

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年2月16日提出
【発行者名】	三井住友D S アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	大和住銀DC年金設計ファンド30 大和住銀DC年金設計ファンド50 大和住銀DC年金設計ファンド70
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	大和住銀DC年金設計ファンド30 5兆円を上限とします。 大和住銀DC年金設計ファンド50 5兆円を上限とします。 大和住銀DC年金設計ファンド70 5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

大和住銀DC年金設計ファンド30

大和住銀DC年金設計ファンド50

大和住銀DC年金設計ファンド70

以下、上記3ファンドを総称して「大和住銀DC年金設計ファンド」または「当ファンド」ということがあり、それぞれを「各ファンド」ということがあります。

また、「大和住銀DC年金設計ファンド30」を「年金設計30」、「大和住銀DC年金設計ファンド50」を「年金設計50」、「大和住銀DC年金設計ファンド70」を「年金設計70」という略称でいうことがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

*ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友DSアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

当初元本は1口当たり1円です。委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「年金設計30」は「大住DC30」、「年金設計50」は「大住DC50」、「年金設計70」は「大住DC70」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター	ホームページ
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

（５）【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2022年2月17日から2022年8月16日まで

申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

販売会社の詳細につきましては、前記「(4) 発行(売出) 価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額(取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数) を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

販売会社において払込みを取り扱います。(販売会社は前記「(4) 発行(売出) 価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。)

(11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

ハ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6) の適用

ありません。

ニ 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則に従って取り扱われるものとし、ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および当該振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

(参考：投資信託振替制度)

・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。) への記載・記録によって行われます。

- ・ 受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます(原則として受益証券を保有することはできません。)。
- ・ ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。
- ・ 振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて世界各国の株式および公社債へバランス運用を行うことにより、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

信託金の限度額

信託金の限度額は、各ファンド1兆円とします。委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

ファンドの基本的性格

当ファンドにおける一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は以下の通りです。

<商品分類表>

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式
	海外	債券
		不動産投信
追加型	内外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類表の各項目の定義について

追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

資産複合...目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投信(リート)およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

上記以外の各区分の定義の詳細については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

<属性区分表>

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
--------	------	--------	------	-------

株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)		
	年2回	日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回	北米	ファミリーファンド	あり ()
	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式、債券)、 資産配分固定型))		アフリカ		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)		
		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

属性区分表の各項目の定義について

その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）、資産配分固定型））

...目論見書又は投資信託約款において、投資信託証券（マザーファンド）を通じて実質的に複数資産（株式、債券）を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

グローバル（日本を含む）...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界（日本を含む）の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

上記以外の各区分の定義の詳細については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

（2）【ファンドの沿革】

2001年9月21日 信託契約締結

2001年9月21日 当ファンドの設定・運用開始

2007年1月4日 投資信託振替制度へ移行

2019年4月1日 ファンドの委託会社としての業務を大和住銀投信投資顧問株式会社から三井住友D

Sアセットマネジメント株式会社へ承継

(3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(ハ) 販売会社

委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

(ニ) 投資顧問会社（運用の委託先）

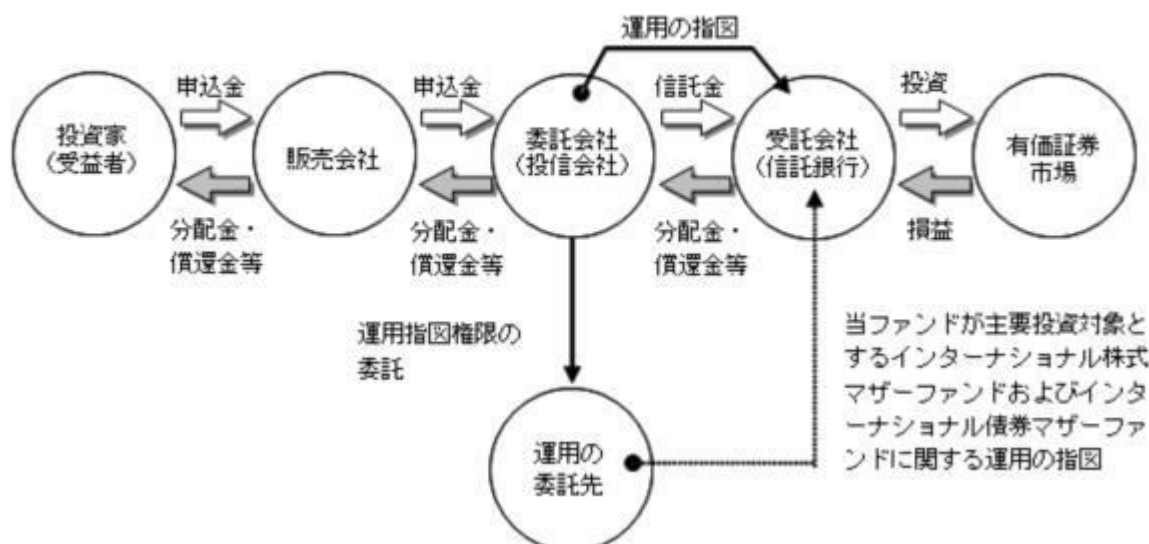
名称：ティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インク

役割：委託会社との間で締結される投資一任契約（運用委託契約）に基づき、国際ナショナル株式マザーファンドの運用指図に関する権限の委託を受け、信託財産の運用を行います。

名称：ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド

役割：委託会社との間で締結される投資一任契約（運用委託契約）に基づき、国際ナショナル債券マザーファンドの運用指図に関する権限の委託を受け、信託財産の運用を行います。

運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2021年12月30日現在）

(ロ) 会社の沿革

1985年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

1987年2月20日 証券投資顧問業の登録

1987年6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可

1999年1月1日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
1999年2月5日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
2000年1月27日	証券投資信託委託業の認可取得
2002年12月1日	住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
2013年4月1日	トヨタアセットマネジメント株式会社と合併
2019年4月1日	大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

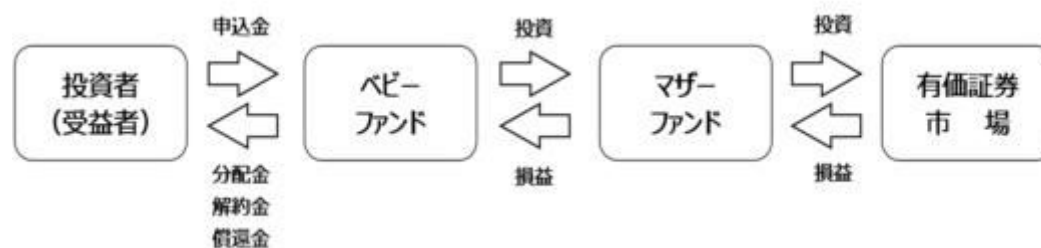
(八) 大株主の状況

(2021年12月30日現在)

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	16,977,897	50.1
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	7,946,406	23.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	5,080,509	15.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528,000	10.4
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	337,248	1.0

八 ファンドの運用形態（ファミリーファンド方式による運用）

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。



2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主として、国内株式、国内債券、海外株式、海外債券へ分散投資を行う各マザーファンドへ投資を行うことにより、リスクの低減を図りつつ、信託財産の中長期的な成長を目指します。

年金日本株式マザーファンド、年金日本債券マザーファンド、国際株式マザーファンドおよび国際債券マザーファンドを主要投資対象とします。なお、株式・公社債等に直接投資することがあります。

各資産(マザーファンド)への基本的な投資比率(「基本資産配分」)は、以下の通りです。投資期間やリスクに応じて、資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

資産	国内株式	国内債券	海外株式	海外債券
対象マザーファンド	年金日本株式マザーファンド	年金日本債券マザーファンド	インターナショナル株式マザーファンド	インターナショナル債券マザーファンド
年金設計30	25%	60%	5%	10%
年金設計50	35%	40%	15%	10%
年金設計70	50%	20%	20%	10%

*資産配分は、基本資産配分より、原則としてそれぞれ±5%の範囲内で行います。

	株式の実質組入比率の上限	外貨建資産の実質組入比率の上限
年金設計30	40%	25%
年金設計50	60%	35%
年金設計70	80%	40%

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

資金動向、市況動向によっては上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの特色

1 主として国内株式、国内債券、海外株式、海外債券へ分散投資を行う各マザーファンドへ投資を行うことにより、リスクの低減を図りつつ、信託財産の中長期的な成長を目指します。

- 年金日本株式マザーファンド、年金日本債券マザーファンド、インターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンドを主要投資対象とします。
※株式・公社債等に直接投資することがあります。

2 資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

▶基本資産配分

資産	国内株式	国内債券	海外株式	海外債券
対象マザーファンド	年金日本株式マザーファンド	年金日本債券マザーファンド	インターナショナル株式マザーファンド	インターナショナル債券マザーファンド
年金設計30	25%	60%	5%	10%
年金設計50	35%	40%	15%	10%
年金設計70	50%	20%	20%	10%

※資産配分は、基本資産配分より、原則としてそれぞれ±5%の範囲内で行います。

3 海外資産の運用は、ティー・ロウ・プライス・グループが行います。

- インターナショナル株式マザーファンドにおける運用指図にかかる権限をティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクへ委託します。
- インターナショナル債券マザーファンドにおける運用指図にかかる権限をティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドへ委託します。

4 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

5 各マザーファンドの運用は、各資産のベンチマーク（下記参照）を中長期的に上回る投資成果を目指して運用を行います。

マザーファンド	投資対象資産	ベンチマーク
年金日本株式マザーファンド	国内株式	TOPIX (東証株価指数・配当込み)
年金日本債券マザーファンド	国内債券	NOMURA-BPI総合
インターナショナル株式マザーファンド	海外株式	MSCIコクサイ・インデックス(円換算)
インターナショナル債券マザーファンド	海外債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本,円換算)

- TOPIX(東証株価指数)は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。TOPIXの算出において、電子計算機の障害または天災地変その他やむを得ない事由が発生した場合は、その算出を延期または中止することがあります。また、株式会社東京証券取引所は、TOPIXがいかなる場合においても真正であることを保証するものではなく、同指数の算出において、数値に誤謬が発生しても、株式会社東京証券取引所は一切その賠償の責めを負いません。
- NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している債券指数で、野村證券株式会社の知的財産です。当該指数に関する一切の知的財産権とその他の一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、野村證券株式会社は当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。
- MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した株価指数です。MSCIインデックスに関する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属しており、その許諾なしにコピーを含め電子的、機械的な一切の手段その他、あらゆる形態を用い、インデックスの全部または一部を複製、配付、使用することは禁じられています。またこれらの情報は信頼のおける情報源から得たものでありますが、その確実性および完結性をMSCI Inc.は何ら保証するものではありません。MSCIコクサイ・インデックス(円換算)とは、米ドルベースのMSCIコクサイ・インデックスを委託会社が円換算したものです。
- FTSE世界国債インデックス(除く日本)とは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算)とは、米ドルベースのFTSE世界国債インデックス(除く日本)を委託会社が円換算したものです。

※資金動向、市況動向によっては上記のような運用ができない場合があります。

ファンドのしくみ

■ファミリーファンド方式を採用し、マザーファンドの組入れを通じて、実際の運用を行います。



- *1 インターナショナル株式マザーファンドの運用にあたっては、ティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクに運用指図に関する権限を委託します。
- *2 インターナショナル債券マザーファンドの運用にあたっては、ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドに運用指図に関する権限を委託します。

三井住友DSアセットマネジメントは、企業等のサステナビリティに考慮した運用を行います。

- 投資判断にあたっては、投資先企業等のサステナビリティ(持続可能性)の重要な要素として、ESG*を判断材料に加えています。
- 企業との対話・働きかけ(エンゲージメント)や、議決権行使等により、ESGに関する問題・懸念の改善に向けた取り組みを運用担当者とアナリスト等が連携して実施します。

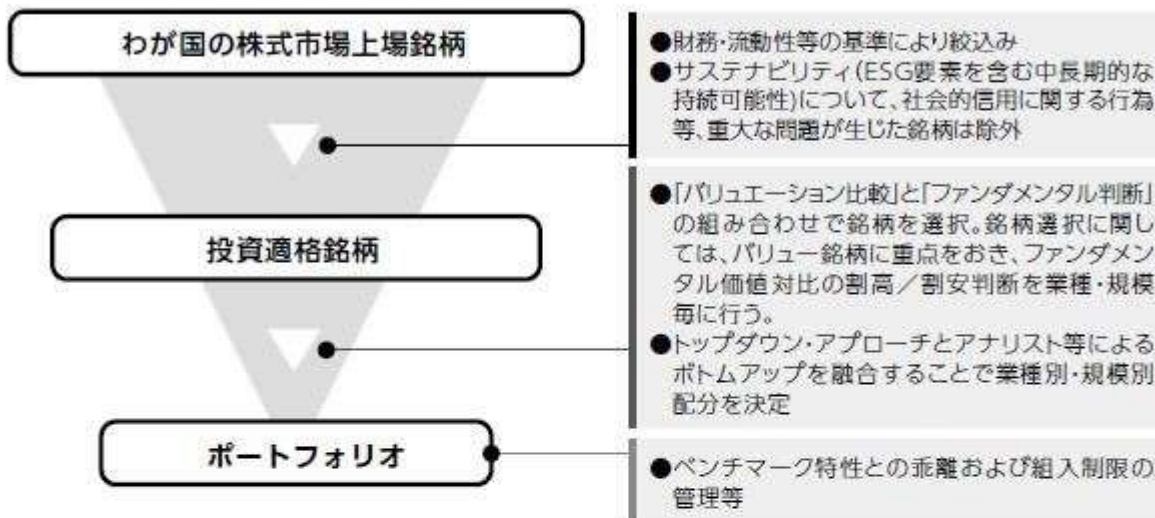
*ESG:Environment(環境)、Social(社会)、Governance(ガバナンス)

各マザーファンドの投資方針等

▶ 年金日本株式マザーファンド

- わが国の株式を主要投資対象とし、ファンダメンタル価値比割安性(バリュー)を重視し、収益性・成長性を勘案したアクティブ運用により信託財産の長期的な成長を目指します。
- TOPIX(東証株価指数・配当込み)をベンチマークとし、バリュー・アプローチを基本としたアクティブ運用により中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。

[運用プロセス]



▶ 年金日本債券マザーファンド

- わが国の公社債を主要投資対象とし、金利予測(デュレーション・コントロール等)等を重視したアクティブ運用により信託財産の長期的な成長を目指します。
- NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。

[運用プロセス]

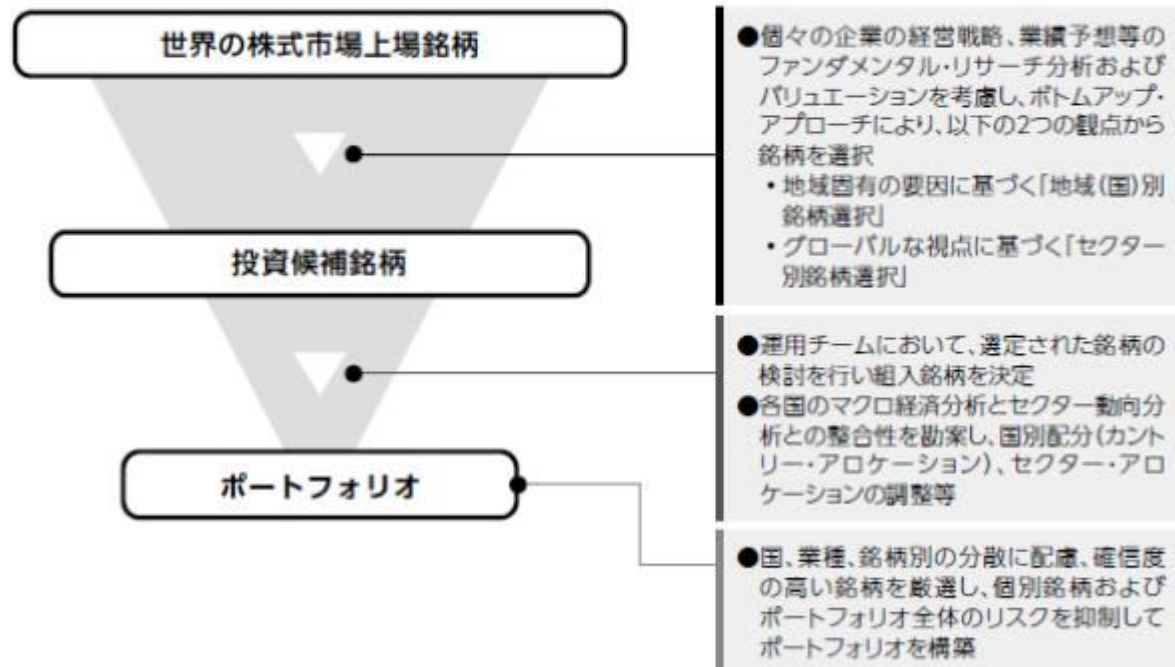


※上記の運用プロセスは2021年12月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

▶ インターナショナル株式マザーファンド

- 海外の株式へ分散投資を行い、リスクの低減とグローバルな投資機会の獲得により信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
- MSCIコクサイ・インデックス(円換算)をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。また、ベンチマーク構成国以外の国の株式へ投資を行うこともあります。
- 運用の指図に関する権限をティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクに委託します。

[運用プロセス]



※上記の運用プロセスは2021年12月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

(出所)ティー・ロウ・プライスの資料を基に委託会社作成

▶ インターナショナル債券マザーファンド

- 海外の公社債へ分散投資を行い、リスクの低減とグローバルな投資機会の獲得により信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
- FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算)をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。また、ベンチマーク構成国以外の国の債券へ投資を行うこともあります。
- 債券と為替の運用に関しては、異なる資産としてそれぞれ独立した運用を行い、世界債券および通貨の分散投資を図ります。
- 運用の指図に関する権限をティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドに委託します。

[運用プロセス]



※ 上記の運用プロセスは2021年12月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

(出所) ティー・ロウ・プライスの資料を基に委託会社作成

マザーファンドの実質的な運用を行う運用会社について

- インターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンドの実質的な運用は、ティー・ロウ・プライス・グループが行います。

〔 ティー・ロウ・プライス・グループの概要 〕

会社概要	<ul style="list-style-type: none"> ●ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド(所在地:英国ロンドン)およびティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インク(所在地:米国メリーランド州ボルチモア)は、米国ティー・ロウ・プライス・グループ傘下の運用会社です。 ●ティー・ロウ・プライス・グループは、1937年に設立された独立系の資産運用会社であり、グローバルに資産運用業務を行っています。 ●ティー・ロウ・プライス・グループ・インクは、米国の上場会社であり、また、S&P500インデックスの採用銘柄です。ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドおよびティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクは、ティー・ロウ・プライス・グループの運用技術および調査能力を活用することができます。 	<p>■ティー・ロウ・プライス・グループはサステナビリティ実現への取組みを強化するため、TCFD（気候関連財務情報開示タスクフォース）への賛同を表明し、SASB Allianceに加入しております。</p>
拠 点	世界16カ国に25拠点を展開	
従 業 員 数	7,124名	
運用資産残高	約180兆円(約1兆6,123億米ドル)	

(注)2021年9月末現在。運用資産残高は1米ドル=111.575円で円換算
(出所)ティー・ロウ・プライスのデータを基に委託会社作成

(2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定めるものに限りません。）
 - ハ．金銭債権
 - ニ．約束手形（金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。）
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

運用の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として三井住友D Sアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三井住友信託銀行株式会社を受託会社として締結された年金日本株式マザーファンド、年金日本債券マザーファンド、インターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
 9. 特別目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 14. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
 15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、有価証券に係るものに限ります。)
 17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、有価証券に限り、有価証券に係るものに限ります。)
 20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、1の証券または証書、12ならびに17の証券または証書のうち1の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2から6までの証券および12ならびに17の証券または証書のうち2から6までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13の証券および14の証券を以下「投資信託証券」といいます。

その他の金融商品の運用の指図

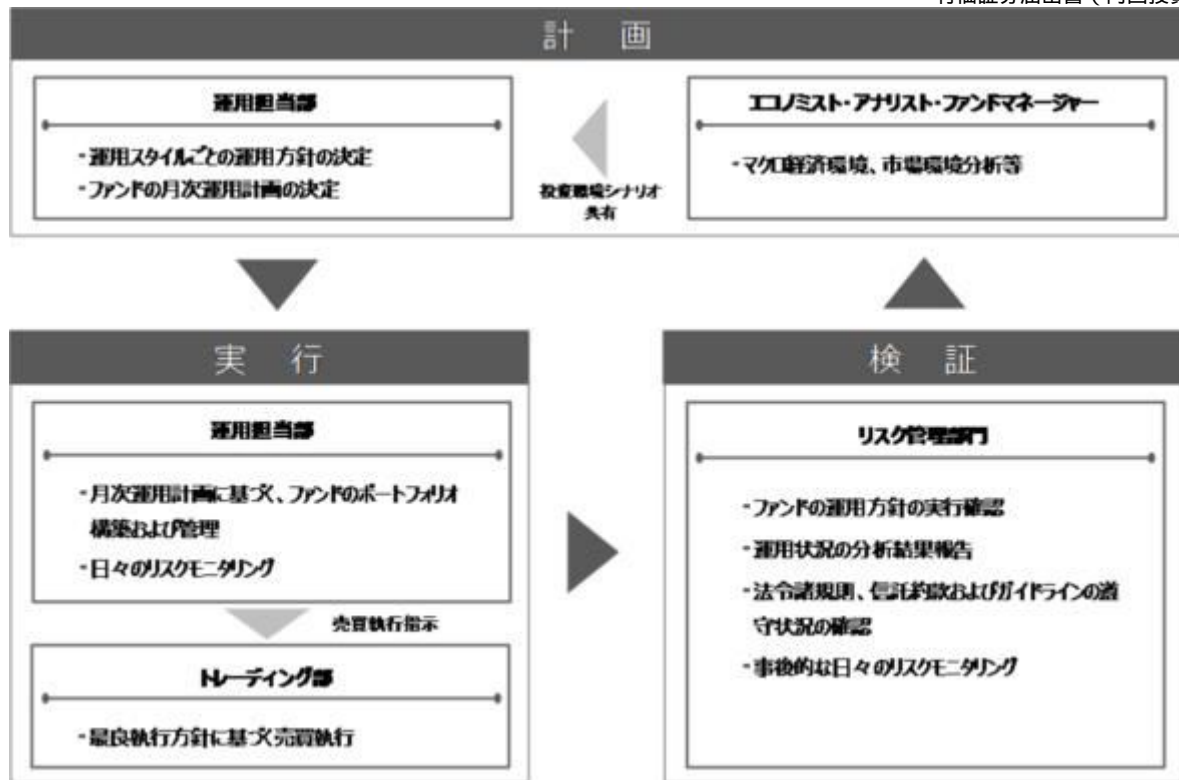
委託会社は、信託金を、前記の有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

また、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、主として前記の1から6までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(3) 【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

当ファンドが主要投資対象とするインターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンドの運用の主要部分は、委託会社からそれぞれマザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を受けたティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクおよびティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドが、投資一任契約（運用委託契約）およびそれに付随するガイドラインに従って行います。

インターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンドについて、委託会社においては、追加設定・一部解約に伴う資金の流入の管理、運用委託先への委託資産の増減の指示、余裕資金の運用等および運用委託先の運用状況（ガイドライン等の遵守状況、運用パフォーマンスなど）のモニタリング等を行います。

ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

運用委託先は、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上、選定しています。また、定性・定量面における評価を継続的に実施するとともに、運用委託契約の継続可否を定期的に判断します。

【参考情報】ティー・ロウ・プライスの運用体制

ティー・ロウ・プライスでは、戦略ごとにポートフォリオ・マネージャーおよびアナリストにより構成される専門運用チームが設けられており、運用チームは他運用戦略の運用プロフェッショナルやマクロエコノミスト等と適宜情報共有し、相互に支援します。運用部門では運用戦略に応じて専門委員会を設けています。また、ティー・ロウ・プライスでは環境、社会、ガバナンス（ESG）に関する諸要素を運用プロセスに取り入れ、ポートフォリオの組入銘柄のパフォーマンスに重大な影響を与えると判断するESG要素を考慮した投資を行っています。

（４）【分配方針】

毎決算時（毎年11月19日。ただし、休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき分

配金額を決定します。

- イ．分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。
 - ロ．収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額な場合等には分配を行わないことがあります。
 - ハ．留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
- 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。
（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

（５）【投資制限】

当ファンドは、委託会社による当ファンドの運用に関して以下のような一定の制限および限度を定めています。

信託約款に定める投資制限

イ．株式等への投資制限

- （イ）委託会社は、取得時において信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドに属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、下記の割合を超えることとなる投資の指図をしません。

大和住銀DC年金設計ファンド30.....信託財産の純資産総額の100分の40

大和住銀DC年金設計ファンド50.....信託財産の純資産総額の100分の60

大和住銀DC年金設計ファンド70.....信託財産の純資産総額の100分の80

* 信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。以下同じです。

- （ロ）委託会社は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．投資する株式等の範囲

- （イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場（上場予定を含みます。）されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じです。

- （ロ）前記にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ハ．同一銘柄の株式等への投資制限

- （イ）委託会社は、取得時において信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- （ロ）委託会社は、取得時において信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証

券の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

ニ．投資信託証券への投資制限

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券(マザーファンドを除きます。)の時価総額とマザーファンドに属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

ホ．信用取引の運用指図

- (イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができますものとしします。
- (ロ)前項の信用取引の指図は、当該売付にかかる建玉の時価総額とマザーファンドに属する当該売付にかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ)信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付にかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとしします。

ヘ．先物取引等の運用指図

- (イ)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとしします(以下同じ。)
- (ロ)委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ)委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ト．スワップ取引の運用指図

- (イ)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下、「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (ロ)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとしします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとしします。
- (ニ)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。

チ．金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図

- (イ)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ)金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとしします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解

約が可能なものについてはこの限りではありません。

- (ハ)金利先渡し取引および為替先渡し取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ)委託会社は、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ホ)金利先渡し取引とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (ヘ)為替先渡し取引とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本項において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本項において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

リ．同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債等への投資制限

委託会社は、取得時において信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

ヌ．有価証券の貸付の指図および範囲

- (イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- a．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- b．公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- (ロ)前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ)委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ル．公社債の空売りの指図

- (イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に

属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができますものとしします。

- (ロ)前項の売付の指図は、当該売付にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ)信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとしします。

ヲ．公社債の借入れ

- (イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認められたときは、担保の提供の指図を行うことができます。
- (ロ)前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ)信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとしします。
- (ニ)上記(イ)の借入れにかかる品借料は信託財産から支弁するものとしします。

ワ．外貨建資産への投資制限

外貨建資産への実質投資割合は、取得時において下記のとおりとします。

大和住銀DC年金設計ファンド30.....信託財産の純資産総額の100分の25以内

大和住銀DC年金設計ファンド50.....信託財産の純資産総額の100分の35以内

大和住銀DC年金設計ファンド70.....信託財産の純資産総額の100分の40以内

なお、外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

カ．外国為替予約の指図および範囲

- (イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- (ロ)前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとしします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ)前項の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとしします。

コ．デリバティブ取引等に係る投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

ク．信用リスク集中回避のための投資制限

一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原

則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

レ. 資金の借入れ

- (イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%の範囲内とします。
- (ハ)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

ソ. 受託会社による資金の立替え

- (イ)信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株主割当がある場合で、委託会社の申し出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。
- (ロ)信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- (ハ)上記(イ)および(ロ)の立替金の決済および利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

法令に基づく投資制限

- イ 同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- ロ デリバティブ取引にかかる投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)
委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。
- ハ 信用リスク集中回避のための投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2)

委託会社は、運用財産に関し、信用リスク(保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。)を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

(参考)マザーファンドの投資方針

年金日本株式マザーファンドの信託約款の運用の基本方針の概要

(1)運用の基本方針

当ファンドは、わが国の株式へ投資を行うことにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

(2)運用方法

投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

- イ. TOPIX(東証株価指数・配当込み)をベンチマークとし、バリュース・アプローチを基本としたアクティブ運用により中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。
- ロ. マクロ経済動向および産業動向等の分析により、業種・規模別配分等を行います。
- ハ. デリバティブ取引(法人税法第61条の5第1項で定めるものをいいます。)は、価格変動リスクを減じる目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- ニ. 資金動向、市況動向によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)運用の指図

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定めるものに限りません。)
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形(金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。)
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券又は新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、転換社債型新株予約権付社債に限りません。)

6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特別目的会社にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前各号の証券の性質を有するもの
13. 証券投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、有価証券に係るものに限ります。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、有価証券に係るものに限ります。)
19. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、1の証券または証書、12ならびに17の証券または証書のうち1の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2から6までの証券および12ならびに17の証券または証書のうち2から6までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13の証券および14の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前記の有価証券の他、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

前記にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、主として前記1から5までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(4) 主な投資制限

株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は、以下の範囲で行います。

イ．委託会社は、わが国の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)。

ロ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引は、以下の範囲で行います。

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引は、以下の範囲で行います。

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。

一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一

般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(参考)マザーファンドの投資方針

年金日本債券マザーファンドの信託約款の運用の基本方針の概要

(1)運用の基本方針

当ファンドは、わが国の公社債へ投資を行うことにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

(2)運用方法

投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

イ．NOMURA - BPI 総合をベンチマークとし、デュレーション・コントロールを重視したアクティブ運用により中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。

ロ．資金動向、市況動向によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)運用の指図

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1．次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定めるものに限りません。)

ハ．金銭債権

ニ．約束手形(金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。)

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1．国債証券

2．地方債証券

3．特別の法律により法人の発行する債券

4．社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、転換社債型新株予約権付社債に限りません。)

5．特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

6．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)

7．協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)

8．特別目的会社にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

号八に掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)

- ロ. 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引は、以下の範囲で行います。

- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引は、以下の範囲で行います。

- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ. 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。

一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(参考)マザーファンドの投資方針

インターナショナル株式マザーファンドの信託約款の運用の基本方針の概要

(1)運用の基本方針

当ファンドは、世界各国の株式へ投資することにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

(2)運用方法

投資対象

世界各国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．MSCIコクサイ・インデックス（円換算）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。
- ロ．運用の指図に関する権限をティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクに委託します。
- ハ．国別資産配分に関しては、各国の経済成長率、金利、為替レート、金融政策、資金需給や各市場間の企業の相対的魅力度分析により決定されます。
- ニ．銘柄選択については、個々の企業の経営戦略、業績予想等のファンダメンタル分析およびバリュエーションを考慮し、ボトムアップ・アプローチにより行います。
- ホ．外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ヘ．資金動向、市況動向によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 運用の指図

委託会社（委託会社から運用の指図に係る権限を委託されたものを含みます。）は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1．株券または新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9．特別目的会社にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10．コマーシャル・ペーパー
- 11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- 13．証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
- 17．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
- 20．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、1の証券または証書、12ならびに17の証券または証書のうち1の証券または証書の性質を有するものおよび14の証券のうちクローズド・エンド型のものを以下「株式」といい、2から6までの証券および12ならびに17の証券または証書のうち2から6までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13の証券および14の証券のうちクローズド・エンド型以外のものを以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前記の有価証券の他、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

前記にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、主として前記1から6までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(4) 主な投資制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は、以下の範囲で行います。

イ. 委託会社は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。

ロ. 委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

ハ. 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国

の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。

一般社団法人投資信託協会の規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(参考)マザーファンドの投資方針

国際ナショナル債券マザーファンドの信託約款の運用の基本方針の概要

(1)運用の基本方針

当ファンドは、日本を除く世界各国の公社債を中心に投資することにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

(2)運用方法

投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算)をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。
- ロ．債券と為替の運用に関しては、異なる資産としてそれぞれ独立した運用を行い、世界債券および通貨の分散投資を図ります。
- ハ．運用の指図に関する権限をティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドに委託します。
- ニ．外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ホ．資金動向、市況動向によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)運用の指図

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1．次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定めるものに限ります。)
 - ハ．金銭債権
 - ニ．約束手形(金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。)
- 2．次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

委託会社(委託会社から運用の指図に係る権限を委託されたものを含みます。)は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

- 1．国債証券
- 2．地方債証券
- 3．特別の法律により法人の発行する債券
- 4．社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、転換社債型新株予約権付社債に限ります。)
- 5．特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 6．転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使により取得した株券
- 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9．特別目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10．コマーシャル・ペーパー
- 11．新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。)および新株予約権証券
- 12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- 13．投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 14．投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 15．外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 16．オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 17．預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、6の証券または証書、12ならびに17の証券または証書のうち6の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、1から5までの証券および12ならびに17の証券または証書のうち1から5までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13の証券および14の証券を「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前記の有価証券の他、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

前記にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、主として前記1から6までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(4) 主な投資制限

株式への投資割合には、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使により取得したものに限り、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は、以下の範囲で行います。

- イ. 委託会社は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
- ロ. 委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ハ. 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国

の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
 - ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
 - ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - ハ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないこととします。

一般社団法人投資信託協会の規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資者の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

運用の結果として信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。また、一定の投資成果を保証するものではありません。

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

(1) 価格変動リスク

当ファンドは、マザーファンドを通じて、実質的に株式、債券等の値動きのある有価証券等に投資します。実質的な投資対象である有価証券等の価格が下落した場合には、ファンドの基準価額も下落するおそれがあります。

(2) 株価変動に伴うリスク

株価は、発行企業の業績や市場での需給等の影響を受け変動します。また、発行企業の信用状況にも影響されます。これらの要因により、株価が下落した場合、ファンドの基準価額も下落する

おそれがあります。

(3)金利変動に伴うリスク

投資対象の債券等は、経済情勢の変化等を受けた金利水準の変動に伴い価格が変動します。通常、金利が低下すると債券価格は上昇し、金利が上昇すると債券価格は下落します。債券価格が下落した場合、ファンドの基準価額も下落するおそれがあります。また、債券の種類や特定の銘柄に関わる格付け等の違い、利払い等の仕組みの違いなどにより、価格の変動度合いが大きくなる場合と小さくなる場合があります。

デュレーションについて

デュレーションとは、「投資元本の平均的な回収期間」を表す指標で、単位は「年」で表示されます。また、「金利の変動に対する債券価格の変動性」の指標としても利用され、一般的にこの値が長い(大きい)ほど、金利の変動に対する債券価格の変動が大きくなります。

(4)外国証券投資のリスク

<為替リスク>

当ファンドは、マザーファンドを通じて外貨建資産に投資するため、為替変動のリスクが生じます。また、当ファンドは原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を直接受けません。したがって、円高局面では、その資産価値が大きく減少する可能性があり、この場合、ファンドの基準価額が下落するおそれがあります。

<カントリーリスク>

投資対象となる国と地域によっては、政治・経済情勢が不安定になったり、証券取引・外国為替取引等に関する規制が変更されたりする場合があります。さらに、外国政府が資産の没収、国有化、差押えなどを行う可能性もあります。これらの場合、ファンドの基準価額が下落するおそれがあります。

(5)流動性リスク

実質的な投資対象となる有価証券等の需給、市場に対する相場見通し、経済・金融情勢等の変化や、当該有価証券等が売買される市場の規模や厚み、市場参加者の差異等は、当該有価証券等の流動性に大きく影響します。当該有価証券等の流動性が低下した場合、売買が実行できなくなったり、不利な条件での売買を強いられることとなったり、デリバティブ等の決済の場合に反対売買が困難になったりする可能性があります。その結果、ファンドの基準価額が下落するおそれがあります。

(6)信用リスク

投資対象となる債券等の発行体において、万一、元利金の債務不履行や支払い遅延(デフォルト)が起きますと、債券価格は大幅に下落します。この場合、ファンドの基準価額が下落するおそれがあります。また、格付機関により格下げされた場合は、債券価格が下落し、ファンドの基準価額が下落するおそれがあります。

株式の発行企業の財務状況等が悪化し、当該企業が経営不安や倒産等に陥ったときには、当該企業の株価は大きく下落し、投資資金が回収できなくなることもあります。この場合、ファンドの基準価額が下落するおそれがあります。

(7)ファミリーファンド方式に関わる基準価額の変動について

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用します。当ファンドや当ファンドの投資対象となるマザーファンドに投資する他のベビーファンドで解約申込みがあった際に、マザーファンドに属する有価証券を売却しなければならない場合があります。この場合、市場規模、市場動向によっては当該売却により市場実勢が押し下げられ、当初期待されていた価格で売却できないこと

もあります。この際に、当ファンドの基準価額が下落するおそれがあります。

<その他の留意点>

(1) 分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

(2) 繰上償還について

当ファンドは、各ファンドにおいて信託財産の純資産総額が30億円を下回ることとなった場合等には、当該ファンドが繰上償還されることがあります。

(3) 資産および投資先の配分について

当ファンドの実質的な資産配分は、基本的な資産配分比率と乖離を生じる場合があります。この結果、運用成果は、基本資産配分で運用を行った場合を上回ったり下回ったりすることがありますので、ご留意ください。

(4) 換金制限等に関する留意点

ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金申込みの受付が中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

(5) クーリング・オフについて

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。

(6) 法令・税制・会計等の変更可能性について

法令・税制・会計等は、変更される可能性があります。

(7) その他

委託会社と投資顧問会社(インターナショナル株式マザーファンドにおいてはティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インク、インターナショナル債券マザーファンドにおいてはティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド)との合意等により、インターナショナル株式

マザーファンドおよび国際債券マザーファンドの運用指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

ロ 投資リスクの管理体制

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、運用リスク管理を行っています。

リスク管理部は、信託約款等に定める各種投資制限やリスク指標のモニタリングを実施し、制限に対する抵触等があった場合には運用部門に対処要請等を行い、結果をリスク管理会議へ報告します。また、ファンドのパフォーマンスの分析・評価を行い、結果を運用評価会議等へ報告することで、運用方針等との整合性を維持するよう適切に管理しています。さらに、流動性リスク管理について規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングやストレステストを実施するとともに、緊急時対応策等の策定や有効性の検証等を行います。なお、当該流動性リスクの適切な管理の実施等について、定期的にリスク管理会議へ報告します。

コンプライアンス部は、法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行い、結果をコンプライアンス会議に報告します。

[参考情報] ティー・ロウ・プライスのリスク管理体制

ティール・ロウ・プライスでは、グループ全体で包括的に運用リスクを管理する体制としています。

運用チームがポートフォリオのモニタリングを行い、その運用リスクを管理するとともに、運用部門とは独立したリスク管理部門によるリスク管理(流動性リスク管理を含みます。)も行われております。法令、規則および運用ガイドライン等の遵守にあたっては、インベストメント・コンプライアンスが運用部門から独立したモニタリングを行っています。

ティール・ロウ・プライス・グループの委員会等において、管理・監督(流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢についての監督を含みます。)を行うアプローチにより牽制機能を効かせています。

（参考情報）投資リスクの定量的比較

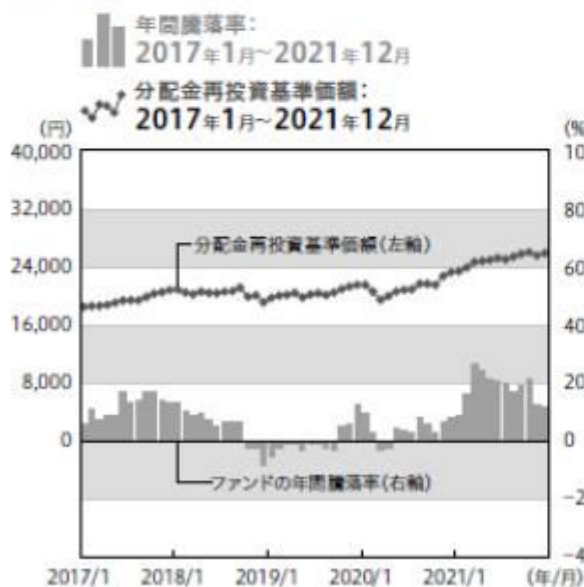
「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

■年金設計30



■年金設計50

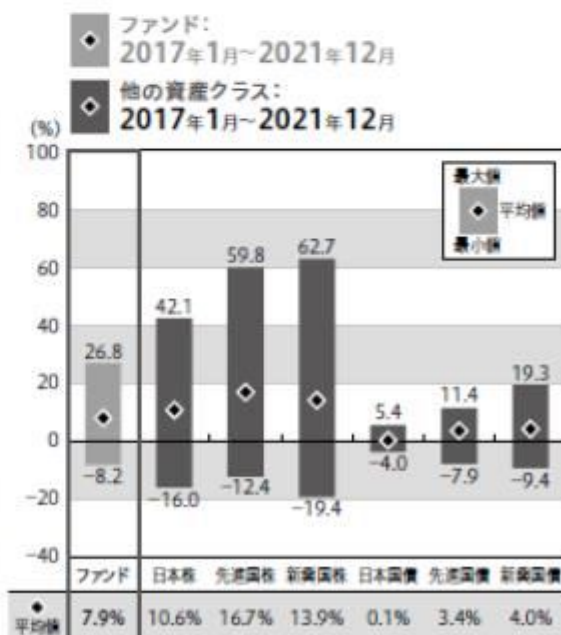
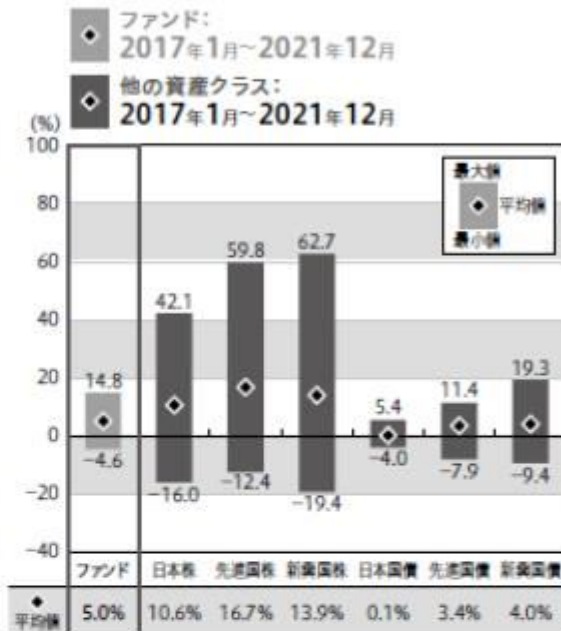


※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



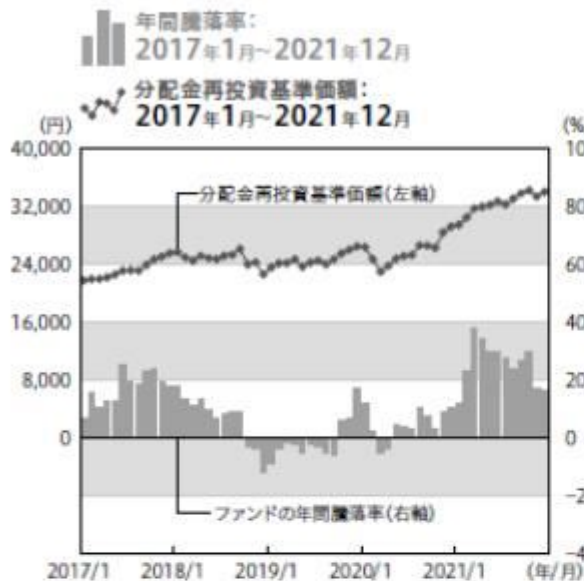
※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

【ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移】

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

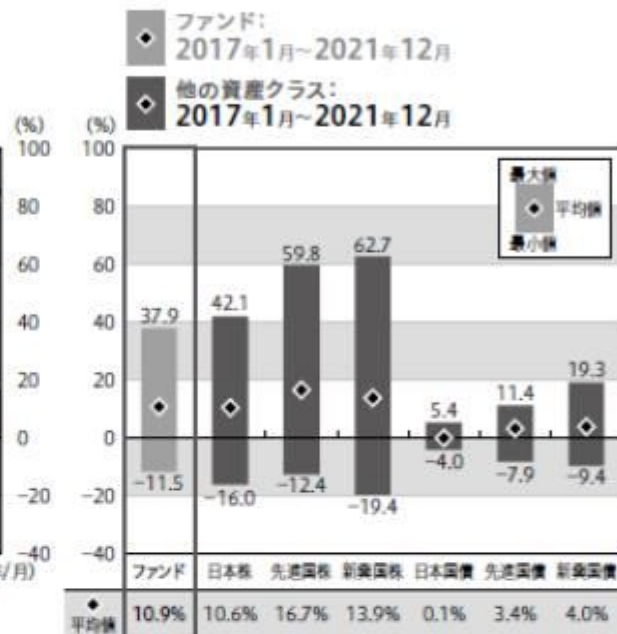
■年金設計70



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

【ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較】

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	TOPIX(配当込み) 株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場している株式を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが開発した指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。
※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額に以下の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

< 信託報酬率およびその配分 >

ファンド	信託報酬率	配分（税抜き）		
		委託会社	販売会社	受託会社
年金設計 3 0	年0.99% (税抜き0.90%)	年0.42%	年0.40%	年0.08%
年金設計 5 0	年1.21% (税抜き1.10%)	年0.52%	年0.50%	年0.08%
年金設計 7 0	年1.43% (税抜き1.30%)	年0.62%	年0.60%	年0.08%

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

委託会社の報酬には、以下の運用の指図の委託先への報酬の合計額が含まれます。

- ・ インターナショナル株式マザーファンドの組入評価額に対して年0.51%を乗じた額
- ・ インターナショナル債券マザーファンドの組入評価額に対して年0.36%を乗じた額

支払先	役務の内容
委託会社	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

(4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0088%（税抜き0.0080%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

上記（１）～（４）にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあつたりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

(5) 【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

- (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
- (ハ) 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）

ロ 一部解約時および償還時の課税について

個人の受益者については、一部解約時および償還時の譲渡益が課税対象となり、法人の受益者については、一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

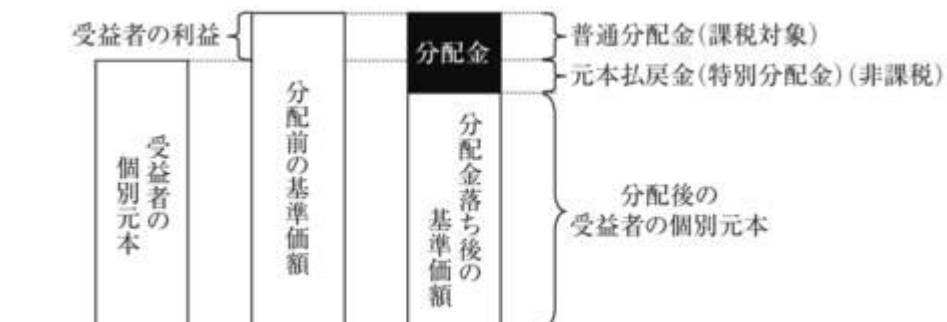
ハ 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。



収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



上記の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

・一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（上場株式、公募株式投資信託、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募公社債投資信託および特定公社債をいいます。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り、）および利子所得の金額との損益通算が可能です。

(ロ) 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2021年12月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

大和住銀DC年金設計ファンド30

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	4,095,491,043	100.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	4,275,497	0.10
合計(純資産総額)		4,091,215,546	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。

大和住銀DC年金設計ファンド50

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	9,101,004,074	100.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	11,413,190	0.13
合計(純資産総額)		9,089,590,884	100.00

大和住銀DC年金設計ファンド70

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	8,979,987,293	100.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	13,431,145	0.15
合計(純資産総額)		8,966,556,148	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

大和住銀DC年金設計ファンド30

イ 主要投資銘柄

2021年12月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	年金日本債券マ ザーファンド	1,831,512,740	1.2906	2,363,761,709	1.2899	2,362,468,283	57.74
日本	親投資 信託受 益証券	年金日本株式マ ザーファンド	335,741,873	3.3431	1,122,424,328	3.3029	1,108,921,832	27.10
日本	親投資 信託受 益証券	インターナシヨ ナル債券マザー ファンド	135,899,343	2.9992	407,588,633	2.9969	407,276,741	9.95
日本	親投資 信託受 益証券	インターナシヨ ナル株式マザー ファンド	24,493,266	9.2383	226,274,972	8.8524	216,824,187	5.30

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.10
合計	100.10

大和住銀DC年金設計ファンド50

イ 主要投資銘柄

2021年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	年金日本株式マ ザーファンド	1,036,352,467	3.3431	3,464,629,019	3.3029	3,422,968,563	37.66
日本	親投資 信託受 益証券	年金日本債券マ ザーファンド	2,600,058,278	1.2906	3,355,653,012	1.2899	3,353,815,172	36.90
日本	親投資 信託受 益証券	インターナシヨ ナル株式マザー ファンド	164,250,012	9.2388	1,517,467,418	8.8524	1,454,006,806	16.00
日本	親投資 信託受 益証券	インターナシヨ ナル債券マザー ファンド	290,371,228	2.9992	870,881,018	2.9969	870,213,533	9.57

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.13
合計	100.13

大和住銀DC年金設計ファンド70

イ 主要投資銘柄

2021年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	年金日本株式マ ザーファンド	1,351,336,049	3.3429	4,517,424,391	3.3029	4,463,327,836	49.78
日本	親投資 信託受 益証券	インターナシヨ ナル株式マザー ファンド	203,750,937	9.2372	1,882,083,270	8.8524	1,803,684,794	20.12
日本	親投資 信託受 益証券	年金日本債券マ ザーファンド	1,396,120,352	1.2906	1,801,848,235	1.2899	1,800,855,642	20.08
日本	親投資 信託受 益証券	インターナシヨ ナル債券マザー ファンド	304,354,173	2.9992	912,806,947	2.9969	912,119,021	10.17

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.15
合計	100.15

【投資不動産物件】

大和住銀DC年金設計ファンド30

該当事項はありません。

大和住銀DC年金設計ファンド50

該当事項はありません。

大和住銀DC年金設計ファンド70

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

大和住銀DC年金設計ファンド30

該当事項はありません。

大和住銀DC年金設計ファンド50

該当事項はありません。

大和住銀DC年金設計ファンド70

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

大和住銀DC年金設計ファンド30

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11期 (2012年11月19日)	2,130,763,553	2,130,763,553	11,122	11,122
第12期 (2013年11月19日)	2,655,292,612	2,655,292,612	13,476	13,476

第13期 (2014年11月19日)	2,972,260,536	2,972,260,536	14,656	14,656
第14期 (2015年11月19日)	3,078,782,579	3,078,782,579	15,402	15,402
第15期 (2016年11月21日)	3,200,694,792	3,200,694,792	15,197	15,197
第16期 (2017年11月20日)	3,443,277,170	3,443,277,170	16,550	16,550
第17期 (2018年11月19日)	3,339,411,732	3,339,411,732	16,297	16,297
第18期 (2019年11月19日)	3,542,052,292	3,542,052,292	17,123	17,123
第19期 (2020年11月19日)	3,723,266,105	3,723,266,105	17,826	17,826
第20期 (2021年11月19日)	4,117,876,215	4,117,876,215	19,632	19,632
2020年12月末日	3,796,032,708	-	18,199	-
2021年 1月末日	3,819,944,687	-	18,262	-
2月末日	3,864,519,200	-	18,474	-
3月末日	3,962,907,263	-	18,917	-
4月末日	3,950,961,247	-	18,938	-
5月末日	3,976,988,863	-	19,025	-
6月末日	3,994,947,927	-	19,141	-
7月末日	3,998,048,396	-	19,082	-
8月末日	4,037,174,581	-	19,257	-
9月末日	4,090,500,164	-	19,459	-
10月末日	4,093,891,105	-	19,536	-
11月末日	4,052,189,106	-	19,313	-
12月末日	4,091,215,546	-	19,492	-

大和住銀DC年金設計ファンド50

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11期 (2012年11月19日)	3,719,725,019	3,719,725,019	11,378	11,378
第12期 (2013年11月19日)	4,971,461,387	4,971,461,387	15,159	15,159
第13期 (2014年11月19日)	5,937,653,630	5,937,653,630	17,053	17,053
第14期 (2015年11月19日)	6,353,543,009	6,353,543,009	18,305	18,305
第15期 (2016年11月21日)	6,489,688,868	6,489,688,868	17,757	17,757
第16期 (2017年11月20日)	7,205,526,822	7,205,526,822	20,382	20,382
第17期 (2018年11月19日)	7,065,208,811	7,065,208,811	19,860	19,860
第18期 (2019年11月19日)	7,464,387,467	7,464,387,467	21,086	21,086
第19期 (2020年11月19日)	7,990,761,978	7,990,761,978	22,458	22,458
第20期 (2021年11月19日)	9,181,898,872	9,181,898,872	26,226	26,226
2020年12月末日	8,227,714,949	-	23,226	-
2021年 1月末日	8,284,799,527	-	23,374	-
2月末日	8,436,497,754	-	23,911	-
3月末日	8,657,437,657	-	24,652	-
4月末日	8,669,989,382	-	24,783	-
5月末日	8,709,825,449	-	24,922	-
6月末日	8,790,527,953	-	25,185	-
7月末日	8,755,170,617	-	25,003	-

8月末日	8,894,516,158	-	25,394	-
9月末日	9,022,857,853	-	25,761	-
10月末日	9,128,963,445	-	26,012	-
11月末日	8,937,467,077	-	25,522	-
12月末日	9,089,590,884	-	25,882	-

大和住銀DC年金設計ファンド70

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11期 (2012年11月19日)	2,896,859,717	2,896,859,717	11,983	11,983
第12期 (2013年11月19日)	4,337,024,979	4,337,024,979	17,515	17,515
第13期 (2014年11月19日)	5,292,336,762	5,292,336,762	20,329	20,329
第14期 (2015年11月19日)	5,782,844,185	5,782,844,185	22,272	22,272
第15期 (2016年11月21日)	5,606,043,967	5,606,043,967	20,638	20,638
第16期 (2017年11月20日)	6,553,268,444	6,553,268,444	24,796	24,796
第17期 (2018年11月19日)	6,353,963,052	6,353,963,052	23,947	23,947
第18期 (2019年11月19日)	6,778,366,283	6,778,366,283	25,784	25,784
第19期 (2020年11月19日)	7,299,998,600	7,299,998,600	27,923	27,923
第20期 (2021年11月19日)	9,073,172,179	9,073,172,179	34,548	34,548
2020年12月末日	7,591,455,167	-	29,196	-
2021年 1月末日	7,635,124,522	-	29,468	-
2月末日	7,838,984,783	-	30,430	-
3月末日	8,207,989,576	-	31,695	-
4月末日	8,265,319,878	-	31,936	-
5月末日	8,317,877,868	-	32,165	-
6月末日	8,464,339,576	-	32,664	-
7月末日	8,386,917,912	-	32,250	-
8月末日	8,597,014,447	-	33,007	-
9月末日	8,794,491,262	-	33,781	-
10月末日	8,973,141,362	-	34,185	-
11月末日	8,765,075,162	-	33,338	-
12月末日	8,966,556,148	-	33,978	-

【分配の推移】

大和住銀DC年金設計ファンド30

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第11期	2011年11月22日～2012年11月19日	0
第12期	2012年11月20日～2013年11月19日	0
第13期	2013年11月20日～2014年11月19日	0
第14期	2014年11月20日～2015年11月19日	0
第15期	2015年11月20日～2016年11月21日	0

第16期	2016年11月22日～2017年11月20日	0
第17期	2017年11月21日～2018年11月19日	0
第18期	2018年11月20日～2019年11月19日	0
第19期	2019年11月20日～2020年11月19日	0
第20期	2020年11月20日～2021年11月19日	0

大和住銀DC年金設計ファンド50

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第11期	2011年11月22日～2012年11月19日	0
第12期	2012年11月20日～2013年11月19日	0
第13期	2013年11月20日～2014年11月19日	0
第14期	2014年11月20日～2015年11月19日	0
第15期	2015年11月20日～2016年11月21日	0
第16期	2016年11月22日～2017年11月20日	0
第17期	2017年11月21日～2018年11月19日	0
第18期	2018年11月20日～2019年11月19日	0
第19期	2019年11月20日～2020年11月19日	0
第20期	2020年11月20日～2021年11月19日	0

大和住銀DC年金設計ファンド70

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第11期	2011年11月22日～2012年11月19日	0
第12期	2012年11月20日～2013年11月19日	0
第13期	2013年11月20日～2014年11月19日	0
第14期	2014年11月20日～2015年11月19日	0
第15期	2015年11月20日～2016年11月21日	0
第16期	2016年11月22日～2017年11月20日	0
第17期	2017年11月21日～2018年11月19日	0
第18期	2018年11月20日～2019年11月19日	0
第19期	2019年11月20日～2020年11月19日	0
第20期	2020年11月20日～2021年11月19日	0

【収益率の推移】

大和住銀DC年金設計ファンド30

	収益率（％）
第11期	5.2
第12期	21.2
第13期	8.8
第14期	5.1
第15期	1.3
第16期	8.9

第17期	1.5
第18期	5.1
第19期	4.1
第20期	10.1

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

大和住銀DC年金設計ファンド50

	収益率(%)
第11期	6.7
第12期	33.2
第13期	12.5
第14期	7.3
第15期	3.0
第16期	14.8
第17期	2.6
第18期	6.2
第19期	6.5
第20期	16.8

(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。

大和住銀DC年金設計ファンド70

	収益率(%)
第11期	8.4
第12期	46.2
第13期	16.1
第14期	9.6
第15期	7.3
第16期	20.1
第17期	3.4
第18期	7.7
第19期	8.3
第20期	23.7

(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。

(4) 【設定及び解約の実績】

大和住銀DC年金設計ファンド30

	設定口数(口)	解約口数(口)
第11期	233,706,227	148,426,124

第12期	317,138,297	262,519,434
第13期	312,565,077	254,961,384
第14期	309,826,201	338,796,477
第15期	246,561,526	139,449,347
第16期	190,729,547	216,357,431
第17期	177,042,330	208,423,587
第18期	196,902,639	177,424,115
第19期	245,058,103	225,002,927
第20期	217,980,831	209,133,099

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

大和住銀DC年金設計ファンド50

	設定口数（口）	解約口数（口）
第11期	405,650,395	188,431,268
第12期	381,945,305	371,607,208
第13期	498,211,684	295,867,385
第14期	476,375,260	487,502,605
第15期	387,981,906	204,065,383
第16期	285,008,907	404,550,713
第17期	275,769,053	253,513,096
第18期	280,300,218	297,760,580
第19期	315,558,978	297,549,523
第20期	282,153,008	339,151,882

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

大和住銀DC年金設計ファンド70

	設定口数（口）	解約口数（口）
第11期	349,296,357	182,307,355
第12期	419,578,520	360,743,160
第13期	465,045,301	337,942,409
第14期	468,485,032	475,360,148
第15期	345,149,754	225,264,310
第16期	291,843,926	365,295,752
第17期	287,709,097	277,289,617
第18期	258,694,020	283,051,401
第19期	325,599,540	340,250,275
第20期	340,307,488	328,348,522

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

（１）投資状況

年金日本株式マザーファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	78,703,695,880	98.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,077,422,703	1.35
合計(純資産総額)		79,781,118,583	100.00

年金日本債券マザーファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	17,511,353,828	68.40
地方債証券	日本	502,661,500	1.96
特殊債券	日本	949,219,724	3.71
社債券	日本	5,816,501,100	22.72
	アメリカ	299,159,000	1.17
	フランス	200,017,000	0.78
	小計	6,315,677,100	24.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	322,377,429	1.26
合計(純資産総額)		25,601,289,581	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 (%)
債券先物取引	買建	日本	151,590,000	0.59
合計	買建	-	151,590,000	0.59

インターナショナル株式マザーファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	103,811,074,164	56.49
	オランダ	13,505,828,680	7.35
	ケイマン諸島	12,354,069,179	6.72
	イギリス	11,726,072,552	6.38
	インド	5,268,520,540	2.87
	台湾	4,015,338,465	2.19
	ドイツ	3,956,985,247	2.15
	ジャージー	3,200,954,774	1.74
	スペイン	2,918,973,269	1.59
	スウェーデン	2,045,540,878	1.11
	カナダ	1,873,369,386	1.02
	イタリア	1,633,576,070	0.89
	デンマーク	920,343,313	0.50
	ブラジル	811,720,423	0.44
	中国	143,204,800	0.08
小計	168,185,571,740	91.53	
投資証券	アメリカ	3,963,511,147	2.16

	イギリス	2,805,496,100	1.53
	小計	6,769,007,247	3.68
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	8,798,196,270	4.79
合計（純資産総額）		183,752,775,257	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建	-	4,204,638,928	2.29
為替予約取引	売建	-	36,990,146	0.02

インターナショナル債券マザーファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	2,466,268,461	41.79
	フランス	334,552,990	5.67
	ドイツ	329,645,184	5.59
	イタリア	313,656,439	5.31
	イギリス	283,180,527	4.80
	シンガポール	128,362,807	2.17
	スペイン	109,822,276	1.86
	アイルランド	92,910,767	1.57
	カナダ	86,214,410	1.46
	メキシコ	75,603,762	1.28
	オーストラリア	72,983,413	1.24
	ベルギー	70,577,996	1.20
	オランダ	68,674,035	1.16
	イスラエル	62,721,256	1.06
	ルーマニア	60,657,803	1.03
	チェコ	57,691,246	0.98
	ニュージーランド	46,127,232	0.78
	マレーシア	44,773,727	0.76
	アイスランド	43,566,621	0.74
	スウェーデン	42,462,947	0.72
	オーストリア	38,713,994	0.66
	キプロス	33,208,634	0.56
	チリ	31,946,812	0.54
	ハンガリー	22,649,508	0.38
	インドネシア	15,190,058	0.26
	クロアチア	13,528,405	0.23
スロヴェニア	4,152,269	0.07	
小計		4,949,843,579	83.87
地方債証券	カナダ	21,324,500	0.36
特殊債券	国際機関	40,921,825	0.69
	ドイツ	28,679,045	0.49

	オーストラリア	13,076,059	0.22
	ハンガリー	12,993,706	0.22
	小計	95,670,635	1.62
社債券	アメリカ	99,935,554	1.69
	ドイツ	78,643,368	1.33
	アイスランド	47,189,179	0.80
	スウェーデン	46,033,425	0.78
	ケイマン諸島	45,374,699	0.77
	デンマーク	41,916,986	0.71
	オーストリア	26,882,449	0.46
	バミューダ	23,163,187	0.39
	アラブ首長国連邦	23,037,815	0.39
	メキシコ	22,487,938	0.38
	イギリス	21,005,990	0.36
	イタリア	13,593,138	0.23
	オランダ	13,490,557	0.23
	ノルウェー	13,090,283	0.22
		小計	515,844,568
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	319,322,086	5.41
合計(純資産総額)		5,902,005,368	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 (%)
債券先物取引	買建	ドイツ	382,676,201	6.48
債券先物取引	買建	アメリカ	74,888,803	1.27
合計	買建	-	457,565,004	7.75
債券先物取引	売建	イギリス	405,874,980	6.88
債券先物取引	売建	ドイツ	301,100,926	5.10
債券先物取引	売建	アメリカ	1,284,751,834	21.77
債券先物取引	売建	オーストラリア	152,720,183	2.59
合計	売建	-	2,144,447,923	36.33
種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	2,883,289,909	48.85
為替予約取引	売建	-	2,741,498,915	46.45

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

年金日本株式マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	1,379,200	2,742.39	3,782,301,135	3,150.00	4,344,480,000	5.45

日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	2,012,000	1,626.26	3,272,039,504	2,105.50	4,236,266,000	5.31
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	290,200	11,118.80	3,226,675,614	14,475.00	4,200,645,000	5.27
日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	6,578,300	530.00	3,486,503,350	624.90	4,110,779,670	5.15
日本	株式	商船三井	海運業	421,000	3,131.53	1,318,375,022	8,540.00	3,595,340,000	4.51
日本	株式	豊田自動織機	輸送用機器	375,900	8,719.50	3,277,661,487	9,190.00	3,454,521,000	4.33
日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	1,109,600	1,656.38	1,837,921,390	2,325.50	2,580,374,800	3.23
日本	株式	日本ユニシス	情報・通信業	688,500	3,986.96	2,745,019,304	3,230.00	2,223,855,000	2.79
日本	株式	日立製作所	電気機器	343,400	4,699.49	1,613,804,268	6,230.00	2,139,382,000	2.68
日本	株式	T D K	電気機器	467,100	5,916.67	2,763,675,000	4,490.00	2,097,279,000	2.63
日本	株式	富士通	電気機器	101,100	16,307.07	1,648,644,335	19,730.00	1,994,703,000	2.50
日本	株式	富士電機	電気機器	268,000	4,260.37	1,141,777,907	6,280.00	1,683,040,000	2.11
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	894,900	1,825.76	1,633,872,507	1,870.50	1,673,910,450	2.10
日本	株式	丸紅	卸売業	1,484,800	760.19	1,128,723,443	1,119.50	1,662,233,600	2.08
日本	株式	バンダイナムコホールディングス	その他製品	170,000	9,299.00	1,580,830,000	8,994.00	1,528,980,000	1.92
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	22,800	43,900.00	1,000,920,000	66,280.00	1,511,184,000	1.89
日本	株式	東映	情報・通信業	85,700	18,390.00	1,576,023,000	17,540.00	1,503,178,000	1.88
日本	株式	S Gホールディングス	陸運業	554,000	2,679.95	1,484,689,797	2,693.00	1,491,922,000	1.87
日本	株式	セーレン	繊維製品	580,700	1,593.42	925,298,764	2,517.00	1,461,621,900	1.83
日本	株式	日本新薬	医薬品	161,000	7,394.87	1,190,573,554	8,010.00	1,289,610,000	1.62
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	230,400	8,214.80	1,892,689,226	5,434.00	1,251,993,600	1.57
日本	株式	ニチレイ	食料品	466,000	2,991.94	1,394,245,859	2,663.00	1,240,958,000	1.56
日本	株式	三井物産	卸売業	441,300	2,037.21	899,020,502	2,723.50	1,201,880,550	1.51
日本	株式	A D E K A	化学	458,400	1,941.23	889,858,876	2,567.00	1,176,712,800	1.47
日本	株式	東京建物	不動産業	667,700	1,459.73	974,662,493	1,680.00	1,121,736,000	1.41
日本	株式	クボタ	機械	399,000	2,418.97	965,170,498	2,553.50	1,018,846,500	1.28
日本	株式	三菱商事	卸売業	276,100	3,253.91	898,404,679	3,652.00	1,008,317,200	1.26
日本	株式	長谷工コーポレーション	建設業	706,900	1,433.97	1,013,672,989	1,426.00	1,008,039,400	1.26
日本	株式	ヤマハ発動機	輸送用機器	338,800	2,683.07	909,025,574	2,759.00	934,749,200	1.17
日本	株式	D M G 森精機	機械	420,600	1,806.96	760,005,485	1,977.00	831,526,200	1.04

□ 種類別・業種別投資比率

2021年12月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	建設業	1.26
	食料品	3.02
	繊維製品	2.17

化学	2.05
医薬品	3.71
ガラス・土石製品	0.80
鉄鋼	1.00
金属製品	0.41
機械	4.41
電気機器	20.09
輸送用機器	12.44
その他製品	2.33
電気・ガス業	1.32
陸運業	1.99
海運業	5.10
情報・通信業	12.67
卸売業	6.57
小売業	1.78
銀行業	6.05
保険業	5.45
その他金融業	0.99
不動産業	2.49
サービス業	0.57
合計	98.65

年金日本債券マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単 価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債 証券	4 3 0 2年国債	2,360,000,000	100.25	2,365,913,000	100.19	2,364,507,600	0.005	2023/11/01	9.24
日本	国債 証券	4 3 1 2年国債	1,490,000,000	100.23	1,493,456,400	100.20	1,492,980,000	0.005	2023/12/01	5.83
日本	国債 証券	3 6 4 10年国 債	1,440,000,000	100.44	1,446,308,000	100.29	1,444,161,600	0.100	2031/09/20	5.64
日本	国債 証券	1 4 9 20年国 債	960,000,000	117.34	1,126,435,200	115.94	1,113,043,200	1.500	2034/06/20	4.35
日本	国債 証券	1 4 9 5年国債	1,000,000,000	100.44	1,004,380,000	100.40	1,004,010,000	0.005	2026/09/20	3.92
日本	国債 証券	1 7 8 20年国 債	640,000,000	100.71	644,557,800	100.45	642,880,000	0.500	2041/09/20	2.51
日本	国債 証券	7 2 3 0年国債	640,000,000	100.47	642,998,500	100.25	641,574,400	0.700	2051/09/20	2.51
日本	国債 証券	4 7 3 0年国債	470,000,000	124.12	583,362,700	122.97	577,935,500	1.600	2045/06/20	2.26

日本	国債証券	115 20年国債	460,000,000	119.72	550,730,400	117.74	541,617,800	2.200	2029/12/20	2.12
日本	国債証券	429 2年国債	490,000,000	100.24	491,166,200	100.18	490,891,800	0.005	2023/10/01	1.92
日本	国債証券	350 10年国債	450,000,000	101.08	454,867,000	101.03	454,626,000	0.100	2028/03/20	1.78
日本	国債証券	170 20年国債	450,000,000	98.95	445,269,300	98.10	441,459,000	0.300	2039/09/20	1.72
日本	国債証券	703 0年国債	410,000,000	100.85	413,488,400	100.49	411,996,700	0.700	2051/03/20	1.61
日本	国債証券	223 0年国債	290,000,000	133.11	386,027,700	131.05	380,030,500	2.500	2036/03/20	1.48
日本	国債証券	166 20年国債	320,000,000	105.55	337,769,600	105.28	336,880,000	0.700	2038/09/20	1.32
日本	国債証券	583 0年国債	310,000,000	104.61	324,303,300	104.29	323,305,200	0.800	2048/03/20	1.26
日本	国債証券	161 20年国債	300,000,000	104.56	313,674,000	104.20	312,600,000	0.600	2037/06/20	1.22
日本	国債証券	443 0年国債	240,000,000	125.89	302,134,400	124.73	299,344,800	1.700	2044/09/20	1.17
日本	国債証券	164 20年国債	280,000,000	102.94	288,237,600	102.30	286,440,000	0.500	2038/03/20	1.12
日本	国債証券	349 10年国債	270,000,000	101.35	273,652,500	101.02	272,745,900	0.100	2027/12/20	1.07
日本	国債証券	144 0年国債	275,000,000	98.23	270,137,550	98.63	271,243,500	0.700	2061/03/20	1.06
日本	国債証券	363 10年国債	250,000,000	100.61	251,516,600	100.42	251,057,500	0.100	2031/06/20	0.98
日本	国債証券	353 10年国債	240,000,000	101.09	242,607,800	101.08	242,596,800	0.100	2028/12/20	0.95
日本	国債証券	150 20年国債	200,000,000	116.09	232,171,800	114.87	229,746,000	1.400	2034/09/20	0.90
日本	国債証券	348 10年国債	220,000,000	101.33	222,926,000	100.97	222,142,800	0.100	2027/09/20	0.87
日本	社債券	1 武田 薬品劣後 FR	200,000,000	102.98	205,959,000	102.91	205,820,000	1.720	2079/06/06	0.80
日本	社債券	8 イオン 劣後 FR	200,000,000	100.00	200,000,000	102.00	203,990,000	1.185	2051/09/08	0.80

日本	社債券	1 アサヒグループHD劣FR	200,000,000	101.14	202,280,000	101.64	203,272,000	0.970	2080/10/15	0.79
日本	社債券	2 住友化学劣FR	200,000,000	100.19	200,380,000	100.86	201,720,000	0.840	2079/12/13	0.79
日本	地方債証券	763 東京都公債	200,000,000	100.61	201,210,000	100.69	201,379,000	0.150	2026/12/18	0.79

□ 種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	68.40
地方債証券	1.96
特殊債券	3.71
社債券	24.67
合計	98.74

インターナショナル株式マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年12月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	SCHWAB (CHARLES) CORP	各種金融	846,756	8,453.38	7,157,946,894	9,772.10	8,274,583,630	4.50
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	20,650	401,465.11	8,290,254,426	389,229.98	8,037,599,095	4.37
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	119,492	47,119.53	5,630,406,713	58,151.81	6,948,676,271	3.78
オランダ	株式	AIRBUS SE	資本財	427,446	14,589.58	6,236,258,918	14,632.78	6,254,723,792	3.40
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	549,110	11,990.83	6,584,286,483	10,902.75	5,986,806,746	3.26
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CLASS A	メディア・娯楽	17,014	288,142.35	4,902,453,993	337,365.16	5,739,930,866	3.12
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	133,500	39,327.40	5,250,207,749	39,331.09	5,250,700,381	2.86

アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	254,300	18,892.75	4,804,426,041	20,632.29	5,246,790,736	2.86
アメリカ	株式	T-MOBILE US INC	電気通信サービス	387,711	16,021.80	6,211,827,000	13,530.95	5,246,099,241	2.85
イギリス	株式	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	各種金融	455,600	12,209.06	5,562,447,267	10,972.36	4,999,008,673	2.72
イギリス	株式	ASHTAD GROUP PLC	資本財	524,435	8,504.36	4,459,983,284	9,500.69	4,982,493,311	2.71
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	613,100	6,926.15	4,246,424,011	6,560.80	4,022,426,480	2.19
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,567,000	2,465.79	3,863,896,645	2,562.44	4,015,338,465	2.19
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	120,971	27,168.80	3,286,636,567	32,023.87	3,873,959,384	2.11
アメリカ	株式	EXPEDIA GROUP INC	消費者サービス	178,933	18,687.28	3,343,770,184	20,815.17	3,724,520,706	2.03
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	49,700	63,750.09	3,168,379,554	70,224.31	3,490,148,246	1.90
アメリカ	株式	SIGNATURE BANK	銀行	94,468	29,189.13	2,757,439,018	36,912.22	3,487,023,447	1.90
アメリカ	株式	WESTERN ALLIANCE BANCORP	銀行	274,178	11,390.42	3,123,002,810	12,426.76	3,407,144,422	1.85
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	80,884	39,295.93	3,178,412,076	41,555.58	3,361,181,193	1.83
オランダ	株式	FERRARI NV	自動車・自動車部品	109,868	23,826.41	2,617,760,153	29,652.16	3,257,823,075	1.77
アメリカ	株式	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	家庭用品・パーソナル用品	76,413	36,471.43	2,786,891,592	42,566.60	3,252,641,728	1.77

オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	34,928	81,060.79	2,831,291,225	91,813.79	3,206,871,882	1.75
ジャージー	株式	EXPERIAN PLC	商業・専門サービス	562,296	4,467.53	2,512,073,556	5,692.65	3,200,954,774	1.74
スペイン	株式	AMADEUS IT GROUP SA	ソフトウェア・サービス	377,930	7,718.05	2,916,883,711	7,723.58	2,918,973,269	1.59
イギリス	投資証券	DERWENT LONDON PLC	-	532,312	5,330.53	2,837,507,319	5,270.40	2,805,496,100	1.53
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	163,597	11,183.82	1,829,639,793	17,052.87	2,789,797,588	1.52
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	2,673,071	1,178.54	3,150,327,779	1,039.28	2,778,055,863	1.51
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	871,900	3,602.21	3,140,763,307	3,186.00	2,777,873,400	1.51
ケイマン諸島	株式	HUAZHU GROUP LTD-ADR	消費者サービス	610,608	5,875.18	3,587,431,891	4,084.36	2,493,943,013	1.36
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	1,105,170	2,317.95	2,561,726,038	2,253.47	2,490,464,676	1.36

□ 種類別・業種別投資比率

2021年12月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式（外国）	素材	1.11
	資本財	9.37
	商業・専門サービス	2.80
	自動車・自動車部品	2.87
	耐久消費財・アパレル	1.86
	消費者サービス	4.92
	小売	7.04
	食品・飲料・タバコ	0.66
	家庭用品・パーソナル用品	2.04
	ヘルスケア機器・サービス	5.80
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4.64
	銀行	6.62
	各種金融	7.22
	ソフトウェア・サービス	11.51
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.86
	半導体・半導体製造装置	6.33
	電気通信サービス	2.85
メディア・娯楽	11.02	

投資証券	-	3.68
合計		95.21

インターナショナル債券マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2021年12月30日現在

国/ 地域	種 類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,277,000	11,551.74	725,102,687	11,368.92	713,627,225	1.250	2028/06/30	12.09
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,133,000	11,595.62	363,290,717	11,620.13	364,058,533	1.625	2031/05/15	6.17
アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B	2,060,000	14,368.82	295,997,632	14,366.31	295,945,895	0.375	2023/07/15	5.01
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,990,000	12,410.77	246,974,276	12,591.01	250,561,082	2.375	2051/05/15	4.25
ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND I/L BOND	1,500,000	15,628.95	234,434,256	15,830.46	237,456,835	0.100	2026/04/15	4.02
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	1,367,000	16,291.30	222,702,102	15,765.61	215,515,861	1.750	2039/06/25	3.65
イギリス	国債証券	UK GILT	1,227,000	13,526.50	165,970,204	13,435.71	164,856,180	0.625	2050/10/22	2.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,400,000	11,526.04	161,364,523	11,328.09	158,593,256	1.375	2031/11/15	2.69
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	1,258,000	11,497.64	144,640,280	11,497.74	144,641,622	0.000	2022/05/19	2.45
シンガポール	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	1,482,000	8,881.32	131,621,092	8,661.46	128,362,807	3.125	2022/09/01	2.17
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	735,000	16,313.82	119,906,567	16,222.86	119,238,005	1.300	2028/05/15	2.02

フランス	国債証券	FRANCE OAT.	800,000	14,784.08	118,272,669	14,879.64	119,037,129	0.100	2025/03/01	2.02
イギリス	国債証券	UK GILT	755,000	15,707.96	118,595,093	15,672.10	118,324,347	1.750	2022/09/07	2.00
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,011,000	11,656.87	117,850,912	11,300.25	114,245,577	1.875	2051/11/15	1.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	671,000	14,374.74	96,454,499	14,377.50	96,473,025	3.375	2044/05/15	1.63
ドイツ	国債証券	BUNDESobligation	700,000	13,249.11	92,743,799	13,169.76	92,188,348	0.000	2023/04/14	1.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	730,000	11,609.77	84,751,348	11,311.41	82,573,306	0.875	2026/06/30	1.40
アイルランド	国債証券	IRISH GOVT TREASURY	640,000	13,004.28	83,227,401	12,752.65	81,616,986	0.000	2031/10/18	1.38
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	655,000	13,183.80	86,353,918	12,278.90	80,426,813	1.700	2051/09/01	1.36
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	452,000	18,839.90	85,156,355	17,179.16	77,649,811	3.450	2048/03/01	1.32
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	483,000	14,917.68	72,052,416	14,612.42	70,577,996	1.250	2033/04/22	1.20
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	598,000	10,415.98	62,287,567	11,271.04	67,400,818	1.875	2051/02/15	1.14
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	547,000	12,113.91	66,263,068	11,977.26	65,515,626	2.250	2041/05/15	1.11
イスラエル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND	1,320,000	4,710.20	62,174,621	4,751.61	62,721,256	3.750	2047/03/31	1.06

カナダ	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	671,000	9,120.42	61,198,029	9,015.07	60,491,152	1.500	2022/02/01	1.02
チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	12,140,000	510.95	62,028,815	475.22	57,691,246	1.000	2026/06/26	0.98
オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	760,000	7,045.54	53,546,066	7,450.99	56,627,531	1.750	2051/06/21	0.96
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	450,000	11,258.66	50,663,973	11,219.28	50,486,763	1.250	2031/08/15	0.86
ドイツ	社債証券	DEUTSCHE BAHN FIN GMBH	380,000	13,556.07	51,513,080	12,752.13	48,458,101	0.875	2039/06/23	0.82
ニュージーランド	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT	591,000	7,632.45	45,107,766	7,804.95	46,127,232	2.750	2051/05/15	0.78

□ 種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	83.87
地方債証券	0.36
特殊債券	1.62
社債券	8.74
合計	94.59

投資不動産物件

年金日本株式マザーファンド
該当事項はありません。

年金日本債券マザーファンド
該当事項はありません。

インターナショナル株式マザーファンド
該当事項はありません。

インターナショナル債券マザーファンド
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
年金日本株式マザーファンド
該当事項はありません。

年金日本債券マザーファンド

2021年12月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
債券先物 取引	日本	大阪取引 所	長国 先 0 4 0 3 月 2 0 2 2 年 3 月	買建	1	日本・円	151,981,540	151,590,000	0.59

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

インターナショナル株式マザーファンド

2021年12月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	36,236,049.42	4,163,100,000	4,167,695,819	2.27
	香港・ドル	買建	2,504,617.66	36,949,528	36,943,109	0.02
	アメリカ・ドル	売建	321,607.88	36,949,528	36,990,146	0.02

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

インターナショナル債券マザーファンド

2021年12月30日現在

種類	地域	取引 所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
債券 先物 取引	ドイツ	EU RE X	EURO - BOB L FU TUR E MA R 2 2 2022年3月	買建	22	ユーロ	2,953,745.10	385,493,273	2,932,160.00	382,676,201	6.48
	アメリカ	シカ ゴ取 引所	US 1 0 YR NOT E (C BT) MAR 2 2 2022年 3月	買建	5	アメリカ・ドル	650,397.55	74,808,726	651,093.75	74,888,803	1.27
	イギリス	IC E - EU	LON G GI LT F UTUR E MA R 2 2 2022年3月	売建	21	イギリス・ポンド	2,614,064.04	405,807,301	2,614,500.00	405,874,980	6.88

ドイツ	EU RE X	EURO - BUN D FU TUR E MA R 2 2 2022年3月	売建	5	ユーロ	872,191.00	113,829,647	857,550.00	111,918,850	1.90
ドイツ	EU RE X	EUR O BU XL 3 0 Y B ND M AR 2 2 2022年3月	売建	7	ユーロ	1,520,247.54	198,407,506	1,449,560.00	189,182,075	3.21
アメリカ	シカ ゴ取 引所	US 5 YR N OTE (CB T) M AR 2 2 2022年3月	売建	4	アメリカ・ドル	483,931.84	55,661,840	483,218.76	55,579,821	0.94
アメリカ	シカ ゴ取 引所	US 2 YR N OTE (CB T) M AR 2 2 2022年3月	売建	49	アメリカ・ドル	10,698,040.04	1,230,488,565	10,686,593.75	1,229,172,013	20.83
オーストラリア	シド ニー 先物 取引 所	AUS 3 Y BO ND F UTUR E MA R 2 2 2022年3月	売建	16	オーストラリア・ドル	1,821,284.48	151,931,551	1,830,738.24	152,720,183	2.59

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2021年12月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	13,338,144.00	1,517,456,570	1,533,833,171	25.99
	ユーロ	買建	4,657,558.17	613,529,267	608,061,916	10.30
	カナダ・ドル	買建	1,965,421.82	179,140,019	176,929,826	3.00
	イスラエル・シュケル	買建	3,413,000.00	121,213,626	125,731,507	2.13
	イギリス・ポンド	買建	620,700.55	95,388,473	96,342,034	1.63
	ポーランド・ズロチ	買建	3,261,187.91	90,439,067	92,281,834	1.56
	オーストラリア・ドル	買建	753,000.00	61,080,503	62,806,675	1.06
	スイス・フラン	買建	493,000.00	61,452,078	62,024,330	1.05
	ロシア・ルーブル	買建	38,221,976.50	58,801,899	59,771,526	1.01
	チェコ・コルナ	買建	6,412,000.00	33,011,356	33,514,241	0.57
	オフショア・人民元	買建	827,000.00	14,669,791	14,878,474	0.25
	ノルウェー・クローネ	買建	1,107,000.00	14,640,920	14,462,180	0.25

デンマーク・クローネ	買建	150,987.20	2,659,563	2,652,195	0.04
アメリカ・ドル	売建	12,561,064.04	1,427,222,562	1,444,492,645	24.47
ユーロ	売建	2,500,383.15	326,109,439	326,434,518	5.53
イスラエル・シケル	売建	4,387,170.39	157,676,366	161,618,969	2.74
メキシコ・ペソ	売建	20,586,894.37	113,429,207	114,611,357	1.94
シンガポール・ドル	売建	1,234,804.89	103,464,301	105,036,084	1.78
スウェーデン・クローナ	売建	6,904,572.85	88,398,796	88,007,756	1.49
オーストラリア・ドル	売建	969,804.48	79,705,779	80,890,031	1.37
スイス・フラン	売建	493,000.00	60,530,540	62,024,330	1.05
カナダ・ドル	売建	685,146.00	60,523,983	61,677,732	1.05
チェコ・コルナ	売建	11,767,607.12	60,969,149	61,506,928	1.04
ロシア・ルーブル	売建	38,221,976.50	60,390,722	59,771,526	1.01
オフショア・人民元	売建	2,673,000.00	47,217,208	48,089,675	0.81
ニュージーランド・ドル	売建	575,864.22	45,960,041	45,296,786	0.77
ルーマニア・レイ	売建	1,139,000.00	29,401,576	29,881,437	0.51
イギリス・ポンド	売建	189,979.90	28,858,842	29,487,730	0.50
マレーシア・リンギット	売建	626,000.00	16,834,767	17,212,496	0.29
ポーランド・ズロチ	売建	99,187.91	2,724,255	2,806,720	0.05
デンマーク・クローネ	売建	150,987.20	2,607,548	2,652,195	0.04

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

参考情報

基準日:2021年12月30日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
 ※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

基準価額・純資産の推移

■年金設計30



分配の推移

決算期	分配金
2021年11月	0円
2020年11月	0円
2019年11月	0円
2018年11月	0円
2017年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。
 ※直近5計算期間を記載しています。

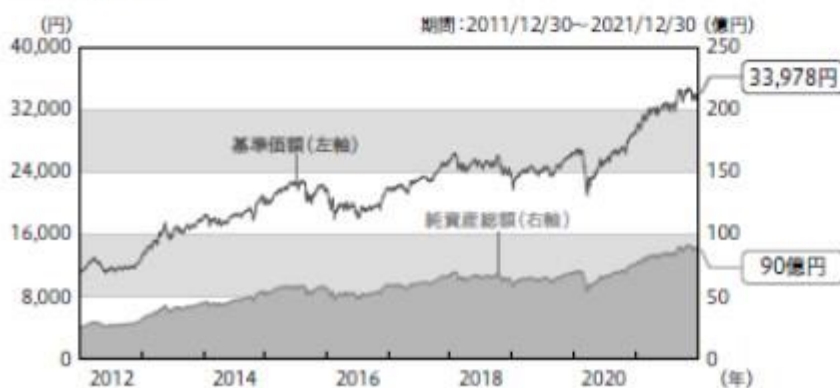
■年金設計50



決算期	分配金
2021年11月	0円
2020年11月	0円
2019年11月	0円
2018年11月	0円
2017年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。
 ※直近5計算期間を記載しています。

■年金設計70



決算期	分配金
2021年11月	0円
2020年11月	0円
2019年11月	0円
2018年11月	0円
2017年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。
 ※直近5計算期間を記載しています。

※基準価額は、1万円当たり、信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

■年金設計30

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.10
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	年金日本債券マザーファンド	57.74
日本	親投資信託受益証券	年金日本株式マザーファンド	27.10
日本	親投資信託受益証券	インターナショナル債券マザーファンド	9.95
日本	親投資信託受益証券	インターナショナル株式マザーファンド	5.30

■年金設計50

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.13
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	年金日本株式マザーファンド	37.66
日本	親投資信託受益証券	年金日本債券マザーファンド	36.90
日本	親投資信託受益証券	インターナショナル株式マザーファンド	16.00
日本	親投資信託受益証券	インターナショナル債券マザーファンド	9.57

■年金設計70

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.15
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	年金日本株式マザーファンド	49.78
日本	親投資信託受益証券	インターナショナル株式マザーファンド	20.12
日本	親投資信託受益証券	年金日本債券マザーファンド	20.08
日本	親投資信託受益証券	インターナショナル債券マザーファンド	10.17

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※[主要投資銘柄(上位10銘柄)]は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

□年金日本株式マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.35
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	5.45
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	5.31
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	5.27
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5.15
日本	株式	商船三井	海運業	4.51
日本	株式	豊田自動織機	輸送用機器	4.33
日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	3.23
日本	株式	日本ユニシス	情報・通信業	2.79
日本	株式	日立製作所	電気機器	2.68
日本	株式	TDK	電気機器	2.63

□年金日本債券マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	68.40
社債券	日本	22.72
	アメリカ	1.17
	フランス	0.78
特殊債券	日本	3.71
地方債証券	日本	1.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.26
合計(純資産総額)		100.00

※債券先物取引の費用は0.59%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	430 2年国債	0.005	2023/11/01	9.24
日本	国債証券	431 2年国債	0.005	2023/12/01	5.83
日本	国債証券	364 10年国債	0.100	2031/09/20	5.64
日本	国債証券	149 20年国債	1.500	2034/06/20	4.35
日本	国債証券	149 5年国債	0.005	2026/09/20	3.92
日本	国債証券	178 20年国債	0.500	2041/09/20	2.51
日本	国債証券	72 30年国債	0.700	2051/09/20	2.51
日本	国債証券	47 30年国債	1.600	2045/06/20	2.26
日本	国債証券	115 20年国債	2.200	2029/12/20	2.12
日本	国債証券	429 2年国債	0.005	2023/10/01	1.92

□インターナショナル株式マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	56.49
	オランダ	7.35
	ケイマン諸島	6.72
	イギリス	6.38
	インド	2.87
	台湾	2.19
	その他	9.53
投資証券	アメリカ・その他	3.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.79
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	Schwab (Charles) Corp	各種金融	4.50
アメリカ	株式	Amazon.com Inc	小売	4.37
アメリカ	株式	UnitedHealth Group Inc	ヘルスケア機器・サービス	3.78
オランダ	株式	Airbus SE	資本財	3.40
アメリカ	株式	General Electric Co	資本財	3.26
アメリカ	株式	Alphabet Inc-cl A	メディア・娯楽	3.12
アメリカ	株式	Microsoft Corp	ソフトウェア・サービス	2.86
アメリカ	株式	Apple Inc	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.86
アメリカ	株式	T-Mobile US Inc	電気通信サービス	2.85
イギリス	株式	London Stock Exchange Group	各種金融	2.72

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■国際債券マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	41.79
	フランス	5.67
	ドイツ	5.59
	イタリア	5.31
	その他	25.51
社債券	アメリカ・その他	8.74
特殊債券	国際機関・その他	1.62
地方債証券	カナダ	0.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5.41
合計(純資産総額)		100.00

※債券先物取引の買建て 7.75%
債券先物取引の売建て △36.33%

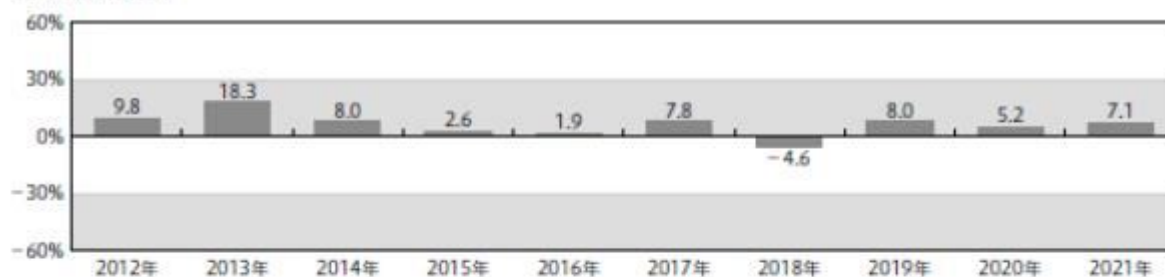
主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2028/06/30	12.09
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2031/05/15	6.17
アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B	0.375	2023/07/15	5.01
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2051/05/15	4.25
ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND I/L BOND	0.100	2026/04/15	4.02
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	1.750	2039/06/25	3.65
イギリス	国債証券	UK GILT	0.625	2050/10/22	2.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2031/11/15	2.69
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	0.000	2022/05/19	2.45
シンガポール	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	2022/09/01	2.17

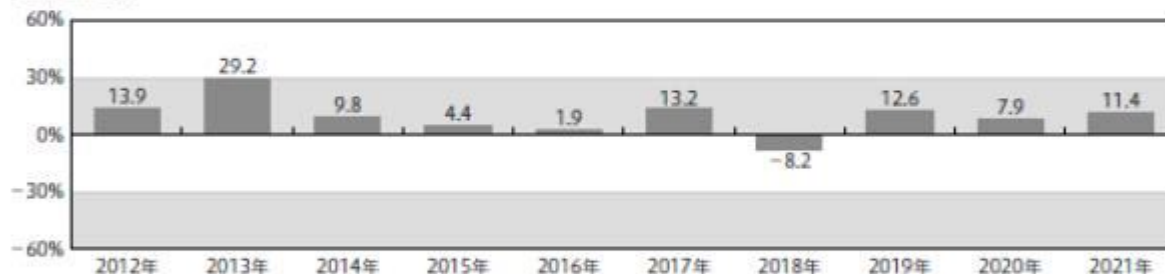
※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

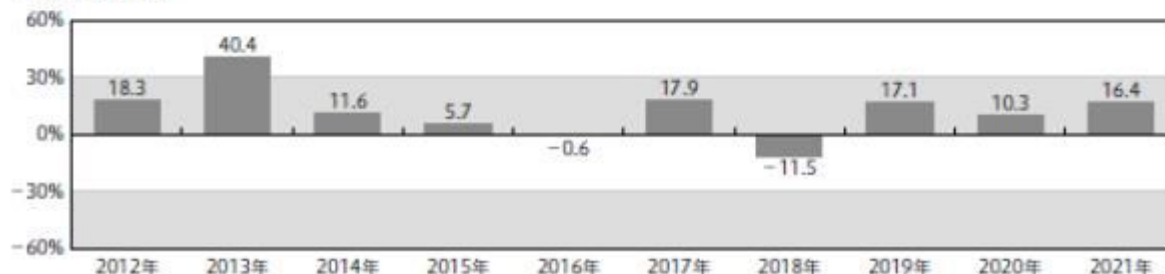
■年金設計30



■年金設計50



■年金設計70



※ファンドには、ベンチマークはありません。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

イ 申込方法

(イ) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社取引口座を開設の上、当ファンドの

取得申込みを行っていただきます。

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。

お申込みの販売会社にお問い合わせください。

- (ロ) 原則として午後3時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。

なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受け付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

- (ハ) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

- (ニ) 定時定額で取得申込みをする「定時定額購入サービス」（販売会社によっては、名称が異なる場合があります。）を利用する場合は、販売会社との間で「定時定額購入サービス」に関する契約を締結します。詳細については、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

ハ 申込手数料

ありません。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求（一部解約の実行請求）により換金することができます。

お買付けの販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。

解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

解約単位の詳細および一部解約価額につきましては、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとし、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<主要投資対象の評価方法>

有価証券等	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日の取引所の最終相場で評価します。 外国で取引される資産については、原則として基準価額計算日の前日とします。
公社債等	原則として、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。 ・日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。） ・価格情報会社の提供する価額 残存期間が1年以内の公社債については、一部償却原価法により評価することができます。 外国で取引される資産については、原則として基準価額計算日の前日とします。

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「年金設計30」は「大住DC30」、「年金設計50」は「大住DC50」、「年金設計70」は「大住DC70」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター	ホームページ
--------	---------	--------

三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp
-----------------------	--------------	---

お問い合わせは、午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)までとさせていただきます。

(2)【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2001年9月21日から下記「(5)その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4)【計算期間】

毎年11月20日から翌年11月19日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、各ファンドの純資産総額が30億円を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 上記bの公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記cの一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、信託契約の解約をしません。
- e. 委託会社は、当ファンドの信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- f. 上記c～eまでの取扱いは、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記cの一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

(二) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないとき、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(ロ) 償還金

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払われます。

八 信託約款の変更

(イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。

(ロ) 委託会社は、上記(イ)の変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

(ハ) 上記(ロ)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

(ニ) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、(イ)の信託約款の変更をしません。

(ホ) 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、す

すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

ニ 反対者の買取請求権

当ファンドの信託契約の解約または重大な信託約款の変更が行われる場合において、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間内に委託会社に異議を述べた受益者は、自己に帰属する受益権を、受託会社に信託財産をもって買い取るよう請求をすることができます。

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの）は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

ヘ 投資顧問会社（運用の委託先）との契約の更改等

委託会社と投資顧問会社との間の運用委託契約には期限の定めがありません。投資一任契約の内容は、必要に応じて、委託会社と投資顧問会社との合意により変更されることがあります。

ト 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。

チ 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.smd-am.co.jp>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

リ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は毎決算後、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書（全体版）および運用報告書（全体版）の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。

交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。なお、運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページで閲覧できます。

4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

八 一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金(解約)手続等」の記載をご参照ください。

二 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。)または重大な信託約款の変更を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に関する異議のある受益者は、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間中に異議を申し立てることができます。異議を申し立てた受益者の受益権の口数が、受益権の総口数の過半数となる場合は、当該解約または信託約款変更は行われません。

当該解約または信託約款変更が行われる場合において、前述の異議を申し立てた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「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)ならびに同規則第2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、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20期(2020年11月20日から2021年11月19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り監査を受けております。

1【財務諸表】

【大和住銀DC年金設計ファンド30】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第19期 (2020年11月19日現在)	第20期 (2021年11月19日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	62,980
コール・ローン	140,705	1,255,706
親投資信託受益証券	3,724,225,681	4,117,574,910
未収入金	18,131,899	21,073,234
流動資産合計	3,742,498,285	4,139,966,830
資産合計	3,742,498,285	4,139,966,830
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,110,488	1,587,160
未払受託者報酬	1,583,148	1,791,542
未払委託者報酬	16,227,631	18,363,630
その他未払費用	310,913	348,283
流動負債合計	19,232,180	22,090,615
負債合計	19,232,180	22,090,615
純資産の部		
元本等		
元本	2,088,646,153	2,097,493,885
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,634,619,952	2,020,382,330
(分配準備積立金)	774,718,420	1,057,425,350
元本等合計	3,723,266,105	4,117,876,215
純資産合計	3,723,266,105	4,117,876,215
負債純資産合計	3,742,498,285	4,139,966,830

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第19期		第20期	
	自	2019年11月20日 至 2020年11月19日	自	2020年11月20日 至 2021年11月19日
営業収益				
受取利息		5		43
有価証券売買等損益		179,069,997		417,410,268
営業収益合計		179,070,002		417,410,311
営業費用				
支払利息		161		454
受託者報酬		3,110,973		3,484,681
委託者報酬		31,888,164		35,718,648
その他費用		310,916		348,283
営業費用合計		35,310,214		39,552,066
営業利益又は営業損失()		143,759,788		377,858,245
経常利益又は経常損失()		143,759,788		377,858,245
当期純利益又は当期純損失()		143,759,788		377,858,245
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		2,040,955		21,407,418
期首剰余金又は期首欠損金()		1,473,461,315		1,634,619,952
剰余金増加額又は欠損金減少額		175,602,018		193,799,889
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		175,602,018		193,799,889
剰余金減少額又は欠損金増加額		160,244,124		164,488,338
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		160,244,124		164,488,338
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		1,634,619,952		2,020,382,330

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第20期
	自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第19期	第20期
	(2020年11月19日現在)	(2021年11月19日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,088,646,153口	2,097,493,885口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7826円 (1万口当たりの純資産額17,826円)	1口当たり純資産額 1.9632円 (1万口当たりの純資産額19,632円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第19期	第20期
	自 2019年11月20日 至 2020年11月19日	自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
1. 委託者報酬	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 2,273,388円	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 2,508,320円

2. 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(145,800,899円)、収益調整金(859,901,688円)、および分配準備積立金(628,917,521円)より、分配対象収益は1,634,620,108円(1万口当たり7,826.22円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(356,451,081円)、収益調整金(962,957,390円)、および分配準備積立金(700,974,269円)より、分配対象収益は2,020,382,740円(1万口当たり9,632.37円)であります。分配を行っておりません。</p>
-------------	--	--

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第20期 自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第20期 (2021年11月19日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>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。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

	(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
--	---

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第19期(自 2019年11月20日 至 2020年11月19日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	161,866,572円
合計	161,866,572円

第20期(自 2020年11月20日 至 2021年11月19日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	367,835,667円
合計	367,835,667円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第20期 自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第19期 (2020年11月19日現在)	第20期 (2021年11月19日現在)
期首元本額	2,068,590,977円	2,088,646,153円
期中追加設定元本額	245,058,103円	217,980,831円
期中一部解約元本額	225,002,927円	209,133,099円

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	インターナショナル債券マザー ファンド	135,809,409	407,333,160	
	年金日本株式マザーファンド	335,530,950	1,121,914,837	
	年金日本債券マザーファンド	1,830,234,011	2,362,100,014	
	インターナショナル株式マザー ファンド	24,478,927	226,226,899	
	親投資信託受益証券 小計		4,117,574,910	
合計			4,117,574,910	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【大和住銀DC年金設計ファンド50】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第19期 (2020年11月19日現在)	第20期 (2021年11月19日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	133,998
コール・ローン	5,581,392	2,671,697
親投資信託受益証券	7,990,235,300	9,182,835,674
未収入金	50,384,722	56,265,926
流動資産合計	8,046,201,414	9,241,907,295
資産合計	8,046,201,414	9,241,907,295
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,770,741	4,935,131
未払受託者報酬	3,346,543	3,949,730
未払委託者報酬	42,668,933	50,359,681
その他未払費用	653,219	763,881
流動負債合計	55,439,436	60,008,423
負債合計	55,439,436	60,008,423
純資産の部		
元本等		
元本	3,558,022,196	3,501,023,322
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,432,739,782	5,680,875,550
(分配準備積立金)	2,352,664,711	3,395,126,427
元本等合計	7,990,761,978	9,181,898,872
純資産合計	7,990,761,978	9,181,898,872
負債純資産合計	8,046,201,414	9,241,907,295

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第19期		第20期	
	自	2019年11月20日 至 2020年11月19日	自	2020年11月20日 至 2021年11月19日
営業収益				
受取利息		22		127
有価証券売買等損益		571,220,921		1,434,175,332
営業収益合計		571,220,943		1,434,175,459
営業費用				
支払利息		215		1,037
受託者報酬		6,533,944		7,640,587
委託者報酬		83,308,766		97,418,679
その他費用		653,220		763,882
営業費用合計		90,496,145		105,824,185
営業利益又は営業損失()		480,724,798		1,328,351,274
経常利益又は経常損失()		480,724,798		1,328,351,274
当期純利益又は当期純損失()		480,724,798		1,328,351,274
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		10,528,864		69,498,242
期首剰余金又は期首欠損金()		3,924,374,726		4,432,739,782
剰余金増加額又は欠損金減少額		346,765,819		413,718,605
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		346,765,819		413,718,605
剰余金減少額又は欠損金増加額		329,654,425		424,435,869
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		329,654,425		424,435,869
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		4,432,739,782		5,680,875,550

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第20期
	自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第19期	第20期
	(2020年11月19日現在)	(2021年11月19日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,558,022,196口	3,501,023,322口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.2458円 (1万口当たりの純資産額22,458円)	1口当たり純資産額 2.6226円 (1万口当たりの純資産額26,226円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第19期	第20期
	自 2019年11月20日 至 2020年11月19日	自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
1. 委託者報酬	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 8,924,575円	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 10,191,108円

2. 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(491,253,855円)、収益調整金(2,080,075,264円)、および分配準備積立金(1,861,410,856円)より、分配対象収益は4,432,739,975円(1万口当たり12,458.44円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,258,853,744円)、収益調整金(2,285,750,027円)、および分配準備積立金(2,136,272,683円)より、分配対象収益は5,680,876,454円(1万口当たり16,226.33円)であります。分配を行っておりません。</p>
-------------	---	---

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第20期 自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第20期 (2021年11月19日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>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。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

	(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
--	---

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第19期(自 2019年11月20日 至 2020年11月19日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	611,617,156円
合計	611,617,156円

第20期(自 2020年11月20日 至 2021年11月19日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,309,166,585円
合計	1,309,166,585円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第20期 自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第19期 (2020年11月19日現在)	第20期 (2021年11月19日現在)
期首元本額	3,540,012,741円	3,558,022,196円
期中追加設定元本額	315,558,978円	282,153,008円
期中一部解約元本額	297,549,523円	339,151,882円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
-----	-----	------	-----	----

親投資信託 受益証券	国際ナショナル債券マザー ファンド	289,492,095	868,273,640	
	年金日本株式マザーファンド	1,033,476,837	3,455,636,499	
	年金日本債券マザーファンド	2,591,947,920	3,345,167,985	
	国際ナショナル株式マザー ファンド	163,796,439	1,513,757,550	
	親投資信託受益証券 小計		9,182,835,674	
合 計			9,182,835,674	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【大和住銀DC年金設計ファンド70】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第19期 (2020年11月19日現在)	第20期 (2021年11月19日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	222,734
コール・ローン	7,726,284	4,440,952
親投資信託受益証券	7,299,469,931	9,072,232,537
未収入金	49,414,979	62,928,305
流動資産合計	7,356,611,194	9,139,824,528
資産合計	7,356,611,194	9,139,824,528
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,226,515	3,763,037
未払受託者報酬	3,003,155	3,825,287
未払委託者報酬	45,798,787	58,336,495
その他未払費用	584,137	727,530
流動負債合計	56,612,594	66,652,349
負債合計	56,612,594	66,652,349
純資産の部		
元本等		
元本	2,614,299,919	2,626,258,885
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,685,698,681	6,446,913,294
(分配準備積立金)	2,274,860,829	3,615,548,035
元本等合計	7,299,998,600	9,073,172,179
純資産合計	7,299,998,600	9,073,172,179
負債純資産合計	7,356,611,194	9,139,824,528

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第19期		第20期	
	自	2019年11月20日	自	2020年11月20日
	至	2020年11月19日	至	2021年11月19日
営業収益				
受取利息		38		102
有価証券売買等損益		644,415,590		1,841,723,728
営業収益合計		644,415,628		1,841,723,830
営業費用				
支払利息		368		1,826
受託者報酬		5,842,925		7,277,000
委託者報酬		89,106,055		110,975,899
その他費用		584,142		727,541
営業費用合計		95,533,490		118,982,266
営業利益又は営業損失()		548,882,138		1,722,741,564
経常利益又は経常損失()		548,882,138		1,722,741,564
当期純利益又は当期純損失()		548,882,138		1,722,741,564
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		20,045,601		111,702,583
期首剰余金又は期首欠損金()		4,149,415,629		4,685,698,681
剰余金増加額又は欠損金減少額		503,651,909		743,713,551
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		503,651,909		743,713,551
剰余金減少額又は欠損金増加額		536,296,596		593,537,919
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		536,296,596		593,537,919
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		4,685,698,681		6,446,913,294

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第20期
	自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第19期	第20期
	(2020年11月19日現在)	(2021年11月19日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,614,299,919口	2,626,258,885口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.7923円 (1万口当たりの純資産額27,923円)	1口当たり純資産額 3.4548円 (1万口当たりの純資産額34,548円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第19期	第20期
	自 2019年11月20日 至 2020年11月19日	自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
1. 委託者報酬	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 9,722,392円	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 12,295,185円

2. 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(568,928,069円)、収益調整金(2,410,838,182円)、および分配準備積立金(1,705,932,760円)より、分配対象収益は4,685,699,011円(1万口当たり17,923.34円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,611,040,337円)、収益調整金(2,831,366,933円)、および分配準備積立金(2,004,507,698円)より、分配対象収益は6,446,914,968円(1万口当たり24,547.90円)であります。分配を行っておりません。</p>
-------------	---	---

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第20期 自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第20期 (2021年11月19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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

	(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
--	---

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第19期(自 2019年11月20日 至 2020年11月19日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	625,904,864円
合計	625,904,864円

第20期(自 2020年11月20日 至 2021年11月19日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,615,324,922円
合計	1,615,324,922円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第20期 自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第19期 (2020年11月19日現在)	第20期 (2021年11月19日現在)
期首元本額	2,628,950,654円	2,614,299,919円
期中追加設定元本額	325,599,540円	340,307,488円
期中一部解約元本額	340,250,275円	328,348,522円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
-----	-----	------	-----	----

親投資信託 受益証券	インターナショナル債券マザー ファンド	302,926,690	908,568,021	
	年金日本株式マザーファンド	1,344,741,536	4,496,412,273	
	年金日本債券マザーファンド	1,389,534,735	1,793,333,528	
	インターナショナル株式マザー ファンド	202,767,750	1,873,918,715	
	親投資信託受益証券 小計		9,072,232,537	
合 計			9,072,232,537	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「大和住銀DC年金設計ファンド30」、「大和住銀DC年金設計ファンド50」および「大和住銀DC年金設計ファンド70」は、「年金日本株式マザーファンド」、「年金日本債券マザーファンド」、「インターナショナル株式マザーファンド」および「インターナショナル債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

年金日本株式マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2020年11月19日現在)	(2021年11月19日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	44,867,246
コール・ローン	688,696,272	894,577,969
株式	60,513,500,800	78,586,180,200
未収入金	-	238,492,470
未収配当金	657,233,350	858,297,150
流動資産合計	61,859,430,422	80,622,415,035
資産合計	61,859,430,422	80,622,415,035
負債の部		
流動負債		
未払金	-	234,216,298
未払解約金	257,426,117	232,318,496
その他未払費用	-	3,704
流動負債合計	257,426,117	466,538,498
負債合計	257,426,117	466,538,498
純資産の部		
元本等		
元本	24,552,308,310	23,972,293,045
剰余金		
剰余金又は欠損金()	37,049,695,995	56,183,583,492

元本等合計	61,602,004,305	80,155,876,537
純資産合計	61,602,004,305	80,155,876,537
負債純資産合計	61,859,430,422	80,622,415,035

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年11月20日 至 2021年11月19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. 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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2020年11月19日現在)	(2021年11月19日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	24,552,308,310口	23,972,293,045口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.5090円 (1万口当たりの純資産額25,090円)	1口当たり純資産額 3.3437円 (1万口当たりの純資産額33,437円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年11月20日 至 2021年11月19日

1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2021年11月19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)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2020年11月19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	25,522,258,131円
同期中における追加設定元本額	4,137,491,237円
同期中における一部解約元本額	5,107,441,058円
2020年11月19日現在の元本の内訳	
大和住銀DC日本株式ファンド	8,090,634,555円
大和住銀DC年金設計ファンド30	395,796,674円
大和住銀DC年金設計ファンド50	1,151,608,007円
大和住銀DC年金設計ファンド70	1,452,646,912円
大和住銀DC国内株式ファンド	6,807,085,999円

大和住銀年金専用日本株式F - 1 (適格機関投資家限定)	5,526,120,765円
大和住銀日本株式ファンドVA (適格機関投資家限定)	933,012,526円
大和住銀年金設計ファンド30VA (適格機関投資家専用)	1,561,261円
大和住銀年金設計ファンド50VA (適格機関投資家専用)	12,004,039円
大和住銀年金設計ファンド70VA (適格機関投資家専用)	6,383,096円
大和住銀バランスファンド60 (適格機関投資家限定)	173,721,813円
大和住銀世界資産バランスVA (適格機関投資家限定)	1,732,663円
合計	24,552,308,310円

(2021年11月19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	24,552,308,310円
同期中における追加設定元本額	1,679,419,243円
同期中における一部解約元本額	2,259,434,508円
2021年11月19日現在の元本の内訳	
大和住銀DC日本株式ファンド	7,787,577,592円
大和住銀DC年金設計ファンド30	335,530,950円
大和住銀DC年金設計ファンド50	1,033,476,837円
大和住銀DC年金設計ファンド70	1,344,741,536円
大和住銀DC国内株式ファンド	7,442,116,547円
大和住銀年金専用日本株式F - 1 (適格機関投資家限定)	5,105,888,169円
大和住銀日本株式ファンドVA (適格機関投資家限定)	773,336,304円
大和住銀年金設計ファンド30VA (適格機関投資家専用)	1,484,472円
大和住銀年金設計ファンド50VA (適格機関投資家専用)	10,446,251円
大和住銀年金設計ファンド70VA (適格機関投資家専用)	4,365,709円
大和住銀バランスファンド60 (適格機関投資家限定)	131,153,273円
大和住銀世界資産バランスVA (適格機関投資家限定)	2,175,405円
合計	23,972,293,045円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
長谷工コーポレーション	706,900	1,458.000	1,030,660,200	
NIPPO	230,600	4,060.000	936,236,000	
宝ホールディングス	232,700	1,336.000	310,887,200	
日清オイリオグループ	121,700	2,926.000	356,094,200	
ニチレイ	466,000	2,629.000	1,225,114,000	
東洋水産	52,000	4,620.000	240,240,000	
東洋紡	136,600	1,337.000	182,634,200	
日本毛織	103,800	893.000	92,693,400	
セーレン	580,700	2,312.000	1,342,578,400	
旭化成	300,400	1,144.500	343,807,800	

クレハ	22,400	8,350.000	187,040,000
ADEKA	427,200	2,508.000	1,071,417,600
アステラス製薬	894,900	1,923.000	1,720,892,700
日本新薬	161,000	8,620.000	1,387,820,000
AGC	116,100	5,620.000	652,482,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	544,900	1,411.000	768,853,900
三和ホールディングス	267,500	1,321.000	353,367,500
DMG森精機	420,600	1,949.000	819,749,400
小田原エンジニアリング	49,100	2,868.000	140,818,800
小松製作所	238,200	2,918.000	695,067,600
住友重機械工業	246,600	2,710.000	668,286,000
クボタ	282,100	2,484.500	700,877,450
THK	72,800	2,735.000	199,108,000
IHI	61,700	2,563.000	158,137,100
日立製作所	343,400	7,289.000	2,503,042,600
富士電機	268,000	6,080.000	1,629,440,000
富士通	101,100	20,605.000	2,083,165,500
ソニーグループ	290,200	14,345.000	4,162,919,000
TDK	467,100	4,815.000	2,249,086,500
日本電子	117,000	9,370.000	1,096,290,000
太陽誘電	120,900	6,870.000	830,583,000
東京エレクトロン	22,800	62,820.000	1,432,296,000
豊田自動織機	364,900	10,180.000	3,714,682,000
日産自動車	1,152,700	636.200	733,347,740
トヨタ自動車	2,012,000	2,132.500	4,290,590,000
太平洋工業	540,600	1,162.000	628,177,200
ヤマハ発動機	338,800	3,040.000	1,029,952,000
バンダイナムコホールディングス	170,000	9,269.000	1,575,730,000
フジシールインターナショナル	155,600	2,218.000	345,120,800
沖縄電力	325,800	1,385.000	451,233,000
丸全昭和運輸	25,100	3,310.000	83,081,000
SGホールディングス	467,400	2,653.000	1,240,012,200
商船三井	397,500	6,290.000	2,500,275,000
東映アニメーション	21,900	17,410.000	381,279,000
日本ユニシス	668,900	3,490.000	2,334,461,000
テレビ朝日ホールディングス	100,200	1,664.000	166,732,800
日本電信電話	1,378,000	3,184.000	4,387,552,000
光通信	12,100	18,600.000	225,060,000
東映	85,700	20,310.000	1,740,567,000
エヌ・ティ・ティ・データ	158,400	2,532.000	401,068,800
ソフトバンクグループ	230,400	6,856.000	1,579,622,400
双日	204,900	1,686.000	345,461,400
伊藤忠商事	231,000	3,386.000	782,166,000
丸紅	1,484,800	1,034.500	1,536,025,600
三井物産	441,300	2,698.500	1,190,848,050
三菱商事	365,600	3,492.000	1,276,675,200
イエローハット	122,300	1,640.000	200,572,000
アスクル	148,800	1,540.000	229,152,000

良品計画	304,100	2,017.000	613,369,700
ケースホールディングス	345,500	1,211.000	418,400,500
サンドラッグ	89,400	3,145.000	281,163,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	812,500	439.000	356,687,500
北國フィナンシャルホールディングス	147,300	1,981.000	291,801,300
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,578,300	637.200	4,191,692,760
かんぽ生命保険	361,300	1,801.000	650,701,300
SOMPOホールディングス	138,400	4,860.000	672,624,000
第一生命ホールディングス	1,109,600	2,316.500	2,570,388,400
東京海上ホールディングス	106,500	5,910.000	629,415,000
イオンフィナンシャルサービス	196,300	1,345.000	264,023,500
オリックス	231,900	2,343.000	543,341,700
野村不動産ホールディングス	203,300	2,677.000	544,234,100
東京建物	617,900	1,670.000	1,031,893,000
ダイビル	74,100	1,533.000	113,595,300
ディー・エヌ・エー	193,300	1,798.000	347,553,400
ベルシステム24ホールディングス	88,500	1,403.000	124,165,500
合計	31,669,900		78,586,180,200

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

年金日本債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2020年11月19日現在)	(2021年11月19日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	14,733,437
コール・ローン	1,475,430,546	293,760,131
国債証券	13,962,917,451	16,184,282,738
地方債証券	403,071,600	502,632,300
特殊債券	1,033,984,767	953,728,620
社債券	5,508,894,700	6,418,008,400
派生商品評価勘定	2,326,140	288,460
未収入金	100,524,000	200,298,000
未収利息	31,472,388	30,721,021
前払費用	2,094,545	2,173,692
差入委託証拠金	7,830,000	660,000
流動資産合計	22,528,546,137	24,601,286,799
資産合計	22,528,546,137	24,601,286,799
負債の部		

流動負債		
前受金	2,250,000	200,000
未払金	101,079,000	200,818,000
未払解約金	53,763,638	52,450,466
その他未払費用	-	5,194
流動負債合計	157,092,638	253,473,660
負債合計	157,092,638	253,473,660
純資産の部		
元本等		
元本	17,438,698,926	18,864,868,587
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,932,754,573	5,482,944,552
元本等合計	22,371,453,499	24,347,813,139
純資産合計	22,371,453,499	24,347,813,139
負債純資産合計	22,528,546,137	24,601,286,799

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2020年11月19日現在)	(2021年11月19日現在)
----	-----------------	-----------------

1. 当計算期間の末日における受益権の総数	17,438,698,926口	18,864,868,587口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2829円 (1万口当たりの純資産額12,829円)	1口当たり純資産額 1.2906円 (1万口当たりの純資産額12,906円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2021年11月19日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>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。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年11月19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	債券先物取引 買建				
	長国 先 0212月	1,367,293,860	-	1,369,620,000	2,326,140
	小計	1,367,293,860	-	1,369,620,000	2,326,140
	合 計	1,367,293,860	-	1,369,620,000	2,326,140

(2021年11月19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	債券先物取引 買建				
	長国 先 0312月	151,331,540	-	151,620,000	288,460
	小計	151,331,540	-	151,620,000	288,460
	合 計	151,331,540	-	151,620,000	288,460

(注) 1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) 債券先物取引の残高は、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。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2020年11月19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	15,295,055,100円
同期中における追加設定元本額	3,956,151,830円
同期中における一部解約元本額	1,812,508,004円
2020年11月19日現在の元本の内訳	
大和住銀DC日本債券ファンド	446,293,649円
大和住銀DC年金設計ファンド30	1,678,131,559円
大和住銀DC年金設計ファンド50	2,325,164,747円
大和住銀DC年金設計ファンド70	1,046,601,178円
大和住銀年金専用日本債券F-1（適格機関投資家限定）	10,962,123,005円
大和住銀日本債券ファンドVA（適格機関投資家限定）	706,397,283円
大和住銀年金設計ファンド30VA（適格機関投資家専用）	6,806,094円
大和住銀年金設計ファンド50VA（適格機関投資家専用）	24,520,897円
大和住銀年金設計ファンド70VA（適格機関投資家専用）	4,209,865円
大和住銀バランスファンド60（適格機関投資家限定）	236,678,521円
大和住銀世界資産バランスVA（適格機関投資家限定）	1,772,128円
合計	17,438,698,926円

(2021年11月19日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	17,438,698,926円
同期中における追加設定元本額	2,129,439,770円
同期中における一部解約元本額	703,270,109円
2021年11月19日現在の元本の内訳	
大和住銀DC日本債券ファンド	496,883,327円
大和住銀DC年金設計ファンド30	1,830,234,011円
大和住銀DC年金設計ファンド50	2,591,947,920円
大和住銀DC年金設計ファンド70	1,389,534,735円
大和住銀年金専用日本債券F-1（適格機関投資家限定）	11,561,180,796円
大和住銀日本債券ファンドVA（適格機関投資家限定）	699,980,531円
大和住銀年金設計ファンド30VA（適格機関投資家専用）	7,524,552円
大和住銀年金設計ファンド50VA（適格機関投資家専用）	27,134,541円
大和住銀年金設計ファンド70VA（適格機関投資家専用）	3,987,119円
大和住銀バランスファンド60（適格機関投資家限定）	254,091,978円
大和住銀世界資産バランスVA（適格機関投資家限定）	2,369,077円
合計	18,864,868,587円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	------	-----	----

国債証券	4 2 9	2年国債	2,410,000,000	2,416,049,100	
	4 3 0	2年国債	1,550,000,000	1,554,061,000	
	1 4 8	5年国債	400,000,000	401,744,000	
	1 4 9	5年国債	600,000,000	602,466,000	
	1 0	40年国債	20,000,000	21,253,200	
	1 4	40年国債	275,000,000	272,896,250	
	3 4 8	10年国債	220,000,000	222,316,600	
	3 4 9	10年国債	270,000,000	272,883,600	
	3 5 0	10年国債	450,000,000	454,855,500	
	3 5 1	10年国債	170,000,000	171,851,300	
	3 5 3	10年国債	140,000,000	141,591,800	
	3 6 3	10年国債	750,000,000	752,850,000	
	3 6 4	10年国債	970,000,000	972,357,100	
	2 0	30年国債	40,000,000	52,308,400	
	2 2	30年国債	290,000,000	381,547,200	
	3 9	30年国債	60,000,000	77,185,200	
	4 4	30年国債	240,000,000	300,547,200	
	4 6	30年国債	130,000,000	157,482,000	
	4 7	30年国債	470,000,000	580,252,600	
	4 9	30年国債	20,000,000	23,842,400	
	5 8	30年国債	160,000,000	167,464,000	
	6 0	30年国債	80,000,000	85,446,400	
	6 4	30年国債	110,000,000	102,912,700	
	6 5	30年国債	210,000,000	196,135,800	
	6 9	30年国債	90,000,000	90,877,500	
	7 0	30年国債	410,000,000	413,517,800	
	7 1	30年国債	180,000,000	181,557,000	
	7 2	30年国債	360,000,000	362,682,000	
	1 1 5	20年国債	460,000,000	542,832,200	
	1 4 9	20年国債	960,000,000	1,115,827,200	
	1 5 0	20年国債	200,000,000	230,302,000	
	1 5 3	20年国債	90,000,000	102,879,900	
	1 6 0	20年国債	140,000,000	148,530,200	
	1 6 1	20年国債	300,000,000	313,392,000	
	1 6 4	20年国債	280,000,000	287,148,400	
	1 6 6	20年国債	320,000,000	337,798,400	
	1 6 7	20年国債	60,000,000	61,302,000	
	1 6 8	20年国債	160,000,000	160,520,000	
	1 7 0	20年国債	450,000,000	442,143,000	
	1 7 1	20年国債	120,000,000	117,679,200	
	1 7 5	20年国債	140,000,000	141,477,000	
1 7 6	20年国債	80,000,000	80,782,400		
1 7 8	20年国債	520,000,000	523,775,200		
2 1	物価連動国債	140,000,000	146,959,988		
	国債証券 小計		16,184,282,738		

地方債証券	7 6 3 東京都公債	200,000,000	201,207,000	
	1 9 東京都30年	100,000,000	100,054,900	
	4 9 8 名古屋市債	200,000,000	201,370,400	
	地方債証券 小計		502,632,300	
特殊債券	1 3 8 住宅機構R M B S	85,920,000	86,779,200	
	1 5 3 住宅機構R M B S	185,024,000	184,764,966	
	1 6 0 住宅機構R M B S	95,458,000	95,696,645	
	1 6 1 住宅機構R M B S	96,114,000	96,190,891	
	1 6 2 住宅機構R M B S	96,352,000	96,419,446	
	1 6 4 住宅機構R M B S	97,073,000	97,179,780	
	1 6 5 住宅機構R M B S	97,114,000	97,492,744	
	1 7 0 住宅機構R M B S	98,861,000	99,286,102	
	1 7 3 住宅機構R M B S	99,829,000	99,918,846	
	特殊債券 小計		953,728,620	
社債券	9 クレディ・アグリコルFR	100,000,000	99,976,000	
	2 1 首都高速道路	100,000,000	100,090,000	
	AFLAC INC	100,000,000	100,648,000	
	1 6 長谷工コ - ボ	100,000,000	100,413,200	
	1 アサヒグループHD劣FR	200,000,000	203,600,000	
	5 サントリー食品	100,000,000	99,792,400	
	1 不二製油G 劣FR	100,000,000	100,540,000	
	3 8 双日	100,000,000	100,178,400	
	1 横浜冷凍劣後FR	100,000,000	99,610,000	
	1 3 セブンアンドアイ	200,000,000	200,104,000	
	1 日本土地建物	100,000,000	99,778,700	
	BNP PARIBAS	100,000,000	100,006,000	
	2 住友化学 劣FR	200,000,000	201,620,000	
	1 9 ZHD	200,000,000	200,036,800	
	1 ENEOS HD 劣FR	100,000,000	100,200,000	
	2 ENEOS HD 劣FR	100,000,000	100,820,000	
	1 0 ジェイテクト	100,000,000	100,144,300	
	1 パナソニック 劣後FR	200,000,000	200,560,000	
	3 パナソニック 劣後FR	100,000,000	101,033,000	
	2 7 日立造船	100,000,000	98,649,600	
	1 8 JA三井リース	100,000,000	99,976,000	
	3 1 いすゞ自動車	100,000,000	100,456,500	
	2 7 トヨタ自動車	100,000,000	99,546,000	
	1 明治安田1劣ローン	100,000,000	100,208,000	
	1 全共連1劣後ローン	100,000,000	100,120,000	
	1 大建工業	100,000,000	99,995,800	
	7 三菱商事劣後FR	200,000,000	199,772,000	
	8 イオン 劣後FR	200,000,000	203,758,000	
	9 イオン 劣後FR	100,000,000	105,388,000	
	3 1 芙蓉総合リース	100,000,000	99,579,400	
	1 7 NTTファイナンス	200,000,000	201,010,200	

20	NTTファイナンス	200,000,000	199,434,200	
52	日産フィナンシャル	100,000,000	98,953,200	
34	東京センチュリー	100,000,000	99,589,600	
69	ホンダファイナンス	100,000,000	99,849,600	
5	イオンFS	100,000,000	100,039,100	
79	アコム	100,000,000	100,245,900	
80	アコム	100,000,000	100,178,400	
30	ジャックス	100,000,000	100,385,700	
5	アプラスフィナンシャル	100,000,000	100,212,400	
1	三菱HC 劣後FR	200,000,000	200,434,000	
3	野村HD劣後FR	100,000,000	101,438,000	
5	三菱地所劣後FR	100,000,000	99,713,000	
6	三菱地所劣後FR	100,000,000	100,000,000	
50	東京地下鉄	100,000,000	100,107,700	
61	阪急阪神HLDG	100,000,000	99,792,800	
43	日本郵船	100,000,000	99,930,500	
13	ソフトバンク	200,000,000	199,037,800	
37	光通信	100,000,000	99,614,700	
41	東京電力パワー	100,000,000	101,951,000	
1	東京電力RP	100,000,000	100,170,500	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC	100,000,000	100,016,000	
	PROLOGIS YEN FIN	100,000,000	99,304,000	
	社債券 小計		6,418,008,400	
	合計		24,058,652,058	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

インターナショナル株式マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2020年11月19日現在)	(2021年11月19日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	521,643,805	3,545,724,608
金銭信託	-	116,073,700
コール・ローン	2,190,560,643	2,314,315,782
株式	119,264,079,240	173,427,696,516
投資証券	1,119,053,677	7,286,158,513
派生商品評価勘定	49	314,890
未収入金	180,052,911	1,589,872,577
未収配当金	36,392,019	34,922,893
流動資産合計	123,311,782,344	188,315,079,479
資産合計	123,311,782,344	188,315,079,479

負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	154,463	293,104
未払金	334,040,214	1,664,365,634
未払解約金	692,101,105	1,014,362,762
その他未払費用	-	6,030
流動負債合計	1,026,295,782	2,679,027,530
負債合計	1,026,295,782	2,679,027,530
純資産の部		
元本等		
元本	18,155,266,699	20,086,768,071
剰余金		
剰余金又は欠損金()	104,130,219,863	165,549,283,878
元本等合計	122,285,486,562	185,636,051,949
純資産合計	122,285,486,562	185,636,051,949
負債純資産合計	123,311,782,344	188,315,079,479

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年11月20日 至 2021年11月19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	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。
----------------------------	---

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2020年11月19日現在)	(2021年11月19日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	18,155,266,699口	20,086,768,071口
2. 1単位あたり純資産の額	1口あたり純資産額 6.7355円 (1万口当たりの純資産額67,355円)	1口あたり純資産額 9.2417円 (1万口当たりの純資産額92,417円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 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 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2021年11月19日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>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。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(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。</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)

(2020年11月19日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	466,900,000	-	466,745,694	154,306
	イギリス・ポンド	22,023	-	21,866	157
	小計	466,922,023	-	466,767,560	154,463
	売建				
	アメリカ・ドル	22,023	-	21,974	49
小計	22,023	-	21,974	49	
	合 計	466,944,046	-	466,789,534	154,414

(2021年11月19日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	149,836,350	-	150,151,240	314,890
	小計	149,836,350	-	150,151,240	314,890
	売建				
	ユーロ	53,836,350	-	54,129,454	293,104
	小計	53,836,350	-	54,129,454	293,104
	合 計	203,672,700	-	204,280,694	21,786

(注) 1 . 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

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。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2020年11月19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	16,964,504,450円
同期中における追加設定元本額	9,929,652,314円
同期中における一部解約元本額	8,738,890,065円
2020年11月19日現在の元本の内訳	
大和住銀DC外国株式ファンド	8,499,103,639円
大和住銀DC年金設計ファンド30	32,580,607円
大和住銀DC年金設計ファンド50	203,682,128円
大和住銀DC年金設計ファンド70	241,573,372円
大和住銀DC海外株式アクティブファンド	6,114,327,550円
インターナショナル株式アクティブファンド(ラップ専用)	20,220,092円
大和住銀グローバルバランスファンドVA	1,989,517円
大和住銀/T・ロウ・プライス外国株式ファンドVA	868,999,365円
大和住銀グローバルバランスファンドSVA	73,564,231円
大和住銀外国株式ファンドMSVA(適格機関投資家限定)	153,375,838円
大和住銀年金設計ファンド30VA(適格機関投資家専用)	186,841円
大和住銀年金設計ファンド50VA(適格機関投資家専用)	1,976,049円
大和住銀年金設計ファンド70VA(適格機関投資家専用)	1,094,784円
大和住銀バランスファンド60(適格機関投資家限定)	31,651,382円
大和住銀世界資産バランスVA(適格機関投資家限定)	941,851円
インターナショナル株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	1,909,999,453円
合 計	18,155,266,699円

(2021年11月19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	18,155,266,699円
同期中における追加設定元本額	5,065,935,768円
同期中における一部解約元本額	3,134,434,396円
2021年11月19日現在の元本の内訳	
大和住銀DC外国株式ファンド	8,836,550,540円
大和住銀DC年金設計ファンド30	24,478,927円

大和住銀DC年金設計ファンド50	163,796,439円
大和住銀DC年金設計ファンド70	202,767,750円
大和住銀DC海外株式アクティブファンド	8,182,436,747円
インターナショナル株式アクティブファンド(ラップ専用)	16,697,916円
大和住銀グローバルバランスファンドVA	1,680,098円
大和住銀/T・ロウ・プライス外国株式ファンドVA	687,941,858円
大和住銀グローバルバランスファンドSVA	43,411,192円
大和住銀外国株式ファンドMSVA(適格機関投資家限定)	81,698,662円
大和住銀年金設計ファンド30VA(適格機関投資家専用)	112,491円
大和住銀年金設計ファンド50VA(適格機関投資家専用)	1,629,695円
大和住銀年金設計ファンド70VA(適格機関投資家専用)	660,276円
大和住銀バランスファンド60(適格機関投資家限定)	24,703,433円
大和住銀世界資産バランスVA(適格機関投資家限定)	1,176,113円
インターナショナル株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	1,817,025,934円
合計	20,086,768,071円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	GENERAL ELECTRIC CO	453,222	100.670	45,625,858.74	
	COPART INC	127,068	155.760	19,792,111.68	
	AURORA INNOVATION INC	49,600	11.300	560,480.00	
	FERRARI NV	112,368	265.800	29,867,414.40	
	RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	20,966	123.380	2,586,785.08	
	TESLA INC	11,500	1,096.380	12,608,370.00	
	NIKE INC -CL B	53,300	171.350	9,132,955.00	
	BRIGHT HORIZONS FAMILY SOLUT	58,135	128.350	7,461,627.25	
	EXPEDIA GROUP INC	162,833	176.580	28,753,051.14	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	545,508	47.910	26,135,288.28	
	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	590,406	29.450	17,387,456.70	
	AMAZON.COM INC	20,430	3,696.060	75,510,505.80	
	DOORDASH INC - A	63,645	228.810	14,562,612.45	
	PINDUODUO INC-ADR	94,689	85.080	8,056,140.12	
	FRESHPET INC	90,752	119.620	10,855,754.24	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	85,213	347.200	29,585,953.60	
	OLAPLEX HOLDINGS INC	63,950	28.990	1,853,910.50	
	INTUITIVE SURGICAL INC	36,648	359.200	13,163,961.60	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	151,692	449.470	68,181,003.24	
ASCENDIS PHARMA A/S - ADR	59,225	148.640	8,803,204.00		

	ELI LILLY & CO	132,271	261.330	34,566,380.43	
	EXACT SCIENCES CORP	252,911	84.800	21,446,852.80	
	I-MAB-SPONSORED ADR	143,513	68.550	9,837,816.15	
	KODIAK SCIENCES INC	39,085	100.660	3,934,296.10	
	ULTRAGENYX PHARMACEUTICAL IN	68,943	77.390	5,335,498.77	
	BANK OF AMERICA CORP	90,432	46.320	4,188,810.24	
	SIGNATURE BANK	86,839	328.000	28,483,192.00	
	WESTERN ALLIANCE BANCORP	227,473	114.850	26,125,274.05	
	NEXTDOOR HOLDINGS INC	67,880	13.010	883,118.80	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	822,898	81.720	67,247,224.56	
	ATLISSIAN CORP PLC-CLASS A	20,939	440.690	9,227,607.91	
	BILL.COM HOLDINGS INC	51,103	314.000	16,046,342.00	
	DATADOG INC - CLASS A	29,982	190.600	5,714,569.20	
	DOCUSIGN INC	15,403	264.180	4,069,164.54	
	HUBSPOT INC	15,700	840.290	13,192,553.00	
	MASTERCARD INC - A	97,484	348.220	33,945,878.48	
	SERVICENOW INC	6,960	675.840	4,703,846.40	
	SHOPIFY INC - CLASS A	14,300	1,681.300	24,042,590.00	
	SNOWFLAKE INC-CLASS A	9,712	397.430	3,859,840.16	
	SQUARE INC - A	106,186	230.350	24,459,945.10	
	UIPATH INC - CLASS A	48,300	53.900	2,603,370.00	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	35,451	255.750	9,066,593.25	
	ADVANCED MICRO DEVICES	189,297	155.020	29,344,820.94	
	T-MOBILE US INC	403,181	116.980	47,164,113.38	
	ALPHABET INC-CL A	17,714	2,996.770	53,084,783.78	
	KANZHUN LTD	280,950	35.230	9,897,868.50	
	LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	42,217	60.000	2,533,020.00	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	86,398	338.690	29,262,138.62	
	NETFLIX INC	51,800	682.020	35,328,636.00	
	ROBLOX CORP -CLASS A	118,800	126.120	14,983,056.00	
	SEA LTD-ADR	54,994	310.740	17,088,835.56	
	SNAP INC - A	95,191	53.470	5,089,862.77	
	WALT DISNEY CO/THE	156,584	155.580	24,361,338.72	
	アメリカ・ドル小計	6,732,041		1,051,603,682.03 (120,261,397,077)	
香港・ドル	PRADA S.P.A.	2,321,400	54.600	126,748,440.00	
	MEITUAN-CLASS B	554,400	285.400	158,225,760.00	
	SHANGHAI MICROPORT MEDBOT GR	164,000	64.850	10,635,400.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	604,900	496.800	300,514,320.00	

香港・ドル小計		3,644,700		596,123,920.00 (8,751,099,146)	
台湾・ドル	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,564,000	613.000	958,732,000.00	
台湾・ドル小計		1,564,000		958,732,000.00 (3,943,935,828)	
イギリス・ポンド	ASHTREAD GROUP PLC	528,482	63.380	33,495,189.16	
	EXPERIAN PLC	664,301	34.460	22,891,812.46	
	TRAINLINE PLC	2,396,521	2.948	7,064,943.90	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	535,540	66.800	35,774,072.00	
イギリス・ポンド小計		4,124,844		99,226,017.52 (15,313,551,284)	
スウェーデン・クローナ	SVENSKA CELLULOSA AB SCA- B	1,077,125	143.450	154,513,581.25	
スウェーデン・クローナ 小計		1,077,125		154,513,581.25 (1,990,134,927)	
インド・ルピー	AXIS BANK LTD	2,932,304	706.350	2,071,232,930.40	
	HDFC BANK LIMITED	1,165,449	1,539.400	1,794,092,190.60	
インド・ルピー小計		4,097,753		3,865,325,121.00 (5,991,253,938)	
ブラジル・リアル	MAGAZINE LUIZA SA	3,658,093	8.990	32,886,256.07	
ブラジル・リアル小計		3,658,093		32,886,256.07 (675,345,577)	
ユーロ	AIRBUS SE	383,912	113.260	43,481,873.12	
	SARTORIUS AG-VORZUG	30,235	562.200	16,998,117.00	
	ADYEN NV	2,629	2,544.500	6,689,490.50	
	AMADEUS IT GROUP SA	369,061	63.200	23,324,655.20	
	ASML HOLDING NV	30,951	770.500	23,847,745.50	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	289,887	43.460	12,598,489.02	
ユーロ小計		1,106,675		126,940,370.34 (16,500,978,739)	
合計		26,005,231		173,427,696,516 (173,427,696,516)	

(注) 金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	53銘柄	64.8%	69.3%
香港・ドル	株式	4銘柄	4.7%	5.0%
台湾・ドル	株式	1銘柄	2.1%	2.3%
イギリス・ポンド	株式	4銘柄	8.2%	8.8%

スウェーデン・クローナ	株式	1銘柄	1.1%	1.1%
インド・ルピー	株式	2銘柄	3.2%	3.5%
ブラジル・リアル	株式	1銘柄	0.4%	0.4%
ユーロ	株式	6銘柄	8.9%	9.5%

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	90,628.00	22,305,363.36	
		EQUITY RESIDENTIAL	205,400.00	18,077,254.00	
	アメリカ・ドル小計		296,028.00	40,382,617.36 (4,618,156,121)	
	イギリス・ポンド	DERWENT LONDON PLC	504,013.00	17,287,645.90	
		イギリス・ポンド小計		504,013.00	17,287,645.90 (2,668,002,392)
投資証券合計				7,286,158,513 (7,286,158,513)	
合計				7,286,158,513 (7,286,158,513)	

(注) 金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数		組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	2銘柄	2.5%	63.4%
イギリス・ポンド	投資証券	1銘柄	1.4%	36.6%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

国際ナショナル債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2020年11月19日現在)	(2021年11月19日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	144,888,541	71,103,118
金銭信託	-	6,108,390
コール・ローン	112,697,497	121,791,089
国債証券	4,639,945,019	4,939,063,092
地方債証券	32,668,192	21,192,361

特殊債券	182,080,537	97,220,562
社債券	351,635,639	602,688,429
派生商品評価勘定	21,303,145	31,223,972
未収入金	-	117,922,506
未収利息	18,848,942	18,776,694
前払費用	4,862,657	2,695,628
差入委託証拠金	26,922,239	25,216,217
流動資産合計	5,535,852,408	6,055,002,058
資産合計	5,535,852,408	6,055,002,058
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	24,425,272	33,589,815
未払金	45,160,149	56,182,430
未払解約金	37,296,324	40,124,301
その他未払費用	-	447
流動負債合計	106,881,745	129,896,993
負債合計	106,881,745	129,896,993
純資産の部		
元本等		
元本	1,926,224,873	1,975,527,227
剰余金		
剰余金又は欠損金()	3,502,745,790	3,949,577,838
元本等合計	5,428,970,663	5,925,105,065
純資産合計	5,428,970,663	5,925,105,065
負債純資産合計	5,535,852,408	6,055,002,058

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (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. 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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2020年11月19日現在)	(2021年11月19日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,926,224,873口	1,975,527,227口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.8185円 (1万口当たりの純資産額28,185円)	1口当たり純資産額 2.9993円 (1万口当たりの純資産額29,993円)

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。 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

	<p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用部署の対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない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認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2021年11月19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。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020年11月19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	債券先物取引				
	買建				
	US 2YR NOTE (CBT) DEC20	458,953,652	-	458,553,601	400,051
	小計	458,953,652	-	458,553,601	400,051
	売建				
	AUST 3Y BOND FUTURE DEC20	141,878,583	-	142,428,940	550,357
	EURO BUXL 30Y BND DEC20	54,844,161	-	55,552,526	708,365
	EURO-BOBL FUTURE DEC20	149,442,836	-	149,797,019	354,183
	EURO-BUND FUTURE DEC20	277,845,025	-	279,971,349	2,126,324
	小計	624,010,605	-	627,749,834	3,739,229
	合 計	1,082,964,257	-	1,086,303,435	4,139,280

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
為替予約取引	買建				
	アメリカ・ドル	762,237,690	-	749,820,693	12,416,997
	カナダ・ドル	49,402,141	-	49,242,064	160,077
	オーストラリア・ドル	38,450,585	-	38,045,542	405,043
	イギリス・ポンド	57,341,016	-	56,712,465	628,551

市場取引 以外の取 引	イスラエル・シケ ル	3,721,093	-	3,749,790	28,697
	スイス・フラン	40,392,866	-	39,896,500	496,366
	デンマーク・クロー ネ	5,968,443	-	5,877,348	91,095
	ノルウェー・クロー ネ	12,001,202	-	11,859,980	141,222
	スウェーデン・ク ローナ	36,618,161	-	36,305,954	312,207
	メキシコ・ペソ	113,054,578	-	114,659,600	1,605,022
	チェコ・コルナ	55,388,620	-	55,951,270	562,650
	ロシア・ルーブル	27,573,136	-	27,905,850	332,714
	ポーランド・ズロチ	33,911,945	-	33,582,667	329,278
	ユーロ	848,509,502	-	847,024,308	1,485,194
	小計	2,084,570,978	-	2,070,634,031	13,936,947
	売建				
	アメリカ・ドル	1,387,715,288	-	1,372,670,404	15,044,884
	シンガポール・ドル	3,689,888	-	3,646,449	43,439
	イギリス・ポンド	137,752,516	-	137,959,852	207,336
	イスラエル・シケ ル	109,136,916	-	109,066,527	70,389
	スウェーデン・ク ローナ	90,875,417	-	92,018,984	1,143,567
	メキシコ・ペソ	32,902,820	-	33,770,440	867,620
	チェコ・コルナ	56,310,700	-	55,951,270	359,430
	オフショア・人民元	58,807,650	-	57,849,030	958,620
ユーロ	110,474,732	-	109,778,872	695,860	
小計	1,987,665,927	-	1,972,711,828	14,954,099	
合 計	4,072,236,905	-	4,043,345,859	1,017,152	

(2021年11月19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		
	債券先物取引				
	買建				
	US 10YR NOTE (CBT) DEC21	76,286,154	-	74,664,575	1,621,579
	EURO-BOBL FUTURE DEC21	370,408,379	-	369,040,310	1,368,069
	小計	446,694,533	-	443,704,885	2,989,648
	売建				
	US 2YR NOTE (CBT) DEC21	175,351,793	-	175,545,278	193,485

市場取引	US 5YR NOTE (CBT) DEC21	56,055,859	-	55,600,405	455,454
	CAN 10YR BOND FUT DEC21	91,744,332	-	89,694,478	2,049,854
	AUST 3Y BOND FUTURE DEC21	155,189,179	-	152,147,494	3,041,685
	LONG GILT FUTURE DEC21	413,551,335	-	409,329,459	4,221,876
	EURO BUXL 30Y BND DEC21	190,045,689	-	194,634,027	4,588,338
	EURO-BUND FUTURE DEC21	112,181,370	-	111,297,438	883,932
	小計	1,194,119,557	-	1,188,248,579	5,870,978
	合計	1,640,814,090	-	1,631,953,464	2,881,330

(注) 1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	1,036,988,870	-	1,041,633,032	4,644,162
	カナダ・ドル	145,965,527	-	144,503,382	1,462,145
	イギリス・ポンド	72,764,885	-	72,500,728	264,157
	イスラエル・シケ ル	121,213,626	-	126,525,712	5,312,086
	スイス・フラン	61,452,078	-	60,929,870	522,208
	デンマーク・クロー ネ	2,659,563	-	2,642,004	17,559
	ノルウェー・クロー ネ	14,640,920	-	14,326,572	314,348
	ロシア・ルーブル	26,487,060	-	25,804,578	682,482
	ポーランド・ズロチ	2,807,198	-	2,743,398	63,800
	ユーロ	574,048,872	-	565,762,650	8,286,222
	小計	2,059,028,599	-	2,057,371,926	1,656,673
	売建				
	アメリカ・ドル	1,111,158,729	-	1,117,138,140	5,979,411
	カナダ・ドル	2,625,660	-	2,630,300	4,640
	オーストラリア・ド ル	45,687,357	-	45,646,341	41,016

シンガポール・ドル	103,464,301	-	103,892,902	428,601
ニュージーランド・ドル	30,159,472	-	29,880,522	278,950
イギリス・ポンド	4,158,810	-	4,164,750	5,940
イスラエル・シケル	94,749,862	-	98,431,679	3,681,817
スイス・フラン	60,530,540	-	60,929,870	399,330
スウェーデン・クローナ	44,905,093	-	44,113,327	791,766
メキシコ・ペソ	110,471,825	-	108,915,968	1,555,857
チェコ・コルナ	60,969,149	-	60,251,325	717,824
オフショア・人民元	47,217,208	-	47,521,395	304,187
ロシア・ルーブル	60,390,722	-	58,861,843	1,528,879
マレーシア・リンギット	17,162,228	-	17,103,947	58,281
ユーロ	152,789,592	-	150,548,740	2,240,852
小計	1,946,440,548	-	1,950,031,049	3,590,501
合計	4,005,469,147	-	4,007,402,975	5,247,174

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2020年11月20日 至 2021年11月19日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2020年11月19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	1,948,672,428円
同期中における追加設定元本額	286,222,459円

同期中における一部解約元本額	308,670,014円
2020年11月19日現在の元本の内訳	
大和住銀DC外国債券ファンド	1,230,759,236円
大和住銀DC年金設計ファンド30	127,319,557円
大和住銀DC年金設計ファンド50	264,678,370円
大和住銀DC年金設計ファンド70	243,028,821円
大和住銀/T・ロウ・プライス外国債券ファンドVA	18,992,831円
大和住銀年金設計ファンド30VA(適格機関投資家専用)	556,733円
大和住銀年金設計ファンド50VA(適格機関投資家専用)	2,727,184円
大和住銀年金設計ファンド70VA(適格機関投資家専用)	1,000,030円
大和住銀バランスファンド60(適格機関投資家限定)	34,975,767円
大和住銀世界資産バランスVA(適格機関投資家限定)	2,186,344円
合計	1,926,224,873円

(2021年11月19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	1,926,224,873円
同期中における追加設定元本額	256,012,759円
同期中における一部解約元本額	206,710,405円
2021年11月19日現在の元本の内訳	
大和住銀DC外国債券ファンド	1,187,388,922円
大和住銀DC年金設計ファンド30	135,809,409円
大和住銀DC年金設計ファンド50	289,492,095円
大和住銀DC年金設計ファンド70	302,926,690円
大和住銀/T・ロウ・プライス外国債券ファンドVA	15,654,075円
大和住銀年金設計ファンド30VA(適格機関投資家専用)	562,306円
大和住銀年金設計ファンド50VA(適格機関投資家専用)	3,019,804円
大和住銀年金設計ファンド70VA(適格機関投資家専用)	883,839円
大和住銀バランスファンド60(適格機関投資家限定)	36,895,043円
大和住銀世界資産バランスVA(適格機関投資家限定)	2,895,044円
合計	1,975,527,227円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	HUNGARY	200,000.00	196,116.00	
		TREASURY BILL	10,000,000.00	9,997,000.00	
		TSY INFL IX N/B	840,000.00	1,057,164.66	
		TSY INFL IX N/B	170,000.00	220,783.67	

	US TREASURY N/B	671,000.00	836,649.75	
	US TREASURY N/B	598,000.00	583,725.74	
	US TREASURY N/B	330,000.00	323,373.60	
	US TREASURY N/B	4,011,000.00	4,039,197.33	
	US TREASURY N/B	1,990,000.00	2,170,333.77	
	US TREASURY N/B	547,000.00	569,563.75	
	US TREASURY N/B	730,000.00	719,217.90	
	US TREASURY N/B	2,044,000.00	2,018,756.60	
	US TREASURY N/B	191,000.00	186,820.92	
	アメリカ・ドル小計	22,322,000.00	22,918,703.69 (2,620,982,954)	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT	671,000.00	672,690.92	
	カナダ・ドル小計	671,000.00	672,690.92 (61,053,428)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	174,000.00	193,811.64	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	420,000.00	355,874.40	
	オーストラリア・ドル小計	594,000.00	549,686.04 (45,733,880)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,482,000.00	1,512,114.24	
	シンガポール・ドル小計	1,482,000.00	1,512,114.24 (127,456,109)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	385,000.00	370,751.15	
	ニュージーランド・ドル小計	385,000.00	370,751.15 (29,841,760)	
イギリス・ポンド	UK GILT	1,227,000.00	1,089,318.33	
	UK GILT	660,000.00	654,291.00	
	イギリス・ポンド小計	1,887,000.00	1,743,609.33 (269,091,228)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND	1,320,000.00	1,700,846.40	
	イスラエル・シュケル小計	1,320,000.00	1,700,846.40 (63,037,450)	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,538,000.00	5,442,192.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,300,000.00	2,314,352.00	
	MEXICAN UDIBONOS	490,000.00	3,353,330.20	
	メキシコ・ペソ小計	8,328,000.00	11,109,874.80 (61,185,413)	

チェコ・ コルナ	CZECH REPUBLIC	12,140,000.00	11,186,767.20	
チェコ・コルナ小計		12,140,000.00	11,186,767.20 (57,501,102)	
ロシア・ ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,650,000.00	19,212,140.50	
ロシア・ルーブル小計		20,650,000.00	19,212,140.50 (29,970,939)	
マレーシ ア・リン ギット	MALAYSIA GOVERNMENT	520,000.00	502,065.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,113,893.00	
マレーシア・リングット小計		1,620,000.00	1,615,958.20 (44,220,858)	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	483,000.00	546,731.85	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	183,000.00	254,596.92	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	202,000.00	317,331.90	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	266,000.00	290,825.78	
	BUNDESobligation	700,000.00	708,218.00	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	452,000.00	618,200.40	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	655,000.00	643,570.25	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	292,000.00	284,518.96	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	453,047.63	
	CROATIA	100,000.00	101,948.00	
	DEUTSCHLAND I/L BOND	1,500,000.00	1,821,073.11	
	FRANCE OAT.	1,367,000.00	1,687,930.59	
	FRANCE OAT.	800,000.00	911,307.20	
	IRISH GOVT TREASURY	75,000.00	88,458.75	
	IRISH GOVT TREASURY	640,000.00	628,108.80	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	230,000.00	315,339.20	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	215,454.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	187,000.00	303,768.41	
	REPUBLIC OF CHILE	245,000.00	245,519.40	
	REPUBLIC OF CYPRUS	240,000.00	257,001.60	
	REPUBLIC OF ICELAND	200,000.00	203,748.00	
	REPUBLIC OF ICELAND	134,000.00	132,262.02	
	REPUBLIC OF INDONESIA	100,000.00	116,662.00	
	REPUBLIKA SLOVENIJA	36,000.00	33,460.56	
	ROMANIA	158,000.00	161,799.90	
	ROMANIA	190,000.00	186,486.90	
	ROMANIA	80,000.00	73,475.20	
	ROMANIA	60,000.00	57,761.40	
UNITED MEXICAN STATES	100,000.00	103,744.00		
ユーロ小計		10,235,000.00	11,762,350.73 (1,528,987,971)	

国債証券合計				4,939,063,092 (4,939,063,092)	
地方債証券	アメリカ・ドル	ONTARIO (PROVINCE OF)	190,000.00	185,312.70	
		アメリカ・ドル小計	190,000.00	185,312.70 (21,192,361)	
地方債証券合計				21,192,361 (21,192,361)	
特殊債券	オーストラリア・ドル	KFW	340,000.00	342,662.20	
		NEW S WALES TREASURY CRP	141,000.00	156,082.77	
		オーストラリア・ドル小計	481,000.00	498,744.97 (41,495,582)	
	ユーロ	EUROPEAN UNION	51,000.00	49,598.52	
		HUNGARIAN DEVELOPMENT BA	100,000.00	100,194.00	
		INT BK RECON & DEVELOP	307,000.00	278,894.15	
	ユーロ小計	458,000.00	428,686.67 (55,724,980)		
特殊債券合計				97,220,562 (97,220,562)	
社債券	アメリカ・ドル	ABU DHABI PORTS CO PJSC	200,000.00	201,046.00	
		ASTRAZENECA FINANCE LLC	60,000.00	59,637.60	
		ASTRAZENECA FINANCE LLC	10,000.00	10,084.40	
		BANK OF AMERICA CORP	100,000.00	100,897.00	
		OOREDOO INTL FINANCE	200,000.00	201,896.00	
		PETROLEOS MEXICANOS	80,000.00	75,872.80	
		QATAR PETROLEUM	200,000.00	197,922.00	
		SA GLOBAL SUKUK LTD	200,000.00	197,684.00	
		SA GLOBAL SUKUK LTD	200,000.00	197,506.00	
		SBA TOWER TRUST	45,000.00	44,499.60	
		SOUTHERN COPPER CORP	30,000.00	37,519.50	
		WELLS FARGO & COMPANY	40,000.00	54,423.20	
	アメリカ・ドル小計	1,365,000.00	1,378,988.10 (157,701,079)		
	オーストラリア・ドル	LLOYDS BANK PLC	250,000.00	252,245.00	
		オーストラリア・ドル小計	250,000.00	252,245.00 (20,986,784)	
イギリス・ポンド	BERKSHIRE HATHAWAY FIN	100,000.00	106,527.00		
	LLOYDS BK CORP MKTS PLC	100,000.00	101,000.00		
	ORSTED A/S	100,000.00	104,545.00		
イギリス・ポンド小計	300,000.00	312,072.00 (48,162,072)			

デンマーク・クローネ	REALKREDIT DANMARK	1,400,000.00	1,475,250.00	
デンマーク・クローネ小計		1,400,000.00	1,475,250.00 (25,787,370)	
スウェーデン・クローナ	NORDEA HYPOTEK AB	2,100,000.00	2,109,408.00	
	SWEDBANK HYPOTEK AB	400,000.00	402,568.00	
スウェーデン・クローナ小計		2,500,000.00	2,511,976.00 (32,354,251)	
ユーロ	ARION BANKI HF	100,000.00	100,623.00	
	AVINOR AS	100,000.00	101,816.00	
	CITIGROUP INC	100,000.00	103,657.00	
	CZECH GAS NETWORKS INV	100,000.00	103,780.00	
	DEUTSCHE BAHN FIN GMBH	380,000.00	379,988.60	
	DEUTSCHE BAHN FIN GMBH	266,000.00	243,004.30	
	ENI SPA	100,000.00	104,884.00	
	FERRARI NV	100,000.00	104,086.00	
	HETA ASSET RESOLUTION AG	200,000.00	206,396.00	
	HOLCIM FINANCE LUX SA	100,000.00	101,571.00	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS	100,000.00	101,895.00	
	ISLANDSBANKI	160,000.00	161,641.60	
	JPMORGAN CHASE & CO	100,000.00	99,407.00	
	LANDSBANKINN HF	100,000.00	99,779.00	
	LIBERTY MUTUAL GROUP INC	100,000.00	110,418.00	
	PETROLEOS MEXICANOS	100,000.00	104,626.00	
	TELE2 AB	110,000.00	109,324.60	
WELLS FARGO & COMPANY	100,000.00	107,113.00		
ユーロ小計		2,416,000.00	2,444,010.10 (317,696,873)	
社債券合計			602,688,429 (602,688,429)	
合計			5,660,164,444 (5,660,164,444)	

(注)金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	13銘柄	44.2%	46.3%
	地方債証券	1銘柄	0.4%	0.4%
	社債券	12銘柄	2.7%	2.8%
カナダ・ドル	国債証券	1銘柄	1.0%	1.1%
オーストラリア・ドル	国債証券	2銘柄	0.8%	0.8%
	特殊債券	2銘柄	0.7%	0.7%

	社債券	1銘柄	0.4%	0.4%
シンガポール・ドル	国債証券	1銘柄	2.2%	2.3%
ニュージーランド・ドル	国債証券	1銘柄	0.5%	0.5%
イギリス・ポンド	国債証券	2銘柄	4.5%	4.8%
	社債券	3銘柄	0.8%	0.9%
イスラエル・シケル	国債証券	1銘柄	1.1%	1.1%
デンマーク・クローネ	社債券	1銘柄	0.4%	0.5%
スウェーデン・クローナ	社債券	2銘柄	0.5%	0.6%
メキシコ・ペソ	国債証券	3銘柄	1.0%	1.1%
チェコ・コルナ	国債証券	1銘柄	1.0%	1.0%
ロシア・ルーブル	国債証券	1銘柄	0.5%	0.5%
マレーシア・リングgit	国債証券	2銘柄	0.7%	0.8%
ユーロ	国債証券	29銘柄	25.8%	27.0%
	特殊債券	3銘柄	0.9%	1.0%
	社債券	18銘柄	5.4%	5.6%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

大和住銀DC年金設計ファンド30

2021年12月30日現在

資産総額	4,096,827,273円
負債総額	5,611,727円
純資産総額（ - ）	4,091,215,546円
発行済口数	2,098,874,547口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.9492円 (19,492円)

大和住銀DC年金設計ファンド50

2021年12月30日現在

資産総額	9,108,774,024円
負債総額	19,183,140円
純資産総額（ - ）	9,089,590,884円
発行済口数	3,511,969,475口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	2.5882円 (25,882円)

大和住銀DC年金設計ファンド70

2021年12月30日現在

資産総額	8,995,961,334円
負債総額	29,405,186円
純資産総額（ - ）	8,966,556,148円
発行済口数	2,638,920,779口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	3.3978円 (33,978円)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券は発行されません。

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

八 受益者に対する特典

ありません。

二 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

- a. 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記aの申請のある場合には、上記aの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記aの振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記aの振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

ホ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議の上、社振法に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

ヘ 償還金

償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	2021年12月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

八 会社の機構

委託会社の取締役は8名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

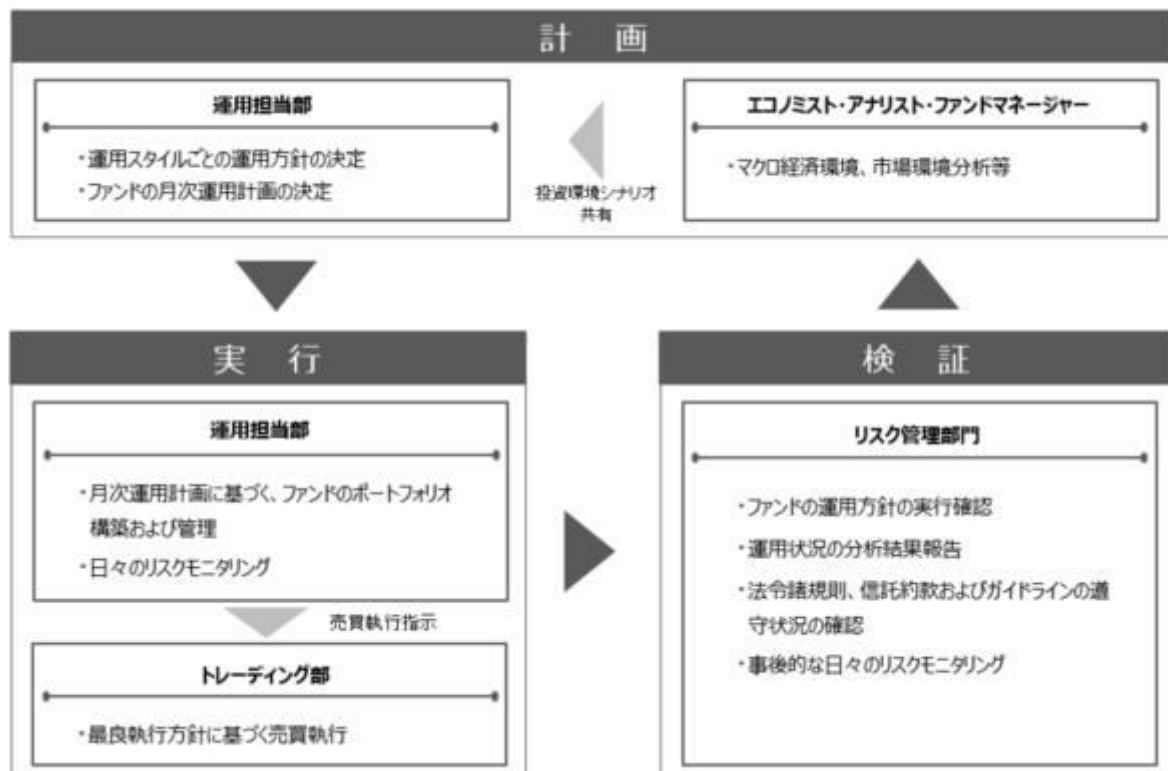
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名を選定することができます。

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年12月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託(親投資信託は除きます)は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	732	9,624,127
単位型株式投資信託	102	551,334
追加型公社債投資信託	1	27,985
単位型公社債投資信託	189	415,688
合計	1,024	10,619,135

3【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、当中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2 当社は、第36期(2020年4月1日から2021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37期中間会計期間(2021年4月1日から2021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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	33,264,545	33,048,142
顧客分別金信託	300,021	300,036
前払費用	515,226	449,748
未収入金	602,605	132,419
未収委託者報酬	8,404,880	9,936,096
未収運用受託報酬	2,199,785	2,247,156
未収投資助言報酬	299,826	398,108
未収収益	37,702	39,975

その他の流動資産		40,119	6,981
流動資産合計		45,664,712	46,558,665
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		101,609	1,509,450
器具備品		783,224	870,855
土地		710	710
リース資産		968	13,483
建設仮勘定		66,498	-
有形固定資産合計		953,010	2,394,500
無形固定資産			
ソフトウェア		909,133	1,347,889
ソフトウェア仮勘定		508,733	1,029,033
のれん		34,397,824	3,654,491
顧客関連資産		17,785,166	15,671,890
電話加入権		12,739	12,727
商標権		54	48
無形固定資産合計		53,613,651	21,716,080
投資その他の資産			
投資有価証券		19,436,480	22,866,282
関係会社株式		11,246,398	11,246,398
長期差入保証金		2,523,637	1,409,091
長期前払費用		113,852	116,117
会員権		90,479	90,479
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産合計		33,390,098	35,707,619
固定資産合計		87,956,760	59,818,200
資産合計		133,621,473	106,376,866

(単位：千円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	1,064	5,153
顧客からの預り金	14,285	20,077
その他の預り金	146,200	169,380
未払金		
未払収益分配金	1,629	1,646
未払償還金	131,338	43,523
未払手数料	3,776,873	4,480,697
その他未払金	502,211	270,290
未払費用	3,935,582	5,940,121
未払消費税等	305,513	235,647
未払法人税等	489,151	762,648
賞与引当金	1,716,321	1,516,622
その他の流動負債	30,951	9,710
流動負債合計	11,051,125	13,455,519
固定負債		
リース債務	-	9,678
繰延税金負債	2,963,538	2,566,958
退職給付引当金	5,299,814	5,258,448
賞与引当金	14,767	-
その他の固定負債	172,918	40,950
固定負債合計	8,451,038	7,876,035

負債合計	19,502,164	21,331,554
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	81,927,000	81,927,000
資本剰余金合計	90,555,984	90,555,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	19,364,265	10,281,242
利益剰余金合計	21,185,470	8,460,037
株主資本計	113,741,454	84,095,946
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	377,855	949,365
評価・換算差額等合計	377,855	949,365
純資産合計	114,119,309	85,045,311
負債・純資産合計	133,621,473	106,376,866

(2) 【損益計算書】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	54,615,133	50,610,457
運用受託報酬	9,389,058	9,450,169
投資助言報酬	1,303,595	1,270,584
その他営業収益		
サービス支 hands 手数料	181,061	200,807
その他	32,421	32,820
営業収益計	65,521,269	61,564,839
営業費用		
支払手数料	24,888,040	22,784,919
広告宣伝費	447,024	365,317
調査費		
調査費	3,214,679	3,061,987
委託調査費	7,702,309	7,810,157
営業雑経費		
通信費	70,007	95,163
印刷費	612,249	554,920
協会費	45,117	40,044
諸会費	32,199	29,473
情報機器関連費	4,349,174	4,562,612
販売促進費	68,688	23,614
その他	154,201	163,332
営業費用合計	41,583,691	39,491,542
一般管理費		
給料		

役員報酬	264,325	277,027
給料・手当	9,789,691	9,280,730
賞与	914,702	950,630
賞与引当金繰入額	1,726,013	1,501,855
交際費	30,898	11,815
寄付金	2,022	949
事務委託費	956,931	844,255
旅費交通費	249,359	21,023
租税公課	389,032	389,819
不動産賃借料	1,121,553	1,639,529
退職給付費用	797,158	790,144
固定資産減価償却費	3,044,658	3,040,894
のれん償却費	2,645,986	2,645,986
諸経費	482,324	608,206
一般管理費合計	22,414,658	22,002,869
営業利益	1,522,919	70,426

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	778,113	13,164
受取利息	947	2,736
時効成立分配金・償還金	1,041	88,335
原稿・講演料	2,061	2,603
投資有価証券償還益	6,398	57,388
投資有価証券売却益	24,206	162,941
雑収入	53,484	72,933
営業外収益合計	866,254	400,104
営業外費用		
為替差損	72,457	766
投資有価証券償還損	129,006	11,762
投資有価証券売却損	12,906	34,473
雑損失	8,334	1,240
営業外費用合計	222,704	48,243
経常利益	2,166,469	422,288
特別損失		
固定資産除却損	1 110,668	54,493
減損損失	2 46,417	28,097,346
合併関連費用	42,800	-
早期退職費用	3 -	216,200
本社移転費用	4 133,168	127,044
その他特別損失	-	5,460
特別損失合計	333,054	28,500,544
税引前当期純利益又は 税引前当期純損失()	1,833,414	28,078,256
法人税、住民税及び事業税	1,874,278	1,549,173
法人税等調整額	619,676	693,192
法人税等合計	1,254,602	855,980

当期純利益又は
当期純損失()

578,811

28,934,237

(3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

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

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304
当期変動額					
剰余金の配当	2,469,600	2,469,600			2,469,600
当期純利益	578,811	578,811			578,811
合併による増加		81,927,000			81,927,000
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)			216,206	216,206	216,206
当期変動額合計	1,890,788	80,036,211	216,206	216,206	79,820,005
当期末残高	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265
当期変動額								
剰余金の配当								711,271
当期純損失()								28,934,237

株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）				-				
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	29,645,508
当期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309
当期変動額					
剰余金の配当	711,271	711,271		-	711,271
当期純損失（ ）	28,934,237	28,934,237		-	28,934,237
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	571,510	571,510	571,510
当期変動額合計	29,645,508	29,645,508	571,510	571,510	29,073,997
当期末残高	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 4～15年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん 14年

顧客関連資産 6～19年

ソフトウェア（自社利用分） 5年（社内における利用可能期間）

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. 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。

(会計方針の変更)

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

(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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
建物	466,875千円	102,329千円
器具備品	1,225,261千円	1,153,649千円
リース資産	1,452千円	2,830千円

2 当座借越契約

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

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

3 保証債務

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

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	132,559千円	93,374千円

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
建物	879千円	18,278千円
器具備品	119千円	28,604千円
リース資産	5,377千円	- 千円
ソフトウェア	1,596千円	7,610千円
ソフトウェア仮勘定	102,695千円	- 千円

2 減損損失

前事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

場所	用途	種類	減損損失
千代田区	事業用資産	建物	46,417

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

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

当事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

(単位:千円)

場所	用途	種類	減損損失
-	その他	のれん	28,097,346

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

当社は、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に伴って発生したのれんを計上しております。当該のれんについて下期以降の業績は上向いているものの、通期では業績計画を下回る結果となったことを踏まえて将来キャッシュ・フローを見直した結果、のれんの帳簿価額の回収が見込まれなくなったため、帳簿価額を回収可能価額まで減損し、当該減少額を減損損失として計上しております。

なお、回収可能価額は使用価値としており、将来キャッシュ・フローを9.2%で割り引いて算出しております。

3 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

4 本社移転費用

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

当事業年度の本社移転費用は、本社移転に伴うものであり、主に設備撤去費用、引越費用などであります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

合併に伴う普通株式の発行により16,230,060株増加しております。

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640,000株	16,230,060株	-	33,870,060株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月24日 臨時株主総会	普通株式	2,469,600	140.00	2019年 3月28日	2019年 6月25日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	711,271	21.00	2020年 3月31日	2020年 6月30日

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

2. 剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

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

2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	711,271	21.00	2020年 3月31日	2020年 6月30日
----------------------	------	---------	-------	----------------	----------------

(リース取引関係)

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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
1年以内	1,618,641	1,194,699
1年超	5,844,934	3,497,258
合計	7,463,576	4,691,958

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っています。そのため、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っていません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

長期差入保証金についても、差入先の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

市場リスクの管理

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

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

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、市場価格のないものは、次表には含まれていません(注2)参照)。

前事業年度(2020年3月31日)

(単位：千円)

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

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

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	33,048,142	33,048,142	-
(2)顧客分別金信託	300,036	300,036	-
(3)未収委託者報酬	9,936,096	9,936,096	-
(4)未収運用受託報酬	2,247,156	2,247,156	-
(5)未収投資助言報酬	398,108	398,108	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	22,826,472	22,826,472	-
(7)長期差入保証金	1,409,091	1,409,091	-
資産計	70,165,105	70,165,105	-
(1)顧客からの預り金	20,077	20,077	-
(2)未払手数料	4,480,697	4,480,697	-
負債計	4,500,774	4,500,774	-

（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）市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

区分	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	45,369	39,809
合計	45,369	39,809
子会社株式 非上場株式	11,246,398	11,246,398
合計	11,246,398	11,246,398

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

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

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

（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（2020年3月31日）

（単位：千円）

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	33,264,545	-	-	-
顧客分別金信託	300,021	-	-	-
未収委託者報酬	8,404,880	-	-	-
未収運用受託報酬	2,199,785	-	-	-
未収投資助言報酬	299,826	-	-	-
長期差入保証金	1,125,292	1,398,345	-	-
合計	45,594,350	1,398,345	-	-

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	33,048,142	-	-	-
顧客分別金信託	300,036	-	-	-
未収委託者報酬	9,936,096	-	-	-
未収運用受託報酬	2,247,156	-	-	-
未収投資助言報酬	398,108	-	-	-
長期差入保証金	42,007	1,367,084	-	-
合計	45,971,548	1,367,084	-	-

(有価証券関係)

1.子会社株式

前事業年度(2020年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円)は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度(2021年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円)は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2.その他有価証券

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	12,411,812	13,327,652	915,839
小計	12,411,812	13,327,652	915,839
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,413,317	6,063,458	349,858
小計	6,413,317	6,063,458	349,858
合計	18,825,130	19,391,111	565,980

(注)非上場株式等(貸借対照表計上額 45,369千円)については、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度(2021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	14,397,606	16,097,433	1,699,827
小計	14,397,606	16,097,433	1,699,827
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,994,762	6,729,039	265,723
小計	6,994,762	6,729,039	265,723
合計	21,392,369	22,826,472	1,434,103

(注)非上場株式等(貸借対照表計上額 39,809千円)については、市場価格がないことから、記載しておりません。

3.事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,814,360	24,206	12,906

(単位:千円)

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,978,622	162,941	34,473

(単位：千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
1,630,219	57,388	11,762

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、投資有価証券について1,560千円（その他有価証券1,560千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

(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 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,418,601	5,299,814
勤務費用	523,396	476,308
利息費用	-	-
数理計算上の差異の発生額	195	67,476
退職給付の支払額	349,050	585,151
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による発生額	1,707,062	-
退職給付債務の期末残高	5,299,814	5,258,448

(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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	5,299,814	5,258,448
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	5,299,814	5,258,448

(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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	492,511	476,308
利息費用	-	-
数理計算上の差異の費用処理額	195	67,476
その他	304,842	246,359
確定給付制度に係る退職給付費用	797,158	790,144

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

	前事業年度	当事業年度
	(自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月 31日)	(自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月 31日)
割引率	0.000%	0.020%

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248,932千円、当事業年度239,162千円であります。

(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 (2020年 3月 31日)	当事業年度 (2021年 3月 31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,622,803	1,610,136
賞与引当金	530,059	464,389
調査費	178,573	247,208
未払金	162,557	206,090
未払事業税	46,423	66,891
ソフトウェア償却	91,937	90,431
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	150,771	131,391
その他	88,250	35,930
繰延税金資産小計	2,986,254	2,967,346
評価性引当額(注)	193,485	218,966
繰延税金資産合計	2,792,768	2,748,380
繰延税金負債		
無形固定資産	5,445,817	4,798,732
その他有価証券評価差額金	310,488	516,605
繰延税金負債合計	5,756,306	5,315,338
繰延税金資産(負債)の純額	2,963,538	2,566,958

(注) 評価性引当額が25,480千円増加しております。この増加の内容は、主としてその他有価証券評価差額金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	当事業年度
	(2020年 3月 31日)	(2021年 3月 31日)
法定実効税率	30.6%	税引前当期純損失のため 記載を省略して おります。
(調整)		
評価性引当額の増減	3.5	
受取配当等永久に益金に算入されない項目	13.9	
交際費等永久に損金に算入されない項目	7.3	
住民税均等割等	0.5	
所得税額控除による税額控除	0.5	
のれん償却費	44.1	
その他	3.3	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	68.4	

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月 31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	54,615,133	9,389,058	1,303,595	213,482	65,521,269

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至2021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	50,610,457	9,450,169	1,270,584	233,628	61,564,839

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金、出資金 又は基金	事業の 内容又 は職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社 の 子会社	㈱三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,703,669	未払 手数料	644,246
親会社 の 子会社	SMBC日興 証券㈱	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	6,265,593	未払 手数料	890,935

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金、出資金 又は基金	事業の 内容又 は職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社 の 子会社	㈱三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,728,851	未払 手数料	863,159
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	5,578,226	未払 手数料	1,070,559

(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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	3,369.33円	2,510.93円
1株当たり当期純利益又は 1株当たり当期純損失()	17.09円	854.27円

(注) 1. 前事業年度の潜在株式調整後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いません。

当事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、1株当たり当期純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載していません。

2. 1株当たり当期純利益又は1株当たり当期純損失の算定上の基礎は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり当期純利益又は当期純損失		
当期純利益又は当期純損失()(千円)	578,811	28,934,237
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又は 当期純損失()(千円)	578,811	28,934,237
期中平均株式数(株)	33,870,060	33,870,060

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第37期中間会計期間 (2021年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	38,529,337
顧客分別金信託	300,038
前払費用	518,490
未収委託者報酬	10,909,133
未収運用受託報酬	2,723,571
未収投資助言報酬	399,072
未収収益	39,947
その他	224,189
流動資産合計	53,643,782
固定資産	
有形固定資産	1 2,218,463
無形固定資産	
のれん	3,502,221
顧客関連資産	14,615,253
その他	2,778,211
無形固定資産合計	20,895,685
投資その他の資産	
投資有価証券	22,000,657
関係会社株式	11,246,398
その他	1,595,579
貸倒引当金	20,750
投資その他の資産合計	34,821,886
固定資産合計	57,936,035
資産合計	111,579,818
負債の部	
流動負債	
リース債務	3,567
顧客からの預り金	12,736
その他の預り金	100,610
未払金	5,104,509
未払費用	7,204,066
未払法人税等	1,493,440
前受収益	32,829
賞与引当金	1,725,017

その他	2	695,069
流動負債合計		16,371,848
固定負債		
リース債務		6,309
繰延税金負債		2,389,323
退職給付引当金		5,414,560
その他		40,950
固定負債合計		7,851,143
負債合計		24,222,992
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
その他資本剰余金		73,466,962
資本剰余金合計		82,095,946
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		1,761,706
利益剰余金合計		2,045,951
株主資本合計		86,141,897
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,214,928
評価・換算差額等合計		1,214,928
純資産合計		87,356,826
負債純資産合計		111,579,818

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		32,740,035
運用受託報酬		4,392,826
投資助言報酬		633,982
その他の営業収益		117,708
営業収益計		37,884,552
営業費用		25,219,811
一般管理費	1	9,605,282
営業利益		3,059,458
営業外収益	2	198,028
営業外費用	3	26,126
経常利益		3,231,360
特別損失	4	146,753
税引前中間純利益		3,084,607
法人税、住民税及び事業税		1,373,478
法人税等調整額		334,822
法人税等合計		1,038,655
中間純利益		2,045,951

(3)中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242
当中間期変動額								
欠損填補			8,460,037	8,460,037				8,460,037
中間純利益								2,045,951
任意積立金の取崩						60,000	1,476,959	1,536,959
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	-	-	8,460,037	8,460,037	-	60,000	1,476,959	12,042,949
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	-	-	1,761,706

	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	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311
当中間期変動額					
欠損填補	8,460,037	-			-
中間純利益	2,045,951	2,045,951			2,045,951
任意積立金の取崩					
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）			265,562	265,562	265,562
当中間期変動額合計	10,505,989	2,045,951	265,562	265,562	2,311,514
当中間期末残高	2,045,951	86,141,897	1,214,928	1,214,928	87,356,826

注記事項

（重要な会計方針）

1．資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産（リース資産を除く）

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	4～15年

(2)無形固定資産(リース資産を除く)

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア(自社利用分)	5年(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. 収益及び費用の計上基準

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下、「収益認識会計基準」という。)等を適用しており、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

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

(1)委託者報酬

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

(2)運用受託報酬

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

(3)投資助言報酬

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

5. 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。

(会計方針の変更)

「収益認識会計基準」等を当中間会計期間の期首から適用し、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

当該会計基準等の適用が中間財務諸表に及ぼす影響はありません。

(中間貸借対照表関係)

第37期中間会計期間 (2021年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,320,556千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	
当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額73,437千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1.一般管理費のうち主要なもの	
のれん償却費	152,270千円
減価償却実施額	
有形固定資産	191,604千円
無形固定資産	1,304,363千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
為替差益	6,622千円
受取配当金	4,755千円
投資有価証券償還益	90,952千円
投資有価証券売却益	48,142千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	15,001千円
投資有価証券売却損	8,258千円
4.特別損失のうち主要なもの	
システム統合関連費用	145,261千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

発行済株式数に関する事項

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

(リース取引関係)

第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021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	1,179,776千円
1年超	2,903,862千円
合計	4,083,639千円

(金融商品関係)

1.金融商品の時価等に関する事項

第37期中間会計期間(2021年9月30日)

2021年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	38,529,337	38,529,337	-
(2)顧客分別金信託	300,038	300,038	-
(3)未収委託者報酬	10,909,133	10,909,133	-
(4)未収運用受託報酬	2,723,571	2,723,571	-
(5)未収投資助言報酬	399,072	399,072	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	21,960,848	21,960,848	-
(7)投資その他の資産 長期差入保証金	1,408,170	1,408,170	-
資産計	76,230,173	76,230,173	-
(1)顧客からの預り金	12,736	12,736	-
(2)未払金 未払手数料	4,996,181	4,996,181	-
負債計	5,008,917	5,008,917	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

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

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(6)投資有価証券

 その他有価証券

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

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

(7)投資その他の資産

 長期差入保証金

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

負債

(1)顧客からの預り金、及び(2)未払金 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2)市場価格のない金融商品

(単位:千円)

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	39,809
合計	39,809
子会社株式 非上場株式	11,246,398
合計	11,246,398

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

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

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

(有価証券関係)

第37期中間会計期間(2021年9月30日)

1.子会社株式

子会社株式(中間貸借対照表計上額 11,246,398千円)は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2.その他有価証券

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	16,269,607	14,102,355	2,167,252
小計	16,269,607	14,102,355	2,167,252
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	5,691,240	6,001,639	310,398
小計	5,691,240	6,001,639	310,398
合計	21,960,848	20,103,994	1,856,853

(注)非上場株式等(中間貸借対照表計上額 39,809千円)については、市場価格がないことから、記載しておりません。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(収益認識関係)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

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

(セグメント情報等)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位:千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	32,740,035	4,392,826	633,982	117,708	37,884,552

(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37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,579円18銭
1株当たり中間純利益	60円41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。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- イ 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
 - (イ) 定款の変更
該当ありません。
 - (ロ) その他の重要事項
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(2019年4月1日付)に伴って発生したのれんについて、2021年3月期決算において28,097,346千円の減損損失を計上しました。
- 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。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

- イ 受託会社
 - (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
 - (ロ) 資本金の額 342,037百万円(2021年3月末現在)

- (八) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 株式会社日本カストディ銀行
- ・ 資本金の額 51,000百万円(2021年3月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

名称	資本金の額(百万円) 2021年3月末現在	事業の内容
株式会社三井住友銀行	1,770,996	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	1,404,065	
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
三井住友信託銀行株式会社	342,037	
大和証券株式会社	100,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

ハ 投資顧問会社(運用の委託先)

名称	資本金の額 2021年9月末現在	事業の内容
ティー・ロウ・プライス・アソシエイツ・インク (T.Rowe Price Associates, Inc.)	24.5百万米ドル	投資運用業を営んでいます。
ティー・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド (T.Rowe Price International Ltd)	174.1百万米ドル	投資運用業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書(目論見書)の提供、一部解約の実行の請求の受け付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

ハ 投資顧問会社(運用の委託先)

委託会社との間で締結される投資一任契約(運用委託契約)に基づき、当ファンドの主要投資対象のうちインターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンド

の運用指図に関する権限の委託を受け、信託財産の運用を行います。

3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）

該当事項はありません。

第3【その他】

- 1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について
 - (1) 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。
 - (2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。
 - (3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス（これらのアドレスをコード化した図形等も含む）を記載することがあります。
 - (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
 - (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
 - (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
 - (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべき旨を記載することがあります。
 - (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
 - (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
 - (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
 - (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
- 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
- 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。
- 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
- 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書（交付目論見書）および投資信託説明書（請求目論見書）を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2021年6月15日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 羽 太 典 明 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕 印**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財

務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年12月28日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 石井 勝也

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド30の2020年11月20日から2021年11月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀DC年金設計ファンド30の2021年11月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2021年12月28日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 石井 勝也
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 栄裕
業務執行社員**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド50の2020年11月20日から2021年11月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀DC年金設計ファンド50の2021年11月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2021年12月28日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 石井 勝也
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 栄裕
業務執行社員**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド70の2020年11月20日から2021年11月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀DC年金設計ファンド70の2021年11月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2021年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

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 羽 太 典 明指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2021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（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の

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

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2 . 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。