

**【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12日提出
【計算期間】	第7期中(自 2023年9月16日至 2024年3月15日)
【ファンド名】	三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型） 三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型） 三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型） 三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型） 三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）
【発行者名】	三井住友D S アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	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・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

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	228,201,118	1.91
親投資信託受益証券	日本	11,603,516,822	97.08
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	121,393,542	1.01
合計（純資産総額）		11,953,111,482	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。

## 三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

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	183,994,619	2.84
親投資信託受益証券	日本	6,227,550,711	96.17
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	64,278,100	0.99
合計（純資産総額）		6,475,823,430	100.00

## 三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

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	711,947,301	3.86
親投資信託受益証券	日本	17,561,204,677	95.14
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	184,521,228	1.00
合計（純資産総額）		18,457,673,206	100.00

## 三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

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	424,048,401	4.75
親投資信託受益証券	日本	8,399,733,281	94.17
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	95,715,767	1.08
合計（純資産総額）		8,919,497,449	100.00

## 三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

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	529,771,991	5.67
親投資信託受益証券	日本	8,713,640,780	93.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	103,063,576	1.10
合計(純資産総額)		9,346,476,347	100.00

## (2) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2018年 9月18日)	188,363,034	188,363,034	9,891	9,891
第2期 (2019年 9月17日)	1,356,985,451	1,356,985,451	10,327	10,327
第3期 (2020年 9月15日)	3,201,120,313	3,201,120,313	10,352	10,352
第4期 (2021年 9月15日)	6,014,936,981	6,014,936,981	10,987	10,987
第5期 (2022年 9月15日)	7,936,728,790	7,936,728,790	10,277	10,277
第6期 (2023年 9月15日)	10,436,090,722	10,436,090,722	10,277	10,277
2023年 3月末日	8,927,158,621	-	10,085	-
4月末日	9,128,408,132	-	10,133	-
5月末日	9,513,270,037	-	10,188	-
6月末日	9,947,571,384	-	10,343	-
7月末日	10,121,662,254	-	10,299	-
8月末日	10,372,142,214	-	10,272	-
9月末日	10,420,958,617	-	10,137	-
10月末日	10,450,654,600	-	9,962	-
11月末日	10,943,882,559	-	10,286	-
12月末日	11,194,951,609	-	10,370	-
2024年 1月末日	11,506,577,439	-	10,436	-
2月末日	11,705,061,854	-	10,542	-
3月末日	11,953,111,482	-	10,649	-

## 三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2018年 9月18日)	95,425,714	95,425,714	10,023	10,023
第2期 (2019年 9月17日)	680,523,123	680,523,123	10,310	10,310
第3期 (2020年 9月15日)	1,423,870,207	1,423,870,207	10,504	10,504
第4期 (2021年 9月15日)	2,948,746,361	2,948,746,361	11,770	11,770

第5期（2022年 9月15日）	3,963,474,003	3,963,474,003	11,317	11,317
第6期（2023年 9月15日）	5,248,052,720	5,248,052,720	11,802	11,802
2023年 3月末日	4,489,153,663	-	11,136	-
4月末日	4,623,315,467	-	11,244	-
5月末日	4,733,355,239	-	11,399	-
6月末日	4,940,661,413	-	11,732	-
7月末日	5,063,345,652	-	11,734	-
8月末日	5,225,189,878	-	11,752	-
9月末日	5,229,878,730	-	11,587	-
10月末日	5,284,921,784	-	11,354	-
11月末日	5,604,943,719	-	11,818	-
12月末日	5,786,853,523	-	11,923	-
2024年 1月末日	5,975,029,896	-	12,147	-
2月末日	6,197,286,799	-	12,364	-
3月末日	6,475,823,430	-	12,592	-

## 三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

年月日	純資産総額 （円）		1万口当たりの 純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期（2018年 9月18日）	294,119,586	294,119,586	10,265	10,265
第2期（2019年 9月17日）	1,355,636,779	1,355,636,779	10,443	10,443
第3期（2020年 9月15日）	3,340,276,783	3,340,276,783	10,752	10,752
第4期（2021年 9月15日）	7,103,911,189	7,103,911,189	12,649	12,649
第5期（2022年 9月15日）	10,302,370,297	10,302,370,297	12,461	12,461
第6期（2023年 9月15日）	14,715,183,751	14,715,183,751	13,483	13,483
2023年 3月末日	11,925,310,654	-	12,286	-
4月末日	12,273,416,087	-	12,457	-
5月末日	12,631,851,723	-	12,725	-
6月末日	13,549,446,874	-	13,257	-
7月末日	13,931,550,127	-	13,319	-
8月末日	14,451,145,452	-	13,380	-
9月末日	14,618,376,219	-	13,185	-
10月末日	14,675,290,940	-	12,880	-
11月末日	15,680,235,845	-	13,498	-
12月末日	16,029,713,267	-	13,621	-
2024年 1月末日	16,810,959,885	-	14,021	-
2月末日	17,584,159,151	-	14,374	-
3月末日	18,457,673,206	-	14,742	-

## 三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

年月日	純資産総額 （円）	1万口当たりの 純資産額（円）
-----	--------------	--------------------

	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2018年 9月18日)	198,459,464	198,459,464	10,365	10,365
第2期 (2019年 9月17日)	635,299,500	635,299,500	10,455	10,455
第3期 (2020年 9月15日)	1,407,129,947	1,407,129,947	10,813	10,813
第4期 (2021年 9月15日)	2,920,936,967	2,920,936,967	13,299	13,299
第5期 (2022年 9月15日)	4,630,827,047	4,630,827,047	13,380	13,380
第6期 (2023年 9月15日)	6,893,523,523	6,893,523,523	14,948	14,948
2023年 3月末日	5,385,865,576	-	13,204	-
4月末日	5,565,163,331	-	13,432	-
5月末日	5,773,712,673	-	13,816	-
6月末日	6,273,537,440	-	14,552	-
7月末日	6,483,051,722	-	14,684	-
8月末日	6,741,512,006	-	14,788	-
9月末日	6,819,468,088	-	14,567	-
10月末日	6,806,324,877	-	14,182	-
11月末日	7,250,096,420	-	14,954	-
12月末日	7,452,493,974	-	15,095	-
2024年 1月末日	7,993,986,824	-	15,676	-
2月末日	8,505,764,873	-	16,173	-
3月末日	8,919,497,449	-	16,691	-

## 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2018年 9月18日)	475,256,788	475,256,788	10,445	10,445
第2期 (2019年 9月17日)	758,503,160	758,503,160	10,399	10,399
第3期 (2020年 9月15日)	1,374,244,182	1,374,244,182	10,821	10,821
第4期 (2021年 9月15日)	2,928,938,274	2,928,938,274	13,753	13,753
第5期 (2022年 9月15日)	4,578,888,251	4,578,888,251	14,067	14,067
第6期 (2023年 9月15日)	6,908,100,522	6,908,100,522	16,214	16,214
2023年 3月末日	5,343,537,213	-	13,928	-
4月末日	5,535,511,731	-	14,186	-
5月末日	5,763,939,136	-	14,691	-
6月末日	6,306,580,089	-	15,629	-
7月末日	6,537,298,639	-	15,842	-
8月末日	6,771,442,232	-	15,989	-
9月末日	6,814,714,435	-	15,750	-
10月末日	6,802,646,406	-	15,283	-
11月末日	7,351,232,125	-	16,225	-
12月末日	7,515,599,607	-	16,371	-
2024年 1月末日	8,189,485,359	-	17,183	-
2月末日	8,779,729,375	-	17,889	-
3月末日	9,346,476,347	-	18,568	-

## 【分配の推移】

## 三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

	計算期間	1 万口当たり分配金（円）
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	0
第5期	2021年 9月16日～2022年 9月15日	0
第6期	2022年 9月16日～2023年 9月15日	0

## 三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

	計算期間	1 万口当たり分配金（円）
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	0
第5期	2021年 9月16日～2022年 9月15日	0
第6期	2022年 9月16日～2023年 9月15日	0

## 三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

	計算期間	1 万口当たり分配金（円）
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	0
第5期	2021年 9月16日～2022年 9月15日	0
第6期	2022年 9月16日～2023年 9月15日	0

## 三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

	計算期間	1 万口当たり分配金（円）
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	0
第5期	2021年 9月16日～2022年 9月15日	0
第6期	2022年 9月16日～2023年 9月15日	0

## 三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	0
第5期	2021年 9月16日～2022年 9月15日	0
第6期	2022年 9月16日～2023年 9月15日	0

## 【収益率の推移】

## 三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)

	収益率(%)
第1期	1.1
第2期	4.4
第3期	0.2
第4期	6.1
第5期	6.5
第6期	0.0
第7期(中間期)	2.3

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

## 三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)

	収益率(%)
第1期	0.2
第2期	2.9
第3期	1.9
第4期	12.1
第5期	3.8
第6期	4.3
第7期(中間期)	4.6

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

## 三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)

	収益率(%)
第1期	2.7
第2期	1.7
第3期	3.0
第4期	17.6
第5期	1.5
第6期	8.2
第7期(中間期)	6.6

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

#### 三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)

	収益率(%)
第1期	3.7
第2期	0.9
第3期	3.4
第4期	23.0
第5期	0.6
第6期	11.7
第7期(中間期)	8.3

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

#### 三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)

	収益率(%)
第1期	4.5
第2期	0.4
第3期	4.1
第4期	27.1
第5期	2.3
第6期	15.3
第7期(中間期)	10.6

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

(参考)

(1) 投資状況

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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

## 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

### 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

### 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

### 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

## 2【設定及び解約の実績】

## 三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	197,260,985	6,814,601
第2期	1,242,016,819	118,444,252
第3期	2,142,530,997	364,184,551
第4期	3,074,461,766	692,313,957
第5期	3,272,525,772	1,024,474,042
第6期	3,585,355,935	1,152,978,488
第7期(中間期)	1,883,321,409	921,500,680

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	235,257,377	140,052,522
第2期	593,034,885	28,199,968
第3期	853,822,366	158,356,618
第4期	1,391,060,134	241,319,938
第5期	1,327,482,394	330,475,830
第6期	1,371,817,336	427,265,280
第7期(中間期)	879,244,727	234,621,736

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	426,008,460	139,473,752
第2期	1,111,549,352	100,006,600
第3期	2,085,818,899	277,142,914
第4期	2,996,875,916	487,585,479
第5期	3,415,030,451	763,606,832
第6期	3,603,123,946	956,915,168
第7期(中間期)	2,112,273,463	639,768,640

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	411,158,724	219,693,175
第2期	485,641,046	69,477,173
第3期	839,231,080	145,565,103
第4期	1,186,838,860	291,846,934
第5期	1,638,627,128	373,806,038

第6期	1,655,293,434	504,703,539
第7期(中間期)	987,348,835	298,353,503

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	762,271,388	307,261,790
第2期	481,502,084	207,078,502
第3期	843,783,098	303,192,666
第4期	1,274,331,650	414,699,900
第5期	1,564,567,682	439,177,712
第6期	1,671,376,606	665,761,266
第7期(中間期)	1,072,552,029	362,897,914

(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16日から2024年3月15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・資産最適化ファンド（1安定重視型）】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 （2023年 9月15日現在）	第7期中間計算期間 （2024年 3月15日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	9,556,244	14,559,555
金銭信託	5,785,640	3,557,853
コール・ローン	156,721,369	165,147,943
投資証券	205,066,890	221,253,589
親投資信託受益証券	10,126,803,515	11,343,785,377
未収入金	3,000,000	5,000,000
流動資産合計	10,506,933,658	11,753,304,317
資産合計	10,506,933,658	11,753,304,317
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	23,448,742	15,595,193
未払受託者報酬	1,604,721	1,809,616
未払委託者報酬	45,468,244	51,273,647
その他未払費用	321,229	362,034
流動負債合計	70,842,936	69,040,490
負債合計	70,842,936	69,040,490
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	10,154,942,383	11,116,763,112
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	281,148,339	567,500,715
（分配準備積立金）	348,905,441	320,242,876
元本等合計	10,436,090,722	11,684,263,827
純資産合計	10,436,090,722	11,684,263,827
負債純資産合計	10,506,933,658	11,753,304,317

## （ 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16日 至 2023年 3月15日	第7期中間計算期間 自 2023年 9月16日 至 2024年 3月15日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	3,473,936	4,847,099
受取利息	15,193	93,883
有価証券売買等損益	171,089,757	307,922,007
為替差損益	9,899,307	1,369,010
営業収益合計	177,499,935	314,231,999
<b>営業費用</b>		
支払利息	26,715	16,390
受託者報酬	1,347,206	1,809,616
委託者報酬	38,172,427	51,273,647
その他費用	280,267	387,604
営業費用合計	39,826,615	53,487,257
営業利益又は営業損失（ ）	217,326,550	260,744,742
経常利益又は経常損失（ ）	217,326,550	260,744,742
中間純利益又は中間純損失（ ）	217,326,550	260,744,742
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	9,784,943	7,171,332
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	214,163,854	281,148,339
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,226,889	57,897,941
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,226,889	57,897,941
剰余金減少額又は欠損金増加額	11,778,997	25,118,975
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	11,778,997	25,118,975
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（ ）	929,861	567,500,715

## (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16日 至 2024年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第6期 (2023年9月15日現在)	第7期中間計算期間 (2024年3月15日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	10,154,942,383口	11,116,763,112口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0277円 (1万口当たりの純資産額10,277円)	1口当たり純資産額 1.0510円 (1万口当たりの純資産額10,510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15日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資証券、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>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)          デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等          これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第6期 (2023年9月15日現在)	第7期中間計算期間 (2024年3月15日現在)
期首元本額	7,722,564,936円	10,154,942,383円
期中追加設定元本額	3,585,355,935円	1,883,321,409円
期中一部解約元本額	1,152,978,488円	921,500,680円

## 【三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 (2023年 9月15日現在)	第7期中間計算期間 (2024年 3月15日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	7,320,089	11,178,948
金銭信託	2,690,057	1,746,097
コール・ローン	72,868,237	81,050,096
投資証券	154,666,233	178,392,946
親投資信託受益証券	5,039,377,757	6,041,286,648
未収入金	15,000,000	-
流動資産合計	5,291,922,373	6,313,654,735
資産合計	5,291,922,373	6,313,654,735
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	20,167,618	1,200,352
未払受託者報酬	802,503	930,879
未払委託者報酬	22,738,929	26,376,188
その他未払費用	160,603	186,191
流動負債合計	43,869,653	28,693,610
負債合計	43,869,653	28,693,610
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,446,804,336	5,091,427,327
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	801,248,384	1,193,533,798
(分配準備積立金)	315,401,783	300,246,245
元本等合計	5,248,052,720	6,284,961,125
純資産合計	5,248,052,720	6,284,961,125
負債純資産合計	5,291,922,373	6,313,654,735

## (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16日 至 2023年 3月15日	第7期中間計算期間 自 2023年 9月16日 至 2024年 3月15日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	2,621,707	3,739,299
受取利息	11,721	71,690
有価証券売買等損益	87,311,339	293,688,173
為替差損益	7,346,569	967,031
営業収益合計	92,024,480	298,466,193
<b>営業費用</b>		
支払利息	12,858	7,740
受託者報酬	675,090	930,879
委託者報酬	19,128,770	26,376,188
その他費用	144,020	207,646
営業費用合計	19,960,738	27,522,453
営業利益又は営業損失( )	111,985,218	270,943,740
経常利益又は経常損失( )	111,985,218	270,943,740
中間純利益又は中間純損失( )	111,985,218	270,943,740
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	3,771,501	2,619,448
期首剰余金又は期首欠損金( )	461,221,723	801,248,384
剰余金増加額又は欠損金減少額	69,635,551	166,021,431
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	69,635,551	166,021,431
剰余金減少額又は欠損金増加額	24,057,767	42,060,309
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	24,057,767	42,060,309
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( )	398,585,790	1,193,533,798

## （ 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16日 至 2024年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## （中間貸借対照表に関する注記）

項目	第6期 (2023年9月15日現在)	第7期中間計算期間 (2024年3月15日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	4,446,804,336口	5,091,427,327口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1802円 (1万口当たりの純資産額11,802円)	1口当たり純資産額 1.2344円 (1万口当たりの純資産額12,344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15日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券、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>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)          デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等          これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項 目	第6期 (2023年9月15日現在)	第7期中間計算期間 (2024年3月15日現在)
期首元本額	3,502,252,280円	4,446,804,336円
期中追加設定元本額	1,371,817,336円	879,244,727円
期中一部解約元本額	427,265,280円	234,621,736円

## 【三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 （2023年 9月15日現在）	第7期中間計算期間 （2024年 3月15日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	26,119,836	40,445,447
金銭信託	6,661,277	5,200,670
コール・ローン	180,440,627	241,403,979
投資証券	564,037,125	670,237,252
親投資信託受益証券	14,003,527,217	16,924,164,831
流動資産合計	14,780,786,082	17,881,452,179
<b>資産合計</b>		
14,780,786,082		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,366,130	5,290,283
未払受託者報酬	2,174,980	2,609,072
未払委託者報酬	61,625,838	73,924,934
その他未払費用	435,383	521,972
流動負債合計	65,602,331	82,346,261
<b>負債合計</b>		
65,602,331		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	10,913,676,279	12,386,181,102
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,801,507,472	5,412,924,816
（分配準備積立金）	1,700,099,921	1,609,732,523
元本等合計	14,715,183,751	17,799,105,918
<b>純資産合計</b>		
14,715,183,751		
<b>負債純資産合計</b>		
14,780,786,082		
17,881,452,179		

## （ 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16日 至 2023年 3月15日	第7期中間計算期間 自 2023年 9月16日 至 2024年 3月15日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	9,298,151	13,897,248
受取利息	40,923	257,301
有価証券売買等損益	243,559,069	1,133,089,369
為替差損益	26,690,239	3,624,513
営業収益合計	260,910,234	1,150,868,431
<b>営業費用</b>		
支払利息	34,306	21,560
受託者報酬	1,781,718	2,609,072
委託者報酬	50,483,250	73,924,934
その他費用	382,318	575,733
営業費用合計	52,681,592	77,131,299
営業利益又は営業損失（ ）	313,591,826	1,073,737,132
経常利益又は経常損失（ ）	313,591,826	1,073,737,132
中間純利益又は中間純損失（ ）	313,591,826	1,073,737,132
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（ ）	8,087,399	13,359,340
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,034,902,796	3,801,507,472
剰余金増加額又は欠損金減少額	359,981,583	773,394,379
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	359,981,583	773,394,379
剰余金減少額又は欠損金増加額	77,954,026	222,354,827
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	77,954,026	222,354,827
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（ ）	2,011,425,926	5,412,924,816

## （ 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16日 至 2024年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## （中間貸借対照表に関する注記）

項 目	第6期 (2023年9月15日現在)	第7期中間計算期間 (2024年3月15日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	10,913,676,279口	12,386,181,102口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3483円 (1万口当たりの純資産額13,483円)	1口当たり純資産額 1.4370円 (1万口当たりの純資産額14,370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15日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券、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>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)          デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等          これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第6期 (2023年9月15日現在)	第7期中間計算期間 (2024年3月15日現在)
期首元本額	8,267,467,501円	10,913,676,279円
期中追加設定元本額	3,603,123,946円	2,112,273,463円
期中一部解約元本額	956,915,168円	639,768,640円

## 【三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 (2023年 9月15日現在)	第7期中間計算期間 (2024年 3月15日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	15,039,419	23,542,761
金銭信託	3,143,390	2,271,184
コール・ローン	85,148,125	105,423,503
投資証券	339,160,150	411,138,347
親投資信託受益証券	6,484,820,833	8,082,448,635
未収入金	-	1,000,000
流動資産合計	6,927,311,917	8,625,824,430
資産合計	6,927,311,917	8,625,824,430
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,306,890	7,138,223
未払受託者報酬	998,198	1,225,099
未払委託者報酬	28,283,525	34,712,784
その他未払費用	199,781	245,058
流動負債合計	33,788,394	43,321,164
負債合計	33,788,394	43,321,164
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,611,698,310	5,300,693,642
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,281,825,213	3,281,809,624
(分配準備積立金)	1,057,078,513	995,025,501
元本等合計	6,893,523,523	8,582,503,266
純資産合計	6,893,523,523	8,582,503,266
負債純資産合計	6,927,311,917	8,625,824,430

## （ 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16日 至 2023年 3月15日	第7期中間計算期間 自 2023年 9月16日 至 2024年 3月15日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	5,278,165	8,256,001
受取利息	23,744	148,778
有価証券売買等損益	116,820,542	663,191,865
為替差損益	15,011,428	2,141,670
営業収益合計	126,530,061	673,738,314
<b>営業費用</b>		
支払利息	15,418	9,684
受託者報酬	806,364	1,225,099
委託者報酬	22,848,070	34,712,784
その他費用	178,329	282,451
営業費用合計	23,848,181	36,230,018
営業利益又は営業損失（ ）	150,378,242	637,508,296
経常利益又は経常損失（ ）	150,378,242	637,508,296
中間純利益又は中間純損失（ ）	150,378,242	637,508,296
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（ ）	6,304,384	7,881,690
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,169,718,632	2,281,825,213
剰余金増加額又は欠損金減少額	234,100,801	517,788,400
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	234,100,801	517,788,400
剰余金減少額又は欠損金増加額	72,276,677	147,430,595
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	72,276,677	147,430,595
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,187,468,898	3,281,809,624

## (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16日 至 2024年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第6期 (2023年9月15日現在)	第7期中間計算期間 (2024年3月15日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	4,611,698,310口	5,300,693,642口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4948円 (1万口当たりの純資産額14,948円)	1口当たり純資産額 1.6191円 (1万口当たりの純資産額16,191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15日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資証券、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>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)          デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等          これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項 目	第6期 (2023年9月15日現在)	第7期中間計算期間 (2024年3月15日現在)
期首元本額	3,461,108,415円	4,611,698,310円
期中追加設定元本額	1,655,293,434円	987,348,835円
期中一部解約元本額	504,703,539円	298,353,503円

## 【三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 （2023年 9月15日現在）	第7期中間計算期間 （2024年 3月15日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	17,943,594	28,217,369
金銭信託	3,084,890	2,504,942
コール・ローン	83,563,489	116,274,053
投資証券	400,453,852	513,643,207
親投資信託受益証券	6,438,063,615	8,304,157,469
流動資産合計	6,943,109,440	8,964,797,040
<b>資産合計</b>	<b>6,943,109,440</b>	<b>8,964,797,040</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,493,992	13,310,607
未払受託者報酬	999,328	1,242,245
未払委託者報酬	28,315,588	35,198,128
その他未払費用	200,010	248,508
流動負債合計	35,008,918	49,999,488
<b>負債合計</b>	<b>35,008,918</b>	<b>49,999,488</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,260,660,672	4,970,314,787
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,647,439,850	3,944,482,765
（分配準備積立金）	1,283,313,753	1,186,343,262
元本等合計	6,908,100,522	8,914,797,552
<b>純資産合計</b>	<b>6,908,100,522</b>	<b>8,914,797,552</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>6,943,109,440</b>	<b>8,964,797,040</b>

## (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16日 至 2023年 3月15日	第7期中間計算期間 自 2023年 9月16日 至 2024年 3月15日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	6,262,015	9,978,579
受取利息	28,249	177,568
有価証券売買等損益	117,198,104	848,683,597
為替差損益	17,592,877	2,421,944
営業収益合計	128,500,717	861,261,688
<b>営業費用</b>		
支払利息	15,305	9,815
受託者報酬	794,893	1,242,245
委託者報酬	22,523,306	35,198,128
その他費用	180,068	289,701
営業費用合計	23,513,572	36,739,889
営業利益又は営業損失( )	152,014,289	824,521,799
経常利益又は経常損失( )	152,014,289	824,521,799
中間純利益又は中間純損失( )	152,014,289	824,521,799
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( )	6,626,192	16,869,312
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,323,842,919	2,647,439,850
剰余金増加額又は欠損金減少額	280,986,359	714,817,328
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	280,986,359	714,817,328
剰余金減少額又は欠損金増加額	92,259,893	225,426,900
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	92,259,893	225,426,900
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,367,181,288	3,944,482,765

## （ 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16日 至 2024年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## （中間貸借対照表に関する注記）

項 目	第6期 (2023年9月15日現在)	第7期中間計算期間 (2024年3月15日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	4,260,660,672口	4,970,314,787口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6214円 (1万口当たりの純資産額16,214円)	1口当たり純資産額 1.7936円 (1万口当たりの純資産額17,936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15日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第6期 (2023年9月15日現在)	第7期中間計算期間 (2024年3月15日現在)
期首元本額	3,255,045,332円	4,260,660,672円
期中追加設定元本額	1,671,376,606円	1,072,552,029円
期中一部解約元本額	665,761,266円	362,897,914円

## (参考)

「三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)」、「三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)」、「三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)」、「三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)」および「三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。  
なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2023年9月15日現在)	(2024年3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	100,257,308	51,201,586
コール・ローン	2,715,769,352	2,376,668,094
株式	284,700,129,980	319,592,059,450
派生商品評価勘定	53,908,400	4,465,300
未収入金	251,162	-
未収配当金	100,534,178	475,486,653
前払金	-	35,345,000
差入委託証拠金	86,940,000	105,139,457

流動資産合計	287,757,790,380	322,640,365,540
資産合計	287,757,790,380	322,640,365,540
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	35,843,600
前受金	34,680,000	-
未払解約金	352,525,346	313,167,169
その他未払費用	8,109	2,632
流動負債合計	387,213,455	349,013,401
負債合計	387,213,455	349,013,401
純資産の部		
元本等		
元本	67,862,268,912	68,417,051,147
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	219,508,308,013	253,874,300,992
元本等合計	287,370,576,925	322,291,352,139
純資産合計	287,370,576,925	322,291,352,139
負債純資産合計	287,757,790,380	322,640,365,540

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2023年9月16日 至 2024年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	( 2023年9月15日現在 )	( 2024年3月15日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	67,862,268,912口	68,417,051,147口

2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 4,2346円 (1万口当たりの純資産額42,346円)	1口当たり純資産額 4,7107円 (1万口当たりの純資産額47,107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15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(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15日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0512月	2,495,921,600	-	2,549,830,000	53,908,400
	小計	2,495,921,600	-	2,549,830,000	53,908,400
合計		2,495,921,600	-	2,549,830,000	53,908,400

(2024年3月15日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0606月	2,753,153,300	-	2,721,775,000	31,378,300
	小計	2,753,153,300	-	2,721,775,000	31,378,300
合計		2,753,153,300	-	2,721,775,000	31,378,300

(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15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	64,962,611,793円
同期中における追加設定元本額	11,856,551,844円
同期中における一部解約元本額	8,956,894,725円
2023年9月15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	9,594,534,517円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,003,087,828円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,509,286,610円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,640,401,024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)	162,076,597円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	3,566,971円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	15,678,498円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	56,013,180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)	157,273,243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)	147,045,696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)	269,114,282円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,263,741,523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	25,375,277,483円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	258,478,442円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	330,935,408円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	199,376,259円
イオン・バランス戦略ファンド	87,758,384円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	48,988,455円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	202,399,356円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	187,424,925円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	744,127,269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	54,871,388円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	1,084,805,444円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	39,681,970円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	231,024,941円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	238,507,526円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,558,204円
日興F W S・日本株インデックス	1,897,707,078円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	47,977,457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DS・DCターゲットイヤーファンド2040	51,540円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	61,241円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	74,595円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	74,595円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	340,558円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	3,964,134円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	19,271,273円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	9,784,827円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	5,418,579円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,477,178,418円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	14,279,429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>	1,028,952,633円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,206,823,650円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	4,672,835,180円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	31,653,541円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	112,870,377円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	604,715,999円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	36,747,614円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	201,101,365円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	670,613,844円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	429,474,597円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,326,267,094円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	322,605円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	27,618,110円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	31,596,310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>	72,087,693円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	181,504,877円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	39,301,636円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	33,340,590円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	6,832,341円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	32,235,541円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	425,002,155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
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	52,627,461円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	621,240,315円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	17,621,175円

SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	32,461,404円
合計	67,862,268,912円

(2024年3月15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	67,862,268,912円
同期中における追加設定元本額	6,091,119,659円
同期中における一部解約元本額	5,536,337,424円
2024年3月15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	9,577,563,825円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	933,472,194円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,219,468,910円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,574,118,763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)	126,842,629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)	13,614,089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)	265,512,453円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,355,566,779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	27,403,378,504円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	211,867,016円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	292,908,753円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	165,170,599円
イオン・バランス戦略ファンド	62,708,255円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	53,943,344円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	194,819,214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)	781,960,428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)	554,786,828円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	56,290,476円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	1,268,467,849円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	38,733,500円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	239,073,042円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	261,836,676円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,628,730円
日興F W S・日本株インデックス	2,284,305,873円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	109,375,849円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	7,090,200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・DCターゲットイヤーファンド2045	5,734,021円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	1,721,552円
三井住友D S・DC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)	486,478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)	49,924,852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)	33,618,858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)	14,497,090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)	2,228,874,459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 >	8,209,345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 2 5 < 適格機関投資家専用 >	801,610,670円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	1,046,599,954円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	4,140,686,405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 >	28,176,463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 >	100,486,196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 >	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 2 5 < 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 5 0 < 適格機関投資家専用 >	578,015,629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 >	382,019,550円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	1,114,585,238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 >	24,835,775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 >	26,064,359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 >	23,786,189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 >	13,492,163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 >	59,753,192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 >	152,355,733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 >	32,537,804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 >	29,459,650円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	6,584,711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 >	28,335,632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 >	360,779,838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 >	139,929,666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 >	42,475,230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2 0 1 6 - 0 4 < 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	68,417,051,147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15日現在)

(2024年3月15日現在)

資産の部		
流動資産		
預金	3,492,115,139	7,300,853,055
金銭信託	15,796,300	15,804,630
コール・ローン	427,890,081	733,617,111
株式	577,749,851,255	698,536,860,276
投資証券	12,325,074,887	14,129,052,772
派生商品評価勘定	68,527,444	4,661,555
未収入金	482,588,717	5,944,777
未収配当金	942,431,642	1,200,230,652
差入委託証拠金	1,949,200,194	2,615,037,817
流動資産合計	597,453,475,659	724,542,062,645
資産合計	597,453,475,659	724,542,062,645
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	125,488	40,970,274
未払解約金	78,482,767	353,147,307
その他未払費用	3,079	2,158
流動負債合計	78,611,334	394,119,739
負債合計	78,611,334	394,119,739
純資産の部		
元本等		
元本	80,676,406,829	84,887,739,960
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	516,698,457,496	639,260,202,946
元本等合計	597,374,864,325	724,147,942,906
純資産合計	597,374,864,325	724,147,942,906
負債純資産合計	597,453,475,659	724,542,062,645

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月16日 至 2024年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

	(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15日現在)	(2024年3月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	80,676,406,829口	84,887,739,960口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 7.4046円 (1万口当たりの純資産額74,046円)	1口当たり純資産額 8.5307円 (1万口当たりの純資産額85,307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15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(2023年9月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT DEC23	5,601,444,960	-	5,648,236,440	46,791,480
	SPI 200 FUTURES SEP23	204,241,958	-	205,424,445	1,182,487
	FTSE 100 IDX FUT DEC23	305,980,208	-	312,342,050	6,361,842
	EURO STOXX 50 DEC23	1,030,539,845	-	1,043,830,742	13,290,897
	小計	7,142,206,971	-	7,209,833,677	67,626,706
	合計	7,142,206,971	-	7,209,833,677	67,626,706

(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 小計	265,180,570	-	265,955,962	775,392
	売建				
	アメリカ・ドル 小計	51,616,740	-	51,616,880	140
	合計	316,797,310	-	317,572,842	775,252

(2024年3月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT JUN24	8,955,827,624	-	8,916,440,130	39,387,494
	SPI 200 FUTURES MAR24	317,477,324	-	320,332,709	2,855,385
	FTSE 100 IDX FUT JUN24	457,052,546	-	456,084,276	968,270
	EURO STOXX 50 JUN24	1,592,467,968	-	1,591,985,354	482,614
	小計	11,322,825,462	-	11,284,842,469	37,982,993
	合計	11,322,825,462	-	11,284,842,469	37,982,993

(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	270,048,525	-	271,747,314	1,698,789
	スイス・フラン	41,998,750	-	41,980,650	18,100
	小計	312,047,275	-	313,727,964	1,680,689
	売建				
	アメリカ・ドル	164,229,940	-	164,236,354	6,414
	小計	164,229,940	-	164,236,354	6,414
	合 計	476,277,215	-	477,964,318	1,674,275

## (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15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	69,478,969,425円
同期中における追加設定元本額	20,151,472,888円
同期中における一部解約元本額	8,954,035,484円
2023年9月15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	39,997,503,982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	1,009,221,373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	21,251,827,109円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	118,408,334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)	141,038,963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)	491,564,646円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	294,517,834円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	395,447,991円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	61,702,017円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	2,216,968,852円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	11,186,228円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	55,569,565円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	53,014,111円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,877,095円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	919,140,475円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	289,823,294円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,322,728,347円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	94,202,209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)	1,150,564円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	5,647,061円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	2,870,419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)	1,593,156円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	352,393,712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>	4,049,938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>	386,759,286円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	598,426,678円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,641,373,346円



SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	8,840,391円
SMAM・バランスファンドVL50<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>	243,025,087円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	565,747,548円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	181,246円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	177,833,787円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	47,076,116円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	5,843,105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>	13,381,141円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	44,019,060円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	88,244,496円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	38,344,500円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	170,474,139円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	56,978,052円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,469,056,578円
SMAM・年金WR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WR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	80,676,406,829円

(2024年3月15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	80,676,406,829円
同期中における追加設定元本額	8,332,836,362円
同期中における一部解約元本額	4,121,503,231円
2024年3月15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	42,664,968,138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)	41,379,821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)	3,838,847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)	109,467,469円
外国株式指数ファンド	1,085,540,194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	22,688,974,083円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	101,416,244円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	139,821,746円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	81,524,499円
イオン・バランス戦略ファンド	42,297,657円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	27,902,795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)	520,753,335円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	320,924,844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DS・外国株式インデックス年金ファンド	2,634,081,890円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	10,845,711円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	57,321,934円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	58,610,821円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,894,959円
SMB C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	1,438,164,393円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	181,710,303円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,972,038,710円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	139,908,243円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	3,189,068円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	1,998,744円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	2,834,012円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	882,879円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	520,322円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	124,357円
三井住友DS・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DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	13,468,456円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	9,148,038円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	3,980,305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)	291,361,898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 >	2,250,301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 >	516,127,174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 >	2,316,975,862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 >	327,255,500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 >	473,279,710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

SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	40,990,345円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<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>	11,068,487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>	79,246,515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>	131,008,184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	84,887,739,960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15日現在)	(2024年3月15日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	1,908,679,199	2,129,116,698
金銭信託	4,584,730	2,535,748
コール・ローン	124,191,134	117,703,990
株式	30,128,690,518	35,654,948,681
投資信託受益証券	1,627,083,400	1,745,770,154
投資証券	2,762,821,675	3,295,220,125
派生商品評価勘定	17,038,360	264,207
未収入金	273,403	-
未収配当金	76,089,192	81,955,958
差入委託証拠金	847,065,152	711,740,755
流動資産合計	37,496,516,763	43,739,256,316
資産合計	37,496,516,763	43,739,256,316
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	-	15,199,271
未払解約金	60,818,010	13,308,298
その他未払費用	387	200
流動負債合計	60,818,397	28,507,769
負債合計	60,818,397	28,507,769
<b>純資産の部</b>		

元本等		
元本	20,327,562,024	22,021,369,983
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	17,108,136,342	21,689,378,564
元本等合計	37,435,698,366	43,710,748,547
純資産合計	37,435,698,366	43,710,748,547
負債純資産合計	37,496,516,763	43,739,256,316

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2023年9月16日 至 2024年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	( 2023年9月15日現在 )	( 2024年3月15日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	20,327,562,024口	22,021,369,983口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8416円 ( 1万口当たりの純資産額18,416円 )	1口当たり純資産額 1.9849円 ( 1万口当たりの純資産額19,849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15日現在 )
-----	------------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2023年9月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT DEC23	2,900,623,761	-	2,917,662,062	17,038,301
	小計	2,900,623,761	-	2,917,662,062	17,038,301
合計		2,900,623,761	-	2,917,662,062	17,038,301

(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	22,300,000	-	22,300,059	59
	小計	22,300,000	-	22,300,059	59
合計		22,300,000	-	22,300,059	59

(2024年3月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT JUN24	3,026,088,842	-	3,010,889,571	15,199,271

	小計	3,026,088,842	-	3,010,889,571	15,199,271
	合計	3,026,088,842	-	3,010,889,571	15,199,271

## (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	42,000,000	-	42,264,207	264,207
	小計	42,000,000	-	42,264,207	264,207
	合計	42,000,000	-	42,264,207	264,207

## (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15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	14,441,656,895円
同期中における追加設定元本額	8,044,472,398円
同期中における一部解約元本額	2,158,567,269円
2023年9月15日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	10,710,326,044円

三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,250,184,637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D S・DCターゲットイヤーファンド2050	49,438,741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)	256,731,249円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	367,566,031円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	121,710,317円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,768,119円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	770,546,384円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,977,128,489円
三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド	68,206,986円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	39,354円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	47,702円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	59,639円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	73,424円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	73,424円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	285,383円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	3,386,264円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	15,899,337円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	8,194,445円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	4,607,919円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	86,918,516円
合計	20,327,562,024円

(2024年3月15日現在)

## 開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	20,327,562,024円
同期中における追加設定元本額	3,489,666,183円
同期中における一部解約元本額	1,795,858,224円

## 2024年3月15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	11,648,252,461円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,346,163,469円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	253,413,519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D S・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)	455,811,882円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	304,651,806円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	455,919,044円

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	135,091,162円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	6,207,102円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	487,918,363円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	3,840,794,067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	6,164,014円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	1,914,824円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	1,119,406円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	133,551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)	13,546,460円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	9,212,589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)	3,832,033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	22,021,369,983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15日現在)	(2024年3月15日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	5,544,104	4,126,763
コール・ローン	150,178,660	191,555,499
投資証券	13,221,914,650	14,200,496,500
派生商品評価勘定	-	405,600
未収配当金	163,470,438	193,639,472
前払金	484,000	150,000
差入委託証拠金	2,290,000	1,913,131
流動資産合計	13,543,881,852	14,592,286,965
資産合計	13,543,881,852	14,592,286,965
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	458,400	-
未払金	99,233,996	177,716,574
未払解約金	13,288,333	489,739
その他未払費用	152	95
流動負債合計	112,980,881	178,206,408
負債合計	112,980,881	178,206,408
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	5,033,491,862	5,743,995,291
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	8,397,409,109	8,670,085,266
元本等合計	13,430,900,971	14,414,080,557



純資産合計	13,430,900,971	14,414,080,557
負債純資産合計	13,543,881,852	14,592,286,965

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月16日 至 2024年3月15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15日現在)	(2024年3月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,033,491,862口	5,743,995,291口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6683円 (1万口当たりの純資産額26,683円)	1口当たり純資産額 2.5094円 (1万口当たりの純資産額25,094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15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

## (デリバティブ取引に関する注記)

(2023年9月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物 0512月	37,778,400	-	37,320,000	458,400
	小計	37,778,400	-	37,320,000	458,400
合計		37,778,400	-	37,320,000	458,400

(2024年3月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物 0606月	33,824,400	-	34,230,000	405,600
	小計	33,824,400	-	34,230,000	405,600
合計		33,824,400	-	34,230,000	405,600

## (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15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,654,656,067円
同期中における追加設定元本額	2,802,607,298円
同期中における一部解約元本額	1,423,771,503円
2023年9月15日現在の元本の内訳	

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	235,220,778円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	314,261,793円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	140,438,642円
イオン・バランス戦略ファンド	66,667,862円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,544,565,576円
三井住友D S・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)	100,776,546円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	74,867,373円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	40,532,839円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,222,138円
三井住友D S・国内リートインデックス年金ファンド	232,836,373円
日興FWS・Jリートインデックス	592,546,805円
三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド	60,690,538円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	10,354円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	12,774円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	19,339円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	26,282円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	26,282円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	122,781円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	2,010,254円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	10,871,546円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	6,000,035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)	3,561,192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>	3,148,468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>	79,713,693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>	49,281,384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>	79,401,552円
S M D A M・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%) <適格機関投資家限定>	136,795,174円
合計	5,033,491,862円

(2024年3月15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,033,491,862円
同期中における追加設定元本額	1,665,752,265円
同期中における一部解約元本額	955,248,836円
2024年3月15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	2,696,794,762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)	51,353,884円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	214,273,450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	52,602,925円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,814,919円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	340,836,191円
日興FWS・Jリートインデックス	894,332,612円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	79,096,288円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	2,107,693円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	1,408,169円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	2,442,794円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	863,338円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	500,323円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	257,184円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	9,178,425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)	57,006,376円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	41,900,895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)	19,202,498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>	2,639,539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>	69,181,938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>	36,290,409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>	57,603,510円
合計	5,743,995,291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15日現在)	(2024年3月15日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	857,440,313	1,199,576,032
金銭信託	975,151	821,052
コール・ローン	26,414,872	38,111,460
投資証券	29,042,043,271	32,634,719,014
派生商品評価勘定	38,923	136,263
未収入金	2,868,865	1,671,315
未収配当金	92,083,991	113,874,953
流動資産合計	30,021,865,386	33,988,910,089
資産合計	30,021,865,386	33,988,910,089
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	319	19,265
未払解約金	1,242,834	8,468,069
その他未払費用	68	40

流動負債合計	1,243,221	8,487,374
負債合計	1,243,221	8,487,374
純資産の部		
元本等		
元本	9,988,366,894	10,605,492,914
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	20,032,255,271	23,374,929,801
元本等合計	30,020,622,165	33,980,422,715
純資産合計	30,020,622,165	33,980,422,715
負債純資産合計	30,021,865,386	33,988,910,089

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月16日 至 2024年3月15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15日現在)	(2024年3月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	9,988,366,894口	10,605,492,914口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.0056円 (1万口当たりの純資産額30,056円)	1口当たり純資産額 3.2040円 (1万口当たりの純資産額32,040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15日現在)
----	----------------

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(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15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	210,300,000	-	210,335,560	35,560
	カナダ・ドル	6,900,000	-	6,900,182	182
	オーストラリア・ドル	13,300,000	-	13,301,496	1,496
	香港・ドル	6,800,000	-	6,800,397	397
	シンガポール・ドル	6,900,000	-	6,901,288	1,288
	イギリス・ポンド	13,700,000	-	13,699,827	173
	ユーロ	12,000,000	-	11,999,854	146
	小計	269,900,000	-	269,938,604	38,604
合計	269,900,000	-	269,938,604	38,604	

(2024年3月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	227,300,000	-	227,414,231	114,231
	オーストラリア・ドル	21,400,000	-	21,399,561	439

市場取引以外の取引	香港・ドル	6,900,000	-	6,898,909	1,091
	シンガポール・ドル	8,700,000	-	8,701,808	1,808
	イギリス・ポンド	19,900,000	-	19,919,259	19,259
	ユーロ	10,000,000	-	10,000,965	965
	小計	294,200,000	-	294,334,733	134,733
売建	シンガポール・ドル	5,700,000	-	5,717,735	17,735
	小計	5,700,000	-	5,717,735	17,735
	合計	299,900,000	-	300,052,468	116,998

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (その他の注記)

(2023年9月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	8,386,046,114円
同期中における追加設定元本額	2,818,902,584円
同期中における一部解約元本額	1,216,581,804円
2023年9月15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	8,039,802,856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N I S A ・世界分散ファンド	113,009,551円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	949,162円
三井住友D S ・外国リートインデックス年金ファンド	348,822,432円
日興F W S ・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	87,420,396円
日興F W S ・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	623,759,950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)	367,326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)	1,830,091円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	907,718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)	525,808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202105(リスク3%) <適格機関投資家限定>	71,412,229円
合計	9,988,366,894円

(2024年3月15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	9,988,366,894円
同期中における追加設定元本額	1,259,525,408円
同期中における一部解約元本額	642,399,388円
2024年3月15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	8,363,753,473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)	38,588,464円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	164,364,963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	122,850,318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	375,150,796円
日興F W S ・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	67,082,061円
日興F W S ・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	915,077,138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 ・ D C ターゲットイヤーファンド2045	973,336円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2055	306,543円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2065	177,051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)	27,871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)	538,158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)	3,352,612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)	2,243,162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)	994,144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 >	29,005,107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 >	42,444,981円
合 計	10,605,492,914円

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2023年9月15日現在)	(2024年3月15日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	15,332,601	9,919,080
コール・ローン	415,329,411	460,422,467
国債証券	101,901,240,800	105,385,108,130
地方債証券	9,953,414,600	8,599,162,900
特殊債券	9,479,481,912	10,432,213,753
社債券	6,165,624,700	7,058,186,200
未収入金	-	144,028,900
未収利息	354,572,258	375,663,215
前払費用	21,006,614	20,043,143
流動資産合計	128,306,002,896	132,484,747,788
資産合計	128,306,002,896	132,484,747,788
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,300,000	161,245,037
その他未払費用	2,120	522
流動負債合計	1,302,120	161,245,559
負債合計	1,302,120	161,245,559
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	105,659,583,769	109,547,340,199
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	22,645,117,007	22,776,162,030
元本等合計	128,304,700,776	132,323,502,229
純資産合計	128,304,700,776	132,323,502,229
負債純資産合計	128,306,002,896	132,484,747,788

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月16日 至 2024年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2023年9月15日現在)	(2024年3月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	105,659,583,769口	109,547,340,199口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2143円 (1万口当たりの純資産額12,143円)	1口当たり純資産額 1.2079円 (1万口当たりの純資産額12,079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15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(2023年9月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	105,094,252,769円
同期中における追加設定元本額	29,696,685,417円
同期中における一部解約元本額	29,131,354,417円
2023年9月15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)	8,940,046,063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)	3,644,324,644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)	871,155,659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)	599,587,401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)	1,152,829,025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)	636,088,971円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	767,763,845円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	145,208,135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)	4,486,748,140円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,442,432,303円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,379,031,619円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	556,389,408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	273,849,780円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	370,323,791円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	770,607,826円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	241,462,029円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	9,993,939円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	395,316円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	340,706円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	234,563円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	113,477円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	115,120円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	2,360,942円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	13,074,446円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	35,502,467円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	8,768,052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)	1,033,789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>	9,435,418,855円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	5,717,595,087円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	14,505,099,336円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	299,776,143円

SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	486,840,988円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	264,798,022円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	116,608,704円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,721,293,475円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,097,868,199円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,143,532,384円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,504,519,879円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,001,996円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	998,088,789円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	378,194,192円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	465,426,832円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	171,339,049円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	47,446,788円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,192,304,936円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,995,130,514円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	588,317,252円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	208,632,864円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	21,745,950円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	253,927,864円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,607,178,796円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,270,648,412円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	801,786,380円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,280,562,535円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	2,417,659,545円
SMDAM・年金WR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	105,659,583,769円

(2024年3月15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	105,659,583,769円
同期中における追加設定元本額	13,269,942,167円
同期中における一部解約元本額	9,382,185,737円
2024年3月15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）	9,772,347,384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
SMAM・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）	194,236,574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）	638,153,034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）	1,275,458,249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）	139,053,232円

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	823,554,467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)	5,074,665,793円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,746,637,270円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,905,110,020円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	702,979,420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NISA・世界分散ファンド	327,473,798円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	414,767,468円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	928,833,470円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	306,092,130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	78,799,724円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	35,230,147円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	28,111,067円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	3,548,272円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	2,076,044円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	6,314,709円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	48,227,383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)	142,908,994円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	47,195,174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
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,031,782,182円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	8,479,859,471円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,886,694,559円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	15,391,388,506円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	306,375,000円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	497,670,273円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	274,074,334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>	118,270,332円
SMAM・インデックス・バランスVA25<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>	7,472,985,319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)	934,554,756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>	569,310,953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>	708,375,673円
合計	109,547,340,199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15日現在)	(2024年3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	218,793,439	224,671,263
金銭信託	36,951,414	31,259,516
コール・ローン	1,000,939,696	1,450,999,857
国債証券	165,512,534,936	177,120,083,587
未収利息	1,085,780,649	1,333,052,008
前払費用	89,372,318	118,386,670
流動資産合計	167,944,372,452	180,278,452,901
資産合計		
	167,944,372,452	180,278,452,901
負債の部		
流動負債		
未払解約金	80,059,162	86,015,426
その他未払費用	2,283	1,709
流動負債合計	80,061,445	86,017,135
負債合計		
	80,061,445	86,017,135
純資産の部		
元本等		
元本	79,403,960,652	81,266,649,100
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	88,460,350,355	98,925,786,666
元本等合計	167,864,311,007	180,192,435,766
純資産合計		
	167,864,311,007	180,192,435,766
負債純資産合計		
	167,944,372,452	180,278,452,901

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月16日 至 2024年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

	<p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 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15日現在)	(2024年3月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	79,403,960,652口	81,266,649,100口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.1141円 (1万口当たりの純資産額21,141円)	1口当たり純資産額 2.2173円 (1万口当たりの純資産額22,173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15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## （その他の注記）

（2023年9月15日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	76,838,969,286円
同期中における追加設定元本額	13,329,957,464円
同期中における一部解約元本額	10,764,966,098円
2023年9月15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	26,613,372,649円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	930,561,373円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	2,323,254,511円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,415,352,860円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	164,009,819円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	5,977,634円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	25,661,980円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	96,927,254円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	286,725,074円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	210,346,480円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	340,690,759円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	22,358,355円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	163,762,009円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	180,392,210円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	100,600,584円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	34,145,395円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	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）	614,777,543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）	94,136,142円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	211,253,808円
三井住友D S ・ 外国債券インデックス年金ファンド	894,259,424円
三井住友D S ・ 年金バランス30（債券重点型）	38,751,866円
三井住友D S ・ 年金バランス50（標準型）	126,408,326円
三井住友D S ・ 年金バランス70（株式重点型）	90,751,827円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	3,979,692円
日興F W S ・ 先進国債インデックス（為替ヘッジなし）	1,224,183,254円
三井住友D S ・ 先進国債インデックス・ファンド	239,163,580円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2035	26,867円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2040	31,324円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2045	39,141円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2055	47,947円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2065	47,947円
三井住友D S ・ 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）	4,467,427円
三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）	19,535,931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）	9,166,368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）	4,656,212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＞	4,734,826,504円



SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	24,742,199円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	4,745,643,462円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,776,414,227円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	8,946,687,136円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	29,825,111円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	70,919,769円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	650,211,181円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	105,409,785円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	891,341,019円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,260,343,854円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,251,043,047円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,841,934,104円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	6,593,586,445円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	317,910,827円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	109,188,358円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	61,534,170円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	29,749,375円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,741,981円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	70,264,649円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	350,309,527円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	76,242,287円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,643,421円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,511,845円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	820,004,466円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	489,884,162円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	668,807,457円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	284,791,331円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	229,812,549円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	119,206,614円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	57,520,352円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	91,943,891円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	1,335,263,034円
SMDAM・年金WR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	79,403,960,652円

(2024年3月15日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	79,403,960,652円
同期中における追加設定元本額	7,629,095,464円
同期中における一部解約元本額	5,766,407,016円
2024年3月15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	27,360,302,996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)	24,761,652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)	295,062,458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)	20,149,798円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	55,911,331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)	362,556,344円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	249,128,768円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	707,928,249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	238,132,651円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	1,099,200,692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)	144,060,975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	4,345,691円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	3,523,944,120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	4,794,872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	1,325,789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・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	598,369円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	8,896,240円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	37,964,348円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	20,360,430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)	7,206,277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>	5,112,653,950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>	4,038,943,266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>	647,667,067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

SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,182,676,466円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,570,435,999円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	6,168,455,377円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	291,026,315円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	101,932,994円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	55,570,310円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	29,310,007円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,741,981円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	63,095,153円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	324,638,043円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	69,680,156円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,190,973円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,805,044円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	775,133,314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>	475,694,440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>	617,018,437円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	244,430,422円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	211,356,046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>	139,618,688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>	73,927,877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>	118,450,386円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	1,151,299,991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>	354,052,429円
合計	81,266,649,100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15日現在)	(2024年3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	37,306,614	32,381,482
金銭信託	6,649,080	2,978,417
コール・ローン	180,110,230	138,251,749
国債証券	18,967,238,881	20,653,060,228
派生商品評価勘定	43,547,647	72,733,287
未収利息	117,667,974	148,388,853
前払費用	19,014,768	19,705,716
流動資産合計	19,371,535,194	21,067,499,732
資産合計	19,371,535,194	21,067,499,732
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	169,457,262	6,082,091
未払解約金	2,000,000	34,887,000

その他未払費用	392	115
流動負債合計	171,457,654	40,969,206
負債合計	171,457,654	40,969,206
純資産の部		
元本等		
元本	15,809,721,819	17,265,955,846
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,390,355,721	3,760,574,680
元本等合計	19,200,077,540	21,026,530,526
純資産合計	19,200,077,540	21,026,530,526
負債純資産合計	19,371,535,194	21,067,499,732

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2023年9月16日 至 2024年3月15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15日現在 )	( 2024年3月15日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	15,809,721,819口	17,265,955,846口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2144円 ( 1万口当たりの純資産額12,144円 )	1口当たり純資産額 1.2178円 ( 1万口当たりの純資産額12,178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15日現在 )
-----	------------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2023年9月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカ・ドル	9,145,118,008	-	9,287,677,815	142,559,807
	カナダ・ドル	382,479,901	-	388,870,818	6,390,917
	オーストラリア・ドル	282,744,725	-	285,723,648	2,978,923
	シンガポール・ドル	185,858,965	-	186,816,645	957,680
	ニュージーランド・ドル	43,144,661	-	43,537,100	392,439
	イギリス・ポンド	955,003,538	-	949,635,960	5,367,578
	イスラエル・シケル	57,719,381	-	58,148,590	429,209
	デンマーク・クローネ	61,506,134	-	61,142,010	364,124
	ノルウェー・クローネ	30,947,347	-	31,128,964	181,617
	スウェーデン・クローナ	36,574,925	-	36,375,144	199,781
	メキシコ・ペソ	195,309,807	-	195,556,973	247,166
	オフショア・人民元	1,260,443,264	-	1,275,762,768	15,319,504
	ポーランド・ズロチ	96,537,316	-	92,811,400	3,725,916
	ユーロ	6,332,967,693	-	6,299,077,445	33,890,248
	小計	19,066,355,665	-	19,192,265,280	125,909,615
合計	19,066,355,665	-	19,192,265,280	125,909,615	

(2024年3月15日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	9,755,472,372	-	9,701,794,500	53,677,872
	カナダ・ドル	419,677,271	-	418,152,098	1,525,173
	オーストラリア・ド ル	283,466,504	-	284,334,416	867,912
	シンガポール・ドル	191,893,573	-	191,883,815	9,758
	ニュージーランド・ ドル	51,723,664	-	51,605,577	118,087
	イギリス・ポンド	1,077,912,737	-	1,079,511,576	1,598,839
	イスラエル・シケ ル	71,791,814	-	69,715,212	2,076,602
	デンマーク・クロー ネ	55,874,888	-	55,817,784	57,104
	ノルウェー・クロー ネ	37,970,997	-	37,776,510	194,487
	スウェーデン・ク ローナ	44,535,764	-	44,221,917	313,847
	メキシコ・ペソ	188,511,174	-	191,721,010	3,209,836
	オフショア・人民元	1,837,340,954	-	1,826,158,686	11,182,268
	ポーランド・ズロチ	115,356,843	-	115,748,001	391,158
	ユーロ	6,687,541,519	-	6,683,977,776	3,563,743
	小計	20,819,070,074	-	20,752,418,878	66,651,196
	合計	20,819,070,074	-	20,752,418,878	66,651,196

## (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15日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	19,909,411,282円
同期中における追加設定元本額	10,273,265,842円
同期中における一部解約元本額	14,372,955,305円
2023年9月15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	863,354,572円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	1,355,355,626円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	592,648,683円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	1,184,245,243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	88,326,908円
日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）	607,138,193円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	2,955,830円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	16,388,961円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）	44,491,084円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	10,999,936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）	1,273,840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VA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	15,809,721,819円

（2024年3月15日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	15,809,721,819円
同期中における追加設定元本額	6,806,081,686円
同期中における一部解約元本額	5,349,847,659円
2024年3月15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）	1,760,997,166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	721,453,738円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,518,456,609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	104,830,985円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	381,397,526円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	5,886,041円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	47,451,604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)	140,799,947円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	46,494,561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)	4,679,684円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,016,449,500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>	6,033,676,399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	17,265,955,846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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
リース債務	3,567	2,564
顧客からの預り金	6,045	11,094
その他の預り金	196,515	128,069
<b>未払金</b>		
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
<b>固定負債</b>		
リース債務	4,525	1,960
繰延税金負債	1,279,409	550,493
退職給付引当金	5,084,506	5,027,832
その他の固定負債	4,620	-
固定負債合計	6,373,062	5,580,287
負債合計	25,291,730	20,178,752
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,000	2,000,000
<b>資本剰余金</b>		
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
<b>利益剰余金</b>		
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
<b>評価・換算差額等</b>		
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
システム統合関連費用	2	375,636
早期退職費用	3	260,075
支払補償費	4	-
その他特別損失		67,000
特別損失合計		786,362
税引前当期純利益		6,254,849
法人税、住民税及び事業税		3,101,482
法人税等調整額		965,673
法人税等合計		2,135,809
当期純利益		4,119,040

## (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		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 其他有価証券	-	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 其他有価証券

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

（有価証券関係）

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. XBR 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・資産最適化ファンド（1安定重視型）の2023年9月16日から2024年3月15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・資産最適化ファンド（1安定重視型）の2024年3月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年9月16日から2024年3月15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15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16日から2023年3月15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。

## 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・資産最適化ファンド（2やや安定型）の2023年9月16日から2024年3月15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・資産最適化ファンド（2やや安定型）の2024年3月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年9月16日から2024年3月15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15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16日から2023年3月15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。

## 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・資産最適化ファンド（3バランス型）の2023年9月16日から2024年3月15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・資産最適化ファンド（3バランス型）の2024年3月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年9月16日から2024年3月15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15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16日から2023年3月15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。



## 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・資産最適化ファンド（4やや成長型）の2023年9月16日から2024年3月15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・資産最適化ファンド（4やや成長型）の2024年3月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年9月16日から2024年3月15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15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16日から2023年3月15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。

## 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・資産最適化ファンド（5成長重視型）の2023年9月16日から2024年3月15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・資産最適化ファンド（5成長重視型）の2024年3月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年9月16日から2024年3月15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15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16日から2023年3月15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。