460	5,807.0122	5,072,192,878	5,917.6058	5,168,791,962	70.23
アメリカ	投資信 託受益 証券	ISHARES GOLD TRUST	374,240	5,492.5906	2,055,547,100	5,649.9829	2,114,449,600	28.73

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10月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.97
合計	98.97

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

エマーGING株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

ゴールド・インデックス・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

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2023年10月31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 (%)
株価指数 先物取引	日本	大阪取引 所	TOPI X 先 物 0512 月 2023年 12月	買建	259	日本・円	6,000,029,900	5,837,860,000	2.16

(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。

外国株式インデックス・マザーファンド

2023年10月31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 (%)
株価 指数 先物 取引	イギ リス	IC E - EU	FTS E 10 0 ID X FU T DE C 23 2023年12 月	買建	36	イギリ ス・ポ ンド	2,734,547.00	496,976,571	2,642,760.00	480,295,202	0.09
	ドイ ツ	EU RE X	EUR OST OXX 50 D EC 23 2023年12 月	買建	245	ユーロ	10,220,550.00	1,621,592,463	9,895,550.00	1,570,027,963	0.28
	アメ リカ	シカ ゴ商 品取 引所	S & P 500 EMIN I FU T DE C 23 2023年12 月	買建	271	アメリ カ・ド ル	58,757,548.00	8,784,841,001	56,716,912.50	8,479,745,587	1.51

オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURE DEC 23 2023年12月	買建	21	オーストラリア・ドル	3,696,444.50	351,864,551	3,560,025.00	338,878,779	0.06
---------	-----------	--------------------------------	----	----	------------	--------------	-------------	--------------	-------------	------

(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10月31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	11,412,000.00	1,711,526,415	1,705,682,952	0.30
	ユーロ	買建	1,143,000.00	181,067,719	181,315,852	0.03
	イギリス・ポンド	買建	548,000.00	99,649,826	99,571,467	0.02
	スイス・フラン	買建	378,000.00	62,974,446	62,655,741	0.01
	オーストラリア・ドル	買建	492,000.00	46,768,978	46,821,327	0.01
	カナダ・ドル	買建	341,000.00	37,059,777	36,836,184	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。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2023年10月31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 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	ICE - US	MSCI EM GMK T DEC 23 2023年12月	買建	352	アメリカ・ドル	17,272,802.00	2,582,456,627	16,285,280.00	2,434,812,212	6.91

(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10月31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	637,267.25	95,400,000	95,215,449	0.27
	アメリカ・ドル	売建	196,947.12	29,500,000	29,436,110	0.08

(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。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2023年10月31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	1,050,000.00	156,526,797	156,809,100	0.73
	ユーロ	買建	650,000.00	101,588,344	103,042,550	0.48
	オフショア・人民元	買建	1,210,000.00	24,629,312	24,657,501	0.12
	イギリス・ポンド	買建	90,000.00	16,208,433	16,339,167	0.08
	オーストラリア・ドル	買建	60,000.00	5,681,566	5,706,222	0.03
	カナダ・ドル	買建	50,000.00	5,444,931	5,396,400	0.03
	メキシコ・ペソ	買建	320,000.00	2,678,528	2,640,992	0.01
	シンガポール・ドル	買建	20,000.00	2,172,654	2,188,886	0.01
	デンマーク・クローネ	買建	40,000.00	838,600	849,652	0.00
	アメリカ・ドル	売建	69,610,000.00	10,329,723,666	10,395,696,620	48.61
	ユーロ	売建	44,120,000.00	6,942,318,723	6,994,211,240	32.70
	オフショア・人民元	売建	73,720,000.00	1,503,381,693	1,502,273,532	7.02
	イギリス・ポンド	売建	5,780,000.00	1,047,966,311	1,049,337,614	4.91
	カナダ・ドル	売建	3,910,000.00	429,062,533	421,998,480	1.97
	オーストラリア・ドル	売建	3,310,000.00	317,093,794	314,793,247	1.47
	シンガポール・ドル	売建	1,910,000.00	207,971,257	209,038,613	0.98
	メキシコ・ペソ	売建	23,350,000.00	197,266,579	192,709,885	0.90
	ポーランド・ズロチ	売建	3,060,000.00	104,106,433	109,000,872	0.51
	デンマーク・クローネ	売建	3,200,000.00	67,539,049	67,972,160	0.32
	イスラエル・シェケル	売建	1,640,000.00	63,826,260	60,944,040	0.28
ニュージーランド・ドル	売建	550,000.00	49,051,039	47,914,185	0.22	
スウェーデン・クローナ	売建	3,060,000.00	41,843,566	40,998,798	0.19	
ノルウェー・クローネ	売建	2,460,000.00	34,295,220	32,984,418	0.15	

(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。

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2023年10月31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	220,000.00	32,905,180	32,886,920	0.55

(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。

Jリート・インデックス・マザーファンド

2023年10月31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 (%)
リート指 数先物取 引	日本	大阪取引 所	TREI T 先 物 0512 月 2023年 12月	買建	20	日本・円	37,778,400	36,220,000	0.27

(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。

外国リート・インデックス・マザーファンド

2023年10月31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	125,360.94	18,800,000	18,734,884	0.07
	ユーロ	買建	37,834.41	6,000,000	6,002,088	0.02
	イギリス・ポンド	買建	30,730.36	5,600,000	5,584,084	0.02
	アメリカ・ドル	売建	167,571.96	25,100,000	25,045,640	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。

ゴールド・インデックス・マザーファンド

2023年10月31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	141,000.00	21,075,834	21,077,526	0.29

(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10月31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

分配の推移

■ レベル1 (保守型)



該当事項はありません。

■ レベル2 (安定型)



該当事項はありません。

■ レベル3 (安定成長型)



該当事項はありません。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

■ レベル4 (成長型)



該当事項はありません。

■ レベル5 (積極成長型)



該当事項はありません。

*基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

■ レベル1 (保守型)

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	99.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.07
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	国内債券パッシブ・マザーファンド	35.77
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	33.92
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	10.69
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	6.42
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	4.78
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	2.92
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	2.62
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	1.20
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	1.10
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	0.52

■ レベル2 (安定型)

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	99.88
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	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	22.83
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	22.65
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	17.08
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	8.90
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	8.00
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	7.79
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	6.29
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	3.77
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	1.88
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	0.68

※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。

■ レベル3 (安定成長型)

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	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.01
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	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	21.33
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	15.62
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	15.50
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	12.60
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	10.09
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	8.00
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	7.60
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	5.87
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	2.39
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	1.00

■ レベル4 (成長型)

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	99.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.44
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	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	25.04
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	16.23
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	11.96
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	9.15
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	9.07
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	9.03
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	7.95
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	7.16
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	2.85
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	1.13

※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。

■ レベル5（積極成長型）

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	99.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.24
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	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	28.86
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	19.95
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	14.00
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	10.17
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	10.13
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	6.89
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	3.25
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	2.61
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	2.57
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	1.34

※比率は、ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

▶ 投資対象とする投資信託の現況

■ 国内債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	451 2年国債	0.005	2025/08/01	3.58
日本	国債証券	147 5年国債	0.005	2026/03/20	1.04
日本	国債証券	149 5年国債	0.005	2026/09/20	0.98
日本	国債証券	145 5年国債	0.100	2025/09/20	0.94
日本	国債証券	160 5年国債	0.200	2028/06/20	0.93

■ 外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5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	1.625	2026/05/15	0.95
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	0.69
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2027/12/31	0.55
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.020	2031/05/27	0.54

※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。

■ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5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	4.125	2025/01/31	1.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2025/05/31	1.05
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2025/07/31	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2030/03/31	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2028/04/30	0.71

■米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	6.000	2033/02/22	3.74
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1.875	2031/09/15	3.32
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	7.500	2034/02/02	3.27
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	9.875	2028/01/15	3.14
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	2.250	2033/02/02	3.01

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	4.34
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.68
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.37
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.78
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.61

■外国株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5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	5.33
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.74
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2.44
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	2.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.47

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	5.97
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	4.49
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	3.80
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	3.74
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.52

*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。

■Jリート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	6.76
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.50
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	5.15
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4.47
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	4.46

■外国リート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	7.89
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	5.78
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	3.67
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.26
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	3.21

■ゴールド・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR GOLD MINISHARES TRUST	70.23
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	28.73

※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。

※「主要投資銘柄(上位5銘柄)」は組入有価証券が5銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)

■レベル1(保守型)



※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。

※ファンドが設定された年の収益率は、設定日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。

■ レベル2 (安定型)



■ レベル3 (安定成長型)



■ レベル4 (成長型)



■ レベル5 (積極成長型)



※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。

※ファンドが設定された年の収益率は、設定日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3【ファンドの経理状況】

<更新後>

- 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。
- 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1期中間計算期間（2023年3月24日から2023年9月23日まで）の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により中間監査を受けております。

1【財務諸表】

【中間財務諸表】

【三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期中間計算期間 (2023年 9月23日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,111
コール・ローン	54,279
親投資信託受益証券	10,914,443
流動資産合計	10,969,833
資産合計	10,969,833
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,786
未払受託者報酬	642
未払委託者報酬	33,230
その他未払費用	46
流動負債合計	37,704
負債合計	37,704
純資産の部	
元本等	
元本	10,793,543
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	138,586
(分配準備積立金)	-
元本等合計	10,932,129
純資産合計	10,932,129
負債純資産合計	10,969,833

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月24日 至 2023年 9月23日
営業収益	

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月24日 至 2023年 9月23日
有価証券売買等損益	3,857
為替差損益	22,396
営業収益合計	26,253
営業費用	
受託者報酬	642
委託者報酬	33,230
その他費用	7,746
営業費用合計	41,618
営業利益又は営業損失（ ）	67,871
経常利益又は経常損失（ ）	67,871
中間純利益又は中間純損失（ ）	67,871
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	206,457
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	206,457
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	138,586

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期中間計算期間 自 2023年3月24日 至 2023年9月23日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第1期中間計算期間 (2023年9月23日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	10,793,543口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0128円 (1万口当たりの純資産額10,128円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期中間計算期間 (2023年9月23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）

第1期中間計算期間（2023年9月23日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	469,559	-	473,345	3,786
	小計	469,559	-	473,345	3,786
合計		469,559	-	473,345	3,786

（注）1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

項目	第1期中間計算期間 (2023年9月23日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	9,793,543円
期中一部解約元本額	-円

【三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期中間計算期間 (2023年9月23日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	6,697
コール・ローン	327,108
親投資信託受益証券	89,732,897
流動資産合計	90,066,702
資産合計	90,066,702
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	61,465
未払受託者報酬	3,967
未払委託者報酬	206,425
その他未払費用	539
流動負債合計	272,396
負債合計	272,396
純資産の部	
元本等	
元本	86,120,800
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,673,506
（分配準備積立金）	-
元本等合計	89,794,306
純資産合計	89,794,306

第1期中間計算期間
(2023年 9月23日現在)

負債純資産合計	90,066,702
---------	------------

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月24日 至 2023年 9月23日
営業収益	
有価証券売買等損益	99,773
為替差損益	257,293
営業収益合計	357,066
営業費用	
支払利息	1
受託者報酬	3,967
委託者報酬	206,425
その他費用	8,239
営業費用合計	218,632
営業利益又は営業損失()	575,698
経常利益又は経常損失()	575,698
中間純利益又は中間純損失()	575,698
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()	7,330
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,374,496
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	4,374,496
剰余金減少額又は欠損金増加額	117,962
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	117,962
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()	3,673,506

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期中間計算期間 自 2023年3月24日 至 2023年9月23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>

	(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。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期中間計算期間 (2023年9月23日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	86,120,800口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0427円 (1万口当たりの純資産額10,427円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期中間計算期間 (2023年9月23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)

第1期中間計算期間（2023年9月23日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
	為替予約取引 売建				

市場取引以外 の取引	アメリカ・ドル	7,624,366	-	7,685,831	61,465
	小計	7,624,366	-	7,685,831	61,465
	合 計	7,624,366	-	7,685,831	61,465

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項 目	第1期中間計算期間 (2023年9月23日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	87,625,506円
期中一部解約元本額	2,504,706円

【三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

第1期中間計算期間 (2023年 9月23日現在)	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	29,263
コール・ローン	1,429,369
親投資信託受益証券	377,611,416
派生商品評価勘定	3,280
流動資産合計	379,073,328
資産合計	379,073,328
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	330,595
未払受託者報酬	16,483
未払委託者報酬	881,021
未払利息	2
その他未払費用	2,412

第1期中間計算期間 (2023年 9月23日現在)	
流動負債合計	1,230,513
負債合計	1,230,513
純資産の部	
元本等	
元本	355,487,664
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	22,355,151
（分配準備積立金）	-
元本等合計	377,842,815
純資産合計	377,842,815
負債純資産合計	379,073,328

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

第1期中間計算期間 自 2023年 3月24日 至 2023年 9月23日	
営業収益	
受取利息	1
有価証券売買等損益	257,196
為替差損益	1,340,914
営業収益合計	1,083,717
営業費用	
支払利息	71
受託者報酬	16,483
委託者報酬	881,021
その他費用	10,112
営業費用合計	907,687
営業利益又は営業損失（ ）	1,991,404
経常利益又は経常損失（ ）	1,991,404
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,991,404
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（ ）	31,696
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	24,579,763
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	24,579,763
剰余金減少額又は欠損金増加額	201,512
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	201,512
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（ ）	22,355,151

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期中間計算期間
	自 2023年3月24日 至 2023年9月23日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第1期中間計算期間 (2023年9月23日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	355,487,664口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0629円 (1万口当たりの純資産額10,629円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期中間計算期間 (2023年9月23日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期中間計算期間（2023年9月23日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建 アメリカ・ドル	43,527,082	-	43,854,397	327,315
	小計	43,527,082	-	43,854,397	327,315
	合 計	43,527,082	-	43,854,397	327,315

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項 目	第1期中間計算期間 (2023年9月23日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	357,494,736円
期中一部解約元本額	3,007,072円

【三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

第1期中間計算期間 (2023年 9月23日現在)	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	14,617

第1期中間計算期間 (2023年 9月23日現在)	
コール・ローン	713,950
親投資信託受益証券	167,603,274
派生商品評価勘定	2,144
流動資産合計	168,333,985
資産合計	168,333,985
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	168,523
未払受託者報酬	7,323
未払委託者報酬	392,182
未払利息	1
その他未払費用	1,047
流動負債合計	569,076
負債合計	569,076
純資産の部	
元本等	
元本	154,982,619
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	12,782,290
（分配準備積立金）	-
元本等合計	167,764,909
純資産合計	167,764,909
負債純資産合計	168,333,985

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

第1期中間計算期間 自 2023年 3月24日 至 2023年 9月23日	
営業収益	
受取利息	1
有価証券売買等損益	968,164
為替差損益	809,375
営業収益合計	158,790
営業費用	
支払利息	10
受託者報酬	7,323
委託者報酬	392,182
その他費用	8,747
営業費用合計	408,262
営業利益又は営業損失（ ）	249,472
経常利益又は経常損失（ ）	249,472
中間純利益又は中間純損失（ ）	249,472
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（ ）	38,194
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	13,225,237
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	13,225,237
剰余金減少額又は欠損金増加額	231,669
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	231,669
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（ ）	12,782,290

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期中間計算期間 自 2023年3月24日 至 2023年9月23日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期中間計算期間 (2023年9月23日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	154,982,619口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0825円 (1万口当たりの純資産額10,825円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項 目	第1期中間計算期間 (2023年9月23日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期中間計算期間（2023年9月23日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	23,397,828	-	23,564,207	166,379
	小計	23,397,828	-	23,564,207	166,379
合 計		23,397,828	-	23,564,207	166,379

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項 目	第1期中間計算期間 (2023年9月23日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	156,794,768円
期中一部解約元本額	2,812,149円

【三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

		第1期中間計算期間 (2023年 9月23日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託		8,398
コール・ローン		410,215
親投資信託受益証券		81,235,837
流動資産合計		81,654,450
資産合計		
81,654,450		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		100,124
未払受託者報酬		4,520
未払委託者報酬		242,974
その他未払費用		623
流動負債合計		348,241
負債合計		
348,241		
純資産の部		
元本等		
元本		73,686,804
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()		7,619,405
(分配準備積立金)		-
元本等合計		81,306,209
純資産合計		
81,306,209		
負債純資産合計		
81,654,450		

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

		第1期中間計算期間 自 2023年 3月24日 至 2023年 9月23日
営業収益		
有価証券売買等損益		1,218,187
為替差損益		576,160
営業収益合計		642,027
営業費用		
支払利息		6
受託者報酬		4,520
委託者報酬		242,974
その他費用		8,323
営業費用合計		255,823
営業利益又は営業損失 ()		
386,204		
経常利益又は経常損失 ()		
386,204		
中間純利益又は中間純損失 ()		
386,204		
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 ()		1,268
期首剰余金又は期首欠損金 ()		
-		
剰余金増加額又は欠損金減少額		7,243,167
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		7,243,167
剰余金減少額又は欠損金増加額		
8,698		

第1期中間計算期間
自 2023年 3月24日
至 2023年 9月23日

中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,698
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（ ）	7,619,405

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第1期中間計算期間 自 2023年3月24日 至 2023年9月23日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期中間計算期間 (2023年9月23日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	73,686,804口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1034円 (1万口当たりの純資産額11,034円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期中間計算期間 (2023年9月23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)

第1期中間計算期間(2023年9月23日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	13,124,727	-	13,224,851	100,124
	小計	13,124,727	-	13,224,851	100,124
合 計		13,124,727	-	13,224,851	100,124

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第1期中間計算期間 (2023年9月23日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	72,776,837円
期中一部解約元本額	90,033円

(参考)

「三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)」、「三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)」、「三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)」、「三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)」および「三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」および「ゴールド・インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

(1)貸借対照表

(単位:円)

(2023年9月23日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	50,660,812
コール・ローン	2,474,539,050
株式	278,587,103,810
派生商品評価勘定	8,092,500
未収入金	431,200
未収配当金	111,809,722
差入委託証拠金	89,280,000
流動資産合計	281,321,917,094
資産合計	
281,321,917,094	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,110,400
前受金	6,765,000
未払解約金	399,289,273
未払利息	4,963
その他未払費用	9,782
流動負債合計	412,179,418
負債合計	
412,179,418	
純資産の部	
元本等	

元本		67,787,503,075
剰余金		
剰余金又は欠損金()		213,122,234,601
元本等合計		280,909,737,676
純資産合計		280,909,737,676
負債純資産合計		281,321,917,094

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年3月24日 至 2023年9月23日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2023年9月23日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	67,787,503,075口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 4.1440円 (1万口当たりの純資産額41,440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9月23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>

	(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)

(2023年9月23日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0512月	2,097,082,900	-	2,099,065,000	1,982,100
	小計	2,097,082,900	-	2,099,065,000	1,982,100
合計		2,097,082,900	-	2,099,065,000	1,982,100

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2023年9月23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	66,701,914,241円
同期中における追加設定元本額	5,971,317,091円
同期中における一部解約元本額	4,885,728,257円
2023年9月23日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,585,442,506円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	996,393,103円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,502,937,826円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,638,728,838円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	162,010,421円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	3,566,971円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	15,678,498円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	55,777,041円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	155,360,907円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	144,882,676円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	268,160,436円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,283,683,581円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	25,409,678,065円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	257,060,404円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	330,935,408円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	199,376,259円
イオン・バランス戦略ファンド	87,758,384円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	48,516,177円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	197,628,120円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	187,424,925円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	742,696,107円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	425,777,503円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	496,767,890円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	54,249,963円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	1,083,869,632円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	39,476,934円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	230,248,249円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	238,333,964円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,558,204円
日興FWS・日本株インデックス	1,915,592,538円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	52,290,837円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	43,516円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	57,551円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	61,241円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	74,595円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	74,595円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	340,558円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	3,964,134円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	19,710,835円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	10,143,396円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	5,593,190円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,467,763,621円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	7,917,691円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>	50,064,321円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,005,103,109円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,200,017,429円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	4,649,817,948円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	31,653,541円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	112,870,377円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	604,715,999円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 <適格機関投資家限定>	36,747,614円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	201,101,365円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	670,613,844円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	418,109,537円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	1,305,872,201円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	322,605円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	27,618,110円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	30,773,848円

SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	26,636,479円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	14,740,890円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	70,300,766円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	179,102,491円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	37,938,431円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	33,340,590円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	6,832,341円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	32,235,541円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	421,917,149円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	153,857,659円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	159,779,160円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	70,095,844円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	57,894,803円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	32,775,213円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	56,169,058円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	32,927,167円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	52,627,461円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	621,240,315円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	17,621,175円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	32,461,404円
合計	67,787,503,075円

外国株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2023年9月23日現在)

資産の部

流動資産

預金	4,228,034,773
金銭信託	7,976,196
コール・ローン	389,599,149
株式	559,188,056,880
投資証券	11,750,817,596
派生商品評価勘定	6,124,534
未収入金	38,864,185
未収配当金	774,177,016
差入委託証拠金	1,948,344,901
流動資産合計	578,331,995,230

資産合計

578,331,995,230

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	185,537,806
未払解約金	232,322,849
未払利息	781

その他未払費用	3,324
流動負債合計	417,864,760
負債合計	417,864,760
純資産の部	
元本等	
元本	80,714,769,806
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	497,199,360,664
元本等合計	577,914,130,470
純資産合計	577,914,130,470
負債純資産合計	578,331,995,230

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年3月24日 至 2023年9月23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>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2023年9月23日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	80,714,769,806口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 7.1600円 (1万口当たりの純資産額71,600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9月23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）

(2023年9月23日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT DEC23	5,695,531,484	-	5,519,993,202	175,538,282
	SPI 200 FUTURES DEC23	222,049,295	-	218,666,273	3,383,022
	FTSE 100 IDX FUT DEC23	303,383,735	-	308,525,801	5,142,066
	EURO STOXX 50 DEC23	1,046,665,928	-	1,041,352,104	5,313,824
	小計	7,267,630,442	-	7,088,537,380	179,093,062
	合計	7,267,630,442	-	7,088,537,380	179,093,062

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	403,060,838	-	401,963,851	1,096,987
	小計	403,060,838	-	401,963,851	1,096,987
	売建				
	アメリカ・ドル	32,495,804	-	32,471,648	24,156
	カナダ・ドル	31,746,592	-	31,652,031	94,561
	イギリス・ポンド	58,745,953	-	58,205,581	540,372
	ユーロ	37,093,269	-	36,975,581	117,688
	小計	160,081,618	-	159,304,841	776,777
合計		563,142,456	-	561,268,692	320,210

(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)

(2023年9月23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	75,417,894,105円
同期中における追加設定元本額	8,771,361,319円
同期中における一部解約元本額	3,474,485,618円
2023年9月23日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	40,011,383,237円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	288,872,736円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,114,280,201円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	815,724,504円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	31,975,460円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	866,919円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	4,357,225円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	14,119,075円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	43,555,666円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	52,652,732円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	109,889,814円
外国株式指数ファンド	1,010,674,268円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	21,240,717,394円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	117,596,810円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	151,850,228円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	91,497,818円
イオン・バランス戦略ファンド	24,732,905円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	24,933,853円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	141,038,963円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	127,478,929円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	496,999,372円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	297,647,761円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	399,120,362円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	61,702,017円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	2,222,272,880円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	11,186,228円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	55,569,565円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	53,014,111円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,887,977円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	926,785,128円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	288,002,945円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,343,800,830円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	95,978,999円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	19,245円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	27,998円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	30,142円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	38,462円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	38,462円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	96,982円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	1,150,564円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	5,890,933円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	3,028,604円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	1,653,839円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	352,453,591円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	2,172,489円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定>	14,085,258円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	382,721,738円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	598,426,678円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,638,785,938円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	8,840,391円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	41,243,434円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	382,756,601円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 <適格機関投資家限定>	31,123,233円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	74,041,043円

SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	375,737,406円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	241,471,563円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	564,630,350円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	181,246円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	177,833,787円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	47,076,116円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	5,806,213円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	5,839,402円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	3,468,121円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	13,196,684円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	44,019,060円
SMAM・グローバルバランスファンド（標準型）VA<適格機関投資家限定>	88,244,496円
SMAM・グローバルバランスファンド（債券重視型）VA<適格機関投資家限定>	38,344,500円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	170,474,139円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	56,978,052円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,469,056,578円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	24,813,997円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	14,256,202円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	22,698,063円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	128,392,752円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド（リスク3%）<適格機関投資家限定>	10,458,542円
合計	80,714,769,806円

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2023年9月23日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,974,731,565
金銭信託	1,987,967
コール・ローン	97,102,711
株式	29,293,946,292
投資信託受益証券	1,609,337,264
投資証券	2,718,544,445
派生商品評価勘定	2,784
未収入金	672,091
未収配当金	70,462,154
差入委託証拠金	847,336,111
流動資産合計	36,614,123,384
資産合計	36,614,123,384
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	84,707,905

未払利息	194
その他未払費用	460
流動負債合計	84,708,559
負債合計	84,708,559
純資産の部	
元本等	
元本	20,375,303,610
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	16,154,111,215
元本等合計	36,529,414,825
純資産合計	36,529,414,825
負債純資産合計	36,614,123,384

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年3月24日 至 2023年9月23日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2023年9月23日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	20,375,303,610口

2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1,7928円 (1万口当たりの純資産額17,928円)
----------------	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年9月23日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(株式、投資信託受益証券、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
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)

(2023年9月23日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT DEC23	3,031,111,338	-	2,946,524,485	84,586,853
	小計	3,031,111,338	-	2,946,524,485	84,586,853
合計		3,031,111,338	-	2,946,524,485	84,586,853

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
	為替予約取引 買建				

市場取引以外	アメリカ・ドル	88,000,000	-	87,881,732	118,268
の取引	小計	88,000,000	-	87,881,732	118,268
	合 計	88,000,000	-	87,881,732	118,268

(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。

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2023年9月23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	18,234,888,009円
同期中における追加設定元本額	3,530,045,927円
同期中における一部解約元本額	1,389,630,326円
2023年9月23日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	10,710,326,044円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,253,659,688円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	292,097,730円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	381,534,217円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	239,181,802円
イオン・バランス戦略ファンド	132,920,221円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	49,602,533円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	111,426,991円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	84,624,996円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	397,831,590円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	259,455,006円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	370,289,788円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	121,970,200円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,768,119円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	766,543,121円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	3,008,538,113円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	68,493,292円

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	39,354円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	55,897円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	61,278円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	73,424円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	73,424円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	285,383円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	3,386,264円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	16,761,176円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	8,604,025円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	4,781,418円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	86,918,516円
合計	20,375,303,610円

国内債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2023年9月23日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	9,091,944
コール・ローン	444,098,101
国債証券	102,027,376,730
地方債証券	9,939,132,200
特殊債券	9,463,616,661
社債券	6,157,195,600
未収利息	147,584,241
前払費用	7,559,900
流動資産合計	128,195,655,377
資産合計	
128,195,655,377	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	35,430,000
未払利息	890
その他未払費用	2,391
流動負債合計	35,433,281
負債合計	
35,433,281	
純資産の部	
元本等	
元本	105,776,138,348
剰余金	
剰余金又は欠損金()	22,384,083,748
元本等合計	128,160,222,096
純資産合計	
128,160,222,096	
負債純資産合計	
128,195,655,377	

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年3月24日 至 2023年9月23日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2023年9月23日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	105,776,138,348口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2116円 (1万口当たりの純資産額12,116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9月23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)

(2023年9月23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	98,535,915,219円
同期中における追加設定元本額	18,839,317,700円
同期中における一部解約元本額	11,599,094,571円
2023年9月23日現在の元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	8,946,336,772円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	14,299,663,381円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,660,547,579円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	877,784,395円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	41,964,940円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	189,022,302円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	600,320,093円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	1,156,954,778円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	640,214,724円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	767,763,845円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	143,886,960円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	943,791,009円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	331,990,644円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,054,188円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	86,988,285円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	4,519,726,612円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,458,921,709円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,399,643,376円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	562,163,422円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	53,974,627円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	275,498,620円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	370,421,114円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	771,515,492円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	243,662,514円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	10,076,380円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	411,813円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	429,823円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	259,318円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	113,477円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	115,120円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	2,360,942円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	13,074,446円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	37,110,564円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	9,205,136円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	1,074,952円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,083,104,237円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	9,417,088,788円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	5,717,595,087円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	14,505,099,336円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	299,776,143円

SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	486,840,988円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	264,798,022円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	116,608,704円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,721,293,475円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,097,868,199円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,143,532,384円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,504,519,879円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,001,996円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	998,088,789円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	378,194,192円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	465,426,832円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	171,339,049円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	47,446,788円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,192,304,936円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,995,130,514円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	588,317,252円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	208,632,864円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	21,745,950円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	253,927,864円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,607,178,796円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,270,648,412円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	801,786,380円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,280,562,535円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	2,417,659,545円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	288,577,060円
合計	105,776,138,348円

外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2023年9月23日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	239,628,152
金銭信託	19,688,126
コール・ローン	961,671,031
国債証券	163,943,810,141
未収利息	1,148,870,693
前払費用	84,589,097
流動資産合計	166,398,257,240
資産合計	166,398,257,240
負債の部	
流動負債	
未払解約金	121,290,828

その他未払費用	2,898
流動負債合計	121,293,726
負債合計	121,293,726
純資産の部	
元本等	
元本	79,359,918,406
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	86,917,045,108
元本等合計	166,276,963,514
純資産合計	166,276,963,514
負債純資産合計	166,398,257,240

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年3月24日 至 2023年9月23日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 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	(2023年9月23日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	79,359,918,406口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.0952円 (1万口当たりの純資産額20,952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9月23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ぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
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ん。

(その他の注記)

(2023年9月23日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	77,880,143,308円
同期中における追加設定元本額	6,264,163,635円
同期中における一部解約元本額	4,784,388,537円
2023年9月23日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	26,554,098,972円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	930,561,373円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,323,254,511円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,415,352,860円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	164,009,819円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	5,977,634円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	25,661,980円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	96,927,254円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	286,725,074円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	210,346,480円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	340,690,759円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	22,003,077円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	163,762,009円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	180,392,210円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	100,600,584円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	34,145,395円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	341,888,818円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	221,289,959円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	618,093,350円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	193,024,457円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	94,136,142円

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	212,007,613円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	892,493,150円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	38,751,866円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	126,408,326円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	90,751,827円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,979,692円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	1,237,785,977円
三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド	243,894,511円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	26,867円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	37,471円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	41,033円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	47,947円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	47,947円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	475,572円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	4,467,427円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	20,426,127円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	9,668,453円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	4,831,054円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	4,732,086,195円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	24,742,199円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	4,735,273,294円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,776,414,227円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	8,946,687,136円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	29,825,111円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	70,919,769円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	650,211,181円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	105,409,785円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	891,341,019円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,260,343,854円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,251,043,047円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,841,934,104円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	6,593,586,445円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	317,910,827円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	109,188,358円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	61,534,170円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	29,749,375円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,741,981円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	69,880,473円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	350,309,527円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	76,006,193円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,643,421円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,511,845円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	820,004,466円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	489,884,162円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	668,807,457円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	284,791,331円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	229,812,549円

SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	119,206,614円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	57,520,352円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	91,943,891円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	1,335,263,034円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド（リスク3%）<適格機関投資家限定>	73,700,721円
合計	79,359,918,406円

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2023年9月23日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	37,761,012
金銭信託	2,951,369
コール・ローン	144,160,280
国債証券	18,884,119,133
派生商品評価勘定	30,407,143
未収利息	125,772,314
前払費用	18,883,409
流動資産合計	19,244,054,660
資産合計	19,244,054,660
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	181,424,094
未払解約金	5,041,000
その他未払費用	499
流動負債合計	186,465,593
負債合計	186,465,593
純資産の部	
元本等	
元本	15,855,295,184
剰余金	
剰余金又は欠損金()	3,202,293,883
元本等合計	19,057,589,067
純資産合計	19,057,589,067
負債純資産合計	19,244,054,660

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年3月24日 至 2023年9月23日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2023年9月23日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	15,855,295,184口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2020円 (1万口当たりの純資産額12,020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9月23日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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)

(2023年9月23日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	9,190,766,366	-	9,347,061,570	156,295,204
	カナダ・ドル	385,751,983	-	393,712,200	7,960,217
	オーストラリア・ド ル	283,697,734	-	285,313,896	1,616,162
	シンガポール・ドル	186,941,293	-	187,685,448	744,155
	ニュージーランド・ ドル	43,144,661	-	43,672,900	528,239
	イギリス・ポンド	958,664,602	-	945,202,104	13,462,498
	イスラエル・シケ ル	57,719,381	-	58,402,119	682,738
	デンマーク・クロー ネ	61,506,134	-	61,351,239	154,895
	ノルウェー・クロー ネ	30,947,347	-	31,069,036	121,689
	スウェーデン・ク ローナ	36,574,925	-	36,433,656	141,269
	メキシコ・ペソ	196,942,459	-	196,415,400	527,059
	オフショア・人民元	1,266,513,218	-	1,279,897,190	13,383,972
	ポーランド・ズロチ	97,552,370	-	94,618,134	2,934,236
	ユーロ	6,367,543,256	-	6,354,447,788	13,095,468
	小計	19,164,265,729	-	19,315,282,680	151,016,951
	合 計	19,164,265,729	-	19,315,282,680	151,016,951

(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)

(2023年9月23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	18,529,239,574円
同期中における追加設定元本額	6,049,240,091円
同期中における一部解約元本額	8,723,184,481円
2023年9月23日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,757,814,559円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	592,185,183円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	11,933,989円
イオン・バランス戦略ファンド	869,102,583円
三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)	1,363,624,873円
三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	600,919,437円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	1,199,938,397円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	335,466,382円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	52,630,230円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	88,904,445円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	607,138,193円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	2,955,830円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	16,388,961円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	46,741,864円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	11,621,038円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	1,323,199円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,087,053,848円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,006,607円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	5,530,928,799円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	608,135,876円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	382,886,890円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	612,248,747円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	74,345,254円
合計	15,855,295,184円

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2023年9月23日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	100,239,109
金銭信託	190,524
コール・ローン	9,306,187
国債証券	4,296,846,578
未収利息	52,359,308
前払費用	3,780,678

流動資産合計	4,462,722,384
資産合計	4,462,722,384
負債の部	
流動負債	
未払金	31,214,485
その他未払費用	46
流動負債合計	31,214,531
負債合計	31,214,531
純資産の部	
元本等	
元本	4,438,340,805
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,832,952
元本等合計	4,431,507,853
純資産合計	4,431,507,853
負債純資産合計	4,462,722,384

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年3月24日 至 2023年9月23日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2023年9月23日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	4,438,340,805口

2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 6,832,952円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9985円 (1万口当たりの純資産額9,985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9月23日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
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)

(2023年9月23日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,732,230,707円
同期中における追加設定元本額	897,769,817円
同期中における一部解約元本額	191,659,719円
2023年9月23日現在の元本の内訳	
日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）	414,040,852円
日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）	3,104,620,053円
三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド	26,996,809円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	166,942,418円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	387,424,522円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	261,617,758円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	41,886,948円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	4,920,292円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	34,762円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	45,334円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	49,379円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	60,552円

三井住友D S ・ D Cターゲットイヤーファンド2 0 6 5	60,552円
三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	119,274円
三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	2,350,173円
三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）	14,029,889円
三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	8,262,402円
三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）	4,878,836円
合 計	4,438,340,805円

Jリート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2023年9月23日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,405,719
コール・ローン	68,662,690
投資証券	13,132,107,600
未収配当金	145,528,436
前払金	614,000
差入委託証拠金	2,260,000
流動資産合計	13,350,578,445
資産合計	13,350,578,445
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	738,400
未払金	7,287,231
未払解約金	14,580,826
未払利息	137
その他未払費用	234
流動負債合計	22,606,828
負債合計	22,606,828
純資産の部	
元本等	
元本	5,032,954,004
剰余金	
剰余金又は欠損金 ()	8,295,017,613
元本等合計	13,327,971,617
純資産合計	13,327,971,617
負債純資産合計	13,350,578,445

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年3月24日
	至 2023年9月23日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

	<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	(2023年9月23日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,032,954,004口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6481円 (1万口当たりの純資産額26,481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9月23日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券） 「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)

(2023年9月23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	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物 0512月	37,778,400	-	37,040,000	738,400
	小計	37,778,400	-	37,040,000	738,400
合 計		37,778,400	-	37,040,000	738,400

(注) 1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2023年9月23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	4,375,703,265円
同期中における追加設定元本額	1,375,216,881円
同期中における一部解約元本額	717,966,142円
2023年9月23日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	235,220,778円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	314,261,793円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	140,438,642円
イオン・バランス戦略ファンド	67,042,212円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,540,302,410円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	19,441,147円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	39,063,929円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	38,725,679円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	161,878,384円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	101,899,595円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	74,867,373円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	40,621,995円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,252,100円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	231,814,046円
日興FWS・Jリートインデックス	599,491,115円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	53,539,240円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	10,354円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	16,533円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	20,843円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	26,282円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	26,282円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	122,781円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	2,010,254円

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	11,449,020円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	6,337,617円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	3,733,329円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,148,468円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	79,713,693円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	49,281,384円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	79,401,552円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%) <適格機関投資家限定>	136,795,174円
合計	5,032,954,004円

外国リート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2023年9月23日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	499,827,133
金銭信託	866,679
コール・ローン	42,333,137
投資証券	28,418,669,291
派生商品評価勘定	10,377
未収入金	2,188,569
未収配当金	106,911,193
流動資産合計	29,070,806,379
資産合計	
	29,070,806,379
負債の部	
流動負債	
未払解約金	42,554,097
未払利息	84
その他未払費用	109
流動負債合計	42,554,290
負債合計	
	42,554,290
純資産の部	
元本等	
元本	10,074,555,604
剰余金	
剰余金又は欠損金()	18,953,696,485
元本等合計	29,028,252,089
純資産合計	
	29,028,252,089
負債純資産合計	
	29,070,806,379

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年3月24日 至 2023年9月23日
----	------------------------------

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2023年9月23日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	10,074,555,604口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.8813円 (1万口当たりの純資産額28,813円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年9月23日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券） 「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）

（2023年9月23日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	27,000,000	-	27,000,787	787
	小計	27,000,000	-	27,000,787	787
	売建				
	アメリカ・ドル	12,900,000	-	12,890,410	9,590
	小計	12,900,000	-	12,890,410	9,590
	合 計	39,900,000	-	39,891,197	10,377

（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）

（2023年9月23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	9,550,824,997円
同期中における追加設定元本額	1,298,164,102円
同期中における一部解約元本額	774,433,495円
2023年9月23日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	13,398,410円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	19,774,737円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	57,234,466円
イオン・バランス戦略ファンド	40,508,648円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	8,114,228,132円

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	8,150,712円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	34,590,661円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	35,439,615円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	146,857,153円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	91,262,852円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	66,931,443円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	113,250,353円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	949,162円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	346,618,295円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	86,945,403円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	631,321,858円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	116,859,148円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	7,339円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	9,382円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	9,541円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	11,376円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	11,376円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	30,436円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	367,326円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	1,914,117円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	954,830円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	545,741円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	34,040,769円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	40,920,094円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%) <適格機関投資家限定>	71,412,229円
合計	10,074,555,604円

ゴールド・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2023年9月23日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	60,463,979
金銭信託	1,297,998
コール・ローン	63,401,028
投資信託受益証券	6,626,085,714
流動資産合計	6,751,248,719
資産合計	6,751,248,719
負債の部	
流動負債	
未払金	19,488,896
未払解約金	27,200,000
未払利息	127
その他未払費用	214
流動負債合計	46,689,237

負債合計	46,689,237
純資産の部	
元本等	
元本	4,856,210,094
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,848,349,388
元本等合計	6,704,559,482
純資産合計	6,704,559,482
負債純資産合計	6,751,248,719

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年3月24日 至 2023年9月23日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<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	(2023年9月23日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	4,856,210,094口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3806円 (1万口当たりの純資産額13,806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9月23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ぬ。

2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2023年9月23日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,822,730,291円
同期中における追加設定元本額	1,318,878,403円
同期中における一部解約元本額	285,398,600円
2023年9月23日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)	329,321,798円
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)	3,844,080,954円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)	639,903,109円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	257,409円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	3,887,829円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	21,668,378円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	11,079,508円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	6,011,109円
合 計	4,856,210,094円

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)

2023年10月31日現在

資産総額	15,643,742円
負債総額	27,467円
純資産総額(-)	15,616,275円
発行済口数	15,739,631口
1口当たり純資産額(/)	0.9922円
(1万口当たり純資産額)	(9,922円)

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)

2023年10月31日現在

資産総額	165,552,717円
負債総額	371,605円
純資産総額(-)	165,181,112円
発行済口数	161,828,089口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.0207円 (10,207円)

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)

2023年10月31日現在

資産総額	586,206,817円
負債総額	1,407,156円
純資産総額(-)	584,799,661円
発行済口数	562,253,220口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.0401円 (10,401円)

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)

2023年10月31日現在

資産総額	233,015,182円
負債総額	673,755円
純資産総額(-)	232,341,427円
発行済口数	219,644,843口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.0578円 (10,578円)

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)

2023年10月31日現在

資産総額	90,628,917円
負債総額	283,790円
純資産総額(-)	90,345,127円
発行済口数	83,843,930口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.0775円 (10,775円)

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】

<更新後>

イ 資本金の額および株式数

	2023年10月31日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

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。

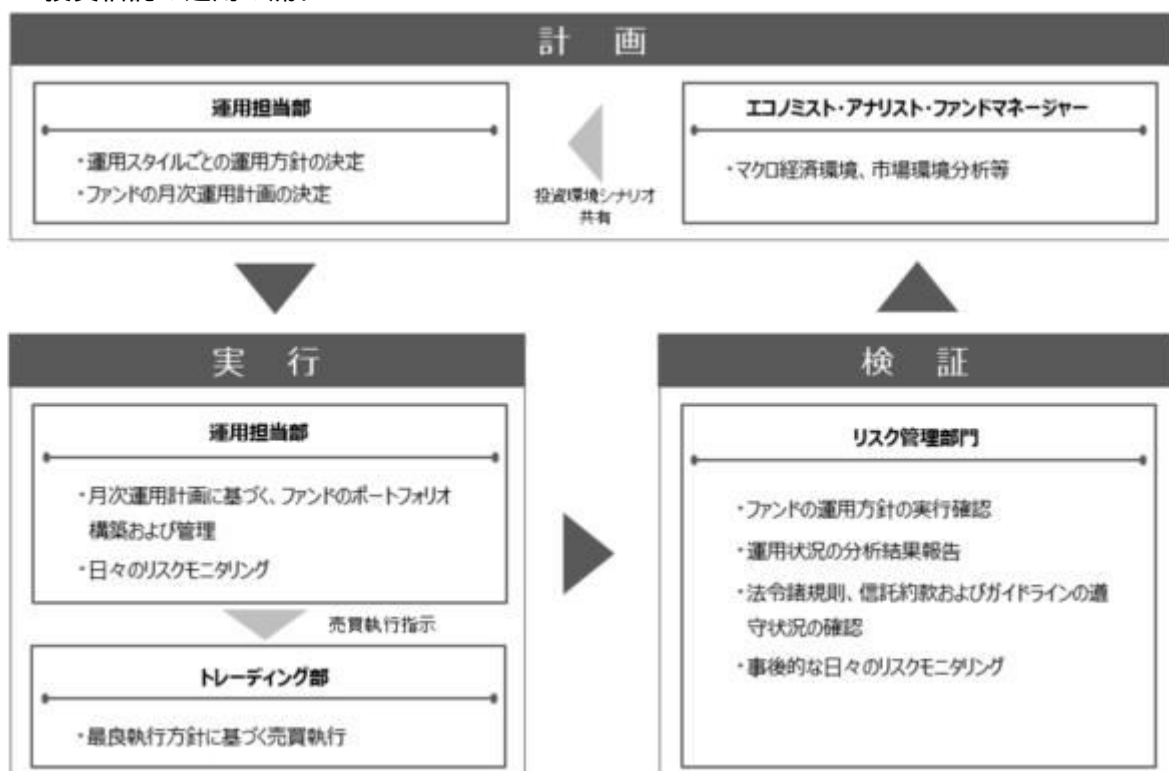
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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】

<更新後>

「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10月31日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	695	10,733,058
単位型株式投資信託	96	554,272
追加型公社債投資信託	1	24,785
単位型公社債投資信託	164	254,556
合計	956	11,566,673

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

- 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)
負債の部		
流動負債		
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

純資産の部

株主資本

資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	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 (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)
営業収益		
委託者報酬	66,139,024	61,471,271
運用受託報酬	9,652,634	8,978,419
投資助言報酬	1,256,334	1,273,386
その他営業収益		
サービス支 hands 手数料	199,046	208,222
その他	32,936	22,995
営業収益計	77,279,976	71,954,296
営業費用		
支払手数料	30,522,133	28,036,456
広告宣伝費	330,161	294,588
調査費		
調査費	3,196,921	3,749,357
委託調査費	12,192,048	11,455,987
営業雑経費		
通信費	67,600	61,068
印刷費	494,834	452,951
協会費	34,433	38,701
諸会費	30,488	33,447
情報機器関連費	4,767,504	5,067,617
販売促進費	31,930	29,621
その他	181,301	197,696
営業費用合計	51,849,358	49,417,495
一般管理費		
給料		
役員報酬	263,893	219,872
給料・手当	8,664,828	7,807,797
賞与	991,916	1,042,472
賞与引当金繰入額	2,100,323	1,798,492

交際費	12,301	27,713
寄付金	29,273	25,518
事務委託費	1,422,189	1,727,189
旅費交通費	16,863	99,733
租税公課	476,729	352,030
不動産賃借料	1,289,256	1,268,303
退職給付費用	632,559	624,551
固定資産減価償却費	3,133,951	3,247,869
のれん償却費	304,540	304,540
諸経費	256,994	200,758
一般管理費合計	19,595,622	18,746,845
営業利益	5,834,995	3,789,956

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	7,666	1,755
受取利息	1,836	1,373
時効成立分配金・償還金	43,406	521
原稿・講演料	2,587	2,281
投資有価証券償還益	383,608	119,033
投資有価証券売却益	911,268	25,848
為替差益	4,673	5,816
雑収入	81,640	91,814
営業外収益合計	1,436,686	248,443
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	454,339
投資有価証券償還損	146,219	83,598
投資有価証券売却損	81,384	152,691
雑損失	2,866	-
営業外費用合計	230,470	690,629
経常利益	7,041,212	3,347,770
特別損失		
固定資産除却損	1 83,651	13,203
システム統合関連費用	2 375,636	-
早期退職費用	3 260,075	126,832
支払補償費	4 -	30,075
その他特別損失	67,000	-
特別損失合計	786,362	170,111
税引前当期純利益	6,254,849	3,177,659
法人税、住民税及び事業税	3,101,482	1,622,064
法人税等調整額	965,673	541,433
法人税等合計	2,135,809	1,080,631
当期純利益	4,119,040	2,097,028

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242
当期変動額								
剰余金の配当								
欠損填補			8,460,037	8,460,037				8,460,037
当期純利益								4,119,040
任意積立金の 取崩						60,000	1,476,959	1,536,959
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）								
当期変動額合計	-	-	8,460,037	8,460,037	-	60,000	1,476,959	14,116,037
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	-	-	3,834,794

	株主資本		評価・換算差額等		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	㈱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㈱	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	㈱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㈱	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いません。

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

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】

<訂正前>

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
株式会社広島銀行	54,573	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

<訂正後>

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(2023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(2023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) 2023年3月末現在	事業の内容
株式会社広島銀行	54,573	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月6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 Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）の2023年3月24日から2023年9月23日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）の2023年9月23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（2023年3月24日から2023年9月23日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

- (注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月6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 Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）の2023年3月24日から2023年9月23日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）の2023年9月23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（2023年3月24日から2023年9月23日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

- (注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月6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 Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）の2023年3月24日から2023年9月23日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）の2023年9月23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（2023年3月24日から2023年9月23日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

- (注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月6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 Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）の2023年3月24日から2023年9月23日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）の2023年9月23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（2023年3月24日から2023年9月23日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

- (注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月6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 Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）の2023年3月24日から2023年9月23日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）の2023年9月23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（2023年3月24日から2023年9月23日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

- (注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

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。