【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成23年６月２日
【計算期間】	第11期（自　平成22年３月９日　至　平成23年３月７日）
【ファンド名】	三井住友・年金プラン30
	三井住友・年金プラン50
	三井住友・年金プラン70
【発行者名】	三井住友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　前田　良治
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目５番１号
【事務連絡者氏名】	隠地　保夫
【連絡場所】	東京都港区愛宕二丁目５番１号
【電話番号】	03-5405-0735
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【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】

イ 当ファンドは、親投資信託である国内株式マザーファンド（Ｂ号）、国内債券マザーファンド（Ｂ号）、外国株式マザーファンド（Ｂ号）および外国債券マザーファンド（Ｂ号）の受益証券への投資を通じて、実質的に内外の株式、債券への分散投資を行い、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。
※以下、上記各親投資信託を総称して、あるいはそれぞれを「マザーファンド」ということがあります。

ロ 各ファンドについて、委託会社が独自に作成した合成指数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。詳細については、後述の「２ 投資方針」をご参照ください。

ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドにつき、それぞれ金2,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	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。
投資対象地域	内外	目論見書または信託約款において、国内およ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。
投資対象資産（収益の源泉）	資産複合	目論見書または信託約款において、株式、債券、不動産投信、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。

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	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））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式および債券であり、ファンドの収益は株式市場、債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年１回	目論見書または信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいいます。

投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

≪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
追加型	海外	債券
	内外	不動産投信
		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。

≪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		
	年4回	北米		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　）	年6回（隔月）	欧州	**ファミリーファンド**	あり
	年12回（毎月）	アジア		
	日々	オセアニア		
	その他 （　　）	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	**なし**
不動産投信		アフリカ		
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））		中近東（中東）		
		エマージング		
資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型				

（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。

※商品分類、属性区分は、社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は社団法人投資信託協会のホームページ（http://www.toushin.or.jp/）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

平成12年９月19日　信託契約締結、設定、運用開始。
（設定時の委託会社は住友ライフ・インベストメント株式会社）

平成13年９月27日　「SLIバランス・プラン30」、「SLIバランス・プラン50」、「SLIバランス・プラン70」から「住友ライフ・年金プラン30」、「住友ライフ・年金プラン50」、「住友ライフ・年金プラン70」に名称を変更。

平成14年12月１日　三井住友アセットマネジメント株式会社が、合併によりファンドの委託会社としての業務を承継。「住友ライフ・年金プラン30」、「住友ライフ・年金プラン50」、「住友ライフ・年金プラン70」から「三井住友・年金プラン30」、「三井住友・年金プラン50」、「三井住友・年金プラン70」に名称を変更。

（３）【ファンドの仕組み】

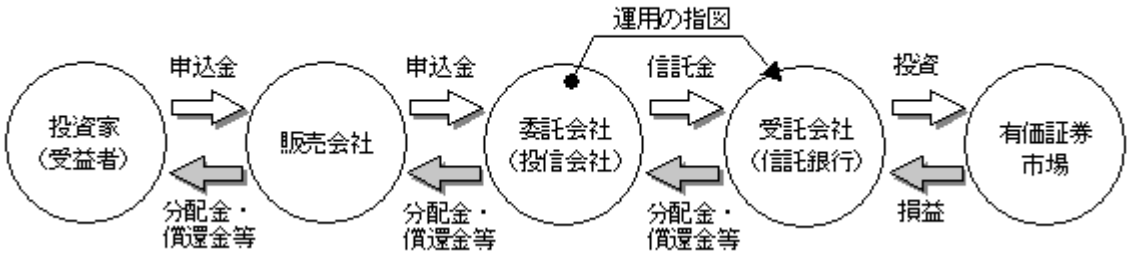
イ　当ファンドの関係法人とその役割

（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。

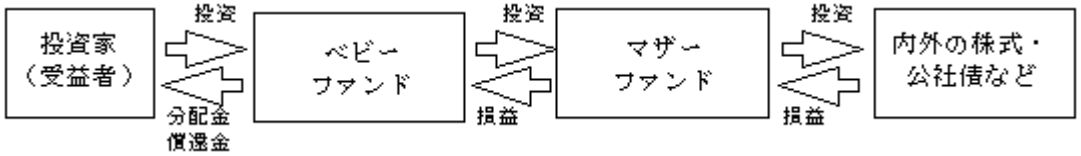
（ロ）受託会社　「住友信託銀行株式会社」
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

（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。

運営の仕組み



※ 当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。
「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。



ロ 委託会社の概況

（イ）資本金の額

2,000百万円（平成23年４月28日現在）

（ロ）会社の沿革

昭和60年７月15日 三生投資顧問株式会社設立

昭和62年２月20日 証券投資顧問業の登録

昭和62年６月10日 投資一任契約にかかる業務の認可

平成11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

平成11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

平成12年１月27日 証券投資信託委託業の認可取得

平成14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

（ハ）大株主の状況

（平成23年４月28日現在）

名称	住所	所有株式数	比率（%）
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	7,056	40.0
三井住友海上火災保険株式会社	東京都中央区新川二丁目27番２号	4,851	27.5
株式会社三井住友銀行	東京都千代田区丸の内一丁目１番２号	4,851	27.5
三井生命保険株式会社	東京都千代田区大手町二丁目１番１号	882	5.0

２【投資方針】

（１）【投資方針】

イ 基本方針

マザーファンドを組み入れることにより、実質的に内外の株式、債券に投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

ロ 投資態度

（イ）各ファンドの標準的な資産配分および各資産の変動幅は、以下の通りとします。

ａ．年金プラン30

		資産配分	変動幅	
			下限	上限
株式		30%	25%	35%
	国内株式	20%	12.5%	30%
	外国株式	10%	5%	15%
債券および短期金融資産		70%	65%	75%
	国内債券	60%	45%	70%
	外国債券	10%	5%	15%
	短期金融資産	0%	0%	5%

ｂ．年金プラン50

		資産配分	変動幅	
			下限	上限
株式		50%	45%	55%
	国内株式	33%	22.5%	45%
	外国株式	17%	10%	25%

債券および短期金融資産		50%	45%	55%
	国内債券	40%	25%	50%
	外国債券	10%	5%	15%
	短期金融資産	0%	0%	5%

c．年金プラン70

		資産配分	変動幅	
			下限	上限
株式		70%	65%	75%
	国内株式	47%	32.5%	60%
	外国株式	23%	15%	35%
債券および短期金融資産		30%	25%	35%
	国内債券	20%	5%	30%
	外国債券	10%	5%	15%
	短期金融資産	0%	0%	5%

（ロ）各ファンドの運用にあたっては、それぞれ以下の比率により委託会社が独自に作成した合成指数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。

	年金プラン 30	年金プラン 50	年金プラン 70
ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）	20%	33%	47%
ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）インデックス	60%	40%	20%
ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円ベース）	10%	17%	23%
シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）	10%	10%	10%

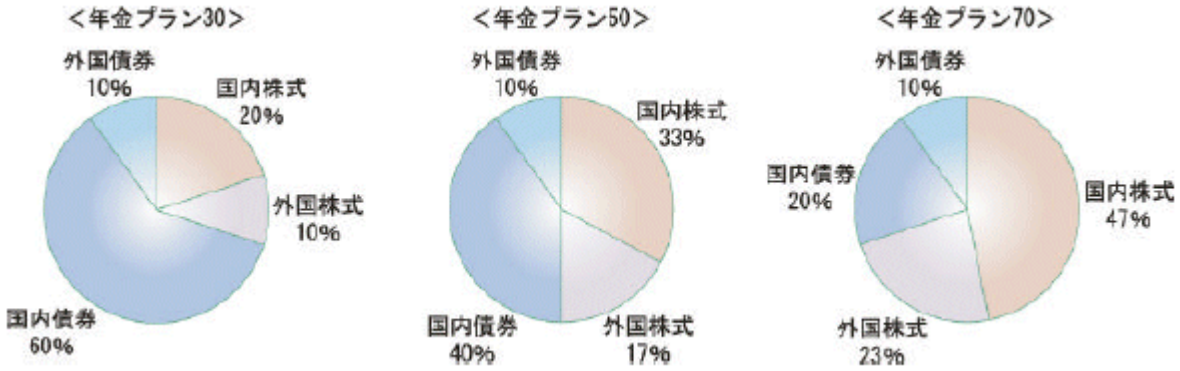
（ハ）実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないことを基本とします。

《ファンドの特色》

１．内外の株式・債券に投資する4つのマザーファンドの組入れを通じて、国内株式、国内債券、外国株式および外国債券への分散投資を行い、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標とします。

２．各ファンドにつき、標準的な資産配分および各資産の変動幅を定め、その範囲内で運用を行います。

〔各ファンドの標準資産配分〕



〔各資産の配分変動幅〕

		年金プラン30	年金プラン50	年金プラン70
株式		**25%～35%**	**45%～55%**	**65%～75%**
	国内株式	12.5%～30%	22.5%～45%	32.5%～60%
	外国株式	5%～15%	10%～25%	15%～35%
債券および短期金融資産		**65%～75%**	**45%～55%**	**25%～35%**
	国内債券	45%～70%	25%～50%	5%～30%
	外国債券	5%～15%	5%～15%	5%～15%
	短期金融資産	0%～5%	0%～5%	0%～5%

３．各ファンドにつき、委託会社が独自に作成した合成指数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。

〔各ファンドのベンチマーク〕

	年金プラン30	年金プラン50	年金プラン70
TOPIX（東証株価指数）	20%	33%	47%
MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）	10%	17%	23%
NOMURA－BPI（総合）インデックス	60%	40%	20%
シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）	10%	10%	10%

・TOPIX（東証株価指数）、MSCIコクサイ・インデックス、NOMURA－BPI（総合）インデックス、シティグループ世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、MSCIインク、野村證券株式会社、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが公表している指数で各社の知的財産です。
・指数を公表する各社は当ファンドの運用と何ら関係ありません。

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を行わないことを基本とします。

※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドが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。

（イ）次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

１．有価証券
２．デリバティブ取引にかかる権利
３．金銭債権
４．約束手形

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

１．為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として第１号から第４号までのマザーファンドの受益証券および第５号から第22号までの有価証券（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．国内株式マザーファンド（B号）
２．国内債券マザーファンド（B号）
３．外国株式マザーファンド（B号）
４．外国債券マザーファンド（B号）
５．株券または新株引受権証書
６．国債証券
７．地方債証券
８．特別の法律により法人の発行する債券
９．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。）
10．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。）
11．コマーシャル・ペーパー
12．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
13．外国または外国の者の発行する証券または証書で、第５号から第12号までの証券または証書の性質を有するもの
14．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。）
15．投資証券もしくは投資法人債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。）
16．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。）

17. 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、有価証券にかかるものに限ります。）
18. 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。）
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 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。）
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、第５号の証券または証書、第13号ならびに第18号の証券または証書のうち第５号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、第６号から第10号までの証券および第13号ならびに第18号の証券または証書のうち第６号から第10号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

ハ 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記ロに掲げる有価証券のほか、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

（３）【運用体制】

イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

（イ）計画（Plan）

国内外のエコノミスト、アナリスト、ファンドマネージャーが、マクロ経済環境、市場環境に関する分析・検討を行います。

これを元に、担当運用グループは投資政策委員会にて、運用方針を決定し月次運用計画を策定します。

（ロ）実行（Do）

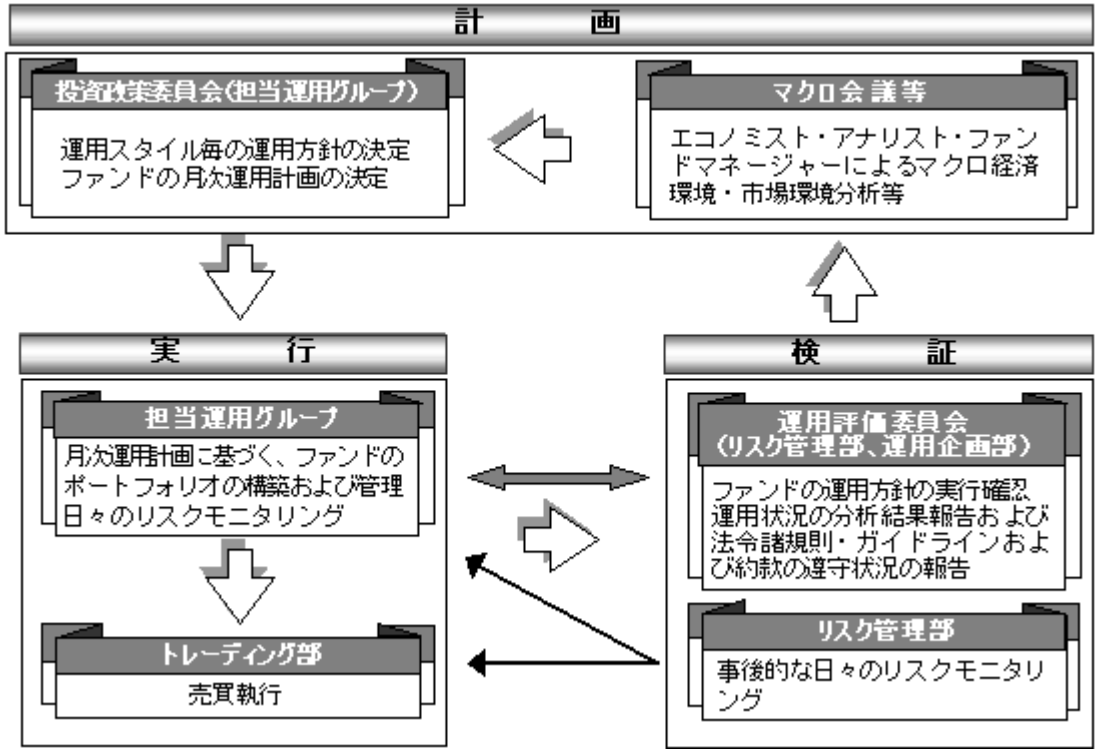
担当運用グループは、月次運用計画に基づき、ファンドのポートフォリオの構築、およびポートフォリオ管理の一環として日々のリスクモニタリングを行います。

売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

（ハ）検証（Check）

運用部門から組織的に分離されたリスク管理部が、約款の遵守状況等、ファンドの運営状況を日々モニタリングし、抵触があった場合直ちに担当運用グループへ状況確認がなされます。担当運用グループは対応結果をリスク管理部へ報告します。
運用評価委員会では、ファンドの運用方針の実行状況、運用状況の分析結果を確認します。また、運用の分析、評価結果、運用リスク状況、法令諸規則、運用ガイドライン、約款の遵守状況についても報告されます。

〔ファンドの運用体制〕



※リスク管理部は10名程度、運用企画部は８名程度で構成されています。
※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。

（４）【分配方針】
毎年１回（原則として３月６日。休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、以下の方針に基づき分配

を行います。

イ 分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

ロ 分配金額は、委託会社が基準価額の水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等や委託会社の判断によっては、分配を行わないこともあります。

ハ 収益の分配に充てず信託財産内に留保した利益については、前記「（１）投資方針」に基づいて運用を行います。

（５）【投資制限】

Ⅰ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

イ 株式への実質投資割合※は、各ファンドにつき、以下の通りとします。

年金プラン30	信託財産の純資産総額の35％以下
年金プラン50	信託財産の純資産総額の55％以下
年金プラン70	信託財産の純資産総額の75％以下

※実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます（以下同じ。）。

ロ 外貨建資産への実質投資割合は、各ファンドにつき、以下の通りとします。

年金プラン30	信託財産の純資産総額の30％以下
年金プラン50	信託財産の純資産総額の40％以下
年金プラン70	信託財産の純資産総額の50％以下

ハ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、各ファンドにつき、取得時において信託財産の純資産総額の10％以下とします。

Ⅱ ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ 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、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、および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、株主割当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。

（ロ）上記（イ）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す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できるものとします。

ロ 信用取引の指図範囲

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をする

ことができます。なお、当該売付けの決済については、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るものとします。

（ロ）信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉のうち信託財産に属するとみなした額（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売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）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、信用取引の売付けにかかる建玉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けの一部を決済するための指図をするものとします。

ハ 先物取引等の運用指図、目的、範囲

（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、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、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。以下同じ。）、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。以下同じ。）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。以下同じ。）ならびに外国の市場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るものとします（以下同じ。）。

（ロ）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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、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市場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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、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市場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。

ニ スワップ取引の運用指図、目的、範囲

（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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り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たときは、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 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図、目的、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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回

避するため、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たときは、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。）までの期間にかか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、その取決めにかか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かか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。以下同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。）を取り決め、その取決めにかか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決めにかか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かか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。

ヘ 有価証券の貸付けの指図および範囲

（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し付けることの指図をすることができます。

１．株式の貸付けは、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を超えないものとします。

２．公社債の貸付けは、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を超えないものとします。

（ロ）上記（イ）の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、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ト 公社債の借入れの指図および範囲

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、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たときは、担保の提供の指図をするものとします。

（ロ）公社債の借入れの指図は、信託財産の純資産総額の範囲内で行うものとします。

（ハ）信託財産の一部解約等の事由により、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り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ます。

（ニ）公社債の借入れにかかる品貸料は、信託財産中から支弁します。

チ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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。

リ 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、ならびに信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

（ロ）外国為替予約取引の指図は、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ます。ただし、信託財産に属する外貨建資産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）上記（ロ）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ます。

ヌ 資金の借入れ

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用および運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り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てを目的として、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代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

（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。

III 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。

（参考情報：マザーファンドの投資方針等）

（国内株式マザーファンド（Ｂ号））

（１）投資方針等

イ 基本方針

わが国の株式を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

ロ 投資態度

（イ）主としてわが国の株式に投資を行い、中長期的にＴＯＰＩＸ（東証株価指数）を上回る投資成果を目指して運用を行います。

（ロ）株式への投資にあたっては、以下の方針に基づいて運用を行います。

ａ．原則として80銘柄以上の株式に分散投資を行います。

ｂ．株価は一時的・部分的にはファンダメンタルズから乖離することがあり、この価格形成の非効率性が超過収益の源泉であるとの観点に立ち、トップダウン、ボトムアップ両面からのアプローチに基づく徹底したリサーチをベースに、市場にまだ十分織り込まれていない投資材料を的確に捉えて、意図したリスクを取ることにより、市場を上回る収益を追求します。

ｃ．業種配分は、主として中長期的な産業成長力に着目した調査・分析に基づいて決定します。各業種の評価にあたっては、市場の成長性、国際競争力、技術革新等に注目します。

ｄ．個別銘柄の選択は、委託会社のアナリストによるグローバルかつ中長期的な視点での定量・定性双方の面からの徹底したリサーチに基づいて行います。

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、主として第５号、第６号、第８号、第11号、第14号、第19号および第20号の有価証券（本邦通貨表示のものに限ります。）ならびに短期社債等に投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品の各号のうち、主として第１号から第４号の金融商品に投資します。

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）外貨建資産への投資は行いません。

（ハ）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15％以下とします。

ロ 法令に基づく投資制限

ベビーファンドにつき上述した法令に基づく制限は、当マザーファンドについても課されます。

（国内債券マザーファンド（Ｂ号））

（１）投資方針等

イ 基本方針

わが国の公社債を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

ロ 投資態度

（イ）主としてわが国の公社債に投資し、中長期的にベンチマークであるＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）インデックスを上回る投資成果を目指して運用を行います。

（ロ）運用にあたっては、リスクを一定以下に抑えて収益の安定性を確保しつつ、定量的相対価値分析を駆使し、残存・セクター・銘柄間の割高割安を判断するだけでなく、ポートフォリオのデュレーションをベンチマーク対比で乖離させることにより、ベンチマークを上回る収益の獲得を目指します。

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、主として第６号から第11号まで、第13号（株券、新株引受権証書、新株引受権証券、新株予約権証券の性質を有しないものに限ります。）から第16号まで、第19号から第21号の有価証券（本邦通貨表示のものに限ります。）に投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）外貨建資産への投資は行いません。

（ロ）国債、地方債および特別の法律により法人の発行する債券以外の債券を取得する場合は、主要格付機関のいずれかよりＢＢＢ格相当以上の格付を得ていることを条件とします。また、その場合、同一の発行体が発行した債券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10％以下とします。

（ハ）上記（ロ）の債券について、いずれの格付機関の格付けもＢＢＢ格相当を下回ることとなった場合には、委託会社は、同一の発行体が発行した債券への投資割合およびＢＢＢ格相当未満の債券合計への投資割合がそれぞれ信託財産の純資産総額の５％以下および10％以下となるよう、当該債券の売却等の指図を行うものとします。

ロ 法令に基づく投資制限

ベビーファンドにつき上述した法令に基づく制限は、当マザーファンドについても課されます。

（外国株式マザーファンド（Ｂ号））

（１）投資方針等

イ 基本方針

日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

ロ 投資態度

（イ）主として日本を除く世界各国の株式に投資し、中長期的にＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円ベース）を上回る投資成果を目指して運用を行います。

（ロ）委託会社のエコノミスト、アナリストによる綿密かつ広範囲のリサーチにより、トップダウンおよびボトムアップ双方の視点から株価に十分織り込まれていない投資材料を見極め、リスクを取ることで超過収益の獲得を目指します。

（ハ）外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないものとします。

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、主として第５号、第６号、第８号、第９号、第11号から第14号まで、第15号（投資法人債券を除きます。）、第16号から第22号の有価証券に投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

（ハ）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％以下とします。

ロ 法令に基づく投資制限

ベビーファンドにつき上述した法令に基づく制限は、当マザーファンドについても課されます。

（外国債券マザーファンド（Ｂ号））

（１）投資方針等

イ 基本方針

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

ロ 投資態度

（イ）主として世界主要先進国の格付けの高い公社債（原則として欧米の主要格付機関からＡ格相当以上の格付けを取得しているもの）に投資し、中長期的にベンチマークであるシティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）を上回る投資成果を目指して運用を行います。

（ロ）ベンチマークとの連動性を維持しつつ、マクロ分析および定量分析をベースにベンチマークを上回る収益の獲得を目指します。

（ハ）外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないものとします。

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、主として第６号から第11号まで、第13号（株券、新株引受権証書、新株引受権証券、新株予約権証券の性質を有しないものに限ります。）、第14号、第15号（投資法人債券を除きます。）、第16号、および第19号から第22号までの有価証券に投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

（ロ）国債以外の債券を取得する場合は、欧米の主要格付機関のいずれかよりＡ格相当以上の格付けを得ていることを条件とします。また、その場合、同一の発行体が発行した債券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10％以下とします。

（ハ）上記（ロ）の債券について、いずれの格付機関による格付けもＡ格相当を下回ることとなった場合には、委託会社は、同一の発行体が発行した債券への投資割合およびＡ格相当未満の格付けの債券全体への投資割合がそれぞれ信託財産の純資産総額の５％以下および10％以下となるよう、当該債券の売却等の指図を行うものとします。

ロ 法令に基づく投資制限

ベビーファンドにつき上述した法令に基づく制限は、当マザーファンドについても課されます。

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、主に内外の株式や債券を投資対象としています（マザーファンドを通じて間接的に投資する場合を含みます。）。当ファンドの基準価額は、組み入れた株式や債券の値動き、為替相場の変動等の影響により上下しますので、これにより投資元本を割り込むことがあります。また、組み入れた株式や債券の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により、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。したがって、当ファンドは金融機関の預金とは異なり、元金が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預金や保険契約と異なり、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。

当ファンドが有するリスク等（当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドへの投資を通じて間接的に受ける実質的なリスク等を含みます。）のうち主要なものは、以下の通りです。

（イ）株式市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、基準価額が大きく下落する要因となります。

（ロ）債券市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により債券相場が下落（金利が上昇）した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、ファンドが保有する個々の債券については、下記「信用リスク」を負うことにもなります。

（ハ）為替変動リスク

外貨建資産への投資は、円建資産に投資する場合の通常のリスクのほかに、為替変動による影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落（円高）する場合、円ベースでの評価額は下落することがあります。為替の変動（円高）は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ニ）信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

（ホ）カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投

資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

（へ）市場流動性リスク

大口の解約請求があった場合、解約資金を手当てするために保有資産を大量に売却しなければならないことがあります。その際、市場動向や取引量等の状況によっては、取引ができなかったり、通常よりも著しく不利な価格での取引を余儀なくされたりすることがあり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ト）ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

ロ 投資リスクの管理体制

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（リスク管理部および法務コンプライアンス部）を設置し、ファンドの投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかるチェックを行っています。リスク管理部では、主に投資信託約款・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を行います。また、法務コンプライアンス部では、主に法令・諸規則等の遵守状況についてのチェックを行います。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価委員会、リスク管理委員会およびコンプライアンス委員会への報告が義務づけられています。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

無手数料です。

ただし、１口につき取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、各ファンドについてそれぞれ以下の率を乗じて得た信託財産留保額を申込金額からご負担いただきます。

年金プラン30：0.085%
年金プラン50：0.105%
年金プラン70：0.125%

（2）【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

ただし、解約の際には、１口につき解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、各ファンドについて、それぞれ上記（１）の率を乗じて得た信託財産留保額が差し引かれます。

（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信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。

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。

各ファンドの信託報酬率および実質的配分は以下の通りです。

	信託報酬率 総額	信託報酬率の配分		
		委託会社	販売会社	受託会社
年金プラン30	年0.945% （0.90%）	年0.4515% （0.43%）	年0.4095% （0.39%）	年0.084% （0.08%）
年金プラン50	年1.155% （1.10%）	年0.5565% （0.53%）	年0.5145% （0.49%）	年0.084% （0.08%）
年金プラン70	年1.365% （1.30%）	年0.6615% （0.63%）	年0.6195% （0.59%）	年0.084% （0.08%）

※（ ）内は税抜き。

（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、「年金プラン30」は年279,300円（税抜き266,000円）を上限として、「年金プラン50」は年382,200円（税抜き364,000円）を上限として、「年金プラン70」は年447,300円（税抜き426,000円）を上限として、日割りした金額が信託財産の費用として計上され、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。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（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）等は、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、その時々の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ったりすることから、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。（「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。）

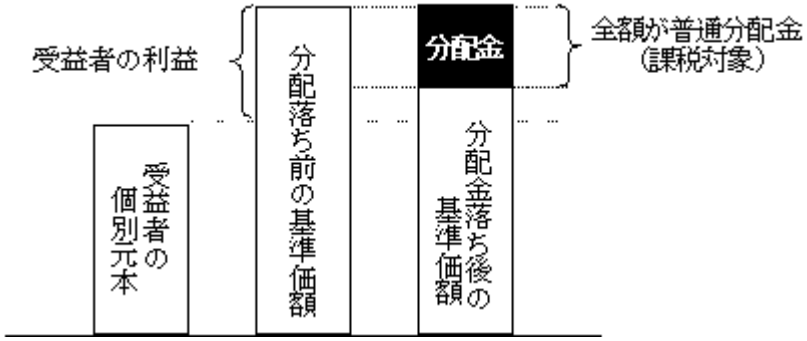
ロ　一部解約時および償還時の課税について

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。

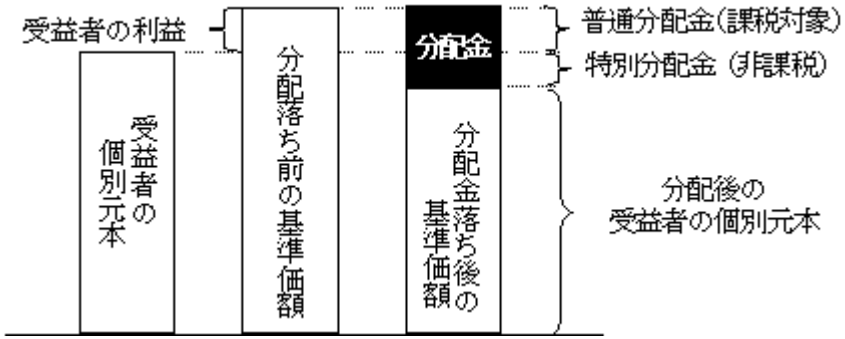
ハ　収益分配金の課税について

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「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。

①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。



②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特別分配金となり、当該収益分配金から当該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①、②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。

ニ 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

ｉ．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、平成23年12月31日までは10%（所得税７％および地方税３％）、平成24年１月１日以降は20%（所得税15%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。

ii．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、平成23年12月31日までは10%（所得税７％および地方税３％）、平成24年１月１日以降は20%（所得税15%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。

なお、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、収益分配金、上場株式等にかかる譲渡益との通算が可能です。

（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、平成23年12月31日までは７％（所得税のみ）、平成24年１月１日以降は15%（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。

当ファンドは、受取配当にかかる益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

※当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

「年金プラン30」

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

「年金プラン50」

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40%以下とします。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

「年金プラン70」

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

※上記にかかわらず、確定拠出年金制度における受益者が支払いを受ける収益分配金、一部解約金、償還金はいずれも課税されません。

※上記「(５)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成23年４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】

a．三井住友・年金プラン30

平成23年４月28日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国内株式マザーファンド（Ｂ号）受益証券	日本	371,014,243	20.18
国内債券マザーファンド（Ｂ号）受益証券	日本	1,087,893,341	59.17
外国株式マザーファンド（Ｂ号）受益証券	日本	195,756,829	10.65
外国債券マザーファンド（Ｂ号）受益証券	日本	185,000,156	10.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△1,128,299	△0.06
合計(純資産総額)		1,838,536,270	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の比率をいいます。以下同じ。

b．三井住友・年金プラン50

平成23年４月28日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国内株式マザーファンド（Ｂ号）受益証券	日本	1,533,201,312	33.21
国内債券マザーファンド（Ｂ号）受益証券	日本	1,809,056,658	39.19
外国株式マザーファンド（Ｂ号）受益証券	日本	817,822,882	17.71
外国債券マザーファンド（Ｂ号）受益証券	日本	463,686,812	10.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△7,139,549	△0.15
合計(純資産総額)		4,616,628,115	100.00

c．三井住友・年金プラン70

平成23年４月28日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国内株式マザーファンド（Ｂ号）受益証券	日本	2,134,336,352	47.08
国内債券マザーファンド（Ｂ号）受益証券	日本	876,985,821	19.35
外国株式マザーファンド（Ｂ号）受益証券	日本	1,075,603,016	23.73

外国債券マザーファンド（Ｂ号）受益証券	**日本**	454,452,654	10.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△8,163,419	△0.18
合計(純資産総額)		4,533,214,424	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ 主要投資銘柄

ａ．三井住友・年金プラン30

平成23年４月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価／金額 （円）	評価額 単価／金額 （円）	投資比率 （%）
日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド（Ｂ号）	925,709,106	1.1685 1,081,706,331	1.1752 1,087,893,341	59.17
日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド（Ｂ号）	580,163,008	0.6886 399,503,665	0.6395 371,014,243	20.18
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド（Ｂ号）	210,899,407	0.8940 188,544,070	0.9282 195,756,829	10.65
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド（Ｂ号）	101,037,770	1.7639 178,225,088	1.8310 185,000,156	10.06

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ｂ．三井住友・年金プラン50

平成23年４月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価／金額 （円）	評価額 単価／金額 （円）	投資比率 （%）
日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド（Ｂ号）	1,539,360,669	1.1685 1,798,742,942	1.1752 1,809,056,658	39.19
日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド（Ｂ号）	2,397,500,097	0.6923 1,659,951,399	0.6395 1,533,201,312	33.21
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド（Ｂ号）	881,084,769	0.8947 788,306,543	0.9282 817,822,882	17.71
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド（Ｂ号）	253,242,388	1.7633 446,546,270	1.8310 463,686,812	10.04

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ｃ．三井住友・年金プラン70

平成23年４月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価／金額 （円）	評価額 単価／金額 （円）	投資比率 （%）
日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド（B号）	3,337,507,979	0.6962 2,323,582,956	0.6395 2,134,336,352	47.08
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド（B号）	1,158,805,232	0.8948 1,036,898,922	0.9282 1,075,603,016	23.73
日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド（B号）	746,243,892	1.1685 871,985,988	1.1752 876,985,821	19.35
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド（B号）	248,199,156	1.7633 437,670,723	1.8310 454,452,654	10.02

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

a．三井住友・年金プラン30

平成23年４月28日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	100.06
合計	100.06

b．三井住友・年金プラン50

平成23年４月28日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	100.15
合計	100.15

c．三井住友・年金プラン70

平成23年４月28日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	100.18
合計	100.18

②【投資不動産物件】

各ファンドにつき、該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

各ファンドにつき、該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

ａ．三井住友・年金プラン30

年月日	純資産総額（円）	１万口当たりの純資産額（円）
第２期（平成14年３月６日）　（分配落）	4,872,355,917	9,745
第２期（平成14年３月６日）　（分配付）	4,872,355,917	9,745
第３期（平成15年３月６日）　（分配落）	4,592,457,527	9,135
第３期（平成15年３月６日）　（分配付）	4,592,457,527	9,135
第４期（平成16年３月８日）　（分配落）	2,586,232,100	9,989
第４期（平成16年３月８日）　（分配付）	2,586,232,100	9,989
第５期（平成17年３月７日）　（分配落）	2,760,226,586	10,167
第５期（平成17年３月７日）　（分配付）	2,760,226,586	10,167
第６期（平成18年３月６日）　（分配落）	3,323,571,650	11,297
第６期（平成18年３月６日）　（分配付）	3,323,571,650	11,297
第７期（平成19年３月６日）　（分配落）	3,650,770,785	11,667
第７期（平成19年３月６日）　（分配付）	3,650,770,785	11,667
第８期（平成20年３月６日）　（分配落）	3,596,889,689	11,066
第８期（平成20年３月６日）　（分配付）	3,596,889,689	11,066
第９期（平成21年３月６日）　（分配落）	3,019,950,287	8,908
第９期（平成21年３月６日）　（分配付）	3,019,950,287	8,908
第10期（平成22年３月８日）　（分配落）	3,516,417,534	9,986
第10期（平成22年３月８日）　（分配付）	3,516,417,534	9,986
第11期（平成23年３月７日）　（分配落）	2,735,219,894	10,278
第11期（平成23年３月７日）　（分配付）	2,735,219,894	10,278
平成22年４月末日	3,648,388,719	10,301
平成22年５月末日	3,505,563,154	9,902
平成22年６月末日	3,475,363,748	9,765
平成22年７月末日	3,524,260,698	9,876
平成22年８月末日	3,471,369,717	9,722
平成22年９月末日	3,555,846,241	9,952
平成22年10月末日	2,580,836,922	9,878

平成22年11月末日	2,612,503,364	9,966
平成22年12月末日	2,671,851,320	10,120
平成23年１月末日	2,690,289,281	10,159
平成23年２月末日	2,717,039,443	10,274
平成23年３月末日	2,717,331,288	10,180
平成23年４月末日	1,838,536,270	10,217

（注１）純資産総額（分配付）および１万口当たりの純資産額（分配付）の欄は、各計算期間にかかる収益分配金の総額を含んでいます。以下同じ。

（注２）純資産総額（分配落）および１万口当たりの純資産額（分配落）の欄は、収益分配時に外国税額控除規定が適用された場合には当該控除額を含んでいます。以下同じ。

ｂ．三井住友・年金プラン50

年月日	純資産総額 （円）	１万口当たりの 純資産額（円）
第２期（平成14年３月６日）　（分配落）	4,590,153,024	9,180
第２期（平成14年３月６日）　（分配付）	4,590,153,024	9,180
第３期（平成15年３月６日）　（分配落）	3,983,921,027	7,937
第３期（平成15年３月６日）　（分配付）	3,983,921,027	7,937
第４期（平成16年３月８日）　（分配落）	4,687,387,597	9,261
第４期（平成16年３月８日）　（分配付）	4,687,387,597	9,261
第５期（平成17年３月７日）　（分配落）	4,980,506,540	9,487
第５期（平成17年３月７日）　（分配付）	4,980,506,540	9,487
第６期（平成18年３月６日）　（分配落）	4,542,833,356	11,235
第６期（平成18年３月６日）　（分配付）	4,542,833,356	11,235
第７期（平成19年３月６日）　（分配落）	5,006,508,030	11,693
第７期（平成19年３月６日）　（分配付）	5,006,508,030	11,693
第８期（平成20年３月６日）　（分配落）	4,720,643,561	10,600
第８期（平成20年３月６日）　（分配付）	4,720,643,561	10,600
第９期（平成21年３月６日）　（分配落）	3,484,638,524	7,537
第９期（平成21年３月６日）　（分配付）	3,484,638,524	7,537
第10期（平成22年３月８日）　（分配落）	4,359,788,479	9,030
第10期（平成22年３月８日）　（分配付）	4,359,788,479	9,030
第11期（平成23年３月７日）　（分配落）	4,684,707,484	9,400
第11期（平成23年３月７日）　（分配付）	4,684,707,484	9,400
平成22年４月末日	4,579,502,128	9,448
平成22年５月末日	4,305,743,037	8,854
平成22年６月末日	4,205,000,574	8,608
平成22年７月末日	4,283,028,456	8,749
平成22年８月末日	4,168,404,537	8,499
平成22年９月末日	4,335,852,974	8,808
平成22年10月末日	4,293,431,111	8,733
平成22年11月末日	4,398,662,096	8,924
平成22年12月末日	4,522,926,051	9,134
平成23年１月末日	4,569,781,499	9,213

平成23年２月末日	4,665,718,248	9,397
平成23年３月末日	4,609,417,556	9,229
平成23年４月末日	4,616,628,115	9,233

ｃ．三井住友・年金プラン70

年月日	純資産総額 （円）	１万口当たりの 純資産額（円）
第２期（平成14年３月６日）　（分配落）	8,605,653,972	8,606
第２期（平成14年３月６日）　（分配付）	8,605,653,972	8,606
第３期（平成15年３月６日）　（分配落）	6,871,567,075	6,860
第３期（平成15年３月６日）　（分配付）	6,871,567,075	6,860
第４期（平成16年３月８日）　（分配落）	8,572,300,108	8,523
第４期（平成16年３月８日）　（分配付）	8,572,300,108	8,523
第５期（平成17年３月７日）　（分配落）	8,946,248,407	8,791
第５期（平成17年３月７日）　（分配付）	8,946,248,407	8,791
第６期（平成18年３月６日）　（分配落）	5,405,185,780	11,106
第６期（平成18年３月６日）　（分配付）	5,405,185,780	11,106
第７期（平成19年３月６日）　（分配落）	5,823,810,651	11,614
第７期（平成19年３月６日）　（分配付）	5,823,810,651	11,614
第８期（平成20年３月６日）　（分配落）	5,156,831,391	10,007
第８期（平成20年３月６日）　（分配付）	5,156,831,391	10,007
第９期（平成21年３月６日）　（分配落）	3,291,708,233	6,234
第９期（平成21年３月６日）　（分配付）	3,291,708,233	6,234
第10期（平成22年３月８日）　（分配落）	4,340,377,485	7,967
第10期（平成22年３月８日）　（分配付）	4,340,377,485	7,967
第11期（平成23年３月７日）　（分配落）	4,674,441,584	8,374
第11期（平成23年３月７日）　（分配付）	4,674,441,584	8,374
平成22年４月末日	4,619,079,842	8,453
平成22年５月末日	4,229,906,754	7,721
平成22年６月末日	4,059,574,248	7,400
平成22年７月末日	4,160,916,507	7,555
平成22年８月末日	3,992,418,170	7,242
平成22年９月末日	4,198,798,644	7,597
平成22年10月末日	4,163,447,158	7,522
平成22年11月末日	4,319,956,795	7,788
平成22年12月末日	4,471,882,278	8,034
平成23年１月末日	4,536,251,724	8,142

平成23年２月末日	4,665,087,469	8,373
平成23年３月末日	4,544,636,859	8,130
平成23年４月末日	4,533,214,424	8,114

②【分配の推移】

ａ．三井住友・年金プラン30

計算期間	１万口当たり分配金（円）
第２期（平成13年３月７日～平成14年３月６日）	0
第３期（平成14年３月７日～平成15年３月６日）	0
第４期（平成15年３月７日～平成16年３月８日）	0
第５期（平成16年３月９日～平成17年３月７日）	0
第６期（平成17年３月８日～平成18年３月６日）	0
第７期（平成18年３月７日～平成19年３月６日）	0
第８期（平成19年３月７日～平成20年３月６日）	0
第９期（平成20年３月７日～平成21年３月６日）	0
第10期（平成21年３月７日～平成22年３月８日）	0
第11期（平成22年３月９日～平成23年３月７日）	0

ｂ．三井住友・年金プラン50

計算期間	１万口当たり分配金（円）
第２期（平成13年３月７日～平成14年３月６日）	0
第３期（平成14年３月７日～平成15年３月６日）	0
第４期（平成15年３月７日～平成16年３月８日）	0
第５期（平成16年３月９日～平成17年３月７日）	0
第６期（平成17年３月８日～平成18年３月６日）	0
第７期（平成18年３月７日～平成19年３月６日）	0
第８期（平成19年３月７日～平成20年３月６日）	0
第９期（平成20年３月７日～平成21年３月６日）	0
第10期（平成21年３月７日～平成22年３月８日）	0
第11期（平成22年３月９日～平成23年３月７日）	0

ｃ．三井住友・年金プラン70

計算期間	１万口当たり分配金（円）
第２期（平成13年３月７日～平成14年３月６日）	0
第３期（平成14年３月７日～平成15年３月６日）	0
第４期（平成15年３月７日～平成16年３月８日）	0

第５期（平成16年３月９日～平成17年３月７日）	0
第６期（平成17年３月８日～平成18年３月６日）	0
第７期（平成18年３月７日～平成19年３月６日）	0
第８期（平成19年３月７日～平成20年３月６日）	0
第９期（平成20年３月７日～平成21年３月６日）	0
第10期（平成21年３月７日～平成22年３月８日）	0
第11期（平成22年３月９日～平成23年３月７日）	0

③【収益率の推移】

ａ．三井住友・年金プラン30

計算期間	収益率（%）
第２期	△1.9
第３期	△6.3
第４期	9.3
第５期	1.8
第６期	11.1
第７期	3.3
第８期	△5.2
第９期	△19.5
第10期	12.1
第11期	2.9

（注１）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。以下同じ。

（注２）収益分配時に外国税額控除規定が適用された場合には、上記収益率は同期間における受益者の投資収益率と異なる場合があります。以下同じ。

ｂ．三井住友・年金プラン50

計算期間	収益率（%）
第２期	△3.6
第３期	△13.5
第４期	16.7
第５期	2.4
第６期	18.4
第７期	4.1
第８期	△9.3
第９期	△28.9
第10期	19.8
第11期	4.1

ｃ．三井住友・年金プラン70

計算期間	収益率（%）
第２期	△5.6
第３期	△20.3
第４期	24.2
第５期	3.1
第６期	26.3
第７期	4.6
第８期	△13.8
第９期	△37.7
第10期	27.8
第11期	5.1

（４）【設定及び解約の実績】

ａ．三井住友・年金プラン30

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第２期	0	0
第３期	27,373,325	42,034
第４期	63,136,643	2,501,311,145
第５期	133,035,457	7,431,472
第６期	259,134,936	31,960,713
第７期	234,984,916	47,738,119
第８期	189,368,387	68,165,911
第９期	222,491,121	82,780,273
第10期	183,714,580	52,468,084
第11期	210,591,064	1,070,732,714

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。以下同じ。

ｂ．三井住友・年金プラン50

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第２期	0	0
第３期	19,488,890	132,398
第４期	43,372,783	1,139,437
第５期	191,436,647	2,960,927
第６期	330,061,232	1,536,488,346
第７期	281,174,896	43,189,891
第８期	248,766,763	77,086,126
第９期	271,146,772	101,034,974
第10期	270,724,990	65,760,310
第11期	239,451,241	83,934,640

ｃ．三井住友・年金プラン70

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第２期	0	0
第３期	16,984,090	91,990

第４期	41,356,268	659,885
第５期	123,401,060	4,146,928
第６期	216,390,249	5,526,126,015
第７期	177,392,132	29,867,538
第８期	186,836,159	48,268,677
第９期	202,613,753	75,211,586
第10期	214,408,798	47,377,314
第11期	199,361,397	64,719,128

〔参考情報：マザーファンドの投資状況・投資資産〕

〔国内株式マザーファンド（Ｂ号）〕

（１）投資状況

平成23年４月28日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	3,935,321,640	97.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		103,383,048	2.56
合計(純資産総額)		4,038,704,688	100.00

（２）投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成23年４月28日現在

国／地域	種類	銘柄名／業種	数量（株）	帳簿価額 単価／金額（円）	評価額 単価／金額（円）	投資比率（％）
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 〔銀行業〕	427,700	434.67 185,908,629	387.00 165,519,900	4.10
日本	株式	本田技研工業 〔輸送用機器〕	48,500	3,404.90 165,137,925	3,190.00 154,715,000	3.83
日本	株式	三菱商事 〔卸売業〕	49,400	2,249.22 111,111,544	2,179.00 107,642,600	2.67
日本	株式	日本電信電話 〔情報・通信業〕	25,900	4,021.54 104,158,004	3,745.00 96,995,500	2.40
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ 〔銀行業〕	34,300	2,986.67 102,442,781	2,495.00 85,578,500	2.12
日本	株式	小松製作所 〔機械〕	28,700	2,593.83 74,442,980	2,840.00 81,508,000	2.02
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 〔情報・通信業〕	538	154,265.45 82,994,815	149,300.00 80,323,400	1.99
日本	株式	Ｔ＆Ｄホールディングス 〔保険業〕	40,300	2,316.77 93,365,880	1,991.00 80,237,300	1.99

日本	株式	トヨタ自動車 〔輸送用機器〕	22,500	3,645.40 82,021,650	3,230.00 72,675,000	1.80
日本	株式	ファナック 〔電気機器〕	5,000	12,675.40 63,377,043	13,450.00 67,250,000	1.67
日本	株式	アステラス製薬 〔医薬品〕	21,600	3,104.60 67,059,492	3,090.00 66,744,000	1.65
日本	株式	野村ホールディングス 〔証券、商品先物取引業〕	141,600	444.63 62,960,137	412.00 58,339,200	1.44
日本	株式	富士フイルムホールディングス 〔化学〕	23,200	2,632.94 61,084,286	2,510.00 58,232,000	1.44
日本	株式	武田薬品工業 〔医薬品〕	14,600	3,795.98 55,421,351	3,920.00 57,232,000	1.42
日本	株式	三菱電機 〔電気機器〕	64,000	952.77 60,977,410	891.00 57,024,000	1.41
日本	株式	住友商事 〔卸売業〕	48,900	1,181.31 57,766,173	1,107.00 54,132,300	1.34
日本	株式	日産自動車 〔輸送用機器〕	66,900	818.98 54,789,900	774.00 51,780,600	1.28
日本	株式	東京海上ホールディングス 〔保険業〕	22,800	2,300.47 52,450,732	2,249.00 51,277,200	1.27
日本	株式	東京瓦斯 〔電気・ガス業〕	140,000	353.70 49,518,740	359.00 50,260,000	1.24
日本	株式	パナソニック 〔電気機器〕	48,800	1,041.84 50,842,176	998.00 48,702,400	1.21
日本	株式	国際石油開発帝石 〔鉱業〕	79	604,275.37 47,737,755	616,000.00 48,664,000	1.20
日本	株式	三井化学 〔化学〕	163,000	285.64 46,560,330	297.00 48,411,000	1.20
日本	株式	ＪＸホールディングス 〔石油・石炭製品〕	85,100	584.38 49,730,839	562.00 47,826,200	1.18
日本	株式	三井住友トラスト・ホールディングス 〔銀行業〕	172,000	336.69 57,911,500	276.00 47,472,000	1.18

日本	株式	村田製作所 〔電気機器〕	8,100	5,858.17 47,451,240	5,850.00 47,385,000	1.17
日本	株式	ソニー 〔電気機器〕	20,300	2,881.95 58,503,666	2,260.00 45,878,000	1.14
日本	株式	ツムラ 〔医薬品〕	17,800	2,582.81 45,974,184	2,515.00 44,767,000	1.11
日本	株式	旭硝子 〔ガラス・土石製品〕	42,000	1,115.44 46,848,480	1,026.00 43,092,000	1.07
日本	株式	三井物産 〔卸売業〕	29,000	1,473.36 42,727,660	1,432.00 41,528,000	1.03
日本	株式	住友電気工業 〔非鉄金属〕	36,600	1,214.17 44,438,642	1,121.00 41,028,600	1.02

ロ 種類別・業種別の投資比率

平成23年４月28日現在

種類	業種	投資比率（%）	種類	業種	投資比率（%）
株式（国内）	鉱業	1.20	株式（国内）	その他製品	1.19
	建設業	0.54		電気・ガス業	1.24
	食料品	2.34		陸運業	1.64
	化学	9.04		海運業	0.90
	医薬品	5.57		情報・通信業	6.20
	石油・石炭製品	1.18		卸売業	5.03
	ガラス・土石製品	2.04		小売業	3.52
	鉄鋼	0.93		銀行業	7.39
	非鉄金属	2.37		証券、商品先物取引業	2.47
	金属製品	0.55		保険業	3.51
	機械	6.29		その他金融業	1.35
	電気機器	15.63		不動産業	1.80
	輸送用機器	13.51	合計		97.44

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

〔国内債券マザーファンド（Ｂ号）〕

（１）投資状況

平成23年４月28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	22,263,254,260	72.04
地方債証券	日本	623,715,000	2.02
特殊債券	日本	2,047,344,633	6.62
社債券	日本	5,404,133,000	17.49
	アメリカ	200,891,000	0.65
	小 計	5,605,024,000	18.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		365,939,553	1.18
合計(純資産総額)		30,905,277,446	100.00

（２）投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成23年４月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	額面金額（円）	帳簿価額 単価／金額（円）	評価額 単価／金額（円）	利率(%)／償還期限	投資比率（%）
日本	国債証券	第９２回利付国債（５年）	2,500,000,000	99.06 2,476,725,000	99.50 2,487,650,000	0.3 2015/9/20	8.05
日本	国債証券	第２９７回利付国債（１０年）	2,300,000,000	103.37 2,377,535,000	103.89 2,389,631,000	1.4 2018/12/20	7.73
日本	国債証券	第８８回利付国債（５年）	2,000,000,000	100.15 2,003,160,000	100.53 2,010,660,000	0.5 2015/3/20	6.51
日本	国債証券	第２９２回利付国債（１０年）	1,800,000,000	105.84 1,905,246,000	106.40 1,915,362,000	1.7 2018/3/20	6.20
日本	国債証券	第２６４回利付国債（１０年）	1,500,000,000	103.84 1,557,600,000	103.98 1,559,730,000	1.5 2014/9/20	5.05

日本	国債証券	第３０３回利付国債（１０年）	1,500,000,000	102.57 1,538,685,000	103.32 1,549,905,000	1.4 2019/9/20	5.02
日本	国債証券	第２６９回利付国債（１０年）	1,300,000,000	103.54 1,346,046,000	103.60 1,346,813,000	1.3 2015/3/20	4.36
日本	国債証券	第３０回利付国債（３０年）	950,000,000	102.58 974,510,000	103.42 982,528,000	2.3 2039/3/20	3.18
日本	国債証券	第９２回利付国債（２０年）	850,000,000	103.68 881,280,000	104.35 887,026,000	2.1 2026/12/20	2.87
日本	国債証券	第３０１回利付国債（１０年）	800,000,000	103.58 828,680,000	104.26 834,088,000	1.5 2019/6/20	2.70
日本	国債証券	第１０４回利付国債（２０年）	800,000,000	102.46 819,744,000	103.04 824,384,000	2.1 2028/6/20	2.67
日本	国債証券	第２０回利付国債（３０年）	600,000,000	106.82 640,932,000	107.57 645,444,000	2.5 2035/9/20	2.09
日本	特殊債券	第５回中日本高速道路社債	500,000,000	105.58 527,900,000	106.10 530,535,000	1.86 2018/9/20	1.72
日本	国債証券	第３０６回利付国債（１０年）	500,000,000	102.08 510,400,000	102.87 514,395,000	1.4 2020/3/20	1.66
日本	国債証券	第１１１回利付国債（２０年）	450,000,000	103.22 464,530,500	103.76 466,933,500	2.2 2029/6/20	1.51
日本	国債証券	第２８７回利付国債（１０年）	400,000,000	107.21 428,840,000	107.66 430,672,000	1.9 2017/6/20	1.39
日本	国債証券	第９５回利付国債（２０年）	300,000,000	106.02 318,084,000	106.64 319,935,000	2.3 2027/6/20	1.04
日本	国債証券	第２８９回利付国債（１０年）	300,000,000	105.00 315,018,000	105.12 315,375,000	1.5 2017/12/20	1.02
日本	国債証券	第２７１回利付国債（１０年）	300,000,000	103.09 309,294,000	103.32 309,966,000	1.2 2015/6/20	1.00
日本	国債証券	第４７回変動利付国債 （１５年）	300,000,000	100.90 302,700,000	102.15 306,450,000	0.52 2022/11/20	0.99
日本	特殊債券	第23回都市再生債権	300,000,000	102.20 306,609,000	102.12 306,384,000	1.28 2013/11/25	0.99

日本	社債券	第27回大阪瓦斯無担保社債	300,000,000	102.15 306,462,000	102.03 306,090,000	1.199 2013/11/27	0.99
日本	国債証券	第１２３回利付国債（２０年）	300,000,000	100.98 302,947,000	101.40 304,224,000	2.1 2030/12/20	0.98
日本	国債証券	第１１８回利付国債（２０年）	250,000,000	99.65 249,132,500	100.00 250,000,000	2 2030/6/20	0.81
日本	国債証券	第６８回利付国債（２０年）	220,000,000	106.98 235,368,800	108.13 237,886,000	2.2 2024/3/20	0.77
日本	国債証券	第２７８回利付国債（１０年）	210,000,000	106.19 222,999,000	106.42 223,490,400	1.8 2016/3/20	0.72
日本	社債券	第４回りそな銀行無担保社債	200,000,000	108.37 216,758,000	108.15 216,300,000	2.766 2019/6/20	0.70
日本	国債証券	第２９３回利付国債（１０年）	200,000,000	106.13 212,278,000	107.05 214,112,000	1.8 2018/6/20	0.69
日本	社債券	第20回三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	105.96 211,924,000	106.51 213,030,000	2.21 2019/7/24	0.69
日本	地方債証券	第４回東京都住宅供給公社債券	200,000,000	105.84 211,694,000	106.06 212,122,000	2.05 2016/9/20	0.69

ロ 種類別の投資比率

平成23年４月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	72.04
地方債証券	2.02
特殊債券	6.62
社債券	18.14
合計	98.82

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

〔外国株式マザーファンド（Ｂ号）〕

（１）投資状況

平成23年４月28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	1,094,944,460	52.41
	カナダ	147,817,605	7.08
	ドイツ	97,488,647	4.67
	イタリア	14,465,240	0.69
	フランス	142,470,927	6.82
	オーストラリア	91,506,557	4.38
	イギリス	191,673,496	9.17
	スイス	97,337,753	4.66
	バミューダ	3,568,224	0.17
	香港	23,139,336	1.11
	シンガポール	14,597,136	0.70
	ニュージーランド	1,814,381	0.09
	オランダ	4,678,403	0.22
	スペイン	42,971,391	2.06
	ベルギー	5,719,238	0.27
	スウェーデン	10,017,761	0.48
	ノルウェー	22,153,712	1.06
	デンマーク	14,265,888	0.68
	アイルランド	16,718,984	0.80
	イスラエル	4,771,478	0.23
	モーリシャス	2,543,744	0.12
	マーシャル諸島	6,668,015	0.32
	小 計	2,051,332,376	98.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		37,956,817	1.82
合計(純資産総額)		2,089,289,193	100.00

（2）投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成23年４月28日現在

国／地域	種類	銘柄名／業種	数量（株）	帳簿価額 単価／金額（円）	評価額 単価／金額（円）	投資比率（%）
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〕	1,810	29,520.07 53,431,330	28,747.69 52,033,335	2.49
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION 〔エネルギー〕	5,320	8,547.81 45,474,355	8,944.25 47,583,450	2.28
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO 〔資本財〕	24,450	1,665.40 40,719,108	1,694.95 41,441,576	1.98
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE 〔食品・飲料・タバコ〕	7,300	5,352.43 39,072,788	5,499.36 40,145,328	1.92
ドイツ	株式	SIEMENS AG-REG 〔資本財〕	3,221	11,607.11 37,386,521	11,832.39 38,112,131	1.82
アメリカ	株式	INTEL CORP 〔半導体・半導体製造装置〕	20,420	1,768.00 36,102,625	1,858.29 37,946,306	1.82
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO 〔各種金融〕	9,080	3,737.92 33,940,342	3,734.63 33,910,531	1.62
アメリカ	株式	CITIGROUP INC 〔各種金融〕	84,200	371.82 31,307,446	370.18 31,169,223	1.49
アメリカ	株式	METLIFE INC 〔保険〕	8,180	3,737.92 30,576,211	3,723.96 30,462,071	1.46
アメリカ	株式	EMC CORP/MASS 〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕	13,030	2,242.42 29,218,805	2,310.55 30,106,492	1.44
アメリカ	株式	HANSEN NATURAL CORPORATION 〔食品・飲料・タバコ〕	5,150	4,627.67 23,832,502	5,425.48 27,941,263	1.34
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	5,810	4,945.59 28,733,879	4,791.21 27,836,970	1.33
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A 〔ソフトウェア・サービス〕	629	49,049.36 30,852,051	44,139.34 27,763,645	1.33

アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC 〔電気通信サービス〕	8,640	2,961.44 25,586,896	3,139.55 27,125,798	1.30
アメリカ	株式	NEWS CORP-CL A 〔メディア〕	18,600	1,439.68 26,778,107	1,456.92 27,098,712	1.30
アメリカ	株式	BAKER HUGHES INC 〔エネルギー〕	4,270	5,727.54 24,456,606	6,343.14 27,085,218	1.30
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION 〔ソフトウェア・サービス〕	8,940	2,692.22 24,068,482	2,894.96 25,880,956	1.24
アメリカ	株式	MONSANTO CO 〔素材〕	4,570	5,986.09 27,356,451	5,573.23 25,469,670	1.22
フランス	株式	TOTAL SA 〔エネルギー〕	4,700	5,337.17 25,084,741	5,186.79 24,377,927	1.17
イギリス	株式	BP PLC 〔エネルギー〕	37,940	674.03 25,573,077	638.41 24,221,654	1.16
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC 〔ヘルスケア機器・サービス〕	6,100	3,645.99 22,240,560	3,957.07 24,138,168	1.16
カナダ	株式	ULTRA PETROLEUM CORP 〔エネルギー〕	5,980	3,676.36 21,984,651	3,962.00 23,692,769	1.13
アメリカ	株式	DANAHER CORP 〔資本財〕	5,180	4,172.12 21,611,614	4,536.56 23,499,389	1.12
フランス	株式	SCHNEIDER ELECTRIC SA 〔資本財〕	1,611	14,581.95 23,491,533	14,472.36 23,314,979	1.12
カナダ	株式	YAMANA GOLD INC 〔素材〕	22,270	1,078.41 24,016,391	1,038.57 23,129,038	1.11
フランス	株式	ALSTOM RGPT 〔資本財〕	4,170	5,060.76 21,103,374	5,444.33 22,702,884	1.09
フランス	株式	SANOFI-AVENTIS 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	3,470	6,222.44 21,591,891	6,485.47 22,504,581	1.08
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED 〔食品・飲料・タバコ〕	4,440	4,890.99 21,716,016	5,059.48 22,464,124	1.08
ノルウェー	株式	DNB NOR ASA 〔銀行〕	16,000	1,358.07 21,729,120	1,384.60 22,153,712	1.06

フランス	**株式**	BNP PARIBAS **〔銀行〕**	3,480	6,479.38 22,548,248	6,351.52 22,103,300	1.06

ロ 種類別・業種別の投資比率

平成23年４月28日現在

種類	業種	投資比率（%）	種類	業種	投資比率（%）
株式（外国）	エネルギー	13.50	株式（外国）	ヘルスケア機器・サービス	1.16
	素材	8.95		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5.14
	資本財	10.53		銀行	8.73
	運輸	1.35		各種金融	5.71
	自動車・自動車部品	0.59		保険	4.44
	耐久消費財・アパレル	1.55		不動産	0.58
	消費者サービス	0.69		ソフトウェア・サービス	4.98
	メディア	2.36		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.67
	小売	2.81		電気通信サービス	3.54
	食品・生活必需品小売り	0.78		公益事業	3.59
	食品・飲料・タバコ	8.45		半導体・半導体製造装置	2.51
	家庭用品・パーソナル用品	0.57	合計		98.18

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

平成23年４月28日現在

種類	取引所等および資産の名称	買建／売建	数量（枚）	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	市場外取引 米ドル	売建	432,667.41	35,331,620	35,509,014	1.70
為替予約取引	市場外取引 カナダドル	売建	38,288.72	3,283,257	3,315,803	0.16
為替予約取引	市場外取引 英ポンド	売建	45,996.57	6,192,058	6,300,150	0.30

為替予約取引	市場外取引 スイスフラン	売建	44,032.23	4,120,536	4,144,753	0.20
為替予約取引	市場外取引 ノルウェークローネ	売建	51,242.06	789,896	799,376	0.04
為替予約取引	市場外取引 ユーロ	売建	74,787.20	8,959,506	9,105,341	0.44

（注）

１．基準日に対顧客先物売買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。

（１）基準日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という）の対顧客先物売買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顧客先物売買相場の仲値で評価しております。

（２）基準日において当該日の対顧客先物売買相場が発表されていない場合は、以下の計算方法によっております。

①基準日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後の二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

②基準日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

２．基準日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、基準日の対顧客直物売買相場の仲値で評価しております。

〔外国債券マザーファンド（Ｂ号）〕

（１）投資状況

平成23年４月28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	599,459,155	29.95
	カナダ	57,146,487	2.85
	ドイツ	294,373,493	14.71
	イタリア	249,196,093	12.45
	フランス	134,053,545	6.70
	オーストラリア	18,519,018	0.93
	イギリス	154,035,113	7.70
	シンガポール	24,084,811	1.20
	オランダ	38,082,105	1.90
	スペイン	52,917,709	2.64
	ベルギー	87,035,592	4.35
	スウェーデン	16,679,946	0.83
	ノルウェー	8,730,860	0.44
	デンマーク	17,908,784	0.89
	メキシコ	19,594,302	0.98
	ポーランド	18,316,533	0.92
	小 計	1,790,133,546	89.43
特殊債券	ドイツ	25,741,043	1.29
	オーストリア	26,113,801	1.30
	国際機関	51,596,033	2.58
	小 計	103,450,877	5.17
社債券	アメリカ	26,008,968	1.30
	オランダ	16,883,856	0.84
	小 計	42,892,824	2.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		65,277,055	3.26

合計(純資産総額)	2,001,754,302	100.00

（2）投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成23年４月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価／金額（円）	評価額 単価／金額（円）	利率(%)／償還期限	投資比率（%）
ドイツ	国債証券	DBR 3.25% 20/01/04	1,120,000	12,205.25 136,698,880	12,243.97 137,132,503	3.25 2020/1/4	6.85
イタリア	国債証券	BTPS 4.25 13/08/01	870,000	12,502.18 108,769,006	12,460.72 108,408,299	4.25 2013/8/1	5.42
ドイツ	国債証券	BUNDESSCHATZ 1% 12/03/16	810,000	12,136.27 98,303,825	12,145.33 98,377,252	1 2012/3/16	4.91
アメリカ	国債証券	US T 2.5% 15/03/31	1,020,000	8,454.24 86,233,248	8,506.82 86,769,589	2.5 2015/3/31	4.33
アメリカ	国債証券	US T 3.875% 12/10/31	930,000	8,666.00 80,593,859	8,635.71 80,312,137	3.875 2012/10/31	4.01
アメリカ	国債証券	US T 4.5% 160215	860,000	9,128.11 78,501,804	9,172.44 78,882,984	4.5 2016/2/15	3.94
アメリカ	国債証券	US T 4.375% 38/02/15	750,000	7,961.76 59,713,200	8,133.61 61,002,112	4.375 2038/2/15	3.05
イタリア	国債証券	BTPS 4.5% 20/02/01	490,000	12,045.48 59,022,893	12,120.98 59,392,830	4.5 2020/2/1	2.97
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 21/02/15	640,000	8,308.79 53,176,297	8,381.13 53,639,280	3.625 2021/2/15	2.68
イタリア	国債証券	BTPS 4.5% 26/03/01	460,000	11,239.37 51,701,106	11,467.08 52,748,572	4.5 2026/3/1	2.64
アメリカ	国債証券	US T 3.25% 16/06/30	550,000	8,600.34 47,301,883	8,655.59 47,605,758	3.25 2016/6/30	2.38
アメリカ	国債証券	US T 3.125% 19/05/15	560,000	8,275.69 46,343,917	8,269.56 46,309,536	3.125 2019/5/15	2.31

フランス	国債証券	FRTR 4% 38/10/25	380,000	12,007.73 45,629,410	11,847.00 45,018,612	4 2038/10/25	2.25
イギリス	国債証券	UKT 4.25% 36/03/07	320,000	13,406.82 42,901,824	13,657.53 43,704,096	4.25 2036/3/7	2.18
イギリス	国債証券	UKT 5% 18/03/07	260,000	15,246.73 39,641,498	15,411.54 40,070,006	5 2018/3/7	2.00
アメリカ	国債証券	US T 6.125% 27/11/15	360,000	10,150.45 36,541,646	10,221.52 36,797,489	6.125 2027/11/15	1.84
アメリカ	国債証券	US T 2.375% 14/08/31	420,000	8,461.93 35,540,127	8,493.35 35,672,096	2.375 2014/8/31	1.78
ベルギー	国債証券	BGB 5% 12/09/28	280,000	12,690.86 35,534,434	12,640.94 35,394,642	5 2012/9/28	1.77
ドイツ	国債証券	DBR 4.75% 34/07/04	240,000	13,886.34 33,327,231	13,826.98 33,184,760	4.75 2034/7/4	1.66
イギリス	国債証券	UKT 4.5% 19/03/07	210,000	14,885.05 31,258,605	14,843.95 31,172,295	4.5 2019/3/7	1.56
スペイン	国債証券	SPGB 6% 29/01/31	250,000	12,259.80 30,649,509	12,161.16 30,402,924	6 2029/1/31	1.52
イタリア	国債証券	BTPS 5% 34/08/01	250,000	11,420.80 28,552,020	11,458.55 28,646,392	5 2034/8/1	1.43
オーストリア	特殊債券	OKB 4.75% 12/10/16	300,000	8,736.84 26,210,548	8,704.60 26,113,801	4.75 2012/10/16	1.30
国際機関	特殊債券	NORDIC INV 3.5% 13/09/11	300,000	8,668.46 26,005,406	8,688.57 26,065,735	3.5 2013/9/11	1.30
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 18/10/25	200,000	12,896.66 25,793,321	12,875.95 25,751,919	4.25 2018/10/25	1.29
ドイツ	特殊債券	RENTENBANK 3.25% 130315	300,000	8,585.87 25,757,639	8,580.34 25,741,043	3.25 2013/3/15	1.29
国際機関	特殊債券	EIB 5.375% 12/10/15	200,000	12,826.27 25,652,555	12,765.14 25,530,298	5.375 2012/10/15	1.28
フランス	国債証券	FRTR 4% 13/10/25	200,000	12,774.89 25,549,781	12,717.65 25,435,317	4 2013/10/25	1.27

アメリカ	国債証券	US T 3.75% 18/11/15	280,000	8,619.22 24,133,818	8,696.63 24,350,571	3.75 2018/11/15	1.22
シンガポール	国債証券	SIGB 3.625 140701	330,000	7,322.97 24,165,801	7,298.42 24,084,811	3.625 2014/7/1	1.20

ロ 種類別の投資比率

平成23年４月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	89.43
特殊債券	5.17
社債券	2.14
合計	96.74

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

平成23年４月28日現在

種類	取引所等および資産の名称	買建／売建	数量（枚）	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
為替予約取引	市場外取引 米ドル	買建	191,302.83	15,636,691	15,700,223	0.78
為替予約取引	市場外取引 オーストラリアドル	買建	240,000	19,776,504	21,376,800	1.07
為替予約取引	市場外取引 英ポンド	買建	229,705.76	30,976,832	31,462,797	1.57
為替予約取引	市場外取引 スイスフラン	買建	140,000	12,392,296	13,178,200	0.66
為替予約取引	市場外取引 シンガポールドル	買建	250,000	16,307,475	16,697,500	0.83
為替予約取引	市場外取引 スウェーデンクローナ	買建	1,400,000	18,638,900	19,026,000	0.95

為替予約取引	市場外取引 ポーランドズロチ	買建	640,000	19,180,160	19,667,200	0.98
為替予約取引	市場外取引 ユーロ	買建	492,919.82	58,934,725	60,003,129	3.00
為替予約取引	市場外取引 米ドル	売建	940,000	77,796,990	77,127,000	3.85
為替予約取引	市場外取引 英ポンド	売建	223,676.80	30,163,800	30,637,011	1.53
為替予約取引	市場外取引 ユーロ	売建	359,592.10	42,661,797	43,761,246	2.19

（注）

１．基準日に対顧客先物売買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。

（１）基準日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という）の対顧客先物売買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顧客先物売買相場の仲値で評価しております。

（２）基準日において当該日の対顧客先物売買相場が発表されていない場合は、以下の計算方法によっております。

①基準日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後の二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

②基準日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

２．基準日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、基準日の対顧客直物売買相場の仲値で評価しております。

〔参考情報〕

基準日2011年4月28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

＜年金プラン30＞

基準価額	10,217円
純資産総額	18億円

分配の推移

決算期	分配金
2011年3月	0円
2010年3月	0円
2009年3月	0円
2008年3月	0円
2007年3月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

＜年金プラン50＞

基準価額	9,233円
純資産総額	46億円

分配の推移

決算期	分配金
2011年3月	0円
2010年3月	0円
2009年3月	0円
2008年3月	0円
2007年3月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

＜年金プラン70＞

基準価額	8,114円
純資産総額	45億円

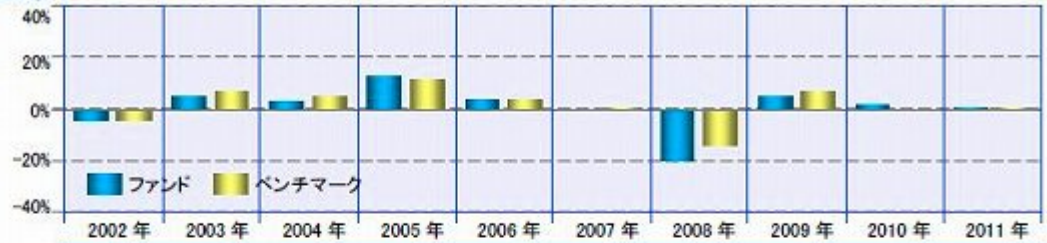
分配の推移

決算期	分配金
2011年3月	0円
2010年3月	0円
2009年3月	0円
2008年3月	0円
2007年3月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

年間収益率の推移（暦年ベース）

＜年金プラン30＞



収益率(%)	2002年	2003年	2004年	2005年	2006年	2007年	2008年	2009年	2010年	2011年
ファンド	△5.0	5.4	3.5	12.7	3.7	△0.6	△19.4	5.6	1.5	1.0
ベンチマーク	△3.7	6.8	5.3	11.4	3.9	0.7	△14.8	6.8	0.2	0.7

＜年金プラン50＞

収益率(%)	2002年	2003年	2004年	2005年	2006年	2007年	2008年	2009年	2010年	2011年
ファンド	△10.6	9.5	4.7	20.8	5.5	△2.1	△29.1	9.1	1.5	1.1
ベンチマーク	△8.8	11.5	7.4	18.4	5.8	△0.9	△25.0	10.1	△0.4	0.9

＜年金プラン70＞

収益率(%)	2002年	2003年	2004年	2005年	2006年	2007年	2008年	2009年	2010年	2011年
ファンド	△15.9	13.6	5.8	29.6	7.0	△4.2	△38.2	12.4	1.4	1.0
ベンチマーク	△13.6	16.3	9.4	26.0	7.4	△2.9	△34.2	12.8	△1.1	0.8

2011年の収益率は、年初から2011年4月28日までの騰落率を表示しています。
ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

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に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。

（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。

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、各ファンドについてそれぞれ下記の率の信託財産留保額を加算した価額（販売基準価額といいます。）となります。

年金プラン30： 0.085%
年金プラン50： 0.105%
年金プラン70： 0.125%

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、各計算期末の販売基準価額となります。

基準価額に買付時の信託財産留保額を加算した販売基準価額は、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、それぞれ「年金30」、「年金50」、「年金70」として掲載されます（販売基準価額は、便宜上１万口単位で表示される場合があります。）。

ハ 申込手数料

無手数料です。

ただし、１口につき取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、各ファンドについてそれぞれ定められた率を乗じて得た信託財産留保額（上記「ロ 申込価額」をご参照ください。）を申込金額からご負担いただきます。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

お申込価額、申込単位の詳細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	電話番号※	インターネット・ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

※お問い合わせは、原則として営業日の午前９時～午後５時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販売基準価額×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。
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から、各ファンドについてそれぞれ下記の率の信託財産留保額を差し引いた価額となります。

年金プラン30：0.085%
年金プラン50：0.105%
年金プラン70：0.125%

一部解約価額は、委託会社の営業日において日々算出されますので、委託会社（電話：0120-88-2976）にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせします。
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を除きます。）を法令および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、原則としてわが国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、原則としてわが国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。

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、委託会社（電話：0120-88-2976）に問い合わせることにより知ることができます。
なお、基準価額に買付時の信託財産留保額を加算した販売基準価額は、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、それぞれ「年金30」、「年金50」、「年金70」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	電話番号※	インターネット・ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

※お問い合わせは、原則として営業日の午前９時～午後５時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】

平成12年９月19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３月７日から翌年３月６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、残存口数が30億口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。

（ニ）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、受託会社が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。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わないことがあります。

b．当ファンドは、分配金自動再投資専用ですので、分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、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。

ハ 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 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。

ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

チ 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」を作成します。

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。

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。

当ファンドは、分配金自動再投資専用であるため、収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、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。

ハ 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。

ニ 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ときは、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」（以下「財務諸表等規則」といいます）（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」（以下「投資信託財産計算規則」といいます）（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

また、第10期（平成21年３月７日から平成22年３月８日まで）については、改正前の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づき、第11期（平成22年３月９日から平成23年３月７日まで）については、改正後の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則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10期（平成21年３月７日から平成22年３月８日まで）の財務諸表については、あずさ監査法人により監査を受け、第11期（平成22年３月９日から平成23年３月７日まで）の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年７月１日をもって有限責任 あずさ監査法人となっております。

１【財務諸表】

【三井住友・年金プラン30】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 (平成22年３月８日現在)	第11期 (平成23年３月７日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	20,190,056	30,461,913
親投資信託受益証券	3,513,249,560	2,719,035,648
未収利息	27	41
流動資産合計	3,533,439,643	2,749,497,602
資産合計	3,533,439,643	2,749,497,602
負債の部		
流動負債		
未払解約金	613,443	535,579
未払受託者報酬	1,446,189	1,209,261
未払委託者報酬	14,823,364	12,394,859
その他未払費用	139,113	138,009
流動負債合計	17,022,109	14,277,708
負債合計	17,022,109	14,277,708
純資産の部		
元本等		
元本	3,521,341,614	2,661,199,964
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△4,924,080	74,019,930
元本等合計	3,516,417,534	2,735,219,894
純資産合計	3,516,417,534	2,735,219,894
負債純資産合計	3,533,439,643	2,749,497,602

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
営業収益		
受取利息	24,566	3,341
有価証券売買等損益	400,897,171	98,802,088
営業収益合計	400,921,737	98,805,429
営業費用		
受託者報酬	2,830,752	2,707,321
委託者報酬	29,015,073	27,749,940
その他費用	278,953	278,953
営業費用合計	32,124,778	30,736,214
営業利益	368,796,959	68,069,215
経常利益	368,796,959	68,069,215
当期純利益	368,796,959	68,069,215
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（△）	4,208,196	△7,774,519
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△370,144,831	△4,924,080
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,655,083	3,100,276
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,655,083	2,361,929
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	738,347
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,023,095	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,023,095	－
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△4,924,080	74,019,930

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同 左
２．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当計算期間は、当期末が休日のため平成21年３月７日から平成22年３月８日までとなっております。	計算期間の取扱い 当計算期間は、前期末および当期末が休日のため平成22年３月９日から平成23年３月７日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第10期 （平成22年３月８日現在）	第11期 （平成23年３月７日現在）
１．受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 3,521,341,614口	当計算期間の末日における受益権の総数 2,661,199,964口
２．元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の６第10号に規定する額 4,924,080円	――――――
３．１単位当たり純資産額	0.9986円 （１万口＝9,986円）	1.0278円 （１万口＝10,278円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（57,674,899円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（134,155,610円）、および分配準備積立金（512,111,606円）より、分配対象収益は703,942,115円（１万口当たり1,999.07円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（35,582,548円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（129,385,711円）、および分配準備積立金（403,834,583円）より、分配対象収益は568,802,842円（１万口当たり2,137.39円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年３月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年３月10日）を適用しております。

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項 目	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７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、親投資信託受益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。当ファンドにおける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。 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。
３．金融商品に係るリスク管理体制	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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 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、上下限値、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限値（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。

４．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	**金融商品の時価には、市場価格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。**

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

第10期（自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日）

種 類	貸借対照表計上額	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	3,513,249,560円	342,020,904円
合 計	3,513,249,560円	342,020,904円

第11期（自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７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	87,054,350円
合 計	87,054,350円

（デリバティブ取引に関する注記）

Ⅰ．取引の状況に関する事項

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日
１．取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 ①ａ．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引。 ｂ．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市場における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。 ｃ．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市場におけるこれらの取引と類似の取引。 ②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（「スワップ取引」）。 ③金利先渡取引および為替先渡取引。 ④外国為替の売買の予約取引。
２．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
３．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。
４．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとして価格変動リスクがあります。
５．取引に係るリスクの管理体制	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、投資信託約款・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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。
６．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。

Ⅱ．取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第10期（平成22年３月８日現在）

第10期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

第11期（平成23年３月７日現在）

第11期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期（自　平成21年３月７日　至　平成22年３月８日）
該当事項はありません。

第11期（自　平成22年３月９日　至　平成23年３月７日）
該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第10期 （平成22年３月８日現在）	第11期 （平成23年３月７日現在）
期首元本額	3,390,095,118円	3,521,341,614円
期中追加設定元本額	183,714,580円	210,591,064円
期中一部解約元本額	52,468,084円	1,070,732,714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

種 類	銘柄名	元本額	評価額	
			単価	金額
親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド （Ｂ号）	774,594,714円	0.7088円	549,032,733円
親投資信託 受益証券	国内債券マザーファンド （Ｂ号）	1,405,743,146円	1.1685円	1,642,610,866円
親投資信託 受益証券	外国株式マザーファンド （Ｂ号）	305,967,497円	0.8962円	274,208,070円
親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド （Ｂ号）	143,707,560円	1.7618円	253,183,979円
合 計	――――	2,630,012,917円	――	2,719,035,648円

【三井住友・年金プラン50】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 (平成22年３月８日現在)	第11期 (平成23年３月７日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	29,280,692	53,617,050
親投資信託受益証券	4,356,269,505	4,657,307,764
未収入金	－	504,000
未収利息	40	73
流動資産合計	4,385,550,237	4,711,428,887
資産合計	4,385,550,237	4,711,428,887
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,104,710	1,049,219
未払受託者報酬	1,779,402	1,853,336
未払委託者報酬	22,687,318	23,629,992
その他未払費用	190,328	188,856
流動負債合計	25,761,758	26,721,403
負債合計	25,761,758	26,721,403
純資産の部		
元本等		
元本	4,828,380,564	4,983,897,165
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△468,592,085	△299,189,681
元本等合計	4,359,788,479	4,684,707,484
純資産合計	4,359,788,479	4,684,707,484
負債純資産合計	4,385,550,237	4,711,428,887

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
営業収益		
受取利息	25,888	3,960
有価証券売買等損益	745,446,183	235,360,259
営業収益合計	745,472,071	235,364,219
営業費用		
受託者報酬	3,458,217	3,695,157
委託者報酬	44,092,126	47,113,152
その他費用	381,688	381,688
営業費用合計	47,932,031	51,189,997
営業利益	697,540,040	184,174,222
経常利益	697,540,040	184,174,222
当期純利益	697,540,040	184,174,222
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（△）	7,138,351	△625,910
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△1,138,777,360	△468,592,085
剰余金増加額又は欠損金減少額	16,053,060	8,228,666
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	16,053,060	8,228,666
剰余金減少額又は欠損金増加額	36,269,474	23,626,394
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	36,269,474	23,626,394
分配金	―	―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△468,592,085	△299,189,681

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同 左
２．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当計算期間は、当期末が休日のため平成21年３月７日から平成22年３月８日までとなっております。	計算期間の取扱い 当計算期間は、前期末および当期末が休日のため平成22年３月９日から平成23年３月７日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第10期 （平成22年３月８日現在）	第11期 （平成23年３月７日現在）
１．受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 4,828,380,564口	当計算期間の末日における受益権の総数 4,983,897,165口
２．元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の６第10号に規定する額 468,592,085円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の６第10号に規定する額 299,189,681円
３．１単位当たり純資産額	0.9030円 （１万口＝9,030円）	0.9400円 （１万口＝9,400円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（74,661,540円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（175,657,116円）、および分配準備積立金（727,069,858円）より、分配対象収益は977,388,514円（１万口当たり2,024.25円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（65,763,029円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（221,233,380円）、および分配準備積立金（788,171,708円）より、分配対象収益は1,075,168,117円（１万口当たり2,157.28円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年３月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年３月10日）を適用しております。

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項 目	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７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、親投資信託受益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。当ファンドにおける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。 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。
３．金融商品に係るリスク管理体制	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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 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、上下限値、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限値（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。

４．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	**金融商品の時価には、市場価格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。**

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

第10期（自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日）

種 類	貸借対照表計上額	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	4,356,269,505円	650,931,232円
合 計	4,356,269,505円	650,931,232円

第11期（自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７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	207,188,657円
合 計	207,188,657円

（デリバティブ取引に関する注記）

Ⅰ．取引の状況に関する事項

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日
１．取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 ①ａ．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引。 ｂ．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市場における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。 ｃ．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市場におけるこれらの取引と類似の取引。 ②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（「スワップ取引」）。 ③金利先渡取引および為替先渡取引。 ④外国為替の売買の予約取引。
２．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
３．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。
４．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとして価格変動リスクがあります。
５．取引に係るリスクの管理体制	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、投資信託約款・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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。
６．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。

Ⅱ．取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第10期（平成22年３月８日現在）

第10期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

第11期（平成23年３月７日現在）

第11末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期（自　平成21年３月７日　至　平成22年３月８日）
該当事項はありません。

第11期（自　平成22年３月９日　至　平成23年３月７日）
該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第10期 （平成22年３月８日現在）	第11期 （平成23年３月７日現在）
期首元本額	4,623,415,884円	4,828,380,564円
期中追加設定元本額	270,724,990円	239,451,241円
期中一部解約元本額	65,760,310円	83,934,640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

種 類	銘柄名	元本額	評価額	
			単価	金額
親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド （Ｂ号）	2,174,521,201円	0.7088円	1,541,300,627円
親投資信託 受益証券	国内債券マザーファンド （Ｂ号）	1,613,742,682円	1.1685円	1,885,658,323円
親投資信託 受益証券	外国株式マザーファンド （Ｂ号）	887,238,754円	0.8962円	795,143,371円
親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド （Ｂ号）	247,023,183円	1.7618円	435,205,443円
合 計	――――	4,922,525,820円	――	4,657,307,764円

【三井住友・年金プラン70】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 (平成22年３月８日現在)	第11期 (平成23年３月７日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	34,068,905	41,161,421
親投資信託受益証券	4,335,493,911	4,663,339,215
未収入金	－	715,000
未収利息	46	56
流動資産合計	4,369,562,862	4,705,215,692
資産合計	4,369,562,862	4,705,215,692
負債の部		
流動負債		
未払解約金	212,979	863,731
未払受託者報酬	1,769,201	1,827,039
未払委託者報酬	26,980,277	27,862,258
その他未払費用	222,920	221,080
流動負債合計	29,185,377	30,774,108
負債合計	29,185,377	30,774,108
純資産の部		
元本等		
元本	5,447,632,576	5,582,274,845
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△1,107,255,091	△907,833,261
元本等合計	4,340,377,485	4,674,441,584
純資産合計	4,340,377,485	4,674,441,584
負債純資産合計	4,369,562,862	4,705,215,692

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
営業収益		
受取利息	17,588	3,062
有価証券売買等損益	978,633,930	287,845,304
営業収益合計	978,651,518	287,848,366
営業費用		
受託者報酬	3,428,862	3,641,491
委託者報酬	52,290,050	55,532,631
その他費用	447,032	447,032
営業費用合計	56,165,944	59,621,154
営業利益	922,485,574	228,227,212
経常利益	922,485,574	228,227,212
当期純利益	922,485,574	228,227,212
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（△）	5,973,461	△367,248
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△1,988,892,859	△1,107,255,091
剰余金増加額又は欠損金減少額	17,757,054	13,222,402
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	17,757,054	13,222,402
剰余金減少額又は欠損金増加額	52,631,399	42,395,032
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	52,631,399	42,395,032
分配金	―	―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△1,107,255,091	△907,833,261

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同 左
２．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当計算期間は、当期末が休日のため平成21年３月７日から平成22年３月８日までとなっております。	計算期間の取扱い 当計算期間は、前期末および当期末が休日のため平成22年３月９日から平成23年３月７日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第10期 （平成22年３月８日現在）	第11期 （平成23年３月７日現在）
１．受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 5,447,632,576口	当計算期間の末日における受益権の総数 5,582,274,845口
２．元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の６第10号に規定する額 1,107,255,091円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の６第10号に規定する額 907,833,261円
３．１単位当たり純資産額	0.7967円 （１万口＝7,967円）	0.8374円 （１万口＝8,374円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（76,990,467円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（123,716,067円）、および分配準備積立金（842,368,757円）より、分配対象収益は1,043,075,291円（１万口当たり1,914.73円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（68,645,014円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（160,586,672円）、および分配準備積立金（908,678,585円）より、分配対象収益は1,137,910,271円（１万口当たり2,038.43円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年３月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年３月10日）を適用しております。

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項 目	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７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、親投資信託受益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。当ファンドにおける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。 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。
３．金融商品に係るリスク管理体制	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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 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、上下限値、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限値（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。

４．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	**金融商品の時価には、市場価格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。**

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

第10期（自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日）

種 類	貸借対照表計上額	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	4,335,493,911円	870,324,340円
合 計	4,335,493,911円	870,324,340円

第11期（自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７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	264,669,964円
合 計	264,669,964円

（デリバティブ取引に関する注記）

Ⅰ．取引の状況に関する事項

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日
１．取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 ①ａ．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引。 ｂ．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市場における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。 ｃ．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市場におけるこれらの取引と類似の取引。 ②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（「スワップ取引」）。 ③金利先渡取引および為替先渡取引。 ④外国為替の売買の予約取引。
２．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
３．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。
４．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとして価格変動リスクがあります。
５．取引に係るリスクの管理体制	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、投資信託約款・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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。
６．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。

Ⅱ．取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第10期（平成22年３月８日現在）

第10期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

第11期（平成23年３月７日現在）

第11期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期（自　平成21年３月７日　至　平成22年３月８日）
該当事項はありません。

第11期（自　平成22年３月９日　至　平成23年３月７日）
該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第10期 （平成22年３月８日現在）	第11期 （平成23年３月７日現在）
期首元本額	5,280,601,092円	5,447,632,576円
期中追加設定元本額	214,408,798円	199,361,397円
期中一部解約元本額	47,377,314円	64,719,128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

種 類	銘柄名	元本額	評価額	
			単価	金額
親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド （Ｂ号）	3,097,314,752円	0.7088円	2,195,376,696円
親投資信託 受益証券	国内債券マザーファンド （Ｂ号）	816,394,965円	1.1685円	953,957,516円
親投資信託 受益証券	外国株式マザーファンド （Ｂ号）	1,202,915,136円	0.8962円	1,078,052,544円
親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド （Ｂ号）	247,447,190円	1.7618円	435,952,459円
合 計	―――	5,364,072,043円	――	4,663,339,215円

（参考情報）

三井住友・年金プラン30、三井住友・年金プラン50および三井住友・年金プラン70は、「国内株式マザーファンド（Ｂ号）」、「国内債券マザーファンド（Ｂ号）」、「外国株式マザーファンド（Ｂ号）」および「外国債券マザーファンド（Ｂ号）」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。

「国内株式マザーファンド（Ｂ号）」の状況

（１）貸借対照表

期 別	第10期 （平成22年３月８日現在）	第11期 （平成23年３月７日現在）
科 目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
Ⅰ 流動資産		
コール・ローン	97,672,570	72,172,289
株式	4,229,793,800	4,210,080,450
未収入金	12,735,811	43,650,663
未収配当金	3,789,150	3,960,400
未収利息	133	98
流動資産合計	4,343,991,464	4,329,863,900
資産合計	4,343,991,464	4,329,863,900
負債の部		
Ⅰ 流動負債		
未払金	13,230,805	44,003,727
流動負債合計	13,230,805	44,003,727
負債合計	13,230,805	44,003,727
純資産の部		
Ⅰ 元本等		
１ 元本		
元本	6,583,336,613	6,046,430,667
２ 剰余金		

期末剰余金又は期末欠損金（△）	△2,252,575,954	△1,760,570,494
元本等合計	4,330,760,659	4,285,860,173
純資産合計	4,330,760,659	4,285,860,173
負債・純資産合計	4,343,991,464	4,329,863,900

（注）「国内株式マザーファンド（Ｂ号）」は、毎年３月６日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成22年３月８日ならびに平成23年３月７日現在における同マザーファンドの状況です。

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	株式（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、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、取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式（売買目的有価証券） 同 左
２．収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。	受取配当金の計上基準 同 左

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第10期 （平成22年３月８日現在）	第11期 （平成23年３月７日現在）
１．受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 6,583,336,613口	当計算期間の末日における受益権の総数 6,046,430,667口
２．元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の６第10号に規定する額 2,252,575,954円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の６第10号に規定する額 1,760,570,494円
３．１単位当たり純資産額	0.6578円 （１万口＝6,578円）	0.7088円 （１万口＝7,088円）

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年３月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年３月10日）を適用しております。

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項 目	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７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。当ファンドにおける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、および価格変動リスクの回避を目的としております。 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 （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。
３．金融商品に係るリスク管理体制	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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 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、上下限値、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限値（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。

４．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	**金融商品の時価には、市場価格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。**

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
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） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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）

Ⅰ．取引の状況に関する事項

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日
１．取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 ①ａ．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券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。 ｂ．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。 ②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（「スワップ取引」）。 ③金利先渡取引。
２．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
３．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため。
４．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとして価格変動リスクがあります。
５．取引に係るリスクの管理体制	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、投資信託約款・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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。

６．取引の時価等に関する事項についての補足説明	**該当事項はありません。**

Ⅱ．取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第10期（平成22年３月８日現在）
第10期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

第11期（平成23年３月７日現在）
第11期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期（自 平成21年３月７日　至 平成22年３月８日）
該当事項はありません。

第11期（自 平成22年３月９日　至 平成23年３月７日）
該当事項はありません。

（その他の注記）

第10期 （平成22年３月８日現在）	
本有価証券報告書における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	6,668,937,521円
同期中における追加設定元本額	828,338,933円
同期中における一部解約元本額	913,939,841円
期末における元本の内訳	
三井住友・年金プラン30	1,116,810,855円
三井住友・年金プラン50	2,264,840,990円
三井住友・年金プラン70	3,201,684,768円
合 計	6,583,336,613円

第11期 （平成23年３月７日現在）
本有価証券報告書における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	6,583,336,613円
同期中における追加設定元本額	779,775,913円
同期中における一部解約元本額	1,316,681,859円
期末における元本の内訳	
三井住友・年金プラン30	774,594,714円
三井住友・年金プラン50	2,174,521,201円
三井住友・年金プラン70	3,097,314,752円
合 計	6,046,430,667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 単価	評価額 金額	備 考
国際石油開発帝石	39	588,000	22,932,000	
積水ハウス	27,000	836	22,572,000	
山崎製パン	8,000	987	7,896,000	
伊藤ハム	26,000	312	8,112,000	
アサヒビール	17,300	1,552	26,849,600	
コカ・コーラウエスト	8,800	1,453	12,786,400	
日清オイリオグループ	25,000	459	11,475,000	
不二製油	28,300	1,200	33,960,000	
キユーピー	7,500	1,036	7,770,000	
旭化成	42,000	577	24,234,000	
昭和電工	119,000	176	20,944,000	
日産化学工業	17,500	929	16,257,500	
セントラル硝子	32,000	358	11,456,000	
日本触媒	10,000	960	9,600,000	
三井化学	97,000	297	28,809,000	
東京応化工業	10,700	1,794	19,195,800	
三菱ケミカルホールディングス	31,500	583	18,364,500	
日本ゼオン	17,000	819	13,923,000	
宇部興産	62,000	257	15,934,000	
ＡＤＥＫＡ	25,400	880	22,352,000	
富士フイルムホールディングス	16,000	2,829	45,264,000	
日東電工	7,700	4,720	36,344,000	
協和発酵キリン	17,000	823	13,991,000	
アステラス製薬	16,300	3,180	51,834,000	
塩野義製薬	19,100	1,523	29,089,300	
中外製薬	11,300	1,540	17,402,000	

ツムラ	17,000	2,625	44,625,000	
ＪＸホールディングス	81,400	597	48,595,800	
旭硝子	40,000	1,128	45,120,000	
日本碍子	11,000	1,424	15,664,000	
住友金属工業	212,000	203	43,036,000	
住友金属鉱山	8,000	1,513	12,104,000	
ＤＯＷＡホールディングス	41,000	554	22,714,000	
住友電気工業	35,000	1,235	43,225,000	
フジクラ	47,000	404	18,988,000	
ＳＵＭＣＯ	19,300	1,464	28,255,200	
日本発條	27,000	939	25,353,000	
アマダ	47,000	730	34,310,000	
森精機製作所	19,300	1,050	20,265,000	
ディスコ	5,600	5,670	31,752,000	
ＳＭＣ	900	13,970	12,573,000	
小松製作所	25,000	2,601	65,025,000	
椿本チエイン	77,000	493	37,961,000	
日本精工	37,000	780	28,860,000	
ＩＨＩ	85,000	216	18,360,000	
ブラザー工業	20,100	1,293	25,989,300	
ミネベア	74,000	478	35,372,000	
日立製作所	180,000	505	90,900,000	
東芝	140,000	518	72,520,000	
三菱電機	61,000	962	58,682,000	
日本電産	1,600	7,430	11,888,000	
オムロン	14,900	2,377	35,417,300	
サンケン電気	27,000	518	13,986,000	
セイコーエプソン	14,000	1,395	19,530,000	
パナソニック	35,000	1,094	38,290,000	
ソニー	19,500	2,926	57,057,000	
ＴＤＫ	7,400	5,510	40,774,000	

ミツミ電機	15,300	1,307	19,997,100	
日本航空電子工業	31,000	671	20,801,000	
ウシオ電機	15,100	1,617	24,416,700	
ファナック	4,700	12,800	60,160,000	
太陽誘電	26,000	1,316	34,216,000	
村田製作所	7,800	5,930	46,254,000	
ニチコン	7,600	1,172	8,907,200	
日本ケミコン	33,000	559	18,447,000	
大日本スクリーン製造	33,000	814	26,862,000	
豊田自動織機	7,900	2,767	21,859,300	
川崎重工業	70,000	337	23,590,000	
日産自動車	100,200	829	83,065,800	
トヨタ自動車	21,500	3,695	79,442,500	
カルソニックカンセイ	85,000	405	34,425,000	
ケーヒン	9,500	1,727	16,406,500	
アイシン精機	5,800	3,095	17,951,000	
ダイハツ工業	14,000	1,264	17,696,000	
本田技研工業	46,400	3,435	159,384,000	
スズキ	22,100	1,916	42,343,600	
エクセディ	2,800	2,613	7,316,400	
豊田合成	17,500	1,873	32,777,500	
タカタ	8,500	2,544	21,624,000	
任天堂	1,000	22,900	22,900,000	
コクヨ	22,100	654	14,453,400	
東京電力	36,600	2,128	77,884,800	
東京瓦斯	80,000	361	28,880,000	
東日本旅客鉄道	12,900	5,740	74,046,000	
東海旅客鉄道	25	730,000	18,250,000	
日立物流	9,200	1,286	11,831,200	
日本郵船	117,000	355	41,535,000	
新日鉄ソリューションズ	9,100	1,810	16,471,000	

ヤフー	675	31,950	21,566,250	
大塚商会	3,800	5,840	22,192,000	
日本テレビ放送網	1,190	13,810	16,433,900	
日本電信電話	24,600	4,060	99,876,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	437	155,200	67,822,400	
双日	167,000	184	30,728,000	
三井物産	27,700	1,491	41,300,700	
三菱商事	47,300	2,272	107,465,600	
ＤＣＭホールディングス	23,300	484	11,277,200	
Ｊ．フロント リテイリング	16,000	403	6,448,000	
ドン・キホーテ	11,700	2,778	32,502,600	
島忠	6,900	1,827	12,606,300	
コメリ	6,300	1,992	12,549,600	
しまむら	4,100	7,770	31,857,000	
高島屋	23,000	645	14,835,000	
ニトリホールディングス	3,200	7,150	22,880,000	
ファーストリテイリング	800	12,270	9,816,000	
サンドラッグ	9,800	2,383	23,353,400	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	372,600	447	166,552,200	
中央三井トラスト・ホールディングス	164,000	344	56,416,000	
三井住友フィナンシャルグループ	37,600	3,030	113,928,000	
みずほフィナンシャルグループ	188,700	167	31,512,900	
ジャフコ	11,800	2,649	31,258,200	
野村ホールディングス	48,300	496	23,956,800	
みずほ証券	25,000	240	6,000,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	49,000	299	14,651,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール	43,900	2,101	92,233,900	
Ｔ＆Ｄホールディングス	38,550	2,354	90,746,700	
リコーリース	3,400	2,186	7,432,400	
三菱ＵＦＪリース	9,800	3,520	34,496,000	
野村不動産ホールディングス	17,300	1,579	27,316,700	

三井不動産	21,000	1,668	35,028,000	
三菱地所	57,000	1,646	93,822,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	237	85,000	20,145,000	
綜合警備保障	8,600	970	8,342,000	
合 計	4,476,653		4,210,080,450	

(b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

「国内債券マザーファンド（Ｂ号）」の状況

（１）貸借対照表

期 別	第10期 （平成22年３月８日現在）	第11期 （平成23年３月７日現在）
科 目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
Ⅰ 流動資産		
コール・ローン	299,928,560	170,469,164
国債証券	25,360,224,640	25,477,377,740
地方債証券	1,414,886,500	723,709,000
特殊債券	3,086,652,681	1,857,769,846
社債券	5,698,015,000	5,112,639,000
未収入金	156,789,000	1,497,067,000
未収利息	129,078,091	107,361,571
前払費用	17,435,935	44,343,680
流動資産合計	36,163,010,407	34,990,737,001
資産合計	36,163,010,407	34,990,737,001
負債の部		
Ⅰ 流動負債		
未払金	－	1,412,597,000
未払解約金	134,484,868	27,504,876
流動負債合計	134,484,868	1,440,101,876
負債合計	134,484,868	1,440,101,876
純資産の部		
Ⅰ 元本等		
１ 元本		
元本	31,400,266,338	28,713,454,971
２ 剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,628,259,201	4,837,180,154
元本等合計	36,028,525,539	33,550,635,125

純資産合計	36,028,525,539	33,550,635,125
負債・純資産合計	36,163,010,407	34,990,737,001

（注）「国内債券マザーファンド（Ｂ号）」は、毎年３月６日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成22年３月８日ならびに平成23年３月７日現在における同マザーファンドの状況です。

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。	国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券（売買目的有価証券） 同 左

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第10期 （平成22年３月８日現在）	第11期 （平成23年３月７日現在）
１．受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 31,400,266,338口	当計算期間の末日における受益権の総数 28,713,454,971口
２．１単位当たり純資産額	1.1474円 （１万口＝11,474円）	1.1685円 （１万口＝11,685円）

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年３月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年３月10日）を適用しております。

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項 目	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７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、特殊債券および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。当ファンドにおける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、および価格変動リスクの回避を目的としております。 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 （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。
３．金融商品に係るリスク管理体制	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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 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、上下限値、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限値（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。

４．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	**金融商品の時価には、市場価格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。**

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
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、特殊債券および社債券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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）

Ⅰ．取引の状況に関する事項

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日
１．取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 ①ａ．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券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。 ｂ．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。 ②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（「スワップ取引」）。 ③金利先渡取引。
２．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
３．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため。
４．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとして価格変動リスクがあります。
５．取引に係るリスクの管理体制	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、投資信託約款・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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。

６．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。

Ⅱ．取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第10期（平成22年３月８日現在）

第10期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

第11期（平成23年３月７日現在）

第11期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期（自　平成21年３月７日　至　平成22年３月８日）

該当事項はありません。

第11期（自　平成22年３月９日　至　平成23年３月７日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

第10期 （平成22年３月８日現在）	
本有価証券報告書における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	52,614,817,223円
同期中における追加設定元本額	6,230,394,063円
同期中における一部解約元本額	27,444,944,948円
期末における元本の内訳	
三井住友・年金プラン30	1,823,334,336円
三井住友・年金プラン50	1,491,626,620円
三井住友・年金プラン70	726,206,681円
三井住友・日本債券年金ファンド	1,877,148,868円
ＳＭＡＭ・年金国内債券アクティブファンド(適格機関投資家専用）	7,298,733,494円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	2,927,580,982円

ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	6,997,422,533円
三井住友／ＦＯＦｓ用日本債Ｆ（適格機関投資家限定）	8,258,212,824円
合 計	31,400,266,338円

第11期 （平成23年３月７日現在）	
本有価証券報告書における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	31,400,266,338円
同期中における追加設定元本額	8,198,166,790円
同期中における一部解約元本額	10,884,978,157円
期末における元本の内訳	
三井住友・年金プラン30	1,405,743,146円
三井住友・年金プラン50	1,613,742,682円
三井住友・年金プラン70	816,394,965円
三井住友・日本債券年金ファンド	2,302,024,362円
ＳＭＡＭ・年金国内債券アクティブファンド(適格機関投資家専用）	8,883,842,790円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	2,044,450,158円
ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	8,008,033,774円
三井住友／ＦＯＦｓ用日本債Ｆ（適格機関投資家限定）	3,639,223,094円
合 計	28,713,454,971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	第７５回利付国債（５年）	400,000,000	408,296,000	
	第８８回利付国債（５年）	2,000,000,000	2,003,160,000	
	第９２回利付国債（５年）	2,500,000,000	2,476,725,000	
	第４７回変動利付国債（１５年）	300,000,000	302,700,000	
	第２３５回利付国債（１０年）	1,500,000,000	1,514,505,000	
	第２４８回利付国債（１０年）	500,000,000	504,840,000	
	第２５６回利付国債（１０年）	600,000,000	618,372,000	
	第２６４回利付国債（１０年）	2,100,000,000	2,180,808,000	
	第２７８回利付国債（１０年）	1,100,000,000	1,168,123,000	
	第２８７回利付国債（１０年）	500,000,000	536,090,000	
	第２９２回利付国債（１０年）	1,800,000,000	1,905,246,000	
	第２９７回利付国債（１０年）	1,500,000,000	1,547,775,000	
	第３０１回利付国債（１０年）	800,000,000	828,680,000	
	第３０３回利付国債（１０年）	1,500,000,000	1,538,685,000	
	第３０６回利付国債（１０年）	900,000,000	918,774,000	
	第３１０回利付国債（１０年）	100,000,000	98,037,000	
	第３回利付国債（３０年）	148,000,000	154,479,440	
	第２０回利付国債（３０年）	600,000,000	640,932,000	
	第３０回利付国債（３０年）	150,000,000	153,934,500	
	第６６回利付国債（２０年）	100,000,000	102,941,000	
	第６８回利付国債（２０年）	20,000,000	21,478,800	
	第７４回利付国債（２０年）	100,000,000	105,526,000	
	第８４回利付国債（２０年）	200,000,000	206,720,000	

	第９２回利付国債（２０年）	1,200,000,000	1,244,232,000	
	第９５回利付国債（２０年）	300,000,000	318,084,000	
	第９７回利付国債（２０年）	300,000,000	313,290,000	
	第１００回利付国債（２０年）	100,000,000	104,060,000	
	第１０４回利付国債（２０年）	800,000,000	819,744,000	
	第１１０回利付国債（２０年）	150,000,000	152,796,000	
	第１１１回利付国債（２０年）	450,000,000	464,530,500	
	第１１８回利付国債（２０年）	250,000,000	249,132,500	
	第１２１回利付国債（２０年）	1,400,000,000	1,369,746,000	
	第１２３回利付国債（２０年）	500,000,000	504,935,000	
	国債証券 小計	24,868,000,000	25,477,377,740	
地方債証券	第６３０回東京都公募公債	200,000,000	209,820,000	
	第２８回１号宮城県公募公債	100,000,000	100,958,000	
	平成１５年度第２回横浜市公募公債	100,000,000	100,630,000	
	平成１４年度第８回札幌市公募公債	100,000,000	100,607,000	
	第４回東京都住宅供給公社債券	200,000,000	211,694,000	
	地方債証券 小計	700,000,000	723,709,000	
特殊債券	第３３２回政府保証道路債券	100,000,000	103,703,000	
	第２３回都市再生債権	300,000,000	306,609,000	
	第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	167,598,000	174,084,042	
	第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,494,000	
	第６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,330,000	78,081,051	
	第７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,225,000	81,038,753	
	い第６７７号農林債	30,000,000	30,229,500	
	い第６９７号農林債	100,000,000	102,538,000	
	第２０６回信金中金債（５年）	50,000,000	50,571,500	
	第２１４回信金中金債（５年）	100,000,000	101,629,000	
	第１１１号商工債（３年）	100,000,000	100,892,000	
	第５回中日本高速道路株式会社社債	500,000,000	527,900,000	

	特殊債券 小計	1,801,153,000	1,857,769,846	
社債券	国家公務員共済組合連合会第二回ＣＬＯ特定目的会社第一回C号	100,000,000	100,950,000	
	アボット・ジャパン １．９５％ １３１１０６	100,000,000	102,010,000	
	第１１回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク円貨債券	100,000,000	100,402,000	
	第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債（２０１０）	100,000,000	100,573,000	
	第９回森永乳業株式会社無担保社債	100,000,000	101,344,000	
	第４９回株式会社東芝無担保社債	200,000,000	203,498,000	
	第４２回三菱電機株式会社無担保社債	100,000,000	102,109,000	
	第１０回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,007,000	
	第１８回三洋電機株式会社無担保社債	100,000,000	100,858,000	
	第１９回三洋電機株式会社無担保社債	100,000,000	100,602,000	
	第１回日本生命２０１０基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,817,000	
	第１回住友生命第３回基金流動化特定目的会社特定社債	100,000,000	99,778,000	
	第４９回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	104,185,000	
	第５１回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,035,000	
	第１１回本田技研工業株式会社無担保社債	200,000,000	201,066,000	
	第７０回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	103,577,000	
	第７２回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	102,977,000	
	第４回株式会社りそな銀行無担保社債	200,000,000	216,758,000	
	第2回株式会社ふくおかフィナンシャルグループ無担保社債	100,000,000	101,680,000	
	第２０回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	211,924,000	
	第３６回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	203,662,000	
	第１３回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	101,697,000	
	第１３回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	203,392,000	
	第１７回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,897,000	
	第６８回住友不動産株式会社無担保社債	200,000,000	207,112,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人第２回無担保投資法人債	100,000,000	100,313,000	
	第２７回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,303,000	
	第３１回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	206,950,000	
	第２０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,604,000	

	第３７回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,624,000	
	第５８回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	203,334,000	
	第５５５回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,220,000	
	第４８９回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,798,000	
	第４７１回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,099,000	
	第３５９回中国電力株式会社社債	200,000,000	204,294,000	
	第２７回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	206,728,000	
	第２７回大阪瓦斯株式会社無担保社債	300,000,000	306,462,000	
	社債券 小計	5,000,000,000	5,112,639,000	
合 計			33,171,495,586	

「外国株式マザーファンド（Ｂ号）」の状況

（１）貸借対照表

期 別	第10期 （平成22年３月８日現在）	第11期 （平成23年３月７日現在）
科 目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
Ⅰ 流動資産		
預金	1,321,859	1,950,878
コール・ローン	69,734,369	15,266,706
株式	2,281,958,034	2,122,108,782
派生商品評価勘定	―	205,896
未収入金	―	286,243,825
未収配当金	5,792,287	2,726,873
未収利息	95	20
流動資産合計	2,358,806,644	2,428,502,980
資産合計	2,358,806,644	2,428,502,980
負債の部		
Ⅰ 流動負債		
派生商品評価勘定	―	332,412
未払金	―	280,661,856
流動負債合計	―	280,994,268
負債合計	―	280,994,268
純資産の部		
Ⅰ 元本等		
１ 元本		
元本	2,882,253,564	2,396,121,387
２ 剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△523,446,920	△248,612,675
元本等合計	2,358,806,644	2,147,508,712
純資産合計	2,358,806,644	2,147,508,712

負債・純資産合計	2,358,806,644	2,428,502,980

（注）「外国株式マザーファンド（Ｂ号）」は、毎年３月６日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成22年３月８日ならびに平成23年３月７日現在における同マザーファンドの状況です。

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	株式（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、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、取引所もしくは店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式（売買目的有価証券） 同 左
２．デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。	為替予約取引 同 左
３．収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。	受取配当金の計上基準 同 左
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。	外貨建資産等の会計処理 同 左

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第10期 （平成22年３月８日現在）	第11期 （平成23年３月７日現在）
１．受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 2,882,253,564口	当計算期間の末日における受益権の総数 2,396,121,387口
２．元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の６第10号に規定する額 523,446,920円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の６第10号に規定する額 248,612,675円
３．１単位当たり純資産額	0.8184円 （１万口＝8,184円）	0.8962円 （１万口＝8,962円）

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年３月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年３月10日）を適用しております。

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項 目	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７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。当ファンドにおける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。
３．金融商品に係るリスク管理体制	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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 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、上下限値、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限値（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。

４．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	**金融商品の時価には、市場価格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。**

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
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） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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）

Ⅰ．取引の状況に関する事項

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日
１．取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 ①ａ．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引。 ｂ．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市場における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。 ｃ．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市場におけるこれらの取引と類似の取引。 ②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（「スワップ取引」）。 ③金利先渡取引および為替先渡取引。 ④外国為替の売買の予約取引。
２．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
３．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。
４．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとして価格変動リスクがあります。

５．取引に係るリスクの管理体制	**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、投資信託約款・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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。**
６．取引の時価等に関する事項についての補足説明	**該当事項はありません。**

Ⅱ．取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第10期（平成22年３月８日現在）

第10期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

第11期（平成23年３月７日現在）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち１年超	時価	評価損益
市場外取引	為替予約取引				
	売 建				
	米ドル	190,894,467	―	190,822,643	71,824
	カナダドル	16,409,017	―	16,418,706	△9,689
	ユーロ	47,569,597	―	47,656,524	△86,927
	英ポンド	11,746,031	―	11,723,701	22,330
	スイスフラン	18,152,751	―	18,275,822	△123,071
	ニュージーランドドル	1,315,654	―	1,316,087	△433
	買 建				
	米ドル	167,230,996	―	167,168,075	△62,921
	カナダドル	34,326,342	―	34,346,610	20,268
	ユーロ	49,278,047	―	49,368,096	90,049
	英ポンド	24,114,733	―	24,068,890	△45,843
	ノルウェークローネ	3,730,947	―	3,727,419	△3,528
	オーストラリアドル	1,947,916	―	1,949,341	1,425
	売建 合計	286,087,517	―	286,213,483	△125,966
	買建 合計	280,628,981	―	280,628,431	△550

（注）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

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

す。

①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

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

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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10期（自 平成21年３月７日　至 平成22年３月８日）
該当事項はありません。

第11期（自 平成22年３月９日　至 平成23年３月７日）
該当事項はありません。

（その他の注記）

第10期 （平成22年３月８日現在）	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,893,581,606円
同期中における追加設定元本額	535,122,524円
同期中における一部解約元本額	546,450,566円
期末における元本の内訳	
三井住友・年金プラン30	524,963,864円
三井住友・年金プラン50	1,029,855,826円
三井住友・年金プラン70	1,327,433,874円
合 計	2,882,253,564円

第11期 （平成23年３月７日現在）	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,882,253,564円
同期中における追加設定元本額	390,258,531円
同期中における一部解約元本額	876,390,708円
期末における元本の内訳	
三井住友・年金プラン30	305,967,497円
三井住友・年金プラン50	887,238,754円
三井住友・年金プラン70	1,202,915,136円

合 計	2,396,121,387円

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

銘 柄	株 数	評価額 単価	評価額 金額	備 考
米ドル				
BAKER HUGHES INC	4,800	69.73	334,704.00	
CHEVRON CORPORATION	5,230	103.75	542,612.50	
HELMERICH & PAYNE INC	3,400	64.06	217,804.00	
MARATHON OIL CORP	4,270	51.66	220,588.20	
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	3,670	80.74	296,315.80	
ULTRA PETROLEUM CORP	5,850	44.18	258,453.00	
FREEPORT-MCMORAN COPPER-B	5,240	51.71	270,960.40	
MONSANTO CO	5,120	73.06	374,067.20	
AGCO CORP	2,650	55.41	146,836.50	
DANAHER CORP	5,890	50.76	298,976.40	
EMERSON ELECTRIC CO	4,530	59.74	270,622.20	
ENER1 INC	19,971	3.50	69,898.50	
GENERAL ELECTRIC CO	24,400	20.37	497,028.00	
WW GRAINGER INC	1,750	136.43	238,752.50	
CSX CORP	3,670	74.96	275,103.20	
NAVIOS MARITIME HOLDINGS INC	11,000	5.67	62,370.00	
GENERAL MOTORS CO	4,750	32.39	153,852.50	
FOSSIL INC	2,600	80.83	210,158.00	
NEWS CORP-CL A	19,000	17.59	334,210.00	
LOWE’S COMPANIES INC	7,360	26.24	193,126.40	
WILLIAMS-SONOMA INC	5,800	36.17	209,786.00	
COCA-COLA CO/THE	7,700	65.21	502,117.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,000	19.87	198,700.00	

HANSEN NATURAL CORPORATION	5,440	56.19	305,673.60	
ENERGIZER HOLDINGS INC	2,060	67.33	138,699.80	
UNITEDHEALTH GROUP INC	7,660	44.45	340,487.00	
ABBOTT LABORATORIES	4,492	48.69	218,715.48	
ALLERGAN INC	2,000	72.20	144,400.00	
MYLAN INC	9,730	22.77	221,552.10	
FIFTH THIRD BANCORP	21,600	13.89	300,024.00	
US BANCORP	10,200	27.04	275,808.00	
BLACKROCK INC	1,120	201.89	226,116.80	
CITIGROUP INC	92,900	4.54	421,766.00	
JEFFERIES GROUP INC	7,100	23.35	165,785.00	
JPMORGAN CHASE & CO	9,850	45.52	448,372.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	6,420	28.61	183,676.20	
METLIFE INC	8,670	45.57	395,091.90	
CITRIX SYSTEMS INC	2,610	71.88	187,606.80	
GOOGLE INC-CL A	595	600.62	357,368.90	
ORACLE CORPORATION	9,580	32.80	314,224.00	
RED HAT INC	5,290	40.96	216,678.40	
SALESFORCE.COM,INC.	1,050	129.97	136,468.50	
APPLE INC	1,993	360.00	717,480.00	
EMC CORP/MASS	13,800	27.32	377,016.00	
JUNIPER NETWORKS INC	6,320	44.11	278,775.20	
SANDISK CORP	3,700	47.69	176,453.00	
AMERICAN TOWER CORPORATION -CL A	4,250	53.07	225,547.50	
PARTNER COMMUNICATIONS-ADR	3,117	18.37	57,259.29	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	9,220	36.08	332,657.60	
ENTERGY CORP	3,810	72.25	275,272.50	
XCEL ENERGY INC	8,980	23.89	214,532.20	
CAVIUM NETWORKS INC	2,100	43.86	92,106.00	
INTEL CORP	22,600	21.58	487,708.00	
XILINX INC	3,590	34.96	125,506.40	

米ドル 小計	460,498		14,535,870.47	
（邦貨換算額）			(1,197,319,650)	**（単位：円）**
カナダドル				
CANADIAN NATURAL RESOURCES	5,800	49.70	288,260.00	
ENBRIDGE INC	4,280	58.35	249,738.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	4,020	59.36	238,627.20	
SILVER WHEATON CORPORATION	1,500	43.64	65,460.00	
YAMANA GOLD INC	23,860	12.45	297,057.00	
VITERRA INC	18,300	11.94	218,502.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	4,380	59.66	261,310.80	
カナダドル 小計	62,140		1,618,955.00	
（邦貨換算額）			(137,190,246)	**（単位：円）**
ユーロ				
TOTAL SA	5,760	43.96	253,209.60	
WACKER CHEMIE AG	1,157	135.80	157,120.60	
ALSTOM RGPT	4,450	41.56	184,964.25	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	1,780	119.75	213,155.00	
SIEMENS AG-REG	3,401	95.40	324,455.40	
DAIMLER AG	3,300	48.23	159,175.50	
MICHELIN (CGDE)-B	1,400	57.64	80,696.00	
ADIDAS AG	2,700	46.89	126,603.00	
CHRISTIAN DIOR SA	623	102.70	63,982.10	
SES	8,710	18.90	164,619.00	
COLRUYT NV	820	37.00	30,340.00	
KERRY GROUP PLC-A	5,286	26.85	141,955.53	
SUEDZUCKER AG	5,712	19.93	113,868.72	
SANOFI-AVENTIS	3,700	51.10	189,070.00	
BANCO SANTANDER SA	10,900	8.34	90,906.00	
BNP PARIBAS	3,690	53.21	196,344.90	

ALLIANZ SE-REG	1,795	104.65	187,846.75	
SAP AG	1,240	44.05	54,622.00	
NOKIA OYJ	3,930	6.06	23,815.80	
ILIAD SA	1,070	84.96	90,907.20	
TELEFONICA S.A.	8,220	18.04	148,329.90	
GDF SUEZ	5,755	27.92	160,708.37	
ASML HOLDING NV	1,360	32.64	44,390.40	
ユーロ 小計	86,759		3,201,086.02	
（邦貨換算額）			(368,573,044)	**（単位：円）**
英ポンド				
BP PLC	47,540	4.93	234,800.06	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	7,250	21.90	158,811.25	
JOHNSON MATTHEY PLC	6,280	18.83	118,252.40	
RIO TINTO PLC	3,590	43.14	154,872.60	
BARCLAYS PLC	35,300	3.13	110,524.30	
STANDARD CHARTERED PLC	8,800	16.96	149,292.00	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	49,641	2.07	102,756.87	
RSA INSURANCE GROUP PLC	56,300	1.37	77,412.50	
NATIONAL GRID PLC	21,400	5.72	122,408.00	
英ポンド 小計	236,101		1,229,129.98	
（邦貨換算額）			(164,568,213)	**（単位：円）**
スイスフラン				
GIVAUDAN-REG	172	938.50	161,422.00	
ARYZTA AG	5,039	43.85	220,960.15	
NESTLE SA-REGISTERED	4,890	51.95	254,035.50	
NOVARTIS AG-REG SHS	6,440	52.75	339,710.00	
スイスフラン 小計	16,541		976,127.65	
（邦貨換算額）			(86,826,554)	**（単位：円）**

スウェーデンクローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	4,600	159.20	732,320.00	
スウェーデンクローナ 小計	4,600		732,320.00	
（邦貨換算額）			(9,498,190)	**（単位：円）**
ノルウェークローネ				
DNB NOR ASA	17,300	87.00	1,505,100.00	
ノルウェークローネ 小計	17,300		1,505,100.00	
（邦貨換算額）			(22,275,480)	**（単位：円）**
オーストラリアドル				
BHP BILLITON LTD	4,635	47.25	219,003.75	
ORICA LIMITED	1,460	25.84	37,726.40	
RIO TINTO LIMITED	630	85.52	53,877.60	
FAIRFAX MEDIA LTD	58,000	1.29	75,110.00	
WESFARMERS LIMITED	3,500	33.65	117,775.00	
CSL LIMITED	2,870	35.96	103,205.20	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	5,300	23.74	125,822.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	3,480	25.52	88,809.60	
WESTPAC BANKING CORPORATION	5,680	23.48	133,366.40	
MACQUARIE GROUP LTD	1,918	37.04	71,042.72	
オーストラリアドル 小計	87,473		1,025,738.67	
（邦貨換算額）			(85,659,436)	**（単位：円）**
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	3,000	8.81	26,430.00	
ニュージーランドドル 小計	3,000		26,430.00	
（邦貨換算額）			(1,606,944)	**（単位：円）**
香港ドル				
MTR CORPORATION	12,000	29.05	348,600.00	

GIORDANO INTERNATIONAL LTD	78,000	4.42	344,760.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	26,000	24.90	647,400.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	6,000	125.10	750,600.00	
WHARF HOLDINGS LIMITED RIGHTS	700	14.60	10,220.00	
WHARF HOLDINGS LTD	7,000	51.25	358,750.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	6,500	51.00	331,500.00	
香港ドル 小計	136,200		2,791,830.00	
（邦貨換算額）			(29,537,561)	**（単位：円）**
シンガポールドル				
KEPPEL CORP LTD	5,000	11.68	58,400.00	
CYCLE & CARRIAGE LTD	2,000	35.36	70,720.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	75,000	0.70	52,875.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	6,000	18.50	111,000.00	
シンガポールドル 小計	88,000		292,995.00	
（邦貨換算額）			(19,053,464)	**（単位：円）**
合 計	1,198,612		2,122,108,782	**単位：円**
（外貨建有価証券邦貨換算額合計）			(2,122,108,782)	**（単位：円）**

（注）

1．合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。

2．米ドル表示の株式については、54銘柄、信託財産純資産総額に対する比率55.8%、
合計に対する比率56.4%です。
カナダドル表示の株式については、7銘柄、信託財産純資産総額に対する比率6.4%、
合計に対する比率6.5%です。
ユーロ表示の株式については、23銘柄、信託財産純資産総額に対する比率17.2%、
合計に対する比率17.4%です。
英ポンド表示の株式については、9銘柄、信託財産純資産総額に対する比率7.7%、
合計に対する比率7.8%です。
スイスフラン表示の株式については、4銘柄、信託財産純資産総額に対する比率4.0%、
合計に対する比率4.1%です。
スウェーデンクローナ表示の株式については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、
合計に対する比率0.4%です。

ノルウェークローネ表示の株式については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.0%、
合計に対する比率1.0%です。
オーストラリアドル表示の株式については、10銘柄、信託財産純資産総額に対する比率4.0%、
合計に対する比率4.0%です。
ニュージーランドドル表示の株式については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、
合計に対する比率0.1%です。
香港ドル表示の株式については、7銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.4%、
合計に対する比率1.4%です。
シンガポールドル表示の株式については、4銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.9%、
合計に対する比率0.9%です。

(b)株式以外の有価証券
該当事項はありません。

②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
※「（デリバティブ取引に関する注記）Ⅱ．取引の時価等に関する事項」に同様の内容が
記載されているため、省略しております。

「外国債券マザーファンド（Ｂ号）」の状況

（１）貸借対照表

期 別	第10期 （平成22年３月８日現在）	第11期 （平成23年３月７日現在）
科 目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
Ⅰ 流動資産		
預金	18,391,686	22,618,082
コール・ローン	35,726,128	15,333,043
国債証券	1,915,089,022	1,868,714,372
特殊債券	187,718,206	102,504,938
社債券	46,893,732	43,091,437
派生商品評価勘定	937,156	2,601,631
未収入金	4,360,259	27,933,599
未収利息	21,624,218	21,366,100
前払費用	1,736,419	3,162,739
流動資産合計	2,232,476,826	2,107,325,941
資産合計	2,232,476,826	2,107,325,941
負債の部		
Ⅰ 流動負債		
派生商品評価勘定	991,530	1,465,589
未払金	1,479,699	15,663,291
流動負債合計	2,471,229	17,128,880
負債合計	2,471,229	17,128,880
純資産の部		
Ⅰ 元本等		
１ 元本		
元本	1,195,823,835	1,186,371,491
２ 剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,034,181,762	903,825,570

元本等合計	2,230,005,597	2,090,197,061
純資産合計	2,230,005,597	2,090,197,061
負債・純資産合計	2,232,476,826	2,107,325,941

（注）「外国債券マザーファンド（Ｂ号）」は、毎年３月６日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成22年３月８日ならびに平成23年３月７日現在における同マザーファンドの状況です。

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊債券および社債券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。	国債証券、特殊債券および社債券（売買目的有価証券） 同 左
２．デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。	為替予約取引 同 左
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。	外貨建資産等の会計処理 同 左

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第10期 （平成22年３月８日現在）	第11期 （平成23年３月７日現在）
１．受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 1,195,823,835口	当計算期間の末日における受益権の総数 1,186,371,491口
２．１単位当たり純資産額	1.8648円 （１万口＝18,648円）	1.7618円 （１万口＝17,618円）

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年３月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年３月10日）を適用しております。

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項 目	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７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、特殊債券および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。当ファンドにおける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。
３．金融商品に係るリスク管理体制	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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 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、上下限値、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限値（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。

４．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	**金融商品の時価には、市場価格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。**

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	第11期 自 平成22年３月９日 至 平成23年３月７日
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、特殊債券および社債券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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）

Ⅰ．取引の状況に関する事項

項 目	第10期 自 平成21年３月７日 至 平成22年３月８日
１．取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 ①ａ．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引。 ｂ．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市場における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。 ｃ．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市場におけるこれらの取引と類似の取引。 ②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（「スワップ取引」）。 ③金利先渡取引および為替先渡取引。 ④外国為替の売買の予約取引。
２．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
３．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。
４．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとして価格変動リスクがあります。

５．取引に係るリスクの管理体制	**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、投資信託約款・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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。**
６．取引の時価等に関する事項についての補足説明	**該当事項はありません。**

Ⅱ．取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

通貨関連

第10期（平成22年３月８日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契 約 額 等	うち１年超	時 価	評価損益
市場外取引	為替予約取引				
	売 建				
	ユーロ	55,772,470	―	56,764,000	△991,530
	買 建				
	米ドル	25,869,044	―	26,204,400	335,356
	スイスフラン	13,262,720	―	13,500,800	238,080
	オーストラリアドル	16,700,880	―	17,064,600	363,720
売建 合計		55,772,470	―	56,764,000	△991,530
買建 合計		55,832,644	―	56,769,800	937,156

（注）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

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

①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

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

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。

２．計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対

顧客相場の仲値で評価しています。

第11期（平成23年３月７日現在）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち１年超	時価	評価損益
市場外取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	68,187,925	―	68,559,764	△371,839
	ユーロ	27,686,250	―	28,780,000	△1,093,750
	買建				
	米ドル	8,558,981	―	8,614,468	55,487
	ユーロ	7,096,580	―	7,202,334	105,754
	スイスフラン	11,867,660	―	12,453,000	585,340
	スウェーデンクローナ	20,449,150	―	21,643,200	1,194,050
	オーストラリアドル	20,553,500	―	20,855,000	301,500
	シンガポールドル	15,895,500	―	16,255,000	359,500
	売建 合計	95,874,175	―	97,339,764	△1,465,589
	買建 合計	84,421,371	―	87,023,002	2,601,631

（注）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

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

①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

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

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

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10期（自　平成21年３月７日　至　平成22年３月８日）

該当事項はありません。

第11期（自　平成22年３月９日　至　平成23年３月７日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

第10期 （平成22年３月８日現在）	
本有価証券報告書における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	1,371,740,430円
同期中における追加設定元本額	133,935,886円
同期中における一部解約元本額	309,852,481円
期末における元本の内訳	
三井住友・年金プラン30	137,755,865円
三井住友・年金プラン50	167,380,262円
三井住友・年金プラン70	166,132,692円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	724,555,016円
合 計	1,195,823,835円

第11期 （平成23年３月７現在）	
本有価証券報告書における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	1,195,823,835円
同期中における追加設定元本額	269,115,417円
同期中における一部解約元本額	278,567,761円
期末における元本の内訳	
三井住友・年金プラン30	143,707,560円
三井住友・年金プラン50	247,023,183円
三井住友・年金プラン70	247,447,190円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	548,193,558円
合 計	1,186,371,491円

（３）附属明細表

①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	銘　柄	券面総額	評価額	備 考
国債証券	米ドル			
	US T 2.375% 14/08/31	420,000.00	432,993.75	
	US T 2.5% 15/03/31	1,200,000.00	1,236,000.00	
	US T 3.125% 19/05/15	550,000.00	548,968.75	
	US T 3.25% 16/06/30	820,000.00	859,206.25	
	US T 3.75% 18/11/15	410,000.00	430,564.06	
	US T 3.875% 12/10/31	1,400,000.00	1,478,203.12	
	US T 4.25% 17/11/15	60,000.00	65,456.25	
	US T 4.375% 38/02/15	850,000.00	824,500.00	
	US T 4.5% 160215	980,000.00	1,089,943.75	
	US T 4.5% 36/02/15	60,000.00	59,765.62	
	US T 4.875% 12/02/15	510,000.00	531,834.37	
	US T 6.125% 27/11/15	310,000.00	381,251.56	
	US T 7.25% 22/08/15	80,000.00	106,675.00	
	米ドル 小計	7,650,000.00	8,045,362.48	
	（邦貨換算額）		(662,696,507)	（単位：円）
	カナダドル			
	CAN 4% 17/06/01	240,000.00	254,904.00	
	CAN 5.25% 12/06/01	200,000.00	209,108.00	
	CAN 8% 27/06/01	60,000.00	91,506.60	
	CAN 9% 25/06/01	120,000.00	191,977.20	
	カナダドル 小計	620,000.00	747,495.80	
	（邦貨換算額）		(63,342,794)	（単位：円）
	メキシコペソ			
	MEX BONOS 8% 200611	2,600,000.00	2,669,238.00	

	メキシコペソ 小計	2,600,000.00	2,669,238.00	
	（邦貨換算額）		(18,230,895)	**（単位：円）**
	ユーロ			
	BGB 3.75% 15/09/28	460,000.00	465,106.00	
	BGB 4% 17/03/28	120,000.00	121,080.00	
	BGB 5% 12/09/28	280,000.00	291,816.00	
	BTPS 4.2513/08/01	610,000.00	625,494.00	
	BTPS 4.5% 20/02/01	490,000.00	484,708.00	
	BTPS 4.5% 26/03/01	460,000.00	424,580.00	
	BTPS 5% 12/02/01	120,000.00	123,214.80	
	BTPS 5% 34/08/01	280,000.00	262,640.00	
	BUNDESSCHATZ 1% 12/03/16	920,000.00	916,632.80	
	DBR 3.25% 20/01/04	830,000.00	830,830.00	
	DBR 4% 18/01/04	270,000.00	286,713.00	
	DBR 4.75% 34/07/04	190,000.00	216,790.00	
	DBR 5.625% 28/01/04	110,000.00	134,596.00	
	FRTR 3.0% 15/10/25	50,000.00	50,535.00	
	FRTR 4% 13/10/25	270,000.00	283,257.00	
	FRTR 4% 38/10/25	380,000.00	374,718.00	
	FRTR 4.25% 18/10/25	200,000.00	211,820.00	
	FRTR 5.5% 29/04/25	70,000.00	82,978.00	
	FRTR 8.5% 19/10/25	210,000.00	288,393.00	
	NETHERLANDS 4.5% 170715	170,000.00	184,042.00	
	NETHERLANDS G1.75% 130115	130,000.00	129,935.00	
	OBL 4% 13/10/11	130,000.00	136,773.00	
	SPGB 5.5% 17/07/30	280,000.00	290,836.00	
	SPGB 6% 29/01/31	250,000.00	251,700.00	
	ユーロ 小計	7,280,000.00	7,469,187.60	
	（邦貨換算額）		(860,002,260)	**（単位：円）**

	英ポンド			
	UKT 4.25% 36/03/07	380,000.00	371,890.80	
	UKT 4.5% 13/03/07	160,000.00	169,784.00	
	UKT 5% 18/03/07	290,000.00	322,758.40	
	UKT 6.0% 281207	150,000.00	182,896.50	
	UKT 8% 21/06/07	110,000.00	149,704.39	
	英ポンド 小計	1,090,000.00	1,197,034.09	
	（邦貨換算額）		(160,270,894)	**（単位：円）**
	スウェーデンクローナ			
	SGB 6.75% 14/05/05	1,100,000.00	1,224,740.00	
	スウェーデンクローナ 小計	1,100,000.00	1,224,740.00	
	（邦貨換算額）		(15,884,877)	**（単位：円）**
	ノルウェークローネ			
	NORWAY GOV 6% 110516	520,000.00	523,380.00	
	ノルウェークローネ 小計	520,000.00	523,380.00	
	（邦貨換算額）		(7,746,024)	**（単位：円）**
	デンマーククローネ			
	DGB 4% 15/11/15	1,040,000.00	1,099,904.00	
	デンマーククローネ 小計	1,040,000.00	1,099,904.00	
	（邦貨換算額）		(16,982,517)	**（単位：円）**
	ポーランドズロチ			
	POLGB 4.75% 12/04/25	290,000.00	289,710.00	
	POLGB 5.25% 17/10/25	520,000.00	499,616.00	
	ポーランドズロチ 小計	810,000.00	789,326.00	
	（邦貨換算額）		(22,803,628)	**（単位：円）**
	オーストラリアドル			

	ACGB 6.25% 14/06/15	200,000.00	206,304.60	
	オーストラリアドル 小計	200,000.00	206,304.60	
	（邦貨換算額）		(17,228,497)	**（単位：円）**
	シンガポールドル			
	SIGB 3.625140701	330,000.00	361,763.49	
	シンガポールドル 小計	330,000.00	361,763.49	
	（邦貨換算額）		(23,525,479)	**（単位：円）**
特殊債券	**米ドル**			
	NORDIC INV 3.5% 13/09/11	300,000.00	316,830.00	
	OKB 4.75% 12/10/16	300,000.00	319,329.30	
	RENTENBANK 3.25% 130315	300,000.00	313,811.40	
	米ドル 小計	900,000.00	949,970.70	
	（邦貨換算額）		(78,249,086)	**（単位：円）**
	ユーロ			
	EIB 5.375% 12/10/15	200,000.00	210,664.00	
	ユーロ 小計	200,000.00	210,664.00	
	（邦貨換算額）		(24,255,852)	**（単位：円）**
社債券	**米ドル**			
	BAC 5.375% 12/09/11	200,000.00	211,083.80	
	GEN ELEC CAP 6% 12/06/15	100,000.00	106,361.00	
	RABOBANK 3% 2012/09/18	200,000.00	205,700.00	
	米ドル 小計	500,000.00	523,144.80	
	（邦貨換算額）		(43,091,437)	**（単位：円）**
	合 計		2,014,310,747	**単位：円**
	（外貨建有価証券邦貨換算額合計）		(2,014,310,747)	**（単位：円）**

（注）

１．合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
２．米ドル表示の債券については、19銘柄、信託財産純資産総額に対する比率37.5%、
合計に対する比率38.9%です。
カナダドル表示の債券については、4銘柄、信託財産純資産総額に対する比率3.0%、
合計に対する比率3.1%です。
メキシコペソ表示の債券については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.9%、
合計に対する比率0.9%です。
ユーロ表示の債券については、25銘柄、信託財産純資産総額に対する比率42.3%、
合計に対する比率43.9%です。
英ポンド表示の債券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率7.7%、
合計に対する比率8.0%です。
スウェーデンクローナ表示の債券については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.8%、
合計に対する比率0.8%です。
ノルウェークローネ表示の債券については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、
合計に対する比率0.4%です。
デンマーククローネ表示の債券については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.8%、
合計に対する比率0.8%です。
ポーランドズロチ表示の債券については、2銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.1%、
合計に対する比率1.1%です。
オーストラリアドル表示の債券については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.8%、
合計に対する比率0.9%です。
シンガポールドル表示の債券については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.1%、
合計に対する比率1.2%です。

②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
※「（デリバティブ取引に関する注記）Ⅱ．取引の時価等に関する事項」に同様の内容が
記載されているため、省略しております。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ａ．三井住友・年金プラン30

	平成23年４月28日現在
Ⅰ 資産総額	1,858,957,844円
Ⅱ 負債総額	20,421,574円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	1,838,536,270円
Ⅳ 発行済口数	1,799,533,724口
Ⅴ １口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.0217円
（ １万口当たり純資産額	10,217円）

ｂ．三井住友・年金プラン50

	平成23年４月28日現在
Ⅰ 資産総額	4,661,212,934円
Ⅱ 負債総額	44,584,819円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	4,616,628,115円
Ⅳ 発行済口数	5,000,050,728口
Ⅴ １口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	0.9233円
（ １万口当たり純資産額	9,233円）

ｃ．三井住友・年金プラン70

	平成23年４月28日現在
Ⅰ 資産総額	4,589,091,265円
Ⅱ 負債総額	55,876,841円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	4,533,214,424円
Ⅳ 発行済口数	5,586,967,523口
Ⅴ １口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	0.8114円
（ １万口当たり純資産額	8,114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。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 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た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。

第二部【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

	平成23年４月28日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640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。

ハ 会社の機構

委託会社の取締役は７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。

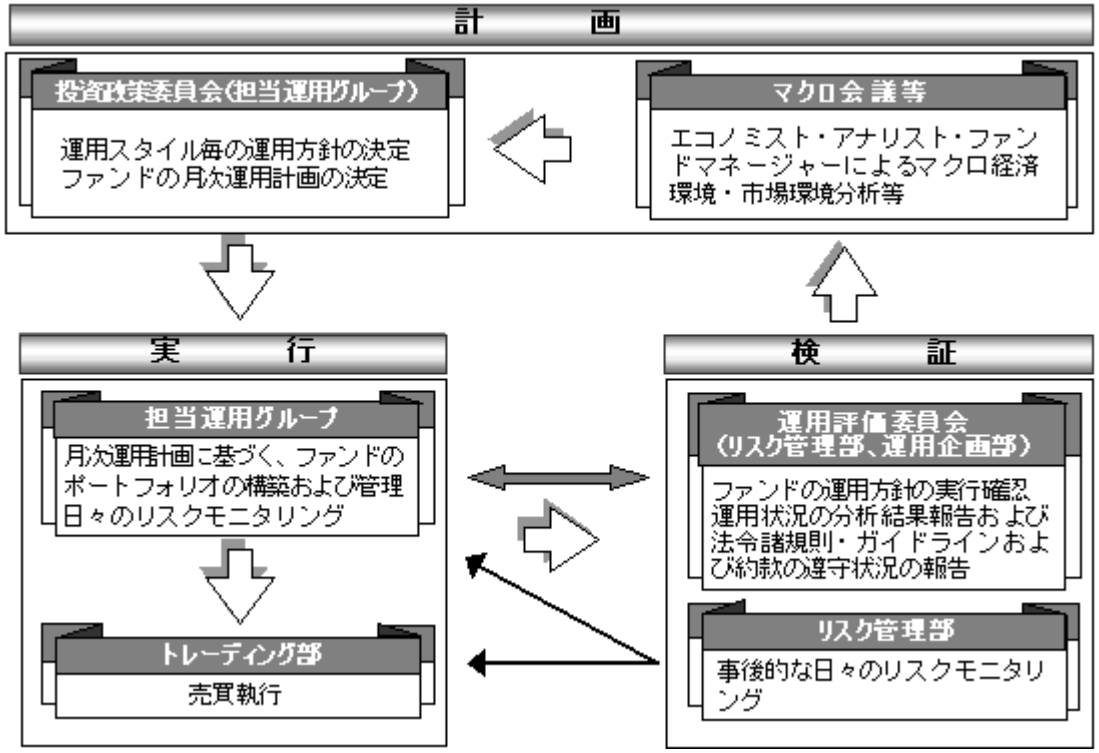
取締役の任期は、選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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、代表取締役を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名のほか、取締役副社長、専務取締役、常務取締役を若干名選定することができます。

ニ 投資信託の運用の流れ


計　　画
投資政策委員会(担当運用グループ)
運用スタイル毎の運用方針の決定
ファンドの月次運用計画の決定
マクロ会議等
エコノミスト・アナリスト・ファンドマネージャーによるマクロ経済環境・市場環境分析等
実　　行
担当運用グループ
月次運用計画に基づく、ファンドのポートフォリオの構築および管理
日々のリスクモニタリング
トレーディング部
売買執行
検　　証
運用評価委員会
(リスク管理部、運用企画部)
ファンドの運用方針の実行確認
運用状況の分析結果報告および法令諸規則・ガイドラインおよび約款の遵守状況の報告
リスク管理部
事後的な日々のリスクモニタリング

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その運用（投資運用業）を行っています。
また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。
平成23年４月28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。

（平成23年４月28日現在、単位：百万円）

		本 数	純資産総額
株式投資信託	単位型	60 （ 1）	104,987 （ 204）
	追加型	271 （ 132）	4,963,521 （ 3,210,189）
	計	331 （ 133）	5,068,508 （ 3,210,393）
公社債投資信託	単位型	0 （ 0）	0 （ 0）
	追加型	0 （ 0）	0 （ 0）
	計	0 （ 0）	0 （ 0）
合 計		331 （ 133）	5,068,508 （ 3,210,393）

※（ ）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

３【委託会社等の経理状況】

１　当社の財務諸表は、第24期（平成20年４月１日から平成21年３月31日まで）については、改正前の「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、第25期（平成21年４月１日から平成22年３月31日まで）については、改正後の「財務諸表等規則」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、中間財務諸表は「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号。）に基づいて作成しております。

２　当社は、第24期（平成20年４月１日から平成21年３月31日まで）及び第25期（平成21年４月１日から平成22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、あずさ監査法人の監査を受けており、第26期中間会計期間(平成22年４月１日から平成22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。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年７月１日付をもって、名称を有限責任 あずさ監査法人に変更しております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

		第　24　期 （平成21年３月31日現在）	第　25　期 （平成22年３月31日現在）
（資 産 の 部）			
流動資産			
現金及び預金	※２	15,883,303	15,484,883
有価証券		2,998,947	2,999,185
前払費用		323,949	248,594
未収入金		3,593	6,524
未収委託者報酬		2,158,082	3,405,895
未収運用受託報酬		635,902	456,672
未収投資助言報酬	※２	406,959	426,716
未収収益		8,062	7,020
未収還付法人税等		1,068,737	-
未収還付消費税等		182,000	-
繰延税金資産		68,795	244,770
その他の流動資産		2,641	1,392
流動資産計		23,740,977	23,281,654
固定資産			
有形固定資産	※１		
建物		169,629	173,574
器具備品		200,701	150,631
有形固定資産合計		370,331	324,206
無形固定資産	※１		
電話加入権		161	150
商標権		8,104	6,160
無形固定資産合計		8,266	6,310
投資その他の資産			
投資有価証券		2,542,125	6,923,150
関係会社株式		236,178	236,178

長期差入保証金	783,231	681,764
長期前払費用	14,643	7,822
会員権	20,113	20,113
繰延税金資産	34,393	524,820
投資その他の資産合計	3,630,686	8,393,850
固定資産計	4,009,284	8,724,367
資産合計	27,750,261	32,006,022

（単位：千円）

		第 24 期 （平成21年３月31日現在）	第 25 期 （平成22年３月31日現在）
（負 債 の 部）			
流動負債			
預り金		44,497	46,362
未払金			
未払収益分配金		947	943
未払償還金		23,376	18,453
未払手数料	※２	891,493	1,523,402
その他未払金		112,743	71,728
未払費用		612,126	869,497
未払消費税等		-	74,053
未払法人税等		-	1,264,485
賞与引当金		291,836	293,651
流動負債計		1,977,020	4,162,578
固定負債			
退職給付引当金		972,202	1,137,766
固定負債計		972,202	1,137,766
負債合計		2,949,223	5,300,344
（純 資 産 の 部）			
株主資本			
資本金		2,000,000	2,000,000
資本剰余金			
資本準備金		8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計		8,628,984	8,628,984
利益剰余金			
利益準備金		284,245	284,245
その他利益剰余金			
配当準備積立金		60,000	60,000

別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	12,356,655	14,172,932
利益剰余金合計	14,177,860	15,994,137
株主資本計	24,806,844	26,623,121
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△ 5,805	82,556
評価・換算差額等計	△ 5,805	82,556
純資産合計	24,801,038	26,705,677
負債・純資産合計	27,750,261	32,006,022

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第　24　期 （自　平成20年４月１日 至　平成21年３月31日）	第　25　期 （自　平成21年４月１日 至　平成22年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	20,072,582	21,113,167
運用受託報酬	3,506,635	2,492,177
投資助言報酬	2,048,748	1,893,038
その他営業収益		
情報提供コンサルタント業務報酬	5,000	5,000
投資法人運用受託報酬	60,260	43,853
その他	2,749	12,348
営業収益計	25,695,976	25,559,586
営業費用		
支払手数料	9,326,200	9,706,627
広告宣伝費	529,276	420,508
公告費	1,227	2,339
調査費		
調査費	538,515	579,477
委託調査費	1,310,113	1,556,961
営業雑経費		
通信費	30,202	31,515
印刷費	302,661	278,539
協会費	23,322	19,271
諸会費	14,373	12,955
情報機器関連費	2,036,426	2,005,507
販売促進費	55,223	13,183
その他	55,485	66,833
営業費用計	14,223,029	14,693,722
一般管理費		

給料		
役員報酬	174,486	155,835
給料・手当	4,004,575	4,192,414
賞与	1,051,279	719,290
賞与引当金繰入額	291,836	293,651
交際費	23,229	19,087
寄付金	4,000	23
事務委託費	356,543	195,150
旅費交通費	258,981	197,842
租税公課	81,166	86,095
不動産賃借料	762,812	714,209
退職給付費用	262,634	197,352
固定資産減価償却費	119,811	97,916
諸経費	281,968	280,916
一般管理費計	7,673,326	7,149,786
営業利益	3,799,620	3,716,077

営業外収益			
受取配当金		-	1,710
有価証券利息		22,216	4,645
受取利息	※1	36,255	16,592
為替差益		11,209	-
時効成立分配金・償還金		7,832	3,492
原稿・講演料		3,910	3,255
還付加算金		-	37,708
雑収入		4,132	6,291
営業外収益計		85,555	73,696
営業外費用			
為替差損		-	5,113
時効成立後支払分配金・償還金		693	-
雑損失		82	-
営業外費用計		775	5,113
経常利益		3,884,401	3,784,660
特別利益			
投資有価証券償還益		1,136	2,459
投資有価証券売却益		122	31,117
特別利益計		1,259	33,577
特別損失			
固定資産除却損	※2	688	5,302
投資有価証券償還損		84,238	-
投資有価証券評価損		65,553	51,557
投資有価証券売却損		464,272	2,724
特別損失計		614,753	59,583
税引前当期純利益		3,270,907	3,758,653
法人税、住民税及び事業税		1,206,047	1,817,726
法人税等調整額		369,088	△ 722,069
法人税等合計		1,575,135	1,095,656
当期純利益		1,695,771	2,662,997

（３）【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	第　24　期 （自　平成20年４月１日 至　平成21年３月31日）	第　25　期 （自　平成21年４月１日 至　平成22年３月31日）
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,000	2,000,000
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	284,245	284,245
当期末残高	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		
前期末残高	60,000	60,000
当期末残高	60,000	60,000
別途積立金		
前期末残高	1,476,959	1,476,959
当期末残高	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金		
前期末残高	13,483,283	12,356,655
当期変動額		

剰余金の配当	△ 2,822,400	△ 846,720
当期純利益	1,695,771	2,662,997
当期変動額合計	△ 1,126,628	1,816,277
当期末残高	12,356,655	14,172,932
利益剰余金合計		
前期末残高	15,304,488	14,177,860
当期変動額		
剰余金の配当	△ 2,822,400	△ 846,720
当期純利益	1,695,771	2,662,997
当期変動額合計	△ 1,126,628	1,816,277
当期末残高	14,177,860	15,994,137
株主資本合計		
前期末残高	25,933,472	24,806,844
当期変動額		
剰余金の配当	△ 2,822,400	△ 846,720
当期純利益	1,695,771	2,662,997
当期変動額合計	△ 1,126,628	1,816,277
当期末残高	24,806,844	26,623,121

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	25,392	△ 5,805
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 31,197	88,361
当期変動額合計	△ 31,197	88,361
当期末残高	△ 5,805	82,556
評価・換算差額合計		
前期末残高	25,392	△ 5,805
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 31,197	88,361
当期変動額合計	△ 31,197	88,361
当期末残高	△ 5,805	82,556
純資産合計		
前期末残高	25,958,864	24,801,038
当期変動額		
剰余金の配当	△ 2,822,400	△ 846,720
当期純利益	1,695,771	2,662,997
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 31,197	88,361
当期変動額合計	△ 1,157,826	1,904,639
当期末残高	24,801,038	26,705,677

重要な会計方針

項目	第24期 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）	第25期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）
１ 有価証券の評価基準及び評価方法	満期保有目的の債券 償却原価法 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの 移動平均法による原価法	満期保有目的の債券 同左 子会社株式及び関連会社株式 同左 その他有価証券 時価のあるもの 同左 時価のないもの 同左
２ 固定資産の減価償却の方法	有形固定資産 定率法によっております。但し、建物（建物附属設備を除く）については、定額法によっております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物　３～50年 器具備品　３～20年 無形固定資産 定額法によっております。	有形固定資産 同左 無形固定資産 同左
３ 引当金の計上基準 (1) 賞与引当金	従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当期の負担額を計上しております。	同左

(2) 退職給付引当金	従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき計上しております。 過去勤務債務については、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。	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に基づき計上しております。 過去勤務債務については、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。 （会計方針の変更） 当事業年度より、「退職給付に係る会計基準」の一部改正（その３）（企業会計基準第19号 平成20年７月31日）を適用しております。この変更が当事業年度の損益に与える影響はありません。また、本会計基準の適用に伴い発生する退職給付債務の差額はありません。
４ リース取引の処理方法	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年４月１日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。	―
５ 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は税抜方式によっております。	同左

会計方針の変更

（会計処理の変更）

第24期 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）	第25期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）
リース取引に関する会計基準 所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、企業会計基準第13号「リース取引に関する会計基準」（平成19年３月30日 企業会計基準委員会）及び企業会計基準適用指針第16号「リース取引に関する会計基準の適用指針」（同前）が平成20年４月１日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当事業年度から同会計基準及び適用指針を適用しております。 当事業年度において、通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理による取引はありません。	―

注 記 事 項

（貸借対照表関係）

第24期 （平成21年３月31日現在）	第25期 （平成22年３月31日現在）
※１ 有形固定資産の減価償却累計額 建　物　150,704千円 器具備品　941,423千円 無形固定資産の減価償却累計額 電話加入権　72千円 商標権　11,337千円	※１ 有形固定資産の減価償却累計額 建　物　172,855千円 器具備品　863,358千円 無形固定資産の減価償却累計額 電話加入権　83千円 商標権　13,282千円
※２ 関係会社に対する債権債務 現金及び預金　10,311,398千円 未収投資助言報酬　398,818千円 未払手数料　331,400千円	※２ 関係会社に対する債権債務 現金及び預金　10,591,647千円 未収投資助言報酬　295,911千円 未払手数料　441,536千円

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行と当座貸越契約を締結しております。 当事業年度末における当座貸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。 当座貸越極度額の総額　10,000,000千円 借入実行残高　　－千円 差引額　　10,000,000千円	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行と当座貸越契約を締結しております。 当事業年度末における当座貸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。 当座貸越極度額の総額　10,000,000千円 借入実行残高　　－千円 差引額　　10,000,000千円
４ 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年６月までの賃借料総額128,926千円の支払保証を行っております。	４ 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年６月までの賃借料総額102,815千円の支払保証を行っております。

（損益計算書関係）

第24期 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）	第25期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）
※１ 関係会社との取引に係るもの 受取利息　18,943千円	※１ 関係会社との取引に係るもの 受取利息　5,916千円
※２ 固定資産除却損は、器具備品688千円であります。	※２ 固定資産除却損は、器具備品5,302千円であります。

（株主資本等変動計算書関係）

第24期(自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日)

１.発行済株式数に関する事項

	前期末株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	－	－	17,640株

２.剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成20年６月23日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000	平成20年 ３月31日	平成20年 ６月24日

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

平成21年６月30日開催の第24回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成21年６月30日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	846,720	48,000	平成21年 ３月31日	平成21年 ７月１日

第25期(自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日)

１.発行済株式数に関する事項

	前期末株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	－	－	17,640株

２.剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成21年６月30日 定時株主総会	普通株式	846,720	48,000	平成21年 ３月31日	平成21年 ７月１日

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

平成22年６月24日開催の第25回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成22年６月24日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,323,000	75,000	平成22年 ３月31日	平成22年 ６月25日

（リース取引関係）

第24期 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）	第25期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）
１．リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 （借主側） ①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額(単位：千円) 器具備品　合計 取得価額相当額　5,330　5,330 減価償却累計額相当額　5,330　5,330 期末残高相当額　-　- ②未経過リース料期末残高相当額(単位：千円) １年以内　- 合計　- ③支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額(単位：千円) 支払リース料　2,067 減価償却費相当額　1,900 支払利息相当額　37 ④減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法 減価償却費相当額の算定方法 ・リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。 利息相当額の算定方法 ・リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。	―

２．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)(単位:千円)

１年以内	710,121
１年超	962,627
合計	1,672,748

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)(単位:千円)

１年以内	667,234
１年超	1,608,004
合計	2,275,239

（金融商品関係）

第25期(自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日)

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。

有価証券及び投資有価証券については、主に満期保有目的の債券及び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、全額出資の海外子会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて１年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスクの管理

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

満期保有目的の債券は、余資運用規則に基づき、短期の国債のみを対象としているため、信用リスクは僅少であります。

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

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

②市場リスクの管理

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

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

合には速やかに処分することとしています。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

２．金融商品の時価等に関する事項

平成22年３月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません（（注２）参照）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	15,484,883	15,484,883	―
(2)未収委託者報酬	3,405,895	3,405,895	―
(3)未収運用受託報酬	456,672	456,672	―
(4)未収投資助言報酬	426,716	426,716	―
(5)有価証券及び投資有価証券			
①満期保有目的の債券	2,999,185	2,999,100	△85
②その他有価証券	6,874,409	6,874,409	―
(6)長期差入保証金	681,764	681,764	―
資産計	30,329,527	30,329,442	△85
(1)未払金			
①未払手数料	1,523,402	1,523,402	―
負債計	1,523,402	1,523,402	―

（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)未収委託者報酬、(3)未収運用受託報酬及び(4)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。

(5)有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券については業界団体が公表する売買参考統計値等によって、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。

(6)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)未払金

①未払手数料

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

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

	貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	48,443
合計	48,741
子会社株式	
非上場株式	236,178
合計	236,178

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(5)②その他有価証券」には含めておりません。また、上記の表中にある「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、51,557千円です。

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

（注３）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

（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	15,484,883	―	―	―
未収委託者報酬	3,405,895	―	―	―
未収運用受託報酬	456,672	―	―	―
未収投資助言報酬	426,716	―	―	―
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	3,000,000	―	―	―
その他有価証券のうち				
満期があるもの	―	―	―	―
長期差入保証金	2,289	679,475	―	―
合計	22,776,457	679,475	―	―

（追加情報）

当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年３月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年３月10日）を適用しております。

（有価証券関係）

第24期(平成21年３月31日現在)

１．満期保有目的の債券で時価のあるもの

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	―	―	―
小計	―	―	―
(2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの	2,998,947	2,998,800	△147

小計	2,998,947	2,998,800	△147
合計	2,998,947	2,998,800	△147

２．その他有価証券で時価のあるもの

（単位：千円）

区分	取得原価	貸借対照表計上額	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	329,907	346,809	16,902
小計	329,907	346,809	16,902
(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	2,117,725	2,095,017	△22,707
小計	2,117,725	2,095,017	△22,707
合計	2,447,632	2,441,827	△5,805

３．時価評価されていない有価証券の内容及び貸借対照表計上額

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	摘要
(1)子会社株式		
子会社株式	236,178	
合計	236,178	
(2)その他有価証券		
非上場株式	298	
投資証券	100,000	
合計	100,298	

４．当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
882,530	122	464,272

５．その他有価証券のうち満期があるもの及び満期保有目的の債券の決算日後における償還予定額

（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
(1)満期保有目的の債券				
国債・地方債等	3,000,000	－	－	－
小計	3,000,000	－	－	－
(2)その他有価証券				
	－	－	－	－
小計	－	－	－	－
合計	3,000,000	－	－	－

第25期(平成22年３月31日現在)

１．満期保有目的の債券

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	―	―	―
小計	―	―	―
(2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの	2,999,185	2,999,100	△85
小計	2,999,185	2,999,100	△85
合計	2,999,185	2,999,100	△85

２．子会社株式及び関連会社株式

子会社及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式236,178千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

３．その他有価証券

（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	2,484,337	2,253,148	231,189
小計	2,484,337	2,253,148	231,189
(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	4,390,071	4,483,035	△92,963
小計	4,390,071	4,483,035	△92,963
合計	6,874,409	6,736,184	138,225

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額 48,741千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

４．当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,539,393	31,117	2,724

（デリバティブ取引関係）

第24期(自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日)

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。

第25期(自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日)

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。

（退職給付関係）

第24期 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）	第25期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）
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。 ２．退職給付債務の額 (単位：千円) 退職給付債務 972,202 退職給付引当金 972,202 ３．退職給付費用の額 (単位：千円) 勤務費用 145,258 利息費用 12,449 過去勤務債務の費用処理額 87,363 数理計算上の差異の費用処理額 6,153 その他 11,409 退職給付費用 262,634	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。 ２．退職給付債務の額 (単位：千円) 退職給付債務 1,137,766 退職給付引当金 1,137,766 ３．退職給付費用の額 (単位：千円) 勤務費用 154,625 利息費用 14,583 数理計算上の差異の費用処理額 12,466 その他 15,677 退職給付費用 197,352 （注）その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。

４．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 **退職給付見込額の期間配分方法** **勤務期間を基準とする方法** **割引率** 1.5% **過去勤務債務の額の処理年数** **１年（発生時において費用処理する方法）** **数理計算上の差異の処理年数** **１年（発生時において費用処理する方法）**	**４．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項** **退職給付見込額の期間配分方法** **勤務期間を基準とする方法** **割引率** 1.5% **過去勤務債務の額の処理年数** **１年（発生時において費用処理する方法）** **数理計算上の差異の処理年数** **１年（発生時において費用処理する方法）**

（税効果会計関係）

第24期 （平成21年３月31日現在）	第25期 （平成22年３月31日現在）
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)	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)
(1) 流動の部	(1) 流動の部
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 118,748	賞与引当金 119,486
未払社会保険料 12,792	未払社会保険料 12,746
未払事業所税 6,134	未払事業税 100,639
その他 5,436	未払事業所税 6,089
繰延税金資産計 143,111	その他 5,807
評価性引当額 ―	繰延税金資産計 244,770
繰延税金資産合計 143,111	評価性引当額 ―
繰延税金負債	繰延税金資産合計 244,770
未収還付税金 74,316	繰延税金資産の純額 244,770
繰延税金負債合計 74,316	
繰延税金資産の純額 68,795	
(2) 固定の部	(2) 固定の部
繰延税金資産	繰延税金資産
退職給付引当金 395,589	退職給付引当金 462,957
ソフトウェア償却 101,933	ソフトウェア償却 111,245
投資有価証券評価損 56,627	投資有価証券評価損 73,440
特定外国子会社留保金額 193,760	特定外国子会社留保金額 213,896
その他有価証券評価差額金 2,362	その他 8,735
その他 14,742	繰延税金資産計 870,274
繰延税金資産計 765,014	評価性引当額 △289,785
評価性引当額 △730,620	繰延税金資産合計 580,489
繰延税金資産合計 34,393	繰延税金負債
繰延税金資産の純額 34,393	その他有価証券評価差額金 55,668
	繰延税金負債合計 55,668
	繰延税金資産の純額 524,820

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	**２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳**
(%)	(%)
法定実効税率 40.7	**法定実効税率** 40.7
（調整）	**（調整）**
評価性引当額の増減 5.4	**評価性引当額の増減** △11.6
交際費等永久に損金に算入されない項目 0.5	**交際費等永久に損金に算入されない項目** 0.2
住民税均等割等 0.2	**住民税均等割等** 0.1
その他 1.4	**その他** △0.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率 48.2	**税効果会計適用後の法人税等の負担率** 29.1

（関連当事者情報）

第24期(自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日)

１．親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）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
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	199,000,000	生命保険業	% (被所有) 直接 40	当社の主要顧客 投信の販売委託	投資助言報酬 委託販売手数料	1,151,492 227,288	未収投資助言報酬 未払手数料	267,215 34,564
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	664,986,500	銀行業	% (被所有) 直接27.5	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,114,655	未払手数料	180,287

（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

(1)投資助言契約の受託については、当社規定の投資助言料率に基づき決定しております。

(2)その他営業取引については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

（追加情報）

当事業年度から平成18年10月17日公表の、「関連当事者の開示に関する会計基準」（企業会計基準委員会 企業会計基準第11号）及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 企業会計基準第13号）を適用しております。

第25期(自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日)

１．親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）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
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	199,000,000	生命保険業	% (被所有) 直接 40	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,125,661	未収投資助言報酬	295,911
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% (被所有) 直接27.5	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,495,661	未払手数料	347,340

（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

(1)投資助言契約の受託については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(2)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．その他の関係会社の子会社等

（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
その他の関係会社の子会社	日興コーディアル証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	% ―	投信の販売委託	委託販売手数料	1,019,546	未払手数料	238,828

（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

(1)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。

（１株当たり情報）

第24期 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）	第25期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）
１株当たり純資産額　1,405,954円57銭 １株当たり当期純利益　96,132円19銭 なお、潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 （１株当たり純資産額の算定上の基礎） 貸借対照表の純資産の部の合計額 24,801,038千円 普通株式に係る純資産額　24,801,038千円 普通株式の発行済株式数　17,640株 １株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 17,640株 （１株当たり当期純利益の算定上の基礎） 損益計算書上の当期純利益　1,695,771千円 普通株式に係る当期純利益　1,695,771千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数　17,640株	１株当たり純資産額　1,513,927円30銭 １株当たり当期純利益　150,963円55銭 なお、潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 （１株当たり純資産額の算定上の基礎） 貸借対照表の純資産の部の合計額 26,705,677千円 普通株式に係る純資産額　26,705,677千円 普通株式の発行済株式数　17,640株 １株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 17,640株 （１株当たり当期純利益の算定上の基礎） 損益計算書上の当期純利益　2,662,997千円 普通株式に係る当期純利益　2,662,997千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数　17,640株

（重要な後発事象）

第24期(自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日)
該当事項はありません。

第25期(自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日)
該当事項はありません。

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

（単位：千円）

		第26期中間会計期間末 （平成22年９月30日現在）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		16,070,989
有価証券		4,943,990
前払費用		251,072
未収委託者報酬		3,680,857
未収運用受託報酬		476,281
未収投資助言報酬		424,563
未収収益		28,359
繰延税金資産		238,094
その他		3,965
流動資産合計		26,118,172
固定資産		
有形固定資産	※１	282,221
無形固定資産		5,332
投資その他の資産		
投資有価証券		4,108,176
その他		1,523,074
投資その他の資産合計		5,631,251
固定資産合計		5,918,806
資産合計		32,036,978
負債の部		
流動負債		
預り金		44,787
未払金		1,890,909

未払費用		764,737
未払法人税等		980,584
前受収益		6,563
賞与引当金		322,819
その他	※2	115,673
流動負債合計		4,126,076
固定負債		
退職給付引当金		1,226,435
固定負債合計		1,226,435
負債合計		5,352,511

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
資本剰余金合計	8,628,984
利益剰余金	
利益準備金	284,245
その他利益剰余金	
配当準備積立金	60,000
別途積立金	1,476,959
繰越利益剰余金	14,195,382
利益剰余金合計	16,016,587
株主資本合計	26,645,571
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	38,896
評価・換算差額等合計	38,896
純資産合計	26,684,467
負債純資産合計	32,036,978

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第26期中間会計期間 （自 平成22年４月１日 至 平成22年９月30日）
営業収益		
委託者報酬		13,415,979
運用受託報酬		1,026,282
投資助言報酬		929,636
その他の営業収益		137,538
営業収益計		15,509,437
営業費用		9,566,713
一般管理費	※１	3,742,792
営業利益		2,199,930
営業外収益	※２	37,736
営業外費用		659
経常利益		2,237,008
特別利益		42,823
特別損失		26,822
税引前中間純利益		2,253,008
法人税、住民税及び事業税		923,945
法人税等調整額		△ 16,386
法人税等合計		907,558
中間純利益		1,345,450

(3)中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

	第26期中間会計期間 （自 平成22年４月１日 至 平成22年９月30日）
株主資本	
資本金	
前期末残高	2,000,000
当中間期末残高	2,000,000
資本剰余金	
資本準備金	
前期末残高	8,628,984
当中間期末残高	8,628,984
資本剰余金合計	
前期末残高	8,628,984
当中間期末残高	8,628,984
利益剰余金	
利益準備金	
前期末残高	284,245
当中間期末残高	284,245
その他利益剰余金	
配当準備積立金	
前期末残高	60,000
当中間期末残高	60,000
別途積立金	
前期末残高	1,476,959
当中間期末残高	1,476,959
繰越利益剰余金	
前期末残高	14,172,932
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 1,323,000
中間純利益	1,345,450

当中間期変動額合計	22,450
当中間期末残高	14,195,382
利益剰余金合計	
前期末残高	15,994,137
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 1,323,000
中間純利益	1,345,450
当中間期変動額合計	22,450
当中間期末残高	16,016,587
株主資本合計	
前期末残高	26,623,121
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 1,323,000
中間純利益	1,345,450
当中間期変動額合計	22,450
当中間期末残高	26,645,571

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	82,556
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 43,660
当中間期変動額合計	△ 43,660
当中間期末残高	38,896
評価・換算差額等合計	
前期末残高	82,556
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 43,660
当中間期変動額合計	△ 43,660
当中間期末残高	38,896
純資産合計	
前期末残高	26,705,677
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 1,323,000
中間純利益	1,345,450
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 43,660
当中間期変動額合計	△ 21,210
当中間期末残高	26,684,467

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

第26期中間会計期間 （自 平成22年４月１日 至 平成22年９月30日）
１．資産の評価基準及び評価方法 （1）有価証券 ・満期保有目的の債券‥償却原価法 ・子会社株式及び関連会社株式‥移動平均法による原価法 ・その他有価証券 時価のあるもの‥中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの‥移動平均法による原価法 ２．固定資産の減価償却の方法 （1）有形固定資産 定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)については、定額法によっております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物　３～50年 器具備品　３～20年 （2）無形固定資産 定額法によっております。 ３．引当金の計上基準 （1）賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、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。 （2）退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、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。 過去勤務債務については、発生時において全額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、発生時において全額を費用処理しております。

４．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（1）消費税等の会計処理

税抜方式によっております。

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項の変更

第26期中間会計期間 （自平成22年４月１日　至　平成22年９月30日）
資産除去債務に関する会計基準 企業会計基準第18号「資産除去債務に関する会計基準」（平成20年３月31日 企業会計基準委員会）及び企業会計基準適用指針第21号「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（同前）が平成22年４月１日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当中間会計期間から同会計基準及び適用指針を適用しております。 これによる損益の影響はありません。

注　記　事　項

（中間貸借対照表関係）

第26期中間会計期間末 （平成22年９月30日現在）
※１．有形固定資産の減価償却累計額 908,018千円
※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 Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年６月までの賃借料総額83,897千円の支払保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

第26期中間会計期間 （自 平成22年４月1日　至 平成22年９月30日）

※１．減価償却実施額

有形固定資産	38,651**千円**
無形固定資産	977**千円**

※２．営業外収益のうち主要なもの

受取利息	4,445**千円**
受取配当金	12,720**千円**
為替差益	10,801**千円**

（中間株主資本等変動計算書関係）

第26期中間会計期間
（自 平成22年４月１日 至 平成22年９月30日）

１．発行済株式数に関する事項

	前事業年度末株式数	当中間会計期間増加株式数	当中間会計期間減少株式数	当中間会計期間末株式数
普通株式	17,640株	－	－	17,640株

２．配当に関する事項

(決議)	株式の種類	配当金の総額(千円)	一株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成22年６月24日定時株主総会	普通株式	1,323,000	75,000	平成22年３月31日	平成22年６月25日

（リース取引関係）

第26期中間会計期間
（自 平成22年４月１日 至 平成22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 670,670千円

１年超 1,274,557千円

合 計 1,945,227千円

（金融商品関係）

１．金融商品の時価等に関する事項

平成22年９月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注２）参照）。

（単位：千円）

第26期中間会計期間末 （平成22年９月30日現在）			
区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
（1）現金及び預金	16,070,989	16,070,989	―
（2）未収委託者報酬	3,680,857	3,680,857	―
（3）未収運用受託報酬	476,281	476,281	―
（4）未収投資助言報酬	424,563	424,563	―
（5）有価証券及び投資有価証券			
①満期保有目的の債券	2,999,963	2,999,700	△263
②その他有価証券	6,003,462	6,003,462	―
（6）投資その他の資産			
①長期差入保証金	681,418	681,418	―
資産計	30,337,535	30,337,271	△263
（1）未払金			
①未払手数料	1,839,602	1,839,602	―
負債計	1,839,602	1,839,602	―

（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）未収委託者報酬、（3）未収運用受託報酬 及び（4）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。

（5）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券については取引金融機関から提示された価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等によって、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。

（6）投資その他の資産

①長期差入保証金

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

負 債

（1）未払金

①未払手数料

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

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

第26期中間会計期間末 （平成22年９月30日現在）	
内容	中間貸借対照表計上額
（1）子会社株式	236,178
合計	236,178
（2）その他有価証券 ①非上場株式 ②投資証券	 298 48,443
合計	48,741

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(5)②その他有価証券」には含めておりません。また、上記の表中にある「中間貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。

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

（追加情報）

前事業年度の下期より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年３月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年３月10日）を適用しております。

（有価証券関係）

１．満期保有目的の債券

（単位：千円）

第26期中間会計期間末 （平成22年９月30日現在）			
区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
（1）中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えるもの	―	―	―
小計	―	―	―

（2）中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えないもの	2,999,963	2,999,700	△263
小計	2,999,963	2,999,700	△263
合計	2,999,963	2,999,700	△263

2．子会社株式及び関連会社株式

第26期中間会計期間末 （平成22年９月30日現在）
子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 236,178千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

３．その他有価証券

（単位：千円）

第26期中間会計期間末 （平成22年９月30日現在）			
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	2,912,845	2,755,148	157,696
小計	2,912,845	2,755,148	157,696
（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	3,090,617	3,182,865	△92,248
小計	3,090,617	3,182,865	△92,248
合計	6,003,462	5,938,014	65,447

（注）非上場株式等（中間貸借対照表計上額 48,741千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

（デリバティブ取引関係）

第26期中間会計期間 （自 平成22年４月１日 至 平成22年９月30日）
当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（持分法損益等）

第26期中間会計期間 （自 平成22年４月1日 至 平成22年９月30日）
該当事項はありません。

（資産除去債務等）

第26期中間会計期間 （自 平成22年４月1日 至 平成22年９月30日）
該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第26期中間会計期間 （自 平成22年４月1日 至 平成22年９月30日）

（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。

（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
外部顧客への売上高	13,415,979	1,026,282	929,636	137,538	15,509,437

２．地域ごとの情報

（1）売上高

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

（2）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

（追加情報）

当中間会計期間より、企業会計基準第17号「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（平成21年３月27日 企業会計基準委員会）及び企業会計基準適用指針第20号「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」（平成20年３月21日 企業会計基準委員会）を適用しております。

（１株当たり情報）

第26期中間会計期間 （自 平成22年４月1日 至 平成22年９月30日）
１株当たり純資産額 1,512,724円91銭 １株当たり中間純利益 76,272円68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。 （注）１株当たり純資産額の算定上の基礎 中間貸借対照表の純資産の部の合計額 26,684,467千円 普通株式に係る純資産額 26,684,467千円 普通株式の発行済株式数 17,640株 １株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 17,640株 １株当たり中間純利益の算定上の基礎 中間損益計算書上の中間純利益 1,345,450千円 普通株式に係る中間純利益 1,345,450千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 17,640株

（重要な後発事象）

第26期中間会計期間 （自 平成22年４月１日 至 平成22年９月30日）
該当事項はありません。

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

平成22年６月24日に開催された定時株主総会において、監査体制の一層の充実を図るため、監査役の員数を１名増員し５名以内とする定款の変更が決議されました。

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　　住友信託銀行株式会社

（ロ）資本金の額　342,037百万円（平成22年９月末現在）

（ハ）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　　日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

・ 資本金の額　51,000百万円（平成22年９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

（イ）名称　　住友生命保険相互会社

（ロ）資本金の額　439,000百万円（平成22年９月末現在の基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。）

（ハ）事業の内容　保険業法に基づき、保険業を営んでいます。

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付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

３【資本関係】

販売会社である住友生命保険相互会社は、委託会社株式を7,056株（持株比率40.0%）保有しています。

第３【参考情報】

当計算期間において書類が以下の通り提出されております。

提出年月日	書類名
平成22年６月３日	有価証券報告書
平成22年６月３日	有価証券届出書
平成22年12月３日	半期報告書
平成22年12月３日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成２３年５月２日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　　公認会計士　鈴 木 敏 夫　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・年金プラン30の平成２２年３月９日から平成２３年３月７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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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・年金プラン30の平成２３年３月７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すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

（注）１．上記は、当社が、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．財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成２３年５月２日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　　公認会計士　鈴 木 敏 夫　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・年金プラン50の平成２２年３月９日から平成２３年３月７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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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・年金プラン50の平成２３年３月７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すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

（注）１．上記は、当社が、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．財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成２３年５月２日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　　公認会計士　鈴 木 敏 夫　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・年金プラン70の平成２２年３月９日から平成２３年３月７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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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・年金プラン70の平成２３年３月７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すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

（注）１．上記は、当社が、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．財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

委託会社の監査報告書（当期）へ

独立監査人の監査報告書

平成２２年５月７日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員　公認会計士　鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・年金プラン30の平成２１年３月７日から平成２２年３月８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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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・年金プラン30の平成２２年３月８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すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

（注）１．上記は、当社が、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．財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成２２年５月７日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員　公認会計士　鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・年金プラン50の平成２１年３月７日から平成２２年３月８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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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・年金プラン50の平成２２年３月８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すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

（注）１．上記は、当社が、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．財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成２２年５月７日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員　公認会計士　鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・年金プラン70の平成２１年３月７日から平成２２年３月８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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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・年金プラン70の平成２２年３月８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すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

（注）１．上記は、当社が、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．財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

委託会社の監査報告書（前期）へ

独立監査人の監査報告書

平成22年６月18日

三井住友アセットマネジメント株式会社
　取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員　公認会計士　鈴木 敏夫 印

指定社員
業務執行社員　公認会計士　辰巳 幸久 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成21年４月１日から平成22年３月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成22年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

※上記は、当社が、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。

委託会社の中間監査報告書へ

独立監査人の監査報告書

平成21年６月26日

三井住友アセットマネジメント株式会社
　取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員　公認会計士　鈴木 敏夫 印

指定社員
業務執行社員　公認会計士　辰巳 幸久 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成20年４月１日から平成21年３月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成21年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

※上記は、当社が、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。

独立監査人の中間監査報告書

平成22年12月16日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　鈴木 敏夫　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　辰巳 幸久　印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成22年４月１日から平成23年３月31日までの第26期事業年度の中間会計期間（平成22年４月１日から平成22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、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成22年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成22年４月１日から平成22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。

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

※上記は、当社が、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。