

**【表紙】**

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2025年1月23日提出
【計算期間】	第10期中(自 2024年4月27日至 2024年10月26日)
【ファンド名】	アセットアロケーション・ファンド(安定型) アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) アセットアロケーション・ファンド(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】

## アセットアロケーション・ファンド（安定型）

2024年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	777,568,537	11.32
親投資信託受益証券	日本	5,883,904,651	85.67
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	206,931,454	3.01
合計（純資産総額）		6,868,404,642	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	-	764,643,247	11.13

## アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

2024年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	1,107,389,940	15.79
親投資信託受益証券	日本	5,715,199,931	81.51
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	189,451,433	2.70
合計（純資産総額）		7,012,041,304	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	-	1,236,927,322	17.64

## アセットアロケーション・ファンド（成長型）

2024年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	461,720,825	13.23
親投資信託受益証券	日本	2,918,438,717	83.62
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	109,787,076	3.15
合計（純資産総額）		3,489,946,618	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	-	557,211,032	15.97

## (2) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

## アセットアロケーション・ファンド(安定型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2016年 4月26日)	13,358,665,467	13,358,665,467	9,514	9,514
第2期 (2017年 4月26日)	48,551,937,727	48,551,937,727	9,992	9,992
第3期 (2018年 4月26日)	30,744,053,222	30,744,053,222	9,815	9,815
第4期 (2019年 4月26日)	21,753,606,702	21,753,606,702	10,029	10,029
第5期 (2020年 4月27日)	13,719,895,964	13,719,895,964	9,846	9,846
第6期 (2021年 4月26日)	11,087,292,976	11,087,292,976	10,684	10,684
第7期 (2022年 4月26日)	9,293,380,144	9,293,380,144	10,221	10,221
第8期 (2023年 4月26日)	8,082,163,354	8,082,163,354	9,713	9,713
第9期 (2024年 4月26日)	7,269,363,271	7,269,363,271	10,153	10,153
2023年11月末日	7,527,753,758	-	9,836	-
12月末日	7,526,425,628	-	9,967	-
2024年 1月末日	7,452,208,968	-	10,003	-
2月末日	7,438,921,076	-	10,099	-
3月末日	7,482,109,393	-	10,308	-
4月末日	7,347,141,886	-	10,261	-
5月末日	7,238,928,303	-	10,256	-
6月末日	7,274,995,724	-	10,389	-
7月末日	7,185,995,161	-	10,324	-
8月末日	7,115,430,304	-	10,380	-
9月末日	7,100,254,503	-	10,407	-
10月末日	7,005,429,933	-	10,343	-
11月末日	6,868,404,642	-	10,269	-

(注) 各月末日の数字は最終営業日のものです。

## アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2016年 4月26日)	12,391,100,166	12,391,100,166	9,296	9,296
第2期 (2017年 4月26日)	32,241,957,798	32,241,957,798	10,040	10,040
第3期 (2018年 4月26日)	20,024,628,165	20,024,628,165	10,020	10,020
第4期 (2019年 4月26日)	14,199,914,498	14,199,914,498	10,254	10,254
第5期 (2020年 4月27日)	9,390,219,478	9,390,219,478	9,662	9,662
第6期 (2021年 4月26日)	8,415,109,788	8,415,109,788	11,260	11,260
第7期 (2022年 4月26日)	7,383,568,948	7,383,568,948	10,932	10,932
第8期 (2023年 4月26日)	7,059,303,629	7,059,303,629	10,546	10,546

第9期 (2024年 4月26日)	7,200,067,555	7,200,067,555	11,633	11,633
2023年11月末日	7,014,812,045	-	10,984	-
12月末日	7,045,075,847	-	11,148	-
2024年 1月末日	7,089,417,378	-	11,259	-
2月末日	7,173,289,989	-	11,443	-
3月末日	7,302,592,802	-	11,777	-
4月末日	7,298,289,214	-	11,792	-
5月末日	7,256,347,484	-	11,820	-
6月末日	7,354,573,288	-	12,026	-
7月末日	7,218,914,074	-	11,885	-
8月末日	7,181,805,797	-	11,903	-
9月末日	7,206,370,587	-	11,961	-
10月末日	7,144,385,692	-	11,953	-
11月末日	7,012,041,304	-	11,841	-

(注) 各月末日の数字は最終営業日のものです。

#### アセットアロケーション・ファンド(成長型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2016年 4月26日)	12,509,183,920	12,509,183,920	9,159	9,159
第2期 (2017年 4月26日)	27,043,239,176	27,043,239,176	10,069	10,069
第3期 (2018年 4月26日)	14,776,735,458	14,776,735,458	10,111	10,111
第4期 (2019年 4月26日)	10,908,544,788	10,908,544,788	10,362	10,362
第5期 (2020年 4月27日)	5,612,179,736	5,612,179,736	9,482	9,482
第6期 (2021年 4月26日)	4,420,068,155	4,420,068,155	11,544	11,544
第7期 (2022年 4月26日)	3,876,188,991	3,876,188,991	11,299	11,299
第8期 (2023年 4月26日)	3,576,466,102	3,576,466,102	11,021	11,021
第9期 (2024年 4月26日)	3,539,488,655	3,539,488,655	12,577	12,577
2023年11月末日	3,468,647,089	-	11,676	-
12月末日	3,436,765,077	-	11,833	-
2024年 1月末日	3,447,578,009	-	12,022	-
2月末日	3,506,160,039	-	12,289	-
3月末日	3,598,029,631	-	12,708	-
4月末日	3,596,664,476	-	12,777	-
5月末日	3,597,371,068	-	12,838	-
6月末日	3,656,375,881	-	13,114	-
7月末日	3,577,799,892	-	12,905	-
8月末日	3,544,176,872	-	12,905	-
9月末日	3,565,357,739	-	12,969	-
10月末日	3,535,700,915	-	13,014	-
11月末日	3,489,946,618	-	12,853	-

(注) 各月末日の数字は最終営業日のものです。

## 【分配の推移】

## アセットアロケーション・ファンド（安定型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2015年 4月17日～2016年 4月26日	0
第2期	2016年 4月27日～2017年 4月26日	0
第3期	2017年 4月27日～2018年 4月26日	0
第4期	2018年 4月27日～2019年 4月26日	0
第5期	2019年 4月27日～2020年 4月27日	0
第6期	2020年 4月28日～2021年 4月26日	0
第7期	2021年 4月27日～2022年 4月26日	0
第8期	2022年 4月27日～2023年 4月26日	0
第9期	2023年 4月27日～2024年 4月26日	0

## アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2015年 4月17日～2016年 4月26日	0
第2期	2016年 4月27日～2017年 4月26日	0
第3期	2017年 4月27日～2018年 4月26日	0
第4期	2018年 4月27日～2019年 4月26日	0
第5期	2019年 4月27日～2020年 4月27日	0
第6期	2020年 4月28日～2021年 4月26日	0
第7期	2021年 4月27日～2022年 4月26日	0
第8期	2022年 4月27日～2023年 4月26日	0
第9期	2023年 4月27日～2024年 4月26日	0

## アセットアロケーション・ファンド（成長型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2015年 4月17日～2016年 4月26日	0
第2期	2016年 4月27日～2017年 4月26日	0
第3期	2017年 4月27日～2018年 4月26日	0
第4期	2018年 4月27日～2019年 4月26日	0
第5期	2019年 4月27日～2020年 4月27日	0
第6期	2020年 4月28日～2021年 4月26日	0
第7期	2021年 4月27日～2022年 4月26日	0
第8期	2022年 4月27日～2023年 4月26日	0
第9期	2023年 4月27日～2024年 4月26日	0

## 【収益率の推移】

## アセットアロケーション・ファンド（安定型）

	収益率(%)
第1期	4.9
第2期	5.0
第3期	1.8
第4期	2.2
第5期	1.8
第6期	8.5
第7期	4.3
第8期	5.0
第9期	4.5
第10期(中間期)	1.8

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

#### アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

	収益率(%)
第1期	7.0
第2期	8.0
第3期	0.2
第4期	2.3
第5期	5.8
第6期	16.5
第7期	2.9
第8期	3.5
第9期	10.3
第10期(中間期)	2.5

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

#### アセットアロケーション・ファンド(成長型)

	収益率(%)
第1期	8.4
第2期	9.9
第3期	0.4
第4期	2.5
第5期	8.5
第6期	21.7
第7期	2.1
第8期	2.5
第9期	14.1
第10期(中間期)	3.1

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

(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11月29日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	343,190,942,040	97.94
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	7,212,803,861	2.06
合計（純資産総額）		350,403,745,901	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	7,206,510,000	2.06
合計	買建	-	7,206,510,000	2.06

## 外国株式インデックス・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	676,180,796,492	72.82
	イギリス	31,804,768,898	3.43
	カナダ	30,665,388,879	3.30
	スイス	24,179,586,855	2.60
	フランス	21,874,255,072	2.36
	ドイツ	20,074,656,473	2.16
	アイルランド	17,670,400,395	1.90
	オーストラリア	15,527,265,111	1.67
	オランダ	14,090,512,801	1.52
	デンマーク	7,254,297,353	0.78
	スウェーデン	6,966,717,034	0.75
	スペイン	5,903,739,592	0.64
	イタリア	4,796,981,225	0.52
	香港	3,221,251,510	0.35
	シンガポール	2,719,618,560	0.29
	フィンランド	2,189,264,849	0.24
	イスラエル	1,990,922,537	0.21
	ジャージー	1,931,611,360	0.21
	ベルギー	1,662,510,870	0.18
	ルクセンブルグ	1,476,332,168	0.16
ケイマン諸島	1,421,422,825	0.15	
ノルウェー	1,336,744,196	0.14	
バミューダ	1,052,392,591	0.11	
オランダ領キュ ラソー	868,818,265	0.09	
リベリア	789,223,958	0.08	

	ニュージーランド	688,869,004	0.07
	オーストリア	401,891,180	0.04
	パナマ	381,688,874	0.04
	ポルトガル	335,267,661	0.04
	マン島	64,776,431	0.01
	小計	899,521,973,019	96.88
新株予約権証券	カナダ	-	0.00
投資証券	アメリカ	15,727,929,417	1.69
	オーストラリア	1,543,554,625	0.17
	フランス	344,350,071	0.04
	イギリス	242,036,226	0.03
	シンガポール	226,434,278	0.02
	香港	155,223,432	0.02
	ケイマン諸島	80,414,555	0.01
	ベルギー	65,326,739	0.01
	カナダ	40,076,754	0.00
		小計	18,425,346,097
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	10,572,953,706	1.14
合計（純資産総額）		928,520,272,822	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	381,448,080	0.04
株価指数先物取引	買建	ドイツ	1,282,820,864	0.14
株価指数先物取引	買建	アメリカ	8,250,980,010	0.89
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	290,845,464	0.03
合計	買建	-	10,206,094,418	1.10

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	-	3,394,393,037	0.37
為替予約取引	売建	-	1,395,702,196	0.15

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	インド	9,914,314,417	18.70
	台湾	9,322,044,261	17.58
	ケイマン諸島	8,102,261,544	15.28
	韓国	4,966,889,659	9.37
	中国	3,123,316,503	5.89
	ブラジル	1,853,058,266	3.50
	南アフリカ	1,405,512,524	2.65
	インドネシア	784,336,951	1.48
	マレーシア	749,274,955	1.41



	タイ	740,102,330	1.40
	メキシコ	686,726,743	1.30
	ポーランド	386,062,542	0.73
	香港	383,783,283	0.72
	トルコ	331,162,244	0.62
	フィリピン	267,088,496	0.50
	ギリシャ	220,497,704	0.42
	チリ	205,957,327	0.39
	バミューダ	186,670,298	0.35
	アメリカ	174,312,902	0.33
	ハンガリー	121,602,453	0.23
	イギリス	83,954,023	0.16
	チェコ	67,947,155	0.13
	ルクセンブルグ	50,852,733	0.10
	コロンビア	50,012,550	0.09
	エジプト	35,366,674	0.07
	オランダ	33,006,247	0.06
	シンガポール	12,010,562	0.02
	ペルー	11,971,375	0.02
	小計	44,270,096,721	83.51
投資信託受益証券	香港	2,064,163,405	3.89
投資証券	アメリカ	3,392,428,659	6.40
	メキシコ	215,333,918	0.41
	ブラジル	68,111,911	0.13
	小計	3,675,874,488	6.93
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,002,429,681	5.67
合計（純資産総額）		53,012,564,295	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	3,005,870,162	5.67
合計	買建	-	3,005,870,162	5.67

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	-	378,596,757	0.71

Jリート・インデックス・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	17,441,084,300	98.98
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	179,937,678	1.02
合計（純資産総額）		17,621,021,978	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	33,250,000	0.19
合計	買建	-	33,250,000	0.19

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	36,727,971,398	78.91
	オーストラリア	3,255,926,125	7.00
	イギリス	1,891,532,126	4.06
	シンガポール	1,286,271,153	2.76
	フランス	774,185,272	1.66
	カナダ	566,128,435	1.22
	ベルギー	381,073,099	0.82
	香港	379,532,487	0.82
	スペイン	197,106,096	0.42
	韓国	75,142,837	0.16
	オランダ	56,730,881	0.12
	イスラエル	55,496,038	0.12
	ガーンジー	52,874,914	0.11
	ニュージーランド	35,690,485	0.08
	ドイツ	14,428,749	0.03
	アイルランド	14,168,709	0.03
イタリア	2,976,551	0.01	
小計		45,767,235,355	98.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	778,435,181	1.67
合計(純資産総額)		46,545,670,536	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	-	217,346,119	0.47
為替予約取引	売建	-	22,617,827	0.05

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	99,479,992,490	76.39
地方債証券	日本	11,271,463,500	8.66
特殊債券	日本	9,992,472,462	7.67
社債券	日本	8,073,699,300	6.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,411,450,655	1.08
合計(純資産総額)		130,229,078,407	100.00

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	87,048,460,109	44.59
	中国	20,835,068,641	10.67
	フランス	13,819,585,454	7.08
	イタリア	12,906,919,826	6.61
	ドイツ	10,883,397,321	5.58
	イギリス	9,610,165,146	4.92
	スペイン	8,359,480,400	4.28
	カナダ	3,600,925,946	1.84
	ベルギー	2,945,992,067	1.51
	オランダ	2,473,030,725	1.27
	オーストラリア	2,380,881,223	1.22
	オーストリア	2,051,622,276	1.05
	メキシコ	1,328,211,163	0.68
	ポルトガル	1,095,903,125	0.56
	ポーランド	946,518,195	0.48
	マレーシア	938,054,604	0.48
	フィンランド	928,258,966	0.48
	アイルランド	904,243,677	0.46
	シンガポール	760,977,955	0.39
	イスラエル	627,549,230	0.32
ニュージーランド	505,045,486	0.26	
デンマーク	491,103,950	0.25	
スウェーデン	302,679,860	0.16	
ノルウェー	282,361,142	0.14	
小計		186,026,436,487	95.29
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	9,186,953,286	4.71
合計（純資産総額）		195,213,389,773	100.00

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	14,674,914,252	45.15
	中国	3,508,610,112	10.80
	フランス	2,332,904,589	7.18
	イタリア	2,184,934,907	6.72
	ドイツ	1,823,952,792	5.61
	イギリス	1,624,700,753	5.00
	スペイン	1,414,236,324	4.35
	カナダ	608,680,160	1.87
	ベルギー	496,301,176	1.53
	オランダ	417,739,908	1.29
	オーストラリア	396,883,802	1.22

オーストリア	343,721,189	1.06	
シンガポール	286,218,615	0.88	
メキシコ	226,384,275	0.70	
ポルトガル	187,303,910	0.58	
ポーランド	159,003,798	0.49	
フィンランド	156,134,683	0.48	
アイルランド	151,078,268	0.46	
イスラエル	100,588,425	0.31	
ニュージーランド	88,653,907	0.27	
デンマーク	82,686,736	0.25	
スウェーデン	51,836,970	0.16	
ノルウェー	48,837,136	0.15	
小計	31,366,306,687	96.51	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,132,783,417	3.49
合計(純資産総額)		32,499,090,104	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	-	4,551,599,630	14.01
為替予約取引	売建	-	35,957,080,277	110.64

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2024年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	トルコ	1,127,366,823	10.80
	サウジアラビア	973,293,962	9.33
	メキシコ	836,376,066	8.01
	ブラジル	734,974,474	7.04
	アラブ首長国連邦	711,223,276	6.81
	コロンビア	683,089,163	6.55
	ポーランド	652,941,464	6.26
	チリ	652,489,998	6.25
	ドミニカ共和国	516,192,548	4.95
	ハンガリー	480,700,664	4.61
	カタール	438,734,196	4.20
	ペルー	371,691,074	3.56
	パナマ	370,190,909	3.55
	南アフリカ	337,100,464	3.23
	中国	261,419,186	2.50
	インドネシア	251,159,370	2.41
	オマーン	188,816,321	1.81
	ウルグアイ	162,050,926	1.55
フィリピン	110,569,900	1.06	

	小計	9,860,380,784	94.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	575,769,638	5.52
合計(純資産総額)		10,436,150,422	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	-	97,941,350	0.94

## 2【設定及び解約の実績】

## アセットアロケーション・ファンド(安定型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	14,471,203,211	430,595,693
第2期	39,440,607,065	4,888,096,644
第3期	3,005,688,776	20,274,975,700
第4期	913,665,451	10,547,332,018
第5期	258,180,741	8,014,561,766
第6期	246,744,303	3,802,926,621
第7期	158,442,458	1,443,373,995
第8期	162,566,897	934,545,023
第9期	92,687,455	1,253,408,617
第10期(中間期)	115,559,244	500,431,156

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

## アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	13,473,777,867	144,788,717
第2期	22,569,690,166	3,786,328,653
第3期	1,994,684,295	14,122,473,521
第4期	758,923,595	6,895,231,238
第5期	498,733,066	4,628,274,076
第6期	582,836,155	2,828,418,770
第7期	430,295,633	1,149,383,746
第8期	409,605,134	469,613,995
第9期	361,886,016	866,800,609
第10期(中間期)	108,933,732	314,288,619

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

## アセットアロケーション・ファンド(成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	13,883,023,089	225,050,831
第2期	19,324,709,567	6,124,106,042
第3期	2,148,349,345	14,391,885,041
第4期	1,008,692,045	5,095,880,106
第5期	306,069,242	4,915,238,211
第6期	188,201,809	2,277,873,843
第7期	172,858,285	571,200,442
第8期	165,383,298	350,773,575
第9期	164,071,212	595,194,940
第10期(中間期)	72,961,653	170,058,761

(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、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第284条、第307条の規定により、「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10期中間計算期間(2024年4月27日から2024年10月26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。



## 【アセットアロケーション・ファンド（安定型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 （2024年 4月26日現在）	第10期中間計算期間 （2024年10月26日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	25,325,909	36,849,444
金銭信託	2,187,397	440,628
コール・ローン	98,491,355	96,825,075
投資証券	884,147,133	266,011,006
親投資信託受益証券	6,295,012,037	6,645,429,707
未収入金	30,044,011	17,000,000
未収利息	-	595
流動資産合計	7,335,207,842	7,062,556,455
<b>資産合計</b>	<b>7,335,207,842</b>	<b>7,062,556,455</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	16,348,353	8,222,490
未払解約金	11,024,978	14,270,982
未払受託者報酬	1,233,010	1,191,411
未払委託者報酬	36,991,681	35,743,312
その他未払費用	246,549	178,623
流動負債合計	65,844,571	59,606,818
<b>負債合計</b>	<b>65,844,571</b>	<b>59,606,818</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,159,970,280	6,775,098,368
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	109,392,991	227,851,269
（分配準備積立金）	894,644,839	832,575,223
元本等合計	7,269,363,271	7,002,949,637
<b>純資産合計</b>	<b>7,269,363,271</b>	<b>7,002,949,637</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>7,335,207,842</b>	<b>7,062,556,455</b>

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第9期中間計算期間 自 2023年 4月27日 至 2023年10月26日	第10期中間計算期間 自 2024年 4月27日 至 2024年10月26日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	15,943,849	15,200,466
受取利息	279,981	504,836
有価証券売買等損益	140,563,238	153,501,786
為替差損益	8,597,660	1,301,898
営業収益合計	132,937,068	167,905,190
<b>営業費用</b>		
支払利息	39,747	-
受託者報酬	1,297,831	1,191,411
委託者報酬	38,936,581	35,743,312
その他費用	312,021	237,185
営業費用合計	40,586,180	37,171,908
営業利益又は営業損失（ ）	173,523,248	130,733,282
経常利益又は経常損失（ ）	173,523,248	130,733,282
中間純利益又は中間純損失（ ）	173,523,248	130,733,282
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（ ）	4,315,988	9,062,401
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	238,528,088	109,392,991
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,331,264	4,519,781
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,331,264	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	4,519,781
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,015,313	7,732,384
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	7,732,384
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,015,313	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	403,051,373	227,851,269

## （３）【中間注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項目	第10期中間計算期間 自 2024年4月27日 至 2024年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## （中間貸借対照表に関する注記）

項目	第9期 (2024年4月26日現在)	第10期中間計算期間 (2024年10月26日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	7,159,970,280口	6,775,098,368口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0153円 (1万口当たりの純資産額10,153円)	1口当たり純資産額 1.0336円 (1万口当たりの純資産額10,336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10期中間計算期間 (2024年10月26日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

第9期(2024年4月26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	834,583,636	-	850,931,989	16,348,353
	小計	834,583,636	-	850,931,989	16,348,353
合計		834,583,636	-	850,931,989	16,348,353

第10期中間計算期間(2024年10月26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	287,627,150	-	295,849,640	8,222,490
	小計	287,627,150	-	295,849,640	8,222,490
合計		287,627,150	-	295,849,640	8,222,490

## (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9期 (2024年4月26日現在)	第10期中間計算期間 (2024年10月26日現在)
期首元本額	8,320,691,442円	7,159,970,280円
期中追加設定元本額	92,687,455円	115,559,244円
期中一部解約元本額	1,253,408,617円	500,431,156円

## 【アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 （2024年 4月26日現在）	第10期中間計算期間 （2024年10月26日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	54,790,495	43,281,438
金銭信託	1,921,861	1,446,520
コール・ローン	86,535,141	100,490,249
投資証券	1,196,759,546	394,610,959
親投資信託受益証券	5,922,489,278	6,656,092,811
未収入金	-	8,000,000
未収利息	-	617
流動資産合計	7,262,496,321	7,203,922,594
<b>資産合計</b>		
	7,262,496,321	7,203,922,594
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	25,285,690	17,823,121
未払解約金	645,511	10,645,831
未払受託者報酬	1,169,762	1,199,529
未払委託者報酬	35,093,908	35,987,460
その他未払費用	233,895	179,856
流動負債合計	62,428,766	65,835,797
<b>負債合計</b>		
	62,428,766	65,835,797
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,189,118,602	5,983,763,715
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,010,948,953	1,154,323,082
（分配準備積立金）	1,102,798,023	1,047,284,807
元本等合計	7,200,067,555	7,138,086,797
<b>純資産合計</b>		
	7,200,067,555	7,138,086,797
<b>負債純資産合計</b>		
	7,262,496,321	7,203,922,594

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第9期中間計算期間 自 2023年 4月27日 至 2023年10月26日	第10期中間計算期間 自 2024年 4月27日 至 2024年10月26日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	21,089,976	21,269,516
受取利息	289,296	586,210
有価証券売買等損益	55,619,044	204,323,868
為替差損益	38,703,409	5,600,949
営業収益合計	38,294,907	220,578,645
<b>営業費用</b>		
支払利息	38,217	-
受託者報酬	1,162,849	1,199,529
委託者報酬	34,886,696	35,987,460
その他費用	299,028	255,160
営業費用合計	36,386,790	37,442,149
営業利益又は営業損失（ ）	1,908,117	183,136,496
経常利益又は経常損失（ ）	1,908,117	183,136,496
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,908,117	183,136,496
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（ ）	11,015,721	9,323,542
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	365,270,434	1,010,948,953
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,429,937	20,974,187
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	11,429,937	20,974,187
剰余金減少額又は欠損金増加額	25,147,313	51,413,012
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	25,147,313	51,413,012
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（ ）	342,445,454	1,154,323,082

## （３）【中間注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項目	第10期中間計算期間 自 2024年4月27日 至 2024年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## （中間貸借対照表に関する注記）

項目	第9期 (2024年4月26日現在)	第10期中間計算期間 (2024年10月26日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	6,189,118,602口	5,983,763,715口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1633円 (1万口当たりの純資産額11,633円)	1口当たり純資産額 1.1929円 (1万口当たりの純資産額11,929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10期中間計算期間 (2024年10月26日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。



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

## (デリバティブ取引に関する注記)

第9期(2024年4月26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	1,290,834,866	-	1,316,120,556	25,285,690
	小計	1,290,834,866	-	1,316,120,556	25,285,690
合計		1,290,834,866	-	1,316,120,556	25,285,690

第10期中間計算期間(2024年10月26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	623,462,439	-	641,285,560	17,823,121
	小計	623,462,439	-	641,285,560	17,823,121
合計		623,462,439	-	641,285,560	17,823,121

## (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9期 (2024年4月26日現在)	第10期中間計算期間 (2024年10月26日現在)
期首元本額	6,694,033,195円	6,189,118,602円
期中追加設定元本額	361,886,016円	108,933,732円
期中一部解約元本額	866,800,609円	314,288,619円

## 【アセットアロケーション・ファンド（成長型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 （2024年 4月26日現在）	第10期中間計算期間 （2024年10月26日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	25,192,979	19,862,901
金銭信託	1,156,845	2,201,657
コール・ローン	52,088,949	49,006,813
投資証券	492,701,546	244,717,092
親投資信託受益証券	2,992,456,503	3,236,299,310
未収入金	4,991,251	2,000,000
未収利息	-	301
流動資産合計	3,568,588,073	3,554,088,074
資産合計	3,568,588,073	3,554,088,074
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	11,199,993	11,315,933
未払解約金	62	668,024
未払受託者報酬	573,661	593,073
未払委託者報酬	17,211,027	17,793,603
その他未払費用	114,675	88,881
流動負債合計	29,099,418	30,459,514
負債合計	29,099,418	30,459,514
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,814,154,861	2,717,057,753
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	725,333,794	806,570,807
（分配準備積立金）	731,290,942	687,728,154
元本等合計	3,539,488,655	3,523,628,560
純資産合計	3,539,488,655	3,523,628,560
負債純資産合計	3,568,588,073	3,554,088,074

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第9期中間計算期間 自 2023年 4月27日 至 2023年10月26日	第10期中間計算期間 自 2024年 4月27日 至 2024年10月26日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	11,738,341	10,706,978
受取利息	189,758	261,436
有価証券売買等損益	81,698,087	117,558,884
為替差損益	25,146,192	275,350
営業収益合計	68,479,994	128,251,948
<b>営業費用</b>		
支払利息	17,756	-
受託者報酬	583,904	593,073
委託者報酬	17,518,378	17,793,603
その他費用	163,964	130,078
営業費用合計	18,284,002	18,516,754
営業利益又は営業損失（ ）	50,195,992	109,735,194
経常利益又は経常損失（ ）	50,195,992	109,735,194
中間純利益又は中間純損失（ ）	50,195,992	109,735,194
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（ ）	13,483,643	5,986,149
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	331,187,513	725,333,794
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,902,913	21,405,793
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	12,902,913	21,405,793
剰余金減少額又は欠損金増加額	35,682,818	43,917,825
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	35,682,818	43,917,825
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（ ）	345,119,957	806,570,807

## (3)【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第10期中間計算期間 自 2024年4月27日 至 2024年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第9期 (2024年4月26日現在)	第10期中間計算期間 (2024年10月26日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	2,814,154,861口	2,717,057,753口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2577円 (1万口当たりの純資産額12,577円)	1口当たり純資産額 1.2969円 (1万口当たりの純資産額12,969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10期中間計算期間 (2024年10月26日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資証券、親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

	(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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）

第9期（2024年4月26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	571,759,796	-	582,959,789	11,199,993
	小計	571,759,796	-	582,959,789	11,199,993
合計		571,759,796	-	582,959,789	11,199,993

第10期中間計算期間（2024年10月26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	395,837,467	-	407,153,400	11,315,933
	小計	395,837,467	-	407,153,400	11,315,933
合計		395,837,467	-	407,153,400	11,315,933

## （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9期 (2024年4月26日現在)	第10期中間計算期間 (2024年10月26日現在)
期首元本額	3,245,278,589円	2,814,154,861円
期中追加設定元本額	164,071,212円	72,961,653円
期中一部解約元本額	595,194,940円	170,058,761円

(参考)

「アセットアロケーション・ファンド(安定型)」、「アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)」および「アセットアロケーション・ファンド(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」、「リート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」および「米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

(1)貸借対照表

(単位：円)

(2024年10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	20,243,718
コール・ローン	4,450,443,374
株式	326,757,821,380
派生商品評価勘定	61,313,300
未収配当金	3,268,330,507
未収利息	27,359
前払金	63,340,000
差入委託証拠金	508,721,534
流動資産合計	335,130,241,172
資産合計	335,130,241,172
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	149,102,000
未払解約金	185,682,489

流動負債合計	334,784,489
負債合計	334,784,489
純資産の部	
元本等	
元本	70,973,141,787
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	263,822,314,896
元本等合計	334,795,456,683
純資産合計	334,795,456,683
負債純資産合計	335,130,241,172

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年4月27日 至 2024年10月26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10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	70,973,141,787口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 4.7172円 (1万口当たりの純資産額47,172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10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。



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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年10月26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	8,413,793,700	-	8,326,005,000	87,788,700
	小計	8,413,793,700	-	8,326,005,000	87,788,700
合計		8,413,793,700	-	8,326,005,000	87,788,700

(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10月26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	68,748,738,551円
同期中における追加設定元本額	5,705,591,213円
同期中における一部解約元本額	3,481,187,977円
2024年10月26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	9,679,276,111円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	956,460,978円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,223,191,581円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,653,144,651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）	128,798,513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)	2,990,745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)	11,872,938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)	38,100,632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)	122,191,587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)	122,907,374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)	247,162,108円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,495,643,929円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	29,768,389,296円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	105,597,214円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	153,515,868円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	92,202,975円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	71,923,810円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	223,403,836円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	223,829,608円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	926,026,380円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	563,129,772円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	703,405,724円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	68,531,573円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	1,512,138,637円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	42,831,232円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	255,493,369円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	291,970,400円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	10,578,653円
日興FWS・日本株インデックス	3,068,333,890円
三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド	244,449,556円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	23,598,575円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	14,864,411円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	16,125,815円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	9,175,793円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	6,116,291円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	875,783円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	24,247,514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)	117,096,081円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	117,245,008円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	44,894,838円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,024,458,146円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	6,823,470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>	658,822,363円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	970,735,898円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	3,825,404,678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>	156,249,124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>	341,910,147円

SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,012,693,241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>	22,820,796円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	16,823,339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>	50,916,848円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	140,343,788円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	28,431,700円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	28,327,919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>	24,396,399円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	322,529,172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)	145,895,986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>	128,995,146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>	23,747,703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>	16,014,189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>	25,509,559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>	117,705,066円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	10,040,442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>	50,630,707円
合計	70,973,141,787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10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	17,959,291,287
金銭信託	2,368,015
コール・ローン	520,592,038
株式	838,977,956,834
投資証券	17,423,421,337
派生商品評価勘定	290,347,931
未収配当金	528,477,477
未収利息	3,200
差入委託証拠金	5,356,469,781
流動資産合計	881,058,927,900
資産合計	881,058,927,900
負債の部	
流動負債	

派生商品評価勘定	49,449,092
未払解約金	478,318,679
流動負債合計	527,767,771
負債合計	527,767,771
純資産の部	
元本等	
元本	90,298,839,521
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	790,232,320,608
元本等合計	880,531,160,129
純資産合計	880,531,160,129
負債純資産合計	881,058,927,900

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項 目	自 2024年4月27日 至 2024年10月26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10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	90,298,839,521口

2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 9.7513円 (1万口当たりの純資産額97,513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10月26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10月26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	19,066,960,380	-	19,312,649,328	245,688,948
	SPI 200 FUTURES DEC24	706,009,247	-	706,173,226	163,979
	FTSE 100 IDX FUT DEC24	923,422,929	-	917,236,320	6,186,609
	EURO STOXX 50 DEC24	3,187,274,713	-	3,188,393,234	1,118,521
	小計	23,883,667,269	-	24,124,452,108	240,784,839
	合計	23,883,667,269	-	24,124,452,108	240,784,839

## (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。

- 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。
- 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 売建				
	アメリカ・ドル	180,940,920	-	180,826,920	114,000
	小計	180,940,920	-	180,826,920	114,000
合 計		180,940,920	-	180,826,920	114,000

## （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10月26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	86,027,780,587円
同期中における追加設定元本額	8,661,087,732円
同期中における一部解約元本額	4,390,028,798円
2024年10月26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	45,218,304,201円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	246,871,141円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	946,387,927円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	760,196,298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）	27,250,595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）	2,660,413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）	9,335,441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）	31,185,679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）	39,368,841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)	87,338,497円
外国株式指数ファンド	1,205,447,797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	24,558,561,412円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	23,548,862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)	40,648,859円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	33,402,362円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	156,893,664円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	147,311,315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)	364,815,666円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	526,167,108円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	70,709,627円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	3,212,482,042円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	10,749,170円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	57,179,799円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	60,207,281円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,829,077円
SMB C・DCインデックスファンド(M S C I コクサイ)	2,458,220,072円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	231,582,566円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	3,506,088,749円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	162,266,056円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	9,529,071円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	6,266,294円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	7,226,883円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	4,207,672円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	2,751,882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)	4,837,808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)	24,422,233円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	24,690,606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)	9,486,021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)	231,002,410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 >	1,697,689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 >	217,750,920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 >	436,998,040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 >	1,986,976,488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 >	330,812,839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 >	174,141,865円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	388,334,211円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	162,750,881円
S M A M・グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	34,139,827円

SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	3,724,708円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	3,335,757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>	8,331,294円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	29,997,359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>	66,748,739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>	28,608,883円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	107,155,385円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	38,472,219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>	460,551,883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>	20,295,706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>	143,763,531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	90,298,839,521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10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	3,633,306,746
金銭信託	598,350
コール・ローン	131,543,158
株式	44,160,493,931
投資信託受益証券	2,051,220,179
投資証券	3,506,293,452
派生商品評価勘定	125,044,187
未収配当金	57,633,556
未収利息	808
差入委託証拠金	756,015,199
流動資産合計	54,422,149,566
資産合計	
54,422,149,566	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,874,595
未払解約金	10,622,115
流動負債合計	33,496,710
負債合計	
33,496,710	
純資産の部	
元本等	
元本	24,257,079,190



剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		30,131,573,666
元本等合計		54,388,652,856
純資産合計		54,388,652,856
負債純資産合計		54,422,149,566

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年4月27日 至 2024年10月26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10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	24,257,079,190口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.2422円 (1万口当たりの純資産額22,422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10月26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10月26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 DEC24	4,587,234,470	-	4,689,574,243	102,339,773
	小計	4,587,234,470	-	4,689,574,243	102,339,773
合計		4,587,234,470	-	4,689,574,243	102,339,773

(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	43,544,875	-	43,375,419	169,456
	小計	43,544,875	-	43,375,419	169,456
	売建				
	エジプト・ボンド	244,875	-	245,600	725
小計		244,875	-	245,600	725
合計		43,789,750	-	43,621,019	170,181

(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10月26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	22,315,764,396円
同期中における追加設定元本額	3,376,650,638円
同期中における一部解約元本額	1,435,335,844円
2024年10月26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	12,927,939,181円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,566,736,142円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	18,859,379円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	159,810,727円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	107,545,834円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	73,294,869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)	337,744,419円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	525,868,838円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	153,848,453円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	10,277,092円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	639,561,700円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	4,680,413,659円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	103,386,296円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	20,518,121円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	13,570,189円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	15,588,779円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	8,941,145円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	5,917,691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D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル3 (安定成長型)	36,409,483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)	36,380,396円
三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル5 (積極成長型)	15,622,865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>	64,505,528円
合 計	24,257,079,190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10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	246,810
コール・ローン	54,259,531
投資証券	15,854,415,350
未収配当金	143,386,688
未収利息	333
前払金	1,588,000
差入委託証拠金	1,854,697
流動資産合計	16,055,751,409
資産合計	
16,055,751,409	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,502,400
未払解約金	489,002
流動負債合計	1,991,402
負債合計	
1,991,402	
純資産の部	
元本等	
元本	6,382,891,860
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	9,670,868,147
元本等合計	16,053,760,007
純資産合計	
16,053,760,007	
負債純資産合計	
16,055,751,409	

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項 目	自 2024年4月27日 至 2024年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	6,382,891,860口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.5151円 (1万口当たりの純資産額25,151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10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(投資証券)</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(2024年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
	リート指数先物取引				

市場取引	買建				
	TREIT 先物 0612月	35,002,400	-	33,500,000	1,502,400
	小計	35,002,400	-	33,500,000	1,502,400
	合 計	35,002,400	-	33,500,000	1,502,400

## (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10月26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	5,891,898,212円
同期中における追加設定元本額	1,328,393,571円
同期中における一部解約元本額	837,399,923円
2024年10月26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)	141,416,381円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	102,705,342円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,863,226,208円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2050	34,449,602円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	49,971,547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)	246,175,920円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	164,807,678円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	130,846,706円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	64,031,296円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	5,212,111円
三井住友D S ・国内リートインデックス年金ファンド	401,607,411円
日興FWS・Jリートインデックス	1,347,129,698円
三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド	205,173,615円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2035	6,529,578円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2040	4,446,607円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2045	6,510,621円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2055	4,451,827円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2065	2,990,071円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	712,490円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	21,896,996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)	112,296,656円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	113,418,302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)	43,996,934円
S M A M ・世界リート・インデックスファンドV A <適格機関投資家限定>	2,625,719円

SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	79,077,843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	6,382,891,860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10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	881,767,165
金銭信託	532,881
コール・ローン	117,150,301
投資証券	43,554,057,131
派生商品評価勘定	276,156
未収配当金	20,067,540
未収利息	720
流動資産合計	44,573,851,894
資産合計	44,573,851,894
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	158,427
流動負債合計	158,427
負債合計	158,427
純資産の部	
元本等	
元本	11,716,750,252
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	32,856,943,215
元本等合計	44,573,693,467
純資産合計	44,573,693,467
負債純資産合計	44,573,851,894

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年4月27日 至 2024年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

	<p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	11,716,750,252口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.8043円 (1万口当たりの純資産額38,043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10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## （デリバティブ取引に関する注記）

（2024年10月26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	115,400,000	-	115,474,681	74,681
	オーストラリア・ドル	11,300,000	-	11,297,043	2,957
	香港・ドル	5,000,000	-	4,978,834	21,166
	シンガポール・ドル	5,800,000	-	5,823,279	23,279
	イギリス・ポンド	5,100,000	-	5,096,886	3,114
	ユーロ	6,400,000	-	6,447,006	47,006
	小計	149,000,000	-	149,117,729	117,729
合計	149,000,000	-	149,117,729	117,729	

## (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10月26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	10,861,853,131円
同期中における追加設定元本額	1,298,937,986円
同期中における一部解約元本額	444,040,865円
2024年10月26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)	8,473,386円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	12,968,501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	9,283,441,174円
三井住友D S・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)	170,068,858円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	112,503,677円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	93,626,730円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	135,140,819円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,707,250円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	459,144,737円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	79,180,923円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	992,355,864円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	157,808,647円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	3,724,496円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	2,104,609円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	2,339,297円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	1,405,435円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	930,155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)	1,463,385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)	8,680,976円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	8,320,528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)	2,824,366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>	28,331,735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>	53,619,518円
合 計	11,716,750,252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10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,000,981
コール・ローン	439,902,124
国債証券	107,351,205,410
地方債証券	11,729,937,150
特殊債券	10,064,007,621
社債券	8,108,215,900
未収利息	254,896,636
前払費用	13,205,818
流動資産合計	137,963,371,640
資産合計	
	137,963,371,640
負債の部	
流動負債	
未払金	15,044,400
未払解約金	47,288,996
流動負債合計	62,333,396
負債合計	
	62,333,396
純資産の部	
元本等	

元本		115,553,359,267
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		22,347,678,977
元本等合計		137,901,038,244
純資産合計		137,901,038,244
負債純資産合計		137,963,371,640

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年4月27日 至 2024年10月26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10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	115,553,359,267口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1934円 (1万口当たりの純資産額11,934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10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(2024年10月26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	110,729,841,082円
同期中における追加設定元本額	16,526,136,684円
同期中における一部解約元本額	11,702,618,499円
2024年10月26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)	10,462,286,763円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	16,939,602,303円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	4,430,708,490円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	897,499,446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)	43,337,962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)	169,294,770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)	550,779,577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)	1,277,233,372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)	735,608,318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)	880,207,265円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	138,377,331円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,552,298,111円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,114,662,337円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	426,216,226円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	195,264,827円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	3,924,243,946円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,189,533,327円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,489,761,488円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	610,331,519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NISA・世界分散ファンド	420,378,607円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	472,228,646円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	1,032,783,855円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	356,787,756円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	22,415,641円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	287,817,862円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	141,009,643円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	93,023,957円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	19,321,066円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	12,905,673円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	14,251,517円

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	127,161,502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)	344,578,681円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	168,597,231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)	18,344,312円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	991,659,749円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	7,139,582,604円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,816,642,948円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	15,210,987,813円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	299,682,684円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	492,021,940円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	287,200,967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>	122,911,810円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,708,910,546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>	2,060,687,007円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,174,830,360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)	879,782,307円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	359,702,443円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	403,442,624円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	137,477,110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>	1,006,883,885円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,892,337,681円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	525,793,892円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	218,528,908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>	232,914,222円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,424,448,331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>	1,322,336,092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>	651,882,618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>	1,038,996,622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>	5,573,526,975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>	613,126,713円
合計	115,553,359,267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10月26日現在)

## 資産の部

## 流動資産

預金	187,469,903
金銭信託	2,238,210
コール・ローン	492,055,183
国債証券	186,978,961,837

未収利息	1,686,500,235
前払費用	104,669,868
流動資産合計	189,451,895,236
資産合計	189,451,895,236
負債の部	
流動負債	
未払解約金	260,007,952
流動負債合計	260,007,952
負債合計	260,007,952
純資産の部	
元本等	
元本	80,912,764,752
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	108,279,122,532
元本等合計	189,191,887,284
純資産合計	189,191,887,284
負債純資産合計	189,451,895,236

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項 目	自 2024年4月27日 至 2024年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項 目	(2024年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	80,912,764,752口

2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2,3382円 (1万口当たりの純資産額23,382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10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(2024年10月26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	81,194,036,018円
同期中における追加設定元本額	6,760,773,882円
同期中における一部解約元本額	7,042,045,148円
2024年10月26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	28,298,523,968円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,008,783,229円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,548,096,007円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,556,819,788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)	168,704,890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)	5,576,213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)	22,109,597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)	70,444,939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)	242,773,216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)	206,091,247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)	341,356,485円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	19,189,679円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	37,319,063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)	41,367,327円

三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2050	53,567,056円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	402,427,093円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	276,356,580円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	823,394,295円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	270,720,339円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	144,393,553円
三井住友・D CつみたてN I S A・世界分散ファンド	289,928,578円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	1,396,208,125円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	44,976,475円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	154,968,381円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	124,086,252円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2060	7,941,286円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	4,497,722,936円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	312,137,633円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2035	15,446,821円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2040	9,996,630円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2045	11,395,187円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2055	6,788,587円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2065	4,542,706円
三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	1,120,762円
三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	4,092,857円
三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	19,810,908円
三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	19,378,285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)	7,514,433円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	5,855,356,231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>	17,065,653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>	3,213,365,559円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	3,352,565,386円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	8,159,692,849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>	25,374,037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>	64,513,915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>	653,251,810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>	94,448,421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>	787,304,796円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	1,169,912,566円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	1,088,555,204円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	3,232,324,849円
S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定>	5,588,645,624円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	268,054,429円
S M A M・グローバルバランス40V A<適格機関投資家限定>	95,384,105円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用>	47,621,904円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用>	21,137,594円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	11,781,731円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用>	52,748,024円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L<適格機関投資家専用>	295,465,371円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2<適格機関投資家専用>	59,560,084円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2<適格機関投資家専用>	34,812,921円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2<適格機関投資家専用>	5,723,530円



SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	683,844,739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>	437,677,660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>	574,661,868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>	187,271,239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>	406,539,718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>	294,086,287円
合計	80,912,764,752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10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	70,258,526
金銭信託	1,348,986
コール・ローン	296,565,479
国債証券	38,314,139,868
派生商品評価勘定	2,221,891
未収入金	252,578,394
未収利息	279,934,056
前払費用	74,269,688
流動資産合計	39,291,316,888
資産合計	39,291,316,888
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,888,087,120
未払解約金	379,999,999
流動負債合計	2,268,087,119
負債合計	2,268,087,119
純資産の部	
元本等	
元本	30,416,673,779
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	6,606,555,990
元本等合計	37,023,229,769
純資産合計	37,023,229,769
負債純資産合計	39,291,316,888

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年4月27日 至 2024年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	30,416,673,779口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2172円 (1万口当たりの純資産額12,172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10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年10月26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	159,260,122	-	161,210,207	1,950,085
	シンガポール・ドル	5,767,765	-	5,761,305	6,460
	ニュージーランド・ドル	906,250	-	912,306	6,056
	イギリス・ポンド	19,678,470	-	19,702,260	23,790
	ノルウェー・クローネ	135,960	-	138,906	2,946
	メキシコ・ペソ	289,691	-	305,932	16,241
	オフショア・人民元	31,945,950	-	31,994,550	48,600
	ユーロ	70,624,971	-	70,729,883	104,912
	小計	288,609,179	-	290,755,349	2,146,170
	売建				
	アメリカ・ドル	17,551,427,137	-	18,716,929,586	1,165,502,449
	カナダ・ドル	724,710,542	-	753,654,801	28,944,259
	オーストラリア・ドル	500,944,329	-	510,906,942	9,962,613
	シンガポール・ドル	354,158,108	-	366,645,828	12,487,720
	ニュージーランド・ドル	103,261,747	-	104,002,884	741,137
	イギリス・ポンド	2,068,452,148	-	2,133,693,491	65,241,343
	イスラエル・シケル	107,913,927	-	112,977,096	5,063,169
	デンマーク・クローネ	101,418,437	-	104,740,350	3,321,913
	ノルウェー・クローネ	57,191,122	-	58,757,238	1,566,116
	スウェーデン・クローナ	58,571,261	-	59,797,920	1,226,659
	メキシコ・ペソ	275,865,465	-	292,088,577	16,223,112
	オフショア・人民元	4,238,715,851	-	4,428,060,120	189,344,269
	ポーランド・ズロチ	202,821,637	-	206,913,690	4,092,053
	ユーロ	11,428,804,387	-	11,813,098,974	384,294,587
	小計	37,774,256,098	-	39,662,267,497	1,888,011,399

合計	38,062,865,277	-	39,953,022,846	1,885,865,229
----	----------------	---	----------------	---------------

## (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10月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	19,458,291,604円
同期中における追加設定元本額	12,342,959,325円
同期中における一部解約元本額	1,384,577,150円
2024年10月26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)	1,977,338,336円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,164,882,078円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	829,760,397円
イオン・バランス戦略ファンド	1,262,094,155円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	3,516,826,074円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,635,968,818円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,770,329,508円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	766,530,326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	132,313,483円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	447,962,845円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	10,802,531円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	154,952,538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)	421,923,821円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	206,129,111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)	23,245,091円
SMA M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	961,495,023円
SMA M・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	10,026,053,971円
SMA M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,048,807,759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>	522,742,754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>	834,011,172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>	605,328,933円
合計	30,416,673,779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10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	329,411,039
金銭信託	113,993
コール・ローン	25,060,533
国債証券	9,654,493,419
未収利息	110,144,569
前払費用	7,324,651
流動資産合計	10,126,548,204
資産合計	10,126,548,204
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,215,189
流動負債合計	5,215,189
負債合計	5,215,189
純資産の部	
元本等	
元本	8,877,742,073
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,243,590,942
元本等合計	10,121,333,015
純資産合計	10,121,333,015
負債純資産合計	10,126,548,204

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年4月27日 至 2024年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	(2024年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	8,877,742,073口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1401円 (1万口当たりの純資産額11,401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10月26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）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

(2024年10月26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	7,773,197,521円
同期中における追加設定元本額	1,715,686,447円
同期中における一部解約元本額	611,141,895円
2024年10月26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)	384,076,413円
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)	7,170,609,124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)	132,378,012円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	346,610,028円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	227,660,989円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	63,510,213円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	9,620,999円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	18,096,220円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	11,704,600円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	13,691,331円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	8,048,067円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	5,414,439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)	12,600,070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)	96,232,052円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	176,611,386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)	70,795,231円
合計	8,877,742,073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11月29日現在

資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

最近5年間における資本金の額の増減  
該当ありません。

## (2)【事業の内容及び営業の状況】

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

2024年11月29日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	657	13,488,884
単位型株式投資信託	81	644,511
追加型公社債投資信託	1	23,036
単位型公社債投資信託	144	223,661
合計	883	14,380,094

## (3)【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

該当ありません。

(ロ) その他の重要事項

該当ありません。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。



## 5【委託会社等の経理状況】

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

また、当社の中間財務諸表は、「財務諸表等規則」並びに同規則第2条、第282条及び第306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、第39期（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、第40期中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

		(単位：千円)	
		前事業年度 (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
流動負債合計	14,598,465	23,736,060
<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
固定負債合計	5,580,287	4,941,989
負債合計	20,178,752	28,678,050
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,000	2,000,000
<b>資本剰余金</b>		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	73,466,962	73,466,962
資本剰余金合計	82,095,946	82,095,946
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	3,391,568	27,075,963
利益剰余金合計	3,675,814	27,360,208
株主資本計	87,771,760	111,456,155
<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
評価・換算差額等合計	142,558	50,045
純資産合計	87,629,201	111,406,109
負債・純資産合計	107,807,953	140,084,160

(2)【損益計算書】

(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)
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 (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)
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
	利益剰余金	

	利益剰余金 合計	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	純資産合計
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。

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、資金調達はありません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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



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

#### 市場リスクの管理

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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)
繰延税金資産		
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
繰延税金負債		
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	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	-	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	5,279,199	未払手数料	1,265,651
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	-	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	7,030,381	未払手数料	1,288,749

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

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	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	-	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	6,642,605	未払手数料	1,630,250
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	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	(株)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

## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位:千円)

		第40期中間会計期間 (2024年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		47,554,844
金銭の信託		32,385,266
顧客分別金信託		500,088
前払費用		668,897
未収委託者報酬		14,766,695
未収運用受託報酬		3,912,269
未収投資助言報酬		414,955
未収収益		95,923
その他		107,185
流動資産合計		100,406,126
固定資産		
有形固定資産	1	1,723,779
無形固定資産		
のれん		2,588,598
顧客関連資産		8,275,427
その他		2,669,494
無形固定資産合計		13,533,520
投資その他の資産		
投資有価証券		8,628,900
関係会社株式		1,927,221
繰延税金資産		851,984
その他		1,484,455
貸倒引当金		20,750
投資その他の資産合計		12,871,811
固定資産合計		28,129,111
資産合計		128,535,237
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		35,815
その他の預り金		102,081
未払金		6,905,143
未払費用		6,996,236
未払法人税等		1,639,174
前受収益		20,339
賞与引当金		2,605,528
その他	2	864,362

流動負債合計	19,168,682
固定負債	
退職給付引当金	5,101,556
固定負債合計	5,101,556
負債合計	24,270,238
純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	
資本準備金	8,628,984
その他資本剰余金	73,466,962
資本剰余金合計	82,095,946
利益剰余金	
利益準備金	284,245
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	19,992,998
利益剰余金合計	20,277,244
株主資本合計	104,373,190
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	108,191
評価・換算差額等合計	108,191
純資産合計	104,264,998
負債純資産合計	128,535,237

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第40期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		38,900,518
運用受託報酬		5,763,952
投資助言報酬		699,359
その他の営業収益		206,638
営業収益計		45,570,468
営業費用		30,344,119
一般管理費	1	10,363,314
営業利益		4,863,035
営業外収益	2	482,490
営業外費用	3	179,370
経常利益		5,166,155
特別損失	4	0
税引前中間純利益		5,166,155
法人税、住民税及び事業税		1,475,655
法人税等調整額		64,954
法人税等合計		1,410,700
中間純利益		3,755,454

## (3)中間株主資本等変動計算書



第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金 繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	27,075,963
当中間期変動額						
剰余金の配当						10,838,419
中間純利益						3,755,454
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）						
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	7,082,964
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	19,992,998

	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	27,360,208	111,456,155	50,045	50,045	111,406,109
当中間期変動額					
剰余金の配当	10,838,419	10,838,419			10,838,419
中間純利益	3,755,454	3,755,454			3,755,454
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）			58,146	58,146	58,146
当中間期変動額合計	7,082,964	7,082,964	58,146	58,146	7,141,110
当中間期末残高	20,277,244	104,373,190	108,191	108,191	104,264,998

## 注記事項

## （重要な会計方針）

## 1．資産の評価基準及び評価方法

## (1)有価証券

## 子会社株式

移動平均法による原価法

## その他有価証券

## 市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

## 市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

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、当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4．収益及び費用の計上基準

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

(1)委託者報酬

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

(2)運用受託報酬

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

(3)投資助言報酬

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

(中間貸借対照表関係)

第40期中間会計期間 (2024年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,996,227千円
2.消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。	

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

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

（中間損益計算書関係）

第40期中間会計期間 （自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）	
1. 一般管理費のうち主要なもの	
のれん償却費	152,270千円
減価償却実施額	
有形固定資産	134,998千円
無形固定資産	1,537,662千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	387,174千円
投資有価証券売却益	798千円
為替差益	6,926千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
金銭の信託運用損	11,765千円
投資有価証券償還損	124,882千円
投資有価証券売却損	93千円
投資事業組合運用損	42,628千円
4. 特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	0千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

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

第40期中間会計期間 （自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）	
1. オペレーティング・リース取引 （借主側）	
未経過リース料（解約不能のもの）	
1年以内	1,145,406千円
1年超	5,081,701千円
合計	6,227,108千円

（金融商品関係）

1. 金融商品の時価等に関する事項

第40期中間会計期間（2024年9月30日）

2024年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません（（注1）参照）。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似することから、注記を省略しております。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
----	------------	----	----

(1)金銭の信託	32,385,266	32,385,266	-
(2)投資有価証券 その他有価証券	7,511,892	7,511,892	-
資産計	39,897,158	39,897,158	-

(注1) 市場価格のない金融商品

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券	
(1)非上場株式	40,367
(2)組合出資金等	1,076,640
合計	1,117,008
子会社株式	
非上場株式	1,927,221
合計	1,927,221

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

## 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

区分	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
(1)金銭の信託	-	32,385,266	-	32,385,266
(2)投資有価証券 その他有価証券	-	7,511,892	-	7,511,892
資産計	-	39,897,158	-	39,897,158

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

## (1) 金銭の信託

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

## (2) 投資有価証券 その他有価証券

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

(有価証券関係)

第40期中間会計期間(2024年9月30日)

## 1. 子会社株式

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

## 2. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	3,313,926	3,300,367	13,559
小計	3,313,926	3,300,367	13,559

(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの 投資信託等	4,197,965	4,313,296	115,330
小計	4,197,965	4,313,296	115,330
合計	7,511,892	7,613,663	101,770

(注) 組合出資金等(中間貸借対照表計上額 1,117,008千円)については、市場価格がないことから、記載しておりません。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(収益認識関係)

第40期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

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

(セグメント情報等)

第40期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	38,900,518	5,763,952	699,359	206,638	45,570,468

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第40期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,078円38銭
1株当たり中間純利益	110円87銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	



**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 . X B R Lデータは監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の中間監査報告書**

2024年11月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

佐藤 栄 裕

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

深井 康 治

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2024年4月1日から2025年3月31日までの第40期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2024年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

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

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2025年1月8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11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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド(安定型)の2024年4月27日から2024年10月26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、アセットアロケーション・ファンド(安定型)の2024年10月26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4月27日から2024年10月26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

2025年1月8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11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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の2024年4月27日から2024年10月26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、アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の2024年10月26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4月27日から2024年10月26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

2025年1月8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11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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド(成長型)の2024年4月27日から2024年10月26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、アセットアロケーション・ファンド(成長型)の2024年10月26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4月27日から2024年10月26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。