

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年6月10日提出
【計算期間】	第4期中(自 2020年9月16日至 2021年3月15日)
【ファンド名】	三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型） 三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型） 三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型） 三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型） 三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型） 三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【電話番号】	03-6205-1649
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【ファンドの運用状況】

(1)【投資状況】

三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

2021年 3月31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	44,362,260	0.97
親投資信託受益証券	日本	4,470,321,990	98.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	45,169,321	0.99
合計(純資産総額)		4,559,853,571	100.00

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

三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

2021年 3月31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	42,448,122	1.96
親投資信託受益証券	日本	2,098,643,617	97.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	21,705,354	1.01
合計(純資産総額)		2,162,797,093	100.00

三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

2021年 3月31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	151,517,887	2.95
親投資信託受益証券	日本	4,931,651,494	96.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	51,941,554	1.01
合計(純資産総額)		5,135,110,935	100.00

三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

2021年 3月31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	82,729,296	3.91
親投資信託受益証券	日本	2,012,036,109	95.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	21,318,254	1.01
合計(純資産総額)		2,116,083,659	100.00

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

2021年 3月31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	103,182,886	4.91
親投資信託受益証券	日本	1,977,325,537	94.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	21,018,536	1.00
合計(純資産総額)		2,101,526,959	100.00

（２）【運用実績】

①【純資産の推移】

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額 (円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第3期 (2020年 9月15日)	3,201,120,313	3,201,120,313	10,352	10,352
2020年 3月末日	2,133,636,125	—	9,927	—
4月末日	2,355,573,309	—	10,088	—
5月末日	2,507,864,285	—	10,185	—
6月末日	2,703,806,897	—	10,199	—
7月末日	2,884,815,379	—	10,235	—
8月末日	3,064,782,512	—	10,336	—
9月末日	3,315,235,342	—	10,331	—
10月末日	3,520,186,485	—	10,243	—
11月末日	3,762,936,667	—	10,515	—
12月末日	3,997,736,761	—	10,584	—
2021年 1月末日	4,163,452,172	—	10,596	—
2月末日	4,241,072,603	—	10,534	—
3月末日	4,559,853,571	—	10,703	—

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額 (円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第3期 (2020年 9月15日)	1,423,870,207	1,423,870,207	10,504	10,504
2020年 3月末日	1,007,552,373	—	9,712	—
4月末日	1,079,517,368	—	9,961	—
5月末日	1,146,865,579	—	10,167	—
6月末日	1,205,592,327	—	10,222	—
7月末日	1,270,979,460	—	10,258	—
8月末日	1,377,346,975	—	10,512	—
9月末日	1,466,625,447	—	10,459	—
10月末日	1,545,603,251	—	10,323	—
11月末日	1,711,824,334	—	10,796	—
12月末日	1,803,136,388	—	10,927	—
2021年 1月末日	1,889,811,091	—	10,982	—
2月末日	1,997,446,584	—	11,022	—
3月末日	2,162,797,093	—	11,313	—

三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額 (円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第3期 (2020年 9月15日)	3,340,276,783	3,340,276,783	10,752	10,752
2020年 3月末日	2,142,238,229	—	9,597	—
4月末日	2,437,391,609	—	9,954	—
5月末日	2,627,654,814	—	10,244	—
6月末日	2,784,413,643	—	10,340	—
7月末日	2,973,660,172	—	10,386	—
8月末日	3,242,643,908	—	10,781	—
9月末日	3,461,308,520	—	10,677	—
10月末日	3,711,133,358	—	10,506	—
11月末日	4,109,896,072	—	11,176	—
12月末日	4,371,500,331	—	11,370	—
2021年 1月末日	4,525,904,638	—	11,484	—
2月末日	4,697,687,423	—	11,629	—
3月末日	5,135,110,935	—	12,035	—

三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

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

		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第3期	(2020年 9月15日)	1,407,129,947	1,407,129,947	10,813	10,813
	2020年 3月末日	850,022,379	—	9,327	—
	4月末日	972,380,555	—	9,771	—
	5月末日	1,056,040,764	—	10,135	—
	6月末日	1,170,605,239	—	10,283	—
	7月末日	1,231,438,047	—	10,346	—
	8月末日	1,373,534,523	—	10,866	—
	9月末日	1,441,931,658	—	10,708	—
	10月末日	1,484,995,945	—	10,516	—
	11月末日	1,658,734,483	—	11,362	—
	12月末日	1,743,550,861	—	11,613	—
	2021年 1月末日	1,830,387,563	—	11,793	—
	2月末日	1,926,853,020	—	12,042	—
	3月末日	2,116,083,659	—	12,551	—

三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額 (円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第3期 (2020年 9月15日)	1,374,244,182	1,374,244,182	10,821	10,821
2020年 3月末日	884,753,724	—	9,009	—
4月末日	1,003,134,535	—	9,560	—
5月末日	1,112,440,086	—	9,968	—
6月末日	1,181,987,042	—	10,177	—
7月末日	1,239,892,377	—	10,266	—
8月末日	1,357,186,100	—	10,894	—
9月末日	1,399,620,696	—	10,683	—
10月末日	1,433,669,547	—	10,503	—
11月末日	1,587,798,702	—	11,499	—
12月末日	1,733,706,695	—	11,795	—
2021年 1月末日	1,828,030,400	—	12,051	—
2月末日	1,926,139,920	—	12,383	—
3月末日	2,101,526,959	—	12,951	—

②【分配の推移】

三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）

	計算期間	1万口当たり分配金 (円)
--	------	---------------

第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0
-----	-------------------------	---

三井住友・資産最適化ファンド（２ やや安定型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0

三井住友・資産最適化ファンド（３ バランス型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0

三井住友・資産最適化ファンド（４ やや成長型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0

三井住友・資産最適化ファンド（５ 成長重視型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0

③【収益率の推移】

三井住友・資産最適化ファンド（１ 安定重視型）

	収益率（％）
第3期	0.2
第4期（中間期）	3.2

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

三井住友・資産最適化ファンド（２ やや安定型）

	収益率（％）
第3期	1.9
第4期（中間期）	7.3

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

三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

	収益率（％）
第3期	3.0
第4期（中間期）	11.3

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

三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

	収益率（％）
第3期	3.4
第4期（中間期）	15.2

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

三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

	収益率（％）
第3期	4.1
第4期（中間期）	18.8

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

（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）

2021年 3月31日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	191,341,230,930	98.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	3,141,807,450	1.62
合計(純資産総額)		194,483,038,380	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	3,126,400,000	1.60
合計	買建	—	3,126,400,000	1.60

外国株式インデックス・マザーファンド

2021年 3月31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	191,467,858,614	66.47
	イギリス	12,714,266,456	4.41
	カナダ	10,197,479,620	3.54
	フランス	9,557,880,967	3.32
	スイス	9,425,668,026	3.27
	ドイツ	8,771,377,349	3.04
	オーストラリア	5,678,023,102	1.97
	オランダ	5,552,789,352	1.93
	アイルランド	5,371,733,844	1.86
	スウェーデン	3,201,704,613	1.11
	香港	2,343,529,516	0.81
	スペイン	2,229,879,046	0.77
	デンマーク	2,203,045,463	0.76
	イタリア	1,767,888,352	0.61
	フィンランド	1,129,720,111	0.39
	ジャージー	1,046,070,045	0.36
	バミューダ	1,001,736,204	0.35
	シンガポール	902,966,039	0.31
	ベルギー	806,497,343	0.28
	ノルウェー	588,056,233	0.20

	イスラエル	554,954,468	0.19
	ケイマン諸島	516,230,624	0.18
	ニュージーランド	305,680,537	0.11
	ルクセンブルグ	286,149,850	0.10
	キュラソー	221,325,418	0.08
	オーストリア	173,013,667	0.06
	ポルトガル	145,061,599	0.05
	リベリア	112,349,781	0.04
	マン島	67,317,902	0.02
	パプアニューギニア	36,708,930	0.01
	小計	278,376,963,071	96.64
投資証券	アメリカ	5,320,501,441	1.85
	オーストラリア	679,258,718	0.24
	イギリス	164,489,636	0.06
	フランス	152,171,690	0.05
	香港	145,748,108	0.05
	シンガポール	139,894,774	0.05
	カナダ	31,532,404	0.01
	小計	6,633,596,771	2.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	3,059,246,480	1.06
合計(純資産総額)		288,069,806,322	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	1,835,609,441	0.63
	買建	ドイツ	397,042,624	0.13
	買建	イギリス	112,720,986	0.03
	買建	オーストラリア	113,211,120	0.03
合計	買建	—	2,458,584,171	0.82

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	—	335,311,400	0.11
	売建	—	604,859,400	△0.20

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2021年 3月31日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	ケイマン諸島	2,669,553,681	18.72
	台湾	1,504,327,077	10.55
	韓国	1,467,327,265	10.29
	インド	1,068,014,084	7.49
	中国	719,050,271	5.04
	ブラジル	469,375,088	3.29
	南アフリカ	404,721,623	2.84
	タイ	205,919,842	1.44
	香港	203,708,861	1.43
	メキシコ	187,736,117	1.32
	マレーシア	153,266,258	1.07
	インドネシア	136,851,649	0.96
	バミューダ	76,927,529	0.54
	フィリピン	71,633,876	0.50
	チリ	62,140,375	0.44
	ポーランド	61,212,850	0.43
	アメリカ	39,968,207	0.28
	トルコ	30,746,588	0.22
	ハンガリー	21,116,948	0.15
	ルクセンブルグ	18,616,092	0.13
	コロンビア	17,515,182	0.12
	ギリシャ	11,946,624	0.08
	チェコ	11,396,388	0.08
	エジプト	8,683,811	0.06
	マン島	4,087,347	0.03
	ペルー	2,474,076	0.02

	シンガポール	2,044,081	0.01
	アルゼンチン	1,166,901	0.01
	小計	9,631,528,691	67.53
投資信託受益証券	香港	497,495,093	3.49
投資証券	アメリカ	834,235,300	5.85
	ブラジル	10,198,262	0.07
	メキシコ	4,749,550	0.03
	南アフリカ	4,282,367	0.03
	小計	853,465,479	5.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	3,280,877,753	23.00
合計(純資産総額)		14,263,367,016	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	3,280,414,797	22.99
合計	買建	—	3,280,414,797	22.99

種類	買建／ 売建	国／地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
為替予約取引	買建	—	2,307,918,930	16.18

Jリート・インデックス・マザーファンド

2021年 3月31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	7,850,280,300	98.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	127,463,783	1.60
合計(純資産総額)		7,977,744,083	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 （％）
R E I T指数先物取引	買建	日本	60,135,000	0.75
合計	買建	—	60,135,000	0.75

外国リート・インデックス・マザーファンド

2021年 3月31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	8,068,572,745	73.39
	オーストラリア	765,317,789	6.96
	イギリス	617,695,739	5.62
	シンガポール	443,062,242	4.03
	フランス	255,165,541	2.32
	カナダ	210,255,188	1.91
	香港	178,980,281	1.63
	ベルギー	141,098,743	1.28
	スペイン	50,396,221	0.46
	ニュージーランド	49,248,463	0.45
	ドイツ	29,658,175	0.27
	オランダ	22,453,364	0.20
	ガーンジー	18,171,412	0.17
	韓国	15,077,597	0.14
	アイルランド	13,266,946	0.12
	イスラエル	6,287,263	0.06

	イタリア	1,532,772	0.01
	マン島	1,484,596	0.01
	小計	10,887,725,077	99.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	105,385,398	0.96
合計(純資産総額)		10,993,110,475	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	—	15,414,429	0.14

国内債券パッシブ・マザーファンド

2021年 3月31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	104,246,934,420	80.79
地方債証券	日本	8,541,602,920	6.62
特殊債券	日本	11,619,414,577	9.00
社債券	日本	3,840,945,000	2.98
	フランス	200,544,000	0.16
	小計	4,041,489,000	3.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	590,150,884	0.46
合計(純資産総額)		129,039,591,801	100.00

外国債券パッシブ・マザーファンド

2021年 3月31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	71,216,470,703	43.29
	フランス	16,834,962,287	10.23
	イタリア	15,831,888,184	9.62
	ドイツ	12,197,501,545	7.41
	イギリス	10,914,344,418	6.63

	スペイン	9,599,450,639	5.83
	ベルギー	4,134,129,158	2.51
	オーストラリア	3,782,655,858	2.30
	カナダ	3,272,509,019	1.99
	オランダ	3,214,066,972	1.95
	オーストリア	2,663,156,442	1.62
	アイルランド	1,421,231,342	0.86
	メキシコ	1,289,534,925	0.78
	フィンランド	1,143,090,060	0.69
	ポーランド	1,036,757,683	0.63
	デンマーク	829,986,914	0.50
	マレーシア	825,225,602	0.50
	イスラエル	739,325,770	0.45
	シンガポール	691,783,995	0.42
	スウェーデン	545,576,576	0.33
	ノルウェー	405,740,780	0.25
	小計	162,589,388,872	98.83
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	—	1,928,460,845	1.17
合計(純資産総額)		164,517,849,717	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2021年 3月31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	7,527,430,336	43.77
	フランス	1,796,176,060	10.45
	イタリア	1,657,124,645	9.64
	ドイツ	1,262,543,131	7.34
	イギリス	1,152,063,974	6.70
	スペイン	1,065,423,085	6.20
	ベルギー	403,421,815	2.35
	オーストラリア	397,955,067	2.31
	カナダ	344,945,089	2.01
	オランダ	337,890,739	1.96
	オーストリア	278,511,303	1.62
	シンガポール	158,820,371	0.92
	アイルランド	157,294,197	0.91
	メキシコ	136,638,344	0.79
	フィンランド	126,117,145	0.73
	ポーランド	108,647,341	0.63
	デンマーク	87,278,164	0.51

		イスラエル	76,486,998	0.44
		スウェーデン	58,350,267	0.34
		ノルウェー	43,595,917	0.25
		小計	17,176,713,988	99.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		—	19,390,807	0.11
合計(純資産総額)			17,196,104,795	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	—	17,405,182,800	△101.21

2【設定及び解約の実績】

三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第3期	2,142,530,997	364,184,551
第4期（中間期）	1,431,397,479	344,176,247

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第3期	853,822,366	158,356,618
第4期（中間期）	599,657,249	102,055,613

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第3期	2,085,818,899	277,142,914
第4期（中間期）	1,287,068,042	233,236,411

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第3期	839,231,080	145,565,103
第4期（中間期）	466,751,611	134,346,433

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第3期	843,783,098	303,192,666
第4期（中間期）	517,663,583	201,728,592

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期中間計算期間（2020年 9月16日から2021年 3月15日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,891,875	1,073,587
コール・ローン	55,679,071	70,088,992
投資証券	31,620,878	43,588,566
親投資信託受益証券	3,136,841,464	4,376,690,658
流動資産合計	3,226,033,288	4,491,441,803
資産合計	3,226,033,288	4,491,441,803
負債の部		
流動負債		
未払金	995,773	-
未払解約金	11,282,503	8,677,923
未払受託者報酬	427,784	627,888
未払委託者報酬	12,120,451	17,790,142
未払利息	133	155
その他未払費用	86,331	125,522
流動負債合計	24,912,975	27,221,630
負債合計	24,912,975	27,221,630
純資産の部		
元本等		
元本	3,092,365,397	4,179,586,629
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	108,754,916	284,633,544
元本等合計	3,201,120,313	4,464,220,173
純資産合計	3,201,120,313	4,464,220,173
負債純資産合計	3,226,033,288	4,491,441,803

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2019年 9月18日 至 2020年 3月17日	第4期中間計算期間 自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15日
営業収益		
受取配当金	327,128	694,603
受取利息	178	-
有価証券売買等損益	△130,069,217	138,937,987
為替差損益	△313,571	1,426,359
営業収益合計	△130,055,482	141,058,949
営業費用		
支払利息	8,891	24,685
受託者報酬	289,659	627,888
委託者報酬	8,206,997	17,790,142
その他費用	73,218	138,142
営業費用合計	8,578,765	18,580,857
営業利益又は営業損失（△）	△138,634,247	122,478,092
経常利益又は経常損失（△）	△138,634,247	122,478,092
中間純利益又は中間純損失（△）	△138,634,247	122,478,092
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（△）	△159,567	4,948,766
期首剰余金又は期首欠損金（△）	42,966,500	108,754,916
剰余金増加額又は欠損金減少額	36,005,881	70,934,717
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	36,005,881	70,934,717
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,718,191	12,585,415
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,718,191	12,585,415
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（△）	△65,220,490	284,633,544

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第4期中間計算期間 自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(表示方法の変更)

当期より、従来「投資信託受益証券」として記載していた銘柄の一部を、投信計理システムの統合に向け、「投資証券」として記載することといたしました。この表示方法の変更を反映させるため、前期の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前期の貸借対照表において「投資信託受益証券」に表示されていた31,620,878円は、「投資証券」31,620,878円として組替えております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
-----	------------------------	------------------------------

1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	3,092,365,397口	4,179,586,629口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額
	1.0352円 10,352円)	1.0681円 10,681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4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はあります。
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。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
期首元本額	1,314,018,951円	3,092,365,397円
期中追加設定元本額	2,142,530,997円	1,431,397,479円
期中一部解約元本額	364,184,551円	344,176,247円

【三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）】

（１）【中間貸借対照表】

(単位：円)		
	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,848,738	976,589
コール・ローン	21,455,680	30,845,410
投資証券	27,761,165	40,217,401
親投資信託受益証券	1,381,309,592	2,025,521,024
未収入金	-	5,000,000
流動資産合計	1,432,375,175	2,102,560,424
資産合計	1,432,375,175	2,102,560,424
負債の部		
流動負債		
未払金	995,773	-
未払解約金	1,780,457	6,315,406
未払受託者報酬	193,964	285,891
未払委託者報酬	5,495,616	8,100,203
未払利息	51	68
その他未払費用	39,107	57,116
流動負債合計	8,504,968	14,758,684
負債合計	8,504,968	14,758,684
純資産の部		
元本等		
元本	1,355,505,520	1,853,107,156
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	68,364,687	234,694,584
元本等合計	1,423,870,207	2,087,801,740
純資産合計	1,423,870,207	2,087,801,740
負債純資産合計	1,432,375,175	2,102,560,424

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2019年 9月18日 至 2020年 3月17日	第4期中間計算期間 自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15日
営業収益		
受取配当金	326,697	642,097
受取利息	180	-
有価証券売買等損益	△105,717,659	132,689,355
為替差損益	△345,857	1,367,066
営業収益合計	△105,736,639	134,698,518
営業費用		
支払利息	4,109	10,314
受託者報酬	142,966	285,891
委託者報酬	4,050,591	8,100,203
その他費用	44,520	69,710
営業費用合計	4,242,186	8,466,118
営業利益又は営業損失（△）	△109,978,825	126,232,400
経常利益又は経常損失（△）	△109,978,825	126,232,400
中間純利益又は中間純損失（△）	△109,978,825	126,232,400
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（△）	724,013	2,820,029
期首剰余金又は期首欠損金（△）	20,483,351	68,364,687
剰余金増加額又は欠損金減少額	20,118,630	48,341,619
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	20,118,630	48,341,619
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,174,389	5,424,093
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,174,389	5,424,093
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（△）	△72,275,246	234,694,584

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第4期中間計算期間 自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(表示方法の変更)

当期より、従来「投資信託受益証券」として記載していた銘柄の一部を、投信計理システムの統合に向け、「投資証券」として記載することといたしました。この表示方法の変更を反映させるため、前期の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前期の貸借対照表において「投資信託受益証券」に表示されていた27,761,165円は、「投資証券」27,761,165円として組替えております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
-----	------------------------	------------------------------

1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,355,505,520口	1,853,107,156口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額	1.0504円 10,504円)
		1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額
		1.1266円 11,266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4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はあります。
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。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
期首元本額	660,039,772円	1,355,505,520円
期中追加設定元本額	853,822,366円	599,657,249円
期中一部解約元本額	158,356,618円	102,055,613円

【三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）】

（１）【中間貸借対照表】

(単位：円)		
	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	4,486,396	2,840,137
コール・ローン	46,319,976	80,227,069
投資証券	99,093,936	144,889,104
親投資信託受益証券	3,208,150,156	4,784,322,482
流動資産合計	3,358,050,464	5,012,278,792
資産合計	3,358,050,464	5,012,278,792
負債の部		
流動負債		
未払金	2,903,337	-
未払解約金	1,799,066	13,520,095
未払受託者報酬	442,569	682,988
未払委託者報酬	12,539,315	19,351,108
未払利息	110	177
その他未払費用	89,284	136,534
流動負債合計	17,773,681	33,690,902
負債合計	17,773,681	33,690,902
純資産の部		
元本等		
元本	3,106,753,445	4,160,585,076
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	233,523,338	818,002,814
元本等合計	3,340,276,783	4,978,587,890
純資産合計	3,340,276,783	4,978,587,890
負債純資産合計	3,358,050,464	5,012,278,792

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2019年 9月18日 至 2020年 3月17日	第4期中間計算期間 自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15日
営業収益		
受取配当金	1,021,515	2,297,882
受取利息	410	-
有価証券売買等損益	△312,064,765	478,199,688
為替差損益	△1,061,179	4,865,640
営業収益合計	△312,104,019	485,363,210
営業費用		
支払利息	9,174	24,726
受託者報酬	295,413	682,988
委託者報酬	8,370,073	19,351,108
その他費用	84,017	158,746
営業費用合計	8,758,677	20,217,568
営業利益又は営業損失（△）	△320,862,696	465,145,642
経常利益又は経常損失（△）	△320,862,696	465,145,642
中間純利益又は中間純損失（△）	△320,862,696	465,145,642
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	2,811,474	12,957,003
期首剰余金又は期首欠損金（△）	57,559,319	233,523,338
剰余金増加額又は欠損金減少額	64,779,279	150,730,351
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	64,779,279	150,730,351
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,860,690	18,439,514
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,860,690	18,439,514
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（△）	△208,196,262	818,002,814

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針の注記）

項 目	第4期中間計算期間 自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（表示方法の変更）

当期より、従来「投資信託受益証券」として記載していた銘柄の一部を、投信計理システムの統合に向け、「投資証券」として記載することといたしました。この表示方法の変更を反映させるため、前期の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前期の貸借対照表において「投資信託受益証券」に表示されていた99,093,936円は、「投資証券」99,093,936円として組替えております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項 目	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
-----	------------------------	------------------------------

1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	3,106,753,445口	4,160,585,076口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	1.0752円 10,752円)
	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	1.1966円 11,966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4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はあります。
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。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
期首元本額	1,298,077,460円	3,106,753,445円
期中追加設定元本額	2,085,818,899円	1,287,068,042円
期中一部解約元本額	277,142,914円	233,236,411円

【三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,406,285	3,287,838
コール・ローン	21,317,416	29,326,865
投資証券	55,642,198	79,500,340
親投資信託受益証券	1,336,906,211	1,936,405,181
流動資産合計	1,415,272,110	2,048,520,224
資産合計	1,415,272,110	2,048,520,224
負債の部		
流動負債		
未払金	491,888	1,640,845
未払解約金	2,266,244	2,994,766
未払受託者報酬	182,289	277,853
未払委託者報酬	5,164,887	7,872,404
未払利息	50	65
その他未払費用	36,805	55,509
流動負債合計	8,142,163	12,841,442
負債合計	8,142,163	12,841,442
純資産の部		
元本等		
元本	1,301,295,399	1,633,700,577
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	105,834,548	401,978,205
元本等合計	1,407,129,947	2,035,678,782
純資産合計	1,407,129,947	2,035,678,782
負債純資産合計	1,415,272,110	2,048,520,224

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2019年 9月18日 至 2020年 3月17日	第4期中間計算期間 自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15日
営業収益		
受取配当金	596,471	1,249,139
受取利息	282	-
有価証券売買等損益	△161,705,749	253,496,209
為替差損益	△568,601	2,653,886
営業収益合計	△161,677,597	257,399,234
営業費用		
支払利息	3,941	10,240
受託者報酬	129,577	277,853
委託者報酬	3,671,390	7,872,404
その他費用	44,215	72,456
営業費用合計	3,849,123	8,232,953
営業利益又は営業損失（△）	△165,526,720	249,166,281
経常利益又は経常損失（△）	△165,526,720	249,166,281
中間純利益又は中間純損失（△）	△165,526,720	249,166,281
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	1,635,648	9,328,560
期首剰余金又は期首欠損金（△）	27,670,078	105,834,548
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,367,488	67,952,009
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	23,367,488	67,952,009
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,919,966	11,646,073
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,919,966	11,646,073
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（△）	△120,044,768	401,978,205

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第4期中間計算期間 自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(表示方法の変更)

当期より、従来「投資信託受益証券」として記載していた銘柄の一部を、投信計理システムの統合に向け、「投資証券」として記載することといたしました。この表示方法の変更を反映させるため、前期の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前期の貸借対照表において「投資信託受益証券」に表示されていた55,642,198円は、「投資証券」55,642,198円として組替えております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
-----	------------------------	------------------------------

1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,301,295,399口	1,633,700,577口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0813円 (10,000口当たりの純資産額 10,813円)	1口当たり純資産額 1.2461円 (10,000口当たりの純資産額 12,461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4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はあります。
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。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
期首元本額	607,629,422円	1,301,295,399円
期中追加設定元本額	839,231,080円	466,751,611円
期中一部解約元本額	145,565,103円	134,346,433円

【三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）】

（１）【中間貸借対照表】

(単位：円)		
	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	2,079,774	1,657,546
コール・ローン	19,141,984	29,170,686
投資証券	68,096,365	98,390,690
親投資信託受益証券	1,292,663,947	1,920,724,635
未収入金	1,000,000	-
流動資産合計	1,382,982,070	2,049,943,557
資産合計	1,382,982,070	2,049,943,557
負債の部		
流動負債		
未払金	899,795	-
未払解約金	2,372,482	2,297,726
未払受託者報酬	185,054	272,698
未払委託者報酬	5,243,199	7,726,463
未払利息	45	64
その他未払費用	37,313	54,474
流動負債合計	8,737,888	10,351,425
負債合計	8,737,888	10,351,425
純資産の部		
元本等		
元本	1,270,023,612	1,585,958,603
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	104,220,570	453,633,529
元本等合計	1,374,244,182	2,039,592,132
純資産合計	1,374,244,182	2,039,592,132
負債純資産合計	1,382,982,070	2,049,943,557

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2019年 9月18日 至 2020年 3月17日	第4期中間計算期間 自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15日
営業収益		
受取配当金	799,808	1,531,029
受取利息	372	-
有価証券売買等損益	△199,361,925	300,553,168
為替差損益	△713,877	3,446,291
営業収益合計	△199,275,622	305,530,488
営業費用		
支払利息	4,853	10,954
受託者報酬	138,393	272,698
委託者報酬	3,921,061	7,726,463
その他費用	49,077	79,158
営業費用合計	4,113,384	8,089,273
営業利益又は営業損失（△）	△203,389,006	297,441,215
経常利益又は経常損失（△）	△203,389,006	297,441,215
中間純利益又は中間純損失（△）	△203,389,006	297,441,215
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（△）	5,281,321	15,971,310
期首剰余金又は期首欠損金（△）	29,069,980	104,220,570
剰余金増加額又は欠損金減少額	24,802,188	85,971,927
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	24,802,188	85,971,927
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,939,925	18,028,873
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,939,925	18,028,873
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（△）	△162,738,084	453,633,529

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第4期中間計算期間 自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(表示方法の変更)

当期より、従来「投資信託受益証券」として記載していた銘柄の一部を、投信計理システムの統合に向け、「投資証券」として記載することといたしました。この表示方法の変更を反映させるため、前期の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前期の貸借対照表において「投資信託受益証券」に表示されていた68,096,365円は、「投資証券」68,096,365円として組替えております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
-----	------------------------	------------------------------

1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,270,023,612口	1,585,958,603口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額
	1.0821円 10,821円)	1.2860円 12,860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4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はあります。
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。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第3期 (2020年 9月15日現在)	第4期中間計算期間 (2021年 3月15日現在)
期首元本額	729,433,180円	1,270,023,612円
期中追加設定元本額	843,783,098円	517,663,583円
期中一部解約元本額	303,192,666円	201,728,592円

（参考）

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

貸借対照表

(単位：円)		
	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	501,238	985,557
コール・ローン	2,233,641,214	2,934,020,518
株式	172,945,807,630	192,801,693,110
派生商品評価勘定	21,661,900	95,381,700
未収入金	5,938,800	492,800
未収配当金	69,902,433	262,829,473
差入委託証拠金	-	13,200,000
流動資産合計	175,277,453,215	196,108,603,158
資産合計	175,277,453,215	196,108,603,158
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	829,800	-
前受金	20,930,000	95,550,000
未払金	14,890,000	-
未払解約金	487,337,774	222,140,931
未払利息	5,343	6,504
その他未払費用	44,248	-
流動負債合計	524,037,165	317,697,435
負債合計	524,037,165	317,697,435
純資産の部		
元本等		
元本	65,691,116,604	60,686,308,146
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	109,062,299,446	135,104,597,577
元本等合計	174,753,416,050	195,790,905,723
純資産合計	174,753,416,050	195,790,905,723
負債純資産合計	175,277,453,215	196,108,603,158

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15日
-----	--------------------------------

1.有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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。
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（2020年 9月15日現在）	（2021年 3月15日現在）
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。
	株式 2,826,400,000円	株式 3,336,000,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	65,691,116,604口	60,686,308,146口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6602円 (10,000口当たりの純資産額 26,602円)	1口当たり純資産額 3.2263円 (10,000口当たりの純資産額 32,263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	（2021年 3月15日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
-----------	---

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 9月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,429,867,900	-	1,450,700,000	20,832,100
	東証株価指数先物	1,429,867,900	-	1,450,700,000	20,832,100
合計		1,429,867,900	-	1,450,700,000	20,832,100

（2021年 3月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,880,468,300	-	2,975,850,000	95,381,700
	東証株価指数先物	2,880,468,300	-	2,975,850,000	95,381,700
合計		2,880,468,300	-	2,975,850,000	95,381,700

（注） 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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います。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います。

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）

(2020年 9月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	66,708,868,107円
同期中における追加設定元本額	16,723,756,826円
同期中における一部解約元本額	17,741,508,329円
2020年 9月15日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,803,407,938円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	956,781,736円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,557,926,901円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,246,692,882円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	79,199,185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）	6,261,625円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	24,034,515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）	67,454,138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）	129,701,004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）	94,275,180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）	193,204,597円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,465,770,896円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	14,476,719,660円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	556,078,457円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	630,495,924円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	399,246,054円
イオン・バランス戦略ファンド	79,845,037円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	18,359,609円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	108,239,510円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	85,447,414円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	276,242,392円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	143,054,941円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	159,884,358円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	21,176,370円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	84,644,782円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	4,979,462円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	28,188,783円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	20,796,599円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,094,930円
SMAM・国内株式バッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	3,481,332,533円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	19,671,842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＞	186,206,344円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	2,810,248,964円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,203,664,791円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	8,216,704,531円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	51,276,484円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	205,573,161円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	540,428円

SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	875,023,385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＞	57,132,852円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	353,640,333円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,043,896,738円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	829,812,974円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	2,633,231,481円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	804,861円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	56,635,977円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	68,958,833円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	43,825,793円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	21,322,488円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	169,050,752円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	333,937,474円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	96,790,701円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	51,654,165円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	9,439,355円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞	62,370,920円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	834,474,721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）	192,328,030円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2＜適格機関投資家専用＞	5,357,793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＞	643,792,295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＞	170,212,578円
SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	1,464,565,051円
SMAM・世界バランスファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	112,200,588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＞	16,640,426円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04＜適格機関投資家限定＞	57,544,240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＞	77,260,127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II＜適格機関投資家限定＞	512,787,716円
合計	65,691,116,604円

(2021年 3月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	65,691,116,604円
同期中における追加設定元本額	4,752,299,372円
同期中における一部解約元本額	9,757,107,830円
2021年 3月15日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,434,563,676円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	881,572,646円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,275,286,516円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,166,714,639円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	142,638,527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）	4,745,714円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	21,668,995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）	63,573,532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）	128,977,623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）	101,753,497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）	196,685,416円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,099,039,489円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	15,660,750,919円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	466,003,423円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	492,978,072円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	316,456,058円
イオン・バランス戦略ファンド	68,572,875円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド２０５０	22,251,381円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	126,315,110円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	104,388,049円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	341,249,550円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	170,154,815円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	195,141,463円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	23,557,260円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	170,550,868円
三井住友DS・年金バランス３０（債券重点型）	9,484,561円
三井住友DS・年金バランス５０（標準型）	41,537,433円
三井住友DS・年金バランス７０（株式重点型）	37,505,187円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド２０６０	3,155,212円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	3,182,789,185円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	19,404,875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＞	137,166,232円
SMAM・バランスファンドVA２５＜適格機関投資家専用＞	2,187,238,504円
SMAM・バランスファンドVA３７．５＜適格機関投資家専用＞	1,851,357,152円
SMAM・バランスファンドVA５０＜適格機関投資家専用＞	6,904,007,616円
SMAM・バランスファンドVL３０＜適格機関投資家限定＞	43,890,062円
SMAM・バランスファンドVL５０＜適格機関投資家限定＞	181,035,305円
世界６資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	438,764円
SMAM・バランスファンドVA７５＜適格機関投資家専用＞	787,238,358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＞	49,447,751円
SMAM・インデックス・バランスVA２５＜適格機関投資家専用＞	287,589,753円
SMAM・インデックス・バランスVA５０＜適格機関投資家専用＞	899,084,795円
SMAM・バランスファンドVA４０＜適格機関投資家専用＞	697,329,505円
SMAM・バランスファンドVA３５＜適格機関投資家専用＞	2,158,595,244円
SMAM・バランスVA株４０T＜適格機関投資家限定＞	459,460円
SMAM・グローバルバランス４０VA＜適格機関投資家限定＞	46,580,813円
SMAM・アセットバランスファンドVA２０A＜適格機関投資家専用＞	54,721,197円
SMAM・アセットバランスファンドVA３５A＜適格機関投資家専用＞	35,682,955円
SMAM・アセットバランスファンドVA５０A＜適格機関投資家専用＞	17,316,995円
SMAM・アセットバランスファンドVA２０L＜適格機関投資家専用＞	136,294,500円
SMAM・アセットバランスファンドVA２５L＜適格機関投資家専用＞	275,641,234円
SMAM・アセットバランスファンドVA２０A２＜適格機関投資家専用＞	74,667,418円
SMAM・アセットバランスファンドVA３５A２＜適格機関投資家専用＞	43,489,672円
SMAM・アセットバランスファンドVA５０A２＜適格機関投資家専用＞	7,533,581円

SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞	51,931,617円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	687,858,152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）	181,102,108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＞	323,940,859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＞	132,507,354円
SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	884,039,779円
SMAM・世界バランスファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	79,523,793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＞	15,231,771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＞	45,493,073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＞	38,143,210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II＜適格機関投資家限定＞	400,262,998円
合計	60,686,308,146円

外国株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

	(単位：円)	
	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,302,839,817	2,084,535,896
コール・ローン	288,473,943	803,914,361
株式	228,238,332,343	274,571,109,949
投資証券	5,709,112,254	6,409,735,735
派生商品評価勘定	57,520,150	4,584,441
未収入金	74,226,113	4,846,772
未収配当金	357,214,595	442,616,410
差入委託証拠金	2,060,491,861	1,295,523,027
流動資産合計	240,088,211,076	285,616,866,591
資産合計	240,088,211,076	285,616,866,591
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,403,886	2,938,084
前受金	56,418,040	2,448,827
未払金	31,480,138	28,305,154
未払解約金	112,690,000	865,232,438
未払利息	690	1,782
その他未払費用	7,560	-
流動負債合計	202,000,314	898,926,285
負債合計	202,000,314	898,926,285
純資産の部		
元本等		
元本	60,178,911,589	58,578,929,083
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	179,707,299,173	226,139,011,223
元本等合計	239,886,210,762	284,717,940,306
純資産合計	239,886,210,762	284,717,940,306
負債純資産合計	240,088,211,076	285,616,866,591

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	60,178,911,589口	58,578,929,083口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.9862円 (10,000口当たりの純資産額 39,862円)	1口当たり純資産額 4.8604円 (10,000口当たりの純資産額 48,604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	(2021年 3月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 9月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,969,131,547	-	6,025,549,587	56,418,040
	SPMINI 2012	4,473,148,034	-	4,528,520,635	55,372,601
	DJ EUR 2012	1,013,627,906	-	1,012,588,849	△1,039,057
	FTSE 2012	268,614,157	-	268,981,414	367,257
	SPI200 2012	213,741,450	-	215,458,689	1,717,239
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	189,406,676	-	189,104,900	△301,776
	米ドル	128,183,903	-	127,933,300	△250,603
	カナダドル	6,427,380	-	6,415,200	△12,180
	ユーロ	25,107,144	-	25,098,000	△9,144
	英ポンド	12,219,054	-	12,218,400	△654
	スイスフラン	6,992,253	-	6,983,400	△8,853
	スウェーデンク ローナ	1,930,861	-	1,926,400	△4,461
	ノルウェークロー ネ	350,967	-	350,400	△567
	デンマーククロー ネ	1,349,984	-	1,349,600	△384
	オーストラリアド ル	4,623,822	-	4,614,600	△9,222

	香港ドル	1,913,553	-	1,908,200	△5,353
	イスラエルシェケル	307,755	-	307,400	△355
合計		6,158,538,223	-	6,214,654,487	56,116,264

(2021年 3月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,590,671,262	-	3,593,120,089	2,448,827
	SPMINI 2106	2,698,327,076	-	2,702,140,358	3,813,282
	DJ EUR 2106	577,242,297	-	575,221,701	△2,020,596
	FTSE 2106	172,284,766	-	173,046,745	761,979
	SPI200 2106	142,817,123	-	142,711,285	△105,838
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	24,537,660	-	24,542,000	4,340
	デンマーククローネ	24,537,660	-	24,542,000	4,340
	売建	332,623,090	-	333,429,900	△806,810
	米ドル	240,316,500	-	241,000,500	△684,000
	カナダドル	11,299,490	-	11,364,600	△65,110
	ユーロ	35,151,840	-	35,191,800	△39,960
	英ポンド	15,195,760	-	15,193,000	2,760
	スイスフラン	10,566,630	-	10,567,800	△1,170
	スウェーデンクローナ	3,855,000	-	3,858,000	△3,000
	ノルウェークローネ	774,620	-	776,400	△1,780
	デンマーククローネ	1,749,900	-	1,753,000	△3,100
	オーストラリアドル	8,463,780	-	8,466,000	△2,220
	香港ドル	3,783,190	-	3,790,800	△7,610
	シンガポールドル	810,500	-	811,200	△700
	イスラエルシェケル	655,880	-	656,800	△920

合計	3,947,832,012	-	3,951,091,989	1,646,357
----	---------------	---	---------------	-----------

(注) １．時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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います。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います。

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) 為替予約取引の時価の算定方法について

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います。

① 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います。

② 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います。

・ 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います。

・ 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います。

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。

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)

(2020年 9月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	50,965,014,742円
同期中における追加設定元本額	27,756,459,532円
同期中における一部解約元本額	18,542,562,685円
2020年 9月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	27,069,924,502円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	314,398,291円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,275,622,210円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	844,314,413円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	77,679,574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）	1,726,629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）	7,270,280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）	21,350,419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）	51,016,249円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	45,221,146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）	92,825,557円
外国株式指数ファンド	559,672,380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	7,284,680,963円

アセットアロケーション・ファンド (安定型)	312,818,715円
アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)	352,729,063円
アセットアロケーション・ファンド (成長型)	222,103,058円
イオン・バランス戦略ファンド	68,938,211円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	10,942,676円
三井住友・資産最適化ファンド (1 安定重視型)	78,845,428円
三井住友・資産最適化ファンド (2 やや安定型)	63,156,998円
三井住友・資産最適化ファンド (3 バランス型)	197,287,832円
三井住友・資産最適化ファンド (4 やや成長型)	100,119,280円
三井住友・資産最適化ファンド (5 成長重視型)	111,835,149円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	27,789,535円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	83,304,398円
三井住友D S・年金バランス30 (債券重点型)	1,598,623円
三井住友D S・年金バランス50 (標準型)	7,880,104円
三井住友D S・年金バランス70 (株式重点型)	5,467,099円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	1,791,304円
SMBC・DCインデックスファンド (MSCIコクサイ)	384,546円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	1,030,735,635円
バランスファンドVA (安定運用型) <適格機関投資家限定>	6,398,828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>	59,688,739円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,190,194,032円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,255,200,561円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	5,345,107,978円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	16,031,634円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	86,614,229円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	274,725円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	651,864,841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>	54,595,763円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	154,273,858円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	678,822,097円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	530,085,597円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,278,255,149円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	516,296円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS (適格機関投資家専用)	268,676,965円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	111,780,799円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	14,738,214円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	11,292,139円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	5,922,681円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	35,545,255円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	90,634,725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>	418,153,613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>	110,332,710円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,911,651,620円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	210,853,707円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,761,001,918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>	10,193,688円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	36,957,323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＞	50,795,778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Ⅱ＜適格機関投資家限定＞	499,025,860円
合計	60,178,911,589円

(2021年 3月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	60,178,911,589円
同期中における追加設定元本額	7,801,696,669円
同期中における一部解約元本額	9,401,679,175円
2021年 3月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	28,249,132,932円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	291,361,100円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,219,166,521円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	839,086,095円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	55,171,471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）	1,387,865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）	6,598,398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）	20,375,706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）	51,392,737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）	49,302,316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）	96,394,780円
外国株式指数ファンド	578,060,382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	9,008,309,107円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	268,094,447円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	281,023,511円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	180,376,158円
イオン・バランス戦略ファンド	45,972,088円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	13,449,723円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	94,101,979円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	78,170,052円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	248,708,840円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	121,756,141円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	137,695,247円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	31,531,540円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	171,603,271円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	3,142,579円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	11,853,220円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	9,942,464円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,910,399円
SMBC・DCインデックスファンド（MSCIコクサイ）	23,547,442円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	832,600,939円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	6,401,323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＞	45,229,221円

SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	974,848,885円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	1,076,868,439円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	4,616,880,477円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	15,024,345円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	81,345,985円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	221,797円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	606,561,551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＞	50,070,584円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	128,019,869円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	605,191,631円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	467,694,239円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	1,069,107,863円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	312,532円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	252,836,609円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	95,631,928円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	11,959,916円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	10,134,411円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	4,880,615円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	29,806,757円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	80,782,323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＞	216,493,593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＞	88,167,329円
SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	3,105,106,643円
SMAM・世界バランスファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	167,424,284円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA＜適格機関投資家限定＞	1,242,023,658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＞	12,428,802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＞	42,831,012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＞	35,863,425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II＜適格機関投資家限定＞	417,559,587円
合計	58,578,929,083円

エマージング株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	370,349,522	282,322,784
コール・ローン	2,112,362,318	2,105,800,658
株式	6,160,546,846	9,710,362,124
投資信託受益証券	663,772,752	498,406,272
投資証券	208,857,950	850,297,112
派生商品評価勘定	25,125,386	9,763,885
未収入金	2,231,595	140,166,232
未収配当金	6,366,448	26,432,075
前払金	-	48,752,001
差入委託証拠金	952,341,318	693,157,805

	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
流動資産合計	10,501,954,135	14,365,460,948
資産合計	10,501,954,135	14,365,460,948
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,690,712	48,752,001
前受金	24,863,703	-
未払金	27,451,381	61,578,678
未払解約金	74,633,173	18,000,000
未払利息	5,053	4,668
その他未払費用	34,538	-
流動負債合計	131,678,560	128,335,347
負債合計	131,678,560	128,335,347
純資産の部		
元本等		
元本	7,467,831,585	8,113,820,710
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	2,902,443,990	6,123,304,891
元本等合計	10,370,275,575	14,237,125,601
純資産合計	10,370,275,575	14,237,125,601
負債純資産合計	10,501,954,135	14,365,460,948

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準

	受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（2020年 9月15日現在）		（2021年 3月15日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		7,467,831,585口		8,113,820,710口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3887円	1口当たり純資産額	1.7547円
	(10,000口当たりの純資産額	13,887円)	(10,000口当たりの純資産額	17,547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	（2021年 3月15日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 9月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,316,686,308	-	3,341,550,011	24,863,703
	MSCIE 2012	3,316,686,308	-	3,341,550,011	24,863,703

市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	2,080,631,256	-	2,075,940,544	△4,690,712
	米ドル	2,080,631,256	-	2,075,940,544	△4,690,712
	売建	66,031,256	-	65,769,573	261,683
	米ドル	66,000,000	-	65,738,477	261,523
	香港ドル	31,256	-	31,096	160
合計		5,463,348,820	-	5,483,260,128	20,434,674

(2021年 3月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,212,898,875	-	3,164,146,874	△48,752,001
	MSCIE 2106	3,212,898,875	-	3,164,146,874	△48,752,001
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	2,149,900,000	-	2,159,663,885	9,763,885
	米ドル	2,149,900,000	-	2,159,663,885	9,763,885
合計		5,362,798,875	-	5,323,810,759	△38,988,116

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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います。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います。

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) 為替予約取引の時価の算定方法について

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います。

① 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います。

② 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います。

- ・ 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います。

- ・ 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います。

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。

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）

(2020年 9月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,806,463,130円
同期中における追加設定元本額	4,536,852,842円
同期中における一部解約元本額	2,875,484,387円
2020年 9月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	3,208,547,296円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,949,190,865円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	575,758,927円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	655,141,612円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	416,212,591円
イオン・バランス戦略ファンド	90,294,022円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	15,717,289円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	45,285,896円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	30,597,380円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	143,761,259円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	100,602,743円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	166,880,524円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	39,971,465円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,609,064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＞	27,260,652円
合計	7,467,831,585円

(2021年 3月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	7,467,831,585円
同期中における追加設定元本額	2,257,094,540円
同期中における一部解約元本額	1,611,105,415円
2021年 3月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	4,055,417,462円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,077,510,225円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	431,951,931円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	467,345,850円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	304,455,670円
イオン・バランス戦略ファンド	124,337,039円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	18,171,632円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	50,039,374円

三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	34,897,175円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	167,274,153円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	114,038,963円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	195,291,405円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	43,329,851円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,635,619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＞	27,124,361円
合計	8,113,820,710円

Jリート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

	(単位：円)	
	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	116,653,820	79,089,281
投資証券	6,700,385,400	7,635,010,700
派生商品評価勘定	32,400	1,376,400
未収入金	61,054,128	2,604,096
未収配当金	75,196,020	70,307,725
差入委託証拠金	12,555,000	7,830,000
流動資産合計	6,965,876,768	7,796,218,202
資産合計	6,965,876,768	7,796,218,202
負債の部		
流動負債		
前受金	39,000	1,383,000
未払金	64,240,288	32,195,090
未払解約金	98,000,000	3,942,357
未払利息	279	175
その他未払費用	2,074	-
流動負債合計	162,281,641	37,520,622
負債合計	162,281,641	37,520,622
純資産の部		
元本等		
元本	3,147,959,475	3,102,204,514
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	3,655,635,652	4,656,493,066
元本等合計	6,803,595,127	7,758,697,580
純資産合計	6,803,595,127	7,758,697,580
負債純資産合計	6,965,876,768	7,796,218,202

注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15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。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	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。
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,147,959,475口	3,102,204,514口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.1613円 (10,000口当たりの純資産額 21,613円)	1口当たり純資産額 2.5010円 (10,000口当たりの純資産額 25,010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	(2021年 3月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2.時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
-----------	---

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 9月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	51,117,600	-	51,150,000	32,400
	東証REIT指数先物	51,117,600	-	51,150,000	32,400
合計		51,117,600	-	51,150,000	32,400

（2021年 3月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	56,628,600	-	58,005,000	1,376,400
	東証REIT指数先物	56,628,600	-	58,005,000	1,376,400
合計		56,628,600	-	58,005,000	1,376,400

（注）1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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います。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います。

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）

(2020年 9月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,000,687,352円
同期中における追加設定元本額	2,988,946,947円
同期中における一部解約元本額	2,841,674,824円
2020年 9月15日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	484,065,576円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	548,906,892円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	359,898,064円
イオン・バランス戦略ファンド	60,993,325円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,348,450,459円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	7,707,216円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	29,043,982円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	19,509,405円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	60,976,141円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	32,111,060円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	25,064,827円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	12,672,700円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,300,787円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	328,136円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションII・ファンド＜適格機関投資家限定＞	47,345,955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＞	13,743,335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＞	39,497,389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＞	56,344,226円
合計	3,147,959,475円

(2021年 3月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,147,959,475円
同期中における追加設定元本額	1,103,634,804円
同期中における一部解約元本額	1,149,389,765円
2021年 3月15日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	333,211,034円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	363,275,354円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	247,684,375円
イオン・バランス戦略ファンド	106,705,286円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,550,470,789円

三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	9,946,233円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	35,461,155円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	24,665,180円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	77,456,806円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	40,177,323円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	31,680,259円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	15,160,652円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	1,424,781円
三井住友D S・国内リートインデックス年金ファンド	9,953,499円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	290,681円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションII・ファンド＜適格機関投資家限定＞	70,840,910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＞	26,382,969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＞	86,167,735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＞	71,249,493円
合計	3,102,204,514円

外国リート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

	(単位：円)	
	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	54,611,703	55,207,904
コール・ローン	10,287,058	20,274,174
投資証券	7,798,417,816	10,607,108,932
派生商品評価勘定	24,580	61,773
未収入金	82,118	131,839
未収配当金	16,211,329	15,730,171
流動資産合計	7,879,634,604	10,698,514,793
資産合計	7,879,634,604	10,698,514,793
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,203	446
未払金	131,634,098	-
未払解約金	7,000,000	-
未払利息	24	44
その他未払費用	153	-
流動負債合計	138,638,478	490
負債合計	138,638,478	490
純資産の部		
元本等		
元本	4,117,357,156	4,726,875,652
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	3,623,638,970	5,971,638,651
元本等合計	7,740,996,126	10,698,514,303
純資産合計	7,740,996,126	10,698,514,303
負債純資産合計	7,879,634,604	10,698,514,793

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15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。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	4,117,357,156口	4,726,875,652口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8801円 (10,000口当たりの純資産額 18,801円)	1口当たり純資産額 2.2633円 (10,000口当たりの純資産額 22,633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	(2021年 3月15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2.時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
-----------	---

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 9月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	135,500,000	-	135,520,377	20,377
	米ドル	98,000,000	-	98,017,020	17,020
	カナダドル	2,650,000	-	2,650,082	82
	ユーロ	6,250,000	-	6,251,431	1,431
	英ポンド	9,000,000	-	9,002,818	2,818
	オーストラリアドル	5,500,000	-	5,500,514	514
	香港ドル	6,100,000	-	6,095,797	△4,203
	シンガポールドル	8,000,000	-	8,002,715	2,715
合計		135,500,000	-	135,520,377	20,377

（2021年 3月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	22,500,000	-	22,561,327	61,327
	米ドル	18,500,000	-	18,558,009	58,009
	英ポンド	1,500,000	-	1,499,555	△445

オーストラリアドル	1,500,000	-	1,500,691	691
香港ドル	1,000,000	-	1,003,072	3,072
合計	22,500,000	-	22,561,327	61,327

（注） 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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います。

① 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います。

② 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います。

・ 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います。

・ 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います。

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。

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）

(2020年 9月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,518,654,861円
同期中における追加設定元本額	2,584,449,838円
同期中における一部解約元本額	985,747,543円
2020年 9月15日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	54,039,875円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	60,808,013円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	40,552,987円
イオン・バランス戦略ファンド	58,981,276円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	3,586,742,215円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	3,122,915円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	33,641,239円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	22,450,380円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	69,600,892円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	36,745,503円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	28,730,510円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	44,478,665円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	539,804円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	359,935円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションII・ファンド＜適格機関投資家限定＞	63,171,451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＞	13,391,496円
合計	4,117,357,156円

(2021年 3月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	4,117,357,156円
同期中における追加設定元本額	961,611,114円
同期中における一部解約元本額	352,092,618円
2021年 3月15日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	36,052,341円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	44,692,972円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	30,587,338円
イオン・バランス戦略ファンド	49,266,052円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	4,184,348,674円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	4,094,486円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	40,667,543円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	28,384,816円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	88,936,916円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	45,940,834円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	36,875,361円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	51,859,711円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	561,764円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	3,529,559円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	335,848円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションII・ファンド＜適格機関投資家限定＞	57,682,338円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	23,059,099円
合計	4,726,875,652円

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)		
	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	396,539,274	325,208,269
国債証券	104,311,002,360	103,186,560,610
地方債証券	8,894,942,430	8,540,167,600
特殊債券	12,902,314,589	11,820,042,854
社債券	5,659,432,000	4,039,361,000
未収入金	150,925,000	73,000,000
未収利息	460,030,466	430,570,336
前払費用	7,672,150	6,785,922
流動資産合計	132,782,858,269	128,421,696,591
資産合計	132,782,858,269	128,421,696,591

	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
負債の部		
流動負債		
未払金	100,000,000	-
未払解約金	46,282,000	3,402,560
未払利息	948	720
その他未払費用	8,273	-
流動負債合計	146,291,221	3,403,280
負債合計	146,291,221	3,403,280
純資産の部		
元本等		
元本	103,559,131,437	100,798,776,544
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	29,077,435,611	27,619,516,767
元本等合計	132,636,567,048	128,418,293,311
純資産合計	132,636,567,048	128,418,293,311
負債純資産合計	132,782,858,269	128,421,696,591

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	103,559,131,437口	100,798,776,544口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2808円 (10,000口当たりの純資産額 12,808円)	1口当たり純資産額 1.2740円 (10,000口当たりの純資産額 12,740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	(2021年 3月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（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）

(2020年 9月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	111,291,274,213円
同期中における追加設定元本額	29,214,010,057円
同期中における一部解約元本額	36,946,152,833円
2020年 9月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	5,417,910,131円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	9,352,829,017円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,998,420,713円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	730,795,894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）	46,082,897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）	181,230,371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）	374,855,441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）	438,441,370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）	177,137,533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）	308,707,190円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	129,925,576円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,337,900,462円

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	382,833,387円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	16,075,994円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	21,159,651円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	840,868,379円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	253,096,548円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	361,732,503円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	76,188,990円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	21,255,805円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	65,668,552円
三井住友D S・年金バランス30（債券重点型）	27,950,990円
三井住友D S・年金バランス50（標準型）	57,969,369円
三井住友D S・年金バランス70（株式重点型）	12,852,515円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,598,454円
SMAM・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	5,903,494,951円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	15,408,583,398円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	6,719,111,006円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	16,611,697,542円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	316,664,963円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	567,607,238円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	1,942,066円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	243,859,822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＞	117,573,504円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	1,922,462,329円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	2,101,626,336円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	2,539,043,379円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	9,356,692,074円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,655,317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）	1,358,855,987円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	465,048,141円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	619,590,284円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	179,522,478円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	43,699,763円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	1,688,140,285円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	2,266,783,215円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	868,223,966円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	211,492,420円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	19,262,253円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞	302,431,646円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	5,618,673,320円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2＜適格機関投資家専用＞	81,344,659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＞	297,899,914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＞	926,069,950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＞	1,237,370,919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II＜適格機関投資家限定＞	2,927,220,580円
合計	103,559,131,437円

(2021年 3月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	103,559,131,437円
同期中における追加設定元本額	11,328,054,760円
同期中における一部解約元本額	14,088,409,653円
2021年 3月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	5,990,618,321円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	10,549,919,996円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	2,353,909,812円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	687,456,782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）	42,772,799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）	197,666,614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）	422,644,322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）	522,074,860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）	226,899,211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）	372,828,535円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	135,352,921円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,279,165,895円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	403,599,304円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	13,590,257円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	31,110,301円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	1,171,315,328円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	368,593,809円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	531,349,125円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	107,257,212円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	30,446,089円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	88,179,056円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	64,701,629円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	102,424,796円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	27,755,659円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,405,133円
SMAM・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,632,672,145円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	14,495,753,213円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	6,716,543,657円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	16,774,405,252円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	328,083,780円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	592,584,810円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	1,828,677円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	269,243,070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＞	120,304,219円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	1,906,397,650円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	2,189,946,035円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	2,520,139,827円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	9,281,879,015円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,121,979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）	1,286,944,332円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	469,017,209円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	593,894,555円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	179,396,083円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	42,334,334円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	1,634,060,164円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	2,263,308,553円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	810,980,182円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	216,345,674円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	18,899,326円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞	303,368,485円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	5,582,241,420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＞	314,209,519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＞	880,349,521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＞	735,785,600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II＜適格機関投資家限定＞	2,910,700,492円
合計	100,798,776,544円

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

	(単位：円)	
	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	312,980,466	345,994,890
コール・ローン	436,715,832	322,897,525
国債証券	164,241,584,009	162,984,396,795
未収入金	1,000,000	-
未収利息	964,840,721	1,014,386,346
前払費用	31,156,429	19,735,661
流動資産合計	165,988,277,457	164,687,411,217
資産合計	165,988,277,457	164,687,411,217
負債の部		
流動負債		
未払解約金	19,890,000	63,644,010
未払利息	1,044	715
その他未払費用	12,488	-
流動負債合計	19,903,532	63,644,725
負債合計	19,903,532	63,644,725
純資産の部		
元本等		
元本	86,672,161,351	85,007,843,876
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	79,296,212,574	79,615,922,616
元本等合計	165,968,373,925	164,623,766,492
純資産合計	165,968,373,925	164,623,766,492
負債純資産合計	165,988,277,457	164,687,411,217

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	86,672,161,351口	85,007,843,876口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9149円 (10,000口当たりの純資産額 19,149円)	1口当たり純資産額 1.9366円 (10,000口当たりの純資産額 19,366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	(2021年 3月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

２．時価の算定方法	(1) 有価証券（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。
-----------	---

（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）

(2020年 9月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	85,315,961,664円
同期中における追加設定元本額	21,890,938,105円
同期中における一部解約元本額	20,534,738,418円
2020年 9月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	22,731,151,256円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	658,594,713円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,773,832,616円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	886,639,369円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	135,734,686円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	7,442,392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）	28,932,686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）	89,355,084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）	147,123,191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）	87,219,265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）	169,760,535円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	23,583,939円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	151,930,417円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	177,017,525円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	117,322,530円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	8,504,435円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	49,486,241円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	29,259,182円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	68,781,313円

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	21,896,060円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	14,152,323円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	58,321,950円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	59,325,052円
三井住友D S・年金バランス３０（債券重点型）	3,401,354円
三井住友D S・年金バランス５０（標準型）	11,013,159円
三井住友D S・年金バランス７０（株式重点型）	5,718,420円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド２０６０	1,437,654円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	2,325,407,859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＞	62,516,303円
SMAM・バランスファンドVA２５＜適格機関投資家専用＞	8,969,125,020円
SMAM・バランスファンドVA３７．５＜適格機関投資家専用＞	4,882,034,678円
SMAM・バランスファンドVA５０＜適格機関投資家専用＞	11,081,288,238円
SMAM・バランスファンドVL３０＜適格機関投資家限定＞	34,927,566円
SMAM・バランスファンドVL５０＜適格機関投資家限定＞	92,654,350円
世界６資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	364,139円
SMAM・バランスファンドVA７５＜適格機関投資家専用＞	667,821,535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＞	117,038,834円
SMAM・インデックス・バランスVA２５＜適格機関投資家専用＞	1,130,698,774円
SMAM・インデックス・バランスVA５０＜適格機関投資家専用＞	1,406,378,119円
SMAM・バランスファンドVA４０＜適格機関投資家専用＞	1,693,637,685円
SMAM・バランスファンドVA３５＜適格機関投資家専用＞	5,375,225,533円
SMAM・バランスVA株４０T＜適格機関投資家限定＞	1,096,475円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA＜適格機関投資家限定＞	8,991,550,157円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	372,710,683円
SMAM・グローバルバランス４０VA＜適格機関投資家限定＞	155,672,719円
SMAM・アセットバランスファンドVA２０A＜適格機関投資家専用＞	94,741,730円
SMAM・アセットバランスファンドVA３５A＜適格機関投資家専用＞	35,684,638円
SMAM・アセットバランスファンドVA５０A＜適格機関投資家専用＞	12,403,524円
SMAM・アセットバランスファンドVA２０L＜適格機関投資家専用＞	114,449,543円
SMAM・アセットバランスファンドVA２５L＜適格機関投資家専用＞	457,949,726円
SMAM・アセットバランスファンドVA２０A２＜適格機関投資家専用＞	131,485,417円
SMAM・アセットバランスファンドVA３５A２＜適格機関投資家専用＞	41,665,026円
SMAM・アセットバランスファンドVA５０A２＜適格機関投資家専用＞	5,430,860円
SMAM・アセットバランスファンドVA２５L２＜適格機関投資家専用＞	1,136,440,664円
SMAM・アセットバランスファンドVA２０T２＜適格機関投資家専用＞	5,422,002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＞	1,418,321,803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＞	1,193,432,057円
SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	5,014,430,246円
SMAM・世界バランスファンドVA２＜適格機関投資家限定＞	523,340,928円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションII・ファンド＜適格機関投資家限定＞	62,703,933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＞	53,516,287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＞	188,026,035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＞	251,064,556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II＜適格機関投資家限定＞	1,054,566,362円

合計	86,672,161,351円
----	-----------------

(2021年 3月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	86,672,161,351円
同期中における追加設定元本額	4,692,480,402円
同期中における一部解約元本額	6,356,797,877円
2021年 3月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	23,452,404,311円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	718,492,589円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,991,870,298円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,038,343,858円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	145,037,097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）	6,940,706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）	31,512,688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）	100,687,379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）	173,881,104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）	111,296,782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）	206,181,810円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	23,801,625円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	87,727,566円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	127,038,109円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	43,978,309円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	12,317,888円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	67,946,341円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	42,286,595円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	99,270,894円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	30,387,515円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	20,344,328円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	77,628,774円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	122,499,596円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	7,758,684円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	19,159,488円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	12,186,094円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,745,173円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	2,047,018,379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＞	53,057,364円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	8,405,518,182円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	4,860,208,256円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	11,174,840,543円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	36,133,414円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	97,680,998円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	344,673円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	721,511,604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＞	120,185,798円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	1,114,161,967円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,455,394,432円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	1,679,976,562円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	5,281,194,473円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	745,024円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA＜適格機関投資家限定＞	8,800,497,408円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	350,947,515円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	155,737,406円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	90,561,097円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	35,408,120円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	11,874,819円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	110,155,429円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	457,296,658円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	123,308,597円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	42,530,817円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	5,327,259円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	1,117,480,487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＞	857,568,863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＞	1,105,135,179円
SMAM・世界バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	3,769,620,279円
SMAM・世界バランスファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	478,769,792円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションII・ファンド＜適格機関投資家限定＞	65,329,936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＞	54,855,114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＞	190,060,550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＞	158,842,215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II＜適格機関投資家限定＞	1,205,839,066円
合計	85,007,843,876円

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	29,056,345	54,431,397
コール・ローン	200,018,460	139,925,098
国債証券	22,541,721,762	17,138,861,025
派生商品評価勘定	171,709,501	298,584
未収入金	995,732	7,181
未収利息	139,068,650	95,129,394
前払費用	9,796,914	11,340,819
流動資産合計	23,092,367,364	17,439,993,498
資産合計	23,092,367,364	17,439,993,498
負債の部		
流動負債		

	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
派生商品評価勘定	6,700,653	302,534,100
未払金	512,912	442,230
未払解約金	11,000,000	-
未払利息	478	310
その他未払費用	4,579	-
流動負債合計	18,218,622	302,976,640
負債合計	18,218,622	302,976,640
純資産の部		
元本等		
元本	14,963,097,482	11,481,503,941
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	8,111,051,260	5,655,512,917
元本等合計	23,074,148,742	17,137,016,858
純資産合計	23,074,148,742	17,137,016,858
負債純資産合計	23,092,367,364	17,439,993,498

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 2020年 9月16日 至 2021年 3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	(2020年 9月15日現在)	(2021年 3月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	14,963,097,482口	11,481,503,941口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.5421円 15,421円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.4926円 14,926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	(2021年 3月15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（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。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 9月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	22,692,931,748	-	22,527,922,900	165,008,848
	米ドル	9,866,560,212	-	9,867,218,400	△658,188
	カナダドル	439,984,922	-	434,521,400	5,463,522
	メキシコペソ	172,350,035	-	178,392,500	△6,042,465
	ユーロ	9,431,597,533	-	9,348,495,000	83,102,533
	英ポンド	1,506,705,928	-	1,444,167,200	62,538,728
	スウェーデンクローナ	73,333,936	-	71,999,200	1,334,736
	ノルウェークローネ	51,047,808	-	49,056,000	1,991,808
	デンマーククローネ	123,330,982	-	122,307,500	1,023,482
	ポーランドズロチ	154,996,078	-	151,447,000	3,549,078
	オーストラリアドル	562,178,910	-	552,839,100	9,339,810

	シンガポールドル	218,720,003	-	217,718,800	1,001,203
	イスラエルシェケル	92,125,401	-	89,760,800	2,364,601
合計		22,692,931,748	-	22,527,922,900	165,008,848

(2021年 3月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	17,012,695,884	-	17,314,931,400	△302,235,516
	米ドル	7,381,115,125	-	7,549,635,000	△168,519,875
	カナダドル	334,812,870	-	348,765,900	△13,953,030
	メキシコペソ	137,964,513	-	141,427,600	△3,463,087
	ユーロ	7,098,649,042	-	7,177,621,600	△78,972,558
	英ポンド	1,129,024,622	-	1,149,807,300	△20,782,678
	スウェーデンクローナ	58,880,718	-	59,799,000	△918,282
	ノルウェークローネ	42,174,777	-	44,125,400	△1,950,623
	デンマーククローネ	87,523,570	-	88,526,500	△1,002,930
	ポーランドズロチ	112,960,584	-	112,662,000	298,584
	オーストラリアドル	395,074,170	-	404,674,800	△9,600,630
	シンガポールドル	159,399,000	-	161,369,100	△1,970,100
	イスラエルシェケル	75,116,893	-	76,517,200	△1,400,307
合計		17,012,695,884	-	17,314,931,400	△302,235,516

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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います。

① 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います。

② 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います。

- ・ 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います。

- ・ 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います。

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。

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)

(2020年 9月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	17,958,175,971円
同期中における追加設定元本額	9,168,095,951円
同期中における一部解約元本額	12,163,174,440円
2020年 9月15日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,231,912,433円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	643,981,489円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	14,020,472円
イオン・バランス戦略ファンド	486,483,527円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	761,269,360円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	256,265,012円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	408,248,126円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	90,493,794円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	17,691,308円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	17,659,776円
SMAM・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	5,047,561,449円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,370,846円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンドⅡ＜適格機関投資家限定＞	4,072,854,395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＞	114,308,290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＞	342,582,870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＞	456,394,335円
合計	14,963,097,482円

(2021年 3月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	14,963,097,482円
同期中における追加設定元本額	4,551,623,800円
同期中における一部解約元本額	8,033,217,341円
2021年 3月15日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,020,403,722円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	573,639,730円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	11,763,790円
イオン・バランス戦略ファンド	521,158,144円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	1,084,959,845円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	381,984,705円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	614,237,886円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	131,040,778円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	25,678,986円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	24,903,030円

(2021年 3月15日現在)	
SMAM・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,368,070,153円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	948,952円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンドII＜適格機関投資家限定＞	4,057,895,794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＞	106,572,517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＞	303,808,337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＞	254,437,572円
合計	11,481,503,941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

	2021年3月31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。

2021年3月31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	729	8,753,606
単位型株式投資信託	113	612,116
追加型公社債投資信託	1	32,161
単位型公社債投資信託	192	457,316
合 計	1,035	9,855,200

（３）【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

（イ）定款の変更

該当ありません。

（ロ）その他の重要事項

該当ありません。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

5【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、当中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2 当社は、第35期（2019年4月1日から2020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36期中間会計期間（2020年4月1日から2020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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,755,961	33,264,545
顧客分別金信託	20,011	300,021
前払費用	476,456	515,226
未収入金	64,856	602,605
未収委託者報酬	6,963,077	8,404,880
未収運用受託報酬	1,129,548	2,199,785
未収投資助言報酬	285,668	299,826
未収収益	44,150	37,702
その他の流動資産	31,771	40,119
流動資産合計	22,771,504	45,664,712
固定資産		
有形固定資産 ※1		
建物	173,517	101,609
器具備品	751,471	783,224
土地	-	710
リース資産	-	968
建設仮勘定	-	66,498
有形固定資産合計	924,988	953,010
無形固定資産		
ソフトウェア	479,867	909,133
ソフトウェア仮勘定	183,528	508,733
のれん	-	34,397,824
顧客関連資産	-	17,785,166
電話加入権	44	12,739
商標権	60	54
無形固定資産合計	663,501	53,613,651
投資その他の資産		
投資有価証券	10,829,628	19,436,480
関係会社株式	10,252,067	11,246,398
長期差入保証金	2,004,451	2,523,637

長期前払費用	97,107	113,852
会員権	7,819	90,479
繰延税金資産	1,426,381	-
貸倒引当金	-	△ 20,750
投資その他の資産合計	24,617,457	33,390,098
固定資産合計	26,205,946	87,956,760
資産合計	48,977,450	133,621,473

(単位：千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	4,534	14,285
その他の預り金	1,480,229	146,200
未払金		
未払収益分配金	1,122	1,629
未払償還金	137,522	131,338
未払手数料	3,246,133	3,776,873
その他未払金	768,373	502,211
リース債務	-	1,064
未払費用	3,535,589	3,935,582
未払消費税等	84,966	305,513
未払法人税等	670,761	489,151
賞与引当金	1,302,052	1,716,321
その他の流動負債	18,110	30,951
流動負債合計	11,249,395	11,051,125
固定負債		
退職給付引当金	3,418,601	5,299,814
賞与引当金	5,074	14,767
繰延税金負債	-	2,963,538
その他の固定負債	5,074	172,918
固定負債合計	3,428,751	8,451,038
負債合計	14,678,146	19,502,164
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	-	81,927,000
資本剰余金合計	8,628,984	90,555,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	21,255,054	19,364,265
利益剰余金合計	23,076,258	21,185,470
株主資本計	33,705,242	113,741,454
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	594,061	377,855
評価・換算差額等合計	594,061	377,855
純資産合計	34,299,304	114,119,309
負債・純資産合計	48,977,450	133,621,473

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)		
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	39,156,499	54,615,133
運用受託報酬	6,277,217	9,389,058
投資助言報酬	1,332,888	1,303,595
その他営業収益		
サービス支援手数料	182,502	181,061
その他	49,507	32,421
営業収益計	46,998,614	65,521,269
営業費用		
支払手数料	18,499,433	24,888,040
広告宣伝費	361,696	447,024
公告費	125	-
調査費		
調査費	1,752,905	3,214,679
委託調査費	6,050,441	7,702,309
営業雑経費		
通信費	46,551	70,007
印刷費	338,465	612,249
協会費	24,700	45,117
諸会費	23,756	32,199
情報機器関連費	2,872,416	4,349,174
販売促進費	49,118	68,688
その他	148,307	154,201
営業費用合計	30,167,918	41,583,691
一般管理費		
給料		
役員報酬	190,951	264,325
給料・手当	6,308,066	9,789,691
賞与	514,259	914,702
賞与引当金繰入額	1,235,936	1,726,013
交際費	27,802	30,898
寄付金	82	2,022
事務委託費	286,905	956,931
旅費交通費	228,538	249,359
租税公課	285,369	389,032
不動産賃借料	612,410	1,121,553
退職給付費用	463,553	797,158
固定資産減価償却費	378,530	3,044,658
のれん償却費	-	2,645,986
諸経費	290,243	482,324
一般管理費合計	10,822,651	22,414,658
営業利益	6,008,044	1,522,919

(単位：千円)		
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

営業外収益		
受取配当金	-	778,113
受取利息	623	947
時効成立分配金・償還金	72	1,041
原稿・講演料	1,951	2,061
投資有価証券償還益	289,451	6,398
投資有価証券売却益	7,247	24,206
雑収入	36,408	53,484
営業外収益合計	335,754	866,254
営業外費用		
為替差損	15,760	72,457
投資有価証券償還損	13,668	129,006
投資有価証券売却損	14,605	12,906
雑損失	7,027	8,334
営業外費用合計	51,061	222,704
経常利益	6,292,738	2,166,469
特別利益		
過去勤務費用償却益	79,850	-
特別利益合計	79,850	
特別損失		
固定資産除却損	※ 1	1,462
関係会社株式評価損		160,455
合併関連費用	※ 2	187,140
本社移転費用	※ 3	-
減損損失	※ 4	-
特別損失合計		349,058
税引前当期純利益		6,023,530
法人税、住民税及び事業税		1,750,031
法人税等調整額		90,084
法人税等合計		1,840,116
当期純利益		4,183,413

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078
当期変動額							
剰余金の配当							△ 9,489,438
当期純利益							4,183,413
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）							

当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	△ 5,306,024
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054

	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	28,382,283	39,011,267	870,535	870,535	39,881,802
当期変動額					
剰余金の配当	△ 9,489,438	△ 9,489,438			△ 9,489,438
当期純利益	4,183,413	4,183,413			4,183,413
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			△ 276,474	△ 276,474	△ 276,474
当期変動額合計	△ 5,306,024	△ 5,306,024	△ 276,474	△ 276,474	△ 5,582,498
当期末残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
						配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	—	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054
当期変動額								
剰余金の配当								△ 2,469,600
当期純利益								578,811
合併による増加			81,927,000	81,927,000				
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）								
当期変動額合計	—	—	81,927,000	81,927,000	—	—	—	△ 1,890,788
当期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265

	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	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304
当期変動額					
剰余金の配当	△ 2,469,600	△ 2,469,600			△ 2,469,600
当期純利益	578,811	578,811			578,811
合併による増加		81,927,000			81,927,000
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			△ 216,206	△ 216,206	△ 216,206
当期変動額合計	△ 1,890,788	80,036,211	△ 216,206	△ 216,206	79,820,005
当期末残高	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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）

時価のないもの

移動平均法による原価法

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、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	2～50年
器具備品	3～15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（社内における利用可能期間）

(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計上しております。

① 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。

② 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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(表示方法の変更)

前事業年度において「特別利益」に含めていた「投資有価証券売却益」及び「投資有価証券償還益」を「営業外収益」として、「特別損失」に含めていた「投資有価証券売却損」及び「投資有価証券償還損」を「営業外費用」として、表示する方法に変更しております。これは、合併を契機に検討した結果、投資有価証券の売却及び償還の大勢が自社設定投信等の処分によるものであり毎期経常的に発生するものとして、当事業年度から取引実態に沿った表示へと変更したものです。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「特別利益」の「投資有価証券売却益」及び「投資有価証券償還益」に

表示していた7,247千円及び289,451千円は「営業外収益」として、「特別損失」の「投資有価証券売却損」及び「投資有価証券償還損」に表示していた14,605千円及び13,668千円は「営業外費用」として組み替えております。

（貸借対照表関係）

※ 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
建物	350,176千円	466,875千円
器具備品	922,553千円	1,225,261千円
リース資産	－千円	1,452千円

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。

当事業年度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。

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	－千円	－千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

3 保証債務

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

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA)Inc.	174,854千円	132,559千円

（損益計算書関係）

※ 1 固定資産除却損

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
建物	－千円	879千円
器具備品	695千円	119千円
リース資産	－千円	5,377千円
ソフトウェア	766千円	1,596千円
ソフトウェア仮勘定	－千円	102,695千円

※ 2 合併関連費用

前事業年度の合併関連費用は、主に目論見書等の一斉改版費用及び当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する業務委託費用であります。

当事業年度の合併関連費用は、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する業務委託費用等及び海外現地法人の統合に関する弁護士費用であります。

※ 3 本社移転費用

本社移転費用は、本社事務所移転に伴い解約日までに賃貸期間の残存分（2020年7月13日から2020年9月30日まで）の賃料及び共益費相当額として133,168千円支払うものであります。

※ 4 減損損失

当社は以下のとおり減損損失を計上しております。

（単位：千円）

場所	用途	種類	減損損失
千代田区	事業用資産	建物	46,417

当社は、資産と対応して継続的に収支の把握ができる単位が全社のみであることから全社資産の単一グループとしております。

上記事業用資産については、霞ヶ関オフィスの移転に係る意思決定をしたことに伴い将来の使用が見込めなくなった資産につき、回収可能額を零と見積もり、当該減少額を減損損失に計上しております。その内訳は、建物に計上した資産除去債務に対応する原状回復費用相当額であります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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	17,640株	17,622,360株	—	17,640,000株

2.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

当社は2018年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。

当該株式分割は2018年11月1日を効力発生日としておりますので、2019年1月31日を基準日とする一株当たり配当額につきましては、株式分割後の株式数を基準に記載しております。

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
2018年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000.00	2018年 3月31日	2018年 6月27日
2019年2月28日 臨時株主総会	普通株式	6,667,038	377.95	2019年 1月31日	2019年 3月22日

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

2019年6月24日開催の臨時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	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
2019年6月24日 臨時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,469,600	140.00	2019年 3月28日	2019年 6月25日

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

合併に伴う普通株式の発行により16,230,060株増加しております。

	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	17,640,000株	16,230,060株	—	33,870,060株

2.剰余金の配当に関する事項

(1)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
2019年6月24日 臨時株主総会	普通株式	2,469,600	140.00	2019年 3月28日	2019年 6月25日

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

2020年6月29日開催の第35回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	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
2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	711,271	21.00	2020年 3月31日	2020年 6月30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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
1年以内	597,239	1,618,641
1年超	6,115,662	5,844,934
合計	6,712,901	7,463,576

(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います。そのため、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、資金調達及びデリバティブ取引は行っていません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先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

①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。

投資有価証券、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。

長期差入保証金についても、差入先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。

②市場リスクの管理

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。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等に基づく価額のほか、これらの価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件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があります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません（（注２）参照）。

前事業年度（2019年３月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	13,755,961	13,755,961	—
(2)顧客分別金信託	20,011	20,011	—
(3)未収委託者報酬	6,963,077	6,963,077	—
(4)未収運用受託報酬	1,129,548	1,129,548	—
(5)未収投資助言報酬	285,668	285,668	—
(6)投資有価証券			
①その他有価証券	10,829,330	10,829,330	—
(7)長期差入保証金	2,004,451	2,004,451	—
資産計	34,988,051	34,988,051	—
(1)顧客からの預り金	4,534	4,534	—
(2)未払手数料	3,246,133	3,246,133	—
負債計	3,250,667	3,250,667	—

当事業年度（2020年３月31日）

（単位：千円）

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

(1)現金及び預金	33,264,545	33,264,545	—
(2)顧客分別金信託	300,021	300,021	—
(3)未収委託者報酬	8,404,880	8,404,880	—
(4)未収運用受託報酬	2,199,785	2,199,785	—
(5)未収投資助言報酬	299,826	299,826	—
(6)投資有価証券			
①その他有価証券	19,391,111	19,391,111	—
(7)長期差入保証金	2,523,637	2,523,637	—
資産計	66,383,807	66,383,807	—
(1)顧客からの預り金	14,285	14,285	—
(2)未払手数料	3,776,873	3,776,873	—
負債計	3,791,158	3,791,158	—

(注１)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(2)顧客分別金信託、(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬及び(5)未収投資助言報酬

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、当該帳簿価額によっています。

(6)投資有価証券

これらの時価について、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

(7)長期差入保証金

これらの時価については、敷金の性質及び賃貸借契約の期間から帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

負 債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

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、当該帳簿価額によっています。

(注２)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位：千円)

区分	前事業年度 (2019年３月31日)	当事業年度 (2020年３月31日)
その他有価証券 非上場株式	298	45,369
合計	298	45,369
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,252,067	11,246,398
合計	10,252,067	11,246,398

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(6)①その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式及び関連会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。

(注３)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2019年３月31日）

(単位：千円)

区分	１年以内	１年超５年以内	５年超１０年以内	１０年超
現金及び預金	13,755,961	—	—	—
顧客分別金信託	20,011	—	—	—
未収委託者報酬	6,963,077	—	—	—
未収運用受託報酬	1,129,548	—	—	—
未収投資助言報酬	285,668	—	—	—
長期差入保証金	54,900	1,949,551	—	—
合計	22,209,168	1,949,551	—	—

当事業年度（2020年３月31日）

(単位：千円)

区分	１年以内	１年超５年以内	５年超１０年以内	１０年超
----	------	---------	----------	------

現金及び預金	33,264,545	—	—	—
顧客分別金信託	300,021	—	—	—
未収委託者報酬	8,404,880	—	—	—
未収運用受託報酬	2,199,785	—	—	—
未収投資助言報酬	299,826	—	—	—
長期差入保証金	1,125,292	1,398,345	—	—
合計	45,594,350	1,398,345	—	—

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2019年3月31日）

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式10,252,067千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（2020年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度（2019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	7,545,410	6,613,088	932,322
小計	7,545,410	6,613,088	932,322
(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	3,283,920	3,360,000	△76,080
小計	3,283,920	3,360,000	△76,080
合計	10,829,330	9,973,088	856,242

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 298千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（2020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	12,411,812	13,327,652	915,839
小計	12,411,812	13,327,652	915,839
(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	6,413,317	6,063,458	△349,858
小計	6,413,317	6,063,458	△349,858
合計	18,825,130	19,391,111	565,980

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 45,369千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、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 2018年4月1日 至 2019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
728,127	7,247	14,605

(単位：千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
1,578,762	289,451	13,668

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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
1,814,360	24,206	12,906

(単位：千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
3,631,425	6,398	129,006

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について160,455千円（関係会社株式160,455千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては子会社株式及び関連会社株式については、当該株式の発行会社の財務状況等を勘案した上で、回復可能性を検討し、回復可能性のないものについて減損処理を行っております。

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,319,830	3,418,601
勤務費用	267,362	523,396
利息費用	—	—
数理計算上の差異の発生額	△3,658	△195
退職給付の支払額	△85,082	△349,050
過去勤務費用の発生額	△79,850	—
合併による発生額	—	1,707,062
退職給付債務の期末残高	3,418,601	5,299,814

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,418,601	5,299,814
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	3,418,601	5,299,814

(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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	267,362	492,511
利息費用	—	—
数理計算上の差異の費用処理額	△3,658	△195
過去勤務費用償却益	△79,850	—
その他	199,849	304,842
確定給付制度に係る退職給付費用	383,703	797,158

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
割引率	0.000%	0.000%

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156,457千円、当事業年度248,932千円であります。

(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

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,046,775	1,622,803
賞与引当金	400,242	530,059
調査費	80,983	178,573
未払金	57,192	162,557
未払事業税	54,797	46,423
ソフトウェア償却	17,501	91,937
子会社株式評価損	50,580	114,876
その他有価証券評価差額金	—	150,771
その他	32,218	88,250
繰延税金資産小計	1,740,292	2,986,254
評価性引当額（注）	△51,729	△193,485
繰延税金資産合計	1,688,563	2,792,768

繰延税金負債		
無形固定資産	—	5,445,817
その他有価証券評価差額金	262,181	310,488
繰延税金負債合計	262,181	5,756,306
繰延税金資産（負債）の純額	1,426,381	△2,963,538

（注）評価性引当額が141,756千円増加しております。この増加の内容は、主として大和住銀投信投資顧問株式会社との合併によるものであります。

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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%
（調整）		
評価性引当額の増減	0.8	3.5
受取配当等永久に益金に算入されない項目	—	△13.9
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.9	7.3
住民税均等割等	0.1	0.5
所得税額控除による税額控除	△1.4	△0.5
のれん償却費	—	44.1
その他	△0.4	△3.3
税効果会計適用後の法人税等の負担率	30.5	68.4

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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	39,156,499	6,277,217	1,332,888	232,009	46,998,614

(2) 地域ごとの情報

① 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。

② 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

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

該当事項はありません。

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 2019年4月1日 至2020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	54,615,133	9,389,058	1,303,595	213,482	65,521,269

(2) 地域ごとの情報

① 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。

② 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 2018年4月1日 至 2019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	2,499,836	未払 手数料	399,447
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	5,789,062	未払 手数料	1,154,875

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 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 2019年4月1日 至 2020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	3,703,669	未払 手数料	644,246
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	6,265,593	未払 手数料	890,935

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	1,944.40円	3,369.33円
1株当たり当期純利益金額	237.15円	17.09円

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

2. 当社は、2018年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。

1株当たり情報については、当該株式分割を2019年3月期の期首（2018年4月1日）に行ったものと仮定して、1株当たり純資産額及び1株当たり当期純利益を算定しております。

3. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
--	--	--

1株当たり当期純利益金額		
当期純利益（千円）	4,183,413	578,811
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金額（千円）	4,183,413	578,811
期中平均株式数（株）	17,640,000	33,870,060

(企業結合等関係)

(取得による企業結合)

当社は、2018年9月28日開催の当社取締役会において、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間で合併契約を締結することについて決議し、同日付で締結しました。本合併契約に基づき、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、2019年4月1日付で合併いたしました。

1. 企業結合の概要

(1)被取得企業の名称及び事業の内容

被取得企業の名称 大和住銀投信投資顧問株式会社
事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業等

(2)企業結合を行った主な理由

資産運用ビジネスはグローバルに成長拡大しており、お客さまから求められる運用力やサービスはますます高度化しております。本件合併は、このようなお客さまからのニーズに対応するために、両運用会社の持つ強み・ノウハウを結集した、フィデューシャリー・デューティーに基づく最高品質の運用パフォーマンスとサービスを提供する資産運用会社の実現を図るものであります。

(3)企業結合日

2019年4月1日

(4)企業結合の法的形式

当社を存続会社とし、大和住銀投信投資顧問株式会社を消滅会社とする吸収合併方式であります。

(5)結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

(6)取得企業を決定するに至った主な根拠

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 2019年1月16日）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 2019年1月16日）の考え方に基づき、当社を取得企業としております。

2. 財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2020年3月31日

3. 被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳

取得の対価	企業結合日に交付した当社の普通株式の時価	81,927,000千円
取得原価		81,927,000千円

4. 合併比率及びその算定方法並びに交付した株式数

(1)合併比率

大和住銀投信投資顧問株式会社の普通株式1株に対し、当社の普通株式4.2156株を割当交付いたしました。

(2)合併比率の算定方法

当社はEYトランザクション・アドバイザー・サービス株式会社を、大和住銀投信投資顧問株式会社はPwCアドバイザー合同会社を、合併比率の算定に関する第三者算定機関としてそれぞれ選定し、各第三者算定機関による算定結果を参考に、両社の財務状況、資産の状況、将来の見通し等の要因を総合的に勘案し、合併比率について慎重に協議を重ねた結果、合併比率が妥当であると判断し、合意に至ったものであります。

(3)交付した株式数

普通株式：16,230,060株

5. 主要な取得関連費用の内容及び金額

業務委託費用及びデューデリジェンス費用等 37,723千円

6. 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

(1)発生したのれん金額

37,043,811千円

(2)発生原因

被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

(3)償却方法及び償却期間

14年にわたる均等償却

7. 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

流動資産	24,546,329千円
固定資産	34,001,531千円
資産合計	58,547,860千円
流動負債	5,406,939千円
固定負債	8,257,731千円
負債合計	13,664,671千円

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第36期中間会計期間 (2020年9月30日)		
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		30,600,006
顧客分別金信託		300,033
前払費用		491,960
未収委託者報酬		8,462,795
未収運用受託報酬		2,637,333
未収投資助言報酬		403,508
未収収益		39,908
その他		127,104
流動資産合計		43,062,650
固定資産		
有形固定資産	※ 1	2,622,154
無形固定資産		
のれん		33,074,831
顧客関連資産		16,728,528
その他		1,741,538
無形固定資産合計		51,544,898
投資その他の資産		
投資有価証券		21,128,629
関係会社株式		11,246,398
その他		2,228,340
貸倒引当金		△ 20,750
投資その他の資産合計		34,582,618
固定資産合計		88,749,672
資産合計		131,812,323
負債の部		
流動負債		
リース債務		266
顧客からの預り金		2,366
その他の預り金		118,688

未払金		3,919,626
未払費用		4,532,572
未払法人税等		330,248
前受収益		28,358
賞与引当金		1,343,147
その他	※ 2	25,119
流動負債合計		10,300,393
固定負債		
繰延税金負債		3,126,317
退職給付引当金		5,442,936
賞与引当金		7,383
その他		150,104
固定負債合計		8,726,742
負債合計		19,027,135
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		81,927,000
資本剰余金合計		90,555,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		60,000
別途積立金		1,476,959
繰越利益剰余金		17,495,141
利益剰余金合計		19,316,346
株主資本合計		111,872,330
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		912,856
評価・換算差額等合計		912,856
純資産合計		112,785,187
負債純資産合計		131,812,323

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		23,512,538
運用受託報酬		4,131,413
投資助言報酬		637,750
その他の営業収益		115,543
営業収益計		28,397,245
営業費用		18,361,605
一般管理費	※ 1	11,009,285
営業損失 (△)		△ 973,645
営業外収益	※ 2	130,819
営業外費用	※ 3	22,619

経常損失（△）		△ 865,445
特別損失	※ 4	179,016
税引前中間純損失（△）		△ 1,044,462
法人税、住民税及び事業税		223,963
法人税等調整額		△ 110,573
法人税等合計		113,390
中間純損失（△）		△ 1,157,852

(3)中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		
						配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265
当中間期変動額								
剰余金の配当								△ 711,271
中間純損失（△）								△ 1,157,852
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	—	—	—	—	—	—	—	△ 1,869,124
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	17,495,141

	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	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309
当中間期変動額					
剰余金の配当	△ 711,271	△ 711,271			△ 711,271
中間純損失（△）	△ 1,157,852	△ 1,157,852			△ 1,157,852
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）			535,001	535,001	535,001
当中間期変動額合計	△ 1,869,124	△ 1,869,124	535,001	535,001	△ 1,334,122
当中間期末残高	19,316,346	111,872,330	912,856	912,856	112,785,187

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

①子会社株式

移動平均法による原価法

②その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等
移動平均法による原価法

2. 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、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	2～50年
器具備品	3～15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（社内における利用可能期間）

(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。

①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。

②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. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

（追加情報）

当社は「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準第31号 2019年7月4日）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44－2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。

（中間貸借対照表関係）

第36期中間会計期間 (2020年9月30日)	
※1.有形固定資産の減価償却累計額	991,194千円
※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
※ 4. 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109,041千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020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	1,322,993千円
減価償却実施額	
有形固定資産	288,293千円
無形固定資産	1,209,507千円
※ 2. 営業外収益のうち主要なもの	
為替差益	4,544千円
受取配当金	5,845千円
投資有価証券償還益	9,936千円
投資有価証券売却益	59,364千円
※ 3. 営業外費用のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	1千円
投資有価証券売却損	21,377千円
※ 4. 特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	51,972千円
本社移転費用	127,044千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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
2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	711,271	21.00	2020年 3月31日	2020年 6月30日

(リース取引関係)

第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020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	1,192,635千円
1年超	4,091,860千円
合 計	5,284,495千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第36期中間会計期間（2020年9月30日）

2020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、次の通りです。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2）参照）。

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	30,600,006	30,600,006	—
(2)顧客分別金信託	300,033	300,033	—
(3)未収委託者報酬	8,462,795	8,462,795	—
(4)未収運用受託報酬	2,637,333	2,637,333	—
(5)未収投資助言報酬	403,508	403,508	—
(6)投資有価証券			
①その他有価証券	21,083,260	21,083,260	—
(7)投資その他の資産			
①長期差入保証金	2,006,627	2,006,627	—
資産計	65,493,564	65,493,564	—
(1)顧客からの預り金	2,366	2,366	—
(2)未払金			
①未払手数料	3,761,585	3,761,585	—
負債計	3,763,951	3,763,951	—

（注１）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金、(2) 顧客分別金信託、(3) 未収委託者報酬、(4) 未収運用受託報酬、及び(5) 未収投資助言報酬

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、当該帳簿価額によっております。

(6) 投資有価証券

①その他有価証券

これらの時価について、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(7) 投資その他の資産

①長期差入保証金

これらの時価については、敷金の性質及び賃貸借契約の期間から帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

負 債

(1) 顧客からの預り金、及び(2) 未払金①未払手数料

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、当該帳簿価額によっております。

（注２）市場価格のない金融商品

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	45,369
合計	45,369
子会社株式 非上場株式	11,246,398
合計	11,246,398

その他有価証券については、市場価格がないため、「(6)①その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式については、市場価格がないため、時価開示の対象とはしておりません。

また時価をもって中間貸借対照表計上額としている「(6)①その他有価証券」は、全て投資信託で構成されております。そのため、時価の算定に関する会計基準の適用指針第26項の経過措置を適用し、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項は記載しておりません。

（有価証券関係）

第36期中間会計期間（2020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 11,246,398千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

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	16,043,944	14,414,570	1,629,373
小計	16,043,944	14,414,570	1,629,373
(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	5,039,315	5,294,354	△255,038
小計	5,039,315	5,294,354	△255,038
合計	21,083,260	19,708,925	1,374,335

(注) 非上場株式等（中間貸借対照表計上額 45,369千円）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。

(セグメント情報等)

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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	23,512,538	4,131,413	637,750	115,543	28,397,245

(2)地域ごとの情報

①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。

②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36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
--

1株当たり純資産額	3,329円93銭
1株当たり中間純損失（△）	△34円18銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純損失については、潜在株式が存在しないため記載していません。

（参考）大和住銀投信投資顧問株式会社の経理状況

※当該（参考）において、大和住銀投信投資顧問株式会社を「委託会社」または「当社」といいます。

1. 委託会社の財務諸表は、「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。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号。）により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第47期事業年度（平成30年4月1日から平成31年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

令和1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

指定有限責任社員 公認会計士 飯田 浩 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 榮 裕 印
業務執行社員

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（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第47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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成31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すべ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。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社と三井住友アセットマネジメント株式会社は、平成31年4月1日付で合併した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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〕 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

〔注2〕 XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

(1) 貸借対照表

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
資産の部		

流動資産		
現金・預金	21,360,895	20,475,527
前払費用	204,460	230,059
未収入金	12,823	4,542
未収委託者報酬	3,363,312	2,923,589
未収運用受託報酬	1,198,432	870,546
未収収益	41,310	38,738
その他	7,553	3,324
流動資産計	26,188,788	24,546,329
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1 75,557	225,975
器具備品	※1 122,169	95,404
土地	710	710
リース資産	※1 7,275	8,108
有形固定資産計	205,712	330,198
無形固定資産		
ソフトウェア	73,887	159,087
ソフトウェア仮勘定	—	6,115
電話加入権	12,706	12,706
無形固定資産計	86,593	177,909
投資その他の資産		
投資有価証券	10,257,600	11,025,039
関係会社株式	956,115	956,115
従業員長期貸付金	1,170	—
長期差入保証金	534,699	534,270
出資金	82,660	82,660
繰延税金資産	1,041,251	1,009,250
その他	—	8,397
貸倒引当金	△20,750	△20,750
投資その他の資産計	12,852,746	13,594,982
固定資産計	13,145,052	14,103,090
資産合計	39,333,840	38,649,419

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,143	3,583
未払金	29,207	1,555,486
未払手数料	1,434,393	1,222,461
未払費用	1,287,722	1,203,269
未払法人税等	1,397,293	264,304
未払消費税等	135,042	48,437
賞与引当金	1,263,100	1,007,040
役員賞与引当金	85,600	72,900
その他	23,128	29,455
流動負債計	5,658,632	5,406,939
固定負債		
リース債務	4,698	5,173

退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
役員退職慰労引当金	88,050	—
長期未払金	—	204,333
資産除去債務	—	248,260
固定負債計	1,632,952	2,164,829
負債合計	7,291,585	7,571,769

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	156,268	156,268
資本剰余金合計	156,268	156,268
利益剰余金		
利益準備金	343,731	343,731
その他利益剰余金		
別途積立金	1,100,000	1,100,000
繰越利益剰余金	28,387,042	27,516,774
利益剰余金合計	29,830,773	28,960,505
株主資本合計	31,987,042	31,116,774
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	55,213	△39,124
評価・換算差額等合計	55,213	△39,124
純資産合計	32,042,255	31,077,650
負債純資産合計	39,333,840	38,649,419

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	5,111,757	4,252,374
委託者報酬	26,383,145	24,415,734
その他営業収益	82,997	66,957
営業収益計	31,577,899	28,735,066
営業費用		
支払手数料	11,900,832	10,708,502
広告宣伝費	93,131	196,206
公告費	—	293
調査費		
調査費	1,637,364	2,076,042
委託調査費	2,959,680	3,032,753
委託計算費	79,120	77,597
営業雑経費		
通信費	42,497	38,715
印刷費	517,371	507,540

協会費	24,374	24,325
諸会費	3,778	1,994
その他	122,930	63,596
営業費用計	17,381,079	16,727,567
一般管理費		
給料		
役員報酬	218,127	217,030
給料・手当	2,809,008	3,002,836
賞与	86,028	48,878
退職金	9,864	2,855
福利厚生費	647,269	638,399
交際費	29,121	38,883
旅費交通費	159,224	153,694
租税公課	199,255	160,817
不動産賃借料	622,807	639,392
退職給付費用	219,724	324,082
固定資産減価償却費	71,624	141,154
賞与引当金繰入額	1,263,100	1,007,040
役員退職慰労引当金繰入額	36,130	102,860
役員賞与引当金繰入額	85,500	72,900
諸経費	901,001	1,011,941
一般管理費計	7,357,787	7,562,768
営業利益	6,839,032	4,444,730
営業外収益		
受取配当金	23,350	35,946
受取利息	199	178
投資有価証券売却益	6,350	45,345
その他	2,831	10,431
営業外収益計	32,732	91,902
営業外費用		
投資有価証券売却損	5,000	4,735
解約違約金	—	982
為替差損	1,784	828
その他	0	410
営業外費用計	6,784	6,956
経常利益	6,864,980	4,529,676
特別損失		
合併関連費用	※2	179,376
固定資産除却損	—	4,121
特別損失計	—	183,498
税引前当期純利益	6,864,980	4,346,177
法人税、住民税及び事業税	2,242,775	1,339,010
法人税等調整額	△78,014	73,635
法人税等合計	2,164,761	1,412,646
当期純利益	4,700,218	2,933,531

(3) 株主資本等変動計算書

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30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
			資本剰余金	その他利益剰余金

		資本準備金	合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	26,100,773
当期変動額						
剰余金の配当						△2,413,950
当期純利益						4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,286,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042

	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	27,544,504	29,700,773	37,917	37,917	29,738,691
当期変動額					
剰余金の配当	△2,413,950	△2,413,950			△2,413,950
当期純利益	4,700,218	4,700,218			4,700,218
株主資本以外の項目の 当期変動額 (純額)			17,295	17,295	17,295
当期変動額合計	2,286,268	2,286,268	17,295	17,295	2,303,564
当期末残高	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31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	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金	
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042
当期変動額						
剰余金の配当						△3,803,800
当期純利益						2,933,531
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	△870,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	27,516,774

	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	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255
当期変動額					
剰余金の配当	△3,803,800	△3,803,800			△3,803,800
当期純利益	2,933,531	2,933,531			2,933,531

株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			△94,337	△94,337	△94,337
当期変動額合計	△870,268	△870,268	△94,337	△94,337	△964,605
当期末残高	28,960,505	31,116,774	△39,124	△39,124	31,077,650

注記事項

（重要な会計方針）

1.有価証券の評価基準及び評価方法 (1) 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法を採用しております。 (2) その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（売却原価は総平均法により算出し、評価差額は全部純資産直入法により処理しております。）を採用しております。 時価のないもの 総平均法による原価法を採用しております。
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） 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 2～30年 器具備品 4～15年 （会計上の見積りの変更） 当事業年度において、当社と三井住友アセットマネジメント株式会社（以下「SMAM」）との間で合併契約を締結したことに伴い、将来利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。 これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ15,534千円減少しております。 (2) 無形固定資産（リース資産を除く） 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。 (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 従業員賞与の支払に備えるため、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) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、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。 (4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。 これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。 (5) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づき事業年度末における要支給額を計上しております。

4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

（表示方法の変更）

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」504,497千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,041,251千円に含めて表示しております。

（追加情報）

当社は、平成31年3月22日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当事業年度において役員退職慰労引当金184,610千円を長期未払金に振り替えております。

（貸借対照表関係）

第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
※1.有形固定資産の減価償却累計額	※1.有形固定資産の減価償却累計額
建物 465,964千円	建物 556,889千円
器具備品 266,621千円	器具備品 297,262千円
リース資産 8,719千円	リース資産 12,584千円

（損益計算書関係）

第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
—	※2. 合併関連費用は、主に目論見書等の一斉改版費用及び当社とSMAMとの合併に関する業務委託費用であります。

（株主資本等変動計算書関係）

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

1.発行済株式に関する事項

（単位：千株）

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	—	—	3,850
合 計	3,850	—	—	3,850

2.配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成29年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,413,950	627	平成29年3月31日	平成29年6月24日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
----	-------	----------------	-----------	------------------	-----	-------

平成30年6月22日 定時株主総会	普通 株式	2,348,500	利益 剰余金	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日
----------------------	----------	-----------	-----------	-----	------------	------------

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

1.発行済株式に関する事項

（単位：千株）

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	—	—	3,850
合 計	3,850	—	—	3,850

2.配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成30年6月22日 定時株主総会	普通株式	2,348,500	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日

（2）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の 種類	配当金 の総額 （千円）	配当の 原資	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成31年3月22日 臨時株主総会	普通 株式	1,455,300	利益 剰余金	378	平成31年3月31日	令和1年6月25日

（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・代理業などの資産運用事業を行っております。余裕資金は安全で流動性の高い金融資産で運用し、銀行からの借入や社債の発行はありません。

安全性の高い金融商品での短期的な運用の他に、自社ファンドの設定に自己資本を投入しております。その自己設定投信は、事業推進目的で保有しており、設定、解約又は償還に関しては、社内規定に従っております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

主たる営業債権は、投資運用業等より発生する未収委託者報酬、未収運用受託報酬であります。

これらの債権は、全て1年以内の債権であり、そのほとんどが信託財産の中から支払われるため、回収不能となるリスクは極めて軽微であります。

未収入金は、当社より他社へ出向している従業員給与等であり、1年以内の債権であります。

投資有価証券は、その大半が事業推進目的で設定した投資信託であり、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。

長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金であり、差入先の信用リスクに晒されております。

未払手数料は、投資信託の販売に係る支払手数料であります。また、未払費用は、投資信託の運用に係る再委託手数料、及び業務委託関連費用であります。

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、社内規定に従って取引先を選定し、担当部門で取引先の状況を定期的にモニタリングし、財務状況等の悪化等による回収懸念の早期把握や軽減を図っております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

当社は、投資有価証券の一部を除いて、資金決済のほとんどを自国通貨で行っているため、為替の変動リスクは極めて限定的であります。

投資有価証券のうち自己設定投信については、その残高及び損益状況等を定期的に経営会議に報告しております。

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、適時に資金繰計画を作成・更新するとともに、社内規定に従って手元流動性を維持することにより、流動性リスクを管理しております。

2.金融商品の時価等に関する事項

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、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表に含めておりません（(注2)を参照ください）。

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	21,360,895	21,360,895	—
(2) 未収委託者報酬	3,363,312	3,363,312	—
(3) 未収運用受託報酬	1,198,432	1,198,432	—
(4) 未収入金	12,823	12,823	—
(5) 投資有価証券 その他有価証券	10,206,465	10,206,465	—
資産計	36,141,929	36,141,929	—
(1) 未払手数料	1,434,393	1,434,393	—
(2) 未払費用（*）	959,074	959,074	—
負債計	2,393,468	2,393,468	—

（*）金融商品に該当するものを表示しております。

第47期（平成31年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	20,475,527	20,475,527	—
(2) 未収委託者報酬	2,923,589	2,923,589	—
(3) 未収運用受託報酬	870,546	870,546	—
(4) 未収入金	4,542	4,542	—
(5) 投資有価証券 その他有価証券	10,979,968	10,979,968	—
(6) 長期差入保証金	524,592	524,592	—
資産計	35,778,767	35,778,767	—
(1) 未払手数料	1,222,461	1,222,461	—
(2) 未払費用（*）	807,875	807,875	—
負債計	2,030,337	2,030,337	—

（*）金融商品に該当するものを表示しております。

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収入金

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、当該帳簿価額によっております。

(5) 投資有価証券

投資信託であり、公表されている基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

(6) 長期差入保証金

敷金の性質及び賃貸借契約の期間から、時価は当該帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額によっております。

負債

(1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

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、当該帳簿価額によっております。

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位：千円)

区分	第46期（平成30年3月31日）	第47期（平成31年3月31日）
(1) その他有価証券 非上場株式	51,135	45,071
(2) 子会社株式 非上場株式	956,115	956,115
(3) 長期差入保証金	534,699	9,677

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象としておりません。このため、(1) その他有価証券の非上場株式については2.(5) 投資有価証券には含めておりません。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第46期（平成30年3月31日）

(単位：千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	21,360,895	—	—	—
未収委託者報酬	3,363,312	—	—	—
未収運用受託報酬	1,198,432	—	—	—
未収入金	12,823	—	—	—
投資有価証券 その他有価証券の うち満期があるもの	1,923,400	373,466	657,576	—
合計	27,858,863	373,466	657,576	—

第47期（平成31年3月31日）

(単位：千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	20,475,527	—	—	—
未収委託者報酬	2,923,589	—	—	—
未収運用受託報酬	870,546	—	—	—
未収入金	4,542	—	—	—
投資有価証券 その他有価証券の うち満期があるもの	151,249	2,135,802	761,441	—
長期差入保証金	—	524,592	—	—
合計	24,425,455	2,660,395	761,441	—

(有価証券関係)

1.子会社株式

第46期（平成30年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

第47期（平成31年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

第46期（平成30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
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	2,522,495	2,276,821	245,674
小計	2,522,495	2,276,821	245,674
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	7,683,969	7,850,063	△166,093
小計	7,683,969	7,850,063	△166,093
合計	10,206,465	10,126,884	79,580

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 51,135千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第47期（平成31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
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	2,207,351	1,967,041	240,309
小計	2,207,351	1,967,041	240,309
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	8,772,616	9,069,317	△296,700
小計	8,772,616	9,069,317	△296,700
合計	10,979,968	11,036,359	△56,391

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 45,071千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	398,350	6,350	5,000

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	1,433,609	45,345	4,735

（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、退職金規程に基づく退職一時金制度のほか、確定拠出年金制度を採用しております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を採用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	1,482,500	1,540,203
退職給付費用	147,235	248,717
退職給付の支払額	△105,520	△61,499
その他	15,987	△20,359
退職給付引当金の期末残高	1,540,203	1,707,062

(注)前事業年度のその他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

当事業年度のその他は、主に長期未払金への振り替えであります。

(2) 退職給付債務及び年金資産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)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	—	—
年金資産	—	—
	—	—
非積立型制度の退職給付債務	1,540,203	1,707,062
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,540,203	1,707,062
退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,540,203	1,707,062

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 第46期 147,235千円 第47期 248,717千円

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第46期は72,489千円、第47期は75,365千円であります。

(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)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	71,030	23,058
賞与引当金	386,761	308,355
社会保険料	30,549	27,751
未払事業所税	4,247	4,370
退職給付引当金	471,610	522,702
資産除去債務	—	77,318
投資有価証券	67,546	65,422
ゴルフ会員権	11,000	11,000
役員退職慰労引当金	26,961	—
その他有価証券評価差額金	—	17,266
その他	74,458	83,141
繰延税金資産小計	1,144,165	1,140,388
評価性引当額	△78,546	△76,422
繰延税金資産合計	1,065,618	1,063,965

繰延税金負債		
建物	—	54,715
その他有価証券評価差額金	△24,367	—
繰延税金負債合計	△24,367	54,715
繰延税金資産の純額	1,041,251	1,009,250

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差異の原因となった主な項目別の内訳

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
法定実効税率	-	30.62%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	0.80%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	0.09%
特定外国子会社等課税対象金額	-	1.99%
税額控除	-	△0.64%
その他	-	△0.36%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	32.50%

(注) 前事業年度は、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の差異が

法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

(1) 当該資産除去債務の概要

主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等であります。

(2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

当該契約に基づく退去予定期限までの期間を使用見込期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから、割引前の見積り額を計上しております。

(3) 当該資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等について合理的な見積りが可能となったことから、「(2) 当該資産除去債務の金額の算定方法」に記載の算定方法に則り、資産除去債務の金額を計算しております。資産除去債務の残高の推移は次のとおりであります。

(単位：千円)

	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
期首残高	—	—
見積りの変更による増加額	—	248,260
期末残高	—	248,260

(セグメント情報等)

セグメント情報

1. 報告セグメントの概要

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

関連情報

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	26,383,145	5,111,757	82,997	31,577,899

2.地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

(2) 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

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

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。

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

該当事項はありません。

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。

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

1.製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	24,415,734	4,252,374	66,957	28,735,066

2.地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

(2) 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

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

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。

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

該当事項はありません。

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。

(関連当事者との取引)

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の 名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他 の関係 会社の 子会社	大和証 券株式 会社	東京 都 千代 田区	1,000	証券業	—	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払※1	3,987,525	未払 手数料 料	573,578
その他 の関係 会社の 子会社	株式 会社 三井 住友 銀行	東京 都 千代 田区	17,709	銀行業	—	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払※1	1,969,101	未払 手数料 料	273,241

取引条件及び取引条件の決定方針等

※1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。

※2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の 名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他 の関係 会社の 子会社	大和証 券株式 会社	東京 都 千代 田区	1,000	証券業	—	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払※1	4,328,153	未払 手数料 料	540,879
その他 の関係 会社の 子会社	株式 会社 三井 住友 銀行	東京 都 千代 田区	17,709	銀行業	—	当社投資信 託に係る事 務代行の委 託等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払※1	1,465,685	未払 手数料 料	228,197

取引条件及び取引条件の決定方針等

※1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。

※2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

（1株当たり情報）

	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
1株当たり純資産額	8,322円66銭	8,072円12銭
1株当たり当期純利益金額	1,220円84銭	761円96銭

(注)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。

1株当たりの当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
当期純利益(千円)	4,700,218	2,933,531
普通株主に帰属しない金額(千円)	—	—
普通株式に係る当期純利益(千円)	4,700,218	2,933,531
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850	3,850

（重要な後発事象）

当社は、平成30年9月28日付で締結した、SMAMとの合併契約書に基づき、当社を消滅会社とし、SMAMを存続会社とする吸収合併方式により、平成31年4月1日付で合併いたしました。

独立監査人の監査報告書

2020年6月15日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 羽 太 典 明 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕 印

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第35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2020年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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。

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. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年11月20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 羽 太 典 明 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 菅 野 雅 子 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 佐 藤 栄 裕 印

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2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020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2020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（2020年4月1日から2020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. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当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

2021年4月27日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 菅 野 雅 子 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 松 井 貴 志 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）の2020年9月16日から2021年3月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）の2021年3月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年9月16日から2021年3月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

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な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. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当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

2021年4月27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 公認会計士 菅 野 雅 子 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 松 井 貴 志 印
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）の2020年9月16日から2021年3月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）の2021年3月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年9月16日から2021年3月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

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な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. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当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

2021年4月27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 公認会計士 菅 野 雅 子 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 松 井 貴 志 印
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）の2020年9月16日から2021年3月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）の2021年3月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年9月16日から2021年3月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

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な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. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当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

2021年4月27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 公認会計士 菅 野 雅 子 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 松 井 貴 志 印
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）の2020年9月16日から2021年3月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）の2021年3月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年9月16日から2021年3月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

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な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. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当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

2021年4月27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 公認会計士 菅 野 雅 子 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 松 井 貴 志 印
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）の2020年9月16日から2021年3月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）の2021年3月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年9月16日から2021年3月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

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な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. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当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。