

**【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1月7日提出
【計算期間】	第13期中(自 2020年4月14日至 2020年10月13日)
【ファンド名】	S M A M ・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)
【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】

## S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)

2020年10月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	1,701,334,428	99.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,472,526	0.26
合計(純資産総額)		1,705,806,954	100.00

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

## (2)【運用実績】

## 【純資産の推移】

## S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)

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12期 (2020年 4月13日)	1,600,674,239	1,600,674,239	13,151	13,151
2019年10月末日	1,648,393,069		13,849	
11月末日	1,674,094,948		13,985	
12月末日	1,687,285,783		14,101	
2020年 1月末日	1,698,666,763		14,072	
2月末日	1,654,733,294		13,586	
3月末日	1,592,012,691		13,029	
4月末日	1,631,488,103		13,289	
5月末日	1,668,468,166		13,488	
6月末日	1,673,473,280		13,514	
7月末日	1,697,628,438		13,558	
8月末日	1,729,904,141		13,794	
9月末日	1,741,979,267		13,777	
10月末日	1,705,806,954		13,576	

## 【分配の推移】

## S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第12期	2019年 4月16日 ~ 2020年 4月13日	0

## 【収益率の推移】

## S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)

	収益率(%)
第12期	4.2
第13期(中間期)	5.7

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

(参考)

## (1) 投資状況

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2020年10月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	164,254,743,990	97.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,466,760,602	2.07
合計(純資産総額)		167,721,504,592	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	2,469,610,000	1.47
合計	買建		2,469,610,000	1.47

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

2020年10月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
-------	------	-------------	-------------

国債証券	日本	102,598,238,570	78.02
地方債証券	日本	8,888,956,420	6.76
特殊債券	日本	14,702,960,604	11.18
社債券	日本	4,455,490,000	3.39
	オーストラリア	200,084,000	0.15
	フランス	199,100,000	0.15
	小計	4,854,674,000	3.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		452,498,331	0.35
合計(純資産総額)		131,497,327,925	100.00

## 外国株式インデックス・マザーファンド

2020年10月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	155,297,370,783	67.12
	イギリス	9,101,842,779	3.93
	スイス	8,142,250,173	3.52
	カナダ	7,654,204,868	3.31
	フランス	7,183,083,892	3.10
	ドイツ	6,575,989,182	2.84
	オーストラリア	4,395,735,290	1.90
	オランダ	4,390,802,593	1.90
	アイルランド	4,079,185,877	1.76
	スウェーデン	2,295,734,160	0.99
	デンマーク	1,918,831,591	0.83
	香港	1,862,172,828	0.80
	スペイン	1,641,970,488	0.71
	イタリア	1,275,007,084	0.55
	フィンランド	871,274,898	0.38
	バミューダ	730,514,909	0.32
	ジャージー	726,754,225	0.31
	シンガポール	665,424,381	0.29
	ベルギー	638,593,682	0.28
	イスラエル	457,464,279	0.20
ケイマン諸島	434,614,391	0.19	
ノルウェー	403,602,647	0.17	

	ニュージーランド	241,208,222	0.10
	ルクセンブルグ	168,561,473	0.07
	ポルトガル	119,906,294	0.05
	オーストリア	115,122,433	0.05
	キュラソー	111,008,403	0.05
	リベリア	50,878,264	0.02
	マン島	47,460,419	0.02
	パプアニューギニア	20,202,822	0.01
	小計	221,616,773,330	95.79
投資証券	アメリカ	4,321,545,633	1.87
	オーストラリア	579,823,787	0.25
	イギリス	120,354,289	0.05
	香港	116,052,142	0.05
	シンガポール	114,688,078	0.05
	フランス	102,159,157	0.04
	カナダ	33,940,953	0.01
	小計	5,388,564,039	2.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,360,916,409	1.88
合計(純資産総額)		231,366,253,778	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	2,366,130,973	1.02
	買建	ドイツ	493,461,478	0.21
	買建	イギリス	135,090,405	0.05
	買建	オーストラリア	163,766,820	0.07
合計	買建		3,158,449,676	1.35

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		159,246,100	0.06
	売建		1,249,912,400	0.54

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

2020年10月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	70,872,870,738	43.60
	フランス	16,759,981,727	10.31
	イタリア	15,132,540,160	9.31
	ドイツ	12,122,168,979	7.46
	イギリス	10,521,251,144	6.47
	スペイン	9,739,293,979	5.99
	ベルギー	4,383,008,131	2.70
	オーストラリア	4,110,462,635	2.53
	オランダ	3,238,103,984	1.99
	カナダ	3,004,896,394	1.85
	オーストリア	2,537,631,084	1.56
	アイルランド	1,295,693,488	0.80
	メキシコ	1,227,915,025	0.76
	フィンランド	1,088,811,290	0.67
	ポーランド	1,000,824,518	0.62
	デンマーク	870,179,900	0.54
	マレーシア	810,904,229	0.50
	シンガポール	693,943,316	0.43
	イスラエル	638,662,069	0.39
	スウェーデン	468,832,112	0.29
ノルウェー	357,000,439	0.22	
	小計	160,874,975,341	98.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,695,891,754	1.04
合計(純資産総額)		162,570,867,095	100.00

## 2【設定及び解約の実績】

## SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第12期	242,872,998	156,591,024
第13期(中間期)	115,226,172	74,601,872

(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13期中間計算期間(2020年4月14日から2020年10月13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。

## 【S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第12期 (2020年4月13日現在)	第13期中間計算期間 (2020年10月13日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	6,419,539	-
コール・ローン	4,462,544	9,325,719
親投資信託受益証券	1,595,233,322	1,745,238,433
未収入金	230,000	1,770,000
流動資産合計	1,606,345,405	1,756,334,152
資産合計	1,606,345,405	1,756,334,152
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	325,113	1,768,340
未払受託者報酬	269,492	278,277
未払委託者報酬	5,030,509	5,194,463
未払利息	12	19
その他未払費用	46,040	46,561
流動負債合計	5,671,166	7,287,660
負債合計	5,671,166	7,287,660
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,217,129,568	1,257,753,868
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	383,544,671	491,292,624
元本等合計	1,600,674,239	1,749,046,492
純資産合計	1,600,674,239	1,749,046,492
負債純資産合計	1,606,345,405	1,756,334,152

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第12期中間計算期間 自 2019年 4月16日 至 2019年10月15日	第13期中間計算期間 自 2020年 4月14日 至 2020年10月13日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	2,768,877	99,069,265
<b>営業収益合計</b>	<b>2,768,877</b>	<b>99,069,265</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	2,611	2,120
受託者報酬	253,798	278,277
委託者報酬	4,737,493	5,194,463
その他費用	43,596	47,509
<b>営業費用合計</b>	<b>5,037,498</b>	<b>5,522,369</b>
営業利益又は営業損失( )	2,268,621	93,546,896
経常利益又は経常損失( )	2,268,621	93,546,896
中間純利益又は中間純損失( )	2,268,621	93,546,896
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( )	712,396	3,149,157
期首剰余金又は期首欠損金( )	421,199,819	383,544,671
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>43,289,363</b>	<b>40,963,162</b>
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	43,289,363	40,963,162
剰余金減少額又は欠損金増加額	25,709,698	23,612,948
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	25,709,698	23,612,948
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
<b>分配金</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
中間剰余金又は中間欠損金( )	437,223,259	491,292,624

## (3)【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項 目	第13期中間計算期間 自 2020年 4月14日 至 2020年10月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第12期 (2020年 4月13日現在)	第13期中間計算期間 (2020年10月13日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,217,129,568口	1,257,753,868口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3151円 (10,000口当たりの純資産額 13,151円)	1口当たり純資産額 1.3906円 (10,000口当たりの純資産額 13,906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13期中間計算期間 (2020年10月13日現在)	
	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(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12期 (2020年4月13日現在)	第13期中間計算期間 (2020年10月13日現在)
	期首元本額	1,130,847,594円
期中追加設定元本額	242,872,998円	115,226,172円
期中一部解約元本額	156,591,024円	74,601,872円

## (参考)

SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」および「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。ただし「マネーインカム・マザーファンド」受益証券への投資は行っておりません。

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4月13日現在)	(2020年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,569,931,879	856,402
コール・ローン	1,091,338,581	1,270,545,988
株式	148,206,257,960	171,736,273,510

	(2020年 4月13日現在)	(2020年10月13日現在)
派生商品評価勘定	70,320,500	12,651,400
未収入金	12,960,400	2,021,200
未収配当金	1,992,318,344	1,485,170,825
差入委託証拠金	-	8,855,000
流動資産合計	152,943,127,664	174,516,374,325
資産合計	152,943,127,664	174,516,374,325
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,468,900	8,063,700
前受金	53,010,000	4,745,000
未払金	45,670,200	156,600
未払解約金	298,597,444	243,165,702
未払利息	2,960	2,697
その他未払費用	383,203	72,706
流動負債合計	415,132,707	256,206,405
負債合計	415,132,707	256,206,405
純資産の部		
元本等		
元本	66,999,567,497	64,640,721,448
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	85,528,427,460	109,619,446,472
元本等合計	152,527,994,957	174,260,167,920
純資産合計	152,527,994,957	174,260,167,920
負債純資産合計	152,943,127,664	174,516,374,325

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年 4月14日 至 2020年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
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4月13日現在)	(2020年10月13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 2,610,000,000円	株式 2,812,000,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	66,999,567,497口	64,640,721,448口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.2766円 (10,000口当たりの純資産額 22,766円)	1口当たり純資産額 2.6958円 (10,000口当たりの純資産額 26,958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	(2020年10月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(株式) 「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4月13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	3,115,148,400	-	3,168,000,000	52,851,600
	東証株価指数先物	3,115,148,400	-	3,168,000,000	52,851,600

合計	3,115,148,400	-	3,168,000,000	52,851,600
----	---------------	---	---------------	------------

(2020年10月13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	2,351,337,300	-	2,355,925,000	4,587,700
	東証株価指数先物	2,351,337,300	-	2,355,925,000	4,587,700
合計		2,351,337,300	-	2,355,925,000	4,587,700

(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 4月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	69,243,723,709円
同期中における追加設定元本額	16,941,213,035円
同期中における一部解約元本額	19,185,369,247円
2020年 4月13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	9,964,536,945円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,007,154,836円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,682,046,360円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,203,157,146円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	84,286,777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)	7,771,247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)	27,830,753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)	77,317,486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)	127,394,223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)	86,046,135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)	181,252,174円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,814,911,783円

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	12,839,183,881円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	547,577,365円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	561,168,497円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	411,929,217円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	14,698,817円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	88,807,681円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	72,638,725円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	212,846,574円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	102,613,725円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	126,077,209円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	16,579,634円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	10,439,245円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	155,573円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	1,105,768円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	827,282円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,752,764円
SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	3,948,100,879円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	22,926,442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>	220,267,664円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	3,234,260,231円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	2,428,994,643円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	9,037,107,599円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	57,396,433円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	218,485,657円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	657,085円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	880,814,914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>	58,124,475円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	405,907,028円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	1,106,480,802円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	939,572,269円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	2,905,693,174円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	1,225,167円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	66,011,486円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	81,792,352円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	48,200,904円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	23,412,935円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	209,289,501円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	402,959,759円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	119,019,653円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	56,952,405円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	10,193,913円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	72,366,784円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	989,295,905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)	188,003,249円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用>	22,115,210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>	937,750,878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>	189,817,826円
SMAM・世界バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	1,542,313,109円

S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	112,200,588円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	10,043,124円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	14,237,375円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	15,653,159円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド< 適格機関投資家限定 >	148,815,098円
合計	66,999,567,497円

( 2020年10月13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	66,999,567,497円
同期中における追加設定元本額	5,189,795,702円
同期中における一部解約元本額	7,548,641,751円
2020年10月13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	9,740,662,146円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	953,737,608円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,531,893,692円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,232,684,150円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	103,303,470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)	6,040,671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)	23,918,266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)	67,077,490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)	128,316,967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)	93,313,486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)	190,419,697円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,470,570,696円
三井住友・DCつみたてN I S A ・日本株インデックスファンド	14,659,098,649円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	545,443,800円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	582,130,592円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	379,669,505円
イオン・バランス戦略ファンド	96,964,880円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	18,234,844円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	114,279,379円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	88,703,755円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	290,227,724円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	147,869,293円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	164,581,293円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	21,059,594円
三井住友D S ・ 国内株式インデックス年金ファンド	104,999,596円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	5,192,087円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	28,376,939円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	23,443,819円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	3,056,977円
S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	3,391,343,810円

バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	19,011,104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 >	172,986,824円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	2,692,127,608円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	2,126,913,603円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	7,965,946,513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 >	202,569,932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 >	852,029,927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 >	55,253,345円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	341,176,214円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	1,003,227,262円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	802,861,745円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	2,527,895,924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 >	55,089,314円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	67,029,821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 >	161,977,609円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	324,774,513円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	94,265,921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 >	61,186,410円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	815,671,707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)	185,098,010円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2 < 適格機関投資家専用 >	2,837,630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 >	550,049,501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 >	1,370,714,161円
SMAM・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	97,147,851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 >	19,299,496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 >	62,862,379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 >	85,838,320円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	369,187,777円
合計	64,640,721,448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 4月13日現在)	(2020年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	315,440,332	-

	(2020年 4月13日現在)	(2020年10月13日現在)
コール・ローン	219,278,434	456,097,866
国債証券	103,352,030,980	102,605,086,390
地方債証券	8,508,860,805	8,895,685,190
特殊債券	13,059,052,368	14,700,100,666
社債券	6,272,811,000	4,955,217,000
未収利息	243,655,508	245,419,871
前払費用	6,060,238	5,473,131
流動資産合計	131,977,189,665	131,863,080,114
資産合計	131,977,189,665	131,863,080,114
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,839,311	6,731,000
未払利息	594	968
その他未払費用	219,836	21,635
流動負債合計	2,059,741	6,753,603
負債合計	2,059,741	6,753,603
純資産の部		
元本等		
元本	102,757,947,265	103,120,109,355
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	29,217,182,659	28,736,217,156
元本等合計	131,975,129,924	131,856,326,511
純資産合計	131,975,129,924	131,856,326,511
負債純資産合計	131,977,189,665	131,863,080,114

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年 4月14日 至 2020年10月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2020年 4月13日現在)	(2020年10月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	102,757,947,265口	103,120,109,355口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2843円 (10,000口当たりの純資産額 12,843円)	1口当たり純資産額 1.2787円 (10,000口当たりの純資産額 12,787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	(2020年10月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券、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 4月13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	135,164,231,551円
同期中における追加設定元本額	26,368,392,039円
同期中における一部解約元本額	58,774,676,325円
2020年 4月13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)	4,916,603,754円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	8,113,528,180円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,680,333,318円
S M A M ・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	760,735,655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)	50,269,872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)	178,435,133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)	338,879,703円

(2020年 4月13日現在)	
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	323,559,798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)	131,188,831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)	240,773,140円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	120,113,280円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,134,904,474円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	857,165,158円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	298,800,465円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	13,814,140円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,104,968,204円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	354,564,578円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	480,307,279円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	82,224,866円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	7,138,094円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	43,025,062円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	765,954円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	1,983,487円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	445,605円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,688,392円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,908,244,271円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	15,261,189,102円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	6,456,184,151円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	15,516,600,710円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	310,135,056円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	527,038,286円
世界6資産バランスファンドV A<適格機関投資家限定>	1,972,815円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	215,926,783円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	103,533,600円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,849,952,469円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	1,964,073,011円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	2,434,015,824円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	9,071,254,432円
S M A M・バランスV A 株4 0 T<適格機関投資家限定>	2,114,879円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	1,357,582,563円
S M A M・グローバルバランス4 0 V A<適格機関投資家限定>	448,466,921円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用>	622,144,119円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用>	170,571,267円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	41,651,607円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用>	1,741,366,557円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L<適格機関投資家専用>	2,265,783,446円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2<適格機関投資家専用>	884,439,072円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2<適格機関投資家専用>	201,287,819円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2<適格機関投資家専用>	17,629,769円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 0 L 2<適格機関投資家専用>	309,173,518円

(2020年 4月13日現在)	
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用>	5,580,424,372円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 <適格機関投資家専用>	257,779,674円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	379,382,709円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 <適格機関投資家限定>	1,223,935,464円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,393,683,063円
S M A M・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	4,003,193,514円
合計	102,757,947,265円

(2020年10月13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	102,757,947,265円
同期中における追加設定元本額	10,751,498,601円
同期中における一部解約元本額	10,389,336,511円
2020年10月13日現在における元本の内訳	
三井住友・D C年金バランス3 0 (債券重点型)	5,467,627,496円
三井住友・D C年金バランス5 0 (標準型)	9,448,508,690円
三井住友・D C年金バランス7 0 (株式重点型)	2,021,888,105円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	691,985,307円
三井住友・D Cターゲットイヤーファンド2 0 2 0 (4資産タイプ)	45,083,259円
三井住友・D Cターゲットイヤーファンド2 0 2 5 (4資産タイプ)	182,432,939円
三井住友・D Cターゲットイヤーファンド2 0 3 0 (4資産タイプ)	375,433,386円
三井住友・D Cターゲットイヤーファンド2 0 3 5 (4資産タイプ)	443,684,217円
三井住友・D Cターゲットイヤーファンド2 0 4 0 (4資産タイプ)	179,263,552円
三井住友・D Cターゲットイヤーファンド2 0 4 5 (4資産タイプ)	309,805,309円
三井住友・D C年金バランスゼロ(債券型)	132,954,246円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,323,841,988円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	367,985,967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・D Cターゲットイヤーファンド2 0 5 0	21,393,696円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	902,816,164円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	269,029,141円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	391,266,509円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	80,251,946円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	22,428,353円
三井住友・D CつみたてN I S A・世界分散ファンド	66,122,401円
三井住友D S・年金バランス3 0 (債券重点型)	29,820,096円
三井住友D S・年金バランス5 0 (標準型)	60,059,626円
三井住友D S・年金バランス7 0 (株式重点型)	14,900,803円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2 0 6 0	3,598,454円

(2020年10月13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>	5,903,494,951円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	15,115,575,026円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,671,933,163円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,483,920,881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>	562,134,212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>	247,763,633円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	116,400,712円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,898,215,882円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,091,820,730円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,499,906,583円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	9,293,129,146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)	1,349,832,684円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	462,970,340円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	615,683,150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>	1,661,744,592円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,245,164,938円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	858,665,437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>	300,000,020円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	5,611,921,599円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	43,147,522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>	281,734,923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>	923,805,032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>	1,256,807,525円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	2,981,839,770円
合計	103,120,109,355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 4月13日現在)	(2020年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,613,138,714	3,181,596,490
金銭信託	196,407,416	-

	(2020年 4月13日現在)	(2020年10月13日現在)
コール・ローン	136,532,670	184,794,080
株式	187,233,126,027	232,454,966,109
投資証券	5,087,009,262	5,680,748,431
派生商品評価勘定	145,973,096	253,086,034
未収入金	1,819,725	-
未収配当金	245,293,678	187,250,480
差入委託証拠金	1,816,503,539	2,226,076,162
流動資産合計	196,475,804,127	244,168,517,786
資産合計	196,475,804,127	244,168,517,786
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	236,418	3,691,196
前受金	136,840,750	249,165,538
未払解約金	2,100,611,158	157,490,619
未払利息	370	392
その他未払費用	99,189	21,995
流動負債合計	2,237,787,885	410,369,740
負債合計	2,237,787,885	410,369,740
純資産の部		
元本等		
元本	58,474,870,859	59,110,966,052
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	135,763,145,383	184,647,181,994
元本等合計	194,238,016,242	243,758,148,046
純資産合計	194,238,016,242	243,758,148,046
負債純資産合計	196,475,804,127	244,168,517,786

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年 4月14日 至 2020年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

	(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 4月13日現在)	(2020年10月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	58,474,870,859口	59,110,966,052口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.3217円 (10,000口当たりの純資産額 33,217円)	1口当たり純資産額 4.1237円 (10,000口当たりの純資産額 41,237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	(2020年10月13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 4月13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	1,756,190,656	-	1,893,031,406	136,840,750
	SPMINI 2006	1,274,191,790	-	1,383,945,668	109,753,878
	DJ EUR 2006	287,308,580	-	303,894,765	16,586,185
	FTSE 2006	90,052,466	-	94,128,144	4,075,678
	SPI200 2006	104,637,820	-	111,062,829	6,425,009
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	90,036,600	-	90,016,300	20,300
	米ドル	70,356,000	-	70,343,000	13,000
	ユーロ	9,464,000	-	9,460,800	3,200
	英ポンド	8,089,800	-	8,087,400	2,400
	スウェーデンクローナ	870,400	-	869,600	800
	香港ドル	1,256,400	-	1,255,500	900
	売建	1,914,997,788	-	1,906,081,560	8,916,228
	米ドル	1,445,100,800	-	1,437,161,600	7,939,200
	カナダドル	55,925,870	-	55,828,800	97,070
	ユーロ	151,146,450	-	150,781,500	364,950
	英ポンド	73,605,672	-	73,325,760	279,912
	スイスフラン	76,343,680	-	76,173,600	170,080
	スウェーデンクローナ	17,072,235	-	17,065,900	6,335
	ノルウェークローネ	4,041,424	-	4,009,000	32,424
	デンマーククローネ	16,677,080	-	16,632,000	45,080
	オーストラリアドル	38,902,562	-	39,079,200	176,638
	ニュージーランドドル	1,969,200	-	1,972,200	3,000
	香港ドル	23,156,415	-	23,017,500	138,915
	シンガポールドル	6,508,200	-	6,494,000	14,200
	イスラエルシケル	4,548,200	-	4,540,500	7,700
	合計	3,761,225,044	-	3,889,129,266	145,736,678

(2020年10月13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	5,322,681,600	-	5,571,847,138	249,165,538
	SPMINI 2012	3,989,033,380	-	4,224,649,420	235,616,040
	DJ EUR 2012	895,813,910	-	900,849,708	5,035,798
	FTSE 2012	237,477,176	-	238,246,208	769,032
	SPI200 2012	200,357,134	-	208,101,802	7,744,668
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	72,877,200	-	72,647,900	229,300
	米ドル	59,164,000	-	58,996,000	168,000
	ユーロ	4,991,200	-	4,972,400	18,800
	英ポンド	2,752,400	-	2,748,800	3,600
	スイスフラン	1,159,900	-	1,157,900	2,000
	スウェーデンクローナ	120,000	-	119,500	500
	ノルウェークローネ	115,300	-	114,900	400
	オーストラリアドル	4,574,400	-	4,538,400	36,000
	合計	5,395,558,800	-	5,644,495,038	249,394,838

## (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。

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。

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 4月13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	51,227,388,044円
同期中における追加設定元本額	27,385,256,620円
同期中における一部解約元本額	20,137,773,805円
2020年 4月13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	25,231,318,479円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	378,421,998円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,463,649,022円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	930,435,402円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	91,109,362円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	2,603,248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)	9,144,941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)	28,111,210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)	58,883,705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)	44,465,029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)	98,964,448円
外国株式指数ファンド	547,230,104円
三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	5,541,347,659円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	258,142,746円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	257,721,554円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	188,944,854円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	9,114,050円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	64,371,954円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	53,821,410円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	154,555,549円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	74,647,971円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	91,931,978円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	24,370,050円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	2,667,451円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	54,190円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	329,790円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	229,988円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	1,790,260円
S M A M・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,336,856,076円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	8,390,349円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定>	71,673,896円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	1,603,381,875円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	1,550,405,958円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	6,427,072,311円

S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	19,789,865円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	105,025,426円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	347,233円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	743,175,435円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	64,157,112円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	186,221,797円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	790,847,473円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	666,936,328円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	1,587,087,513円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	897,600円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	285,453,719円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	135,588,581円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	17,994,714円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	13,073,387円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	7,055,036円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	43,227,998円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	112,493,525円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	688,091,914円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	137,128,409円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	5,755,492,578円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	256,998,128円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	95,964,227円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	6,000,355円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	7,004,719円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	7,446,085円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド< 適格機関投資家限定 >	135,212,835円
合計	58,474,870,859円

( 2020年10月13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	58,474,870,859円
同期中における追加設定元本額	9,037,624,536円
同期中における一部解約元本額	8,401,529,343円
2020年10月13日現在における元本の内訳	
三井住友・D C 外国株式インデックスファンドS	27,313,654,366円
三井住友・D C 年金バランス3 0 ( 債券重点型 )	322,837,870円
三井住友・D C 年金バランス5 0 ( 標準型 )	1,319,563,282円
三井住友・D C 年金バランス7 0 ( 株式重点型 )	874,682,512円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	78,192,787円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 0 ( 4資産タイプ)	1,760,136円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 5 ( 4資産タイプ)	7,484,557円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 0 ( 4資産タイプ)	21,880,887円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 5 ( 4資産タイプ)	53,208,556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)	46,342,783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)	96,156,032円
外国株式指数ファンド	567,905,768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	7,293,594,954円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	319,378,197円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	343,530,748円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	223,659,793円
イオン・バランス戦略ファンド	38,627,441円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	11,325,277円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	85,595,888円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	67,963,234円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	214,796,670円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	107,280,920円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	118,058,668円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	28,411,855円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	98,710,837円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	1,739,158円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	8,173,979円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	6,295,142円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,843,120円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	567,082円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,039,506,279円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	6,322,019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〉	1,192,715,719円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	1,247,134,982円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	5,301,916,230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〉	90,424,216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〉	653,937,511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〉	55,865,581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〉	679,107,005円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	532,076,567円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	1,273,286,183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)	260,738,079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〉	35,299,976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〉	360,623,913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〉	4,900,433,601円
SMAM・世界バランスファンドVA2〈適格機関投資家限定〉	210,435,157円

S M A M ・ 外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	571,461,819円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	12,034,551円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016 - 04 < 適格機関投資家限定 >	38,268,600円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	52,223,598円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	348,445,447円
合計	59,110,966,052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 4月13日現在)	(2020年10月13日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	308,581,281	408,379,846
金銭信託	597,505,503	-
コール・ローン	415,356,115	516,819,351
国債証券	154,165,757,446	163,265,415,146
未収利息	1,166,031,411	1,098,841,421
前払費用	26,718,180	38,198,574
流動資産合計	156,679,949,936	165,327,654,338
資産合計	156,679,949,936	165,327,654,338
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	346,702,542	29,506,926
未払利息	1,126	1,097
その他未払費用	127,850	19,280
流動負債合計	346,831,518	29,527,303
負債合計	346,831,518	29,527,303
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	84,556,952,355	86,695,508,428
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	71,776,166,063	78,602,618,607
元本等合計	156,333,118,418	165,298,127,035
純資産合計	156,333,118,418	165,298,127,035
負債純資産合計	156,679,949,936	165,327,654,338

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年 4月14日 至 2020年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2020年 4月13日現在)	(2020年10月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	84,556,952,355口	86,695,508,428口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8488円 (10,000口当たりの純資産額 18,488円)	1口当たり純資産額 1.9067円 (10,000口当たりの純資産額 19,067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	(2020年10月13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。

項目	(2020年10月13日現在)
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 4月13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	93,585,617,520円
同期中における追加設定元本額	19,007,917,668円
同期中における一部解約元本額	28,036,582,833円
2020年 4月13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	21,722,757,217円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	620,743,841円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,623,582,446円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	762,999,674円
S M A M ・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	59,334,732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)	8,595,523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)	31,127,149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)	88,259,689円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	122,049,060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)	67,678,112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)	141,427,020円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	22,354,389円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	123,833,140円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	139,221,474円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	105,757,710円
イオン・バランス戦略ファンド	11,543,568円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2050	5,928,646円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	56,776,890円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	60,159,644円

(2020年 4月13日現在)	
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	118,132,027円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	42,972,475円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	19,521,125円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	39,747,781円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	1,305,631円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	96,216円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	393,028円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	205,854円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,121,849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>	1,979,767,666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>	65,167,979円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	9,428,559,138円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,852,730,810円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	10,719,433,443円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	35,972,335円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	89,375,303円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	383,602円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	615,393,737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>	107,986,579円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,121,811,212円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,345,145,307円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,687,191,656円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	5,414,915,975円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,474,614円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	9,314,565,021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)	360,272,280円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	155,841,347円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	102,843,371円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	35,912,561円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	12,525,068円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	128,196,997円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	486,454,418円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	145,459,904円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	40,950,132円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,161,186円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,197,268,688円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	19,121,083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>	1,870,186,532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>	1,211,426,201円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,740,964,036円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	515,138,509円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	119,634,570円

(2020年 4月13日現在)	
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	40,310,514円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	34,933,875円
S M A M ・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	37,467,680円
S M A M ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	519,383,116円
合計	84,556,952,355円

(2020年10月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	84,556,952,355円
同期中における追加設定元本額	6,554,560,574円
同期中における一部解約元本額	4,416,004,501円
2020年10月13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	22,816,752,414円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	668,878,961円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,808,450,738円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	906,013,175円
S M A M ・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	136,082,096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)	7,332,179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)	29,616,147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)	90,819,167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)	150,028,845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)	88,203,109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)	173,305,471円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,845,603円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	149,309,594円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	170,715,521円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	113,645,696円
イオン・バランス戦略ファンド	167,226,873円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2050	8,609,765円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	51,855,666円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	30,837,885円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	73,884,821円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	22,894,327円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	14,677,313円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	58,777,994円
三井住友D S ・外国債券インデックス年金ファンド	63,918,656円
三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)	3,649,669円
三井住友D S ・年金バランス50(標準型)	11,515,931円
三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	6,659,515円

(2020年10月13日現在)	
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2060	1,437,654円
S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,325,770,826円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型<適格機関投資家限定>	57,240,371円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	8,892,130,213円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	4,865,589,721円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	11,081,288,238円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	34,927,566円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	92,654,350円
世界6資産バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	364,139円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	680,926,460円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	117,038,834円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	1,124,758,075円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	1,406,378,119円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	1,680,730,871円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	5,343,137,864円
S M A M ・ バランスV A 株40T<適格機関投資家限定>	1,096,475円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンドV A <適格機関投資家限定>	8,929,322,723円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	369,790,405円
S M A M ・ グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	154,186,530円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	94,741,730円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	35,684,638円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	12,403,524円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	113,867,324円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	457,775,996円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 <適格機関投資家専用>	131,813,011円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用>	41,665,026円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	5,430,860円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用>	1,134,326,524円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 <適格機関投資家専用>	2,828,178円
S M A M ・ 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>	1,234,227,716円
S M A M ・ 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>	1,167,234,704円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,988,172,499円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	512,837,829円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	129,884,781円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	53,989,150円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	164,904,647円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	224,394,794円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	1,183,048,932円
合計	86,695,508,428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

	2020年10月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

最近5年間における資本金の額の増減  
該当ありません。

## (2)【事業の内容及び営業の状況】

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

2020年10月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	755	7,665,066
単位型株式投資信託	121	562,065
追加型公社債投資信託	1	28,300
単位型公社債投資信託	181	468,572
合計	1,058	8,724,005

## (3)【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

2020年1月24日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。

(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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
顧客からの預り金	4,534	14,285
その他の預り金	1,480,229	146,200
<b>未払金</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,000	2,000,000
<b>資本剰余金</b>		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	-	81,927,000
資本剰余金合計	8,628,984	90,555,984
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	284,245	284,245
<b>その他利益剰余金</b>		
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
<b>評価・換算差額等</b>		
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)

	(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	110,668
関係会社株式評価損		-
合併関連費用	2	42,800
本社移転費用	3	133,168
減損損失	4	46,417
特別損失合計		333,054
税引前当期純利益	6,023,530	1,833,414
法人税、住民税及び事業税	1,750,031	1,874,278
法人税等調整額	90,084	619,676
法人税等合計	1,840,116	1,254,602
当期純利益	4,183,413	578,811

## (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		利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	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	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。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. 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あります。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、配当の効力発生日が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、配当の効力発生日が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

## 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。

## 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った場合、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 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 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)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

	(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)
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

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 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	㈱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㈱	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	㈱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㈱	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)
<b>資産の部</b>		
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
<b>負債の部</b>		
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

子会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)

市場価格のない株式等  
移動平均法による原価法

## 2. 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。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. 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 その他有価証券	21,083,260	21,083,260	-
(7)投資その他の資産 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 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

    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

    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 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) 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) 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

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3)主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

第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おりません。

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

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		利益準備金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金	繰越利益剰余金
				別途積立金		
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)

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(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。</p> <p>(2) その他有価証券</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
<p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(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。</p> <p>建物 2～30年 器具備品 4～15年</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
<p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

## 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S M A M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

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。

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。

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	第47期
	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	(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	第47期
	(平成30年3月31日)	(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主な原因別の内訳

(単位：千円)

	第46期	第47期
	(平成30年3月31日)	(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、S M A Mとの合併契約書に基づき、当社を消滅会社とし、S M A M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 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

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、継続企業的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、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 . 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**

2020年11月24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SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）の2020年4月14日から2020年10月13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、SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）の2020年10月13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4月14日から2020年10月13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、継続企業的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。