

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年12月20日提出
【計算期間】	第1期中(自 2023年3月24日至 2023年9月23日)
【ファンド名】	三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型) 三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型) 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) 三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型) 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)
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【電話番号】	03-6205-1649
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【ファンドの運用状況】

(1)【投資状況】

三井住友D S・F W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・F W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D S・F W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D S・F W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)【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D S・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D S・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D S・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D S・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。

【収益率の推移】

三井住友D S・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D S・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D S・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D S ・ F W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D S ・ F W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。

（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
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【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。

3【ファンドの経理状況】

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

【三井住友D S ・ F W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	
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 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	<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	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D S ・ F W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
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> <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	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	<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	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
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	<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	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>

	(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	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・FW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
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・FW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
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 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	<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	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 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> <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	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D S ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 5 0	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・D C つみたてN I S A ・世界分散ファンド	54,249,963円
三井住友D S ・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D S ・年金バランス3 0 (債券重点型)	39,476,934円
三井住友D S ・年金バランス5 0 (標準型)	230,248,249円
三井住友D S ・年金バランス7 0 (株式重点型)	238,333,964円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 6 0	5,558,204円
日興F W S ・日本株インデックス	1,915,592,538円
三井住友D S ・T O P I X インデックス・ファンド	52,290,837円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 5	43,516円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 0	57,551円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 5	61,241円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 5 5	74,595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	74,595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)	340,558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)	3,964,134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)	19,710,835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)	10,143,396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)	5,593,190円
S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,467,763,621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 >	7,917,691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 >	50,064,321円
S M A M ・バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,005,103,109円
S M A M ・バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	1,200,017,429円
S M A M ・バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	4,649,817,948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 >	31,653,541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 >	112,870,377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 >	604,715,999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 >	36,747,614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 >	201,101,365円
S M A M ・インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	670,613,844円
S M A M ・バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	418,109,537円
S M A M ・バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	1,305,872,201円
S M A M ・バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	322,605円
S M A M ・グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	27,618,110円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	30,773,848円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	26,636,479円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	14,740,890円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	70,300,766円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	179,102,491円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	37,938,431円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	33,340,590円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	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	<p>(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。</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)

(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		
	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	403,060,838	-	401,963,851	1,096,987

市場取引以 外の取引	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
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	375,737,406円
S M A M・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	241,471,563円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	564,630,350円
S M A M・バランスV A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・V A S(適格機関投資家専用)	177,833,787円
S M A M・グローバルバランス40V A <適格機関投資家限定>	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		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	88,000,000	-	87,881,732	118,268
	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	18,234,888,009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D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル2 (安定型)	3,386,264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)	16,761,176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)	8,604,025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)	4,781,418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	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

	<p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券</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>
--	---

（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）</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）

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
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>	486,840,988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>	264,798,022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>	116,608,704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>	1,721,293,475円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	2,097,868,199円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	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</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	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	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N I S A・世界分散ファンド	212,007,613円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	892,493,150円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	38,751,866円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	126,408,326円

三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	90,751,827円
三井住友D S ・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D S ・先進国債インデックス・ファンド	243,894,511円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2035	26,867円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2040	37,471円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2045	41,033円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2055	47,947円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2065	47,947円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	475,572円
三井住友D S ・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D S ・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D S ・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D S ・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	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(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った場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(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DS・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DS・DCターゲットイヤーファンド2050	41,886,948円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,920,292円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	34,762円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	45,334円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	49,379円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	60,552円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	60,552円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	119,274円
三井住友DS・FW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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

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

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

（デリバティブ取引に関する注記）

(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		
	リート指数先物取引				

市場取引	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D S・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D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,252,100円
三井住友D S・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D S・国内リートインデックス・ファンド	53,539,240円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	10,354円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	16,533円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	20,843円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	26,282円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	26,282円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	122,781円
三井住友D S・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D S・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D S・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D S・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	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>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				
	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W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ん。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

	<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

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

資本金の額および株式数

2023年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

最近5年間における資本金の額の増減
該当ありません。

(2)【事業の内容及び営業の状況】

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

2023年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)【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

該当ありません。

(ロ) その他の重要事項

該当ありません。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

5【委託会社等の経理状況】

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

(1)【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	49,008,279	37,742,400
金銭の信託	-	12,645,575
顧客分別金信託	300,041	300,046
前払費用	475,266	546,900
未収入金	103,809	437,880
未収委託者報酬	12,125,117	11,563,662
未収運用受託報酬	2,437,063	2,138,030
未収投資助言報酬	388,639	344,586
未収収益	36,700	35,477
その他の流動資産	18,458	8,423
流動資産合計	64,893,375	65,762,982
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	1,433,442	1,361,305
器具備品	653,985	559,057
土地	710	710
リース資産	7,357	4,114
建設仮勘定	5,500	81,240
有形固定資産合計	2,100,996	2,006,427
無形固定資産		
ソフトウェア	2,766,476	2,414,295
ソフトウェア仮勘定	100,616	508,956
のれん	3,349,950	3,045,409
顧客関連資産	13,558,615	11,445,340
電話加入権	12,716	12,706
商標権	42	36
無形固定資産合計	19,788,417	17,426,744
投資その他の資産		
投資有価証券	14,212,354	9,222,276
関係会社株式	11,246,398	11,850,598
長期差入保証金	1,414,646	1,388,987
長期前払費用	77,936	80,207
会員権	90,479	90,479
貸倒引当金	20,750	20,750
投資その他の資産合計	27,021,065	22,611,799
固定資産合計	48,910,479	42,044,971
資産合計	113,803,855	107,807,953

(単位：千円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
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	当事業年度 (自 2022年4月1日
--	-----------------------	-----------------------

至 2022年3月31日)

至 2023年3月31日)

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

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
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			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242
当期変動額								
剰余金の配当								
欠損填補			8,460,037	8,460,037				8,460,037
当期純利益								4,119,040
任意積立金の 取崩						60,000	1,476,959	1,536,959
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）								
当期変動額合計	-	-	8,460,037	8,460,037	-	60,000	1,476,959	14,116,037
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	-	-	3,834,794

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311

当期変動額					
剰余金の配当					
欠損填補	8,460,037	-			-
当期純利益	4,119,040	4,119,040			4,119,040
任意積立金の取崩	-	-			-
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			652,227	652,227	652,227
当期変動額合計	12,579,078	4,119,040	652,227	652,227	3,466,812
当期末残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124

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おりません。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 当座借越契約

当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

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

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

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

2 システム統合関連費用

社内システム統合に伴うものであり、主にデータの移行費用などであります。

3 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

4 支払補償費

受益者や販売会社に生じた損失の補償に伴い発生する費用であります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

2. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月28日 定時株主総会	普通株式	2,540,254	75.00	2022年 3月31日	2022年 6月29日

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

2. 剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月28日 定時株主総会	普通株式	2,540,254	75.00	2022年 3月31日	2022年 6月29日

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月28日 定時株主総会	普通株式	1,591,892	47.00	2023年 3月31日	2023年 6月29日

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
1年以内	1,166,952	1,161,545
1年超	2,323,090	1,161,545
合計	3,490,042	2,323,090

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

なお、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。

また、資金調達は行っていません。

(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、定期的に取り締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

当事業年度における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません(注1)参照)。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価格に近似することから、注記を省略しております。

前事業年度(2022年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	-	-	-
(2)投資有価証券			
その他有価証券	14,172,545	14,172,545	-
資産計	14,172,545	14,172,545	-

当事業年度(2023年3月31日)

(単位:千円)

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

(注1)市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
その他有価証券		
非上場株式	39,809	39,809
合計	39,809	39,809
子会社株式		
非上場株式	11,246,398	11,850,598
合計	11,246,398	11,850,598

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。なお、時価算定会計基準適用指針27-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項」については記載しておりません。

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

(単位:千円)

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

時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

(1) 金銭の信託

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

(2) 投資有価証券 その他有価証券

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度（2022年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2023年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式11,850,598千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	9,299,062	8,672,725	626,337
小計	9,299,062	8,672,725	626,337
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	4,873,482	5,039,817	166,335
小計	4,873,482	5,039,817	166,335
合計	14,172,545	13,712,543	460,001

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額 39,809千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	3,144,004	3,054,367	89,637
小計	3,144,004	3,054,367	89,637
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,038,462	6,295,278	256,815
小計	6,038,462	6,295,278	256,815
合計	9,182,466	9,349,645	167,178

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額 39,809千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
4,082,976	911,268	81,384

（単位：千円）

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
7,183,410	383,608	146,219

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,675,637	25,848	152,691

（単位：千円）

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額

6,449,143	119,033	83,598
-----------	---------	--------

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	5,084,506	5,027,832
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	5,084,506	5,027,832

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

(注) 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葉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(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	-	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	8,397,864	未払 手数料	1,661,614

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2.親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ(東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場)

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1.関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	-	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	5,279,199	未払手数料	1,265,651
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	-	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	7,030,381	未払手数料	1,288,749

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2.親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ(東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

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

(注)1.潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2.1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり当期純利益		
当期純利益(千円)	4,119,040	2,097,028
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	4,119,040	2,097,028
期中平均株式数(株)	33,870,060	33,870,060

独立監査人の監査報告書

2023年6月15日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

佐藤 栄裕

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年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。

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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2023年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。

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。