

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年6月6日提出
【計算期間】	第7期中(自 2023年9月12日至 2024年3月11日)
【ファンド名】	三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド
【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】	竹本 政司
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【電話番号】	03-6205-0265
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【ファンドの運用状況】

(1)【投資状況】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

2024年3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	2,727,219,009	99.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	26,769,697	0.97
合計（純資産総額）		2,753,988,706	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。

(2)【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2018年 9月10日)	115,063,603	115,063,603	10,051	10,051
第2期 (2019年 9月10日)	295,583,344	295,583,344	10,442	10,442
第3期 (2020年 9月10日)	544,780,618	544,780,618	10,720	10,720
第4期 (2021年 9月10日)	1,014,406,357	1,014,406,357	12,869	12,869
第5期 (2022年 9月12日)	1,634,445,391	1,634,445,391	13,461	13,461
第6期 (2023年 9月11日)	2,217,351,256	2,217,351,256	14,055	14,055
2023年 3月末日	1,853,892,088	-	12,865	-
4月末日	1,918,543,803	-	13,052	-
5月末日	1,991,216,893	-	13,365	-
6月末日	2,123,916,000	-	13,995	-
7月末日	2,173,661,530	-	14,027	-
8月末日	2,231,517,621	-	14,151	-
9月末日	2,222,981,199	-	13,856	-
10月末日	2,205,503,198	-	13,518	-
11月末日	2,354,113,724	-	14,231	-
12月末日	2,428,774,076	-	14,469	-
2024年 1月末日	2,529,865,391	-	14,753	-
2月末日	2,640,244,817	-	15,094	-
3月末日	2,753,988,706	-	15,494	-

【分配の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2017年10月 3日～2018年 9月10日	0
第2期	2018年 9月11日～2019年 9月10日	0
第3期	2019年 9月11日～2020年 9月10日	0
第4期	2020年 9月11日～2021年 9月10日	0
第5期	2021年 9月11日～2022年 9月12日	0
第6期	2022年 9月13日～2023年 9月11日	0

【収益率の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	収益率（％）
第1期	0.5
第2期	3.9
第3期	2.7
第4期	20.0
第5期	4.6
第6期	4.4
第7期（中間期）	7.0

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

（参考）

（1）投資状況

国内債券パッシブ・マザーファンド

2024年3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	106,939,153,810	79.87
地方債証券	日本	8,623,151,300	6.44
特殊債券	日本	10,456,381,743	7.81
社債券	日本	7,072,401,600	5.28
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	796,159,138	0.60
合計（純資産総額）		133,887,247,591	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年3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	9,879,918,226	46.11
	中国	1,841,243,533	8.59
	フランス	1,664,687,843	7.77
	イタリア	1,515,163,317	7.07
	ドイツ	1,308,112,949	6.10

	イギリス	1,086,614,533	5.07
	スペイン	1,017,586,331	4.75
	カナダ	430,693,338	2.01
	ベルギー	371,134,546	1.73
	オランダ	310,575,461	1.45
	オーストラリア	283,348,498	1.32
	オーストリア	254,583,357	1.19
	シンガポール	193,124,968	0.90
	メキシコ	183,686,755	0.86
	ポーランド	116,335,104	0.54
	フィンランド	112,781,046	0.53
	アイルランド	108,950,016	0.51
	イスラエル	69,395,949	0.32
	デンマーク	56,805,427	0.27
	ニュージーランド	51,725,456	0.24
	スウェーデン	41,530,678	0.19
	ノルウェー	33,084,267	0.15
	小計	20,931,081,598	97.68
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	496,885,518	2.32
合計（純資産総額）		21,427,967,116	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	-	58,490,824	0.27
為替予約取引	売建	-	21,401,052,319	99.87

外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年3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	85,506,812,923	46.40
	中国	15,641,592,315	8.49
	フランス	14,420,025,692	7.83
	イタリア	13,128,229,217	7.12
	ドイツ	11,400,735,469	6.19
	イギリス	9,413,216,674	5.11
	スペイン	8,813,232,512	4.78
	カナダ	3,727,013,883	2.02
	ベルギー	3,176,721,980	1.72
	オランダ	2,681,541,194	1.46
	オーストラリア	2,478,977,991	1.35
	オーストリア	2,173,555,846	1.18
	メキシコ	1,573,974,105	0.85
	ポーランド	1,013,465,796	0.55
	フィンランド	934,522,228	0.51

	アイルランド	926,771,266	0.50
	マレーシア	896,581,094	0.49
	シンガポール	749,079,265	0.41
	イスラエル	567,753,729	0.31
	デンマーク	484,535,641	0.26
	ニュージーランド	450,094,790	0.24
	スウェーデン	347,957,230	0.19
	ノルウェー	304,497,693	0.17
	小計	180,810,888,533	98.12
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,455,587,425	1.88
合計（純資産総額）		184,266,475,958	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	-	1,403,909,572	0.76
為替予約取引	売建	-	642,531,764	0.35

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2024年3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	330,757,661,580	98.20
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	6,066,860,513	1.80
合計（純資産総額）		336,824,522,093	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	5,983,200,000	1.78
合計	買建	-	5,983,200,000	1.78

外国株式インデックス・マザーファンド

2024年3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	525,923,331,426	69.82
	イギリス	27,172,496,844	3.61
	カナダ	24,511,641,063	3.25
	フランス	22,434,090,965	2.98
	スイス	21,822,026,182	2.90
	ドイツ	17,672,181,781	2.35
	オランダ	15,086,616,164	2.00
	アイルランド	13,755,271,821	1.83
	オーストラリア	13,065,731,279	1.73
	デンマーク	7,420,735,936	0.99
	スウェーデン	6,291,810,222	0.84
	スペイン	5,266,826,254	0.70

	イタリア	4,089,751,686	0.54
	香港	2,774,164,276	0.37
	ジャージー	2,238,786,729	0.30
	シンガポール	2,138,213,858	0.28
	フィンランド	1,974,327,678	0.26
	ベルギー	1,540,836,392	0.20
	イスラエル	1,520,162,524	0.20
	ノルウェー	1,207,895,072	0.16
	オランダ領キュ ラソー	947,231,287	0.13
	バミューダ	932,944,274	0.12
	ケイマン諸島	880,986,638	0.12
	ニュージーラン ド	524,103,020	0.07
	リベリア	404,827,693	0.05
	ルクセンブルグ	396,149,761	0.05
	オーストリア	368,752,137	0.05
	ポルトガル	301,792,091	0.04
	パナマ	209,835,651	0.03
	マン島	64,282,023	0.01
	小計	722,937,802,727	95.97
投資証券	アメリカ	12,191,475,200	1.62
	オーストラリア	1,379,004,580	0.18
	フランス	282,921,903	0.04
	シンガポール	240,974,803	0.03
	イギリス	229,589,520	0.03
	香港	123,259,815	0.02
	ベルギー	60,587,247	0.01
	カナダ	57,834,680	0.01
	ケイマン諸島	48,734,479	0.01
	小計	14,614,382,227	1.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	15,749,227,327	2.09
合計(純資産総額)		753,301,412,281	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	イギリス	641,535,451	0.09
株価指数先物取引	買建	ドイツ	2,264,750,950	0.30
株価指数先物取引	買建	アメリカ	12,418,091,768	1.65
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	470,428,866	0.06
合計	買建	-	15,794,807,035	2.10

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	2,781,814,425	0.37

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2024年3月29日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	インド	7,364,172,117	16.58
	台湾	7,032,356,941	15.83
	ケイマン諸島	5,778,249,037	13.01
	韓国	5,271,400,904	11.87
	中国	2,467,321,826	5.56
	ブラジル	2,055,871,316	4.63
	南アフリカ	1,055,313,406	2.38
	メキシコ	815,679,650	1.84
	インドネシア	769,336,136	1.73
	タイ	620,421,985	1.40
	マレーシア	557,534,387	1.26
	ポーランド	375,363,760	0.85
	香港	326,407,187	0.73
	トルコ	283,563,753	0.64
	フィリピン	261,129,029	0.59
	ギリシャ	213,295,911	0.48
	チリ	195,763,091	0.44
	バミューダ	167,082,904	0.38
	アメリカ	147,137,771	0.33
	ハンガリー	100,332,856	0.23
	チェコ	56,899,106	0.13
	イギリス	51,564,511	0.12
	コロンビア	48,237,215	0.11
	ルクセンブルグ	40,585,509	0.09
	エジプト	29,922,534	0.07
	オランダ	27,654,071	0.06
ペルー	18,020,909	0.04	
シンガポール	7,113,832	0.02	
小計		36,137,731,654	81.37
投資信託受益証券	香港	1,747,259,884	3.93
投資証券	アメリカ	2,957,667,730	6.66
	メキシコ	298,039,617	0.67
	ブラジル	97,925,459	0.22
	小計	3,353,632,806	7.55
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,173,581,272	7.15
合計（純資産総額）		44,412,205,616	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,224,230,527	7.26
合計	買建	-	3,224,230,527	7.26

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	-	96,254,061	0.22
為替予約取引	売建	-	482,441	0.00

Jリート・インデックス・マザーファンド

2024年3月29日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	15,030,815,000	98.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	203,163,680	1.33
合計(純資産総額)		15,233,978,680	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
リート指数先物取引	買建	日本	35,720,000	0.23
合計	買建	-	35,720,000	0.23

外国リート・インデックス・マザーファンド

2024年3月29日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	27,096,845,175	75.59
	オーストラリア	2,684,770,433	7.49
	イギリス	1,693,064,822	4.72
	シンガポール	1,109,211,842	3.09
	フランス	622,952,666	1.74
	カナダ	520,326,966	1.45
	ベルギー	368,937,295	1.03
	香港	332,363,605	0.93
	スペイン	142,015,660	0.40
	ニュージーランド	103,234,826	0.29
	ガーンジー	75,439,245	0.21
	韓国	60,112,010	0.17
	オランダ	59,778,581	0.17
	イスラエル	38,881,874	0.11
	ドイツ	13,502,866	0.04
	アイルランド	10,523,371	0.03
イタリア	1,954,880	0.01	
小計		34,933,916,117	97.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	915,540,027	2.55
合計(純資産総額)		35,849,456,144	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	-	76,243,768	0.21

2【設定及び解約の実績】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	134,068,987	19,587,428
第2期	198,345,231	29,755,343
第3期	284,669,114	59,535,952
第4期	357,578,274	77,546,767
第5期	503,710,231	77,728,393
第6期	492,057,391	128,687,266
第7期(中間期)	272,113,185	95,647,894

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期中間計算期間(2023年9月12日から2024年3月11日まで)の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により中間監査を受けております。

【三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 (2023年 9月11日現在)	第7期中間計算期間 (2024年 3月11日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	636,228	748,247
コール・ローン	26,933,570	30,214,956
親投資信託受益証券	2,194,933,022	2,610,381,143
未収入金	3,200,000	2,050,000
流動資産合計	2,225,702,820	2,643,394,346
資産合計	2,225,702,820	2,643,394,346
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,928,762	3,462,203
未払受託者報酬	224,291	261,890
未払委託者報酬	2,131,087	2,488,365
その他未払費用	67,424	78,583
流動負債合計	8,351,564	6,291,041
負債合計	8,351,564	6,291,041
純資産の部		
元本等		
元本	1,577,588,079	1,754,053,370
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	639,763,177	883,049,935
(分配準備積立金)	292,408,266	276,180,215
元本等合計	2,217,351,256	2,637,103,305
純資産合計	2,217,351,256	2,637,103,305
負債純資産合計	2,225,702,820	2,643,394,346

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期中間計算期間 自 2022年 9月13日 至 2023年 3月12日	第7期中間計算期間 自 2023年 9月12日 至 2024年 3月11日
営業収益		
受取利息	77	91
有価証券売買等損益	74,992,426	169,076,121
営業収益合計	74,992,349	169,076,212
営業費用		
支払利息	4,747	3,363
受託者報酬	184,532	261,890
委託者報酬	1,753,473	2,488,365
その他費用	55,652	78,808
営業費用合計	1,998,404	2,832,426
営業利益又は営業損失（ ）	76,990,753	166,243,786
経常利益又は経常損失（ ）	76,990,753	166,243,786
中間純利益又は中間純損失（ ）	76,990,753	166,243,786
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,925,253	3,484,966
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	420,227,437	639,763,177
剰余金増加額又は欠損金減少額	73,151,554	119,408,021
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	73,151,554	119,408,021
剰余金減少額又は欠損金増加額	18,705,953	38,880,083
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	18,705,953	38,880,083
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	400,607,538	883,049,935

（ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針の注記）

項 目	第7期中間計算期間 自 2023年9月12日 至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	<p>中間計算期間の取扱い</p> <p>当中間計算期間は前期末が休日のため、2023年9月12日から2024年3月11日までとなっております。</p>

（中間貸借対照表に関する注記）

項 目	第6期 (2023年9月11日現在)	第7期中間計算期間 (2024年3月11日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,577,588,079口	1,754,053,370口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4055円 (1万口当たりの純資産額14,055円)	1口当たり純資産額 1.5034円 (1万口当たりの純資産額15,034円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項 目	第7期中間計算期間 (2024年3月11日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第6期 (2023年9月11日現在)	第7期中間計算期間 (2024年3月11日現在)
期首元本額	1,214,217,954円	1,577,588,079円
期中追加設定元本額	492,057,391円	272,113,185円
期中一部解約元本額	128,687,266円	95,647,894円

(参考)

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドは、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマーゼンク株式インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」および「外国リート・インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	10,210,097	10,401,110
コール・ローン	432,225,963	420,006,870
国債証券	101,717,238,760	105,777,217,850
地方債証券	9,945,071,700	8,605,753,000
特殊債券	9,472,283,708	10,440,722,518
社債券	6,161,963,800	7,063,512,400
未収利息	345,064,327	367,408,891
前払費用	22,954,890	19,966,870
流動資産合計	128,107,013,245	132,704,989,509
資産合計	128,107,013,245	132,704,989,509
負債の部		
流動負債		
未払金	94,901,000	37,545,200

未払解約金	160,000	19,057,843
その他未払費用	5,714	1,265
流動負債合計	95,066,714	56,604,308
負債合計	95,066,714	56,604,308
純資産の部		
元本等		
元本	105,595,755,237	109,604,685,583
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	22,416,191,294	23,043,699,618
元本等合計	128,011,946,531	132,648,385,201
純資産合計	128,011,946,531	132,648,385,201
負債純資産合計	128,107,013,245	132,704,989,509

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年9月12日 至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	105,595,755,237口	109,604,685,583口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2123円 (1万口当たりの純資産額12,123円)	1口当たり純資産額 1.2102円 (1万口当たりの純資産額12,102円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2024年3月11日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2023年9月11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	105,070,373,916円
同期中における追加設定元本額	29,627,474,001円
同期中における一部解約元本額	29,102,092,680円
2023年9月11日現在の元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	8,895,871,906円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	14,276,531,560円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,639,693,680円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	871,073,171円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	41,964,940円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	189,022,302円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	597,899,046円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	1,152,268,985円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	635,710,120円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	765,396,816円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	145,241,149円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	943,791,009円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	331,990,644円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,054,188円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	86,411,203円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	4,478,509,550円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,439,958,484円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,358,439,215円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	554,742,232円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	53,974,627円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	269,611,226円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	370,316,428円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	769,947,923円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	239,821,733円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	11,065,309円

三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2035	395,316円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2040	340,706円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2045	234,563円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2055	113,477円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2065	115,120円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	2,360,942円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	12,350,202円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	31,875,293円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	7,622,799円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	992,596円
S M A M ・ 年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,091,741,014円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	9,468,188,150円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	5,717,595,087円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	14,505,099,336円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	299,776,143円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	486,840,988円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	264,798,022円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	116,608,704円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	1,721,293,475円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,097,868,199円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	2,141,404,899円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	7,504,519,879円
S M A M ・ バランスV A 株40T<適格機関投資家限定>	1,001,996円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	997,923,867円
S M A M ・ グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	378,194,192円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	466,557,662円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	171,339,049円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	47,446,788円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	1,194,682,155円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	1,995,130,514円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 <適格機関投資家専用>	588,317,252円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用>	208,632,864円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	21,745,950円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 <適格機関投資家専用>	253,927,864円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用>	4,607,178,796円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,270,648,412円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	801,786,380円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,280,562,535円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	2,417,659,545円
S M D A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	288,577,060円
合 計	105,595,755,237円

(2024年3月11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

105,595,755,237円

同期中における追加設定元本額	13,252,670,977円
同期中における一部解約元本額	9,243,740,631円
2024年3月11日現在の元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	9,727,006,230円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	15,714,274,054円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	4,104,212,009円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	939,814,174円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	43,075,854円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	194,476,250円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	634,840,626円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	1,273,682,843円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	712,443,679円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	874,776,765円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	139,450,265円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	829,342,057円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	244,972,210円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,534,979円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	112,071,391円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	5,054,838,592円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,735,898,110円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,896,848,288円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	703,806,893円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	77,062,937円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	322,789,396円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	416,100,551円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	929,601,558円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	305,698,871円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	11,558,117円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	78,267,370円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	35,174,743円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	28,265,511円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	3,491,264円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	2,083,478円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	7,860,420円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	47,096,646円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	134,264,899円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	45,311,303円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	5,268,596円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,035,185,575円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	8,541,341,773円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	5,883,555,619円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	15,391,388,506円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	306,375,000円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	497,670,273円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	274,074,334円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	118,270,332円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,732,178,254円

SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,201,314,761円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,138,773,236円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,464,236,456円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	934,803,029円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	370,979,799円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	448,136,826円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	180,473,962円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	51,549,601円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,121,752,777円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,953,339,453円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	569,691,182円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	220,775,391円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	25,746,829円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	247,758,985円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,568,171,763円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,212,786,710円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	772,470,672円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,232,425,839円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	902,525,395円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	807,672,322円
合計	109,604,685,583円

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	37,148,722	29,507,227
金銭信託	3,665,467	1,895,469
コール・ローン	155,170,920	76,540,853
国債証券	18,922,834,265	20,671,868,139
派生商品評価勘定	33,548,149	265,616,585
未収利息	112,115,149	143,344,134
前払費用	18,930,362	20,194,642
流動資産合計	19,283,413,034	21,208,967,049
資産合計	19,283,413,034	21,208,967,049
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	97,323,664	-
未払解約金	3,864,250	10,935,000
その他未払費用	1,478	563
流動負債合計	101,189,392	10,935,563
負債合計	101,189,392	10,935,563

純資産の部		
元本等		
元本	15,785,182,828	17,234,543,869
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,397,040,814	3,963,487,617
元本等合計	19,182,223,642	21,198,031,486
純資産合計	19,182,223,642	21,198,031,486
負債純資産合計	19,283,413,034	21,208,967,049

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月12日 至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	15,785,182,828口	17,234,543,869口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2152円 (1万口当たりの純資産額12,152円)	1口当たり純資産額 1.2300円 (1万口当たりの純資産額12,300円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年3月11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) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2023年9月11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	9,145,118,008	-	9,240,925,927	95,807,919
	カナダ・ドル	382,479,901	-	383,646,480	1,166,579
	オーストラリア・ドル	282,744,725	-	282,073,120	671,605
	シンガポール・ドル	185,858,965	-	185,911,509	52,544
	ニュージーランド・ドル	43,144,661	-	43,235,150	90,489
	イギリス・ポンド	955,003,538	-	950,939,600	4,063,938
	イスラエル・シケル	57,719,381	-	57,428,622	290,759
	デンマーク・クローネ	61,506,134	-	61,302,933	203,201
	ノルウェー・クローネ	30,947,347	-	31,153,480	206,133
	スウェーデン・クローナ	36,574,925	-	36,457,668	117,257
	メキシコ・ペソ	195,309,807	-	189,380,025	5,929,782
	オフショア・人民元	1,260,443,264	-	1,259,056,848	1,386,416
	ポーランド・ズロチ	96,537,316	-	93,305,575	3,231,741
	ユーロ	6,332,967,693	-	6,315,314,243	17,653,450
	小計	19,066,355,665	-	19,130,131,180	63,775,515
合計	19,066,355,665	-	19,130,131,180	63,775,515	

(2024年3月11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	9,755,472,372	-	9,580,704,650	174,767,722
	カナダ・ドル	419,677,271	-	414,693,088	4,984,183
	オーストラリア・ドル	283,466,504	-	283,146,852	319,652
	シンガポール・ドル	191,893,573	-	190,400,513	1,493,060
	ニュージーランド・ドル	51,723,664	-	51,516,258	207,406
	イギリス・ポンド	1,077,912,737	-	1,076,038,964	1,873,773
	イスラエル・シケル	71,791,814	-	70,247,380	1,544,434
	デンマーク・クローネ	55,874,888	-	55,459,164	415,724
	ノルウェー・クローネ	37,970,997	-	37,890,450	80,547
	スウェーデン・クローナ	44,535,764	-	44,345,517	190,247
	メキシコ・ペソ	188,511,174	-	188,310,369	200,805
	オフショア・人民元	1,837,340,954	-	1,806,158,805	31,182,149
	ポーランド・ズロチ	115,356,843	-	114,892,071	464,772
	ユーロ	6,687,541,519	-	6,639,649,408	47,892,111
	小計	20,819,070,074	-	20,553,453,489	265,616,585
合計	20,819,070,074	-	20,553,453,489	265,616,585	

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

（2023年9月11日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	20,045,986,946円
同期中における追加設定元本額	10,298,549,113円
同期中における一部解約元本額	14,559,353,231円
2023年9月11日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,757,814,559円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	592,185,183円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	11,933,989円
イオン・バランス戦略ファンド	864,182,580円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	1,350,410,842円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	586,893,997円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	1,173,539,486円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	332,985,607円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	52,630,230円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	85,609,309円
日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）	613,150,901円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	2,955,830円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	15,393,411円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）	39,736,679円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	9,542,434円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）	1,224,416円
S M A M・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,089,575,826円
S M A M・バランスV A株40T＜適格機関投資家限定＞	1,006,607円
S M A M・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞	5,526,794,175円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	608,135,876円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04＜適格機関投資家限定＞	382,886,890円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	612,248,747円
S M D A M・年金Wリスクコントロールファンド（リスク3%）＜適格機関投資家限定＞	74,345,254円
合 計	15,785,182,828円

（2024年3月11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	15,785,182,828円
同期中における追加設定元本額	6,776,886,413円
同期中における一部解約元本額	5,327,525,372円
2024年3月11日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,770,803,232円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	599,388,293円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	9,479,909円
イオン・バランス戦略ファンド	726,353,698円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,522,547,593円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	707,294,808円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,437,311,160円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	418,450,282円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	72,324,019円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	103,090,298円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	381,453,256円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	7,293,919円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	46,954,415円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	133,785,249円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	45,152,872円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	4,638,930円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,026,175,405円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	5,982,912,916円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	682,283,481円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	444,023,155円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	709,048,602円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	403,778,377円
合計	17,234,543,869円

外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	217,197,619	215,214,954
金銭信託	21,927,226	30,410,504
コール・ローン	928,249,419	1,228,005,514
国債証券	165,129,161,640	177,278,336,372
未収利息	1,038,102,290	1,278,459,728
前払費用	88,967,311	117,289,549
流動資産合計	167,423,605,505	180,147,716,621
資産合計		
	167,423,605,505	180,147,716,621
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,794,196	54,539,324
その他未払費用	7,990	3,643
流動負債合計	12,802,186	54,542,967
負債合計		
	12,802,186	54,542,967
純資産の部		
元本等		
元本	79,394,261,585	81,180,123,823
剰余金		
剰余金又は欠損金()	88,016,541,734	98,913,049,831

元本等合計	167,410,803,319	180,093,173,654
純資産合計	167,410,803,319	180,093,173,654
負債純資産合計	167,423,605,505	180,147,716,621

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月12日 至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	79,394,261,585口	81,180,123,823口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.1086円 (1万口当たりの純資産額21,086円)	1口当たり純資産額 2.2184円 (1万口当たりの純資産額22,184円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年3月11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) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2023年9月11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	76,795,410,154円
同期中における追加設定元本額	13,399,654,234円
同期中における一部解約元本額	10,800,802,803円
2023年9月11日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	26,603,451,045円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	930,561,373円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,323,254,511円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,415,352,860円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	164,009,819円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	5,977,634円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	25,661,980円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	96,927,254円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	286,725,074円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	210,028,401円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	340,690,759円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	22,249,143円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	166,128,425円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	180,392,210円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	100,600,584円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	34,074,328円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	339,520,384円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	217,974,152円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	605,311,705円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	191,603,396円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	93,190,694円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	208,489,850円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	894,110,043円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	38,751,866円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	126,408,326円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	90,751,827円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	4,358,624円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	1,219,374,866円

三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド	234,491,533円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 3 5	26,867円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 4 0	31,324円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 4 5	39,141円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 5 5	47,947円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 6 5	47,947円
三井住友D S ・F W専用ポートフォリオ・レベル1 (保守型)	475,572円
三井住友D S ・F W専用ポートフォリオ・レベル2 (安定型)	4,199,196円
三井住友D S ・F W専用ポートフォリオ・レベル3 (安定成長型)	17,467,272円
三井住友D S ・F W専用ポートフォリオ・レベル4 (成長型)	7,928,172円
三井住友D S ・F W専用ポートフォリオ・レベル5 (積極成長型)	4,481,444円
S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	4,735,092,348円
S M A M ・バランスファンドV A 安定成長型<適格機関投資家限定>	24,742,199円
S M A M ・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	4,765,081,202円
S M A M ・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	3,776,414,227円
S M A M ・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	8,946,687,136円
S M A M ・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	29,825,111円
S M A M ・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	70,919,769円
S M A M ・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	650,211,181円
S M A M ・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	105,409,785円
S M A M ・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	891,341,019円
S M A M ・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	1,260,343,854円
S M A M ・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	1,251,043,047円
S M A M ・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	3,841,934,104円
S M A M ・バランスV A 株4 0 T <適格機関投資家限定>	604,716円
S M A M ・外国債券パッシブファンドV A <適格機関投資家限定>	6,597,388,341円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	317,910,827円
S M A M ・グローバルバランス4 0 V A <適格機関投資家限定>	110,161,119円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	61,534,170円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	29,749,375円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	11,741,981円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	70,316,869円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	350,309,527円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 <適格機関投資家専用>	76,242,287円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用>	37,643,421円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	5,511,845円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用>	820,004,466円
S M A M ・グローバルバランスファンド(標準型) V A <適格機関投資家限定>	489,884,162円
S M A M ・グローバルバランスファンド(債券重視型) V A <適格機関投資家限定>	668,807,457円
S M A M ・世界バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	284,791,331円
S M A M ・世界バランスファンドV A 2 <適格機関投資家限定>	229,812,549円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	119,206,614円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 <適格機関投資家限定>	57,520,352円
S M A M ・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	91,943,891円
S M A M ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	1,335,263,034円

SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%) < 適格機関投資家限定 >	73,700,721円
合計	79,394,261,585円

(2024年3月11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	79,394,261,585円
同期中における追加設定元本額	7,523,324,254円
同期中における一部解約元本額	5,737,462,016円
2024年3月11日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	27,372,480,390円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	969,291,403円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,437,524,335円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,482,471,479円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	165,914,478円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	5,712,728円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	24,969,215円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	95,498,475円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	293,433,368円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	222,554,062円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	364,364,727円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	20,176,872円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	57,265,000円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	101,159,985円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	64,458,044円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	41,995,882円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	359,406,170円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	247,327,453円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	703,418,055円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	227,172,109円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	120,184,802円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	233,712,661円
三井住友D S ・ 外国債券インデックス年金ファンド	1,088,148,022円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	41,184,328円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	143,868,381円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	110,848,238円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	4,300,688円
日興F W S ・ 先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	3,448,991,887円
三井住友D S ・ 先進国債インデックス・ファンド	308,383,784円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2035	4,761,120円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2040	2,984,752円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2045	4,237,118円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2055	1,286,550円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2065	771,479円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	751,785円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	8,666,727円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	35,438,527円

三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル4 (成長型)	19,405,993円
三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル5 (積極成長型)	6,715,230円
S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	5,105,079,793円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型<適格機関投資家限定>	21,269,064円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	4,041,298,650円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	3,597,206,169円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	8,585,342,356円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	28,565,773円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	68,538,172円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	646,535,008円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	97,653,517円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	843,878,697円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	1,219,045,963円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	1,182,676,466円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	3,585,194,533円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンドV A <適格機関投資家限定>	6,191,016,644円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	291,026,315円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A <適格機関投資家限定>	101,932,994円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	55,570,310円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	29,310,007円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	11,741,981円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	63,446,869円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	324,638,043円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 <適格機関投資家専用>	69,815,523円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用>	37,190,973円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	5,805,044円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用>	776,247,405円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A <適格機関投資家限定>	475,694,440円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型) V A <適格機関投資家限定>	617,018,437円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	247,141,919円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 <適格機関投資家限定>	211,356,046円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	139,618,688円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 <適格機関投資家限定>	73,927,877円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	118,450,386円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	1,151,299,991円
S M D A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%) <適格機関投資家限定>	324,353,468円
合 計	81,180,123,823円

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	49,747,753	47,692,400

コール・ローン	2,105,981,016	1,925,865,148
株式	276,740,872,060	319,115,512,940
未収配当金	133,452,128	483,490,803
前払金	4,675,000	-
差入委託証拠金	79,050,000	89,817,125
流動資産合計	279,113,777,957	321,662,378,416
資産合計	279,113,777,957	321,662,378,416
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,218,500	37,255,800
前受金	-	10,800,000
未払解約金	294,798,093	368,514,967
その他未払費用	33,303	11,756
流動負債合計	297,049,896	416,582,523
負債合計	297,049,896	416,582,523
純資産の部		
元本等		
元本	67,733,425,616	68,297,511,279
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	211,083,302,445	252,948,284,614
元本等合計	278,816,728,061	321,245,795,893
純資産合計	278,816,728,061	321,245,795,893
負債純資産合計	279,113,777,957	321,662,378,416

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年9月12日 至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2023年9月11日現在）	（2024年3月11日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	67,733,425,616口	68,297,511,279口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 4.1164円 （1万口当たりの純資産額41,164円）	1口当たり純資産額 4.7036円 （1万口当たりの純資産額47,036円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（2024年3月11日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2023年9月11日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0512月	1,994,193,500	-	1,991,975,000	2,218,500
	小計	1,994,193,500	-	1,991,975,000	2,218,500
合計		1,994,193,500	-	1,991,975,000	2,218,500

（2024年3月11日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
	株価指数先物取引 買建				

市場取引	TOPIX 先物 0606月	2,098,405,800	-	2,061,150,000	37,255,800
	小計	2,098,405,800	-	2,061,150,000	37,255,800
	合計	2,098,405,800	-	2,061,150,000	37,255,800

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2023年9月11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	64,681,311,514円
同期中における追加設定元本額	11,902,850,475円
同期中における一部解約元本額	8,850,736,373円
2023年9月11日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,591,481,988円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,007,680,143円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,516,293,931円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,642,841,830円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	162,411,744円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	3,566,971円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	15,726,214円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	56,375,030円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	157,876,103円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	147,286,974円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	270,312,573円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,281,339,864円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	25,135,439,200円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	263,303,999円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	336,243,520円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	202,765,236円
イオン・バランス戦略ファンド	87,515,647円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	49,107,745円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	203,601,343円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	191,016,426円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	744,856,646円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	426,486,522円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	496,767,890円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	54,438,122円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	1,079,692,316円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	39,416,892円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	231,146,504円

三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	239,344,365円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	6,297,797円
日興FWS・日本株インデックス	1,894,762,882円
三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド	48,035,769円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	43,516円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	51,540円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	61,241円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	74,595円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	74,595円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	350,209円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	3,814,930円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	17,184,361円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	8,499,319円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	5,286,087円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,483,964,175円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	8,759,088円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>	50,064,321円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,039,591,664円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,218,612,918円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	4,693,186,871円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	31,653,541円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	112,870,377円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	608,209,715円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 <適格機関投資家限定>	36,747,614円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	201,101,365円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	670,613,844円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	432,830,639円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	1,339,067,175円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	322,605円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	29,607,883円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	31,750,643円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	26,636,479円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	14,740,890円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	72,250,966円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	183,363,073円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	39,684,868円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	33,340,590円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	6,832,341円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	32,686,441円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	427,173,399円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	153,857,659円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA <適格機関投資家限定>	159,779,160円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA <適格機関投資家限定>	70,095,844円
SMAM・世界バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	57,894,803円
SMAM・世界バランスファンドVA2 <適格機関投資家限定>	32,775,213円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド <適格機関投資家限定>	57,132,194円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04 <適格機関投資家限定>	32,927,167円

S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	52,627,461円
S M A M・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	621,240,315円
S M D A M・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	18,098,332円
S M D A M・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限 定>	32,461,404円
合 計	67,733,425,616円

(2024年3月11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	67,733,425,616円
同期中における追加設定元本額	6,080,369,267円
同期中における一部解約元本額	5,516,283,604円

2024年3月11日現在の元本の内訳

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,607,829,289円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	939,160,985円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,229,739,693円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,587,518,522円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	127,272,796円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	3,203,821円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	13,846,014円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	52,376,274円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	152,283,274円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	143,550,909円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	265,615,227円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,327,323,381円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	27,199,941,941円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	212,938,231円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	294,622,696円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	166,879,267円
イオン・バランス戦略ファンド	63,666,776円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	53,906,980円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	192,680,176円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	199,716,157円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	781,318,037円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	466,515,767円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	554,781,185円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	56,753,284円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	1,268,750,290円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	38,660,223円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	239,112,001円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	261,141,702円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,553,809円
日興F W S・日本株インデックス	2,268,749,216円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	108,013,501円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	7,081,484円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	4,210,049円

三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2045	5,772,166円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2055	1,698,134円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2065	1,008,963円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	612,016円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	9,287,154円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	46,028,645円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	31,664,641円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	13,824,338円
S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,228,437,226円
バランスファンドV A (安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	8,319,578円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	41,808,833円
S M A M ・ バランスファンドV A 25 < 適格機関投資家専用 >	805,800,234円
S M A M ・ バランスファンドV A 37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,057,665,511円
S M A M ・ バランスファンドV A 50 < 適格機関投資家専用 >	4,156,407,633円
S M A M ・ バランスファンドV L 30 < 適格機関投資家限定 >	28,176,463円
S M A M ・ バランスファンドV L 50 < 適格機関投資家限定 >	100,486,196円
S M A M ・ バランスファンドV A 75 < 適格機関投資家専用 >	573,525,116円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	30,970,130円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 25 < 適格機関投資家専用 >	172,458,319円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 50 < 適格機関投資家専用 >	596,821,950円
S M A M ・ バランスファンドV A 40 < 適格機関投資家専用 >	382,961,981円
S M A M ・ バランスファンドV A 35 < 適格機関投資家専用 >	1,126,110,202円
S M A M ・ グローバルバランス40 V A < 適格機関投資家限定 >	24,835,775円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20 A < 適格機関投資家専用 >	25,933,877円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 35 A < 適格機関投資家専用 >	23,786,189円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 50 A < 適格機関投資家専用 >	13,492,163円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20 L < 適格機関投資家専用 >	60,672,294円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 25 L < 適格機関投資家専用 >	152,355,733円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20 A 2 < 適格機関投資家専用 >	32,882,500円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 35 A 2 < 適格機関投資家専用 >	29,459,650円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 50 A 2 < 適格機関投資家専用 >	6,584,711円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 30 L 2 < 適格機関投資家専用 >	28,335,632円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 25 L 2 < 適格機関投資家専用 >	362,740,730円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・ V A (適格機関投資家専用)	151,542,165円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	145,695,201円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	56,504,391円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	44,183,537円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	28,268,521円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	38,577,357円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04 < 適格機関投資家限定 >	20,403,150円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	32,596,587円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	601,941,108円
S M D A M ・ 日米3資産バランスオープン < 適格機関投資家限定 >	9,891,604円
S M D A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%) < 適格機関投資家限定 >	92,270,018円
合 計	68,297,511,279円

外国株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位 : 円)

	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,445,957,107	3,497,368,695
金銭信託	7,372,615	11,699,603
コール・ローン	312,106,304	472,441,253
株式	569,929,396,265	687,480,385,800
投資証券	12,160,647,103	14,388,886,059
派生商品評価勘定	14,804,960	88,855,284
未収入金	33,825,475	344,226
未収配当金	1,014,274,287	1,170,576,840
差入委託証拠金	949,230,375	2,373,375,907
流動資産合計	585,867,614,491	709,483,933,667
資産合計	585,867,614,491	709,483,933,667
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,124,929	2,425,143
未払解約金	156,963,106	207,651,902
その他未払費用	8,320	5,239
流動負債合計	174,096,355	210,082,284
負債合計	174,096,355	210,082,284
純資産の部		
元本等		
元本	80,285,355,686	84,457,867,457
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	505,408,162,450	624,815,983,926
元本等合計	585,693,518,136	709,273,851,383
純資産合計	585,693,518,136	709,273,851,383
負債純資産合計	585,867,614,491	709,483,933,667

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年9月12日 至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	80,285,355,686口	84,457,867,457口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 7.2951円 (1万口当たりの純資産額72,951円)	1口当たり純資産額 8.3980円 (1万口当たりの純資産額83,980円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年3月11日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2023年9月11日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT SEP23	2,816,973,990	-	2,819,696,609	2,722,619
	SPI 200 FUTURES SEP23	117,201,550	-	117,617,500	415,950
	FTSE 100 IDX FUT SEP23	149,809,019	-	151,117,659	1,308,640
	EURO STOXX 50 SEP23	534,513,892	-	527,743,826	6,770,066
	小計	3,618,498,451	-	3,616,175,594	2,322,857
	合 計	3,618,498,451	-	3,616,175,594	2,322,857

（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	176,716,609	-	176,719,497	2,888
	小計	176,716,609	-	176,719,497	2,888
合 計		176,716,609	-	176,719,497	2,888

（2024年3月11日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT MAR24	5,926,758,185	-	5,986,666,251	59,908,066
	SPI 200 FUTURES MAR24	222,485,671	-	229,304,298	6,818,627
	FTSE 100 IDX FUT MAR24	303,352,512	-	303,802,800	450,288
	EURO STOXX 50 MAR24	1,079,983,304	-	1,101,374,633	21,391,329
	小計	7,532,579,672	-	7,621,147,982	88,568,310
	合 計	7,532,579,672	-	7,621,147,982	88,568,310

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	642,907,722	-	640,763,028	2,144,694
	ユーロ	69,864,436	-	69,870,961	6,525
	小計	712,772,158	-	710,633,989	2,138,169
合 計		712,772,158	-	710,633,989	2,138,169

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2023年9月11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	69,094,291,205円
同期中における追加設定元本額	20,220,370,634円
同期中における一部解約元本額	9,029,306,153円
2023年9月11日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	39,947,626,157円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	288,872,736円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,114,280,201円

三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	815,724,504円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	31,975,460円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	866,919円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	4,357,225円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	14,119,075円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	43,555,666円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	52,652,732円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	109,889,814円
外国株式指数ファンド	1,005,322,004円
三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	20,961,308,631円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	118,818,176円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	151,850,228円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	91,497,818円
イオン・バランス戦略ファンド	24,596,891円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	24,933,853円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	140,085,726円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	128,019,945円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	490,747,585円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	293,424,933円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	394,219,966円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	60,936,519円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	2,210,041,998円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	11,129,714円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	55,569,565円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	53,014,111円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,205,314円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	873,388,944円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	297,199,867円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,316,652,259円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	94,405,191円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	19,245円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	24,584円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	30,142円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	38,462円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	38,462円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	96,982円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	1,095,017円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	5,036,135円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	2,491,452円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	1,538,674円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	353,445,856円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	2,435,607円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定>	14,085,258円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	390,119,752円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	598,731,327円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,644,112,230円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	8,840,391円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	41,243,434円

SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	382,756,601円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	31,123,233円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	74,041,043円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	375,737,406円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	243,895,256円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	566,929,127円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	181,246円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	177,806,517円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	48,611,426円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	5,871,789円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	5,839,402円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	3,468,121円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	13,508,815円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	44,155,646円
SMAM・グローバルバランスファンド（標準型）VA<適格機関投資家限定>	88,244,496円
SMAM・グローバルバランスファンド（債券重視型）VA<適格機関投資家限定>	38,344,500円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	170,474,139円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	56,978,052円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,469,056,578円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	24,813,997円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	14,256,202円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	22,698,063円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	128,392,752円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド（リスク3%）<適格機関投資家限定>	10,458,542円
合計	80,285,355,686円

(2024年3月11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	80,285,355,686円
同期中における追加設定元本額	8,239,999,821円
同期中における一部解約元本額	4,067,488,050円
2024年3月11日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	42,674,113,995円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	262,630,320円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,017,359,735円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	793,921,765円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	41,729,345円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	765,630円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	3,909,208円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	13,730,815円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	43,252,923円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	51,991,661円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	109,626,387円
外国株式指数ファンド	1,081,322,523円

三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	22,429,217,596円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	101,651,475円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	141,007,757円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	82,230,393円
イオン・バランス戦略ファンド	42,532,888円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	27,724,448円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	137,527,552円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	132,982,852円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	518,632,989円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	320,449,253円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	446,608,982円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	63,162,793円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	2,626,144,740円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	10,845,711円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	57,321,934円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	58,264,913円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,841,992円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	1,316,702,556円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	181,876,813円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,910,650,400円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	138,237,307円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	3,163,482円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	1,998,744円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	2,834,012円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	867,273円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	520,793円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	155,364円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	2,481,010円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	12,452,005円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	8,633,008円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	3,812,447円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	290,691,569円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	2,311,319円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定>	11,708,833円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	300,183,498円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	521,011,278円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,319,958,067円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	8,008,470円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	37,259,371円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	366,150,876円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 <適格機関投資家限定>	25,858,474円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	64,805,042円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	332,318,111円
S M A M・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	213,719,946円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	476,810,132円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	176,004,529円
S M A M・グローバルバランス40V A <適格機関投資家限定>	40,990,345円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	4,833,474円

SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	5,585,430円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	3,245,145円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	11,300,389円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	36,517,528円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	80,441,373円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	31,231,025円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	132,919,956円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	48,871,271円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	802,311,788円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	23,417,421円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	12,599,665円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	20,272,952円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	136,627,922円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	42,014,469円
合計	84,457,867,457円

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,630,617,357	1,485,411,747
金銭信託	1,458,905	3,351,103
コール・ローン	61,760,109	135,320,756
株式	29,711,323,555	34,879,200,458
投資信託受益証券	1,628,023,643	1,717,618,053
投資証券	2,748,434,286	3,232,969,770
派生商品評価勘定	1,294,161	80,901,538
未収入金	4,122,136	-
未収配当金	53,082,698	63,056,386
差入委託証拠金	600,754,318	600,886,254
流動資産合計	36,440,871,168	42,198,716,065
資産合計	36,440,871,168	42,198,716,065
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	69,272,629	176,184
未払金	3,795,093	-
未払解約金	10,692,240	68,572,519
その他未払費用	1,369	322
流動負債合計	83,761,331	68,749,025
負債合計	83,761,331	68,749,025
純資産の部		
元本等		

元本	20,017,222,114	21,687,014,430
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	16,339,887,723	20,442,952,610
元本等合計	36,357,109,837	42,129,967,040
純資産合計	36,357,109,837	42,129,967,040
負債純資産合計	36,440,871,168	42,198,716,065

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年9月12日 至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	20,017,222,114口	21,687,014,430口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8163円 (1万口当たりの純資産額18,163円)	1口当たり純資産額 1.9426円 (1万口当たりの純資産額19,426円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2024年3月11日現在)
-----	------------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2023年9月11日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT SEP23	2,346,365,762	-	2,278,387,728	67,978,034
	小計	2,346,365,762	-	2,278,387,728	67,978,034
合計		2,346,365,762	-	2,278,387,728	67,978,034

(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				
	台湾・ドル	210,121	-	209,597	524
	小計	210,121	-	209,597	524
	売建				
	アメリカ・ドル	210,121	-	210,031	90
小計		210,121	-	210,031	90
合計		420,242	-	419,628	434

(2024年3月11日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		

市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT MAR24	2,311,483,427	-	2,392,205,797	80,722,370
	小計	2,311,483,427	-	2,392,205,797	80,722,370
合 計		2,311,483,427	-	2,392,205,797	80,722,370

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	104,300,000	-	104,302,984	2,984
	小計	104,300,000	-	104,302,984	2,984
合 計		104,300,000	-	104,302,984	2,984

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2023年9月11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	14,201,860,735円
同期中における追加設定元本額	7,973,773,018円
同期中における一部解約元本額	2,158,411,639円

2023年9月11日現在の元本の内訳

三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	10,417,727,573円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,240,313,140円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	292,097,730円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	381,534,217円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	236,465,753円
イオン・バランス戦略ファンド	131,835,857円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	49,301,302円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	111,426,991円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	84,624,996円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	392,384,076円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	255,091,546円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	364,281,059円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	120,116,820円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	6,317,238円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	790,947,272円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,957,874,461円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	68,386,705円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	39,354円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	47,702円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	59,639円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	73,424円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	73,424円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	285,383円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	3,195,219円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	14,231,028円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	7,138,672円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	4,433,017円
SMA M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	86,918,516円
合計	20,017,222,114円

(2024年3月11日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	20,017,222,114円
同期中における追加設定元本額	3,494,889,701円
同期中における一部解約元本額	1,825,097,385円

2024年3月11日現在の元本の内訳

三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	11,387,868,713円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,348,421,563円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	254,936,594円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	351,795,377円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	229,604,511円
イオン・バランス戦略ファンド	30,517,268円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	60,114,964円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	122,188,331円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	95,743,900円

三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	453,246,727円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	301,060,589円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	448,223,579円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	134,721,779円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	6,156,795円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	490,844,367円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	3,775,611,541円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	76,895,879円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	6,903,905円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	4,307,757円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	6,171,618円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	1,860,937円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	1,120,927円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	169,640円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	2,545,908円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	12,821,891円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	8,791,967円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	3,760,972円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	70,606,431円
合計	21,687,014,430円

Jリート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,079,562	2,106,819
コール・ローン	45,701,297	85,075,376
投資証券	13,183,983,800	13,695,086,700
未収配当金	172,193,896	204,439,756
前払金	-	430,000
差入委託証拠金	2,290,000	1,912,173
流動資産合計	13,405,248,555	13,989,050,824
資産合計	13,405,248,555	13,989,050,824
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	268,400	284,400
前受金	56,000	-
未払金	-	66,216,349
未払解約金	14,462,955	1,994,896
その他未払費用	1,380	437
流動負債合計	14,788,735	68,496,082
負債合計	14,788,735	68,496,082
純資産の部		
元本等		
元本	4,995,462,169	5,658,981,500

剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,394,997,651	8,261,573,242
元本等合計	13,390,459,820	13,920,554,742
純資産合計	13,390,459,820	13,920,554,742
負債純資産合計	13,405,248,555	13,989,050,824

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月12日 至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	4,995,462,169口	5,658,981,500口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6805円 (1万口当たりの純資産額26,805円)	1口当たり純資産額 2.4599円 (1万口当たりの純資産額24,599円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年3月11日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2023年9月11日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物 0512月	37,778,400	-	37,510,000	268,400
	小計	37,778,400	-	37,510,000	268,400
合計		37,778,400	-	37,510,000	268,400

(2024年3月11日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物 0606月	33,824,400	-	33,540,000	284,400
	小計	33,824,400	-	33,540,000	284,400
合計		33,824,400	-	33,540,000	284,400

(注) 1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2023年9月11日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,618,768,466円
同期中における追加設定元本額	2,796,296,809円

同期中における一部解約元本額	1,419,603,106円
2023年9月11日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	235,220,778円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	316,152,868円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	142,329,717円
イオン・バランス戦略ファンド	65,920,793円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,510,623,916円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	19,066,545円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	39,063,929円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	38,725,679円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	160,007,336円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	98,903,746円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	74,867,373円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	39,990,515円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,447,550円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	233,155,759円
日興FWS・Jリートインデックス	589,430,782円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	60,690,538円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	10,354円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	12,774円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	19,339円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	26,282円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	26,282円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	122,781円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	1,912,971円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	9,735,376円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	5,209,846円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	3,448,069円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,148,468円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	79,713,693円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	49,281,384円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	79,401,552円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%) <適格機関投資家限定>	136,795,174円
合計	4,995,462,169円

(2024年3月11日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	4,995,462,169円
同期中における追加設定元本額	1,621,563,793円
同期中における一部解約元本額	958,044,462円
2024年3月11日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	223,670,880円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	359,312,135円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	188,982,889円

イオン・バランス戦略ファンド	23,231,595円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,657,062,760円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	27,468,328円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	44,853,288円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	47,667,450円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	210,195,479円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	137,432,696円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	106,355,358円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	50,043,713円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,814,919円
三井住友D S・国内リートインデックス年金ファンド	320,329,158円
日興FWS・Jリートインデックス	886,735,569円
三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド	78,895,541円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	2,077,275円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	1,408,169円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	2,418,937円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	848,272円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	500,323円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	297,898円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	9,009,894円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	53,236,137円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	39,962,063円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	18,164,965円
S M A M・世界リート・インデックスファンドV A <適格機関投資家限定>	2,929,952円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	69,181,938円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	36,290,409円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	57,603,510円
合計	5,658,981,500円

外国リート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	836,911,495	1,105,466,215
金銭信託	537,925	569,550
コール・ローン	22,772,077	22,998,985
投資証券	28,657,250,207	33,109,296,986
派生商品評価勘定	52,940	344,061
未収入金	3,187,911	1,966,319
未収配当金	57,921,581	72,979,487
流動資産合計	29,578,634,136	34,313,621,603
資産合計	29,578,634,136	34,313,621,603
負債の部		
流動負債		

派生商品評価勘定	148,153	254,929
未払解約金	14,568,268	1,495,861
その他未払費用	686	262
流動負債合計	14,717,107	1,751,052
負債合計	14,717,107	1,751,052
純資産の部		
元本等		
元本	9,979,027,630	10,582,375,566
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	19,584,889,399	23,729,494,985
元本等合計	29,563,917,029	34,311,870,551
純資産合計	29,563,917,029	34,311,870,551
負債純資産合計	29,578,634,136	34,313,621,603

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月12日 至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	9,979,027,630口	10,582,375,566口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.9626円 (1万口当たりの純資産額29,626円)	1口当たり純資産額 3.2424円 (1万口当たりの純資産額32,424円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年3月11日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2023年9月11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	24,700,000	-	24,554,557	145,443
	小計	24,700,000	-	24,554,557	145,443
	売建				
	アメリカ・ドル	11,000,000	-	11,002,710	2,710
	オーストラリア・ドル	20,100,000	-	20,047,060	52,940
	小計	31,100,000	-	31,049,770	50,230
	合計	55,800,000	-	55,604,327	95,213

（2024年3月11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	69,700,000	-	69,605,098	94,902
	イギリス・ポンド	34,200,000	-	34,041,543	158,457

市場取引以外 の取引	小計	103,900,000	-	103,646,641	253,359
	売建				
	オーストラリア・ド ル	24,600,000	-	24,440,444	159,556
	ユーロ	17,800,000	-	17,617,065	182,935
	小計	42,400,000	-	42,057,509	342,491
	合 計	146,300,000	-	145,704,150	89,132

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2023年9月11日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	8,375,587,967円
同期中における追加設定元本額	2,826,749,138円
同期中における一部解約元本額	1,223,309,475円
2023年9月11日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	13,398,410円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	19,774,737円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	57,234,466円
イオン・バランス戦略ファンド	40,172,185円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	8,031,891,206円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	8,150,712円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	34,590,661円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	35,439,615円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	145,174,840円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	90,253,464円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	66,931,443円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	111,536,949円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,051,013円

三井住友D S・外国リートインデックス年金ファンド	348,394,851円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	89,672,010円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	622,235,622円
三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド	113,400,205円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	7,339円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	7,706円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	9,541円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	11,376円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	11,376円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	30,436円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	350,802円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	1,627,905円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	790,005円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	505,663円
S M A M・世界リート・インデックスファンドV A <適格機関投資家限定>	34,040,769円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	40,920,094円
S M D A M・リスクコントロール型バランスファンド2021 05(リスク3%) <適格機関投資家限定>	71,412,229円
合計	9,979,027,630円

(2024年3月11日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	9,979,027,630円
同期中における追加設定元本額	1,242,861,625円
同期中における一部解約元本額	639,513,689円
2024年3月11日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	19,062,981円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	27,082,042円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	39,629,837円
イオン・バランス戦略ファンド	36,519,630円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	8,361,060,857円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	9,910,853円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	35,891,483円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	37,046,206円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	161,272,338円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	104,592,996円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	81,569,226円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	120,982,373円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	1,000,874円
三井住友D S・外国リートインデックス年金ファンド	375,595,893円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	67,455,152円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	897,187,153円
三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド	121,316,673円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	1,296,045円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	690,096円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	984,784円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	299,739円

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	177,051円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	43,316円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	538,158円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	3,334,055円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	2,243,162円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	994,144円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	32,153,468円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	42,444,981円
合計	10,582,375,566円

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

資本金の額および株式数

2024年3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

最近5年間における資本金の額の増減
該当ありません。

(2)【事業の内容及び営業の状況】

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

2024年3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	685	12,568,560
単位型株式投資信託	94	660,549
追加型公社債投資信託	1	25,689
単位型公社債投資信託	157	248,446
合計	937	13,503,245

(3)【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

該当ありません。

(ロ) その他の重要事項

該当ありません。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

5【委託会社等の経理状況】

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

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		
サービス支援手数料	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			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242
当期変動額								
剰余金の配当								
欠損填補			8,460,037	8,460,037				8,460,037
当期純利益								4,119,040
任意積立金の取崩						60,000	1,476,959	1,536,959
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)								

当期変動額合計	-	-	8,460,037	8,460,037	-	60,000	1,476,959	14,116,037
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	-	-	3,834,794

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:千円)

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

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 重要な資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

子会社株式
移動平均法による原価法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

(2) 金銭の信託

運用目的の金銭の信託：時価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

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

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	8～50年
器具備品	4～15年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア（自社利用分）	5年

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 委託者報酬

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

(2) 運用受託報酬

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

(3)投資助言報酬

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

(会計方針の変更)

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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 当座借越契約

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

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

3 保証債務

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

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

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

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

2 システム統合関連費用

社内システム統合に伴うものであり、主にデータの移行費用などであります。

3 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

4 支払補償費

受益者や販売会社に生じた損失の補償に伴い発生する費用であります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

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

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

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

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

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

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

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

また、資金調達はありません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(単位：千円)

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

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

(収益認識関係)

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

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2022年4月1日 至2023年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1.関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

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

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2.親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1.関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

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

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2.親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

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

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

2.1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、次のとおりであります。

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

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			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(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いません。

独立監査人の監査報告書

2023年6月15日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕**監査意見**

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

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。

独立監査人の中間監査報告書

2024年5月29日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの2023年9月12日から2024年3月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの2024年3月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年9月12日から2024年3月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

その他の事項

ファンドの2023年9月11日をもって終了した前計算期間の中間計算期間（2022年9月13日から2023年3月12日まで）に係る中間財務諸表は、前任監査人によって中間監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2023年5月30日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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