

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	令和2年1月23日提出
【計算期間】	第5期中(自 平成31年4月27日至 令和1年10月26日)
【ファンド名】	アセットアロケーション・ファンド(安定型) アセットアロケーション・ファンド(安定成長型) アセットアロケーション・ファンド(成長型)
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【連絡場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【電話番号】	03-5405-0784
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【ファンドの運用状況】

(1)【投資状況】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

2019年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	2,174,633,550	13.13
親投資信託受益証券	日本	14,095,672,323	85.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		292,451,820	1.77
合計(純資産総額)		16,562,757,693	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。以下同じ。
その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		37,189,200	0.22
	売建		1,798,491,762	10.85

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

2019年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	2,269,568,136	19.75
親投資信託受益証券	日本	9,013,640,818	78.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		205,638,553	1.79
合計(純資産総額)		11,488,847,507	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		25,048,020	0.21
	売建		1,867,211,382	16.25

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	1,575,931,581	21.84
親投資信託受益証券	日本	5,519,470,887	76.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		121,154,279	1.68
合計(純資産総額)		7,216,556,747	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		64,971,720	0.90
	売建		1,206,052,993	16.71

(2) 【運用実績】

【純資産の推移】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第4期 (2019年 4月26日)	21,753,606,702	21,753,606,702	10,029	10,029
2018年11月末日	23,598,056,894		9,728	
12月末日	22,961,568,967		9,683	
2019年 1月末日	22,973,977,420		9,816	
2月末日	22,709,606,058		9,879	
3月末日	22,598,214,837		9,979	
4月末日	21,753,606,702		10,029	
5月末日	20,768,528,269		9,873	
6月末日	20,052,981,120		10,076	
7月末日	19,488,758,844		10,169	
8月末日	18,860,611,216		10,180	
9月末日	17,698,741,347		10,249	
10月末日	17,063,300,423		10,317	
11月末日	16,562,757,693		10,370	

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第4期 (2019年 4月26日)	14,199,914,498	14,199,914,498	10,254	10,254
2018年11月末日	15,576,101,152		9,892	
12月末日	15,062,352,427		9,702	
2019年 1月末日	15,207,033,945		9,939	
2月末日	15,013,426,653		10,059	
3月末日	14,841,024,942		10,148	
4月末日	14,199,914,498		10,254	
5月末日	13,283,670,002		9,969	
6月末日	13,235,271,071		10,214	
7月末日	12,848,802,253		10,341	
8月末日	12,409,381,296		10,249	
9月末日	12,225,568,940		10,415	
10月末日	11,696,042,567		10,584	
11月末日	11,488,847,507		10,672	

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第4期 (2019年 4月26日)	10,908,544,788	10,908,544,788	10,362	10,362
2018年11月末日	11,578,996,762		9,957	
12月末日	11,157,055,437		9,688	
2019年 1月末日	11,370,188,977		9,976	
2月末日	11,442,856,955		10,131	
3月末日	11,468,494,958		10,212	
4月末日	10,908,544,788		10,362	
5月末日	10,155,212,084		9,978	
6月末日	10,152,206,248		10,244	
7月末日	9,821,798,181		10,401	
8月末日	9,355,718,197		10,221	
9月末日	8,965,996,363		10,447	
10月末日	7,726,186,371		10,677	
11月末日	7,216,556,747		10,792	

【分配の推移】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第4期	2018年 4月27日～2019年 4月26日	0

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第4期	2018年 4月27日～2019年 4月26日	0

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第4期	2018年 4月27日～2019年 4月26日	0

【収益率の推移】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

	収益率（％）
第4期	2.2
第5期（中間期）	2.8

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

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

	収益率（％）
第4期	2.3
第5期（中間期）	3.0

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

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

	収益率（％）
第4期	2.5
第5期（中間期）	2.7

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

(参考)

(1) 投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2019年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	168,902,980,880	97.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,092,095,066	2.37
合計(純資産総額)		172,995,075,946	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,954,010,000	2.28
合計	買建	-	3,954,010,000	2.28

外国株式インデックス・マザーファンド

2019年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	146,400,779,043	62.78
	イギリス	13,086,058,884	5.61
	カナダ	8,505,748,862	3.65
	フランス	8,434,098,776	3.62
	スイス	8,285,990,832	3.55
	ドイツ	7,137,267,594	3.06
	オーストラリア	4,925,709,668	2.11
	オランダ	4,365,492,373	1.87
	アイルランド	4,239,242,884	1.82
	スペイン	2,311,335,429	0.99

	スウェーデン	2,019,635,441	0.87
	香港	1,975,323,784	0.85
	イタリア	1,566,958,737	0.67
	デンマーク	1,498,485,974	0.64
	シンガポール	971,445,461	0.42
	バミューダ	899,987,657	0.39
	フィンランド	897,539,577	0.38
	ベルギー	813,810,858	0.35
	ジャージー	806,718,565	0.35
	ケイマン諸島	529,463,181	0.23
	ノルウェー	499,979,307	0.21
	イスラエル	486,108,902	0.21
	キュラソー	296,797,271	0.13
	ルクセンブルグ	220,724,276	0.09
	ニュージーランド	220,272,851	0.09
	オーストリア	183,782,598	0.08
	ポルトガル	125,593,296	0.05
	リベリア	120,085,079	0.05
	パプアニューギニア	38,614,243	0.02
	マン島	28,672,577	0.01
	英ヴァージン諸島	25,591,846	0.01
	小計	221,917,315,826	95.17
投資証券	アメリカ	4,731,071,587	2.03
	オーストラリア	691,310,351	0.30
	フランス	255,144,092	0.11
	イギリス	159,091,775	0.07
	香港	155,183,000	0.07
	シンガポール	118,642,732	0.05
	カナダ	66,271,079	0.03
	小計	6,176,714,616	2.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,084,743,906	2.18
合計(純資産総額)		233,178,774,348	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,679,897,993	1.57
	買建	ドイツ	838,824,040	0.35
	買建	イギリス	293,678,490	0.12
	買建	オーストラリア	216,533,284	0.09
合計	買建	-	5,028,933,807	2.13

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		102,797,800	0.04
	売建		114,312,200	0.04

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2019年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	ケイマン諸島	820,266,206	9.66
	韓国	543,128,042	6.40
	台湾	537,808,340	6.34
	インド	427,147,342	5.03
	中国	380,497,503	4.48
	ブラジル	322,137,480	3.80
	南アフリカ	200,472,954	2.36
	香港	175,673,156	2.07
	タイ	126,681,842	1.49
	メキシコ	104,609,452	1.23
	インドネシア	88,277,958	1.04
	マレーシア	86,172,100	1.02
	フィリピン	46,229,558	0.54
	ポーランド	42,615,884	0.50
	パミュダ	35,784,146	0.42
チリ	32,393,871	0.38	

	トルコ	23,201,408	0.27
	コロンビア	16,175,962	0.19
	アメリカ	15,383,052	0.18
	ギリシャ	13,607,620	0.16
	ハンガリー	13,597,658	0.16
	エジプト	6,492,378	0.08
	チェコ	6,265,497	0.07
	ルクセンブルグ	5,353,417	0.06
	アルゼンチン	3,842,779	0.05
	マン島	2,770,381	0.03
	ペルー	2,563,424	0.03
	シンガポール	1,346,800	0.02
	ベルギー	748,348	0.01
	小計	4,081,244,558	48.09
投資信託受益証券	アメリカ	256,110,317	3.02
	香港	185,495,635	2.19
	小計	441,605,952	5.20
投資証券	アメリカ	112,789,031	1.33
	ブラジル	8,392,072	0.10
	南アフリカ	7,482,080	0.09
	メキシコ	3,884,139	0.05
	小計	132,547,322	1.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,831,800,982	45.15
合計(純資産総額)		8,487,198,814	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,838,539,777	45.22
合計	買建	-	3,838,539,777	45.22

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
----	-----------	------	---------	-----------------

為替予約取引	買建		4,129,445,511	48.65
	売建		1,071,400,041	12.62

Jリート・インデックス・マザーファンド

2019年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	8,189,938,400	98.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		95,911,498	1.16
合計(純資産総額)		8,285,849,898	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 (%)
REIT指数先物取引	買建	日本	66,585,000	0.80
合計	買建	-	66,585,000	0.80

外国リート・インデックス・マザーファンド

2019年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	4,977,732,232	73.15
	オーストラリア	440,447,405	6.47
	イギリス	355,341,862	5.22
	シンガポール	264,949,906	3.89
	フランス	235,279,858	3.46
	カナダ	129,476,019	1.90
	香港	126,461,020	1.86
	ベルギー	70,521,478	1.04
	スペイン	41,479,694	0.61
	ニュージーランド	27,097,244	0.40
	オランダ	20,523,200	0.30
	ドイツ	16,421,436	0.24
	アイルランド	6,517,117	0.10
	イスラエル	5,594,400	0.08

	イタリア	2,621,993	0.04
	ガンジー	1,908,160	0.03
	マン島	1,445,263	0.02
	小計	6,723,818,287	98.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		80,908,026	1.19
合計(純資産総額)		6,804,726,313	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		17,320,537	0.25

国内債券パッシブ・マザーファンド

2019年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	103,535,208,000	76.54
地方債証券	日本	8,581,190,845	6.34
特殊債券	日本	15,442,481,099	11.42
社債券	日本	6,444,597,000	4.76
	フランス	200,654,000	0.15
	オーストラリア	200,236,000	0.15
	小計	6,845,487,000	5.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		859,222,778	0.64
合計(純資産総額)		135,263,589,722	100.00

外国債券パッシブ・マザーファンド

2019年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	81,701,653,841	47.92
	フランス	16,855,944,123	9.89
	イタリア	15,016,194,205	8.81
	イギリス	10,688,230,556	6.27
	ドイツ	9,230,332,668	5.41
	スペイン	9,197,400,446	5.39
	ベルギー	4,207,601,801	2.47
	オーストラリア	3,365,764,481	1.97

	カナダ	3,168,117,586	1.86
	オランダ	3,102,828,934	1.82
	オーストリア	2,430,471,433	1.43
	メキシコ	1,394,401,102	0.82
	アイルランド	1,236,548,551	0.73
	フィンランド	1,224,350,148	0.72
	ポーランド	953,351,573	0.56
	南アフリカ	945,407,465	0.55
	デンマーク	876,029,327	0.51
	マレーシア	768,387,210	0.45
	シンガポール	687,137,446	0.40
	スウェーデン	571,047,834	0.33
	ノルウェー	386,084,855	0.23
	小計	168,007,285,585	98.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,491,252,789	1.46
合計(純資産総額)		170,498,538,374	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2019年11月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	9,834,884,251	48.52
	フランス	1,979,178,010	9.76
	イタリア	1,902,261,123	9.39
	イギリス	1,285,015,651	6.34
	スペイン	1,200,036,925	5.92
	ドイツ	989,903,860	4.88
	ベルギー	418,771,989	2.07
	オーストラリア	401,036,605	1.98
	カナダ	379,488,987	1.87
	オランダ	370,313,257	1.83
	オーストリア	327,575,742	1.62
	シンガポール	179,550,478	0.89
	アイルランド	176,579,937	0.87
	メキシコ	168,298,276	0.83
	フィンランド	151,654,828	0.75
	南アフリカ	118,298,231	0.58
	ポーランド	117,902,530	0.58
	デンマーク	106,899,690	0.53
	スウェーデン	70,485,245	0.35
ノルウェー	48,225,540	0.24	

	小計	20,226,361,155	99.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		42,384,032	0.21
合計(純資産総額)		20,268,745,187	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		20,466,679,000	100.97

2【設定及び解約の実績】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第4期	913,665,451	10,547,332,018
第5期（中間期）	142,009,588	5,165,149,114

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第4期	758,923,595	6,895,231,238
第5期（中間期）	217,181,256	2,857,950,005

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第4期	1,008,692,045	5,095,880,106
第5期（中間期）	159,423,170	3,394,931,824

（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5期中間計算期間(平成31年4月27日から令和1年10月26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。

【アセットアロケーション・ファンド(安定型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 (平成31年 4月26日現在)	第5期中間計算期間 (令和 1年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	2,704,937	6,501,225
金銭信託	423,210,355	-
コール・ローン	136,721,241	451,176,341
投資信託受益証券	2,822,292,951	1,471,782,392
親投資信託受益証券	18,406,344,760	15,429,587,985
派生商品評価勘定	-	126,730
未収入金	418,987,598	46,000,000
流動資産合計	22,210,261,842	17,405,174,673
資産合計		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,550,708	22,105,192
未払解約金	336,856,092	102,108,328
未払受託者報酬	3,725,103	3,168,238
未払委託者報酬	111,752,796	95,047,180
未払利息	400	1,704
その他未払費用	770,041	635,783
流動負債合計	456,655,140	223,066,425
負債合計		
純資産の部		
元本等		
元本	21,690,164,448	16,667,024,922
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	63,442,254	515,083,326
元本等合計	21,753,606,702	17,182,108,248
純資産合計		
純資産合計	21,753,606,702	17,182,108,248
負債純資産合計		
負債純資産合計	22,210,261,842	17,405,174,673

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期中間計算期間 自 平成30年 4月27日 至 平成30年10月26日	第5期中間計算期間 自 平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26日
営業収益		
受取配当金	98,619,401	57,868,636
受取利息	7,505	32,581
有価証券売買等損益	253,594,950	588,899,454
為替差損益	45,178,714	39,646,045
その他収益	-	624,048
営業収益合計	200,146,758	607,778,674
営業費用		
支払利息	170,869	141,362
受託者報酬	4,437,729	3,168,238
委託者報酬	133,131,574	95,047,180
その他費用	1,378,596	961,176
営業費用合計	139,118,768	99,317,956
営業利益又は営業損失（ ）	339,265,526	508,460,718
経常利益又は経常損失（ ）	339,265,526	508,460,718
中間純利益又は中間純損失（ ）	339,265,526	508,460,718
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（ ）	106,619	43,569,401
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	579,777,793	63,442,254
剰余金増加額又は欠損金減少額	122,880,185	1,945,318
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	122,880,185	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,945,318
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,187,259	15,195,563
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	15,195,563
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,187,259	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	800,243,774	515,083,326

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第5期中間計算期間	
	自 平成31年 4月27日	至 令和 1年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>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。</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	<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>	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第4期		第5期中間計算期間	
	(平成31年 4月26日現在)		(令和 1年10月26日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	21,690,164,448口		16,667,024,922口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0029円	1口当たり純資産額	1.0309円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,029円)	(10,000口当たりの純資産額)	10,309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5期中間計算期間 (令和 1年10月26日現在)	
	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資信託受益証券、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）

第4期（平成31年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	92,901,265	-	92,619,700	281,565
	米ドル	92,901,265	-	92,619,700	281,565
	売建	2,388,885,687	-	2,392,154,830	3,269,143
	米ドル	2,388,885,687	-	2,392,154,830	3,269,143
	合計	2,481,786,952	-	2,484,774,530	3,550,708

第5期中間計算期間（令和 1年10月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	40,804,160	-	40,930,890	126,730
	米ドル	40,804,160	-	40,930,890	126,730

売建	1,348,048,208	-	1,370,153,400	22,105,192
米ドル	1,348,048,208	-	1,370,153,400	22,105,192
合計	1,388,852,368	-	1,411,084,290	21,978,462

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第4期 (平成31年 4月26日現在)	第5期中間計算期間 (令和 1年10月26日現在)
期首元本額	31,323,831,015円	21,690,164,448円
期中追加設定元本額	913,665,451円	142,009,588円
期中一部解約元本額	10,547,332,018円	5,165,149,114円

【アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 （平成31年 4月26日現在）	第5期中間計算期間 （令和 1年10月26日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	13,451,932	6,808,219
金銭信託	312,346,695	1,600,001
コール・ローン	100,905,914	318,785,584
投資信託受益証券	2,801,819,742	1,626,395,213
親投資信託受益証券	11,069,855,417	10,027,099,615
派生商品評価勘定	-	118,418
未収入金	198,000,000	125,025,002
流動資産合計	14,496,379,700	12,105,832,052
資産合計		
	14,496,379,700	12,105,832,052
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,483,743	23,549,206
未払解約金	216,361,818	184,817,559
未払受託者報酬	2,455,249	2,096,308
未払委託者報酬	73,657,518	62,889,232
未払利息	295	1,204
その他未払費用	506,579	420,567
流動負債合計	296,465,202	273,774,076
負債合計		
	296,465,202	273,774,076
純資産の部		
元本等		
元本	13,848,253,794	11,207,485,045
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	351,660,704	624,572,931
元本等合計	14,199,914,498	11,832,057,976
純資産合計		
	14,199,914,498	11,832,057,976
負債純資産合計		
	14,496,379,700	12,105,832,052

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第4期中間計算期間 自 平成30年 4月27日 至 平成30年10月26日	第5期中間計算期間 自 平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26日
営業収益		
受取配当金	103,102,544	56,389,992
受取利息	7,777	31,308
有価証券売買等損益	330,591,192	392,418,216
為替差損益	48,028,974	40,078,955
営業収益合計	275,509,845	408,760,561
営業費用		
支払利息	117,981	95,349
受託者報酬	2,911,126	2,096,308
委託者報酬	87,333,816	62,889,232
その他費用	1,071,076	720,286
営業費用合計	91,433,999	65,801,175
営業利益又は営業損失（ ）	366,943,844	342,959,386
経常利益又は経常損失（ ）	366,943,844	342,959,386
中間純利益又は中間純損失（ ）	366,943,844	342,959,386
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（ ）	252,133	3,148,486
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	40,066,728	351,660,704
剰余金増加額又は欠損金減少額	957,023	5,523,785
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	957,023	5,523,785
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,894,414	72,422,458
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,894,414	72,422,458
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	334,066,640	624,572,931

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第5期中間計算期間	
	自 平成31年 4月27日	至 令和 1年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第4期		第5期中間計算期間	
	(平成31年 4月26日現在)		(令和 1年10月26日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	13,848,253,794口		11,207,485,045口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0254円	1口当たり純資産額	1.0557円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,254円)	(10,000口当たりの純資産額)	10,557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5期中間計算期間 (令和 1年10月26日現在)	
	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資信託受益証券、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）

第4期（平成31年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	91,529,685	-	91,280,620	249,065
	米ドル	91,529,685	-	91,280,620	249,065
	売建	2,363,700,812	-	2,366,935,490	3,234,678
	米ドル	2,363,700,812	-	2,366,935,490	3,234,678
	合計	2,455,230,497	-	2,458,216,110	3,483,743

第5期中間計算期間（令和 1年10月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	40,921,042	-	41,039,460	118,418
	米ドル	40,921,042	-	41,039,460	118,418

売建	1,451,219,368	-	1,474,768,574	23,549,206
米ドル	1,451,219,368	-	1,474,768,574	23,549,206
合計	1,492,140,410	-	1,515,808,034	23,430,788

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第4期 (平成31年 4月26日現在)	第5期中間計算期間 (令和 1年10月26日現在)
期首元本額	19,984,561,437円	13,848,253,794円
期中追加設定元本額	758,923,595円	217,181,256円
期中一部解約元本額	6,895,231,238円	2,857,950,005円

【アセットアロケーション・ファンド（成長型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 （平成31年 4月26日現在）	第5期中間計算期間 （令和 1年10月26日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	11,417,331	7,093,772
金銭信託	245,418,042	-
コール・ローン	79,284,117	205,089,428
投資信託受益証券	2,370,281,005	1,389,720,625
親投資信託受益証券	8,281,795,201	6,320,819,218
派生商品評価勘定	-	669,818
未収入金	155,000,000	60,063,842
流動資産合計	11,143,195,696	7,983,456,703
資産合計		
11,143,195,696		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,698,602	22,378,171
未払解約金	174,274,464	154,477,720
未払受託者報酬	1,848,267	1,577,892
未払委託者報酬	55,447,896	47,336,890
未払利息	232	774
その他未払費用	381,447	316,773
流動負債合計	234,650,908	226,088,220
負債合計		
234,650,908		
純資産の部		
元本等		
元本	10,527,852,026	7,292,343,372
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	380,692,762	465,025,111
元本等合計	10,908,544,788	7,757,368,483
純資産合計		
10,908,544,788		
負債純資産合計		
11,143,195,696		

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期中間計算期間 自 平成30年 4月27日 至 平成30年10月26日	第5期中間計算期間 自 平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26日
営業収益		
受取配当金	94,693,088	48,932,827
受取利息	6,898	27,011
有価証券売買等損益	305,299,284	250,302,496
為替差損益	44,459,800	52,410,568
営業収益合計	255,059,098	246,851,766
営業費用		
支払利息	89,081	74,615
受託者報酬	2,137,250	1,577,892
委託者報酬	64,117,366	47,336,890
その他費用	879,280	567,229
営業費用合計	67,222,977	49,556,626
営業利益又は営業損失()	322,282,075	197,295,140
経常利益又は経常損失()	322,282,075	197,295,140
中間純利益又は中間純損失()	322,282,075	197,295,140
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	2,552,165	4,207,287
期首剰余金又は期首欠損金()	161,695,371	380,692,762
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,876,318	5,394,606
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	6,876,318	5,394,606
剰余金減少額又は欠損金増加額	34,943,581	122,564,684
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	34,943,581	122,564,684
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	186,101,802	465,025,111

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第5期中間計算期間	
	自 平成31年 4月27日	至 令和 1年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>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。</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	<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>	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第4期		第5期中間計算期間	
	(平成31年 4月26日現在)		(令和 1年10月26日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	10,527,852,026口		7,292,343,372口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0362円	1口当たり純資産額	1.0638円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,362円)	(10,000口当たりの純資産額)	10,638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5期中間計算期間 (令和 1年10月26日現在)	
	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資信託受益証券、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）

第4期（平成31年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	86,708,369	-	86,482,250	226,119
	米ドル	86,708,369	-	86,482,250	226,119
	売建	1,806,736,187	-	1,809,208,670	2,472,483
	米ドル	1,806,736,187	-	1,809,208,670	2,472,483
	合計	1,893,444,556	-	1,895,690,920	2,698,602

第5期中間計算期間（令和 1年10月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	189,761,962	-	190,431,780	669,818
	米ドル	189,761,962	-	190,431,780	669,818

売建	1,377,013,597	-	1,399,391,768	22,378,171
米ドル	1,377,013,597	-	1,399,391,768	22,378,171
合計	1,566,775,559	-	1,589,823,548	21,708,353

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第4期 (平成31年 4月26日現在)	第5期中間計算期間 (令和 1年10月26日現在)
期首元本額	14,615,040,087円	10,527,852,026円
期中追加設定元本額	1,008,692,045円	159,423,170円
期中一部解約元本額	5,095,880,106円	3,394,931,824円

(参考)

「アセットアロケーション・ファンド(安定型)」「アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)」および「アセットアロケーション・ファンド(成長型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「リート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF」、「iシェアーズ」J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF」および「SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF」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」および「投資信託受益証券」はこれらの親投資信託および投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

貸借対照表

(単位:円)

	(平成31年 4月26日現在)	(令和 1年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,409,744,393	-

	（平成31年 4月26日現在）	（令和 1年10月26日現在）
コール・ローン	455,428,374	1,207,506,492
株式	172,267,269,170	167,728,630,910
派生商品評価勘定	17,550,320	53,241,420
未収入金	263,476,160	8,709,840
未収配当金	1,934,662,457	1,611,312,783
流動資産合計	176,348,130,874	170,609,401,445
資産合計	176,348,130,874	170,609,401,445
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	714,840	-
前受金	17,045,000	53,375,000
未払金	442,124,980	8,985,000
未払解約金	412,800,909	445,091,005
未払利息	1,335	2,282
その他未払費用	110,085	16,240
流動負債合計	872,797,149	507,469,527
負債合計	872,797,149	507,469,527
純資産の部		
元本等		
元本	68,808,381,443	64,685,704,148
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	106,666,952,282	105,416,227,770
元本等合計	175,475,333,725	170,101,931,918
純資産合計	175,475,333,725	170,101,931,918
負債純資産合計	176,348,130,874	170,609,401,445

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</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	（平成31年 4月26日現在）	（令和 1年10月26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 2,762,000,000円	株式 2,992,800,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	68,808,381,443口	64,685,704,148口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.5502円 (10,000口当たりの純資産額 25,502円)	1口当たり純資産額 2.6297円 (10,000口当たりの純資産額 26,297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	（令和 1年10月26日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「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）

（平成31年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,116,264,520	-	3,133,100,000	16,835,480
	東証株価指数先物	3,116,264,520	-	3,133,100,000	16,835,480

合計	3,116,264,520	-	3,133,100,000	16,835,480
----	---------------	---	---------------	------------

(令和 1年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,970,108,580	-	2,023,350,000	53,241,420
	東証株価指数先物	1,970,108,580	-	2,023,350,000	53,241,420
合計		1,970,108,580	-	2,023,350,000	53,241,420

(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)

(平成31年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	67,579,087,442円
同期中における追加設定元本額	14,060,784,008円
同期中における一部解約元本額	12,831,490,007円
平成31年 4月26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	10,172,824,380円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	830,155,477円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	3,969,466,510円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,853,749,898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)	120,162,198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)	6,965,080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)	23,612,948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)	60,915,863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)	92,315,517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)	58,012,897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)	140,545,819円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,825,003,426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	9,109,742,427円

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,115,979,600円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,063,599,557円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	1,001,707,943円
イオン・バランス戦略ファンド	72,532,788円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	9,361,956円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	20,652,117円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	23,010,329円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	80,832,051円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	47,010,703円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	77,649,500円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	8,358,236円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	5,361,347,730円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	26,386,178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〉	225,151,325円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	3,414,383,364円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	2,479,883,434円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	9,233,009,781円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	59,588,186円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	223,472,980円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	796,449円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	942,907,444円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型〈適格機関投資家限定〉	57,187,516円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	382,097,522円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	1,109,499,058円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	964,779,994円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	3,101,038,753円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	1,573,523円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	880,282,695円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	65,177,660円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	41,425,659円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,045,609,939円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	107,829,530円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	48,426,618円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	22,746,684円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	208,991,050円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	391,095,028円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	162,209,912円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2〈適格機関投資家専用〉	119,503,474円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉	62,251,723円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2〈適格機関投資家専用〉	9,591,895円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2〈適格機関投資家専用〉	77,314,903円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2〈適格機関投資家専用〉	945,660,284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)	204,123,008円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2〈適格機関投資家専用〉	20,958,549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〉	1,618,468,794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〉	224,746,577円
SMAM・世界バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	1,575,906,619円
SMAM・世界バランスファンドVA2〈適格機関投資家限定〉	133,073,322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>	11,331,622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>	118,884,555円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	56,899,955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>	140,273,790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>	148,327,141円
合計	68,808,381,443円

(令和 1年10月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	68,808,381,443円
同期中における追加設定元本額	5,341,961,262円
同期中における一部解約元本額	9,464,638,557円
令和 1年10月26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	10,151,843,641円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	884,182,364円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,183,011,248円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,992,025,716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)	124,943,684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)	7,056,540円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	24,943,610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)	66,546,333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)	110,464,724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)	70,365,034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)	157,448,517円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,758,274,706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	11,140,385,871円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	618,603,170円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	634,445,526円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	517,153,532円
イオン・バランス戦略ファンド	48,100,552円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	10,912,963円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	50,879,134円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	45,339,698円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	125,124,624円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	71,923,495円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	95,618,033円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	12,600,123円
三井住友D S ・国内株式インデックス年金ファンド	407,382円
三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)	80,525円
三井住友D S ・年金バランス50(標準型)	141,272円
三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	202,283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)	4,012,700,692円

バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	22,019,252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>	218,475,561円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	3,210,831,471円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	2,378,640,210円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	8,713,571,444円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	58,224,066円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	218,959,028円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	794,882円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	908,494,350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>	56,544,959円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	378,569,673円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	1,106,018,298円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	888,237,600円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	2,905,203,061円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	1,158,682円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	61,193,764円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	88,043,237円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	45,801,688円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	22,678,789円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	190,920,859円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	362,575,492円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	42,874,320円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	115,646,200円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	60,142,141円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	9,363,931円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	74,004,445円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	919,193,597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)	195,800,627円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用>	20,874,254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>	1,242,973,034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>	195,532,883円
SMAM・世界バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	1,575,906,619円
SMAM・世界バランスファンドVA2 <適格機関投資家限定>	114,936,447円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド <適格機関投資家限定>	13,800,187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>	87,168,514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>	125,175,129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>	139,630,462円
合計	64,685,704,148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)

(平成31年 4月26日現在)

(令和 1年10月26日現在)

資産の部

（平成31年 4月26日現在）

（令和 1年10月26日現在）

流動資産		
預金	504,936,832	1,775,017,663
金銭信託	827,792,557	-
コール・ローン	267,424,520	2,367,253,844
株式	178,606,464,111	209,001,707,070
投資証券	4,394,088,058	5,949,725,528
派生商品評価勘定	27,245,209	63,841,995
未収入金	48,846,591	2,639,128
未収配当金	267,879,105	197,958,044
差入委託証拠金	1,096,617,753	1,474,767,863
流動資産合計	186,041,294,736	220,832,911,135
資産合計	186,041,294,736	220,832,911,135
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,286,862	2,146,888
前受金	22,998,847	62,306,938
未払金	11,682,025	171,343
未払解約金	992,052,101	260,483,369
未払利息	783	4,475
その他未払費用	23,083	4,507
流動負債合計	1,031,043,701	325,117,520
負債合計	1,031,043,701	325,117,520
純資産の部		
元本等		
元本	50,156,918,145	59,477,422,867
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	134,853,332,890	161,030,370,748
元本等合計	185,010,251,035	220,507,793,615
純資産合計	185,010,251,035	220,507,793,615
負債純資産合計	186,041,294,736	220,832,911,135

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資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	(1) 先物取引

法	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成31年 4月26日現在)	(令和 1年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	50,156,918,145口	59,477,422,867口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.6886円 (10,000口当たりの純資産額 36,886円)	1口当たり純資産額 3.7074円 (10,000口当たりの純資産額 37,074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	(令和 1年10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(株式、投資証券) 「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)

(平成31年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,847,197,992	-	1,870,196,839	22,998,847
	SPMINI 1906	1,326,815,033	-	1,341,957,285	15,142,252
	DJ EUR 1906	317,818,264	-	323,761,140	5,942,876
	FTSE 1906	116,233,325	-	117,084,589	851,264
	SPI200 1906	86,331,370	-	87,393,825	1,062,455
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	122,280,500	-	122,321,000	40,500
	米ドル	89,360,000	-	89,384,000	24,000
	カナダドル	4,142,000	-	4,144,000	2,000
	ユーロ	24,864,000	-	24,876,000	12,000
	オーストラリアドル	3,914,500	-	3,917,000	2,500
合計		1,969,478,492	-	1,992,517,839	22,958,347

(令和 1年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,486,773,742	-	5,549,080,680	62,306,938
	SPMINI 1912	3,962,792,791	-	4,001,789,673	38,996,882
	DJ EUR 1912	943,324,815	-	963,223,417	19,898,602
	FTSE 1912	334,926,305	-	336,769,910	1,843,605
	SPI200 1912	245,729,831	-	247,297,680	1,567,849
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	2,041,084,631	-	2,040,472,800	611,831
	米ドル	1,412,632,000	-	1,413,230,000	598,000
	カナダドル	73,107,760	-	73,172,000	64,240
	ユーロ	244,284,660	-	243,814,000	470,660
	英ポンド	115,036,160	-	114,554,000	482,160
	スイスフラン	66,876,740	-	66,801,100	75,640

スウェーデンクローナ	19,948,254	-	19,930,200	18,054
ノルウェークローネ	4,759,880	-	4,752,000	7,880
デンマーククローネ	13,114,467	-	13,089,600	24,867
オーストラリアドル	50,570,240	-	50,401,600	168,640
ニュージーランドドル	1,394,400	-	1,386,400	8,000
香港ドル	25,778,670	-	25,779,600	930
シンガポールドル	9,574,800	-	9,570,000	4,800
イスラエルシェケル	4,006,600	-	3,992,300	14,300
合計	7,527,858,373	-	7,589,553,480	61,695,107

(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)

(平成31年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	53,208,560,898円
同期中における追加設定元本額	12,569,281,751円

同期中における一部解約元本額	15,620,924,504円
平成31年 4月26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	14,530,943,449円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	281,447,230円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,173,444,908円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	786,537,850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)	73,260,890円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	1,988,128円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	7,899,545円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	21,142,487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)	39,734,004円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	28,557,819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)	72,267,318円
外国株式指数ファンド	515,978,365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	3,283,561,242円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	509,858,594円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	498,067,966円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	492,485,334円
イオン・バランス戦略ファンド	31,169,212円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	5,505,740円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	14,280,511円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	15,985,108円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	56,285,291円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	32,652,516円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	53,909,723円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	11,770,492円
S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,742,054,495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 >	8,619,538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 >	76,749,837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 >	1,554,318,707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 >	1,493,601,415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 >	6,319,455,272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 >	20,379,742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 >	103,737,458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 >	423,742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 >	758,296,083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 >	60,125,135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 >	175,645,387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 >	775,699,406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 >	658,649,408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 >	1,587,648,005円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,104,987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)	409,339,094円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	601,436,192円
S M A M ・ グローバルバランス40V A < 適格機関投資家限定 >	135,732,381円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	28,425,171円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	720,253,058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 >	23,722,444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 >	12,876,765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 >	6,622,031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 >	44,693,351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 >	111,349,288円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	111,277,275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 >	1,090,156,776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 >	152,693,007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 >	6,115,998,283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 >	278,956,079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 >	2,012,443,704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 >	7,865,987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 >	101,802,107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 5 < 適格機関投資家限定 >	48,744,796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 >	120,134,876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 >	147,153,141円
合計	50,156,918,145円

(令和 1年10月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	50,156,918,145円
同期中における追加設定元本額	17,597,791,759円
同期中における一部解約元本額	8,277,287,037円
令和 1年10月26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	23,988,644,918円
三井住友・D C 年金バランス3 0 (債券重点型)	319,900,475円
三井住友・D C 年金バランス5 0 (標準型)	1,268,733,114円
三井住友・D C 年金バランス7 0 (株式重点型)	842,664,043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)	78,667,934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)	2,230,162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)	8,805,522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)	24,250,262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)	49,818,720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)	35,858,348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)	84,498,995円
外国株式指数ファンド	518,821,440円
三井住友・D C つみたてN I S A ・ 全海外株インデックスファンド	4,463,218,648円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	383,641,247円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	390,701,353円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	317,907,624円
イオン・バランス戦略ファンド	14,934,063円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 5 0	6,567,880円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	36,272,187円

三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	32,400,907円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	88,434,058円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	50,673,683円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	67,363,743円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	17,994,520円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	280,003円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	28,871円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	42,581円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	56,291円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,510,998,304円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	7,733,190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>	73,969,974円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,504,940,221円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,460,709,925円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	6,139,461,309円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	20,735,530円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	103,934,006円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	419,448円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	734,759,494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>	60,167,094円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	171,173,908円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	767,803,553円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	628,702,300円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,544,314,843円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	807,485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)	300,344,466円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	130,007,149円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	20,478,960円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	12,859,940円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	6,751,404円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	44,823,065円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	109,633,207円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	30,346,977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>	883,202,518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>	138,400,774円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,822,528,466円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	264,988,176円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	3,563,705,816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>	9,674,740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>	54,990,620円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	79,129,569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>	181,514,844円
合計	59,477,422,867円

エマージング株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	（平成31年 4月26日現在）	（令和 1年10月26日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	40,395,507	118,722,976
金銭信託	819,944,438	-
コール・ローン	264,889,127	2,813,749,316
株式	2,983,396,437	3,509,469,851
投資信託受益証券	205,443,266	331,026,095
投資証券	16,033,917	115,849,295
派生商品評価勘定	212,613,737	36,022,464
現先取引勘定	3,000,720,000	-
未収入金	-	65,844
未収配当金	3,196,279	2,978,087
差入委託証拠金	907,222,865	551,831,033
流動資産合計	8,453,855,573	7,479,714,961
資産合計	8,453,855,573	7,479,714,961
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,805,238	6,097,793
前受金	160,746,345	12,897,651
未払金	844	-
未払解約金	335,678,000	32,753,785
未払利息	776	5,319
その他未払費用	132,913	18,669
流動負債合計	498,364,116	51,773,217
負債合計	498,364,116	51,773,217
純資産の部		
元本等		
元本	5,742,636,631	5,645,682,137
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,212,854,826	1,782,259,607
元本等合計	7,955,491,457	7,427,941,744
純資産合計	7,955,491,457	7,427,941,744
負債純資産合計	8,453,855,573	7,479,714,961

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26日

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の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) 金融商品取引所等の上場されていない有価証券 金融商品取引所等の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> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</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	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成31年 4月26日現在)	(令和 1年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,742,636,631口	5,645,682,137口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3853円 (10,000口当たりの純資産額 13,853円)	1口当たり純資産額 1.3157円 (10,000口当たりの純資産額 13,157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	(令和 1年10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成31年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,590,893,317	-	4,751,639,662	160,746,345
	MSCIE 1906	4,590,893,317	-	4,751,639,662	160,746,345
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,167,300,000	-	4,217,227,453	49,927,453
	米ドル	4,167,300,000	-	4,217,227,453	49,927,453
	売建	417,000,000	-	416,865,299	134,701
	米ドル	417,000,000	-	416,865,299	134,701
	合計	9,175,193,317	-	9,385,732,414	210,808,499

(令和 1年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,455,579,410	-	3,468,477,061	12,897,651
	MSCIE 1912	3,455,579,410	-	3,468,477,061	12,897,651
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,172,643,119	-	3,195,766,881	23,123,762
	米ドル	3,172,643,119	-	3,195,766,881	23,123,762

売建	391,943,119	-	398,039,861	6,096,742
米ドル	391,000,000	-	397,097,793	6,097,793
ブラジルレアル	943,119	-	942,068	1,051
合計	7,020,165,648	-	7,062,283,803	29,924,671

(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)

(平成31年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,878,626,011円
同期中における追加設定元本額	4,007,992,951円
同期中における一部解約元本額	1,143,982,331円
平成31年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	1,216,433,946円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,366,945,879円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,011,050,786円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	966,886,784円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	929,156,206円
イオン・バランス戦略ファンド	34,214,964円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	7,300,944円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	12,743,929円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	8,973,559円

三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	41,732,939円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	32,975,659円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	77,343,543円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	15,269,337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>	21,608,156円
合計	5,742,636,631円

(令和 1年10月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,742,636,631円
同期中における追加設定元本額	1,432,897,348円
同期中における一部解約元本額	1,529,851,842円
令和 1年10月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	1,763,182,929円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,620,648,743円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	674,203,087円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	697,077,084円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	568,411,151円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	9,298,102円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	22,736,795円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	16,960,112円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	68,356,382円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	52,663,766円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	100,870,851円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	25,459,435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>	25,813,700円
合計	5,645,682,137円

Jリート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	(平成31年 4月26日現在)	(令和 1年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	119,389,113	-
コール・ローン	38,569,538	80,797,333
投資証券	12,718,162,720	7,411,590,080
未収入金	156,274,541	-
未収配当金	111,852,741	55,345,187
流動資産合計	13,144,248,653	7,547,732,600
資産合計	13,144,248,653	7,547,732,600
負債の部		
流動負債		
未払金	14,383,851	-
未払解約金	200,090,000	30,000,000
未払利息	113	152

	（平成31年 4月26日現在）	（令和 1年10月26日現在）
その他未払費用	6,468	949
流動負債合計	214,480,432	30,001,101
負債合計	214,480,432	30,001,101
純資産の部		
元本等		
元本	5,748,282,368	2,774,543,656
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,181,485,853	4,743,187,843
元本等合計	12,929,768,221	7,517,731,499
純資産合計	12,929,768,221	7,517,731,499
負債純資産合計	13,144,248,653	7,547,732,600

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>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。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成31年 4月26日現在）	（令和 1年10月26日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,748,282,368口	2,774,543,656口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.2493円 (10,000口当たりの純資産額 22,493円)	1口当たり純資産額 2.7095円 (10,000口当たりの純資産額 27,095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	(令和 1年10月26日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(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)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成31年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,131,265,092円
同期中における追加設定元本額	4,291,910,342円
同期中における一部解約元本額	3,674,893,066円
平成31年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	924,366,881円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	870,273,854円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	832,359,678円
イオン・バランス戦略ファンド	119,998,945円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	634,337,452円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,309,201円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	7,582,448円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	5,477,505円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	17,206,371円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	10,219,373円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	11,827,257円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	4,636,404円

世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	449,196円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	983,874,679円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	578,315,919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>	78,756,375円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	23,779,298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>	241,284,470円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	115,538,605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>	284,688,457円
合計	5,748,282,368円

(令和1年10月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,748,282,368円
同期中における追加設定元本額	964,854,305円
同期中における一部解約元本額	3,938,593,017円
令和1年10月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	376,799,307円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	484,393,600円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	385,787,478円
イオン・バランス戦略ファンド	66,663,605円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,066,895,524円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,171,229円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	10,770,192円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	8,049,068円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	21,689,309円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	12,697,517円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	11,522,248円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	6,007,023円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	397,582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>	40,647,409円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	17,150,036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>	108,080,622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>	153,821,907円
合計	2,774,543,656円

外国リート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(平成31年 4月26日現在)

(令和 1年10月26日現在)

資産の部		
流動資産		
預金	24,025,748	39,745,277
金銭信託	85,127,412	-
コール・ローン	27,501,041	12,137,957
投資証券	5,377,489,103	6,583,541,063
派生商品評価勘定	-	2,991
未収入金	47,435	66,089
未収配当金	5,509,720	6,196,254
流動資産合計	5,519,700,459	6,641,689,631
資産合計	5,519,700,459	6,641,689,631
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	2,224
未払解約金	110,000,000	2,400,000
未払利息	80	22
その他未払費用	1,437	26
流動負債合計	110,001,517	2,402,272
負債合計	110,001,517	2,402,272
純資産の部		
元本等		
元本	2,475,122,234	2,845,386,218
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,934,576,708	3,793,901,141
元本等合計	5,409,698,942	6,639,287,359
純資産合計	5,409,698,942	6,639,287,359
負債純資産合計	5,519,700,459	6,641,689,631

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券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	為替予約取引

法	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	(平成31年 4月26日現在)	(令和 1年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,475,122,234口	2,845,386,218口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.1856円 (10,000口当たりの純資産額 21,856円)	1口当たり純資産額 2.3334円 (10,000口当たりの純資産額 23,334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	(令和 1年10月26日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(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)

(平成31年 4月26日現在)

該当事項はありません。

(令和 1年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	買建	7,500,000	-	7,501,089	1,089
	米ドル	6,500,000	-	6,502,991	2,991
	ユーロ	1,000,000	-	998,098	1,902
	売建	1,000,000	-	1,000,322	322
	米ドル	1,000,000	-	1,000,322	322
合計		8,500,000	-	8,501,411	767

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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)

(平成31年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,192,135,055円
同期中における追加設定元本額	2,055,570,269円
同期中における一部解約元本額	1,772,583,090円
平成31年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	78,329,005円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	78,891,404円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	80,027,060円
イオン・バランス戦略ファンド	21,338,148円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	1,487,090,193円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,374,240円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	12,100,758円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	7,627,470円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	22,566,359円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	12,381,573円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	15,162,584円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	14,839,613円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	459,604円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	585,081,246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>	43,080,884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>	14,772,093円
合計	2,475,122,234円

(令和1年10月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,475,122,234円
同期中における追加設定元本額	1,229,656,387円
同期中における一部解約元本額	859,392,403円
令和1年10月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	118,897,836円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	102,141,804円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	75,557,817円
イオン・バランス戦略ファンド	56,191,028円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	2,338,993,778円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,476,851円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	12,638,783円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	9,459,202円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	25,553,273円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	14,932,495円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	13,491,825円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	21,447,155円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	439,498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>	38,667,840円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	15,497,033円
合計	2,845,386,218円

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(平成31年4月26日現在)

(令和1年10月26日現在)

資産の部

流動資産

金銭信託

1,101,630,186

-

	（平成31年 4月26日現在）	（令和 1年10月26日現在）
コール・ローン	355,889,796	547,495,015
国債証券	126,505,019,860	104,921,542,250
地方債証券	13,311,528,945	10,005,120,860
特殊債券	21,583,378,483	15,900,018,360
社債券	8,387,830,000	6,972,118,000
未収入金	667,981,500	-
未収利息	374,711,697	308,257,964
前払費用	4,541,029	2,783,791
流動資産合計	172,292,511,496	138,657,336,240
資産合計	172,292,511,496	138,657,336,240
負債の部		
流動負債		
未払金	137,095,650	-
未払解約金	1,107,232,306	146,204,071
未払利息	1,043	1,034
その他未払費用	43,086	6,222
流動負債合計	1,244,372,085	146,211,327
負債合計	1,244,372,085	146,211,327
純資産の部		
元本等		
元本	133,381,240,777	106,752,017,614
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	37,666,898,634	31,759,107,299
元本等合計	171,048,139,411	138,511,124,913
純資産合計	171,048,139,411	138,511,124,913
負債純資産合計	172,292,511,496	138,657,336,240

注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26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	（平成31年 4月26日現在）	（令和 1年10月26日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	133,381,240,777口	106,752,017,614口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2824円 (10,000口当たりの純資産額 12,824円)	1口当たり純資産額 1.2975円 (10,000口当たりの純資産額 12,975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	（令和 1年10月26日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、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）

（平成31年 4月26日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	163,997,039,244円
同期中における追加設定元本額	19,222,300,106円
同期中における一部解約元本額	49,838,098,573円
平成31年 4月26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）	4,506,040,354円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	7,846,558,666円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,698,259,549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）	599,400,661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）	49,601,336円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	168,249,075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)	311,686,143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)	270,606,999円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	101,709,183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)	212,238,129円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	88,745,992円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,475,358,230円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	658,742,873円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	33,591,719円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	9,754,258円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	34,257,580円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	13,111,015円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	7,386,803円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	3,545,151円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	4,896,557円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	25,137,922円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,804,678,114円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	18,344,941,767円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,314,559,645円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	17,857,476,316円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	351,415,849円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	578,749,942円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,742,513円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	252,488,538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>	112,648,590円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,014,357,930円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,167,297,178円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,824,705,632円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	10,766,831,762円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	3,063,620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)	2,519,139,610円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	10,665,263,520円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	520,836,297円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	336,866,364円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	9,606,037,597円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	927,922,952円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	189,230,061円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	44,401,846円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,006,963,386円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,524,154,466円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,386,225,311円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,026,373,073円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	244,033,609円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	18,430,319円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	357,572,916円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	6,279,517,945円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	301,457,933円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	154,310,304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>	1,424,200,086円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-05 <適格機関投資家限定>	682,426,859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>	1,680,356,767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>	1,970,683,965円
合計	133,381,240,777円

(令和1年10月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	133,381,240,777円
同期中における追加設定元本額	9,280,196,562円
同期中における一部解約元本額	35,909,419,725円
令和1年10月26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)	4,833,215,372円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	8,317,591,269円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,790,833,112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)	588,614,103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)	49,625,870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)	175,648,734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)	333,869,909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)	318,447,539円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	122,705,548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)	235,043,209円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	96,296,912円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,467,582,206円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,009,576,901円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	358,169,172円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	11,455,084円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	738,113,977円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	255,663,426円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	318,771,922円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	63,743,494円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	5,898,404円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	37,527,989円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	424,416円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	271,637円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	118,060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>	5,793,124,662円
S M A M ・ バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	16,954,689,478円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,961,709,375円
S M A M ・ バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	17,114,206,301円
S M A M ・ バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	348,446,332円
S M A M ・ バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	580,787,734円

世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,803,761円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	252,577,830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>	113,342,508円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,939,775,338円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,118,069,751円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,617,379,785円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	10,001,906,295円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,241,258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)	1,450,205,509円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	482,254,878円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	768,939,649円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	184,290,025円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,533,373円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,842,914,950円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,380,524,292円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	629,050,272円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	996,703,303円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	236,676,654円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	18,384,179円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	342,228,935円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	5,967,320,873円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	290,439,860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>	153,215,984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>	699,339,354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>	1,001,925,029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>	2,333,801,822円
合計	106,752,017,614円

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

	(平成31年 4月26日現在)	(令和 1年10月26日現在)
(単位:円)		
資産の部		
流動資産		
預金	312,110,255	212,415,123
金銭信託	1,047,385,769	-
コール・ローン	338,365,735	627,124,976
国債証券	160,094,281,169	167,463,161,822
未収入金	50,372,692	-
未収利息	1,301,526,987	1,257,256,235
前払費用	45,707,890	104,113,813
流動資産合計	163,189,750,497	169,664,071,969
資産合計	163,189,750,497	169,664,071,969
負債の部		
流動負債		
未払解約金	420,072,631	137,810,440
未払利息	991	1,185

	(平成31年 4月26日現在)	(令和 1年10月26日現在)
その他未払費用	18,100	53,631
流動負債合計	420,091,722	137,865,256
負債合計	420,091,722	137,865,256
純資産の部		
元本等		
元本	92,111,667,202	93,216,067,995
剰余金		
剰余金又は欠損金()	70,657,991,573	76,310,138,718
元本等合計	162,769,658,775	169,526,206,713
純資産合計	162,769,658,775	169,526,206,713
負債純資産合計	163,189,750,497	169,664,071,969

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基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	(平成31年 4月26日現在)	(令和 1年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	92,111,667,202口	93,216,067,995口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7671円 (10,000口当たりの純資産額 17,671円)	1口当たり純資産額 1.8186円 (10,000口当たりの純資産額 18,186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	(令和 1年10月26日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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)

(平成31年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	104,217,368,782円
同期中における追加設定元本額	8,079,804,274円
同期中における一部解約元本額	20,185,505,854円
平成31年 4月26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	11,016,273,018円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	591,416,375円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,606,544,104円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	811,289,304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)	91,821,119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)	8,821,430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)	29,870,669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)	83,335,203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)	103,813,269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)	54,778,231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)	127,497,633円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	17,013,381円

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	278,321,489円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	284,675,131円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	277,435,529円
イオン・バランス戦略ファンド	51,896,581円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,457,849円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	55,042,841円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	37,931,733円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	77,885,818円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	28,430,283円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	14,131,556円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	24,104,917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>	1,736,006,800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>	73,408,505円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	11,541,133,932円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,789,213,731円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	13,034,779,889円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	42,432,859円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	105,186,441円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	558,437円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	762,181,383円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	122,817,278円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,275,375,766円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,583,991,812円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,038,275,666円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,652,838,286円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,272,452円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	11,134,953,111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)	535,979,423円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,245,644,030円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	186,677,195円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	242,900,447円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,494,332,748円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	152,344,874円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	40,322,301円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,729,397円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	142,814,622円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	551,798,563円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	171,602,935円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	166,401,726円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	51,978,475円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,651,025円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,348,834,490円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	22,153,877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>	3,670,504,123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>	1,616,384,536円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	6,185,538,375円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	693,320,307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>	44,399,157円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	40,044,700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>	410,598,751円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	196,656,702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>	484,437,893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>	824,402,719円
合計	92,111,667,202円

(令和 1年10月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	92,111,667,202円
同期中における追加設定元本額	12,982,013,528円
同期中における一部解約元本額	11,877,612,735円
令和 1年10月26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	21,204,959,150円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	632,548,159円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,712,421,647円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	851,144,225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)	132,803,507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)	8,916,951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)	31,677,757円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	89,319,612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)	125,268,897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)	66,971,744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)	144,721,418円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	18,628,534円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	156,861,617円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	178,311,517円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	150,330,174円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	5,209,152円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	39,931,906円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	44,263,680円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	80,891,330円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	34,068,738円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	17,114,631円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	35,844,100円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	563,635円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	56,364円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	56,364円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	56,364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>	1,706,287,208円
S M A M ・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	68,956,145円

SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	10,682,506,621円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,466,114,893円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	12,406,346,106円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	41,825,379円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	103,984,328円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	558,555円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	729,537,782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>	121,435,728円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,233,947,890円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,538,130,778円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,892,409,294円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,206,625,776円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,620,816円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	10,375,720,969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)	391,748,050円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	173,237,061円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	125,800,586円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	39,116,492円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,553,191円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	135,439,180円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	518,229,838円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	45,735,104円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	165,047,138円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	51,439,144円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,536,577円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,305,295,597円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	21,829,928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>	2,837,600,298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>	1,428,550,422円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	5,798,596,392円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	628,558,255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>	14,860,487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>	42,055,806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>	214,675,367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>	308,384,760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>	611,828,881円
合計	93,216,067,995円

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(平成31年 4月26日現在)

(令和 1年10月26日現在)

資産の部

流動資産

	(平成31年 4月26日現在)	(令和 1年10月26日現在)
預金	50,359,494	162,581,112
金銭信託	415,258,078	-
コール・ローン	134,152,199	81,023,065
国債証券	29,078,480,015	25,338,616,990
派生商品評価勘定	41,355,593	-
未収入金	-	5,700,854
未収利息	230,974,541	196,281,031
前払費用	16,985,596	13,744,225
流動資産合計	29,967,565,516	25,797,947,277
資産合計	29,967,565,516	25,797,947,277
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	127,368,030	440,398,662
未払金	7,120,428	-
未払解約金	373,800,000	67,000,000
未払利息	393	153
その他未払費用	10,280	2,212
流動負債合計	508,299,131	507,401,027
負債合計	508,299,131	507,401,027
純資産の部		
元本等		
元本	20,968,888,985	17,157,118,552
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,490,377,400	8,133,427,698
元本等合計	29,459,266,385	25,290,546,250
純資産合計	29,459,266,385	25,290,546,250
負債純資産合計	29,967,565,516	25,797,947,277

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成31年 4月27日 至 令和 1年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本と	外貨建資産等の会計処理

なる重要な事項	「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	(平成31年 4月26日現在)	(令和 1年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	20,968,888,985口	17,157,118,552口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4049円 (10,000口当たりの純資産額 14,049円)	1口当たり純資産額 1.4741円 (10,000口当たりの純資産額 14,741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	(令和 1年10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成31年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	29,418,097,563	-	29,504,110,000	86,012,437
	米ドル	13,705,195,380	-	13,824,746,000	119,550,620
	カナダドル	564,236,800	-	563,312,000	924,800
	メキシコペソ	245,669,510	-	252,439,000	6,769,490
	ユーロ	11,360,099,278	-	11,331,018,000	29,081,278

英ポンド	1,977,945,825	-	1,973,759,000	4,186,825
スウェーデンク ローナ	106,512,530	-	104,219,000	2,293,530
ノルウェークロー ネ	73,408,590	-	73,302,000	106,590
デンマーククロー ネ	152,034,610	-	151,606,000	428,610
ポーランドズロチ	190,955,820	-	191,004,000	48,180
オーストラリアドル	622,982,500	-	618,649,000	4,333,500
シンガポールドル	253,660,600	-	253,952,000	291,400
南アフリカランド	165,396,120	-	166,104,000	707,880
合計	29,418,097,563	-	29,504,110,000	86,012,437

(令和 1年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	25,374,177,838	-	25,814,576,500	440,398,662
	米ドル	12,243,797,256	-	12,322,997,500	79,200,244
	カナダドル	464,603,409	-	473,556,000	8,952,591
	メキシコペソ	205,760,995	-	214,514,000	8,753,005
	ユーロ	9,595,952,021	-	9,825,791,000	229,838,979
	英ポンド	1,579,214,728	-	1,661,716,000	82,501,272
	スウェーデンク ローナ	86,806,780	-	88,954,000	2,147,220
	ノルウェークロー ネ	59,243,500	-	59,350,000	106,500
	デンマーククロー ネ	134,237,950	-	137,360,000	3,122,050
	ポーランドズロチ	145,379,664	-	152,172,000	6,792,336
	オーストラリアドル	502,466,970	-	511,152,000	8,685,030
	シンガポールドル	218,498,000	-	223,104,000	4,606,000
	南アフリカランド	138,216,565	-	143,910,000	5,693,435
合計	25,374,177,838	-	25,814,576,500	440,398,662	

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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)

(平成31年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	37,484,650,129円
同期中における追加設定元本額	4,051,374,366円
同期中における一部解約元本額	20,567,135,510円
平成31年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	4,528,795,593円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,212,263,331円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	30,628,517円
イオン・バランス戦略ファンド	484,931,670円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	405,127,343円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	119,950,191円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	175,969,660円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	36,277,400円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	8,715,362円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	7,505,272円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,306,637,177円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,816,640円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,862,382,122円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	3,845,668,421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>	80,321,679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>	699,835,651円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	335,294,032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>	825,768,924円
合計	20,968,888,985円

（令和 1年10月26日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	20,968,888,985円
同期中における追加設定元本額	5,495,078,177円
同期中における一部解約元本額	9,306,848,610円
令和 1年10月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	4,550,679,255円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,904,933,318円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	729,040,475円
イオン・バランス戦略ファンド	649,348,987円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	49,064,685円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	4,912,620円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	9,181,032円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	4,571,549円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	5,087,212円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	10,628,391円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,245,923,775円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,957,251円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	3,026,026,511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>	77,518,149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>	364,711,921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>	523,533,421円
合計	17,157,118,552円

バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETFは、米国籍の上場外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF

（純資産計算書）

区分	2018年10月31日現在
	金額（千米ドル）
債券	1,301,701
短期金融資産	8,279
投資総額	1,309,980
その他資産及び負債	8,401
純資産額	1,318,381

（1口当たり情報）

（2018年10月31日現在）	
1口当たり純資産額	
（一般投資家クラス） 74.27米ドル	

i シェアーズ J . P . モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 E T F は、米国籍の上場外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

i シェアーズ J . P . モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 E T F

(純資産計算書)

区分	2018年10月31日現在
	金額(千米ドル)
債券	14,469,132
短期金融資産	62,171
投資総額	14,531,303
その他資産及び負債	213,427
純資産額	14,744,730

(1口当たり情報)

(2018年10月31日現在)
1口当たり純資産額 (一般投資家クラス) 104.57米ドル

S P D R ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券 E T F は、米国籍の上場外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

S P D R ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券 E T F

(純資産計算書)

区分	2019年6月30日現在
	金額(千米ドル)
債券	9,263,633
短期金融資産等	629,461
投資総額	9,893,094
その他資産及び負債	490,855
純資産額	9,402,239

(1口当たり情報)

(2019年6月30日)
1口当たり純資産額 (一般投資家クラス) 108.73米ドル

(注) 1口当たり純資産は前年度35.60米ドル。2019年5月6日実施の3株を1株とする株式併合を反映。

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

	2019年11月29日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

最近5年間における資本金の額の増減
該当ありません。

(2)【事業の内容及び営業の状況】

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

2019年11月29日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	762	8,210,104
単位型株式投資信託	118	645,445
追加型公社債投資信託	1	29,929
単位型公社債投資信託	187	517,762
合計	1,068	9,403,241

(3)【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

- a. 2018年11月1日付で、発行可能株式総数を変更する定款の変更を行いました。
- b. 2019年4月1日付で、取締役の員数の上限を変更する等の定款の変更を行いました。

(ロ) その他の重要事項

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D S アセットマネジメント株式会社に変更しました。

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。

2 当社は、第34期(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35期中間会計期間(平成31年4月1日から令和1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 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,873,870	13,755,961
顧客分別金信託	20,010	20,011
前払費用	402,249	476,456
未収入金	39,030	64,856
未収委託者報酬	6,332,203	6,963,077
未収運用受託報酬	1,725,215	1,129,548
未収投資助言報酬	316,407	285,668
未収収益	50,321	44,150
その他の流動資産	10,891	31,771
流動資産合計	29,770,200	22,771,504
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	185,371	173,517
器具備品	300,694	751,471
有形固定資産合計	486,065	924,988
無形固定資産		
ソフトウェア	409,765	479,867
ソフトウェア仮勘定	5,755	183,528
電話加入権	56	44
商標権	-	60
無形固定資産合計	415,576	663,501
投資その他の資産		
投資有価証券	10,616,594	10,829,628
関係会社株式	10,412,523	10,252,067
長期差入保証金	658,505	2,004,451
長期前払費用	69,423	97,107
会員権	7,819	7,819

繰延税金資産	1,394,447	1,426,381
投資その他の資産合計	23,159,314	24,617,457
固定資産合計	24,060,956	26,205,946
資産合計	53,831,157	48,977,450

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	84	4,534
その他の預り金	92,326	1,480,229
未払金		
未払収益分配金	649	1,122
未払償還金	137,522	137,522
未払手数料	2,783,763	3,246,133
その他未払金	236,739	768,373
未払費用	3,433,641	3,535,589
未払消費税等	547,706	84,966
未払法人税等	1,785,341	670,761
賞与引当金	1,507,256	1,302,052
その他の流動負債	1,408	18,110
流動負債合計	10,526,438	11,249,395
固定負債		
退職給付引当金	3,319,830	3,418,601
賞与引当金	99,721	5,074
その他の固定負債	3,363	5,074
固定負債合計	3,422,915	3,428,751
負債合計	13,949,354	14,678,146
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	26,561,078	21,255,054
利益剰余金合計	28,382,283	23,076,258
株主資本計	39,011,267	33,705,242
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	870,535	594,061
評価・換算差額等合計	870,535	594,061
純資産合計	39,881,802	34,299,304
負債・純資産合計	53,831,157	48,977,450

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	平成29年4月1日	(自	平成30年4月1日
	至	平成30年3月31日)	至	平成31年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		36,538,981		39,156,499
運用受託報酬		8,362,118		6,277,217
投資助言報酬		1,440,233		1,332,888
その他営業収益				
情報提供コンサルタント				
業務報酬		5,000		-
サービス支援手数料		128,324		182,502
その他		55,820		49,507
営業収益計		46,530,479		46,998,614
営業費用				
支払手数料		16,961,384		18,499,433
広告宣伝費		353,971		361,696
公告費		1,140		125
調査費				
調査費		1,654,233		1,752,905
委託調査費		5,972,473		6,050,441
営業雑経費				
通信費		40,066		46,551
印刷費		339,048		338,465
協会費		-		24,700
諸会費		45,465		23,756
情報機器関連費		2,582,734		2,872,416
販売促進費		34,333		49,118
その他		136,669		148,307
営業費用合計		28,121,520		30,167,918
一般管理費				
給料				
役員報酬		196,529		190,951
給料・手当		6,190,716		6,308,066
賞与		601,375		514,259
賞与引当金繰入額		1,566,810		1,235,936
交際費		25,709		27,802
寄付金		-		82
事務委託費		256,413		286,905
旅費交通費		220,569		228,538
租税公課		282,036		285,369
不動産賃借料		654,286		612,410
退職給付費用		419,884		463,553
固定資産減価償却費		329,756		378,530
諸経費		285,490		290,243
一般管理費合計		11,029,580		10,822,651

営業利益	7,379,378	6,008,044
------	-----------	-----------

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(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)	
営業外収益				
受取配当金		51,335		-
受取利息		520		623
時効成立分配金・償還金		2,622		72
原稿・講演料		894		1,951
雑収入		10,669		36,408
営業外収益合計		66,042		39,055
営業外費用				
為替差損		5,125		15,760
雑損失		913		7,027
営業外費用合計		6,038		22,787
経常利益		7,439,383		6,024,312
特別利益				
投資有価証券償還益		61,842		289,451
投資有価証券売却益		30,980		7,247
過去勤務費用償却益	1	-		79,850
特別利益合計		92,822		376,549
特別損失				
固定資産除却損	2	354,695		1,462
投資有価証券償還損		141,666		13,668
投資有価証券売却損		9,634		14,605
関係会社株式評価損	3	-		160,455
合併関連費用	4	-		187,140
特別損失合計		505,996		377,331
税引前当期純利益		7,026,209		6,023,530
法人税、住民税及び事業税		2,350,891		1,750,031
法人税等調整額		280,166		90,084
法人税等合計		2,070,725		1,840,116
当期純利益		4,955,483		4,183,413

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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	23,493,074
当期変動額							
剰余金の配当							1,887,480
当期純利益							4,955,483

株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)							
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,068,003
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078

	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	25,314,279	35,943,263	327,116	327,116	36,270,379
当期変動額					
剰余金の配当	1,887,480	1,887,480			1,887,480
当期純利益	4,955,483	4,955,483			4,955,483
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)			543,419	543,419	543,419
当期変動額合計	3,068,003	3,068,003	543,419	543,419	3,611,423
当期末残高	28,382,283	39,011,267	870,535	870,535	39,881,802

当事業年度（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		
					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

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

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

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに平成28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	3～50年
器具備品	3～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 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。

(2) 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)

「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するとともに、税効果会計関係注記を変更しております。

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」715,988千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,394,447千円に含めて表示しております。

また、税効果会計関係注記において、税効果会計基準一部改正第3項から第4項に定める「税効果会計に係る会計基準」注解(注8)(評価性引当額の合計額を除く。)に記載された内容を追加しております。ただし、当該内容のうち前事業年度に係る内容については、税効果会計基準一部改正第7項に定める経過的な取扱いに従って記載しておりません。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
建物	312,784千円	350,176千円
器具備品	768,929千円	922,553千円

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 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31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 Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、令和5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 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	204,923千円	174,854千円

(損益計算書関係)

1 過去勤務費用償却益

過去勤務費用償却益は、退職金規程を変更したことに伴い発生した過去勤務費用の一時処理額であります。

2 固定資産除却損

	前事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
器具備品	0 千円	695 千円
ソフトウェア	9,000 千円	766 千円
ソフトウェア仮勘定	345,695 千円	- 千円

3 関係会社株式評価損

関係会社株式評価損は、関連会社の株式について減損処理を適用したことによるものであります。

4 合併関連費用

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。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成29年4月1日 至平成30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	-	-	17,640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
平成29年6月27日 定時株主総会	普通株式	1,887,480	107,000.00	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

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

平成30年6月26日開催の第33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
平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,822,400	160,000.00	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日

当事業年度(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

当社は平成30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

当社は平成30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。

当該株式分割は平成30年11月1日を効力発生日としておりますので、平成31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
平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000.00	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日
平成31年2月28日 臨時株主総会	普通株式	6,667,038	377.95	平成31年 1月31日	平成31年 3月22日

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

令和1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
令和1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	平成31年 3月28日	令和1年 6月25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 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
1年以内	208,187	597,239
1年超	42,916	6,115,662
合計	251,104	6,712,901

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っております。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おります。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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及び50%出資した関連会社の株式であり、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おります。

投資有価証券、子会社株式及び関連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おります。

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おります。

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、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おります。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、次のとおりです。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（平成30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	20,873,870	20,873,870	-
(2)顧客分別金信託	20,010	20,010	-
(3)未収委託者報酬	6,332,203	6,332,203	-
(4)未収運用受託報酬	1,725,215	1,725,215	-
(5)未収投資助言報酬	316,407	316,407	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,616,296	10,616,296	-
(7)長期差入保証金	658,505	658,505	-
資産計	40,542,507	40,542,507	-
(1)顧客からの預り金	84	84	-
(2)未払手数料	2,783,763	2,783,763	-
負債計	2,783,847	2,783,847	-

当事業年度（平成31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	-

(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 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	298	298
合計	298	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523	10,252,067
合計	10,412,523	10,252,067

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(平成30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	20,873,870	-	-	-
顧客分別金信託	20,010	-	-	-
未収委託者報酬	6,332,203	-	-	-
未収運用受託報酬	1,725,215	-	-	-
未収投資助言報酬	316,407	-	-	-
長期差入保証金	602,360	56,144	-	-
合計	29,870,067	56,144	-	-

当事業年度(平成31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	-	-

(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(平成30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10,412,523千円)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(平成31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。

2.その他有価証券

前事業年度(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
(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	7,366,669	6,046,232	1,320,437
小計	7,366,669	6,046,232	1,320,437
(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	3,249,626	3,315,328	65,701
小計	3,249,626	3,315,328	65,701
合計	10,616,296	9,361,560	1,254,735

(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（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
(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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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
532,099	30,980	9,634

当事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成31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

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

当事業年度において、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。

(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	当事業年度
	（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）
退職給付債務の期首残高	3,177,131	3,319,830
勤務費用	285,715	267,362
利息費用	2,922	-
数理計算上の差異の発生額	51,212	3,658
退職給付の支払額	94,727	85,082
過去勤務費用の発生額	-	79,850
退職給付債務の期末残高	3,319,830	3,418,601

(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	当事業年度
	（平成30年3月31日）	（平成31年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	3,319,830	3,418,601
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	3,319,830	3,418,601

(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 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)	当事業年度 (自 平成30年 4月 1日 至 平成31年 3月31日)
勤務費用	285,715	267,362
利息費用	2,922	-
数理計算上の差異の費用処理額	51,212	3,658
過去勤務費用償却益	-	79,850
その他	182,458	199,849
確定給付制度に係る退職給付費用	419,884	383,703

- (注) 1.退職金規程を変更したことに伴い、過去勤務費用償却益79,850千円を特別利益に計上しております。
2.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 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)	当事業年度 (自 平成30年 4月 1日 至 平成31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147,195千円、当事業年度156,457千円であります。

(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 (平成30年 3月31日)	当事業年度 (平成31年 3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,016,532	1,046,775
賞与引当金	492,056	400,242
調査費	90,509	80,983
未払金	60,851	57,192
未払事業税	102,103	54,797
ソフトウェア償却	11,289	17,501
その他	7,903	82,798
繰延税金資産小計	1,781,245	1,740,292
評価性引当額(注)	2,597	51,729
繰延税金資産合計	1,778,648	1,688,563
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	384,200	262,181
繰延税金負債合計	384,200	262,181
繰延税金資産の純額	1,394,447	1,426,381

- (注) 評価性引当額が49,131千円増加しております。この増加の内容は、主として関係会社株式評価損に係る評価性引当額を追加的に認識したことに伴うものであります。

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 (平成30年 3月31日)	当事業年度 (平成31年 3月31日)
法定実効税率 (調整)	30.8%	30.6%

評価性引当額の増減	-	0.8
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.9
住民税均等割等	0.1	0.1
所得税額控除による税額控除	1.9	1.4
その他	0.1	0.4
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4	30.5

(セグメント情報等)

前事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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	36,538,981	8,362,118	1,440,233	189,145	46,530,479

(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 平成30年4月1日 至 平成31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。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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	2,761,066	未払 手数料	429,436
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	5,685,815	未払 手数料	953,752

(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 平成30年4月1日 至 平成31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)

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (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	2,260.87円	1,944.40円
1株当たり当期純利益金額	280.92円	237.15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おりません。

2. 当社は、平成30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。これに伴い、前事業年度の期首に当該株式分割が行われたと仮定して、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 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	4,955,483	4,183,413
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)	4,955,483	4,183,413
期中平均株式数(株)	17,640,000	17,640,000

(重要な後発事象)

前事業年度(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

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主要株主間での基本合意について

平成30年5月11日付で当社及び大和住銀投信投資顧問株式会社の主要株主である株式会社三井住友フィナンシャルグループ、株式会社大和証券グループ本社、三井住友海上火災保険株式会社及び住友生命保険相互会社が、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基本合意書を締結しました。

当事業年度(自平成30年4月1日至平成31年3月31日)

取得による企業結合

当社は、平成30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、平成31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)企業結合を行う主な理由

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

平成31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 平成25年9月13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 平成25年9月13日)の考え方に基づき、当社を取得企業とし

ております。

2. 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株を割当て交付いたしました。

(2) 合併比率の算定方法

当社はE Y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P w C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、両社の財務の状況、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

3. 主要な取得関連費用の内容及び金額

デューデリジェンス費用13,700千円

4. 取得原価の配分に関する事項

現時点では確定しておりません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第35期中間会計期間 (令和1年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		31,390,396
顧客分別金信託		120,015
前払費用		518,120
未収委託者報酬		9,224,857
未収運用受託報酬		2,518,829
未収投資助言報酬		300,807
未収収益		49,098
その他		251,169
流動資産合計		44,373,295
固定資産		
有形固定資産	1	1,165,925
無形固定資産		
のれん		35,720,818
顧客関連資産		18,841,803
その他		1,287,309
無形固定資産合計		55,849,931
投資その他の資産		
投資有価証券		19,980,993
関係会社株式		11,208,183
その他		2,725,272
貸倒引当金		20,750
投資その他の資産合計		33,893,699
固定資産合計		90,909,555
資産合計		135,282,851
負債の部		
流動負債		
リース債務		1,568
顧客からの預り金		3,725
その他の預り金		117,464

未払金		4,558,058
未払費用		4,003,445
未払法人税等		1,108,639
前受収益		37,155
賞与引当金		1,620,047
資産除去債務		248,260
その他	2	262,615
流動負債合計		11,960,980
固定負債		
リース債務		1,045
退職給付引当金		5,317,984
賞与引当金		2,537
その他		218,125
繰延税金負債		3,515,376
固定負債合計		9,055,069
負債合計		21,016,049
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		19,373,541
利益剰余金合計		21,194,745
株主資本合計		113,750,729
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		516,072
評価・換算差額等合計		516,072
純資産合計		114,266,801
負債純資産合計		135,282,851

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		28,593,570
運用受託報酬		4,633,054
投資助言報酬		661,581
その他の営業収益		118,885
営業収益計		34,007,092
営業費用		21,567,446
一般管理費	1	11,224,956
営業利益		1,214,689
営業外収益	2	258,897
営業外費用	3	41,920

経常利益		1,431,666
特別損失	4	11,471
税引前中間純利益		1,420,194
法人税、住民税及び事業税		950,377
法人税等調整額		118,269
法人税等合計		832,107
中間純利益		588,086

(3)中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和1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	-	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054
当中間期変動額								
剰余金の配当								2,469,600
中間純利益								588,086
合併による増加			81,927,000	81,927,000				
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	-	-	81,927,000	81,927,000	-	-	-	1,881,513
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	19,373,541

	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
当中間期変動額					
剰余金の配当	2,469,600	2,469,600			2,469,600
中間純利益	588,086	588,086			588,086
合併による増加		81,927,000			81,927,000
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			77,989	77,989	77,989
当中間期変動額合計	1,881,513	80,045,486	77,989	77,989	79,967,497
当中間期末残高	21,194,745	113,750,729	516,072	516,072	114,266,801

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

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

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)

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)並びに平成28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	3～20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。

(表示方法の変更)

(中間損益計算書)

当社は当中間会計期間より、「投資有価証券売却益」及び「投資有価証券償還益」を「特別利益」ではなく「営業外収益」として、「投資有価証券売却損」及び「投資有価証券償還損」を「特別損失」ではなく「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、当中間会計期間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。

この結果、従来の方法に比較して、「特別利益」は23,677千円減少し、「営業外収益」は同額増加しており、「特別損失」は30,023千円減少し、「営業外費用」は同額増加しております。また、「経常利益」は6,346千円減少しております。

(中間貸借対照表関係)

第35期中間会計期間 (令和1年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,557,220千円
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、令和5年6月までの賃借料総額150,945千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日)	
1.のれん償却費	1,322,993千円
減価償却実施額	
有形固定資産	287,191千円
無形固定資産	1,187,351千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	209,815千円
投資有価証券償還益	5,197千円
投資有価証券売却益	18,480千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	11,810千円
投資有価証券償還損	22,585千円
投資有価証券売却損	7,437千円
4.特別損失のうち主要なもの	
合併関連費用	6,094千円
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 あります。	
固定資産除却損	5,377千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第35期中間会計期間(自 平成31年4月1日 至 令和1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	17,640,000株	16,230,060株	-	33,870,060株

(変動事由の概要)

合併に伴う普通株式の発行による増加 16,230,060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
令和1年6月24日 臨時株主総会	普通株式	2,469,600	140.00	平成31年 3月28日	令和1年 6月25日

(リース取引関係)

第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和1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	1,675,025千円
1年超	6,419,696千円
合計	8,094,721千円

(金融商品関係)

1.金融商品の時価等に関する事項

第35期中間会計期間(令和1年9月30日)

令和1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、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	31,390,396	31,390,396	-
(2)顧客分別金信託	120,015	120,015	-
(3)未収委託者報酬	9,224,857	9,224,857	-
(4)未収運用受託報酬	2,518,829	2,518,829	-
(5)未収投資助言報酬	300,807	300,807	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	19,935,624	19,935,624	-
(7)投資その他の資産			
長期差入保証金	2,528,392	2,528,392	-
資産計	66,018,923	66,018,923	-
(1)顧客からの預り金	3,725	3,725	-
(2)未払金			
未払手数料	4,192,554	4,192,554	-
負債計	4,196,280	4,196,280	-

(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)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

(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
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	11,208,183
合計	11,208,183

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。

(有価証券関係)

第35期中間会計期間(令和1年9月30日)

1.子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 11,208,183千円)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

(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	12,082,796	11,176,487	906,308
小計	12,082,796	11,176,487	906,308
(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	7,852,827	8,004,506	151,679
小計	7,852,827	8,004,506	151,679
合計	19,935,624	19,180,994	754,629

(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。

(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。

(企業結合等関係)

(取得による企業結合)

当社は、平成30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、平成31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その事業の内容

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

平成31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D S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 平成31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 平成31年1月16日)の考え方にに基づき、当社を取得企業としております。

2. 中間財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間

平成31年4月1日から令和1年9月30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株を割当て交付いたしました。

(2) 合併比率の算定方法

当社はEYトラザクシオン・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、両社の財務の状況、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

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

(資産除去債務関係)

当該資産除去債務の総額の増減

(単位：千円)

	当中間会計期間
	(自 平成31年4月1日
	至 令和1年9月30日)
期首残高	-
合併による増加額(注)	248,260
中間期末残高	248,260

(注) 合併に伴い主として霞ヶ関オフィスの不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等について、資産除去債務の金額を計上しております。

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。

(セグメント情報等)

第35期中間会計期間(自 平成31年4月1日 至 令和1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葉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	28,593,570	4,633,054	661,581	118,885	34,007,092

(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35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和1年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,373円68銭
1株当たり中間純利益	17円36銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

(参考) 大和住銀投信投資顧問株式会社の経理状況

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

1. 委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号。)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第47期事業年度(平成30年4月1日から平成31年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

令和1年6月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第47期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成31年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

（注1） 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注2） XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

（1）貸借対照表

（単位：千円）

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

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

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

(2) 損益計算書

(単位：千円)

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

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

(3) 株主資本等変動計算書

第46期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		利益剰余金
			資本剰余金	その他利益剰余金

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

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
利益剰余金 合計					
当期首残高	27,544,504	29,700,773	37,917	37,917	29,738,691
当期変動額					
剰余金の配当	2,413,950	2,413,950			2,413,950
当期純利益	4,700,218	4,700,218			4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)			17,295	17,295	17,295
当期変動額合計	2,286,268	2,286,268	17,295	17,295	2,303,564
当期末残高	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255

第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	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 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法(売却原価は総平均法により算出し、評価差額は全部純資産直入法により処理しております。)を採用しております。 時価のないもの 総平均法による原価法を採用しております。</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。 建物 2～30年 器具備品 4～15年 (会計上の見積りの変更) 当事業年度において、当社と三井住友アセットマネジメント株式会社(以下「SMAM」)との間で合併契約を締結したことに伴い、将来利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。 これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ15,534千円減少しております。</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の主な原因別の内訳

(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	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	273,241

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 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。
- 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	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	228,197

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 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。
- 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

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 小澤 陽一 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

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 三井住友アセットマネジメント株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34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 三井住友アセットマネジメント株式会社）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、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、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。 2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

令和1年11月22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 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

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平成31年4月1日から令和2年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（平成31年4月1日から令和1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。

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。

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中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示の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。また、中間監査には、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中間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、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。

中間監査意見

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令和1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（平成31年4月1日から令和1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。

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

令和1年12月10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	小澤 陽一 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

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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定型）の平成31年4月27日から令和1年10月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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。

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中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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。また、中間監査には、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中間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、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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（安定型）の令和1年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成31年4月27日から令和1年10月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

令和1年12月10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	小澤 陽一 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

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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の平成31年4月27日から令和1年10月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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。

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中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示の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に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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。また、中間監査には、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中間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、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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の令和1年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成31年4月27日から令和1年10月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

令和1年12月10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	小澤 陽一 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

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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（成長型）の平成31年4月27日から令和1年10月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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。

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中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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。また、中間監査には、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中間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、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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（成長型）の令和1年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成31年4月27日から令和1年10月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。