

**【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12月12日提出
【計算期間】	第2期中(自 2024年3月19日至 2024年9月18日)
【ファンド名】	三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル1（保守型） 三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル2（安定型） 三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型） 三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル4（成長型） 三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）
【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DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)

2024年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	44,542,982	99.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	85,278	0.19
合計(純資産総額)		44,628,260	100.00

(注)投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。以下同じ。

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	1,148,100	2.57

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)

2024年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	618,125,121	99.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,905,118	0.31
合計(純資産総額)		620,030,239	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	58,216,155	9.39

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)

2024年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	2,391,399,412	99.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	8,791,440	0.37
合計(純資産総額)		2,400,190,852	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	314,375,786	13.10

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)

2024年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	2,022,036,900	99.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	8,480,186	0.42
合計(純資産総額)		2,030,517,086	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	325,831,177	16.05

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)

2024年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	664,760,170	99.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	3,319,241	0.50
合計(純資産総額)		668,079,411	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	126,350,832	18.91

## (2)【運用実績】

### 【純資産の推移】

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2024年 3月18日)	24,404,041	24,404,041	10,414	10,414
2023年 9月末日	10,856,987	-	10,059	-
10月末日	15,616,275	-	9,922	-
11月末日	21,146,964	-	10,222	-
12月末日	21,375,760	-	10,333	-
2024年 1月末日	21,417,083	-	10,353	-
2月末日	26,501,894	-	10,396	-
3月末日	24,659,117	-	10,523	-
4月末日	31,401,143	-	10,417	-
5月末日	34,196,591	-	10,353	-
6月末日	34,527,446	-	10,453	-
7月末日	34,415,470	-	10,419	-
8月末日	34,500,329	-	10,445	-
9月末日	44,628,260	-	10,475	-

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2024年 3月18日)	258,398,396	258,398,396	10,891	10,891
2023年 9月末日	121,986,554	-	10,348	-
10月末日	165,181,112	-	10,207	-
11月末日	196,165,289	-	10,563	-
12月末日	215,822,751	-	10,649	-
2024年 1月末日	243,342,142	-	10,751	-
2月末日	247,893,444	-	10,822	-
3月末日	289,971,805	-	11,072	-
4月末日	328,138,044	-	11,009	-
5月末日	380,339,272	-	10,961	-
6月末日	442,624,747	-	11,077	-
7月末日	544,580,317	-	11,033	-
8月末日	587,857,612	-	11,057	-
9月末日	620,030,239	-	11,093	-

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2024年 3月18日)	1,121,962,337	1,121,962,337	11,214	11,214
2023年 9月末日	422,681,812	-	10,547	-
10月末日	584,799,661	-	10,401	-
11月末日	695,728,200	-	10,796	-
12月末日	819,751,151	-	10,868	-
2024年 1月末日	922,292,743	-	11,027	-
2月末日	997,821,021	-	11,116	-
3月末日	1,173,833,607	-	11,446	-
4月末日	1,334,417,200	-	11,415	-
5月末日	1,447,528,344	-	11,386	-
6月末日	1,754,400,620	-	11,528	-
7月末日	2,009,950,095	-	11,457	-
8月末日	2,250,810,006	-	11,468	-
9月末日	2,400,190,852	-	11,502	-

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）

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

第1期 (2024年 3月18日)	668,185,314	668,185,314	11,512	11,512
2023年 9月末日	207,479,223	-	10,739	-
10月末日	232,341,427	-	10,578	-
11月末日	338,062,245	-	11,006	-
12月末日	368,916,446	-	11,066	-
2024年 1月末日	506,814,244	-	11,279	-
2月末日	587,454,863	-	11,388	-
3月末日	707,975,730	-	11,789	-
4月末日	769,864,044	-	11,784	-
5月末日	977,031,140	-	11,772	-
6月末日	1,190,692,242	-	11,942	-
7月末日	1,736,259,163	-	11,839	-
8月末日	1,913,557,918	-	11,825	-
9月末日	2,030,517,086	-	11,853	-

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2024年 3月18日)	240,248,069	240,248,069	11,849	11,849
2023年 9月末日	80,671,477	-	10,947	-
10月末日	90,345,127	-	10,775	-
11月末日	128,298,154	-	11,242	-
12月末日	157,036,857	-	11,288	-
2024年 1月末日	205,090,228	-	11,561	-
2月末日	225,446,782	-	11,697	-
3月末日	249,833,406	-	12,171	-
4月末日	269,774,356	-	12,197	-
5月末日	345,663,192	-	12,208	-
6月末日	440,484,962	-	12,406	-
7月末日	539,023,246	-	12,272	-
8月末日	622,412,459	-	12,223	-
9月末日	668,079,411	-	12,244	-

## 【分配の推移】

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2023年 3月24日～2024年 3月18日	0

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2023年 3月24日～2024年 3月18日	0

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2023年3月24日～2024年3月18日	0

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2023年3月24日～2024年3月18日	0

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2023年3月24日～2024年3月18日	0

## 【収益率の推移】

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)

	収益率(%)
第1期	4.1
第2期(中間期)	0.3

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

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)

	収益率(%)
第1期	8.9
第2期(中間期)	0.8

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

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)

	収益率(%)
第1期	12.1
第2期(中間期)	1.1

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

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)

	収益率(%)
第1期	15.1

第2期(中間期)	1.1
----------	-----

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

#### 三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)

	収益率(%)
第1期	18.5
第2期(中間期)	1.1

(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9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	330,222,231,790	98.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	6,399,065,345	1.90
合計(純資産総額)		336,621,297,135	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	6,751,125,000	2.01
合計	買建	-	6,751,125,000	2.01

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

2024年9月30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	574,646,178,220	70.29
	イギリス	30,074,991,615	3.68
	カナダ	26,603,480,190	3.25
	スイス	24,123,837,879	2.95
	フランス	22,772,730,348	2.79
	ドイツ	19,281,269,558	2.36
	アイルランド	14,863,601,322	1.82
	オーストラリア	14,464,614,522	1.77
	オランダ	14,424,841,812	1.76
	デンマーク	7,237,063,213	0.89
	スウェーデン	7,234,878,162	0.89
	スペイン	5,871,515,702	0.72
	イタリア	4,655,647,420	0.57
	香港	3,249,827,334	0.40

	シンガポール	2,383,233,064	0.29
	フィンランド	2,204,089,920	0.27
	ジャージー	1,885,689,618	0.23
	ベルギー	1,705,566,512	0.21
	イスラエル	1,634,889,732	0.20
	ノルウェー	1,211,490,599	0.15
	ケイマン諸島	1,185,924,146	0.15
	バミューダ	1,013,778,137	0.12
	オランダ領キュ ラソー	733,380,281	0.09
	ニュージーラン ド	563,367,654	0.07
	リベリア	549,098,618	0.07
	ルクセンブルグ	430,431,937	0.05
	オーストリア	404,488,351	0.05
	ポルトガル	345,844,919	0.04
	パナマ	224,438,657	0.03
	マン島	63,509,447	0.01
	小計	786,043,698,889	96.15
新株予約権証券	カナダ	-	0.00
投資証券	アメリカ	13,889,448,196	1.70
	オーストラリア	1,512,799,528	0.19
	フランス	313,089,319	0.04
	イギリス	269,690,142	0.03
	シンガポール	201,390,106	0.02
	香港	174,592,613	0.02
	ケイマン諸島	80,758,561	0.01
	ベルギー	54,476,867	0.01
	カナダ	46,644,373	0.01
	小計	16,542,889,705	2.02
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	14,908,407,506	1.83
合計（純資産総額）		817,494,996,100	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	688,028,930	0.08
株価指数先物取引	買建	ドイツ	2,380,961,100	0.29
株価指数先物取引	買建	アメリカ	13,679,983,611	1.67
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	448,258,882	0.05
合計	買建	-	17,197,232,523	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	-	3,891,016,247	0.48

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2024年9月30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	9,524,707,306	18.25
	台湾	8,589,140,295	16.46
	ケイマン諸島	7,873,113,636	15.09
	韓国	5,178,652,958	9.92
	中国	2,989,639,656	5.73
	ブラジル	1,953,559,530	3.74
	南アフリカ	1,414,468,237	2.71
	インドネシア	817,693,654	1.57
	マレーシア	730,433,191	1.40
	タイ	719,609,798	1.38
	メキシコ	674,202,938	1.29
	ポーランド	390,366,853	0.75
	香港	370,695,864	0.71
	トルコ	311,213,232	0.60
	フィリピン	279,812,803	0.54
	ギリシャ	225,133,105	0.43
	チリ	198,248,124	0.38
	バミューダ	182,041,313	0.35
	アメリカ	161,708,124	0.31
	ハンガリー	112,465,208	0.22
	イギリス	66,889,819	0.13
	チェコ	59,653,561	0.11
	ルクセンブルグ	51,311,867	0.10
	コロンビア	44,868,185	0.09
	エジプト	33,445,131	0.06
	オランダ	28,250,531	0.05
ペルー	13,179,208	0.03	
シンガポール	12,241,951	0.02	
小計		43,006,746,078	82.42
投資信託受益証券	香港	1,927,046,716	3.69
投資証券	アメリカ	3,115,635,130	5.97
	メキシコ	230,692,586	0.44
	ブラジル	76,238,043	0.15
	小計	3,422,565,759	6.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	3,823,446,402	7.33
合計(純資産総額)		52,179,804,955	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	3,958,273,998	7.59
合計	買建	-	3,958,273,998	7.59

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	-	124,524,700	0.24
--------	----	---	-------------	------

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

2024年9月30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	106,859,210,390	78.10
地方債証券	日本	11,563,255,900	8.45
特殊債券	日本	10,123,577,021	7.40
社債券	日本	7,830,159,100	5.72
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	440,487,612	0.33
合計(純資産総額)		136,816,690,023	100.00

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年9月30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	82,914,705,419	45.56
	中国	19,650,489,053	10.80
	フランス	13,690,053,250	7.52
	イタリア	12,514,963,801	6.88
	ドイツ	10,874,696,943	5.98
	イギリス	9,797,447,781	5.38
	スペイン	8,126,937,235	4.47
	カナダ	3,454,723,406	1.90
	ベルギー	2,884,237,097	1.58
	オランダ	2,447,599,811	1.34
	オーストラリア	2,399,661,528	1.32
	オーストリア	2,076,080,161	1.14
	メキシコ	1,334,805,271	0.73
	マレーシア	977,561,259	0.54
	ポーランド	972,965,907	0.53
	フィンランド	940,792,284	0.52
	アイルランド	890,272,265	0.49
	シンガポール	754,115,194	0.41
	イスラエル	541,915,970	0.30
	ニュージーランド	503,894,420	0.28
デンマーク	484,075,334	0.27	
スウェーデン	290,056,838	0.16	
ノルウェー	283,802,284	0.16	
小計		178,805,852,511	98.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	3,175,566,238	1.74
合計(純資産総額)		181,981,418,749	100.00

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年9月30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	16,882,375,872	45.17
	中国	4,004,814,136	10.72
	フランス	2,800,080,919	7.49
	イタリア	2,553,103,044	6.83
	ドイツ	2,215,137,829	5.93
	イギリス	2,005,007,802	5.36
	スペイン	1,670,511,366	4.47
	カナダ	713,916,386	1.91
	ベルギー	592,327,712	1.58
	オランダ	494,534,258	1.32
	オーストラリア	490,328,357	1.31
	オーストリア	426,294,153	1.14
	シンガポール	340,839,968	0.91
	メキシコ	264,945,164	0.71
	ポーランド	190,957,013	0.51
	フィンランド	185,961,176	0.50
	アイルランド	173,339,247	0.46
	イスラエル	109,862,753	0.29
	ニュージーランド	102,180,289	0.27
	デンマーク	100,047,087	0.27
ノルウェー	57,015,727	0.15	
スウェーデン	55,196,154	0.15	
小計		36,428,776,412	97.48
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	943,314,125	2.52
合計（純資産総額）		37,372,090,537	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	-	60,324,341	0.16
為替予約取引	売建	-	36,410,933,827	97.43

## 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2024年9月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	トルコ	1,026,839,156	10.19
	サウジアラビア	963,696,688	9.56
	メキシコ	832,958,863	8.27
	アラブ首長国連邦	756,100,328	7.50
	ブラジル	712,085,536	7.07

	チリ	638,578,301	6.34
	ポーランド	601,280,526	5.97
	コロンビア	565,343,538	5.61
	ドミニカ共和国	507,462,242	5.04
	ハンガリー	443,937,400	4.41
	カタール	430,959,104	4.28
	パナマ	372,916,951	3.70
	ペルー	367,127,965	3.64
	南アフリカ	295,514,043	2.93
	オマーン	272,945,433	2.71
	中国	250,761,480	2.49
	インドネシア	246,422,774	2.45
	ウルグアイ	159,486,644	1.58
	フィリピン	110,181,279	1.09
	小計	9,554,598,251	94.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	521,939,251	5.18
合計(純資産総額)		10,076,537,502	100.00

## リート・インデックス・マザーファンド

2024年9月30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	15,409,516,500	98.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	237,073,255	1.52
合計(純資産総額)		15,646,589,755	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	34,350,000	0.22
合計	買建	-	34,350,000	0.22

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

2024年9月30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	32,403,062,787	76.82
	オーストラリア	3,090,948,746	7.33
	イギリス	1,993,321,326	4.73
	シンガポール	1,328,778,195	3.15
	フランス	784,641,358	1.86
	カナダ	592,149,666	1.40
	ベルギー	411,005,135	0.97
	香港	401,344,637	0.95
	スペイン	210,965,635	0.50
	ガーンジィ	84,473,384	0.20
	韓国	76,610,006	0.18

	オランダ	57,924,050	0.14
	イスラエル	38,295,358	0.09
	ニュージーランド	36,272,661	0.09
	アイルランド	14,079,064	0.03
	ドイツ	13,591,275	0.03
	イタリア	3,226,110	0.01
	小計	41,540,689,393	98.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	641,101,790	1.52
合計(純資産総額)		42,181,791,183	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	-	127,897,859	0.30

### ゴールド・インデックス・マザーファンド

2024年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	13,218,338,227	98.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	251,254,972	1.87
合計(純資産総額)		13,469,593,199	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	-	79,774,722	0.59

## 2【設定及び解約の実績】

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	28,380,396	4,946,088
第2期(中間期)	19,170,466	0

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	240,675,062	3,412,475
第2期(中間期)	325,141,629	3,492,578

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	1,003,889,516	3,391,734
第2期(中間期)	1,045,977,135	23,225,366

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	583,651,620	3,247,608
第2期(中間期)	1,127,178,081	14,219,524

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	208,518,523	5,754,802
第2期(中間期)	332,624,030	436,642

(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2期中間計算期間(2024年3月19日から2024年9月18日まで)の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により中間監査を受けております。

## 【三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2024年 3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年 9月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	9,807	2,394
コール・ローン	365,866	352,936
親投資信託受益証券	24,189,965	44,367,806
派生商品評価勘定	-	13,843
未収入金	6,608	22,829
流動資産合計	24,572,246	44,759,808
資産合計	24,572,246	44,759,808
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	13,648	-
未払受託者報酬	3,092	5,461
未払委託者報酬	151,073	265,752
その他未払費用	392	739
流動負債合計	168,205	271,952
負債合計	168,205	271,952
純資産の部		
元本等		
元本	23,434,308	42,604,774
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	969,733	1,883,082
(分配準備積立金)	448,497	448,497
元本等合計	24,404,041	44,487,856
純資産合計	24,404,041	44,487,856
負債純資産合計	24,572,246	44,759,808

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月24日 至 2023年 9月23日	第2期中間計算期間 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月18日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	64
有価証券売買等損益	3,857	327,841
為替差損益	22,396	27,862
<b>営業収益合計</b>	<b>26,253</b>	<b>355,767</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	642	5,461
委託者報酬	33,230	265,752
その他費用	7,746	739
<b>営業費用合計</b>	<b>41,618</b>	<b>271,952</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>67,871</b>	<b>83,815</b>
<b>経常利益又は経常損失（ ）</b>	<b>67,871</b>	<b>83,815</b>
<b>中間純利益又は中間純損失（ ）</b>	<b>67,871</b>	<b>83,815</b>
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（ ）	-	-
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>-</b>	<b>969,733</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>206,457</b>	<b>829,534</b>
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	206,457	829,534
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
<b>分配金</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>中間剰余金又は中間欠損金（ ）</b>	<b>138,586</b>	<b>1,883,082</b>

## (3)【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第2期中間計算期間 自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	23,434,308口	42,604,774口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0414円 (1万口当たりの純資産額10,414円)	1口当たり純資産額 1.0442円 (1万口当たりの純資産額10,442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2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2024年3月18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	824,089	-	837,737	13,648
	小計	824,089	-	837,737	13,648
合 計		824,089	-	837,737	13,648

第2期中間計算期間(2024年9月18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	1,151,139	-	1,137,296	13,843
	小計	1,151,139	-	1,137,296	13,843
合 計		1,151,139	-	1,137,296	13,843

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
期首元本額	1,000,000円	23,434,308円
期中追加設定元本額	27,380,396円	19,170,466円
期中一部解約元本額	4,946,088円	-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)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2024年 3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年 9月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	76,774	31,667
コール・ローン	2,864,331	4,667,500
親投資信託受益証券	257,524,737	611,007,548
派生商品評価勘定	-	663,598
未収入金	110,020	1,281,599
流動資産合計	260,575,862	617,651,912
資産合計	260,575,862	617,651,912
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	468,881	14,280
未払受託者報酬	32,298	72,325
未払委託者報酬	1,670,972	3,738,860
その他未払費用	5,315	10,777
流動負債合計	2,177,466	3,836,242
負債合計	2,177,466	3,836,242
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	237,262,587	558,911,638
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	21,135,809	54,904,032
(分配準備積立金)	9,967,661	9,860,520
元本等合計	258,398,396	613,815,670
純資産合計	258,398,396	613,815,670
負債純資産合計	260,575,862	617,651,912

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月24日 至 2023年 9月23日	第2期中間計算期間 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月18日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	2,362
有価証券売買等損益	99,773	1,352,811
為替差損益	257,293	2,812,928
<b>営業収益合計</b>	<b>357,066</b>	<b>4,168,101</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	1	-
受託者報酬	3,967	72,325
委託者報酬	206,425	3,738,860
その他費用	8,239	10,777
<b>営業費用合計</b>	<b>218,632</b>	<b>3,821,962</b>
営業利益又は営業損失（ ）	575,698	346,139
経常利益又は経常損失（ ）	575,698	346,139
中間純利益又は中間純損失（ ）	575,698	346,139
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	7,330	570
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	21,135,809
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,374,496	33,738,380
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,374,496	33,738,380
剰余金減少額又は欠損金増加額	117,962	316,866
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	117,962	316,866
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,673,506	54,904,032

## (3)【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第2期中間計算期間 自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	237,262,587口	558,911,638口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0891円 (1万口当たりの純資産額10,891円)	1口当たり純資産額 1.0982円 (1万口当たりの純資産額10,982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2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2024年3月18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	27,213,158	-	27,682,039	468,881
	小計	27,213,158	-	27,682,039	468,881
合計		27,213,158	-	27,682,039	468,881

第2期中間計算期間(2024年9月18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	58,317,648	-	57,668,330	649,318
	小計	58,317,648	-	57,668,330	649,318
合計		58,317,648	-	57,668,330	649,318

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
期首元本額	1,000,000円	237,262,587円
期中追加設定元本額	239,675,062円	325,141,629円
期中一部解約元本額	3,412,475円	3,492,578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）】

## （ 1 ）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （2024年 3月18日現在）	第2期中間計算期間 （2024年 9月18日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	224,319	117,579
コール・ローン	8,369,005	17,330,427
親投資信託受益証券	1,121,914,475	2,281,369,961
派生商品評価勘定	-	3,564,746
未収入金	796,745	6,686,807
流動資産合計	1,131,304,544	2,309,069,520
資産合計	1,131,304,544	2,309,069,520
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,758,846	60,214
未払金	-	14,884
未払受託者報酬	120,749	278,055
未払委託者報酬	6,442,177	14,831,771
その他未払費用	20,435	41,624
流動負債合計	9,342,207	15,226,548
負債合計	9,342,207	15,226,548
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,000,497,782	2,023,249,551
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	121,464,555	270,593,421
（分配準備積立金）	46,586,791	45,993,016
元本等合計	1,121,962,337	2,293,842,972
純資産合計	1,121,962,337	2,293,842,972
負債純資産合計	1,131,304,544	2,309,069,520

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月24日 至 2023年 9月23日	第2期中間計算期間 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月18日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1	7,190
有価証券売買等損益	257,196	5,285,486
為替差損益	1,340,914	13,837,736
<b>営業収益合計</b>	<b>1,083,717</b>	<b>19,130,412</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	71	1
受託者報酬	16,483	278,055
委託者報酬	881,021	14,831,771
その他費用	10,112	41,624
<b>営業費用合計</b>	<b>907,687</b>	<b>15,151,451</b>
営業利益又は営業損失（ ）	1,991,404	3,978,961
経常利益又は経常損失（ ）	1,991,404	3,978,961
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,991,404	3,978,961
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	31,696	317,859
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	121,464,555
剰余金増加額又は欠損金減少額	24,579,763	148,497,949
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	24,579,763	148,497,949
剰余金減少額又は欠損金増加額	201,512	3,030,185
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	201,512	3,030,185
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	22,355,151	270,593,421

## （ 3 ）【中間注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項目	第2期中間計算期間 自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

## （中間貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,000,497,782口	2,023,249,551口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1214円 (1万口当たりの純資産額11,214円)	1口当たり純資産額 1.1337円 (1万口当たりの純資産額11,337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2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2024年3月18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	153,457,559	-	156,216,405	2,758,846
	小計	153,457,559	-	156,216,405	2,758,846
合計		153,457,559	-	156,216,405	2,758,846

第2期中間計算期間(2024年9月18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	310,072,820	-	306,568,288	3,504,532
	小計	310,072,820	-	306,568,288	3,504,532
合計		310,072,820	-	306,568,288	3,504,532

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
期首元本額	1,000,000円	1,000,497,782円
期中追加設定元本額	1,002,889,516円	1,045,977,135円
期中一部解約元本額	3,391,734円	23,225,366円

## 【三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）】

## （ 1 ）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （2024年 3月18日現在）	第2期中間計算期間 （2024年 9月18日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	170,958	87,809
コール・ローン	6,378,187	12,942,595
親投資信託受益証券	666,221,024	1,958,122,133
派生商品評価勘定	-	3,678,966
未収入金	667,989	6,947,785
流動資産合計	673,438,158	1,981,779,288
資産合計	673,438,158	1,981,779,288
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,957,970	41,265
未払金	-	21,842
未払受託者報酬	60,421	203,159
未払委託者報酬	3,224,428	10,837,578
その他未払費用	10,025	30,385
流動負債合計	5,252,844	11,134,229
負債合計	5,252,844	11,134,229
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	580,404,012	1,693,362,569
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	87,781,302	277,282,490
（分配準備積立金）	27,762,621	27,364,106
元本等合計	668,185,314	1,970,645,059
純資産合計	668,185,314	1,970,645,059
負債純資産合計	673,438,158	1,981,779,288

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月24日 至 2023年 9月23日	第2期中間計算期間 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月18日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1	5,090
有価証券売買等損益	968,164	24,908,891
為替差損益	809,375	18,671,658
<b>営業収益合計</b>	<b>158,790</b>	<b>6,232,143</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	10	1
受託者報酬	7,323	203,159
委託者報酬	392,182	10,837,578
その他費用	8,747	30,385
<b>営業費用合計</b>	<b>408,262</b>	<b>11,071,123</b>
営業利益又は営業損失（ ）	249,472	17,303,266
経常利益又は経常損失（ ）	249,472	17,303,266
中間純利益又は中間純損失（ ）	249,472	17,303,266
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	38,194	48,834
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	87,781,302
剰余金増加額又は欠損金減少額	13,225,237	209,202,006
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	13,225,237	209,202,006
剰余金減少額又は欠損金増加額	231,669	2,348,718
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	231,669	2,348,718
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	12,782,290	277,282,490

## (3)【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第2期中間計算期間 自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	580,404,012口	1,693,362,569口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1512円 (1万口当たりの純資産額11,512円)	1口当たり純資産額 1.1637円 (1万口当たりの純資産額11,637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2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2024年3月18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	112,230,444	-	114,188,414	1,957,970
	小計	112,230,444	-	114,188,414	1,957,970
合計		112,230,444	-	114,188,414	1,957,970

第2期中間計算期間(2024年9月18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	318,663,823	-	315,026,122	3,637,701
	小計	318,663,823	-	315,026,122	3,637,701
合計		318,663,823	-	315,026,122	3,637,701

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
期首元本額	1,000,000円	580,404,012円
期中追加設定元本額	582,651,620円	1,127,178,081円
期中一部解約元本額	3,247,608円	14,219,524円

## 【三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2024年 3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年 9月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	103,395	29,079
コール・ローン	3,857,508	4,286,045
親投資信託受益証券	238,174,768	635,873,973
派生商品評価勘定	-	1,424,322
未収入金	270,237	2,628,614
流動資産合計	242,405,908	644,242,033
資産合計	242,405,908	644,242,033
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	867,288	3,343
未払受託者報酬	23,649	66,785
未払委託者報酬	1,262,823	3,564,844
その他未払費用	4,079	9,929
流動負債合計	2,157,839	3,644,901
負債合計	2,157,839	3,644,901
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	202,763,721	534,951,109
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	37,484,348	105,646,023
(分配準備積立金)	12,572,126	12,555,878
元本等合計	240,248,069	640,597,132
純資産合計	240,248,069	640,597,132
負債純資産合計	242,405,908	644,242,033

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月24日 至 2023年 9月23日	第2期中間計算期間 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月18日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	1,256
有価証券売買等損益	1,218,187	5,990,795
為替差損益	576,160	6,135,125
<b>営業収益合計</b>	<b>642,027</b>	<b>145,586</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	6	-
受託者報酬	4,520	66,785
委託者報酬	242,974	3,564,844
その他費用	8,323	9,929
<b>営業費用合計</b>	<b>255,823</b>	<b>3,641,558</b>
営業利益又は営業損失（ ）	386,204	3,495,972
経常利益又は経常損失（ ）	386,204	3,495,972
中間純利益又は中間純損失（ ）	386,204	3,495,972
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,268	7,355
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	37,484,348
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,243,167	71,751,000
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,243,167	71,751,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,698	85,998
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,698	85,998
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,619,405	105,646,023

## （ 3 ）【中間注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項目	第2期中間計算期間 自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

## （中間貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	202,763,721口	534,951,109口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1849円 (1万口当たりの純資産額11,849円)	1口当たり純資産額 1.1975円 (1万口当たりの純資産額11,975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2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2024年3月18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	47,932,703	-	48,799,991	867,288
	小計	47,932,703	-	48,799,991	867,288
合計		47,932,703	-	48,799,991	867,288

第2期中間計算期間(2024年9月18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	121,945,112	-	120,524,133	1,420,979
	小計	121,945,112	-	120,524,133	1,420,979
合計		121,945,112	-	120,524,133	1,420,979

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
期首元本額	1,000,000円	202,763,721円
期中追加設定元本額	207,518,523円	332,624,030円
期中一部解約元本額	5,754,802円	436,642円

(参考)

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

(1)貸借対照表

(単位：円)

(2024年9月18日現在)

資産の部

流動資産

金銭信託	38,167,895
コール・ローン	5,625,732,880
株式	316,252,739,240
派生商品評価勘定	3,029,800
未収配当金	125,467,439
前払金	76,945,000
差入委託証拠金	499,906,583
流動資産合計	322,621,988,837

資産合計

322,621,988,837

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	56,683,700
未払解約金	27,668,697
流動負債合計	84,352,397

負債合計	84,352,397
純資産の部	
元本等	
元本	70,455,254,248
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	252,082,382,192
元本等合計	322,537,636,440
純資産合計	322,537,636,440
負債純資産合計	322,621,988,837

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項 目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項 目	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	70,455,254,248口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 4.5779円 (1万口当たりの純資産額45,779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9月18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)

(2024年9月18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 0612月	6,388,213,900	-	6,334,560,000	53,653,900
	小計	6,388,213,900	-	6,334,560,000	53,653,900
	合計	6,388,213,900	-	6,334,560,000	53,653,900

## (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)

(2024年9月18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	68,414,614,168円
同期中における追加設定元本額	5,802,537,616円
同期中における一部解約元本額	3,761,897,536円
2024年9月18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	9,728,098,656円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	951,093,583円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,200,376,951円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,629,902,384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)	130,862,270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)	3,042,957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)	11,977,031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)	42,887,777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)	124,903,411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)	124,228,530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)	253,304,691円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,595,096,060円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	29,537,164,184円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	105,178,908円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	151,619,140円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	92,399,058円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	70,040,729円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	220,110,574円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	221,025,089円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	905,753,876円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	548,021,447円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	677,825,806円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	66,541,957円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	1,493,228,780円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	42,130,422円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	254,742,952円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	291,224,732円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	9,795,302円
日興FWS・日本株インデックス	2,802,285,684円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	228,075,914円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	23,040,928円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	14,474,296円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	15,224,099円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	8,267,077円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	5,275,441円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	875,783円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	24,192,794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)	117,393,795円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	123,701,189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)	47,814,523円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,993,156,333円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	7,061,523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>	33,548,131円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	696,968,941円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	977,324,801円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	3,842,256,121円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	23,860,855円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	91,834,407円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	561,545,046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>	29,035,936円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	155,287,022円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	543,730,636円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	344,922,224円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	1,024,338,247円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	22,216,667円

SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	23,652,147円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	17,992,772円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,108,995円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	53,729,988円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	143,857,608円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	28,624,594円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	28,432,856円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	6,486,356円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	24,746,633円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	324,341,423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)	147,428,669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>	132,037,002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>	53,003,126円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	37,593,666円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	24,166,736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>	25,219,091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>	15,386,731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>	24,463,796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>	23,379,285円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	10,117,443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>	57,199,661円
合計	70,455,254,248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)

(2024年9月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	7,836,617,597
金銭信託	3,967,132
コール・ローン	584,732,980
株式	763,686,484,909
投資証券	16,565,153,708
派生商品評価勘定	11,027,558
未収入金	13,786,978
未収配当金	1,055,863,006
差入委託証拠金	3,368,064,868
流動資産合計	793,125,698,736
資産合計	793,125,698,736
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	386,832
未払解約金	260,061,224

流動負債合計	260,448,056
負債合計	260,448,056
純資産の部	
元本等	
元本	89,306,311,702
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	703,558,938,978
元本等合計	792,865,250,680
純資産合計	792,865,250,680
負債純資産合計	793,125,698,736

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、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	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	89,306,311,702口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 8.8780円 (1万口当たりの純資産額88,780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9月18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、新株予約権証券、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）

(2024年9月18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 DEC24	9,968,028,145	-	9,969,777,152	1,749,007
	SPI 200 FUTURES SEP24	363,278,689	-	371,059,313	7,780,624
	FTSE 100 IDX FUT DEC24	500,198,848	-	500,109,314	89,534
	EURO STOXX 50 DEC24	1,711,160,565	-	1,711,597,822	437,257
	小計	12,542,666,247	-	12,552,543,601	9,877,354
	合計	12,542,666,247	-	12,552,543,601	9,877,354

## （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)

契約額等	
------	--

区分	種類		うち 1年超	時価	評価損益
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	260,600,264	-	261,656,140	1,055,876
	ユーロ	40,632,755	-	40,629,840	2,915
	小計	301,233,019	-	302,285,980	1,052,961
	売建				
	アメリカ・ドル	92,876,480	-	92,876,480	-
	オーストラリア・ド ル	28,461,900	-	28,751,490	289,590
	小計	121,338,380	-	121,627,970	289,590
	合計		422,571,399	-	423,913,950

## (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)

(2024年9月18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	84,869,986,453円
同期中における追加設定元本額	8,670,607,049円
同期中における一部解約元本額	4,234,281,800円
2024年9月18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	44,978,651,544円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	247,742,375円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	956,054,621円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	766,986,589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)	28,648,686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)	679,815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)	2,679,721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)	11,113,114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)	33,803,961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)	42,254,871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)	95,689,898円
外国株式指数ファンド	1,210,624,971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	24,324,748,344円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	23,754,138円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	67,345,056円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	40,858,189円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	33,382,010円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	159,273,974円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	147,413,953円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	589,741,929円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	365,764,014円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	523,440,476円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	70,941,793円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	3,125,273,264円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	11,128,354円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	57,165,915円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	61,059,103円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,714,636円
SMB C・DCインデックスファンド(M S C I コクサイ)	2,314,045,976円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	165,327,238円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	3,650,696,562円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	167,369,130円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	9,630,196円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	6,305,022円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	7,095,394円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	3,948,075円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	2,562,663円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	175,874円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	5,197,848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)	25,812,503円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	27,593,843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)	10,630,651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)	235,799,660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 >	1,796,780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 >	8,507,417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 >	244,702,267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 >	451,986,789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 >	2,044,178,308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 >	6,385,797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 >	32,476,182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 >	336,590,787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 >	23,753,768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 >	54,210,390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 >	286,136,389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 >	183,205,513円

SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	404,330,166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)	165,260,941円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	35,586,512円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	4,094,878円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	3,762,642円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	3,045,479円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	9,255,993円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	31,912,804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>	68,971,315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>	28,947,304円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	113,387,274円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	42,612,522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>	20,452,057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>	17,673,700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>	11,287,097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>	18,145,014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>	12,599,975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>	27,929,693円
合計	89,306,311,702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)

(2024年9月18日現在)

## 資産の部

## 流動資産

預金	2,418,913,251
金銭信託	1,672,977
コール・ローン	246,587,353
株式	39,660,184,811
投資信託受益証券	1,543,089,037
投資証券	3,301,640,641
派生商品評価勘定	35,797,015
未収入金	159,215
未収配当金	107,195,374
差入委託証拠金	667,199,361
流動資産合計	47,982,439,035

## 資産合計

47,982,439,035

## 負債の部

## 流動負債

派生商品評価勘定	21,222,465
未払解約金	10,501,460
流動負債合計	31,723,925

## 負債合計

31,723,925

純資産の部	
元本等	
元本	23,889,928,774
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	24,060,786,336
元本等合計	47,950,715,110
純資産合計	47,950,715,110
負債純資産合計	47,982,439,035

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18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	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	23,889,928,774口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.0072円 (1万口当たりの純資産額20,072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9月18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）

(2024年9月18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 SEP24	3,351,728,329	-	3,365,483,172	13,754,843
	小計	3,351,728,329	-	3,365,483,172	13,754,843
合計		3,351,728,329	-	3,365,483,172	13,754,843

## (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	166,900,000	-	167,719,014	819,014
	小計	166,900,000	-	167,719,014	819,014
	売建				

	アメリカ・ドル	70,000,000	-	69,999,307	693
	小計	70,000,000	-	69,999,307	693
	合 計	236,900,000	-	237,718,321	819,707

## (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)

(2024年9月18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	22,032,341,427円
同期中における追加設定元本額	3,226,519,337円
同期中における一部解約元本額	1,368,931,990円
2024年9月18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	12,841,087,357円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,533,976,621円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	21,555,748円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	163,832,351円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	110,983,901円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	73,979,089円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	129,079,159円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	100,737,280円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	495,929,929円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	343,107,308円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	528,563,853円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	154,489,712円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	10,500,026円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	445,096,411円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	4,601,699,823円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	101,619,358円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	20,642,992円

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	13,696,789円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	15,545,306円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	8,753,989円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	5,534,686円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	298,679円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	8,293,357円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	39,807,868円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	42,432,334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)	16,463,051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>	62,221,797円
合計	23,889,928,774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)

(2024年9月18日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,951,051
コール・ローン	434,968,287
国債証券	107,160,813,130
地方債証券	11,576,071,050
特殊債券	10,143,031,657
社債券	7,734,655,600
未収入金	454,306,600
未収利息	407,040,513
前払費用	26,517,632
流動資産合計	137,940,355,520
資産合計	137,940,355,520
負債の部	
流動負債	
未払解約金	172,471,000
流動負債合計	172,471,000
負債合計	172,471,000
純資産の部	
元本等	
元本	114,526,606,193
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	23,241,278,327
元本等合計	137,767,884,520
純資産合計	137,767,884,520
負債純資産合計	137,940,355,520

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18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	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	114,526,606,193口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2029円 (1万口当たりの純資産額12,029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9月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(2024年9月18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	109,512,290,248円

同期中における追加設定元本額	16,202,564,721円
同期中における一部解約元本額	11,188,248,776円
2024年9月18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)	10,343,539,283円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	16,888,922,140円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	4,452,977,078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)	882,745,466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)	43,596,669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)	168,936,664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)	631,790,723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)	1,290,173,672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)	737,500,143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)	881,997,715円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	135,923,163円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,571,602,308円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,128,067,579円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	432,894,496円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	185,583,392円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	3,838,117,862円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,152,749,545円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,399,387,825円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	582,772,045円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	90,370,739円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	395,038,749円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	458,193,684円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	1,022,810,205円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	352,510,961円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	19,874,233円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	264,877,000円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	129,129,979円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	83,137,314円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	16,592,600円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	10,595,273円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	12,241,466円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	117,834,547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)	301,057,687円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	151,565,792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)	13,623,862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>	997,067,571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>	7,345,516,444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>	5,873,840,831円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	15,313,360,430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>	299,682,684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>	492,021,940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>	284,234,196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>	122,911,810円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,771,183,954円

SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,237,429,887円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,071,263,718円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,229,348,513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)	885,421,999円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	365,526,555円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	416,257,652円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	140,691,746円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	54,178,432円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,053,377,150円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,912,644,726円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	532,613,671円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	228,840,970円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	26,228,031円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	234,896,115円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,480,421,738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>	1,372,264,667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>	665,197,090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>	1,061,464,793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>	4,256,860,308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>	613,126,713円
合 計	114,526,606,193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)

(2024年9月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	255,819,866
金銭信託	8,143,846
コール・ローン	1,200,357,052
国債証券	177,522,332,795
未収入金	109,000,000
未収利息	1,338,421,632
前払費用	108,699,144
流動資産合計	180,542,774,335
資産合計	
180,542,774,335	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	80,805,810
流動負債合計	80,805,810
負債合計	
80,805,810	
純資産の部	
元本等	

元本		80,629,901,493
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		99,832,067,032
元本等合計		180,461,968,525
純資産合計		180,461,968,525
負債純資産合計		180,542,774,335

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	80,629,901,493口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.2382円 (1万口当たりの純資産額22,382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9月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

	<p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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。</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)

(2024年9月18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	81,276,928,619円
同期中における追加設定元本額	6,293,480,310円
同期中における一部解約元本額	6,940,507,436円
2024年9月18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	28,345,678,996円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,002,073,370円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,523,871,866円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,532,824,942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)	167,861,301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)	5,567,516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)	21,970,186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)	80,585,426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)	252,816,462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)	211,076,276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)	353,704,343円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	19,525,984円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	38,612,613円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	64,743,524円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	40,503,731円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	52,122,910円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	397,092,412円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	272,850,257円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	800,274,081円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	261,559,099円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	143,088,978円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	277,027,246円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	1,360,378,043円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	44,539,158円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	151,428,714円

三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	121,439,101円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	7,277,256円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	4,472,661,857円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	329,834,076円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	14,950,436円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	9,480,528円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	10,584,382円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	6,063,479円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	3,874,367円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	1,120,762円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	3,989,577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)	18,685,645円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	18,766,300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)	7,167,837円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	5,458,669,632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>	18,176,913円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	3,434,094,933円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,386,540,500円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	8,180,290,949円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	25,374,037円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	64,513,915円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	652,639,659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>	94,448,421円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	787,304,796円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,169,912,566円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,106,440,614円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,286,663,120円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	5,703,411,356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)	267,494,495円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	95,826,153円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	50,442,563円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	22,317,166円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,781,731円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	56,501,585円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	304,304,665円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	60,667,510円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	35,582,152円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,723,530円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	692,755,925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>	445,487,788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>	580,475,822円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	219,399,292円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	195,107,235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>	149,601,796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>	90,241,775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>	143,958,855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>	149,555,150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>	236,521,857円
合計	80,629,901,493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)

(2024年9月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	55,069,173
金銭信託	1,115,720
コール・ローン	164,450,848
国債証券	36,169,343,390
派生商品評価勘定	877,879,900
未収利息	201,444,371
前払費用	93,940,268
流動資産合計	37,563,243,670
資産合計	37,563,243,670
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,863,395
未払解約金	45,205,760
流動負債合計	48,069,155
負債合計	48,069,155
純資産の部	
元本等	
元本	30,168,816,295
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	7,346,358,220
元本等合計	37,515,174,515
純資産合計	37,515,174,515
負債純資産合計	37,563,243,670

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18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</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	30,168,816,295口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2435円 (1万口当たりの純資産額12,435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9月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## （デリバティブ取引に関する注記）

（2024年9月18日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

	契 約 額 等	
--	---------	--

区 分	種 類		うち 1年超	時 価	評価損益
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	33,402,971	-	32,503,600	899,371
	カナダ・ドル	1,076,790	-	1,040,300	36,490
	オーストラリア・ド ル	1,964,476	-	1,913,500	50,976
	デンマーク・クロー ネ	215,469	-	210,900	4,569
	メキシコ・ペソ	1,978,322	-	1,990,548	12,226
	ユーロ	22,491,831	-	22,028,300	463,531
	小計	61,129,859	-	59,687,148	1,442,711
	売建				
	アメリカ・ドル	17,116,557,245	-	16,691,305,200	425,252,045
	カナダ・ドル	740,241,648	-	715,726,400	24,515,248
	オーストラリア・ド ル	491,624,572	-	478,375,000	13,249,572
	シンガポール・ドル	338,519,497	-	331,968,000	6,551,497
	ニュージーランド・ ドル	102,374,761	-	99,038,850	3,335,911
	イギリス・ポンド	2,013,352,923	-	1,967,658,350	45,694,573
	イスラエル・シユケ ル	116,330,735	-	108,814,212	7,516,523
	デンマーク・クロー ネ	100,735,779	-	98,701,200	2,034,579
	ノルウェー・クロー ネ	57,914,153	-	56,364,750	1,549,403
	スウェーデン・ク ローナ	55,289,960	-	54,171,000	1,118,960
	メキシコ・ペソ	267,650,821	-	269,018,876	1,368,055
	オフショア・人民元	4,042,344,219	-	3,926,768,532	115,575,687
	ポーランド・ズロチ	192,422,075	-	188,286,903	4,135,172
	ユーロ	11,158,055,251	-	10,930,757,150	227,298,101
	小計	36,793,413,639	-	35,916,954,423	876,459,216
	合 計	36,854,543,498	-	35,976,641,571	875,016,505

## (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あります。

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あります。

- ・ 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)

(2024年9月18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	17,274,485,812円
同期中における追加設定元本額	13,859,396,527円
同期中における一部解約元本額	965,066,044円
2024年9月18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)	1,997,842,238円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,201,553,605円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	848,422,165円
イオン・バランス戦略ファンド	1,260,478,663円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	3,398,635,377円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,573,946,740円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,650,606,842円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	730,726,946円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	97,175,055円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	127,986,090円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	331,686,007円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	14,903,918円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	141,698,232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)	367,591,701円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	182,502,932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)	16,859,938円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	970,009,355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>	10,283,969,685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>	915,871,890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>	512,269,018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>	817,092,061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>	726,987,837円
合計	30,168,816,295円

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

(1)貸借対照表

(単位:円)

(2024年9月18日現在)

資産の部

流動資産		
預金		366,119,198
金銭信託		507,466
コール・ローン		74,797,606
国債証券		9,546,284,139
派生商品評価勘定		462,600
未収入金		11,000,000
未収利息		124,753,739
前払費用		8,946,100
流動資産合計		10,132,870,848
資産合計		10,132,870,848
負債の部		
流動負債		
未払金		147,502,895
未払解約金		1,600,388
流動負債合計		149,103,283
負債合計		149,103,283
純資産の部		
元本等		
元本		9,104,153,324
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		879,614,241
元本等合計		9,983,767,565
純資産合計		9,983,767,565
負債純資産合計		10,132,870,848

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18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	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	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	9,104,153,324口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0966円 (1万口当たりの純資産額10,966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9月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月18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	63,257,400	-	63,720,000	462,600
	小計	63,257,400	-	63,720,000	462,600
	合計	63,257,400	-	63,720,000	462,600

## (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）

（2024年9月18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	7,493,553,376円
同期中における追加設定元本額	1,757,316,466円
同期中における一部解約元本額	146,716,518円
2024年9月18日現在の元本の内訳	
日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）	299,442,944円
日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）	7,514,312,058円
三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド	129,771,691円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	132,298,874円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	362,503,867円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	239,161,536円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	61,455,847円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	8,804,420円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	17,655,715円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	11,144,351円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	12,792,849円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	7,242,158円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	4,640,665円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	311,208円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	18,833,374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）	107,139,354円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	124,840,013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）	51,802,400円
合計	9,104,153,324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）

（2024年9月18日現在）

資産の部

流動資産

金銭信託	510,766
コール・ローン	75,284,030
投資証券	15,569,980,500
未収配当金	199,326,352
前払金	68,000
差入委託証拠金	2,141,758
流動資産合計	15,847,311,406
資産合計	15,847,311,406
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	162,400
未払金	39,531,192
未払解約金	6,937,736
流動負債合計	46,631,328
負債合計	46,631,328
純資産の部	
元本等	
元本	6,050,773,615
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,749,906,463
元本等合計	15,800,680,078
純資産合計	15,800,680,078
負債純資産合計	15,847,311,406

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18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	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	6,050,773,615口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6113円 (1万口当たりの純資産額26,113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9月18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）

(2024年9月18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 0612月	35,002,400	-	34,840,000	162,400
	小計	35,002,400	-	34,840,000	162,400
	合計	35,002,400	-	34,840,000	162,400

## （注）1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (その他の注記)

(2024年9月18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	5,754,272,779円
同期中における追加設定元本額	1,187,395,373円
同期中における一部解約元本額	890,894,537円
2024年9月18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)	60,530,524円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	143,794,181円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	104,273,357円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,830,659,271円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	32,189,464円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	48,821,857円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	52,586,537円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	239,482,273円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	156,128,374円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	127,306,138円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	61,188,113円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,495,227円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	399,465,877円
日興FWS・Jリートインデックス	1,131,740,770円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	190,247,563円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	6,123,718円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	4,111,113円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	5,773,534円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	3,728,679円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	2,393,809円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	415,601円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	18,719,566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)	95,922,950円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	103,711,157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)	40,514,770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>	2,641,141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>	69,740,411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>	43,842,620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>	70,225,020円
合計	6,050,773,615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)

(2024年9月18日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	1,345,332,571

金銭信託	2,082,907
コール・ローン	307,008,729
投資証券	39,923,958,197
派生商品評価勘定	662,048
未収入金	2,207,495
未収配当金	136,938,570
流動資産合計	41,718,190,517
資産合計	41,718,190,517
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,165
未払解約金	213,490
流動負債合計	216,655
負債合計	216,655
純資産の部	
元本等	
元本	11,582,944,955
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	30,135,028,907
元本等合計	41,717,973,862
純資産合計	41,717,973,862
負債純資産合計	41,718,190,517

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18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</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	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	11,582,944,955口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.6017円 (1万口当たりの純資産額36,017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9月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び 差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する 事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## （デリバティブ取引に関する注記）

(2024年9月18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	246,500,000	-	246,893,244	393,244
	カナダ・ドル	9,000,000	-	8,997,556	2,444
	オーストラリア・ドル	23,100,000	-	23,231,927	131,927
	シンガポール・ドル	8,800,000	-	8,842,612	42,612
	イギリス・ポンド	13,000,000	-	13,045,317	45,317
	ユーロ	9,900,000	-	9,948,227	48,227
	小計	310,300,000	-	310,958,883	658,883
合 計	310,300,000	-	310,958,883	658,883	

## （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)

(2024年9月18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	10,694,933,338円
同期中における追加設定元本額	1,216,774,493円
同期中における一部解約元本額	328,762,876円
2024年9月18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)	9,287,763円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	14,066,046円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	8,047,360円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	9,064,778,235円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	11,148,089円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	38,740,973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)	167,348,435円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	112,510,735円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	94,715,195円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	132,220,140円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,569,833円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	442,792,646円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	61,625,528円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	1,123,512,371円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	154,702,343円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	3,744,661円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	2,066,872円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	2,234,489円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	1,250,247円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	817,062円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	60,300円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	1,130,199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）	6,189,308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）	6,844,237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）	2,761,958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 >	28,476,244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 >	51,715,222円
合 計	11,582,944,955円

## ゴールド・インデックス・マザーファンド

## ( 1 ) 貸借対照表

( 単位：円 )

( 2024年9月18日現在 )

資産の部	
流動資産	
預金	168,886,281
金銭信託	835,400
コール・ローン	123,133,302
投資信託受益証券	12,489,183,030
流動資産合計	12,782,038,013
資産合計	12,782,038,013
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	41
未払金	28,862,156
未払解約金	1,211,649
流動負債合計	30,073,846
負債合計	30,073,846
純資産の部	
元本等	
元本	7,246,594,854
剰余金	
剰余金又は欠損金 ( )	5,505,369,313
元本等合計	12,751,964,167
純資産合計	12,751,964,167
負債純資産合計	12,782,038,013

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

	<p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	7,246,594,854口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7597円 (1万口当たりの純資産額17,597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9月18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（投資信託受益証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## （デリバティブ取引に関する注記）

（2024年9月18日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

	契 約 額 等	
--	---------	--

区 分	種 類		うち 1 年超	時 価	評価損益
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	29,169,641	-	29,169,600	41
	小計	29,169,641	-	29,169,600	41
	合 計	29,169,641	-	29,169,600	41

## (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)

(2024年9月18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	6,243,929,441円
同期中における追加設定元本額	1,236,964,616円
同期中における一部解約元本額	234,299,203円
2024年9月18日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)	201,831,311円
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)	6,163,096,130円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)	618,561,392円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	447,328円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	21,016,266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)	104,311,945円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	101,180,391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)	36,150,091円
合 計	7,246,594,854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9月30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9月30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	656	12,573,982
単位型株式投資信託	85	656,370
追加型公社債投資信託	1	22,975
単位型公社債投資信託	146	233,812
合計	888	13,487,141

## (3)【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

該当ありません。

(ロ) その他の重要事項

該当ありません。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

## 5【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、当事業年度（2023年4月1日から2024年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	37,742,400	66,540,261
金銭の信託	12,645,575	23,435,831
顧客分別金信託	300,046	300,051
前払費用	546,900	583,635
未収入金	437,880	193,837
未収委託者報酬	11,563,662	14,480,419
未収運用受託報酬	2,138,030	3,342,186
未収投資助言報酬	344,586	406,420
未収収益	35,477	84,166
その他の流動資産	8,423	43,391
流動資産合計	65,762,982	109,410,202
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	1,361,305	1,265,924
器具備品	559,057	516,485
土地	710	710
リース資産	4,114	1,782
建設仮勘定	81,240	-
有形固定資産合計	2,006,427	1,784,901
無形固定資産		
ソフトウェア	2,414,295	2,606,617
ソフトウェア仮勘定	508,956	101,101
のれん	3,045,409	2,740,868
顧客関連資産	11,445,340	9,332,065
電話加入権	12,706	12,706
商標権	36	30
無形固定資産合計	17,426,744	14,793,389
投資その他の資産		
投資有価証券	9,222,276	9,976,957
関係会社株式	11,850,598	1,927,221
長期差入保証金	1,388,987	1,361,654
長期前払費用	80,207	44,009
会員権	90,479	90,479
繰延税金資産	-	716,093
貸倒引当金	20,750	20,750
投資その他の資産合計	22,611,799	14,095,666
固定資産合計	42,044,971	30,673,957

資産合計

107,807,953

140,084,160

(単位：千円)

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
リース債務	2,564	1,960
顧客からの預り金	11,094	21,728
その他の預り金	128,069	166,944
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	2,013	1,927
未払償還金	1,312	1,253
未払手数料	5,194,011	6,580,971
その他未払金	259,542	642,514
未払費用	6,370,986	7,405,559
未払消費税等	406,770	937,155
未払法人税等	333,009	5,104,541
賞与引当金	1,801,492	2,854,060
資産除去債務	13,940	-
その他の流動負債	73,657	17,443
<b>流動負債合計</b>	<b>14,598,465</b>	<b>23,736,060</b>
<b>固定負債</b>		
リース債務	1,960	-
繰延税金負債	550,493	-
退職給付引当金	5,027,832	4,941,989
<b>固定負債合計</b>	<b>5,580,287</b>	<b>4,941,989</b>
<b>負債合計</b>	<b>20,178,752</b>	<b>28,678,050</b>
<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
<b>資本剰余金合計</b>	<b>82,095,946</b>	<b>82,095,946</b>
<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	3,391,568	27,075,963
<b>利益剰余金合計</b>	<b>3,675,814</b>	<b>27,360,208</b>
<b>株主資本計</b>	<b>87,771,760</b>	<b>111,456,155</b>
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	142,558	50,045
<b>評価・換算差額等合計</b>	<b>142,558</b>	<b>50,045</b>
<b>純資産合計</b>	<b>87,629,201</b>	<b>111,406,109</b>
<b>負債・純資産合計</b>	<b>107,807,953</b>	<b>140,084,160</b>

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

至 2023年3月31日)

至 2024年3月31日)

営業収益		
委託者報酬	61,471,271	69,953,226
運用受託報酬	8,978,419	11,147,187
投資助言報酬	1,273,386	1,302,916
その他営業収益		
サービス支援手数料	208,222	319,553
その他	22,995	8,758
営業収益計	71,954,296	82,731,642
営業費用		
支払手数料	28,036,456	32,014,851
広告宣伝費	294,588	320,694
調査費		
調査費	3,749,357	4,637,211
委託調査費	11,455,987	12,412,033
営業雑経費		
通信費	61,068	56,291
印刷費	452,951	457,187
協会費	38,701	38,305
諸会費	33,447	30,484
情報機器関連費	5,067,617	5,268,275
販売促進費	29,621	31,339
その他	197,696	253,344
営業費用合計	49,417,495	55,520,019
一般管理費		
給料		
役員報酬	219,872	232,329
給料・手当	7,807,797	8,043,456
賞与	1,042,472	1,073,375
賞与引当金繰入額	1,798,492	2,854,060
交際費	27,713	57,134
寄付金	25,518	26,400
事務委託費	1,727,189	2,022,734
旅費交通費	99,733	166,596
租税公課	352,030	600,468
不動産賃借料	1,268,303	1,249,392
退職給付費用	624,551	712,228
固定資産減価償却費	3,247,869	3,281,572
のれん償却費	304,540	304,540
諸経費	200,758	215,455
一般管理費合計	18,746,845	20,839,745
営業利益	3,789,956	6,371,877

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	1,755	11,021,392
受取利息	1,373	2,840
金銭の信託運用益	-	199,056
時効成立分配金・償還金	521	461
原稿・講演料	2,281	2,143
投資有価証券償還益	119,033	5,384

投資有価証券売却益		25,848	12,261
為替差益		5,816	-
雑収入		91,814	129,137
営業外収益合計		248,443	11,372,678
営業外費用			
金銭の信託運用損		454,339	-
投資有価証券償還損		83,598	10,829
投資有価証券売却損		152,691	48,575
為替差損		-	4,701
営業外費用合計		690,629	64,106
経常利益		3,347,770	17,680,450
特別利益			
子会社株式売却益	1	-	14,096,622
特別利益合計		-	14,096,622
特別損失			
固定資産除却損	2	13,203	12,385
早期退職費用	3	126,832	-
支払補償費	4	30,075	-
特別損失合計		170,111	12,385
税引前当期純利益		3,177,659	31,764,687
法人税、住民税及び事業税		1,622,064	7,802,794
法人税等調整額		541,433	1,314,394
法人税等合計		1,080,631	6,488,400
当期純利益		2,097,028	25,276,287

### （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	3,391,568
当期変動額						
剰余金の配当						1,591,892
当期純利益						25,276,287
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	23,684,394
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	27,075,963

	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
当期変動額					
剰余金の配当	1,591,892	1,591,892			1,591,892
当期純利益	25,276,287	25,276,287			25,276,287
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			92,513	92,513	92,513
当期変動額合計	23,684,394	23,684,394	92,513	92,513	23,776,908
当期末残高	27,360,208	111,456,155	50,045	50,045	111,406,109

[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

投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資（金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるも

の)

組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

(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	8～30年
器具備品	4～15年

(2)無形固定資産(リース資産を除く)

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア(自社利用分)	5年

(3)リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. 収益及び費用の計上基準

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

(1)委託者報酬

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

(2)運用受託報酬

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

(3)投資助言報酬

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

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
建物	301,463千円	397,568千円
器具備品	1,499,284千円	1,493,885千円
リース資産	7,493千円	9,824千円

## 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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024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

前事業年度は、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。

当事業年度は、該当事項はありません。

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	12,514千円	- 千円

## (損益計算書関係)

## 1 子会社売却益

日興グローバルラップ株式会社の株式を譲渡したことによる売却益であります。

## 2 固定資産除却損

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
建物	2,482千円	9,039千円
器具備品	4,273千円	2,987千円
リース資産	532千円	- 千円
ソフトウェア	5,915千円	358千円

## 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 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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024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
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

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
2024年6月26日 定時株主総会	普通株式	10,838,419	320.00	2024年 3月31日	2024年 6月27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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
1年以内	1,161,545	1,161,545
1年超	1,161,545	-
合計	2,323,090	1,161,545

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

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

また、資金調達は行っておりません。

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(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	-

当事業年度(2024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	23,435,831	23,435,831	-
(2)投資有価証券 その他有価証券	9,292,678	9,292,678	-
資産計	32,728,510	32,728,510	-

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
その他有価証券		
(1)非上場株式	39,809	40,370
(2)組合出資金等	-	643,909
合計	39,809	684,279
子会社株式		
非上場株式	11,850,598	1,927,221
合計	11,850,598	1,927,221

## 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

前事業年度(2023年3月31日)

(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

当事業年度(2024年3月31日)

(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	-	23,435,831	-	23,435,831
(2)投資有価証券 その他有価証券	-	9,292,678	-	9,292,678
資産計	-	32,728,510	-	32,728,510

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(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。

当事業年度(2024年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式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

前事業年度(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。

当事業年度(2024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	3,489,939	3,297,367	192,572
小計	3,489,939	3,297,367	192,572
(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	5,802,739	6,025,562	222,822
小計	5,802,739	6,025,562	222,822
合計	9,292,678	9,322,929	30,250

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 684,279千円)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 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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024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
801,686	12,261	48,575

(単位：千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
217,908	5,384	10,829

(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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	5,084,506	5,027,832
勤務費用	429,188	423,516
利息費用	6,502	11,432
数理計算上の差異の発生額	12,781	34,405
退職給付の支払額	479,583	466,321
過去勤務費用の発生額	-	20,064
退職給付債務の期末残高	5,027,832	4,941,989

## (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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	5,027,832	4,941,989
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	5,027,832	4,941,989

## (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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	429,188	423,516
利息費用	6,502	11,432
数理計算上の差異の費用処理額	12,781	34,405
過去勤務費用の費用処理額	-	20,064
その他	39,914	67,197
確定給付制度に係る退職給付費用	382,994	447,675

(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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
--	--	--

割引率	0.230%	0.440%
-----	--------	--------

### 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241,556千円、当事業年度264,552千円であります。

#### (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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
<b>繰延税金資産</b>		
退職給付引当金	1,539,522	1,513,237
賞与引当金	551,617	873,913
調査費	473,972	558,908
未払金	211,439	176,993
未払事業税	39,995	365,090
ソフトウェア償却	105,506	101,113
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	120,350	109,942
その他	21,158	18,064
繰延税金資産小計	3,178,439	3,832,139
評価性引当額	193,662	198,503
繰延税金資産合計	2,984,776	3,633,635
<b>繰延税金負債</b>		
無形固定資産	3,504,563	2,857,478
資産除去債務	3,201	-
その他有価証券評価差額金	27,506	60,063
繰延税金負債合計	3,535,270	2,917,542
繰延税金資産（負債）の純額	550,493	716,093

##### 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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%
(調整)		
受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.0	10.6
のれん償却費	2.9	0.2
交際費等永久に損金に算入されない項目	3.0	0.1
所得税額控除による税額控除	1.3	-
その他	1.2	0.0
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.0	20.4

#### (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 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。

当事業年度(自 2023年4月1日 至2024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	69,953,226	11,147,187	1,302,916	328,311	82,731,642

### (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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1)兄弟会社等

(単位：千円)

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

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1)兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	-	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	6,642,605	未払手数料	1,630,250
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	135,000,000	証券業	-	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	6,960,278	未払手数料	1,200,878

## (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

(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	㈱三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区	2,344,038,000	銀行業	50.1%	持株会社	子会社株式の売却(売却価格)	24,000,000	-	-
							子会社株式売却益	14,096,622		

## (注) 子会社株式の売却及び子会社株式売却益

取引価額については、企業価値を勘案し、両社協議のうえ合理的に決定しております。

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	2,587.21円	3,289.22円
1株当たり当期純利益	61.91円	746.27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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり当期純利益		
当期純利益(千円)	2,097,028	25,276,287
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)	2,097,028	25,276,287
期中平均株式数(株)	33,870,060	33,870,060

**独立監査人の監査報告書**

2024年6月14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**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2024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. XBR 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

2024年12月4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 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）の2024年3月19日から2024年9月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）の2024年9月18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（2024年3月19日から2024年9月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の中間監査報告書

2024年12月4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 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）の2024年3月19日から2024年9月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）の2024年9月18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（2024年3月19日から2024年9月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の中間監査報告書

2024年12月4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 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）の2024年3月19日から2024年9月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）の2024年9月18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（2024年3月19日から2024年9月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の中間監査報告書

2024年12月4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 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）の2024年3月19日から2024年9月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）の2024年9月18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（2024年3月19日から2024年9月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の中間監査報告書

2024年12月4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 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）の2024年3月19日から2024年9月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）の2024年9月18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（2024年3月19日から2024年9月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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