

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年3月12日提出
【発行者名】	三井住友D S アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・DCバランスファンド（安定型） 三井住友・DCバランスファンド（安定成長型） 三井住友・DCバランスファンド（成長型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	三井住友・DCバランスファンド（安定型） 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DCバランスファンド（安定成長型） 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DCバランスファンド（成長型） 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

三井住友・DCバランスファンド（安定型）

三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）

三井住友・DCバランスファンド（成長型）

以下、上記3ファンドを総称して「当ファンド」ということがあり、それぞれを「各ファンド」ということがあります。

また、「三井住友・DCバランスファンド（安定型）」を「（安定型）」、「三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）」を「（安定成長型）」、「三井住友・DCバランスファンド（成長型）」を「（成長型）」という略称でいうことがあります。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

各ファンド2兆5,000億円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、それぞれ「DC安定」、「DC安成」、「DC成長」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2024年3月13日から2024年9月12日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

販売会社によっては一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

ハ スイッチング

販売会社によっては、「スイッチング」（ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること）による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。

ニ クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用

ありません。

ホ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

- ・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われます。
- ・受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます(原則として受益証券を保有することはできません。)
- ・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。
- ・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、「国内株式マザーファンド（A号）」、「国内債券マザーファンド（B号）」、「外国株式マザーファンド（A号）」、「外国債券マザーファンド（A号）」（以下「マザーファンド」といいます。）への投資を通じて、実質的に、日本を含む世界各国の株式、公社債へ分散投資することにより、収益機会の拡大とリスクの低減効果を狙い、中長期的に信託財産の着実な成長を目指した運用を行います（このほか、各ファンドが内外の株式・公社債へ直接投資、または預金等の金融商品による運用を行うことも約款上認められています。）。
- ロ 各ファンドの運用にあたっては、株式、債券、現預金を各ファンド毎の基本資産配分の比率で加重平均した複合ベンチマークを、中長期的に上回る運用成果を目指します。詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。
- ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドとも金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書または信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 （収益の源泉）	資産複合	目論見書または信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分変更型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式および債券であり、ファンドの収益は株式市場、債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル （日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり(適時ヘッジ)	目論見書または信託約款において、適時対円で為替ヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載していません。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

2001年10月4日	信託契約締結、設定、運用開始。
2002年12月1日	各ファンドの名称を「MLG・DCバランス（安定型）」、「MLG・DCバランス（安定成長型）」、「MLG・DCバランス（成長型）」から「三井住友・DCバランスファンド（安定型）」、「三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）」、「三井住友・DCバランスファンド（成長型）」に名称を変更。
2014年11月28日	投資対象マザーファンドについて、「国内債券マザーファンド（A号）」から「国内債券マザーファンド（B号）」に変更。

（３）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

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

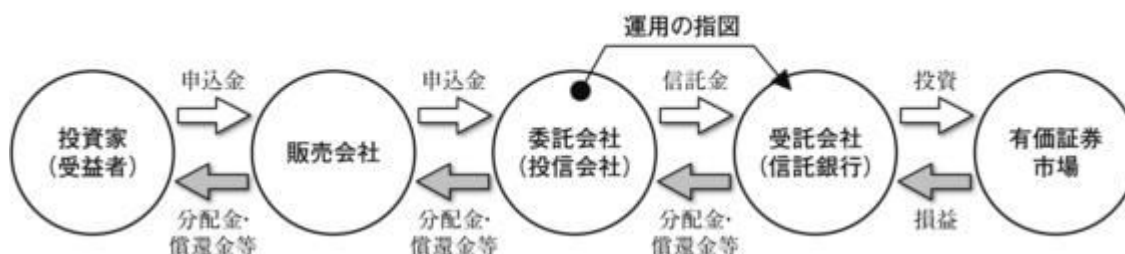
（ロ）受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

（ハ）販売会社

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

運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

（イ）資本金の額

20億円（2023年12月29日現在）

（ロ）会社の沿革

1985年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

1987年2月20日	証券投資顧問業の登録
1987年6月10日	投資一任契約にかかる業務の認可
1999年1月1日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
1999年2月5日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
2000年1月27日	証券投資信託委託業の認可取得
2002年12月1日	住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
2013年4月1日	トヨタアセットマネジメント株式会社と合併
2019年4月1日	大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

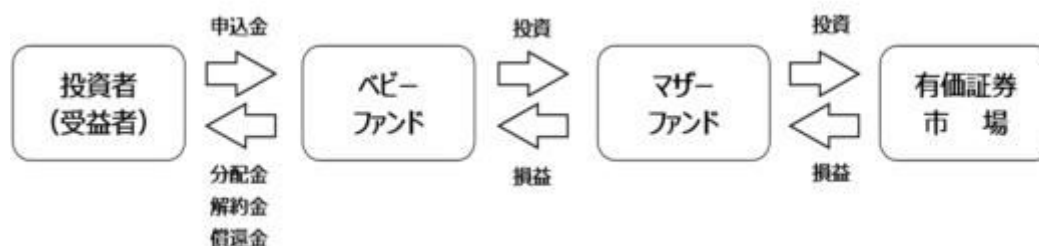
(八) 大株主の状況

(2023年12月29日現在)

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

八 ファンドの運用形態（ファミリーファンド方式による運用）

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



2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

イ 基本方針

内外の株式・公社債に投資する4つのマザーファンドの組入れを通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債へ分散投資することにより、収益機会の拡大とリスクの低減効果を狙い、中長期的に信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) 各ファンドにつき、株式、債券、現預金の基本的な資産配分とその上限と下限を定め、その範囲内で変更を行います。

	(安定型)			(安定成長型)			(成長型)		
	下限	基本	上限	下限	基本	上限	下限	基本	上限
株 式	10%	25%	40%	25%	45%	65%	50%	65%	80%
債 券	50%	70%	85%	30%	50%	70%	15%	30%	45%
現 預 金	0%	5%	20%	0%	5%	15%	0%	5%	15%

なお、基本資産配分と組入比率の上限と下限については、マクロ経済環境・金融市場動向を想定して設定するため5年程度に一度見直します。

- (ロ) 当ファンドの運用は、株式...TOPIX(東証株価指数、配当込み)、債券...ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス総合(「NOMURA-BPI(総合)」)、現預金...無担保コール翌日物を個別資産のベンチマークとし、それらを基本資産配分の比率で加重平均した複合ベンチマークに対し、資産配分の変更と個別資産毎の運用の両面で超過収益の獲得を目指し、複合ベンチマークを中長期的に上回る運用成果を目標とします。
- (ハ) 当ファンドの実質組入外貨建資産については、為替変動リスクが生じますが、外貨エクスポージャーをコントロールすることにより、ファンド全体の為替変動リスクを管理します。また、対円での為替ヘッジに限定せずに、全体的な投資収益を上昇させるため、割高な通貨を売り、割安な通貨を買うことに相当する為替取引を行うことがあります。外貨エクスポージャーとは、実質組入外貨建資産のうち対円での為替ヘッジが行われていない部分のファンド全体に対する比率のことで、0%を下限とし外貨建資産の実質組入比率を上限とします。
- (ニ) 運用にあたっては、まずマクロ経済環境分析、各資産市場評価を行い、総合的な検討を行った上で、各資産の配分、市場配分、通貨配分、業種配分の決定を行います。さらに各ファンドマネージャーが個別銘柄の選定を行います(トップダウンアプローチ)。
- (ホ) 資金動向、市場動向によっては、上記のような運用ができない場合やファンドの目的が達成されない場合があります。

ファンドの特色

1 日本を含む世界各国の株式、債券に分散投資を行い、リスクを軽減しつつ、中長期的に信託財産の着実な成長を目指します。

■ 実際の運用は、内外の株式、債券に投資する4つのマザーファンドへの投資を通じて行います。

2 各ファンドにつき、株式、債券、現預金の基本的な資産配分と、その上限・下限を定め、その範囲内で変更を行います。

〔各ファンドの基本資産配分〕

三井住友・DCバランスファンド		株式(内外)	債券(内外)	現預金
(安定型)	基本資産配分	25%	70%	5%
	変動幅	10~40%	50~85%	0~20%
(安定成長型)	基本資産配分	45%	50%	5%
	変動幅	25~65%	30~70%	0~15%
(成長型)	基本資産配分	65%	30%	5%
	変動幅	50~80%	15~45%	0~15%

※基本資産配分と、組入比率の上限・下限については、マクロ経済環境・金融市場動向を想定して設定するため5年程度に一度見直しします。

※株式、債券については、各々国内と外国のファンド全体に対する組入比率の上限と下限を定め、その範囲内で組入れを行います。

3

株式、債券、現預金で構成する複合ベンチマークを設け、中長期的にベンチマークを上回る運用成果を目指します。

- 株式……TOPIX（東証株価指数、配当込み）、債券……NOMURA-BPI（総合）、現預金…無担保コール翌日物を個別資産のベンチマークとし、それらを各ファンドの基本資産配分の比率で加重平均した複合ベンチマークを中長期的に上回る運用成果を目指します。
- 各ファンドはそれぞれの複合ベンチマークに対して、資産配分の変更と個別資産毎の運用の両面で超過収益の獲得を目指します。

〔各ファンドの複合ベンチマーク構成比〕



4

外貨エクスポージャーのコントロールにより、ファンド全体の為替変動リスクを管理します。

- 各ファンドの実質組入外貨建資産については、為替変動リスクが生じますが、外貨エクスポージャーをコントロールすることにより、ファンド全体の為替変動リスクを把握します。
- 対円での為替ヘッジに限定せず、全体的な投資収益を上昇させるため、割高な通貨を売り、割安な通貨を買うことに相当する為替取引を行うことがあります。



外貨エクスポージャーとは

実質組入外貨建資産のうち対円での為替ヘッジが行われていない部分のファンド全体に対する比率のことで、0%を下限とし外貨建資産の実質組入比率を上限とします。

5

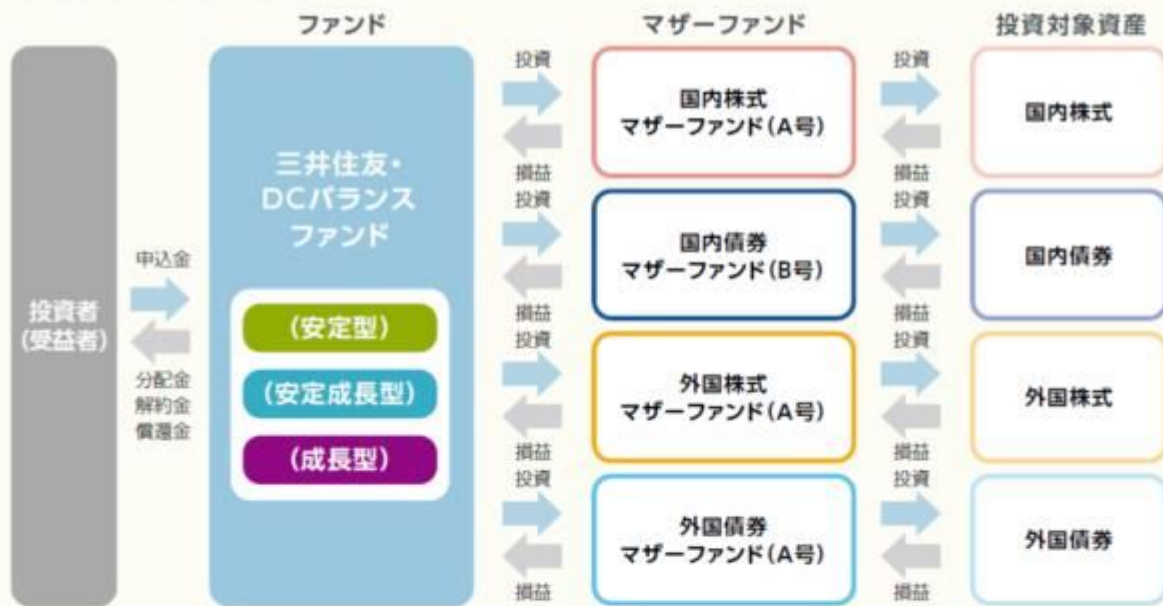
ファンドの運用はトップダウンアプローチにより行われます。

- 運用にあたっては、まずマクロ経済環境分析、各資産市場評価を行い、総合的な検討を行ったうえで、各資産の配分、市場配分、通貨配分、業種配分の決定を行います。さらにファンドマネージャーが個別銘柄の選定を行います。

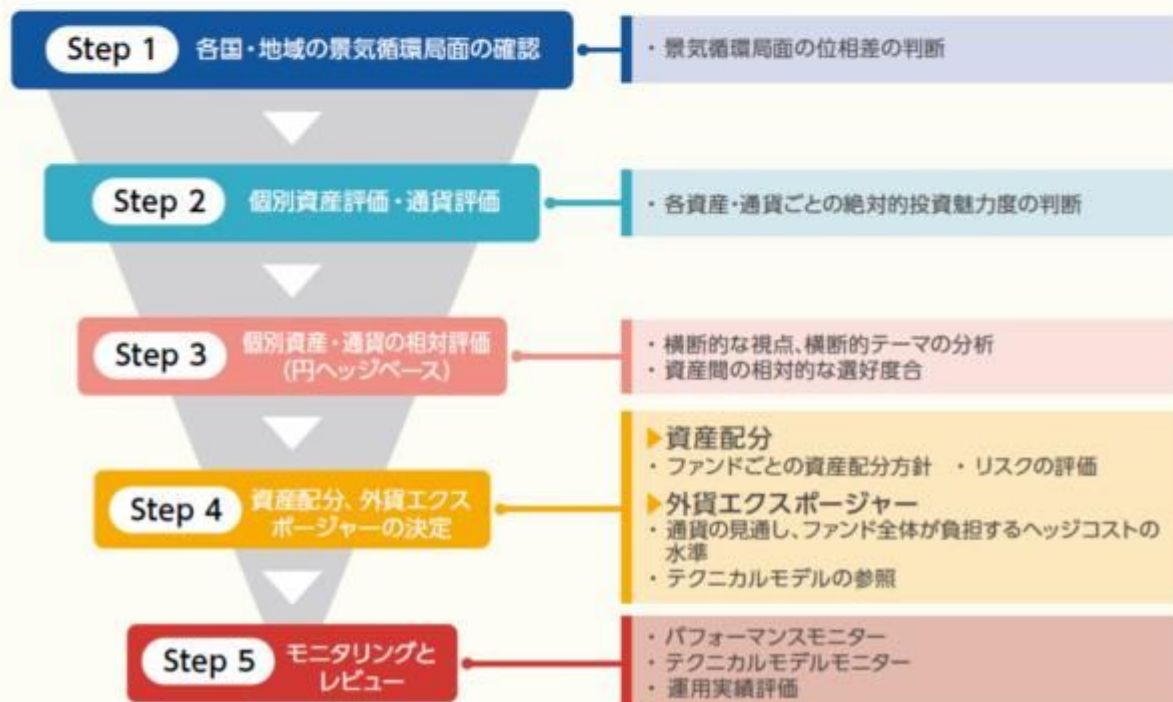
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドのしくみ

■ファミリーファンド方式を採用し、内外の株式、債券に投資する4つのマザーファンドの組入れを通じて、実際の運用を行います。



運用(資産配分)プロセス



※上記の運用プロセスは2023年12月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

各マザーファンドの投資方針等

▶国内株式マザーファンド(A号)

- TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークに対し同程度のリスクで、安定的に上回るリターンを目指します。
- マクロ経済分析をもとにしたトップダウンアプローチにより、委託会社が独自に定めるユニバース構成業種毎の基準ウエイトから一定の範囲内で乖離をとる業種配分と、企業の中長期成長力およびバリュエーションを重視した銘柄選択により超過収益の獲得を目指します。

▶国内債券マザーファンド(B号)

- NOMURA-BPI（総合）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。
- 定量的相対価値分析を行い、残存期間・セクター・銘柄間の割高割安を判断することに加え、デュレーションをベンチマーク対比で乖離させることにより、超過収益の獲得を目指します。ただし、リスクを一定以下に抑えて収益の安定性を確保します。

▶外国株式マザーファンド(A号)

- MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークに対し同程度のリスクで、安定的に上回るリターンを目指します。
- 委託会社のエコノミスト、アナリストによる綿密かつ広範囲のリサーチにより、トップダウンおよびボトムアップ双方の視点から株価に十分織り込まれていない投資材料を見極め、リスクを取ることで超過収益の獲得を目指します。
- 原則として対円での為替ヘッジを行いません。ただし、資産と通貨を別々に管理しており、株式市場の見通しと通貨の見通しとの双方の観点から資産の配分比率と通貨の配分比率との間に一定の範囲内で乖離をとる場合があります。

▶外国債券マザーファンド(A号)

- FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークに対し同程度のリスクで安定的に上回るリターンを目指します。
- 投資対象は欧米の主要格付機関からA格以上の格付けを取得している公社債を主としますが、信用リスクや利回り格差等を考慮して、A格未満の格付けの公社債を信託財産の純資産総額の5%以内で組み入れることもあります。
- マクロ経済分析や市場分析による金利予測に基づいて、市場配分、デュレーション、満期構成を決定し、ベンチマークとの乖離が主要な超過収益となるアクティブ運用を行います。ただし、ベンチマークとの乖離は一定の範囲内にとどめることとし、リスクをコントロールします。また、市場毎に利回り格差や流動性を考慮して、債券種別の配分、銘柄選択においても超過収益の獲得を目指します。
- 原則として対円での為替ヘッジを行いません。ただし、資産と通貨を別々に管理しており、債券市場の見通しと通貨の見通しとの双方の観点から資産の配分比率と通貨の配分比率との間に一定の範囲内で乖離をとる場合があります。

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

指数の著作権など

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

(2)【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. デリバティブ取引にかかる権利
3. 金銭債権
4. 約束手形

(口) 特定資産以外の資産で次に掲げるもの

1. 為替手形

口 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主としてマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

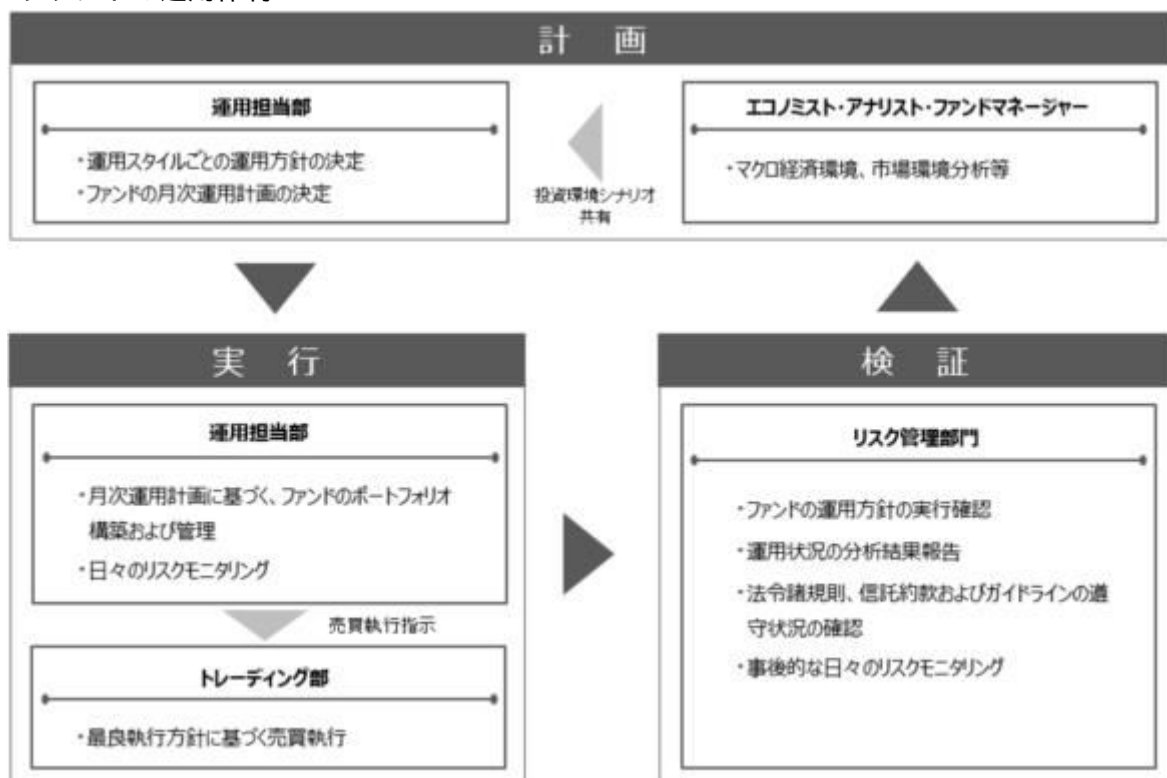
八 投資対象とする金融商品

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

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

（3）【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約40名です。

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（4）【配分方針】

毎決算時（12月15日。ただし、休業日の場合は翌日以降の最初の営業日とします。）に、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額の範囲は、経費控除後の利子、配当収益および売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。
- ロ 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額

が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

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

(基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)

(5)【投資制限】

以下、この「(5)投資制限」の記載は、特にファンドを特定しない限り各ファンド共通です。

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

イ 各マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。ただし、各マザーファンド受益証券への投資により実質的に保有する資産が、口以下のすべての条件を満たす範囲内とします。

口 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額に対して、以下の通りとします。

三井住友・DCバランスファンド(安定型) 40%以内

三井住友・DCバランスファンド(安定成長型) 65%以内

三井住友・DCバランスファンド(成長型) 80%以内

実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率(「組入比率」といいます。)と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます(以下同じ。)

ハ 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

ニ 各マザーファンド受益証券を除く投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

ホ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%以内とします。

ヘ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ 投資する株式等の範囲

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

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

ロ 信用取引の指図

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

戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- (ロ) 信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドに属する当該売付けにかかる建玉の時価総額との合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により信用取引の売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

八 先物取引等の指図

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

ニ スワップ取引の指図

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

ホ 金利先渡取引および為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するために、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ホ) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本

として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- (ヘ)「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

ヘ 有価証券の貸付けの指図

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

ト 公社債の空売りの指図

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

チ 公社債の借入れの指図

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

リ 特別の場合の外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合に

は制約されることがあります。

ヌ 外国為替予約取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- (ハ) 上記(ロ)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。またマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ニ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するために外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

ル 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払い資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

ヲ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

法令に基づく投資制限

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

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

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

号)

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

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

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

（参考情報：マザーファンドの投資方針等）

（国内株式マザーファンド（A号））

（1）投資方針等

イ 基本方針

主として日本の取引所上場株式に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

（イ）TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークに対し同程度のリスクで、安定的に上回るリターンを目指します。

（ロ）実際の運用にあたっては、マクロ経済分析をもとにしたトップダウンアプローチで行い、委託会社独自に定めるユニバースを構成する業種毎の基準ウエイトから一定の範囲内で乖離をとる業種配分と、企業の中長期成長力およびバリュエーションを重視した銘柄選択により超過収益の獲得を目指します。

（ハ）株式の組入比率は、原則として高位とします。ただし、資金動向、市場動向によっては上記のような運用ができない場合やファンドの目的が達成されない場合があります。

（2）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針（2）投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針（2）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする各号（第1号から第21号まで）の有価証券（ただし、第12号は本邦通貨建表示のものとし、また、投資法人債券を除きます。）に投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針（2）投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

（3）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（ロ）新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

- (八) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (二) 外貨建資産への投資は行いません。
- (ホ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ヘ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(国内債券マザーファンド(B号))

(1) 投資方針等

イ 基本方針

日本の公社債を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) 主として日本の公社債に投資し、中長期的にNOMURA-BPI(総合)(以下「ベンチマーク」といいます。)を上回る投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 運用にあたっては、リスクを一定以下に抑えて収益の安定性を確保しつつ、定量的相対価値分析を駆使し、残存・セクター・銘柄間の割高割安を判断するだけでなく、ポートフォリオのデュレーションをベンチマーク対比で乖離させることにより、ベンチマークを上回る収益の獲得を目指します。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

1. 国債証券
2. 地方債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。)
5. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
6. コマーシャル・ペーパー
7. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券の性質を有するもの
8. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
9. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
10. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
11. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
12. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
13. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ロ) 国債、地方債および特別の法律により法人の発行する債券以外の債券を取得する場合は、主要格付機関のいずれかよりBBB格相当以上の格付けを得ていることを条件とします。

(ハ) 上記(ロ)の債券について、いずれの格付機関の格付けもBBB格相当を下回ることとなった場合には、委託会社は、同一の発行体が発行した債券への投資割合およびBBB格相当未満の債券合計への投資割合がそれぞれ信託財産の純資産総額の5%以下および10%以下となるよう、当該債券の売却等の指図を行うものとします。

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

(外国株式マザーファンド(A号))

(1) 投資方針等

イ 基本方針

日本を除く世界各国の株式に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、中長期的にベンチマークに対し同程度のリスクで、安定的に上回るリターンを目指します。

(ロ) 委託会社のエコノミスト、アナリストによる綿密かつ広範囲のリサーチにより、トップダウンおよびボトムアップ双方の視点から株価に十分織り込まれていない投資材料を見極め、リスクを取ることで超過収益の獲得を目指します。

(ハ) 原則として対円での為替ヘッジを行いません。ただし、資産と通貨を別々に管理しており、株式市場の見通しと通貨の見通しとの双方の観点から資産の配分比率と通貨の配分比率との間に一定の範囲内で乖離をとる場合があります。

(ニ) 株式組入比率は原則として高位とします。ただし資金動向、市場動向によっては上記のような運用ができない場合やファンドの目的が達成されない場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする各号(第1号から第21号まで)の有価証券(ただし、投資法人債券を除きます。)に投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
- (ロ) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ハ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ニ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (ホ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ヘ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(外国債券マザーファンド(A号))

(1) 投資方針等

イ 基本方針

日本を除く世界各国の公社債に分散投資することにより、安定した成長と収益の確保を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)をベンチマークとし、中長期的にベンチマークに対し同程度のリスクで安定的に上回るリターンを目指します。
- (ロ) 投資対象は欧米の主要格付機関からA格以上の格付けを取得している公社債を主としますが、信用リスクや利回り格差等を考慮して、A格未満の格付けの公社債を信託財産の純資産総額の5%以内で組み入れることもあります。
- (ハ) 実際の運用にあたっては、マクロ経済分析や市場分析による金利予測に基づいて、市場配分、デュレーション、満期構成を決定し、ベンチマークとの乖離が主要な超過収益となるアクティブ運用を行います。ただし、ベンチマークとの乖離は一定の範囲内にとどめることとし、リスクをコントロールします。
また、市場毎に利回り格差や流動性を考慮して、債券種別の配分、銘柄選択においても超過収益の獲得を目指します。
- (ニ) 原則として対円での為替ヘッジを行いません。ただし、資産と通貨を別々に管理しており、債券市場の見通しと通貨の見通しとの双方の観点から資産の配分比率と通貨の配分比率との間に一定の範囲内で乖離をとる場合があります。
- (ホ) 債券組入比率は原則として高位とします。ただし資金動向、市場動向によっては上記のような運用ができない場合やファンドの目的が達成されない場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第2号から第6号、第10号、第12号(ただし、第2号から第6号および第10号の性質を有するものに限ります。)から第15号および第18号から第21号に掲げるものに投資します。ただし、投資信託証券については、株券または新株の引

受権を表示する証券もしくは証書に投資するものを除きます。また、投資法人債券には投資しません。

八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載したベビーフンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

(ロ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

(イ) 株式市場リスク

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

(ロ) 債券市場リスク

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

(ハ) 信用リスク

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

(ニ) 為替変動リスク

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

(ホ) カントリーリスク

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

（ヘ）流動性リスク

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

ロ その他の留意点

（イ）投資信託に関する留意点

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

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

（ロ）分配金に関する留意事項

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



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

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

八 投資リスクの管理体制

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

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

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

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

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

（参考情報）投資リスクの定量的比較

「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

■(安定型)



「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



■(安定成長型)



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

【ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移】

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

■(成長型)



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

【ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較】

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



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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

解約手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

純資産総額に年1.54%（税抜き1.4%）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日とします。）と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬の配分は以下の通りです。

< 信託報酬の配分（税抜き）>

支払先	料率	役務の内容
委託会社	年0.65%	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	年0.65%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年0.1%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

（４）【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、原則として、計算期間を通じて毎日、信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日とします。）と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

- （イ）追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- （ロ）受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には、各販売会社毎に個別元本の算出が行われま

す。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。

- (八) 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）

ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

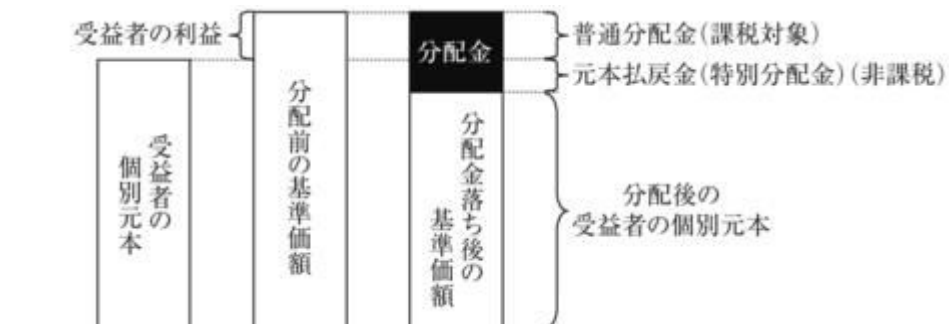
ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



上記の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・ 収益分配時

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

・ 一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、20.315%（所得税15.315%および地方税

5%)の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

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

（ロ）法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

上記「（5）課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2024年1月現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

（参考情報）総経費率

直近の運用報告書の対象期間（2022年12月16日～2023年12月15日）における当ファンドの総経費率（年率換算）は以下の通りです。

	総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
(安定型)	1.56%	1.54%	0.02%
(安定成長型)	1.56%	1.54%	0.02%
(成長型)	1.57%	1.54%	0.03%

※上記は、対象期間の運用報告書に記載されている総経費率（原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含まれていません。）です。

※当ファンドが上場投資信託（ETF）および上場不動産投資信託（REIT）に投資している場合、当該ETFおよびREITの管理費用等は含まれていません。

※計算方法等の詳細は、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。なお、新たな対象期間にかかる運用報告書が作成され、上記の総経費率が更新されている場合があります。

運用報告書は、委託会社のホームページ（<https://www.smd-am.co.jp/fund/unpo/>）から検索いただけます。

5【運用状況】

（1）【投資状況】

三井住友・DCバランスファンド（安定型）

2023年12月29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	248,410,323	95.67
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	11,239,047	4.33
合計（純資産総額）		259,649,370	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	売建	-	33,222,618	12.80

三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)

2023年12月29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	730,765,516	95.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	32,539,724	4.26
合計(純資産総額)		763,305,240	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	107,794,427	14.12

三井住友・DCバランスファンド(成長型)

2023年12月29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	431,428,048	95.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	19,851,917	4.40
合計(純資産総額)		451,279,965	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	-	83,709,409	18.55

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・DCバランスファンド(安定型)

イ 主要投資銘柄

2023年12月29日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額単価 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド(B号)	102,856,156	1.3593	139,807,698	1.3658	140,480,937	54.10
日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド(A号)	26,287,446	1.9180	50,418,493	1.9489	51,231,603	19.73

日本	親投資 信託受 益証券	外国債券マザー ファンド(A 号)	10,455,598	3.2254	33,723,230	3.2590	34,074,793	13.12
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式マザー ファンド(A 号)	4,597,795	4.8399	22,252,869	4.9204	22,622,990	8.71

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.67
合計	95.67

三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)

イ 主要投資銘柄

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	国内債券マザー ファンド(B 号)	207,070,259	1.3593	281,464,462	1.3658	282,816,559	37.05
日本	親投資 信託受 益証券	国内株式マザー ファンド(A 号)	134,484,320	1.9179	257,923,672	1.9489	262,096,491	34.34
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式マザー ファンド(A 号)	23,674,737	4.8399	114,583,360	4.9204	116,489,175	15.26
日本	親投資 信託受 益証券	外国債券マザー ファンド(A 号)	21,283,612	3.2253	68,645,473	3.2590	69,363,291	9.09

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.74
合計	95.74

三井住友・DCバランスファンド(成長型)

イ 主要投資銘柄

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
----------	----	-----	----	-------------	-------------	------------------	------------	-----------------

日本	親投資 信託受 益証券	国内株式マザー ファンド(A 号)	105,826,700	1.9175	202,922,774	1.9489	206,245,655	45.70
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式マザー ファンド(A 号)	20,865,187	4.8399	100,985,419	4.9204	102,665,066	22.75
日本	親投資 信託受 益証券	国内債券マザー ファンド(B 号)	69,527,134	1.3594	94,511,879	1.3658	94,960,159	21.04
日本	親投資 信託受 益証券	外国債券マザー ファンド(A 号)	8,455,713	3.2251	27,270,519	3.2590	27,557,168	6.11

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.60
合計	95.60

【投資不動産物件】

三井住友・DCバランスファンド(安定型)

該当事項はありません。

三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)

該当事項はありません。

三井住友・DCバランスファンド(成長型)

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・DCバランスファンド(安定型)

2023年12月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	142,000.00	20,573,300	20,062,910	7.73
	ユーロ	売建	84,000.00	13,121,514	13,159,708	5.07

(注)日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)

2023年12月29日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約	アメリカ・ドル	売建	519,000.00	75,193,965	73,328,523	9.61
取引	ユーロ	売建	220,000.00	34,365,870	34,465,904	4.52

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

三井住友・DCバランスファンド（成長型）

2023年12月29日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約	アメリカ・ドル	売建	445,000.00	64,472,668	62,873,204	13.93
取引	ユーロ	売建	133,000.00	20,775,730	20,836,205	4.62

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友・DCバランスファンド（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)
第14期 (2014年12月15日)	193,650,525	193,650,525	12,095	12,095
第15期 (2015年12月15日)	194,962,056	194,962,056	12,239	12,239
第16期 (2016年12月15日)	201,719,250	201,719,250	12,433	12,433
第17期 (2017年12月15日)	213,524,340	213,524,340	12,995	12,995
第18期 (2018年12月17日)	211,627,484	211,627,484	12,448	12,448
第19期 (2019年12月16日)	239,453,885	239,453,885	12,928	12,928
第20期 (2020年12月15日)	257,997,052	257,997,052	13,191	13,191
第21期 (2021年12月15日)	272,099,673	272,099,673	13,936	13,936
第22期 (2022年12月15日)	251,603,364	251,603,364	12,886	12,886
第23期 (2023年12月15日)	257,190,117	257,190,117	13,255	13,255
2022年12月末日	247,136,762	-	12,571	-
2023年 1月末日	247,832,746	-	12,702	-
2月末日	246,975,256	-	12,779	-
3月末日	252,759,629	-	12,946	-
4月末日	252,017,079	-	13,004	-
5月末日	252,077,489	-	13,123	-
6月末日	252,896,864	-	13,403	-
7月末日	252,016,661	-	13,340	-
8月末日	253,841,384	-	13,295	-
9月末日	250,953,166	-	13,139	-
10月末日	247,479,754	-	12,879	-
11月末日	256,169,294	-	13,278	-

12月末日	259,649,370	-	13,359	-
-------	-------------	---	--------	---

三井住友・DCバランスファンド(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)
第14期 (2014年12月15日)	420,847,336	420,847,336	13,250	13,250
第15期 (2015年12月15日)	444,047,636	444,047,636	13,581	13,581
第16期 (2016年12月15日)	470,354,291	470,354,291	13,929	13,929
第17期 (2017年12月15日)	531,244,503	531,244,503	15,086	15,086
第18期 (2018年12月17日)	518,003,637	518,003,637	14,166	14,166
第19期 (2019年12月16日)	576,417,301	576,417,301	15,013	15,013
第20期 (2020年12月15日)	617,253,549	617,253,549	15,589	15,589
第21期 (2021年12月15日)	726,112,920	726,112,920	17,261	17,261
第22期 (2022年12月15日)	713,825,522	713,825,522	15,838	15,838
第23期 (2023年12月15日)	754,496,255	754,496,255	16,934	16,934
2022年12月末日	697,012,962	-	15,371	-
2023年 1月末日	710,583,406	-	15,652	-
2月末日	711,401,024	-	15,772	-
3月末日	727,698,930	-	15,983	-
4月末日	727,711,259	-	16,097	-
5月末日	742,312,556	-	16,378	-
6月末日	762,076,335	-	16,971	-
7月末日	763,448,585	-	17,014	-
8月末日	769,229,294	-	16,993	-
9月末日	750,270,907	-	16,769	-
10月末日	726,348,184	-	16,352	-
11月末日	759,450,644	-	17,001	-
12月末日	763,305,240	-	17,107	-

三井住友・DCバランスファンド(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)
第14期 (2014年12月15日)	218,572,062	218,572,062	13,714	13,714
第15期 (2015年12月15日)	237,546,681	237,546,681	14,214	14,214
第16期 (2016年12月15日)	257,072,805	257,072,805	14,646	14,646
第17期 (2017年12月15日)	276,171,202	276,171,202	16,361	16,361
第18期 (2018年12月17日)	291,223,562	291,223,562	15,195	15,195
第19期 (2019年12月16日)	315,051,132	315,051,132	16,458	16,458
第20期 (2020年12月15日)	352,960,972	352,960,972	17,483	17,483
第21期 (2021年12月15日)	390,381,837	390,381,837	20,198	20,198
第22期 (2022年12月15日)	384,796,288	384,796,288	18,454	18,454
第23期 (2023年12月15日)	441,449,495	441,449,495	20,451	20,451

2022年12月末日	374,475,740	-	17,825	-
2023年 1月末日	382,284,120	-	18,290	-
2月末日	381,364,823	-	18,443	-
3月末日	400,763,015	-	18,707	-
4月末日	403,642,055	-	18,885	-
5月末日	414,044,360	-	19,351	-
6月末日	438,469,844	-	20,307	-
7月末日	444,017,106	-	20,512	-
8月末日	450,054,336	-	20,504	-
9月末日	436,040,887	-	20,185	-
10月末日	424,499,668	-	19,578	-
11月末日	448,896,547	-	20,548	-
12月末日	451,279,965	-	20,704	-

【分配の推移】

三井住友・DCバランスファンド（安定型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第14期	2013年12月17日～2014年12月15日	0
第15期	2014年12月16日～2015年12月15日	0
第16期	2015年12月16日～2016年12月15日	0
第17期	2016年12月16日～2017年12月15日	0
第18期	2017年12月16日～2018年12月17日	0
第19期	2018年12月18日～2019年12月16日	0
第20期	2019年12月17日～2020年12月15日	0
第21期	2020年12月16日～2021年12月15日	0
第22期	2021年12月16日～2022年12月15日	0
第23期	2022年12月16日～2023年12月15日	0

三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第14期	2013年12月17日～2014年12月15日	0
第15期	2014年12月16日～2015年12月15日	0
第16期	2015年12月16日～2016年12月15日	0
第17期	2016年12月16日～2017年12月15日	0
第18期	2017年12月16日～2018年12月17日	0
第19期	2018年12月18日～2019年12月16日	0
第20期	2019年12月17日～2020年12月15日	0
第21期	2020年12月16日～2021年12月15日	0
第22期	2021年12月16日～2022年12月15日	0
第23期	2022年12月16日～2023年12月15日	0

三井住友・DCバランスファンド（成長型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第14期	2013年12月17日～2014年12月15日	0
第15期	2014年12月16日～2015年12月15日	0
第16期	2015年12月16日～2016年12月15日	0
第17期	2016年12月16日～2017年12月15日	0
第18期	2017年12月16日～2018年12月17日	0
第19期	2018年12月18日～2019年12月16日	0
第20期	2019年12月17日～2020年12月15日	0
第21期	2020年12月16日～2021年12月15日	0
第22期	2021年12月16日～2022年12月15日	0
第23期	2022年12月16日～2023年12月15日	0

【収益率の推移】

三井住友・DCバランスファンド（安定型）

	収益率（％）
第14期	7.3
第15期	1.2
第16期	1.6
第17期	4.5
第18期	4.2
第19期	3.9
第20期	2.0
第21期	5.6
第22期	7.5
第23期	2.9

（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・DCバランスファンド（安定成長型）

	収益率（％）
第14期	9.8
第15期	2.5
第16期	2.6
第17期	8.3
第18期	6.1
第19期	6.0
第20期	3.8
第21期	10.7
第22期	8.2
第23期	6.9

（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・DCバランスファンド（成長型）

	収益率（％）
第14期	12.1
第15期	3.6
第16期	3.0
第17期	11.7
第18期	7.1
第19期	8.3
第20期	6.2
第21期	15.5
第22期	8.6
第23期	10.8

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

（４）【設定及び解約の実績】

三井住友・DCバランスファンド（安定型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第14期	26,877,673	18,418,719
第15期	19,553,674	20,366,616
第16期	16,903,981	13,945,073
第17期	27,169,884	25,105,893
第18期	20,643,253	14,945,350
第19期	29,485,931	14,272,652
第20期	50,212,684	39,851,436
第21期	30,974,151	31,316,907
第22期	19,184,342	19,181,177
第23期	22,709,510	23,922,639

（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・DCバランスファンド（安定成長型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第14期	43,122,250	59,598,131
第15期	35,396,094	26,051,670
第16期	29,757,139	19,038,681
第17期	38,264,679	23,802,398
第18期	43,435,774	29,909,672
第19期	43,928,626	25,663,952
第20期	84,381,096	72,367,159
第21期	51,726,104	27,011,845
第22期	54,458,838	24,427,967
第23期	45,733,711	50,886,536

（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・DCバランスファンド（成長型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第14期	17,359,549	23,221,845
第15期	25,035,109	17,286,266
第16期	21,278,735	12,882,481
第17期	24,011,241	30,733,506
第18期	32,703,031	9,843,884
第19期	23,898,524	24,132,198
第20期	39,447,397	28,981,800
第21期	30,625,816	39,233,950
第22期	28,771,839	13,531,347
第23期	34,812,976	27,478,543

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

（1）投資状況

国内株式マザーファンド（A号）

2023年12月29日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	日本	1,220,020,230	97.91
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	26,001,265	2.09
合計（純資産総額）		1,246,021,495	100.00

国内債券マザーファンド（B号）

2023年12月29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	204,678,776,550	64.39
地方債証券	日本	4,590,922,200	1.44
特殊債券	日本	15,975,463,215	5.03
社債券	日本	63,197,023,900	19.88
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	29,442,137,073	9.26
合計（純資産総額）		317,884,322,938	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率 （％）
債券先物取引	買建	日本	27,288,060,000	8.58
合計	買建	-	27,288,060,000	8.58

外国株式マザーファンド（A号）

2023年12月29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	2,236,022,691	71.36
	フランス	206,044,616	6.58
	アイルランド	167,963,103	5.36
	スイス	120,063,824	3.83
	イギリス	100,397,143	3.20
	オランダ	84,326,756	2.69
	香港	71,261,800	2.27
	ドイツ	27,991,784	0.89
	ジャージー	27,266,640	0.87
	オーストラリア	18,429,129	0.59
	小計	3,059,767,486	97.65
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	73,711,769	2.35
合計（純資産総額）		3,133,479,255	100.00

外国債券マザーファンド（A号）

2023年12月29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	2,742,356,673	41.12
	フランス	1,118,075,174	16.76
	スペイン	877,976,787	13.16
	イギリス	596,890,454	8.95
	中国	164,493,549	2.47
	イタリア	118,463,546	1.78
	カナダ	82,607,636	1.24
	オーストラリア	76,262,387	1.14
	ベルギー	53,973,783	0.81
	メキシコ	53,139,884	0.80
	アイルランド	46,337,594	0.69
	シンガポール	32,511,625	0.49
	ポーランド	25,108,138	0.38
	ドイツ	21,528,708	0.32
	マレーシア	19,197,636	0.29
	スウェーデン	14,725,056	0.22
	イスラエル	11,751,313	0.18
	小計	6,055,399,943	90.79
	地方債証券	カナダ	37,181,394
特殊債券	日本	74,707,417	1.12
社債券	日本	240,368,420	3.60
	アメリカ	131,599,092	1.97
	小計	371,967,512	5.58
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	130,333,952	1.95
合計（純資産総額）		6,669,590,218	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	-	438,244,728	6.57
為替予約取引	売建	-	414,503,795	6.21

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式マザーファンド(A号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	21,000	2,600.50	54,610,500	2,590.50	54,400,500	4.37
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2,700	13,352.20	36,050,938	13,410.00	36,207,000	2.91
日本	株式	日立製作所	電気機器	3,500	9,859.00	34,506,500	10,170.00	35,595,000	2.86
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	189,100	169.83	32,113,968	172.30	32,581,930	2.61
日本	株式	キーエンス	電気機器	500	62,411.55	31,205,774	62,120.00	31,060,000	2.49
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1,200	24,513.12	29,415,738	25,255.00	30,306,000	2.43
日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	24,900	1,204.59	29,994,207	1,211.50	30,166,350	2.42
日本	株式	日本郵船	海運業	6,900	4,151.80	28,647,446	4,371.00	30,159,900	2.42
日本	株式	オリエンタル ランド	サービス業	4,700	5,270.00	24,769,000	5,251.00	24,679,700	1.98
日本	株式	ディスコ	機械	700	32,973.51	23,081,456	34,980.00	24,486,000	1.97
日本	株式	三菱重工業	機械	2,900	7,620.41	22,099,203	8,241.00	23,898,900	1.92
日本	株式	スズキ	輸送用機器	3,800	5,578.98	21,200,134	6,033.00	22,925,400	1.84
日本	株式	任天堂	その他製品	3,000	6,778.00	20,334,000	7,359.00	22,077,000	1.77
日本	株式	ダイヘン	電気機器	3,200	6,207.91	19,865,319	6,450.00	20,640,000	1.66
日本	株式	東海東京フィ ナンシャル・ ホールディング ス	証券、商品先物取引業	37,700	513.33	19,352,404	526.00	19,830,200	1.59
日本	株式	インターネッ トイニシア ティブ	情報・通信業	6,700	2,784.63	18,657,034	2,884.00	19,322,800	1.55
日本	株式	マクニカホ ールディング ス	卸売業	2,500	7,711.00	19,277,500	7,437.00	18,592,500	1.49
日本	株式	ゆうちょ銀行	銀行業	12,600	1,442.73	18,178,430	1,436.00	18,093,600	1.45
日本	株式	リクルート ホールディング ス	サービス業	3,000	5,915.00	17,745,000	5,963.00	17,889,000	1.44
日本	株式	タツモ	機械	6,400	2,701.59	17,290,207	2,770.00	17,728,000	1.42
日本	株式	ルネサスエレ クトロニクス	電気機器	6,600	2,520.00	16,632,000	2,549.00	16,823,400	1.35

日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	2,900	5,783.61	16,772,460	5,767.00	16,724,300	1.34
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	4,400	3,492.00	15,364,800	3,529.00	15,527,600	1.25
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2,400	6,125.39	14,700,942	6,293.00	15,103,200	1.21
日本	株式	中外製薬	医薬品	2,800	5,343.38	14,961,471	5,342.00	14,957,600	1.20
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	22,800	626.59	14,286,301	637.70	14,539,560	1.17
日本	株式	大阪ソーダ	化学	1,500	8,895.64	13,343,461	9,680.00	14,520,000	1.17
日本	株式	出光興産	石油・石炭製品	18,000	769.80	13,856,400	767.50	13,815,000	1.11
日本	株式	第一三共	医薬品	3,500	4,000.63	14,002,195	3,872.00	13,552,000	1.09
日本	株式	ミネベアミツミ	電気機器	4,600	2,848.50	13,103,085	2,898.50	13,333,100	1.07

□ 種類別・業種別投資比率

2023年12月29日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	鉱業	0.86
	建設業	1.81
	食料品	1.45
	パルプ・紙	0.20
	化学	4.49
	医薬品	3.44
	石油・石炭製品	1.11
	ゴム製品	0.86
	ガラス・土石製品	0.81
	鉄鋼	0.81
	非鉄金属	0.29
	機械	9.03
	電気機器	21.81
	輸送用機器	8.39
	精密機器	0.78
	その他製品	1.77
	電気・ガス業	0.45
	陸運業	3.75
	海運業	2.42
	情報・通信業	7.91
	卸売業	4.24
	小売業	2.38
	銀行業	6.88
証券、商品先物取引業	3.75	
保険業	2.25	
その他金融業	0.69	
不動産業	1.05	
サービス業	4.23	
合計		97.91

国内債券マザーファンド（B号）

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単 価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債 証券	4 5 5 2年国債	48,100,000,000	99.88	48,042,276,000	99.96	48,081,241,000	0.005	2025/12/01	15.13
日本	国債 証券	3 7 2 10年国 債	19,200,000,000	101.20	19,430,504,000	101.70	19,525,440,000	0.800	2033/09/20	6.14
日本	国債 証券	1 8 6 20年国 債	13,620,000,000	99.11	13,498,802,000	101.86	13,873,195,800	1.500	2043/09/20	4.36
日本	国債 証券	8 0 3 0年国債	7,730,000,000	103.48	7,998,805,000	103.30	7,985,012,700	1.800	2053/09/20	2.51
日本	国債 証券	1 4 9 20年国 債	7,010,000,000	108.73	7,621,913,000	108.11	7,578,581,100	1.500	2034/06/20	2.38
日本	国債 証券	3 5 4 10年国 債	6,850,000,000	98.79	6,767,115,000	99.31	6,802,392,500	0.100	2029/03/20	2.14
日本	国債 証券	4 5 3 2年国債	5,300,000,000	99.86	5,292,468,000	99.97	5,298,569,000	0.005	2025/10/01	1.67
日本	国債 証券	1 7 3 20年国 債	4,850,000,000	88.29	4,282,210,500	88.10	4,272,704,500	0.400	2040/06/20	1.34
日本	国債 証券	1 5 9 5年国債	4,100,000,000	99.56	4,082,097,000	99.65	4,085,486,000	0.100	2028/06/20	1.29
日本	国債 証券	1 6 0 5年国債	4,000,000,000	99.84	3,993,644,000	100.09	4,003,520,000	0.200	2028/06/20	1.26
日本	国債 証券	1 6 5 20年国 債	4,300,000,000	92.61	3,982,088,000	92.81	3,990,615,000	0.500	2038/06/20	1.26
日本	国債 証券	1 6 7 20年国 債	4,330,000,000	92.42	4,001,637,000	92.00	3,983,470,100	0.500	2038/12/20	1.25
日本	国債 証券	1 8 3 20年国 債	3,800,000,000	104.76	3,980,880,000	100.83	3,831,540,000	1.400	2042/12/20	1.21
日本	国債 証券	3 6 4 10年国 債	3,500,000,000	96.74	3,386,065,000	97.39	3,408,720,000	0.100	2031/09/20	1.07
日本	国債 証券	4 5 3 0年国債	3,250,000,000	104.10	3,383,315,000	101.05	3,284,027,500	1.500	2044/12/20	1.03
日本	国債 証券	6 7 3 0年国債	3,980,000,000	81.67	3,250,289,000	78.35	3,118,409,600	0.600	2050/06/20	0.98
日本	国債 証券	1 6 4 20年国 債	3,260,000,000	93.34	3,042,934,900	93.14	3,036,461,800	0.500	2038/03/20	0.96
日本	国債 証券	7 0 3 0年国債	3,800,000,000	83.39	3,168,744,000	79.77	3,031,070,000	0.700	2051/03/20	0.95

日本	国債証券	155 20年国債	2,760,000,000	102.44	2,827,332,600	101.90	2,812,550,400	1.000	2035/12/20	0.88
日本	国債証券	753 0年国債	3,050,000,000	95.31	2,907,055,000	92.15	2,810,605,500	1.300	2052/06/20	0.88
日本	国債証券	170 20年国債	3,100,000,000	88.26	2,736,107,000	87.99	2,727,597,000	0.300	2039/09/20	0.86
日本	社債券	112 住友不動産	2,700,000,000	100.00	2,700,000,000	99.82	2,695,234,500	0.490	2028/08/09	0.85
日本	国債証券	185 20年国債	2,800,000,000	93.76	2,625,280,000	95.27	2,667,448,000	1.100	2043/06/20	0.84
日本	国債証券	175 20年国債	2,950,000,000	89.28	2,633,835,000	88.76	2,618,420,000	0.500	2040/12/20	0.82
日本	国債証券	603 0年国債	2,790,000,000	88.34	2,464,806,800	86.46	2,412,094,500	0.900	2048/09/20	0.76
日本	国債証券	763 0年国債	2,511,000,000	97.46	2,447,166,800	94.30	2,367,923,220	1.400	2052/09/20	0.74
日本	国債証券	163 20年国債	2,250,000,000	94.72	2,131,290,000	94.81	2,133,225,000	0.600	2037/12/20	0.67
日本	国債証券	151 20年国債	2,020,000,000	104.17	2,104,303,600	104.82	2,117,404,400	1.200	2034/12/20	0.67
日本	国債証券	593 0年国債	2,550,000,000	85.25	2,173,947,500	82.73	2,109,487,500	0.700	2048/06/20	0.66
日本	社債券	92 東日本高速道	2,100,000,000	99.91	2,098,051,200	100.10	2,102,198,700	0.051	2024/06/20	0.66

□ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	64.39
地方債証券	1.44
特殊債券	5.03
社債券	19.88
合計	90.74

外国株式マザーファンド(A号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年12月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	2,299	68,574.81	157,653,476	70,237.05	161,474,983	5.15

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	7,365	18,713.05	137,821,614	19,888.82	146,481,165	4.67
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	2,582	51,899.85	134,005,417	53,225.96	137,429,434	4.39
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,070	81,363.62	87,059,069	82,381.96	88,148,692	2.81
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1,206	47,253.50	56,987,722	50,820.53	61,289,553	1.96
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	1,601	36,695.68	58,749,777	36,932.53	59,128,983	1.89
アメリカ	株式	INTUIT INC	ソフトウェア・サービス	652	85,265.36	55,593,014	89,072.08	58,074,993	1.85
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	666	82,919.49	55,224,381	84,462.60	56,252,092	1.80
アメリカ	株式	SERVICENOW INC	ソフトウェア・サービス	558	96,499.71	53,846,840	99,629.90	55,593,485	1.77
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	1,111	48,609.40	54,005,038	49,866.01	55,401,136	1.77
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	2,284	23,258.70	53,122,874	24,153.65	55,166,934	1.76
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	1,109	49,897.21	55,336,008	49,266.07	54,636,070	1.74
イギリス	株式	ASTRAZENECA PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,740	18,913.58	51,823,215	19,105.10	52,347,982	1.67
アメリカ	株式	FORTINET INC	ソフトウェア・サービス	6,050	8,091.40	48,952,979	8,424.70	50,969,447	1.63
アメリカ	株式	SYNOPSYS INC	ソフトウェア・サービス	690	78,212.15	53,966,385	73,384.26	50,635,139	1.62
フランス	株式	SCHNEIDER ELECTRIC SE	資本財	1,706	28,124.48	47,980,362	28,495.28	48,612,953	1.55
アメリカ	株式	LULULEMON ATHLETICA INC	耐久消費財・アパレル	610	69,397.42	42,332,425	72,222.67	44,055,830	1.41
アメリカ	株式	ARES MANAGEMENT CORP - A	金融サービス	2,557	16,182.80	41,379,427	17,002.58	43,475,598	1.39

フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	耐久消費 財・アパ レル	376	117,497.96	44,179,234	114,854.72	43,185,374	1.38
フランス	株式	L'OREAL	家庭用 品・パー ソナル用 品	603	69,690.58	42,023,417	70,908.26	42,757,678	1.36
アメリカ	株式	BOOKING HOLDINGS INC	消費者 サービス	82	487,937.75	40,010,895	503,563.16	41,292,179	1.32
アメリカ	株式	ROCKWELL AUTOMATION INC	資本財	928	43,520.54	40,387,056	44,055.23	40,883,257	1.30
アメリカ	株式	ANSYS INC	ソフト ウェア・ サービス	789	41,825.67	33,000,451	51,322.60	40,493,534	1.29
アメリカ	株式	IQVIA HOLDINGS INC	医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	1,129	32,698.91	36,917,065	33,008.10	37,266,140	1.19
アメリカ	株式	TRADEWEB MARKETS INC- CLASS A	金融サー ビス	2,862	12,472.53	35,696,381	12,817.18	36,682,760	1.17
アイルラ ンド	株式	TRANE TECHNOLOGIES PLC	資本財	1,054	33,883.19	35,712,879	34,579.57	36,446,869	1.16
アメリカ	株式	INTUITIVE SURGICAL INC	ヘルスケ ア機器・ サービス	743	46,262.11	34,372,747	47,993.85	35,659,433	1.14
アメリカ	株式	IDEXX LABORATORIES INC	ヘルスケ ア機器・ サービス	450	78,599.35	35,369,707	79,002.15	35,550,965	1.13
アメリカ	株式	AVERY DENNISON CORP	素材	1,227	28,217.08	34,622,355	28,760.29	35,288,872	1.13
アメリカ	株式	ZOETIS INC	医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	1,237	28,378.76	35,104,531	27,963.20	34,590,481	1.10

□ 種類別・業種別投資比率

2023年12月29日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式（外国）	エネルギー	2.08
	素材	2.87
	資本財	10.75
	商業・専門サービス	1.51
	自動車・自動車部品	1.94
	耐久消費財・アパレル	4.61
	消費者サービス	4.44

一般消費財・サービス流通・小売り	2.27
生活必需品流通・小売り	0.44
食品・飲料・タバコ	2.06
家庭用品・パーソナル用品	1.36
ヘルスケア機器・サービス	4.05
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.64
銀行	2.82
金融サービス	9.93
保険	1.83
ソフトウェア・サービス	17.68
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.40
半導体・半導体製造装置	8.04
メディア・娯楽	7.18
不動産管理・開発	0.75
合計	97.65

外国債券マザーファンド（A号）

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2023年12月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	3,740,000	13,520.94	505,683,064	13,558.81	507,099,350	2.750	2028/02/15	7.60
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	4,110,000	11,750.47	482,944,467	11,810.33	485,404,395	1.375	2031/11/15	7.28
フランス	国債 証券	FRANCE OAT.	2,450,000	13,649.96	334,423,949	13,847.77	339,270,394	0.000	2029/11/25	5.09
フランス	国債 証券	FRANCE OAT.	2,440,000	12,733.32	310,692,984	12,958.47	316,186,716	0.000	2032/05/25	4.74
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2,280,000	13,406.20	305,661,293	13,433.85	306,291,869	1.625	2026/02/15	4.59
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2,780,000	9,077.12	252,343,936	9,218.38	256,271,038	1.125	2040/05/15	3.84
スペイン	国債 証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,680,000	15,121.23	254,036,643	15,234.51	255,939,806	1.500	2027/04/30	3.84
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,680,000	12,585.43	211,435,171	12,621.74	212,045,154	0.500	2027/05/31	3.18
イギリス	国債 証券	UK GILT	1,100,000	17,806.19	195,868,141	17,919.12	197,110,316	3.500	2025/10/22	2.96
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,530,000	12,585.14	192,552,691	12,621.74	193,112,551	1.375	2028/10/31	2.90
スペイン	国債 証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,210,000	15,411.59	186,480,197	15,443.48	186,866,131	1.600	2025/04/30	2.80
フランス	国債 証券	FRANCE OAT.	1,180,000	15,012.50	177,147,520	15,250.38	179,954,500	2.000	2032/11/25	2.70
イギリス	国債 証券	UK GILT	990,000	17,337.69	171,643,145	17,758.13	175,805,524	3.250	2033/01/31	2.64

日本	社債 券	MITSUBISHI UFJ FIN GRP	1,220,000	14,130.38	172,390,649	14,134.21	172,437,367	5.063	2025/09/12	2.59
スペイン	国債 証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,090,000	15,377.81	167,618,082	15,805.02	172,274,663	3.450	2043/07/30	2.58
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,330,000	11,675.73	155,287,199	11,780.97	156,686,862	3.000	2045/11/15	2.35
スペイン	国債 証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000	11,432.68	137,192,156	11,732.46	140,789,575	0.850	2037/07/30	2.11
アメリカ	社債 券	JPMORGAN CHASE & CO	950,000	13,826.86	131,355,216	13,852.54	131,599,092	0.969	2025/06/23	1.97
イギリス	国債 証券	UK TSY GILT	1,060,000	11,984.87	127,039,577	12,380.19	131,230,052	1.125	2039/01/31	1.97
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	4,700,000	2,263.94	106,404,967	2,296.47	107,934,215	3.720	2051/04/12	1.62
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	790,000	13,362.94	105,567,217	13,405.06	105,899,993	2.750	2029/05/31	1.59
フランス	国債 証券	FRANCE OAT.	570,000	17,805.15	101,489,370	18,192.30	103,696,089	4.000	2038/10/25	1.55
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	760,000	13,431.73	102,081,121	13,460.80	102,302,092	2.250	2027/02/15	1.53
フランス	国債 証券	FRANCE OAT.	720,000	12,922.33	93,040,807	13,143.09	94,630,233	0.000	2031/11/25	1.42
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	900,000	10,091.20	90,820,840	10,183.68	91,653,098	2.250	2046/08/15	1.37
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	620,000	13,846.15	85,846,153	13,891.54	86,127,543	3.500	2030/01/31	1.29
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	580,000	14,390.07	83,462,416	14,478.72	83,976,550	4.125	2053/08/15	1.26
イタリア	国債 証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000	15,489.36	77,446,804	15,654.65	78,273,256	2.800	2028/12/01	1.17
日本	特殊 債券	DEVELOPMENT BK OF JAPAN	500,000	14,880.68	74,403,390	14,941.48	74,707,417	0.010	2025/09/09	1.12
日本	社債 券	MIZUHO FINANCIAL GROUP	680,000	9,889.04	67,245,494	9,989.86	67,931,053	6.025	2029/08/28	1.02

□ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	90.79
地方債証券	0.56
特殊債券	1.12
社債券	5.58
合計	98.05

投資不動産物件

国内株式マザーファンド（A号）

該当事項はありません。

国内債券マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

外国株式マザーファンド（A号）

該当事項はありません。

外国債券マザーファンド（A号）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

国内株式マザーファンド（A号）

該当事項はありません。

国内債券マザーファンド（B号）

2023年12月29日現在

種類	国/ 地域	取引所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
債券先物 取引	日本	大阪取引 所	長国 先 0 6 0 3 月 2 0 2 4 年 3 月	買建	186	日本・円	27,148,716,440	27,288,060,000	8.58

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外国株式マザーファンド（A号）

該当事項はありません。

外国債券マザーファンド（A号）

2023年12月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	オフショア・人民元	買建	12,987,000.00	257,894,479	256,943,898	3.85
	アメリカ・ドル	買建	743,000.00	103,975,476	104,124,763	1.56
	デンマーク・クローネ	買建	1,400,000.00	28,781,592	29,268,680	0.44
	カナダ・ドル	買建	144,000.00	15,048,021	15,275,174	0.23
	ノルウェー・クローネ	買建	1,064,000.00	13,887,189	14,657,557	0.22
	ニュージーランド・ドル	買建	142,000.00	12,381,758	12,616,998	0.19
	イギリス・ポンド	買建	30,000.00	5,347,839	5,357,658	0.08
	イギリス・ポンド	売建	1,390,000.00	247,011,797	248,238,153	3.72
	ユーロ	売建	908,000.00	139,414,871	141,397,210	2.12
	オーストラリア・ドル	売建	123,000.00	11,515,494	11,808,762	0.18
	イスラエル・シケル	売建	285,000.00	10,956,465	11,025,196	0.17
	スウェーデン・クローナ	売建	120,000.00	1,640,971	1,692,708	0.03
メキシコ・ペソ	売建	42,000.00	42,000.00	334,371	341,766	0.01

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

参考情報

基準日:2023年12月29日

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

基準価額・純資産の推移

■(安定型)



分配の推移

決算期	分配金
2023年12月	0円
2022年12月	0円
2021年12月	0円
2020年12月	0円
2019年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

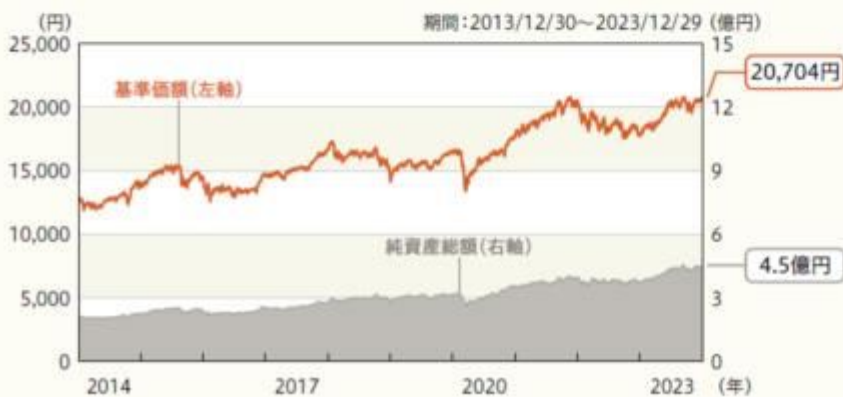
■(安定成長型)



決算期	分配金
2023年12月	0円
2022年12月	0円
2021年12月	0円
2020年12月	0円
2019年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

■(成長型)



決算期	分配金
2023年12月	0円
2022年12月	0円
2021年12月	0円
2020年12月	0円
2019年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

■(安定型)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.33
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド(B号)	54.10
日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド(A号)	19.73
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド(A号)	13.12
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド(A号)	8.71

■(安定成長型)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.26
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド(B号)	37.05
日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド(A号)	34.34
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド(A号)	15.26
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド(A号)	9.09

■(成長型)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.40
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド(A号)	45.70
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド(A号)	22.75
日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド(B号)	21.04
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド(A号)	6.11

■国内株式マザーファンド(A号)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	97.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.09
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	4.37
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.91
日本	株式	日立製作所	電気機器	2.86
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2.61
日本	株式	キーエンス	電気機器	2.49
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	2.43
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.42
日本	株式	日本郵船	海運業	2.42
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	1.98
日本	株式	ディスコ	機械	1.97

*比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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

■国内債券マザーファンド(B号)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	64.39
社債券	日本	19.88
特殊債券	日本	5.03
地方債証券	日本	1.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9.26
合計(純資産総額)		100.00

※債券先物取引の買建て 8.58%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	455 2年国債	0.005	2025/12/01	15.13
日本	国債証券	372 10年国債	0.800	2033/09/20	6.14
日本	国債証券	186 20年国債	1.500	2043/09/20	4.36
日本	国債証券	80 30年国債	1.800	2053/09/20	2.51
日本	国債証券	149 20年国債	1.500	2034/06/20	2.38
日本	国債証券	354 10年国債	0.100	2029/03/20	2.14
日本	国債証券	453 2年国債	0.005	2025/10/01	1.67
日本	国債証券	173 20年国債	0.400	2040/06/20	1.34
日本	国債証券	159 5年国債	0.100	2028/06/20	1.29
日本	国債証券	160 5年国債	0.200	2028/06/20	1.26

■外国株式マザーファンド(A号)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	71.36
	フランス	6.58
	アイルランド	5.36
	スイス	3.83
	イギリス	3.20
	オランダ	2.69
	香港	2.27
	その他	2.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.35
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	5.15
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	4.67
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.39
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー ライフサイエンス	2.81
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1.96
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	1.89
アメリカ	株式	INTUIT INC	ソフトウェア・サービス	1.85
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	1.80
アメリカ	株式	SERVICENOW INC	ソフトウェア・サービス	1.77
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	1.77

■外国債券マザーファンド(A号)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	41.12
	フランス	16.76
	スペイン	13.16
	イギリス	8.95
	その他	10.80
社債券	日本・その他	5.58
特殊債券	日本	1.12
地方債証券	カナダ	0.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.95
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2028/02/15	7.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2031/11/15	7.28
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	0.000	2029/11/25	5.09
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	0.000	2032/05/25	4.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/02/15	4.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2040/05/15	3.84
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.500	2027/04/30	3.84
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.500	2027/05/31	3.18
イギリス	国債証券	UK GILT	3.500	2025/10/22	2.96
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2028/10/31	2.90

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

■(安定型)



■(安定成長型)



■(成長型)



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

※2023年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※複合ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

イ 申込方法

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

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。販売会社によっては、「スイッチング」(ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること)による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。お申込みの販売会社にお問い合わせください。

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

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

- (八) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。
- 販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。
- ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。
- (二) 定時定額で取得申込みをする「定時定額購入サービス」（販売会社によっては、名称が異なる場合があります。）を利用する場合は、販売会社との間で「定時定額購入サービス」に関する契約を締結します。詳細については、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

ありません。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるとき

は、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

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

<主要投資対象の評価方法>

主要投資対象	有価証券等の評価方法
株式、投資証券、債券等	(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の最終相場で評価します。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 原則として、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価します。
市場デリバティブ取引	原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の発表する清算値段または最終相場で評価します。

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

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、それぞれ「DC安定」、「DC安成」、「DC成長」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(2)【保管】

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

証券の保管に関する該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

2001年10月4日から下記「(5) その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4) 【計算期間】

毎年12月16日から翌年12月15日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

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

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。

- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないとき、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。
ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更

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

二 反対者の買取請求権

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

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および

償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

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

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

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

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

ハ 一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができま

す。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金(解約)手続等」の記載をご参照ください。

二 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

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

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

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第23期(2022年12月16日から2023年12月15日まで)の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三井住友・DCバランスファンド(安定型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第22期 (2022年12月15日現在)	第23期 (2023年12月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	275,915	285,892
コール・ローン	9,356,986	15,953,542
親投資信託受益証券	243,226,119	241,397,010
派生商品評価勘定	188,081	502,858
未収入金	580,918	1,004,632
流動資産合計	253,628,019	259,143,934
資産合計	253,628,019	259,143,934
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	91,521	-
未払受託者報酬	137,552	139,020
未払委託者報酬	1,788,734	1,807,900
その他未払費用	6,848	6,897
流動負債合計	2,024,655	1,953,817
負債合計	2,024,655	1,953,817
純資産の部		
元本等		
元本	195,248,223	194,035,094
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	56,355,141	63,155,023
(分配準備積立金)	33,217,707	31,066,145
元本等合計	251,603,364	257,190,117
純資産合計	251,603,364	257,190,117
負債純資産合計	253,628,019	259,143,934

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第22期		第23期	
	自	2021年12月16日 至 2022年12月15日	自	2022年12月16日 至 2023年12月15日
営業収益				
受取利息		75		185
有価証券売買等損益		9,229,322		15,320,891
為替差損益		7,080,732		4,217,803
営業収益合計		16,309,979		11,103,273
営業費用				
支払利息		3,609		6,314
受託者報酬		280,031		275,986
委託者報酬		3,641,541		3,588,991
その他費用		14,063		14,010
営業費用合計		3,939,244		3,885,301
営業利益又は営業損失()		20,249,223		7,217,972
経常利益又は経常損失()		20,249,223		7,217,972
当期純利益又は当期純損失()		20,249,223		7,217,972
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		1,139,032		457,082
期首剰余金又は期首欠損金()		76,854,615		56,355,141
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,126,218		6,945,958
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,126,218		6,945,958
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,515,501		6,906,966
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,515,501		6,906,966
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		56,355,141		63,155,023

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第23期	
	自 2022年12月16日 至 2023年12月15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>	

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第22期	第23期
	(2022年12月15日現在)	(2023年12月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	195,248,223口	194,035,094口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2886円 (1万口当たりの純資産額12,886円)	1口当たり純資産額 1.3255円 (1万口当たりの純資産額13,255円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第22期	第23期
	自 2021年12月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年12月15日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（61,988,156円）、および分配準備積立金（33,217,707円）より、分配対象収益は95,205,863円（1万口当たり4,876.14円）ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,729,505円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（65,304,746円）、および分配準備積立金（29,336,640円）より、分配対象収益は96,370,891円（1万口当たり4,966.67円）ですが、分配を行っておりません。</p>

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項 目	第23期 自 2022年12月16日 至 2023年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第23期 (2023年12月15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第22期（自 2021年12月16日 至 2022年12月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	6,262,187円
合計	6,262,187円

第23期(自 2022年12月16日 至 2023年12月15日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	12,561,233円
合計	12,561,233円

(デリバティブ取引に関する注記)

第22期(2022年12月15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	20,948,235	-	20,760,154	188,081
	ユーロ	13,339,827	-	13,431,348	91,521
	小計	34,288,062	-	34,191,502	96,560
合 計		34,288,062	-	34,191,502	96,560

第23期(2023年12月15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	20,573,300	-	20,108,620	464,680
	ユーロ	13,121,514	-	13,083,336	38,178
	小計	33,694,814	-	33,191,956	502,858
合 計		33,694,814	-	33,191,956	502,858

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

第23期 自 2022年12月16日 至 2023年12月15日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第22期 (2022年12月15日現在)	第23期 (2023年12月15日現在)
期首元本額	195,245,058円	195,248,223円
期中追加設定元本額	19,184,342円	22,709,510円
期中一部解約元本額	19,181,177円	23,922,639円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益 証券	国内株式マザーファンド(A号)	24,004,222	46,018,493	
	外国株式マザーファンド(A号)	4,601,880	22,272,639	
	外国債券マザーファンド(A号)	10,394,478	33,523,230	
	国内債券マザーファンド(B号)	102,694,709	139,582,648	
	親投資信託受益証券 小計		241,397,010	
合 計			241,397,010	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第22期 (2022年12月15日現在)	第23期 (2023年12月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	697,297	944,790
コール・ローン	23,647,121	52,721,811
親投資信託受益証券	692,562,753	701,520,935
派生商品評価勘定	642,404	1,798,365
未収入金	1,859,217	3,345,652
流動資産合計	719,408,792	760,331,553
資産合計	719,408,792	760,331,553
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	234,215	-
未払受託者報酬	380,682	415,274
未払委託者報酬	4,949,303	5,399,253
その他未払費用	19,070	20,771
流動負債合計	5,583,270	5,835,298
負債合計	5,583,270	5,835,298
純資産の部		
元本等		
元本	450,696,033	445,543,208
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	263,129,489	308,953,047
(分配準備積立金)	165,987,951	155,642,313
元本等合計	713,825,522	754,496,255
純資産合計	713,825,522	754,496,255
負債純資産合計	719,408,792	760,331,553

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第22期		第23期	
	自	2021年12月16日 至 2022年12月15日	自	2022年12月16日 至 2023年12月15日
営業収益				
受取利息		223		555
有価証券売買等損益		26,145,109		74,918,182
為替差損益		23,372,261		13,644,815
営業収益合計		49,517,147		61,273,922
営業費用				
支払利息		10,618		19,549
受託者報酬		765,846		809,702
委託者報酬		9,957,054		10,527,311
その他費用		38,998		41,817
営業費用合計		10,772,516		11,398,379
営業利益又は営業損失（ ）		60,289,663		49,875,543
経常利益又は経常損失（ ）		60,289,663		49,875,543
当期純利益又は当期純損失（ ）		60,289,663		49,875,543
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		2,455,203		3,399,321
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		305,447,758		263,129,489
剰余金増加額又は欠損金減少額		33,143,977		29,129,410
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		33,143,977		29,129,410
剰余金減少額又は欠損金増加額		17,627,786		29,782,074
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		17,627,786		29,782,074
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		263,129,489		308,953,047

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第23期	
	自 2022年12月16日 至 2023年12月15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>	

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第22期	第23期
	(2022年12月15日現在)	(2023年12月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	450,696,033口	445,543,208口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.5838円 (1万口当たりの純資産額15,838円)	1口当たり純資産額 1.6934円 (1万口当たりの純資産額16,934円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第22期	第23期
	自 2021年12月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年12月15日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(231,809,588円)、および分配準備積立金(165,987,951円)より、分配対象収益は397,797,539円(1万口当たり8,826.29円)ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,410,899円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(245,103,802円)、および分配準備積立金(148,231,414円)より、分配対象収益は400,746,115円(1万口当たり8,994.55円)ですが、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項 目	第23期 自 2022年12月16日 至 2023年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第23期 (2023年12月15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第22期（自 2021年12月16日 至 2022年12月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	16,102,575円
合計	16,102,575円

第23期(自 2022年12月16日 至 2023年12月15日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	61,856,436円
合計	61,856,436円

(デリバティブ取引に関する注記)

第22期(2022年12月15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	71,550,465	-	70,908,061	642,404
	ユーロ	34,138,482	-	34,372,697	234,215
	小計	105,688,947	-	105,280,758	408,189
合 計		105,688,947	-	105,280,758	408,189

第23期(2023年12月15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	75,193,965	-	73,495,590	1,698,375
	ユーロ	34,365,870	-	34,265,880	99,990
	小計	109,559,835	-	107,761,470	1,798,365
合 計		109,559,835	-	107,761,470	1,798,365

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

<p>第23期 自 2022年12月16日 至 2023年12月15日</p>
<p>市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。</p>

(その他の注記)

項 目	第22期 (2022年12月15日現在)	第23期 (2023年12月15日現在)
期首元本額	420,665,162円	450,696,033円
期中追加設定元本額	54,458,838円	45,733,711円
期中一部解約元本額	24,427,967円	50,886,536円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益 証券	国内株式マザーファンド(A号)	124,106,031	237,923,672	
	外国株式マザーファンド(A号)	23,678,822	114,603,130	
	外国債券マザーファンド(A号)	21,210,342	68,405,473	
	国内債券マザーファンド(B号)	206,436,625	280,588,660	
	親投資信託受益証券 小計		701,520,935	
合 計			701,520,935	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【三井住友・DCバランスファンド(成長型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第22期 (2022年12月15日現在)	第23期 (2023年12月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	443,570	468,494
コール・ローン	15,042,587	26,143,216
親投資信託受益証券	370,454,682	414,071,999
派生商品評価勘定	493,406	1,516,666
未収入金	1,405,088	2,644,931
流動資産合計	387,839,333	444,845,306
資産合計	387,839,333	444,845,306
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	130,885	-
未払受託者報酬	207,234	241,669
未払委託者報酬	2,694,567	3,142,092
その他未払費用	10,359	12,050
流動負債合計	3,043,045	3,395,811
負債合計	3,043,045	3,395,811
純資産の部		
元本等		
元本	208,521,242	215,855,675
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	176,275,046	225,593,820
(分配準備積立金)	106,537,522	105,157,850
元本等合計	384,796,288	441,449,495
純資産合計	384,796,288	441,449,495
負債純資産合計	387,839,333	444,845,306

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第22期		第23期	
	自	2021年12月16日	自	2022年12月16日
	至	2022年12月15日	至	2023年12月15日
営業収益				
受取利息		111		324
有価証券売買等損益		12,632,994		58,932,317
為替差損益		15,649,896		9,536,373
営業収益合計		28,282,779		49,396,268
営業費用				
支払利息		5,998		10,869
受託者報酬		415,066		457,261
委託者報酬		5,396,942		5,945,366
その他費用		21,011		23,447
営業費用合計		5,839,017		6,436,943
営業利益又は営業損失 ()		34,121,796		42,959,325
経常利益又は経常損失 ()		34,121,796		42,959,325
当期純利益又は当期純損失 ()		34,121,796		42,959,325
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ()		2,101,015		3,209,549
期首剰余金又は期首欠損金 ()		197,101,087		176,275,046
剰余金増加額又は欠損金減少額		24,854,949		32,961,604
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		24,854,949		32,961,604
剰余金減少額又は欠損金増加額		13,660,209		23,392,606
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		13,660,209		23,392,606
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		176,275,046		225,593,820

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第23期	
	自 2022年12月16日 至 2023年12月15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>	

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第22期	第23期
	(2022年12月15日現在)	(2023年12月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	208,521,242口	215,855,675口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8454円 (1万口当たりの純資産額18,454円)	1口当たり純資産額 2.0451円 (1万口当たりの純資産額20,451円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第22期	第23期
	自 2021年12月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年12月15日

分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(163,169円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(151,710,985円)、および分配準備積立金(106,374,353円)より、分配対象収益は258,248,507円(1万口当たり12,384.76円)ですが、分配を行っていません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,125,092円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(6,312,798円)、収益調整金(173,717,182円)、および分配準備積立金(93,719,960円)より、分配対象収益は278,875,032円(1万口当たり12,919.51円)ですが、分配を行っていません。</p>
----------	--	---

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項目	<p style="text-align: center;">第23期 自 2022年12月16日 至 2023年12月15日</p>
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第23期 (2023年12月15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第22期（自 2021年12月16日 至 2022年12月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	7,959,735円
合計	7,959,735円

第23期(自 2022年12月16日 至 2023年12月15日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	52,019,015円
合計	52,019,015円

(デリバティブ取引に関する注記)

第22期(2022年12月15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	54,955,110	-	54,461,704	493,406
	ユーロ	19,077,387	-	19,208,272	130,885
	小計	74,032,497	-	73,669,976	362,521
合 計		74,032,497	-	73,669,976	362,521

第23期(2023年12月15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	64,472,668	-	63,016,450	1,456,218
	ユーロ	20,775,730	-	20,715,282	60,448
	小計	85,248,398	-	83,731,732	1,516,666
合 計		85,248,398	-	83,731,732	1,516,666

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

<p>第23期 自 2022年12月16日 至 2023年12月15日</p>
<p>市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。</p>

(その他の注記)

項 目	第22期 (2022年12月15日現在)	第23期 (2023年12月15日現在)
期首元本額	193,280,750円	208,521,242円
期中追加設定元本額	28,771,839円	34,812,976円
期中一部解約元本額	13,531,347円	27,478,543円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益 証券	国内株式マザーファンド(A号)	100,095,339	191,892,774	
	外国株式マザーファンド(A号)	20,869,272	101,005,189	
	外国債券マザーファンド(A号)	8,455,713	27,270,519	
	国内債券マザーファンド(B号)	69,087,344	93,903,517	
	親投資信託受益証券 小計		414,071,999	
合 計			414,071,999	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

(参考)

「三井住友・DCバランスファンド(安定型)」、「三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)」および「三井住友・DCバランスファンド(成長型)」は、「国内株式マザーファンド(A号)」、「国内債券マザーファンド(B号)」、「外国株式マザーファンド(A号)」および「外国債券マザーファンド(A号)」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式マザーファンド（A号）

（1）貸借対照表

（単位：円）

	（2022年12月15日現在）	（2023年12月15日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	523,580	532,482
コール・ローン	17,755,918	29,713,911
株式	1,038,988,200	1,170,195,140
未収入金	-	26,761,377
未収配当金	245,250	673,850
流動資産合計	1,057,512,948	1,227,876,760
資産合計	1,057,512,948	1,227,876,760
負債の部		
流動負債		
未払金	-	27,520,346
未払解約金	20,676	193,514
その他未払費用	61	33
流動負債合計	20,737	27,713,893
負債合計	20,737	27,713,893
純資産の部		
元本等		
元本	663,608,255	626,016,414
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	393,883,956	574,146,453
元本等合計	1,057,492,211	1,200,162,867
純資産合計	1,057,492,211	1,200,162,867
負債純資産合計	1,057,512,948	1,227,876,760

（2）注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 2022年12月16日 至 2023年12月15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</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>
--	--

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（2022年12月15日現在）	（2023年12月15日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	663,608,255口	626,016,414口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.5935円 （1万口当たりの純資産額15,935円）	1口当たり純資産額 1.9171円 （1万口当たりの純資産額19,171円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項 目	自 2022年12月16日 至 2023年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年12月15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)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年12月16日 至 2023年12月15日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年12月15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	658,063,858円
同期中における追加設定元本額	105,463,178円
同期中における一部解約元本額	99,918,781円
2022年12月15日現在の元本の内訳	
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	28,329,523円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	144,770,029円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	105,689,429円
三井住友・DC国内株式アクティブS	371,344,869円
S M A M・バランスファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	11,672,288円
S M A M・バランスファンドVA株40型(適格機関投資家専用)	650,900円
S M A M・バランスファンドVA株60型(適格機関投資家専用)	455,834円
S M A M・バランスファンドVA株80型(適格機関投資家専用)	695,383円
合 計	663,608,255円

(2023年12月15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	663,608,255円
同期中における追加設定元本額	106,765,301円
同期中における一部解約元本額	144,357,142円
2023年12月15日現在の元本の内訳	
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	24,004,222円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	124,106,031円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	100,095,339円
三井住友・DC国内株式アクティブS	368,388,322円
S M A M・バランスファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	8,567,770円
S M A M・バランスファンドVA株40型(適格機関投資家専用)	561,439円
S M A M・バランスファンドVA株60型(適格機関投資家専用)	113,156円
S M A M・バランスファンドVA株80型(適格機関投資家専用)	180,135円
合 計	626,016,414円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位 : 円)

銘 柄	株 数	評 価 額		備 考
		単 価	金 額	

INPEX	5,500	1,900.000	10,450,000
鹿島建設	2,000	2,335.000	4,670,000
東鉄工業	800	3,050.000	2,440,000
住友林業	800	4,187.000	3,349,600
九電工	1,600	5,030.000	8,048,000
日清食品ホールディングス	900	14,365.000	12,928,500
レンゴー	5,500	912.900	5,020,950
大阪ソーダ	1,400	8,870.000	12,418,000
信越化学工業	800	5,459.000	4,367,200
三井化学	2,700	4,214.000	11,377,800
日本ゼオン	3,300	1,327.500	4,380,750
関西ペイント	1,600	2,380.000	3,808,000
中国塗料	2,600	1,622.000	4,217,200
ニフコ	700	3,492.000	2,444,400
ユニ・チャーム	2,300	4,883.000	11,230,900
武田薬品工業	1,500	3,995.000	5,992,500
中外製薬	2,700	5,344.000	14,428,800
エーザイ	800	7,207.000	5,765,600
ロート製薬	800	2,805.000	2,244,000
第一三共	3,400	4,005.000	13,617,000
出光興産	3,600	3,849.000	13,856,400
横浜ゴム	3,300	3,149.000	10,391,700
東洋炭素	1,600	4,590.000	7,344,000
日本製鉄	2,800	3,274.000	9,167,200
共英製鋼	1,500	1,996.000	2,994,000
住友電気工業	2,000	1,764.000	3,528,000
日本製鋼所	700	2,466.000	1,726,200
アマダ	5,500	1,477.000	8,123,500
ディスコ	600	32,930.000	19,758,000
平田機工	600	6,010.000	3,606,000
タツモ	4,200	2,607.000	10,949,400
クボタ	2,300	2,086.000	4,797,800
荏原製作所	300	7,898.000	2,369,400
ダイキン工業	200	22,335.000	4,467,000
CKD	3,800	2,484.000	9,439,200
アマノ	2,600	3,285.000	8,541,000
三菱重工業	2,800	7,612.000	21,313,600
イビデン	700	7,599.000	5,319,300
ミネベアミツミ	4,000	2,847.000	11,388,000
日立製作所	3,500	9,859.000	34,506,500
富士電機	1,400	5,968.000	8,355,200
ダイヘン	2,500	6,200.000	15,500,000
日本電気	800	8,131.000	6,504,800
ルネサスエレクトロニクス	6,600	2,520.000	16,632,000
パナソニック ホールディングス	7,000	1,367.500	9,572,500
ソニーグループ	2,600	13,365.000	34,749,000
TDK	1,200	6,575.000	7,890,000
古野電気	3,300	1,633.000	5,388,900

エスペック	2,100	2,261.000	4,748,100
キーエンス	400	62,500.000	25,000,000
日置電機	500	6,200.000	3,100,000
イリソ電子工業	1,300	3,680.000	4,784,000
レーザーテック	300	32,700.000	9,810,000
日本セラミック	1,300	2,851.000	3,706,300
日本電子	2,000	6,098.000	12,196,000
ローム	1,700	2,900.000	4,930,000
三井ハイテック	200	7,827.000	1,565,400
ニチコン	6,700	1,333.000	8,931,100
東京エレクトロン	1,000	24,370.000	24,370,000
デンソー	4,500	2,089.500	9,402,750
川崎重工業	1,600	2,938.000	4,700,800
トヨタ自動車	21,000	2,600.500	54,610,500
マツダ	7,000	1,509.000	10,563,000
スズキ	3,700	5,565.000	20,590,500
豊田合成	2,700	2,597.000	7,011,900
テルモ	1,900	4,647.000	8,829,300
任天堂	3,000	6,778.000	20,334,000
関西電力	3,000	1,944.500	5,833,500
東武鉄道	2,300	3,793.000	8,723,900
小田急電鉄	2,900	2,236.000	6,484,400
京成電鉄	1,800	6,550.000	11,790,000
西日本旅客鉄道	1,700	5,913.000	10,052,100
京阪ホールディングス	2,500	3,776.000	9,440,000
セイノーホールディングス	2,900	2,058.000	5,968,200
日本郵船	2,700	3,911.000	10,559,700
住友倉庫	1,000	2,482.000	2,482,000
コーエーテクモホールディングス	1,000	1,668.500	1,668,500
ネクソン	3,700	2,960.500	10,953,850
フィックスターズ	2,200	1,229.000	2,703,800
インターネットイニシアティブ	5,300	2,784.000	14,755,200
大塚商会	1,600	6,119.000	9,790,400
日本電信電話	186,800	169.800	31,718,640
ソフトバンクグループ	2,100	6,088.000	12,784,800
円谷フィールズホールディングス	1,900	1,174.000	2,230,600
マクニカホールディングス	2,700	7,711.000	20,819,700
伊藤忠商事	3,000	5,784.000	17,352,000
丸紅	3,800	2,222.500	8,445,500
豊田通商	800	8,181.000	6,544,800
マツキヨココカラ&カンパニー	5,000	2,541.500	12,707,500
ヨシックスホールディングス	900	2,710.000	2,439,000
サイゼリヤ	800	4,745.000	3,796,000
ファーストリテイリング	500	35,580.000	17,790,000
ゆうちょ銀行	10,900	1,443.000	15,728,700
三菱UFJフィナンシャル・グループ	28,100	1,204.500	33,846,450
三井住友トラスト・ホールディングス	1,800	5,351.000	9,631,800
群馬銀行	15,500	713.500	11,059,250

七十七銀行	5,000	3,505.000	17,525,000
北洋銀行	13,300	361.000	4,801,300
SBIホールディングス	3,900	3,050.000	11,895,000
野村ホールディングス	15,800	620.000	9,796,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	36,600	513.000	18,775,800
第一生命ホールディングス	4,600	2,962.500	13,627,500
東京海上ホールディングス	4,400	3,492.000	15,364,800
日本取引所グループ	2,900	2,836.000	8,224,400
大東建託	800	16,195.000	12,956,000
オリエンタルランド	5,400	5,270.000	28,458,000
リクルートホールディングス	3,000	5,915.000	17,745,000
日本郵政	8,200	1,243.000	10,192,600
キュービーネットホールディングス	1,500	1,448.000	2,172,000
合 計	581,200		1,170,195,140

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内債券マザーファンド(B号)

(1) 貸借対照表

(単位 : 円)

	(2022年12月15日現在)	(2023年12月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	63,146,823	527,163,917
コール・ローン	2,141,469,422	29,417,164,707
国債証券	223,024,273,320	198,756,364,430
地方債証券	5,827,944,200	5,081,917,400
特殊債券	14,820,656,844	15,919,639,544
社債券	38,768,753,300	63,636,519,600
派生商品評価勘定	-	11,865,360
未収入金	1,498,096,000	1,499,535,000
未収利息	429,567,773	466,148,312
前払費用	51,204,889	119,756,176
差入委託証拠金	-	342,388,563
流動資産合計	286,625,112,571	315,778,463,009
資産合計	286,625,112,571	315,778,463,009
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	78,981,800
前受金	-	9,430,000
未払金	1,497,113,000	1,805,564,000
未払解約金	11,629,076	316,335,771
その他未払費用	9,958	37,315
流動負債合計	1,508,752,034	2,210,348,886

負債合計	1,508,752,034	2,210,348,886
純資産の部		
元本等		
元本	207,882,455,077	230,702,563,745
剰余金		
剰余金又は欠損金()	77,233,905,460	82,865,550,378
元本等合計	285,116,360,537	313,568,114,123
純資産合計	285,116,360,537	313,568,114,123
負債純資産合計	286,625,112,571	315,778,463,009

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年12月16日 至 2023年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2022年12月15日現在)	(2023年12月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	207,882,455,077口	230,702,563,745口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3715円 (1万口当たりの純資産額13,715円)	1口当たり純資産額 1.3592円 (1万口当たりの純資産額13,592円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 2022年12月16日 至 2023年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年12月15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年12月15日現在)

該当事項はありません。

(2023年12月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	債券先物取引 買建				
	長国先 0603月	27,148,716,440	-	27,081,600,000	67,116,440
	小計	27,148,716,440	-	27,081,600,000	67,116,440
合 計		27,148,716,440	-	27,081,600,000	67,116,440

(注) 1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年12月16日 至 2023年12月15日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年12月15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	150,024,384,893円
同期中における追加設定元本額	61,048,094,708円
同期中における一部解約元本額	3,190,024,524円
2022年12月15日現在の元本の内訳	
三井住友・年金プラン30	1,003,154,942円
三井住友・年金プラン50	944,766,745円
三井住友・年金プラン70	335,935,019円
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	104,783,681円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	212,517,304円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	67,478,517円
三井住友・DC国内債券アクティブ	314,188,601円
三井住友・日本債券年金ファンド	4,413,376,330円
S M A M・年金国内債券アクティブファンド(適格機関投資家専用)	2,944,482,418円
S M A M・バランスファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	112,162,659円
S M A M・バランスファンドVA株40型(適格機関投資家専用)	1,312,609円
S M A M・バランスファンドVA株60型(適格機関投資家専用)	362,331円
S M A M・バランスファンドVA株80型(適格機関投資家専用)	155,587円

バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	71,843,901円
三井住友/FOFS用日本債F(適格機関投資家限定)	197,355,934,433円
合計	207,882,455,077円

(2023年12月15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	207,882,455,077円
同期中における追加設定元本額	42,500,908,074円
同期中における一部解約元本額	19,680,799,406円
2023年12月15日現在の元本の内訳	
三井住友・年金プラン30	1,037,272,097円
三井住友・年金プラン50	1,013,662,096円
三井住友・年金プラン70	353,026,694円
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	102,694,709円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	206,436,625円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	69,087,344円
三井住友・DC国内債券アクティブ	306,678,043円
三井住友・日本債券年金ファンド	4,389,734,453円
SMAM・年金国内債券アクティブファンド(適格機関投資家専用)	3,101,548,908円
SMAM・バランスファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	101,834,121円
SMAM・バランスファンドVA株40型(適格機関投資家専用)	1,396,618円
SMAM・バランスファンドVA株60型(適格機関投資家専用)	107,438円
SMAM・バランスファンドVA株80型(適格機関投資家専用)	46,265円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	63,465,520円
三井住友/FOFS用日本債F(適格機関投資家限定)	219,955,572,814円
合計	230,702,563,745円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	453 2年国債	5,300,000,000	5,293,852,000	
	455 2年国債	47,300,000,000	47,225,739,000	
	156 5年国債	1,000,000,000	999,400,000	
	158 5年国債	1,300,000,000	1,292,057,000	
	159 5年国債	4,100,000,000	4,068,963,000	
	160 5年国債	4,000,000,000	3,987,520,000	
	161 5年国債	1,100,000,000	1,101,463,000	
	163 5年国債	2,000,000,000	2,008,420,000	
	10 40年国債	150,000,000	120,786,000	
	11 40年国債	400,000,000	309,344,000	
	14 40年国債	1,350,000,000	980,586,000	
	15 40年国債	509,000,000	406,619,740	

1 6 4 0 年国債	2,080,000,000	1,819,854,400	
3 5 3 1 0 年国債	1,850,000,000	1,829,946,000	
3 5 4 1 0 年国債	6,850,000,000	6,766,909,500	
3 5 8 1 0 年国債	200,000,000	196,460,000	
3 6 3 1 0 年国債	700,000,000	678,517,000	
3 6 4 1 0 年国債	3,500,000,000	3,382,820,000	
3 7 2 1 0 年国債	18,600,000,000	18,761,262,000	
3 0 3 0 年国債	510,000,000	591,472,500	
4 2 3 0 年国債	1,170,000,000	1,221,526,800	
4 5 3 0 年国債	3,250,000,000	3,268,265,000	
4 6 3 0 年国債	1,130,000,000	1,134,565,200	
4 8 3 0 年国債	1,770,000,000	1,739,538,300	
5 2 3 0 年国債	210,000,000	168,787,500	
5 5 3 0 年国債	1,000,000,000	853,870,000	
5 9 3 0 年国債	2,550,000,000	2,099,797,500	
6 0 3 0 年国債	2,790,000,000	2,403,194,400	
6 1 3 0 年国債	350,000,000	286,324,500	
6 7 3 0 年国債	3,980,000,000	3,109,056,600	
7 0 3 0 年国債	3,800,000,000	3,024,686,000	
7 1 3 0 年国債	870,000,000	690,136,200	
7 2 3 0 年国債	150,000,000	118,690,500	
7 3 3 0 年国債	200,000,000	157,860,000	
7 4 3 0 年国債	1,620,000,000	1,385,051,400	
7 5 3 0 年国債	3,050,000,000	2,813,045,500	
7 6 3 0 年国債	2,511,000,000	2,372,367,690	
7 8 3 0 年国債	1,360,000,000	1,282,792,800	
7 9 3 0 年国債	500,000,000	448,235,000	
8 0 3 0 年国債	7,130,000,000	7,380,263,000	
1 4 9 2 0 年国債	7,010,000,000	7,521,870,200	
1 5 1 2 0 年国債	2,020,000,000	2,101,709,000	
1 5 3 2 0 年国債	1,430,000,000	1,499,784,000	
1 5 4 2 0 年国債	1,360,000,000	1,409,368,000	
1 5 5 2 0 年国債	2,760,000,000	2,792,926,800	
1 6 0 2 0 年国債	50,000,000	48,160,000	
1 6 3 2 0 年国債	2,250,000,000	2,117,317,500	
1 6 4 2 0 年国債	3,260,000,000	3,013,413,600	
1 6 5 2 0 年国債	4,300,000,000	3,959,913,000	
1 6 7 2 0 年国債	4,330,000,000	3,954,632,300	
1 6 8 2 0 年国債	1,000,000,000	895,120,000	
1 7 0 2 0 年国債	3,100,000,000	2,703,417,000	
1 7 3 2 0 年国債	4,850,000,000	4,233,807,500	
1 7 5 2 0 年国債	2,650,000,000	2,332,000,000	
1 8 1 2 0 年国債	750,000,000	693,352,500	
1 8 2 2 0 年国債	665,000,000	634,888,800	
1 8 3 2 0 年国債	3,800,000,000	3,808,550,000	

	184 20年国債	1,300,000,000	1,234,298,000	
	185 20年国債	2,800,000,000	2,648,968,000	
	186 20年国債	13,220,000,000	13,372,823,200	
	国債証券 小計		198,756,364,430	
地方債証券	759 東京都公債	100,000,000	99,586,500	
	763 東京都公債	100,000,000	99,742,800	
	6 東京都20年	600,000,000	614,155,800	
	14 東京都20年	500,000,000	540,979,500	
	28-3 埼玉県公債	200,000,000	199,390,800	
	28-10 埼玉県公債	100,000,000	99,871,600	
	4 埼玉県20年	400,000,000	428,029,600	
	154 共同発行地方	600,000,000	602,681,400	
	155 共同発行地方	900,000,000	900,491,400	
	29-4 横浜市公債	1,000,000,000	996,947,000	
	86 川崎市公債	500,000,000	500,041,000	
	地方債証券 小計		5,081,917,400	
特殊債券	2 地方公営20年	250,000,000	273,321,250	
	9 地方公共団20年	800,000,000	868,996,000	
	F77 地方公共団体	100,000,000	103,530,300	
	F80 地方公共団体	400,000,000	422,608,400	
	F116 地方公共団体	100,000,000	103,897,400	
	F134 地方公共団体	200,000,000	207,853,200	
	F143 地方公共団体	500,000,000	518,448,500	
	F163 地方公共団体	100,000,000	102,693,800	
	F172 地方公共団体	300,000,000	306,720,600	
	2 地方公共団15年	500,000,000	516,401,000	
	F225 地方公共団体	100,000,000	102,685,300	
	F226 地方公共団体	100,000,000	102,977,700	
	67 地方公共団体	800,000,000	803,110,400	
	71 政保地方公共団	214,000,000	214,839,094	
	73 政保地方公共団	201,000,000	202,105,500	
	75 政保地方公共団	303,000,000	304,520,151	
	F303 地方公共団体	100,000,000	100,755,800	
	F306 地方公共団体	300,000,000	302,404,200	
	91 地方公共団体	400,000,000	398,446,800	
	20 公営企業20年	400,000,000	425,333,600	
	24 公営企業20年	200,000,000	216,083,200	
	7 住宅機構R M B S	9,917,000	9,970,551	
	46 住宅機構R M B S	35,040,000	36,504,672	
	48 住宅機構R M B S	33,234,000	34,593,270	
	50 住宅機構R M B S	17,577,000	18,209,772	
	57 住宅機構R M B S	23,663,000	24,420,216	
	59 住宅機構R M B S	25,124,000	25,945,554	
	71 住宅機構R M B S	28,253,000	28,693,746	
	88 住宅機構R M B S	76,730,000	77,036,920	

9 0	住宅機構 R M B S	40,304,000	40,316,091	
9 1	住宅機構 R M B S	41,509,000	41,372,020	
1 2 3	住宅機構 R M B S	70,846,000	67,643,760	
1 2 7	住宅機構 R M B S	72,609,000	68,869,636	
1 2 8	住宅機構 R M B S	71,161,000	67,659,878	
1 2 9	住宅機構 R M B S	145,924,000	138,948,832	
1 3 0	住宅機構 R M B S	364,795,000	346,482,291	
1 3 3	住宅機構 R M B S	293,356,000	278,277,501	
1 3 4	住宅機構 R M B S	73,968,000	69,825,792	
1 3 5	住宅機構 R M B S	74,371,000	70,169,038	
1 3 6	住宅機構 R M B S	74,982,000	71,067,939	
1 3 9	住宅機構 R M B S	75,095,000	71,280,174	
1 4 0	住宅機構 R M B S	750,730,000	706,962,441	
1 4 1	住宅機構 R M B S	764,840,000	717,878,824	
1 4 2	住宅機構 R M B S	232,617,000	217,706,250	
1 4 3	住宅機構 R M B S	155,850,000	145,548,315	
1 4 6	住宅機構 R M B S	478,266,000	442,730,836	
1 4 7	住宅機構 R M B S	395,835,000	366,305,709	
1 4 8	住宅機構 R M B S	803,260,000	738,918,874	
1 5 2	住宅機構 R M B S	412,305,000	384,804,256	
1 5 3	住宅機構 R M B S	165,562,000	154,469,346	
1 5 4	住宅機構 R M B S	250,809,000	233,177,127	
1 6 4	住宅機構 R M B S	87,964,000	81,533,831	
1 7 8	住宅機構 R M B S	91,829,000	86,089,687	
1 7 9	住宅機構 R M B S	92,150,000	86,086,530	
1 8 8	住宅機構 R M B S	384,424,000	381,733,032	
1 8 9	住宅機構 R M B S	287,865,000	285,446,934	
1 9 0	住宅機構 R M B S	1,449,195,000	1,454,991,780	
1 9 1	住宅機構 R M B S	1,262,482,000	1,250,235,924	
	特殊債券 小計		15,919,639,544	
社債券	9 2 東日本高速道	2,100,000,000	2,099,794,200	
	1 0 3 東日本高速道	300,000,000	299,130,600	
	9 9 中日本高速道	400,000,000	399,068,800	
	1 0 1 中日本高速道	500,000,000	497,794,000	
	6 5 西日本高速道	500,000,000	496,262,500	
	1 6 長谷工コ - ポ	300,000,000	296,857,500	
	1 7 長谷工コ - ポ	600,000,000	598,706,400	
	1 8 長谷工コ - ポ	200,000,000	199,601,800	
	1 9 長谷工コ - ポ	400,000,000	399,337,200	
	1 2 西松建設	400,000,000	394,797,600	
	1 4 西松建設	1,700,000,000	1,687,506,700	
	3 7 サツポロホールディング	600,000,000	592,497,600	
	1 アサヒグループHD劣FR	1,300,000,000	1,298,549,200	
	1 6 アサヒグループHD	100,000,000	99,463,700	
	2 1 アサヒグループHD	500,000,000	502,971,000	

1 2	サントリーホールディング	200,000,000	194,079,800	
2	サントリーHD劣後FR	600,000,000	598,986,000	
4	サントリーHD劣後FR	300,000,000	298,836,900	
5	サントリー食品	300,000,000	299,881,500	
2 9	東急不動産HD	100,000,000	99,068,600	
1	東急不動産劣FR	400,000,000	398,887,600	
2	東急不動産劣FR	500,000,000	472,196,500	
1 5	セブンアンドアイ	300,000,000	296,597,700	
1 0	エア・ウォーター	400,000,000	395,867,200	
1 4	野村総合研究所	600,000,000	597,915,600	
1	武田薬品劣後FR	1,000,000,000	1,006,354,000	
7	日本製鉄	600,000,000	599,265,600	
1 4	L I X I L	300,000,000	299,061,900	
1 6	クボタ	400,000,000	398,198,000	
5 5	日本精工	100,000,000	99,834,700	
2 3	日立製作所	1,300,000,000	1,295,470,800	
3 7	ソニーG	600,000,000	598,996,800	
3 8	ソニーG	100,000,000	99,503,400	
1 9	JA三井リース	400,000,000	395,808,400	
2 3	JA三井リース	400,000,000	398,613,600	
3 1	いすゞ自動車	300,000,000	294,826,500	
2 7	トヨタ自動車	1,200,000,000	1,149,670,800	
1	アイシン精機 劣FR	800,000,000	795,827,200	
1	明治安田2019基	1,000,000,000	1,000,499,000	
1	丸紅 劣後FR	1,000,000,000	989,168,000	
7	三菱商事劣後FR	700,000,000	688,469,600	
9 5	クレディセゾン	500,000,000	493,910,000	
9	三菱UFJFG FR	1,300,000,000	1,295,635,900	
1 0	三菱UFJFG FR	1,400,000,000	1,392,287,400	
1	芙蓉総合リース劣FR	600,000,000	605,065,800	
1 7	みずほリース	900,000,000	902,804,400	
2 6	NTTファイナンス	2,100,000,000	2,045,941,800	
2 8	NTTファイナンス	800,000,000	798,890,400	
3 0	NTTファイナンス	500,000,000	498,220,500	
2	東京センチュリー劣FR	1,800,000,000	1,799,613,000	
3 4	東京センチュリー	600,000,000	585,834,000	
8 1	ホンダファイナンス	100,000,000	99,221,200	
8 5	ホンダファイナンス	400,000,000	399,321,600	
9 8	トヨタファイナンス	300,000,000	299,602,500	
6 4	アイフル	200,000,000	200,179,400	
6 5	アイフル	1,200,000,000	1,198,101,600	
2 9	オリエントコーポレーション	100,000,000	99,969,600	
2 1 3	オリックス	700,000,000	691,243,700	
2 2 0	オリックス	1,300,000,000	1,297,900,500	
4 0	大和証券G本社	200,000,000	199,819,000	

4 1	大和証券G本社	100,000,000	99,840,100	
1	SOMPOHD	1,200,000,000	1,198,058,400	
4	損保ジャパン劣FR	1,500,000,000	1,507,756,500	
8 2	三井不動産	500,000,000	495,382,000	
5	三菱地所劣後FR	400,000,000	398,270,800	
1 4 2	三菱地所	200,000,000	199,019,800	
1 4 3	三菱地所	100,000,000	98,534,300	
3 4	東京建物	900,000,000	864,444,600	
1 1 2	住友不動産	2,700,000,000	2,683,991,700	
1 1 5	住友不動産	1,500,000,000	1,500,000,000	
6 2	京成電鉄	100,000,000	99,085,800	
2 8	KDDI	200,000,000	196,160,400	
3 0	KDDI	300,000,000	299,476,800	
5 3 6	関西電力	200,000,000	191,579,600	
5 4 9	関西電力	300,000,000	300,034,200	
1	関西電力劣後FR	500,000,000	494,099,000	
3	関西電力劣後FR	100,000,000	93,815,800	
1	中国電力劣後FR	400,000,000	365,117,200	
4 4 8	中国電力	1,000,000,000	964,355,000	
4 5 0	中国電力	1,000,000,000	987,819,000	
1	東北電力劣後FR	1,400,000,000	1,411,953,200	
5 3 6	東北電力	500,000,000	468,591,000	
1	九州電力劣後FR	400,000,000	399,712,000	
3	九州電力劣後FR	500,000,000	477,035,500	
4 9 4	九州電力	200,000,000	188,945,000	
5 1 1	九州電力	400,000,000	400,541,600	
5 1 6	九州電力	300,000,000	289,573,500	
3 8 5	北海道電力	1,400,000,000	1,364,942,600	
3 4	沖縄電力	700,000,000	691,396,300	
7 3	電源開発	500,000,000	472,455,500	
4 9	東京電力PG	1,000,000,000	997,272,000	
5 0	東京電力PG	900,000,000	863,323,200	
2	JERA	800,000,000	767,256,800	
1 7	JERA	1,300,000,000	1,296,802,000	
1	JERA 劣後FR	600,000,000	613,072,800	
1	大阪瓦斯 劣FR	600,000,000	587,620,800	
2	大阪瓦斯 劣FR	200,000,000	189,060,600	
2	日鉄住金物産	600,000,000	592,337,400	
	社債券 小計		63,636,519,600	
	合計		283,394,440,974	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

外国株式マザーファンド(A号)

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年12月15日現在)	(2023年12月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	6,539,821	7,780,180
金銭信託	1,297,140	856,453
コール・ローン	43,989,327	47,792,393
株式	2,342,668,898	3,031,101,503
未収配当金	1,951,033	2,157,154
流動資産合計	2,396,446,219	3,089,687,683
資産合計	2,396,446,219	3,089,687,683
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	326,135
その他未払費用	158	65
流動負債合計	158	326,200
負債合計	158	326,200
純資産の部		
元本等		
元本	629,837,324	638,312,308
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	1,766,608,737	2,451,049,175
元本等合計	2,396,446,061	3,089,361,483
純資産合計	2,396,446,061	3,089,361,483
負債純資産合計	2,396,446,219	3,089,687,683

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年12月16日 至 2023年12月15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	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2022年12月15日現在）	（2023年12月15日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	629,837,324口	638,312,308口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.8049円 （1万口当たりの純資産額38,049円）	1口当たり純資産額 4.8399円 （1万口当たりの純資産額48,399円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年12月16日 至 2023年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年12月15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)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年12月16日 至 2023年12月15日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年12月15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	629,886,510円
同期中における追加設定元本額	114,341,719円
同期中における一部解約元本額	114,390,905円
2022年12月15日現在の元本の内訳	
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	5,671,992円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	27,972,944円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	22,747,953円
三井住友・DC外国株式アクティブ	570,658,501円
S M A M・バランスファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	2,327,220円
S M A M・バランスファンドVA株40型(適格機関投資家専用)	158,042円
S M A M・バランスファンドVA株60型(適格機関投資家専用)	131,866円
S M A M・バランスファンドVA株80型(適格機関投資家専用)	168,806円
合 計	629,837,324円

(2023年12月15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	629,837,324円
同期中における追加設定元本額	90,998,519円
同期中における一部解約元本額	82,523,535円
2023年12月15日現在の元本の内訳	
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	4,601,880円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	23,678,822円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	20,869,272円
三井住友・DC外国株式アクティブ	587,234,853円
S M A M・バランスファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	1,714,425円
S M A M・バランスファンドVA株40型(適格機関投資家専用)	134,028円
S M A M・バランスファンドVA株60型(適格機関投資家専用)	33,727円
S M A M・バランスファンドVA株80型(適格機関投資家専用)	45,301円
合 計	638,312,308円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	

アメリカ・ドル	CONOCOPHILLIPS	966	114.950	111,041.70	
	EOG RESOURCES INC	2,128	120.600	256,636.80	
	AVERY DENNISON CORP	1,238	198.950	246,300.10	
	CROWN HOLDINGS INC	1,084	90.830	98,459.72	
	EATON CORP PLC	915	237.700	217,495.50	
	PARKER HANNIFIN CORP	391	455.410	178,065.31	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	937	306.850	287,518.45	
	TRANE TECHNOLOGIES PLC	1,063	238.900	253,950.70	
	TREX COMPANY INC	2,575	80.140	206,360.50	
	WILLSCOT MOBILE MINI HOLDING	3,779	45.190	170,773.01	
	CINTAS CORP	466	563.420	262,553.72	
	APTIV PLC	2,125	88.850	188,806.25	
	LULULEMON ATHLETICA INC	615	489.300	300,919.50	
	NIKE INC -CL B	1,745	121.020	211,179.90	
	YETI HOLDINGS INC	3,275	51.030	167,123.25	
	AIRBNB INC-CLASS A	1,444	147.260	212,643.44	
	BOOKING HOLDINGS INC	83	3,440.300	285,544.90	
	MCDONALD'S CORP	701	290.020	203,304.02	
	HOME DEPOT INC	1,119	351.810	393,675.39	
	POOL CORP	290	396.300	114,927.00	
	COSTCO WHOLESALE CORP	145	630.780	91,463.10	
	PEPSICO INC	699	168.250	117,606.75	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,131	77.760	165,706.56	
	IDEXX LABORATORIES INC	454	554.180	251,597.72	
	INTUITIVE SURGICAL INC	749	326.180	244,308.82	
	STRYKER CORP	763	297.100	226,687.30	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	154	534.240	82,272.96	
	ELI LILLY & CO	1,080	573.670	619,563.60	
	IQVIA HOLDINGS INC	1,139	230.550	262,596.45	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	432	521.520	225,296.64	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	518	406.600	210,618.80	
	ZOETIS INC	1,248	200.090	249,712.32	
	BANK OF AMERICA CORP	2,584	33.940	87,700.96	
	JPMORGAN CHASE & CO	2,304	163.990	377,832.96	
	AMERICAN EXPRESS CO	1,143	178.860	204,436.98	
	ARES MANAGEMENT CORP - A	2,580	114.100	294,378.00	
	LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	1,028	214.830	220,845.24	
	MSCI INC	306	542.110	165,885.66	
	S&P GLOBAL INC	518	437.780	226,770.04	
	TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	2,888	87.940	253,970.72	
	VISA INC-CLASS A SHARES	1,615	258.730	417,848.95	
MARSH & MCLENNAN COS	1,050	191.270	200,833.50		
ACCENTURE PLC-CL A	1,121	342.730	384,200.33		
ADOBE INC	672	584.640	392,878.08		

	ANSYS INC	796	294.900	234,740.40	
	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	617	252.680	155,903.56	
	FORTINET INC	6,105	57.050	348,290.25	
	INTUIT INC	658	601.180	395,576.44	
	MICROSOFT CORP	2,605	365.930	953,247.65	
	SERVICENOW INC	563	680.390	383,059.57	
	SYNOPSYS INC	816	551.450	449,983.20	
	WORKDAY INC-CLASS A	695	270.780	188,192.10	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	979	158.720	155,386.88	
	TRIMBLE INC	2,978	51.780	154,200.84	
	ANALOG DEVICES INC	1,161	200.170	232,397.37	
	NVIDIA CORP	2,320	483.500	1,121,720.00	
	ALPHABET INC-CL A	7,431	131.940	980,446.14	
	ALPHABET INC-CL C	885	133.200	117,882.00	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	1,217	333.170	405,467.89	
	COSTAR GROUP INC	1,875	88.250	165,468.75	
	アメリカ・ドル小計	85,961		16,784,254.64 (2,391,756,286)	
オーストラリア・ドル	IDP EDUCATION LTD	9,684	20.580	199,296.72	
	オーストラリア・ドル小計	9,684		199,296.72 (19,022,872)	
香港・ドル	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	14,500	87.150	1,263,675.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,700	248.800	920,560.00	
	AIA GROUP LTD	23,600	65.350	1,542,260.00	
	香港・ドル小計	41,800		3,726,495.00 (68,008,534)	
イギリス・ポンド	ASHTREAD GROUP PLC	2,625	54.860	144,007.50	
	COMPASS GROUP PLC	5,731	21.150	121,210.65	
	ASTRAZENECA PLC	2,765	104.680	289,440.20	
	イギリス・ポンド小計	11,121		554,658.35 (100,781,422)	
スイス・フラン	SIKA AG-REG	605	271.100	164,015.50	
	NESTLE SA-REG	1,547	97.720	151,172.84	
	LONZA GROUP AG-REG	336	332.000	111,552.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	166	1,216.000	201,856.00	
	スイス・フラン小計	2,654		628,596.34 (103,196,661)	
ユーロ	TOTALENERGIES SE	2,392	61.410	146,892.72	
	AIR LIQUIDE SA	1,059	175.100	185,430.90	
	KINGSPAN GROUP PLC	1,244	79.700	99,146.80	
	SAFRAN SA	1,099	160.780	176,697.22	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,722	179.000	308,238.00	
	FERRARI NV	714	331.200	236,476.80	

LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	322	746.800	240,469.60
KERRY GROUP PLC-A	1,873	74.340	139,238.82
L'OREAL	609	443.550	270,121.95
ING GROEP NV	6,878	13.624	93,705.87
ASML HOLDING NV	279	682.200	190,333.80
INFINEON TECHNOLOGIES AG	3,630	38.380	139,319.40
ユーロ小計	21,821		2,226,071.88 (348,335,728)
合計	173,041		3,031,101,503 (3,031,101,503)

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 60銘柄	77.4%	78.9%
オーストラリア・ドル	株式 1銘柄	0.6%	0.6%
香港・ドル	株式 3銘柄	2.2%	2.2%
イギリス・ポンド	株式 3銘柄	3.3%	3.3%
スイス・フラン	株式 4銘柄	3.3%	3.4%
ユーロ	株式 12銘柄	11.3%	11.5%

(b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券マザーファンド(A号)

(1)貸借対照表

(単位:円)

	(2022年12月15日現在)	(2023年12月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	27,251,526	65,793,963
金銭信託	762,066	601,953
コール・ローン	25,843,585	33,590,595
国債証券	5,477,167,007	5,993,571,431
地方債証券	34,494,992	36,743,444
特殊債券	66,943,570	74,100,322
社債券	319,416,292	371,392,659
派生商品評価勘定	842,169	2,358,814
未収入金	123,386,889	88,345,547
未収利息	20,649,773	29,210,198
前払費用	5,063,245	8,618,005
流動資産合計	6,101,821,114	6,704,326,931
資産合計	6,101,821,114	6,704,326,931
負債の部		
流動負債		

派生商品評価勘定	3,209,992	4,532,638
未払金	123,182,406	89,457,942
未払解約金	191,329	-
その他未払費用	230	34
流動負債合計	126,583,957	93,990,614
負債合計	126,583,957	93,990,614
純資産の部		
元本等		
元本	1,993,587,252	2,049,680,819
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,981,649,905	4,560,655,498
元本等合計	5,975,237,157	6,610,336,317
純資産合計	5,975,237,157	6,610,336,317
負債純資産合計	6,101,821,114	6,704,326,931

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年12月16日 至 2023年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2022年12月15日現在)	(2023年12月15日現在)
-----	-------------------	-------------------

1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,993,587,252口	2,049,680,819口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.9972円 (1万口当たりの純資産額29,972円)	1口当たり純資産額 3.2251円 (1万口当たりの純資産額32,251円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年12月16日 至 2023年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年12月15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年12月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	101,537,903	-	100,907,820	630,083
	カナダ・ドル	8,891,487	-	8,904,600	13,113
	オーストラリア・ド ル	7,906,895	-	8,026,620	119,725
	ニュージーランド・ ドル	12,174,725	-	12,301,460	126,735
	デンマーク・クロー ネ	26,898,690	-	27,104,000	205,310
	ノルウェー・クロー ネ	459,652	-	469,540	9,888
	メキシコ・ペソ	4,973,470	-	4,942,902	30,568
	オフショア・人民元	102,820,849	-	102,166,873	653,976
	ユーロ	48,970,791	-	49,076,720	105,929
	小計	314,634,462	-	313,900,535	733,927
	売建				
	アメリカ・ドル	49,225,165	-	48,981,780	243,385
	イギリス・ポンド	90,125,915	-	91,018,200	892,285
	イスラエル・シュケ ル	5,230,896	-	5,212,812	18,084
	スウェーデン・ク ローナ	1,569,108	-	1,591,200	22,092
	ユーロ	148,551,892	-	149,532,880	980,988
	小計	294,702,976	-	296,336,872	1,633,896
	合 計		609,337,438	-	610,237,407

(2023年12月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	91,382,950	-	91,728,281	345,331
	カナダ・ドル	12,400,340	-	12,478,875	78,535
	ニュージーランド・ ドル	12,381,758	-	12,368,682	13,076
	イギリス・ポンド	89,361,285	-	90,539,527	1,178,242
	デンマーク・クロー ネ	28,781,592	-	29,108,940	327,348

市場取引以 外の取引	ノルウェー・クロー ネ	13,887,189	-	14,248,768	361,579
	オフショア・人民元	236,744,045	-	236,104,662	639,383
	小計	484,939,159	-	486,577,735	1,638,576
	売建				
	アメリカ・ドル	88,827,416	-	89,202,492	375,076
	オーストラリア・ド ル	11,515,494	-	11,604,078	88,584
	イギリス・ポンド	247,011,797	-	249,139,290	2,127,493
	イスラエル・シユケ ル	10,956,465	-	10,914,844	41,621
	スウェーデン・ク ローナ	1,640,971	-	1,649,004	8,033
	メキシコ・ペソ	334,371	-	337,780	3,409
	ユーロ	113,018,722	-	114,270,148	1,251,426
	小計	473,305,236	-	477,117,636	3,812,400
	合 計	958,244,395	-	963,695,371	2,173,824

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年12月16日 至 2023年12月15日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていな いため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年12月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,959,828,448円
同期中における追加設定元本額	194,419,036円

同期中における一部解約元本額	160,660,232円
2022年12月15日現在の元本の内訳	
三井住友・ライフビュー・バランスファンド30(安定型)	172,992,850円
三井住友・ライフビュー・バランスファンド50(標準型)	266,935,279円
三井住友・ライフビュー・バランスファンド70(積極型)	134,510,540円
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	10,940,493円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	21,343,246円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	7,653,178円
三井住友・DC外国債券アクティブ	1,378,840,015円
S M A M・バランスファンドV A株40型(適格機関投資家専用)	200,149円
S M A M・バランスファンドV A株60型(適格機関投資家専用)	99,706円
S M A M・バランスファンドV A株80型(適格機関投資家専用)	71,796円
合計	1,993,587,252円

(2023年12月15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,993,587,252円
同期中における追加設定元本額	197,574,426円
同期中における一部解約元本額	141,480,859円
2023年12月15日現在の元本の内訳	
三井住友・ライフビュー・バランスファンド30(安定型)	172,709,455円
三井住友・ライフビュー・バランスファンド50(標準型)	275,700,174円
三井住友・ライフビュー・バランスファンド70(積極型)	147,500,443円
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	10,394,478円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	21,210,342円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	8,455,713円
三井住友・DC外国債券アクティブ	1,413,460,423円
S M A M・バランスファンドV A株40型(適格機関投資家専用)	202,036円
S M A M・バランスファンドV A株60型(適格機関投資家専用)	27,743円
S M A M・バランスファンドV A株80型(適格機関投資家専用)	20,012円
合計	2,049,680,819円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	T 0.5 05/31/27	1,680,000.00	1,490,764.80	
		T 0.625 05/15/30	540,000.00	439,959.60	
		T 1.125 05/15/40	2,780,000.00	1,779,200.00	
		T 1.375 10/31/28	1,530,000.00	1,357,630.20	
		T 1.375 11/15/31	4,110,000.00	3,405,093.90	
		T 1.625 02/15/26	2,280,000.00	2,155,124.40	

	T 1.625 05/15/26	60,000.00	56,479.20	
	T 2.25 02/15/27	760,000.00	719,742.80	
	T 2.25 08/15/46	900,000.00	640,350.00	
	T 2.75 02/15/28	3,740,000.00	3,565,416.80	
	T 2.75 05/31/29	790,000.00	744,322.20	
	T 2.875 05/15/43	490,000.00	402,182.20	
	T 3 11/15/45	1,330,000.00	1,094,882.60	
	T 3.5 01/31/30	620,000.00	605,275.00	
	T 3.75 08/15/41	200,000.00	189,760.00	
	T 4.125 08/15/53	580,000.00	588,468.00	
	アメリカ・ドル小計	22,390,000.00	19,234,651.70 (2,740,937,867)	
カナダ・ドル	CAN 1 06/01/27	640,000.00	592,044.80	
	CAN 2 12/01/51	220,000.00	178,928.20	
	カナダ・ドル小計	860,000.00	770,973.00 (81,908,172)	
オーストラリア・ドル	ACGB 1.75 06/21/51	90,000.00	51,120.00	
	ACGB 3 03/21/47	500,000.00	392,175.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	360,000.00	315,072.00	
	オーストラリア・ドル小計	950,000.00	758,367.00 (72,386,130)	
シンガポール・ドル	SIGB 2.875 07/01/29	300,000.00	302,160.00	
	シンガポール・ドル小計	300,000.00	302,160.00 (32,409,682)	
イギリス・ポンド	UK TSY GILT 1.125 01/31/39	1,060,000.00	703,119.20	
	UKT 1 04/22/24	150,000.00	147,826.50	
	UKT 1.75 09/07/37	290,000.00	219,872.20	
	UKT 3.25 01/31/33	990,000.00	949,984.20	
	UKT 3.5 10/22/25	1,100,000.00	1,084,061.00	
	UKT 4.5 12/07/42	130,000.00	134,418.70	
	イギリス・ポンド小計	3,720,000.00	3,239,281.80 (588,577,503)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 2.25 09/28/28	320,000.00	300,992.00	
	イスラエル・シュケル小計	320,000.00	300,992.00 (11,667,202)	
スウェーデン・クローナ	SGB 2.5 05/12/25	1,040,000.00	1,033,094.40	
	スウェーデン・クローナ小計	1,040,000.00	1,033,094.40 (14,349,681)	
	MBONO 5.75 03/05/26	4,500,000.00	4,148,370.00	

メキシコ・ペソ	MBONO 8.5 11/18/38	2,300,000.00	2,160,919.00	
メキシコ・ペソ小計		6,800,000.00	6,309,289.00 (52,295,804)	
オフショア・人民元	CGB 2.75 06/15/29	2,800,000.00	2,819,236.00	
	CGB 3.72 04/12/51	4,700,000.00	5,340,328.00	
オフショア・人民元小計		7,500,000.00	8,159,564.00 (163,118,660)	
マレーシア・リングgit	MGS 4.059 09/30/24	620,000.00	622,709.40	
マレーシア・リングgit小計		620,000.00	622,709.40 (18,985,351)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 2.25 10/25/24	710,000.00	693,613.20	
ポーランド・ズロチ小計		710,000.00	693,613.20 (25,097,908)	
ユーロ	BGB 4.25 03/28/41	290,000.00	336,008.50	
	BTPS 1.5 04/30/45	100,000.00	62,912.00	
	BTPS 2.8 12/01/28	500,000.00	492,915.00	
	BTPS 5 08/01/34	170,000.00	187,720.80	
	DBR 0 08/15/50	240,000.00	131,361.60	
	FRTR 0 05/25/32	2,440,000.00	1,977,424.80	
	FRTR 0 11/25/29	2,450,000.00	2,128,462.00	
	FRTR 0 11/25/31	720,000.00	592,164.00	
	FRTR 0.75 11/25/28	160,000.00	147,996.80	
	FRTR 2 11/25/32	1,180,000.00	1,127,466.40	
	FRTR 2.5 05/25/43	240,000.00	220,718.40	
	FRTR 3 05/25/54	160,000.00	155,408.00	
	FRTR 4 10/25/38	570,000.00	645,935.40	
	IRISH 0.9 05/15/28	310,000.00	291,902.20	
	SPGB 0.85 07/30/37	1,200,000.00	873,168.00	
	SPGB 1.4 04/30/28	310,000.00	293,951.30	
	SPGB 1.5 04/30/27	1,680,000.00	1,616,832.00	
	SPGB 1.6 04/30/25	1,210,000.00	1,186,864.80	
	SPGB 2.35 07/30/33	340,000.00	320,688.00	
	SPGB 3.45 07/30/43	1,090,000.00	1,066,815.70	
SPGB 4.7 07/30/41	130,000.00	150,425.60		
ユーロ小計		15,490,000.00	14,007,141.30 (2,191,837,471)	
国債証券合計			5,993,571,431 (5,993,571,431)	
地方債証券	カナダ・ドル	ONT 2.05 06/02/30	380,000.00	345,853.20

	カナダ・ドル小計		380,000.00	345,853.20 (36,743,444)	
地方債証券合計				36,743,444 (36,743,444)	
特殊債券	ユーロ	DBJJP 0.01 09/09/25	500,000.00	473,545.00	
	ユーロ小計		500,000.00	473,545.00 (74,100,322)	
特殊債券合計				74,100,322 (74,100,322)	
社債券	アメリカ・ドル	JPM FL 06/23/25	950,000.00	926,145.50	
		MUFG FL 09/12/25	1,220,000.00	1,215,473.80	
	アメリカ・ドル小計		2,170,000.00	2,141,619.30 (305,180,750)	
	オーストラリア・ドル	MIZUHO FL 08/28/29	680,000.00	693,681.60	
		オーストラリア・ドル小計		680,000.00	693,681.60 (66,211,909)
社債券合計				371,392,659 (371,392,659)	
合 計				6,475,807,856 (6,475,807,856)	

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

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	16銘柄	41.5%	42.3%
	社債券	2銘柄	4.6%	4.7%
カナダ・ドル	国債証券	2銘柄	1.2%	1.3%
	地方債証券	1銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリア・ドル	国債証券	3銘柄	1.1%	1.1%
	社債券	1銘柄	1.0%	1.0%
シンガポール・ドル	国債証券	1銘柄	0.5%	0.5%
イギリス・ポンド	国債証券	6銘柄	8.9%	9.1%
イスラエル・シェケル	国債証券	1銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	1銘柄	0.2%	0.2%
メキシコ・ペソ	国債証券	2銘柄	0.8%	0.8%
オフショア・人民元	国債証券	2銘柄	2.5%	2.5%
マレーシア・リングギット	国債証券	1銘柄	0.3%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券	1銘柄	0.4%	0.4%
ユーロ	国債証券	21銘柄	33.2%	33.8%
	特殊債券	1銘柄	1.1%	1.1%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・DCバランスファンド（安定型）

2023年12月29日現在

資産総額	259,840,165円
負債総額	190,795円
純資産総額（ - ）	259,649,370円
発行済口数	194,355,974口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.3359円 (13,359円)

三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）

2023年12月29日現在

資産総額	763,950,663円
負債総額	645,423円
純資産総額（ - ）	763,305,240円
発行済口数	446,203,798口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.7107円 (17,107円)

三井住友・DCバランスファンド（成長型）

2023年12月29日現在

資産総額	451,604,236円
負債総額	324,271円
純資産総額（ - ）	451,279,965円
発行済口数	217,967,085口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	2.0704円 (20,704円)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

- イ 名義書換
該当事項はありません。
- ロ 受益者名簿
作成しません。
- ハ 受益者に対する特典

ありません。

二 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

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

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ 受益権の再分割

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

ヘ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	2023年12月29日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

ハ 会社の機構

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

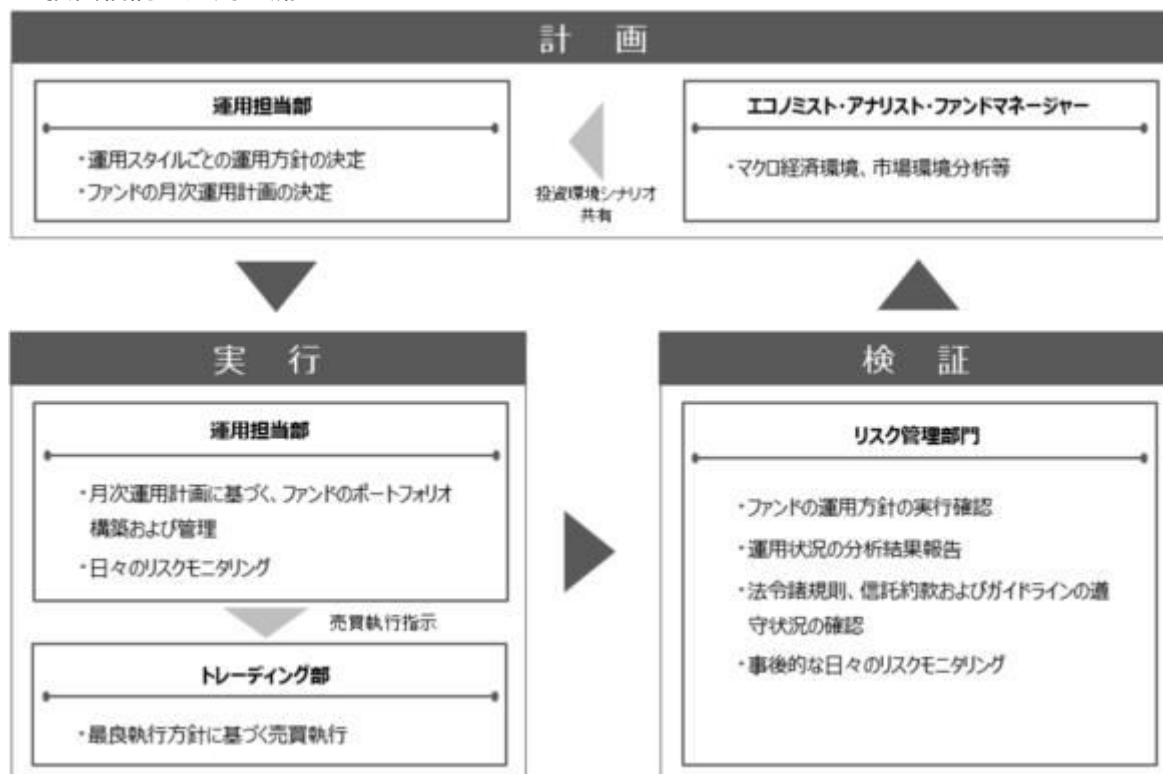
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

ニ 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託

の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2023年12月29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	691	11,388,930
単位型株式投資信託	98	672,908
追加型公社債投資信託	1	25,097
単位型公社債投資信託	159	257,300
合計	949	12,344,237

3【委託会社等の経理状況】

1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

なお、当中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2 当社は、第38期(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、第39期中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

	(単位:千円)	
	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	49,008,279	37,742,400
金銭の信託	-	12,645,575
顧客分別金信託	300,041	300,046
前払費用	475,266	546,900
未収入金	103,809	437,880
未収委託者報酬	12,125,117	11,563,662
未収運用受託報酬	2,437,063	2,138,030
未収投資助言報酬	388,639	344,586
未収収益	36,700	35,477
その他の流動資産	18,458	8,423

流動資産合計		64,893,375	65,762,982
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		1,433,442	1,361,305
器具備品		653,985	559,057
土地		710	710
リース資産		7,357	4,114
建設仮勘定		5,500	81,240
有形固定資産合計		2,100,996	2,006,427
無形固定資産			
ソフトウェア		2,766,476	2,414,295
ソフトウェア仮勘定		100,616	508,956
のれん		3,349,950	3,045,409
顧客関連資産		13,558,615	11,445,340
電話加入権		12,716	12,706
商標権		42	36
無形固定資産合計		19,788,417	17,426,744
投資その他の資産			
投資有価証券		14,212,354	9,222,276
関係会社株式		11,246,398	11,850,598
長期差入保証金		1,414,646	1,388,987
長期前払費用		77,936	80,207
会員権		90,479	90,479
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産合計		27,021,065	22,611,799
固定資産合計		48,910,479	42,044,971
資産合計		113,803,855	107,807,953

(単位：千円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,567	2,564
顧客からの預り金	6,045	11,094
その他の預り金	196,515	128,069
未払金		
未払収益分配金	1,969	2,013
未払償還金	152	1,312
未払手数料	5,545,582	5,194,011
その他未払金	48,893	259,542
未払費用	7,379,404	6,370,986
未払消費税等	1,133,332	406,770
未払法人税等	2,455,291	333,009
賞与引当金	2,100,323	1,801,492
資産除去債務	7,192	13,940
その他の流動負債	40,396	73,657
流動負債合計	18,918,667	14,598,465
固定負債		
リース債務	4,525	1,960
繰延税金負債	1,279,409	550,493
退職給付引当金	5,084,506	5,027,832
その他の固定負債	4,620	-
固定負債合計	6,373,062	5,580,287
負債合計	25,291,730	20,178,752

純資産の部

株主資本

資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	73,466,962	73,466,962
資本剰余金合計	82,095,946	82,095,946
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	3,834,794	3,391,568
利益剰余金合計	4,119,040	3,675,814
株主資本計	88,214,986	87,771,760
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	297,138	142,558
評価・換算差額等合計	297,138	142,558
純資産合計	88,512,124	87,629,201
負債・純資産合計	113,803,855	107,807,953

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	66,139,024	61,471,271
運用受託報酬	9,652,634	8,978,419
投資助言報酬	1,256,334	1,273,386
その他営業収益		
サービス支助手数料	199,046	208,222
その他	32,936	22,995
営業収益計	77,279,976	71,954,296
営業費用		
支払手数料	30,522,133	28,036,456
広告宣伝費	330,161	294,588
調査費		
調査費	3,196,921	3,749,357
委託調査費	12,192,048	11,455,987
営業雑経費		
通信費	67,600	61,068
印刷費	494,834	452,951
協会費	34,433	38,701
諸会費	30,488	33,447
情報機器関連費	4,767,504	5,067,617
販売促進費	31,930	29,621
その他	181,301	197,696
営業費用合計	51,849,358	49,417,495
一般管理費		
給料		
役員報酬	263,893	219,872
給料・手当	8,664,828	7,807,797
賞与	991,916	1,042,472
賞与引当金繰入額	2,100,323	1,798,492

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

(単位：千円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,834,794
当期変動額						
剰余金の配当						2,540,254
当期純利益						2,097,028
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	443,225
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,391,568

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 重要な資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

子会社株式
移動平均法による原価法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

(2) 金銭の信託

運用目的の金銭の信託：時価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 8～50年

器具備品 4～15年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん 14年

顧客関連資産 6～19年

ソフトウェア（自社利用分） 5年

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、当事業年度の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. 収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び収益を認識する通常の時点は以下のとおりであります。

(1)委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2)運用受託報酬

運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(3)投資助言報酬

投資助言報酬は、対象顧客との投資助言契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の助言期間にわたり収益として認識しております。

(会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。なお、時価算定会計基準適用指針27-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項」注記については記載していません。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 当座借越契約

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

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

3 保証債務

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

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

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

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

2 システム統合関連費用

社内システム統合に伴うものであり、主にデータの移行費用などです。

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す。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

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

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

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

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

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

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

また、資金調達は行っていません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

当社は、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、営業債権について取引先毎の期日管理及び残高管理を行うとともに、その状況について取締役会に報告しています。

金銭の信託、投資有価証券及び子会社株式は発行体の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

市場リスクの管理

金銭の信託及び投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、経営企画部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。

なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

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

(注1)市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

(単位：千円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
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			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
(1)金銭の信託	-	12,645,575	-	12,645,575
(2)投資有価証券 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

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

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度237,296千円、当事業年度241,556千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,556,876	1,539,522
賞与引当金	643,119	551,617
調査費	279,809	473,972
未払金	284,070	211,439
未払事業税	139,522	39,995
ソフトウェア償却	107,998	105,506
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	93,946	120,350
その他	28,056	21,158
繰延税金資産小計	3,248,274	3,178,439
評価性引当額	189,102	193,662
繰延税金資産合計	3,059,171	2,984,776
繰延税金負債		
無形固定資産	4,151,648	3,504,563
資産除去債務	825	3,201
その他有価証券評価差額金	186,107	27,506
繰延税金負債合計	4,338,581	3,535,270
繰延税金資産（負債）の純額	1,279,409	550,493

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.6	3.0
のれん償却費	1.4	2.9
所得税額控除による税額控除	-	1.3

その他	0.3	1.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.1	34.0

(収益認識関係)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「セグメント情報等」注記に記載のとおりであります。

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1.セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	66,139,024	9,652,634	1,256,334	231,982	77,279,976

(2)地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2022年4月1日 至2023年3月31日)

1.セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	61,471,271	8,978,419	1,273,386	231,218	71,954,296

(2)地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の 子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	-	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	4,727,024	未払 手数料	1,098,966
親会社の 子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	-	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	8,397,864	未払 手数料	1,661,614

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、次のとおりであります。

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

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第39期中間会計期間 (2023年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	71,777,366
金銭の信託	12,836,073
顧客分別金信託	300,049
前払費用	544,624
未収委託者報酬	13,133,566
未収運用受託報酬	2,879,922
未収投資助言報酬	463,644
未収収益	67,881
その他	193,812
流動資産合計	102,196,941
固定資産	
有形固定資産	1 1,897,269
無形固定資産	
のれん	2,893,139
顧客関連資産	10,388,702
その他	2,893,330
無形固定資産合計	16,175,172
投資その他の資産	
投資有価証券	9,623,355
関係会社株式	1,927,221
繰延税金資産	128,142
その他	1,543,634
貸倒引当金	20,750
投資その他の資産合計	13,201,604
固定資産合計	31,274,046
資産合計	133,470,988
負債の部	
流動負債	
リース債務	2,070
顧客からの預り金	11,882
その他の預り金	161,963
未払金	6,019,407
未払費用	6,744,050
未払法人税等	3,908,872
前受収益	21,118

賞与引当金		2,110,575
資産除去債務		13,940
その他	2	623,468
流動負債合計		19,617,350
固定負債		
リース債務		1,172
退職給付引当金		5,235,679
固定負債合計		5,236,852
負債合計		24,854,202
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
その他資本剰余金		73,466,962
資本剰余金合計		82,095,946
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		24,226,602
利益剰余金合計		24,510,847
株主資本合計		108,606,793
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		9,992
評価・換算差額等合計		9,992
純資産合計		108,616,786
負債純資産合計		133,470,988

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

		第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		33,390,366
運用受託報酬		4,611,539
投資助言報酬		646,058
その他の営業収益		137,072
営業収益計		38,785,036
営業費用		26,393,207
一般管理費	1	10,162,729
営業利益		2,229,099
営業外収益	2	11,280,120
営業外費用	3	51,894
経常利益		13,457,325
特別利益	4	14,096,622
特別損失	5	358
税引前中間純利益		27,553,589
法人税、住民税及び事業税		5,843,255
法人税等調整額		716,591
法人税等合計		5,126,663

中間純利益

22,426,926

(3)中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金 繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,391,568
当中間期変動額						
剰余金の配当						1,591,892
中間純利益						22,426,926
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）						
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	20,835,033
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	24,226,602

	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	3,675,814	87,771,760	142,558	142,558	87,629,201
当中間期変動額					
剰余金の配当	1,591,892	1,591,892			1,591,892
中間純利益	22,426,926	22,426,926			22,426,926
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）			152,551	152,551	152,551
当中間期変動額合計	20,835,033	20,835,033	152,551	152,551	20,987,584
当中間期末残高	24,510,847	108,606,793	9,992	9,992	108,616,786

注記事項

(重要な会計方針)

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

(2)金銭の信託

運用目的の金銭の信託

時価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産（リース資産を除く）

定率法によっております。但し、建物（建物附属設備を除く）並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	8～50年
器具備品	4～15年

(2)無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア（自社利用分）	5年

(3)リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. 収益及び費用の計上基準

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。

(中間貸借対照表関係)

第39期中間会計期間 (2023年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,963,152千円
2.消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。	

3. 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。

当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円

（中間損益計算書関係）

第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）	
1. 一般管理費のうち主要なもの	
のれん償却費	152,270千円
減価償却実施額	
有形固定資産	155,138千円
無形固定資産	1,475,775千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	11,020,394千円
投資有価証券売却益	2,513千円
金銭の信託運用益	190,497千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	1,978千円
投資有価証券償還損	883千円
投資有価証券売却損	48,575千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
子会社株式売却益	14,096,622千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	358千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. 発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

2. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
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）

第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）	
1. オペレーティング・リース取引 （借主側）	
未経過リース料（解約不能のもの）	
1年以内	1,161,545千円
1年超	580,772千円
合計	1,742,317千円

（金融商品関係）

1. 金融商品の時価等に関する事項

第39期中間会計期間（2023年9月30日）

2023年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません（（注1）参照）。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価格に近似することから、注記を省略しております。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	12,836,073	12,836,073	-
(2)投資有価証券 その他有価証券	9,582,998	9,582,998	-
資産計	22,419,071	22,419,071	-

(注1) 市場価格のない金融商品

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	40,356
合計	40,356
子会社株式 非上場株式	1,927,221
合計	1,927,221

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

区分	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
(1)金銭の信託	-	12,836,073	-	12,836,073
(2)投資有価証券 その他有価証券	-	9,582,998	-	9,582,998
資産計	-	22,419,071	-	22,419,071

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

(1) 金銭の信託

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

(2) 投資有価証券 その他有価証券

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

(有価証券関係)

第39期中間会計期間（2023年9月30日）

1. 子会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 1,927,221千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	3,341,749	3,156,408	185,340
小計	3,341,749	3,156,408	185,340

(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの 投資信託等	6,241,249	6,403,283	162,034
小計	6,241,249	6,403,283	162,034
合計	9,582,998	9,559,692	23,306

(注)非上場株式等（中間貸借対照表計上額 40,356千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(収益認識関係)

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「セグメント情報等」注記に記載のとおりであります。

(セグメント情報等)

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	33,390,366	4,611,539	646,058	137,072	38,785,036

(2)地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,206円86銭
1株当たり中間純利益	662円14銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
 - (イ) 定款の変更
該当ありません。
 - (ロ) その他の重要事項
該当ありません。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円（2023年3月末現在）
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 株式会社日本カストディ銀行
- ・ 資本金の額 51,000百万円（2023年3月末現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 2023年3月末現在	事業の内容
日本生命保険相互会社	1,450,000	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

日本生命保険相互会社の資本金の額の箇所には、基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

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

3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）

該当ありません。

第3【その他】

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

- (1) 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。
- (2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。
- (3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス（これらのアドレスをコード化した図形等も含む）を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
- (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨を記載することがあります。
- (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
- (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
- (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
- (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。

2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。

4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。

5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。

6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあり

ます。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)および投資信託説明書(請求目論見書)を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2023年6月15日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

佐藤 栄裕

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年2月28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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCバランスファンド（安定型）の2022年12月16日から2023年12月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DCバランスファンド（安定型）の2023年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の事項

ファンドの2022年12月15日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2023年2月28日付けで無限定適正意見を表明している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2024年2月28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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)の2022年12月16日から2023年12月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)の2023年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の事項

ファンドの2022年12月15日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2023年2月28日付けで無限定適正意見を表明している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書(訂正有価証券届出書を含む。)に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2024年2月28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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCバランスファンド(成長型)の2022年12月16日から2023年12月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DCバランスファンド(成長型)の2023年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の事項

ファンドの2022年12月15日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2023年2月28日付けで無限定適正意見を表明している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書(訂正有価証券届出書を含む。)に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

利害関係

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

以 上

- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
2. XBRL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11月17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

佐藤 栄 裕

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

深井 康 治

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。