

## 【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成24年9月14日

【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】 三島 克哉

【電話番号】 03-5405-0228

【届出の対象とした募集内国投資信託受 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010  
益証券に係るファンドの名称】 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020  
三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030  
三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

【届出の対象とした募集内国投資信託受 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010  
益証券の金額】 : 3,000億円を上限とします。  
三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020  
: 3,000億円を上限とします。  
三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030  
: 3,000億円を上限とします。  
三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040  
: 3,000億円を上限とします。  
合計1兆2,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

**・【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

平成24年3月15日付をもって提出しました「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040」の有価証券届出書について、平成24年9月14日に半期報告書を提出したことに伴う関係情報の更新、その他訂正すべき事項がありますので、本訂正届出書により訂正を行うものです。

**・【訂正の内容】**

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示します。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

**<訂正前>**

(略)

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。

(略)

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。

**<訂正後>**

(略)

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。

(略)

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

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。

### （３）【ファンドの仕組み】

#### <訂正前>

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（略）

（ロ）受託会社「中央三井アセット信託銀行株式会社」

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、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

ただし、関係当局の認可等を前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および住友信託銀行株式会社と合併し、新商号を三井住友信託銀行株式会社とする予定です。

（略）

ロ 委託会社の概況

（イ）資本金の額

2,000百万円（平成24年1月31日現在）

（略）

（ハ）大株主の状況

（平成24年1月31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

（略）

## &lt;訂正後&gt;

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(略)

(ロ) 受託会社「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、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、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(略)

ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（平成24年7月31日現在）

(略)

(ハ) 大株主の状況

(平成24年7月31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

(略)

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <訂正前>

(略)

#### 【ファンドの特色】

(略)

#### 【基本的な投資資産配分（基本アロケーション）】

2012年1月末現在、各ファンドの基本アロケーションは以下の通りです。

(略)

#### <訂正後>

(略)

#### 【ファンドの特色】

(略)

#### 【基本的な投資資産配分（基本アロケーション）】

2012年7月末現在、各ファンドの基本アロケーションは以下の通りです。

(略)

**（ 3 ）【運用体制】****<訂正前>**

イ 運用体制

（ 略 ）

リスク管理部は7名程度、運用企画部は10名程度で構成されています。

（ 略 ）

**<訂正後>**

イ 運用体制

（ 略 ）

リスク管理部は8名程度、運用企画部は9名程度で構成されています。

（ 略 ）

**(5) 【投資制限】**

&lt;訂正前&gt;

(略)

【参考情報：投資対象とする投資信託の概要(平成24年3月15日現在)】

**〔SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)〕****(1) 運用会社等**

イ 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社

ロ 受託会社 住友信託銀行株式会社

(略)

**〔SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>〕****(1) 運用会社等**

イ 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社

ロ 受託会社 中央三井アセット信託銀行株式会社

(略)

**〔SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)〕****(1) 運用会社等**

イ 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社

ロ 受託会社 住友信託銀行株式会社**(2) 投資方針等**

(略)

ロ 投資態度

(略)

(ロ) 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。

(略)

## 〔SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;〕

## (1) 運用会社等

- 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社  
 受託会社 住友信託銀行株式会社

## (2) 投資方針等

(略)

- 投資態度

(略)

(二) 保有する外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

(略)

## 〔SMAM・マネーインカムファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;〕

## (1) 運用会社等

- 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社  
 受託会社 住友信託銀行株式会社

(略)

## &lt;訂正後&gt;

( 略 )

〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要（平成24年9月14日現在）〕

〔SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）〕

(1) 運用会社等

イ 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社

ロ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

( 略 )

〔SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>〕

(1) 運用会社等

イ 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社

ロ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

( 略 )

〔SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）〕

(1) 運用会社等

イ 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社

ロ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

(2) 投資方針等

( 略 )

ロ 投資態度

( 略 )

(ロ) 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。

( 略 )

## 〔SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;〕

## (1) 運用会社等

- イ 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社
- ロ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

## (2) 投資方針等

(略)

- ロ 投資態度

(略)

(二) 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

(略)

## 〔SMAM・マネーインカムファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;〕

## (1) 運用会社等

- イ 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社
- ロ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

(略)

## 4【手数料等及び税金】

### (3)【信託報酬等】

#### <訂正前>

(略)

投資対象とする投資信託(「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)」、「SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>」、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)」、「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>」、「SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>」)の信託報酬を含めた総額(税込み)は、各ファンドの基本アロケーション(平成24年1月末現在)に従った場合、以下の通りとなります。なお、SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>は、信託報酬が変動するため、その上限額である年0.189%(税抜き0.18%)で計算しております。

(略)

#### <訂正後>

(略)

投資対象とする投資信託(「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)」、「SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>」、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)」、「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>」、「SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>」)の信託報酬を含めた総額は、各ファンドの基本アロケーション(平成24年7月末現在)に従った場合、以下の通りとなります。なお、SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>は、信託報酬が変動するため、その上限額である年0.189%(税抜き0.18%)で計算しております。

(略)

## （５）【課税上の取扱い】

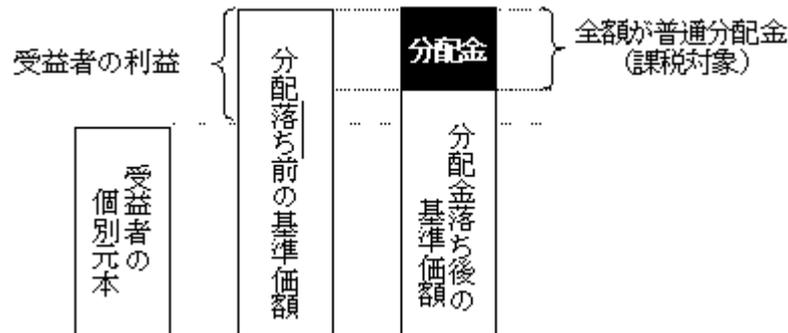
### <訂正前>

（略）

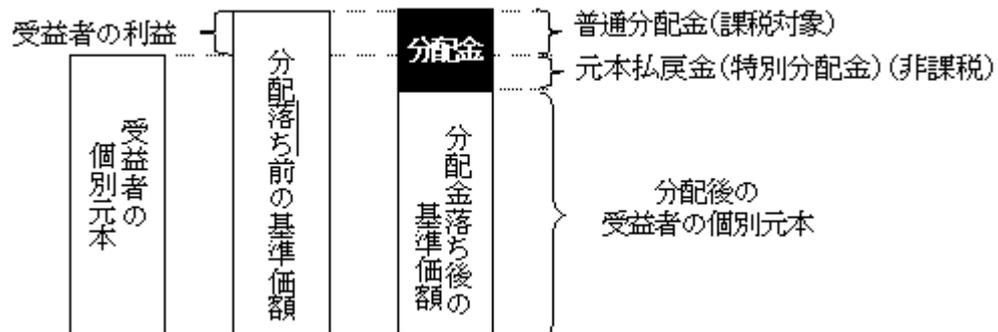
#### 八 収益分配金の課税について

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

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



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



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

（略）

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24年1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。

## &lt;訂正後&gt;

(略)

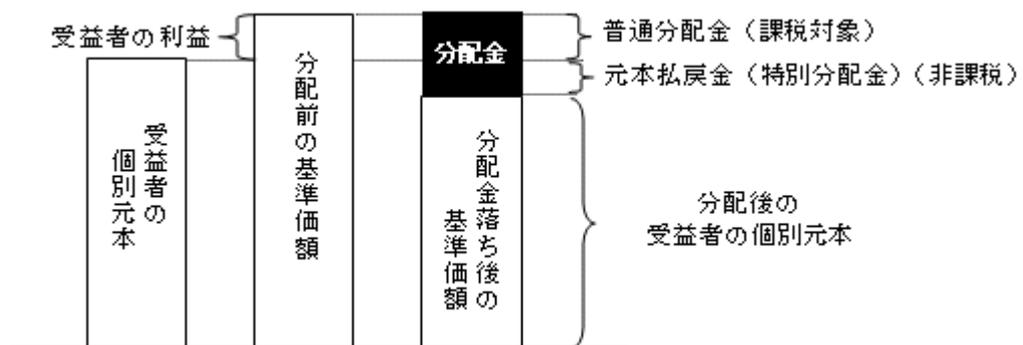
## 八 収益分配金の課税について

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

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



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



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

(略)

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24年7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】

原届出書「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」の記載は、下記の通り更新されます。

### (1)【投資状況】

#### 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010〕

平成24年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	日本	340,191,035	99.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,129,675	0.33
合計(純資産総額)		341,320,710	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。

投資信託受益証券の明細は以下の通りです。

銘柄名	主要投資対象	時価合計 (円)	投資比率 (%)
S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	国内株式	16,775,228	4.91
S M A M ・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	国内債券	118,826,813	34.81
S M A M ・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	外国株式	17,642,797	5.17
S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	外国債券	16,771,637	4.91
S M A M ・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	国内債券	170,174,560	49.86

#### 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020〕

平成24年7月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	日本	533,919,271	99.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,512,904	0.65
合計(純資産総額)		537,432,175	100.00

投資信託受益証券の明細は以下の通りです。

銘柄名	主要投資対象	時価合計 (円)	投資比率 (%)
S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	国内株式	85,449,424	15.90
S M A M ・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	国内債券	305,002,946	56.75
S M A M ・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	外国株式	53,681,564	9.99
S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	外国債券	74,137,067	13.79
S M A M ・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	国内債券	15,648,270	2.91

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030〕

平成24年7月31日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	日本	312,526,650	99.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,181,005	0.38
合計(純資産総額)		313,707,655	100.00

投資信託受益証券の明細は以下の通りです。

銘柄名	主要投資対象	時価合計 (円)	投資比率 (%)
S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	国内株式	92,257,208	29.41
S M A M ・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	国内債券	129,102,379	41.15
S M A M ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	外国株式	51,041,606	16.27
S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	外国債券	34,053,443	10.86
S M A M ・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	国内債券	6,072,014	1.94

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040〕

平成24年7月31日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	日本	249,700,931	99.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,055,785	0.42
合計(純資産総額)		250,756,716	100.00

投資信託受益証券の明細は以下の通りです。

銘柄名	主要投資対象	時価合計 (円)	投資比率 (%)
S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	国内株式	113,980,923	45.45
S M A M ・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	国内債券	55,081,653	21.97
S M A M ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	外国株式	51,072,564	20.37
S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	外国債券	24,724,670	9.86
S M A M ・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	国内債券	4,841,121	1.93

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ 主要投資銘柄

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010〕

平成24年7月31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	投資信託 受益証券	S M A M ・ マネーインカムファンド < 適格機関投資家 限定 >	168,890,989	1.007 170,074,770	1.0076 170,174,560	49.86
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 年金国内債券パッシブファンド < 適格機関 投資家限定 >	102,251,797	1.1412 116,692,902	1.1621 118,826,813	34.81
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投 資家専用）	17,935,140	0.8788 15,761,885	0.9837 17,642,797	5.17
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投 資家専用）	25,587,597	0.6385 16,339,395	0.6556 16,775,228	4.91
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド < 適格機 関投資家限定 >	15,106,861	1.0914 16,488,134	1.1102 16,771,637	4.91

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020〕

平成24年7月31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	投資信託 受益証券	S M A M ・ 年金国内債券パッシブファンド < 適格機関 投資家限定 >	262,458,434	1.1415 299,599,976	1.1621 305,002,946	56.75
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投 資家専用）	130,337,744	0.6389 83,275,840	0.6556 85,449,424	15.90
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド < 適格機 関投資家限定 >	66,778,119	1.0918 72,910,161	1.1102 74,137,067	13.79
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投 資家専用）	54,571,073	0.8775 47,887,655	0.9837 53,681,564	9.99
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ マネーインカムファンド < 適格機関投資家 限定 >	15,530,241	1.007 15,639,023	1.0076 15,648,270	2.91

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030〕

平成24年7月31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	投資信託 受益証券	S M A M ・ 年金国内債券パッシブファンド<適格機関 投資家限定>	111,094,036	1.1422 126,899,521	1.1621 129,102,379	41.15
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投 資家専用）	140,721,794	0.6381 89,801,387	0.6556 92,257,208	29.41
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投 資家専用）	51,887,371	0.8784 45,580,521	0.9837 51,041,606	16.27
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機 関投資家限定>	30,673,251	1.0927 33,518,099	1.1102 34,053,443	10.86
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家 限定>	6,026,215	1.007 6,068,574	1.0076 6,072,014	1.94

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040〕

平成24年7月31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	投資信託 受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投 資家専用）	173,857,418	0.6358 110,554,133	0.6556 113,980,923	45.45
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 年金国内債券パッシブファンド<適格機関 投資家限定>	47,398,377	1.1421 54,136,216	1.1621 55,081,653	21.97
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投 資家専用）	51,918,842	0.8737 45,362,011	0.9837 51,072,564	20.37
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機 関投資家限定>	22,270,465	1.0908 24,293,628	1.1102 24,724,670	9.86
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家 限定>	4,804,606	1.007 4,838,324	1.0076 4,841,121	1.93

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## □ 種類別の投資比率

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010〕

平成24年7月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.67
合計	99.67

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020〕

平成24年7月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.35
合計	99.35

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030〕

平成24年7月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.62
合計	99.62

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040〕

平成24年7月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.58
合計	99.58

## 【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。

## 【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】

## 【純資産の推移】

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010〕

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12月20日)(分配落)	14,380,994	9,762
第2期(平成14年12月20日)(分配付)	14,380,994	9,762
第3期(平成15年12月22日)(分配落)	35,391,890	10,088
第3期(平成15年12月22日)(分配付)	35,391,890	10,088
第4期(平成16年12月20日)(分配落)	56,778,399	10,387
第4期(平成16年12月20日)(分配付)	56,778,399	10,387
第5期(平成17年12月20日)(分配落)	118,527,624	10,782
第5期(平成17年12月20日)(分配付)	118,527,624	10,782
第6期(平成18年12月20日)(分配落)	160,590,675	11,048
第6期(平成18年12月20日)(分配付)	160,590,675	11,048
第7期(平成19年12月20日)(分配落)	217,158,042	11,245
第7期(平成19年12月20日)(分配付)	217,158,042	11,245
第8期(平成20年12月22日)(分配落)	238,566,878	10,578
第8期(平成20年12月22日)(分配付)	238,566,878	10,578
第9期(平成21年12月21日)(分配落)	301,495,735	10,921
第9期(平成21年12月21日)(分配付)	301,495,735	10,921
第10期(平成22年12月20日)(分配落)	324,751,925	10,941
第10期(平成22年12月20日)(分配付)	324,751,925	10,941
第11期(平成23年12月20日)(分配落)	329,392,588	10,818
第11期(平成23年12月20日)(分配付)	329,392,588	10,818
第12期(中間期)(平成24年6月20日)	338,433,060	10,959
平成23年7月末日	343,697,192	10,938
平成23年8月末日	333,997,387	10,854
平成23年9月末日	328,817,941	10,819
平成23年10月末日	333,137,115	10,900
平成23年11月末日	326,773,668	10,803
平成23年12月末日	331,478,931	10,836
平成24年1月末日	334,673,593	10,888
平成24年2月末日	340,367,151	11,047
平成24年3月末日	340,453,689	11,081
平成24年4月末日	338,405,753	11,048
平成24年5月末日	335,626,687	10,918
平成24年6月末日	338,728,312	10,963
平成24年7月末日	341,320,710	10,972

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020〕

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12月20日）（分配落）	10,808,556	9,000
第2期（平成14年12月20日）（分配付）	10,808,556	9,000
第3期（平成15年12月22日）（分配落）	23,886,277	9,725
第3期（平成15年12月22日）（分配付）	23,886,277	9,725
第4期（平成16年12月20日）（分配落）	50,534,185	10,223
第4期（平成16年12月20日）（分配付）	50,534,185	10,223
第5期（平成17年12月20日）（分配落）	116,847,054	11,660
第5期（平成17年12月20日）（分配付）	116,847,054	11,660
第6期（平成18年12月20日）（分配落）	156,345,353	12,355
第6期（平成18年12月20日）（分配付）	156,345,353	12,355
第7期（平成19年12月20日）（分配落）	244,051,631	12,244
第7期（平成19年12月20日）（分配付）	244,051,631	12,244
第8期（平成20年12月22日）（分配落）	258,579,003	10,124
第8期（平成20年12月22日）（分配付）	258,579,003	10,124
第9期（平成21年12月21日）（分配落）	364,838,536	10,782
第9期（平成21年12月21日）（分配付）	364,838,536	10,782
第10期（平成22年12月20日）（分配落）	460,154,017	10,871
第10期（平成22年12月20日）（分配付）	460,154,017	10,871
第11期（平成23年12月20日）（分配落）	503,354,494	10,466
第11期（平成23年12月20日）（分配付）	503,354,494	10,466
第12期（中間期）（平成24年6月20日）	529,133,919	10,779
平成23年7月末日	508,080,803	10,832
平成23年8月末日	497,798,558	10,592
平成23年9月末日	496,839,732	10,509
平成23年10月末日	511,348,813	10,702
平成23年11月末日	501,146,577	10,454
平成23年12月末日	506,018,153	10,512
平成24年1月末日	513,715,594	10,644
平成24年2月末日	535,841,083	11,055
平成24年3月末日	538,589,043	11,152
平成24年4月末日	538,095,950	11,038
平成24年5月末日	521,043,400	10,685
平成24年6月末日	533,751,203	10,807
平成24年7月末日	537,432,175	10,796

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030〕

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12月20日）（分配落）	10,514,023	8,353
第2期（平成14年12月20日）（分配付）	10,514,023	8,353
第3期（平成15年12月22日）（分配落）	14,059,509	9,390
第3期（平成15年12月22日）（分配付）	14,059,509	9,390
第4期（平成16年12月20日）（分配落）	26,147,117	10,035
第4期（平成16年12月20日）（分配付）	26,147,117	10,035
第5期（平成17年12月20日）（分配落）	55,989,814	12,178
第5期（平成17年12月20日）（分配付）	55,989,814	12,178
第6期（平成18年12月20日）（分配落）	101,147,764	13,183
第6期（平成18年12月20日）（分配付）	101,147,764	13,183
第7期（平成19年12月20日）（分配落）	149,262,430	12,809
第7期（平成19年12月20日）（分配付）	149,262,430	12,809
第8期（平成20年12月22日）（分配落）	146,078,912	9,332
第8期（平成20年12月22日）（分配付）	146,078,912	9,332
第9期（平成21年12月21日）（分配落）	214,049,126	10,168
第9期（平成21年12月21日）（分配付）	214,049,126	10,168
第10期（平成22年12月20日）（分配落）	266,798,732	10,308
第10期（平成22年12月20日）（分配付）	266,798,732	10,308
第11期（平成23年12月20日）（分配落）	273,003,638	9,525
第11期（平成23年12月20日）（分配付）	273,003,638	9,525
第12期（中間期）（平成24年6月20日）	303,421,212	9,899
平成23年7月末日	276,604,021	10,177
平成23年8月末日	269,943,690	9,745
平成23年9月末日	269,186,137	9,634
平成23年10月末日	278,743,341	9,901
平成23年11月末日	270,517,583	9,554
平成23年12月末日	275,895,157	9,603
平成24年1月末日	284,555,472	9,803
平成24年2月末日	305,398,867	10,371
平成24年3月末日	312,675,717	10,524
平成24年4月末日	311,591,016	10,317
平成24年5月末日	297,654,406	9,773
平成24年6月末日	308,739,748	9,959
平成24年7月末日	313,707,655	9,917

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040〕

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12月20日)(分配落)	8,847,644	8,036
第2期(平成14年12月20日)(分配付)	8,847,644	8,036
第3期(平成15年12月22日)(分配落)	18,376,281	9,180
第3期(平成15年12月22日)(分配付)	18,376,281	9,180
第4期(平成16年12月20日)(分配落)	30,736,176	9,865
第4期(平成16年12月20日)(分配付)	30,736,176	9,865
第5期(平成17年12月20日)(分配落)	64,001,577	12,443
第5期(平成17年12月20日)(分配付)	64,001,577	12,443
第6期(平成18年12月20日)(分配落)	113,160,193	13,668
第6期(平成18年12月20日)(分配付)	113,160,193	13,668
第7期(平成19年12月20日)(分配落)	143,523,897	13,111
第7期(平成19年12月20日)(分配付)	143,523,897	13,111
第8期(平成20年12月22日)(分配落)	134,815,396	8,596
第8期(平成20年12月22日)(分配付)	134,815,396	8,596
第9期(平成21年12月21日)(分配落)	188,270,881	9,559
第9期(平成21年12月21日)(分配付)	188,270,881	9,559
第10期(平成22年12月20日)(分配落)	231,956,041	9,713
第10期(平成22年12月20日)(分配付)	231,956,041	9,713
第11期(平成23年12月20日)(分配落)	230,424,744	8,586
第11期(平成23年12月20日)(分配付)	230,424,744	8,586
第12期(中間期)(平成24年6月20日)	247,642,925	8,981
平成23年7月末日	242,747,438	9,481
平成23年8月末日	227,342,534	8,892
平成23年9月末日	228,059,679	8,773
平成23年10月末日	241,671,270	9,069
平成23年11月末日	230,998,774	8,651
平成23年12月末日	234,967,753	8,681
平成24年1月末日	240,389,367	8,934
平成24年2月末日	262,829,728	9,639
平成24年3月末日	266,162,292	9,840
平成24年4月末日	258,058,959	9,545
平成24年5月末日	240,785,174	8,831
平成24年6月末日	250,570,170	9,076
平成24年7月末日	250,756,716	8,991

## 【分配の推移】

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010〕

計算期間	1万口当たり分配金(円)
第2期(平成13年12月21日～平成14年12月20日)	0
第3期(平成14年12月21日～平成15年12月22日)	0
第4期(平成15年12月23日～平成16年12月20日)	0
第5期(平成16年12月21日～平成17年12月20日)	0
第6期(平成17年12月21日～平成18年12月20日)	0
第7期(平成18年12月21日～平成19年12月20日)	0
第8期(平成19年12月21日～平成20年12月22日)	0
第9期(平成20年12月23日～平成21年12月21日)	0
第10期(平成21年12月22日～平成22年12月20日)	0
第11期(平成22年12月21日～平成23年12月20日)	0

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020〕

計算期間	1万口当たり分配金(円)
第2期(平成13年12月21日～平成14年12月20日)	0
第3期(平成14年12月21日～平成15年12月22日)	0
第4期(平成15年12月23日～平成16年12月20日)	0
第5期(平成16年12月21日～平成17年12月20日)	0
第6期(平成17年12月21日～平成18年12月20日)	0
第7期(平成18年12月21日～平成19年12月20日)	0
第8期(平成19年12月21日～平成20年12月22日)	0
第9期(平成20年12月23日～平成21年12月21日)	0
第10期(平成21年12月22日～平成22年12月20日)	0
第11期(平成22年12月21日～平成23年12月20日)	0

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030〕

計算期間	1万口当たり分配金(円)
第2期(平成13年12月21日～平成14年12月20日)	0
第3期(平成14年12月21日～平成15年12月22日)	0
第4期(平成15年12月23日～平成16年12月20日)	0
第5期(平成16年12月21日～平成17年12月20日)	0
第6期(平成17年12月21日～平成18年12月20日)	0
第7期(平成18年12月21日～平成19年12月20日)	0
第8期(平成19年12月21日～平成20年12月22日)	0
第9期(平成20年12月23日～平成21年12月21日)	0
第10期(平成21年12月22日～平成22年12月20日)	0
第11期(平成22年12月21日～平成23年12月20日)	0

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040〕

計算期間	1万口当たり分配金（円）
第2期（平成13年12月21日～平成14年12月20日）	0
第3期（平成14年12月21日～平成15年12月22日）	0
第4期（平成15年12月23日～平成16年12月20日）	0
第5期（平成16年12月21日～平成17年12月20日）	0
第6期（平成17年12月21日～平成18年12月20日）	0
第7期（平成18年12月21日～平成19年12月20日）	0
第8期（平成19年12月21日～平成20年12月22日）	0
第9期（平成20年12月23日～平成21年12月21日）	0
第10期（平成21年12月22日～平成22年12月20日）	0
第11期（平成22年12月21日～平成23年12月20日）	0

## 【収益率の推移】

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010〕

計算期間	収益率（％）
第2期	1.0
第3期	3.3
第4期	3.0
第5期	3.8
第6期	2.5
第7期	1.8
第8期	5.9
第9期	3.2
第10期	0.2
第11期	1.1
第12期（中間期）	1.3

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

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020〕

計算期間	収益率（％）
第2期	7.5
第3期	8.1
第4期	5.1
第5期	14.1
第6期	6.0
第7期	0.9
第8期	17.3
第9期	6.5
第10期	0.8
第11期	3.7
第12期（中間期）	3.0

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030〕

計算期間	収益率(%)
第2期	12.8
第3期	12.4
第4期	6.9
第5期	21.4
第6期	8.3
第7期	2.8
第8期	27.1
第9期	9.0
第10期	1.4
第11期	7.6
第12期(中間期)	3.9

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040〕

計算期間	収益率(%)
第2期	16.1
第3期	14.2
第4期	7.5
第5期	26.1
第6期	9.8
第7期	4.1
第8期	34.4
第9期	11.2
第10期	1.6
第11期	11.6
第12期(中間期)	4.6

**（４）【設定及び解約の実績】****【三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010】**

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第２期	4,731,811	0
第３期	31,104,873	10,751,901
第４期	21,071,041	1,494,879
第５期	58,009,119	2,742,491
第６期	55,018,651	19,583,375
第７期	68,363,183	20,609,878
第８期	56,897,891	24,476,235
第９期	64,237,153	13,713,349
第10期	56,241,790	35,487,520
第11期	50,688,810	43,023,358
第12期（中間期）	15,716,180	11,387,685

（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。

**【三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020】**

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第２期	2,009,839	0
第３期	23,365,670	10,813,485
第４期	25,287,983	418,069
第５期	56,755,832	5,972,212
第６期	45,933,217	19,605,145
第７期	83,458,432	10,678,494
第８期	83,157,158	27,059,755
第９期	95,242,920	12,283,196
第10期	111,793,677	26,894,086
第11期	87,891,359	30,227,601
第12期（中間期）	34,030,968	24,069,885

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030〕

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第2期	2,586,651	0
第3期	13,813,044	11,426,860
第4期	11,517,637	435,535
第5期	21,538,032	1,618,154
第6期	34,029,711	3,275,922
第7期	48,479,281	8,680,254
第8期	58,044,415	18,035,819
第9期	63,896,452	9,917,639
第10期	58,503,162	10,182,239
第11期	47,890,237	20,123,017
第12期（中間期）	25,325,767	5,420,912

## 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040〕

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第2期	1,009,825	0
第3期	19,928,524	10,920,638
第4期	11,907,838	767,723
第5期	38,175,773	17,899,095
第6期	51,096,621	19,739,396
第7期	50,628,800	23,956,246
第8期	65,487,055	18,108,518
第9期	57,723,829	17,613,224
第10期	52,737,375	10,883,373
第11期	49,611,557	20,043,137
第12期（中間期）	26,106,921	18,729,334

## 〔参考情報：投資対象とする他の投資信託の現況〕

## 〔S M A M・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）〕

## 投資有価証券の主要銘柄

## 主要投資銘柄

平成24年7月30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	国内株式インデックス・ マザーファンド（B号）	65,388,949,422	0.9801 64,094,248,094	0.9957 65,107,776,939	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「S M A M・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」は「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」受益証券を主要対象としており、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」の投資有価証券の上位30銘柄は以下の通りです。

平成24年7月30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	トヨタ自動車 〔輸送用機器〕	3,520,900	2,541.51 8,948,411,180	2,957.00 10,411,301,300	3.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ 〔銀行業〕	20,288,300	329.23 6,679,656,516	385.00 7,810,995,500	2.84
日本	株式	本田技研工業 〔輸送用機器〕	2,290,400	2,400.02 5,497,023,732	2,499.00 5,723,709,600	2.08
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ 〔銀行業〕	2,034,600	2,104.00 4,280,808,988	2,502.00 5,090,569,200	1.85
日本	株式	日本電信電話 〔情報・通信業〕	1,234,000	3,757.10 4,636,264,940	3,645.00 4,497,930,000	1.64
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ 〔銀行業〕	34,471,500	100.97 3,480,856,015	130.00 4,481,295,000	1.63
日本	株式	キヤノン 〔電気機器〕	1,686,700	3,414.01 5,758,415,676	2,504.00 4,223,496,800	1.54
日本	株式	武田薬品工業 〔医薬品〕	1,065,300	3,154.40 3,360,384,077	3,640.00 3,877,692,000	1.41
日本	株式	ソフトバンク 〔情報・通信業〕	1,214,900	2,532.90 3,077,226,596	2,991.00 3,633,765,900	1.32
日本	株式	ファナック 〔電気機器〕	282,700	12,343.26 3,489,441,810	12,730.00 3,598,771,000	1.31
日本	株式	日本たばこ産業 〔食料品〕	1,350,000	1,844.39 2,489,934,841	2,445.00 3,300,750,000	1.20
日本	株式	三菱商事 〔卸売業〕	1,951,900	1,552.86 3,031,029,359	1,550.00 3,025,445,000	1.10
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 〔情報・通信業〕	22,071	134,587.21 2,970,474,518	129,900.00 2,867,022,900	1.04
日本	株式	日立製作所 〔電気機器〕	6,258,000	427.65 2,676,262,080	456.00 2,853,648,000	1.04

日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス 〔小売業〕	1,121,500	2,141.27 2,401,436,986	2,503.00 2,807,114,500	1.02
日本	株式	三菱地所 〔不動産業〕	1,877,000	1,261.39 2,367,638,770	1,430.00 2,684,110,000	0.98
日本	株式	三井物産 〔卸売業〕	2,313,900	1,179.19 2,728,548,216	1,155.00 2,672,554,500	0.97
日本	株式	日産自動車 〔輸送用機器〕	3,454,400	693.06 2,394,106,765	736.00 2,542,438,400	0.92
日本	株式	東日本旅客鉄道 〔陸運業〕	472,500	4,693.21 2,217,545,596	5,090.00 2,405,025,000	0.87
日本	株式	アステラス製薬 〔医薬品〕	631,200	2,947.76 1,860,626,595	3,730.00 2,354,376,000	0.86
日本	株式	小松製作所 〔機械〕	1,326,400	1,897.43 2,516,751,470	1,731.00 2,295,998,400	0.83
日本	株式	K D D I 〔情報・通信業〕	4,162	504,629.72 2,100,268,916	539,000.00 2,243,318,000	0.82
日本	株式	信越化学工業 〔化学〕	510,200	3,821.08 1,949,515,388	3,935.00 2,007,637,000	0.73
日本	株式	三井不動産 〔不動産業〕	1,190,000	1,222.60 1,454,899,000	1,519.00 1,807,610,000	0.66
日本	株式	伊藤忠商事 〔卸売業〕	2,138,200	768.55 1,643,314,350	819.00 1,751,185,800	0.64
日本	株式	東京海上ホールディングス 〔保険業〕	973,300	1,829.97 1,781,109,801	1,791.00 1,743,180,300	0.63
日本	株式	住友商事 〔卸売業〕	1,582,000	1,010.61 1,598,790,232	1,101.00 1,741,782,000	0.63
日本	株式	デンソー 〔輸送用機器〕	670,400	2,163.34 1,450,306,158	2,475.00 1,659,240,000	0.60
日本	株式	三菱電機 〔電気機器〕	2,717,000	707.32 1,921,810,780	605.00 1,643,785,000	0.60
日本	株式	パナソニック 〔電気機器〕	3,102,500	716.07 2,221,608,216	522.00 1,619,505,000	0.59

## 〔SMAM・年金国内債券パッシブファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;〕

## 投資有価証券の主要銘柄

## 主要投資銘柄

平成24年7月30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（NOMURA - BPI） マザーファンド	45,250,963,490	1.2452 56,346,499,738	1.2506 56,590,854,940	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>」は「国内債券（NOMURA - BPI）マザーファンド」受益証券を主要対象としており、「国内債券（NOMURA - BPI）マザーファンド」の投資有価証券の上位30銘柄は以下の通りです。

平成24年7月30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284回利付国債（10年）	4,225,000,000	106.80 4,512,465,500	106.75 4,510,356,500	1.7 2016/12/20	2.81
日本	国債証券	第265回利付国債（10年）	3,645,000,000	103.48 3,772,028,250	103.33 3,766,451,400	1.5 2014/12/20	2.35
日本	国債証券	第263回利付国債（10年）	3,635,000,000	103.36 3,757,208,700	103.19 3,751,247,300	1.6 2014/9/20	2.34
日本	国債証券	第280回利付国債（10年）	2,933,000,000	107.00 3,138,578,300	106.90 3,135,464,990	1.9 2016/6/20	1.96
日本	国債証券	第258回利付国債（10年）	2,960,000,000	102.08 3,021,775,200	101.95 3,017,897,600	1.3 2014/3/20	1.88
日本	国債証券	第268回利付国債（10年）	2,820,000,000	103.82 2,927,949,600	103.67 2,923,663,200	1.5 2015/3/20	1.82
日本	国債証券	第272回利付国債（10年）	2,780,000,000	104.19 2,896,634,000	104.06 2,893,007,000	1.4 2015/9/20	1.81
日本	国債証券	第282回利付国債（10年）	2,716,000,000	106.51 2,892,830,800	106.43 2,890,856,080	1.7 2016/9/20	1.80
日本	国債証券	第270回利付国債（10年）	2,733,000,000	103.57 2,830,765,860	103.45 2,827,315,830	1.3 2015/6/20	1.76
日本	国債証券	第277回利付国債（10年）	2,484,000,000	105.53 2,621,439,720	105.42 2,618,856,360	1.6 2016/3/20	1.63
日本	国債証券	第260回利付国債（10年）	2,276,000,000	102.98 2,343,880,100	102.82 2,340,228,720	1.6 2014/6/20	1.46
日本	国債証券	第306回利付国債（10年）	2,180,000,000	106.62 2,324,512,200	106.81 2,328,523,400	1.4 2020/3/20	1.45
日本	国債証券	第274回利付国債（10年）	2,198,000,000	104.85 2,304,778,840	104.72 2,301,833,520	1.5 2015/12/20	1.44
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	2,140,000,000	105.97 2,267,779,400	106.11 2,270,839,600	1.3 2019/12/20	1.42
日本	国債証券	第286回利付国債（10年）	2,065,000,000	107.85 2,227,192,700	107.81 2,226,441,700	1.8 2017/6/20	1.39

日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	2,040,000,000	103.22 2,105,769,600	103.54 2,112,318,000	1 2020/9/20	1.32
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	2,000,000,000	104.31 2,086,380,000	104.66 2,093,260,000	1.2 2021/6/20	1.31
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	1,990,000,000	104.68 2,083,151,900	105.00 2,089,500,000	1.2 2020/12/20	1.30
日本	国債証券	第317回利付国債(10年)	1,940,000,000	103.24 2,003,030,600	103.61 2,010,092,200	1.1 2021/9/20	1.25
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	1,880,000,000	105.33 1,980,260,400	105.65 1,986,370,400	1.3 2021/3/20	1.24
日本	国債証券	第253回利付国債(10年)	1,757,000,000	101.84 1,789,486,200	101.70 1,786,921,710	1.6 2013/9/20	1.12
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	1,664,000,000	107.07 1,781,678,080	107.03 1,781,012,480	1.7 2017/3/20	1.11
日本	国債証券	第256回利付国債(10年)	1,745,000,000	101.94 1,778,870,450	101.79 1,776,392,550	1.4 2013/12/20	1.11
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	1,720,000,000	102.12 1,756,550,000	102.50 1,763,103,200	1 2021/12/20	1.10
日本	国債証券	第297回利付国債(10年)	1,524,000,000	106.60 1,624,599,240	106.65 1,625,467,920	1.4 2018/12/20	1.01
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	1,332,000,000	106.32 1,416,302,280	106.32 1,416,288,960	1.4 2018/3/20	0.88
日本	国債証券	第269回利付国債(10年)	1,350,000,000	103.28 1,394,293,500	103.15 1,392,538,500	1.3 2015/3/20	0.87
日本	国債証券	第288回利付国債(10年)	1,213,000,000	107.62 1,305,430,600	107.57 1,304,848,360	1.7 2017/9/20	0.81
日本	国債証券	第293回利付国債(10年)	1,191,000,000	108.80 1,295,808,000	108.80 1,295,808,000	1.8 2018/6/20	0.81
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	1,166,000,000	107.12 1,249,112,480	107.19 1,249,928,680	1.5 2018/9/20	0.78

## 〔SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）〕

## 投資有価証券の主要銘柄

## 主要投資銘柄

平成24年7月31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	外国株式インデックス・ マザーファンド	34,968,434,506	1.1216 39,220,596,142	1.2641 44,203,598,059	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」は「外国株式インデックス・マザーファンド」受益証券を主要対象としており、「外国株式インデックス・マザーファンド」の投資有価証券の上位30銘柄は以下の通りです。

平成24年7月31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〕	115,374	29,641.44 3,419,852,484	46,513.49 5,366,447,983	2.51
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION 〔エネルギー〕	583,196	6,024.17 3,513,273,586	6,844.56 3,991,723,046	1.87
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	934,665	1,950.68 1,823,240,727	2,316.95 2,165,580,296	1.01
アメリカ	株式	AT&T INC 〔電気通信サービス〕	733,624	2,206.88 1,619,020,761	2,925.90 2,146,512,735	1.00
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO 〔資本財〕	1,309,345	1,176.95 1,541,041,557	1,625.93 2,128,911,171	1.00
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION 〔エネルギー〕	244,735	7,621.93 1,865,354,367	8,584.62 2,100,959,276	0.98
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	136,186	14,175.09 1,930,449,773	15,374.47 2,093,788,334	0.98
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED 〔食品・飲料・タバコ〕	408,290	4,055.83 1,655,955,340	4,776.62 1,950,249,650	0.91
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	339,764	4,893.88 1,662,764,970	5,428.90 1,844,546,988	0.86
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO 〔家庭用品・パーソナル用品〕	340,775	4,889.06 1,666,070,120	5,088.86 1,734,158,651	0.81
アメリカ	株式	PFIZER INC 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	933,201	1,521.45 1,419,823,603	1,853.41 1,729,604,718	0.81
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY 〔銀行〕	619,819	1,900.15 1,177,750,865	2,654.65 1,645,404,491	0.77
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE 〔食品・飲料・タバコ〕	252,087	5,192.55 1,308,976,598	6,341.15 1,598,521,580	0.75
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A 〔ソフトウェア・サービス〕	31,931	45,607.24 1,456,284,852	49,426.89 1,578,250,056	0.74
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC. 〔食品・飲料・タバコ〕	213,050	5,842.06 1,244,652,693	7,127.54 1,518,522,524	0.71

イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC 〔銀行〕	2,228,261	598.76 1,334,202,976	667.14 1,486,571,045	0.70
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC 〔電気通信サービス〕	6,169,697	207.66 1,281,252,013	224.18 1,383,141,181	0.65
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC 〔食品・生活必需品小売り〕	233,158	4,555.53 1,062,158,875	5,861.18 1,366,582,545	0.64
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO 〔各種金融〕	470,185	2,248.58 1,057,251,976	2,825.06 1,328,302,622	0.62
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC. 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	376,622	2,703.42 1,018,168,642	3,477.00 1,309,515,296	0.61
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〕	284,758	3,899.28 1,110,352,770	4,553.16 1,296,548,877	0.61
イギリス	株式	BP PLC 〔エネルギー〕	2,349,550	538.16 1,264,455,230	545.96 1,282,765,909	0.60
アメリカ	株式	INTEL CORP 〔半導体・半導体製造装置〕	618,139	1,848.07 1,142,367,922	2,013.65 1,244,721,284	0.58
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC 〔電気通信サービス〕	350,717	2,875.13 1,008,360,271	3,513.74 1,232,328,877	0.58
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS 〔エネルギー〕	453,813	2,627.12 1,192,225,503	2,667.47 1,210,532,834	0.57
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION 〔ソフトウェア・サービス〕	497,747	2,320.81 1,155,178,785	2,390.43 1,189,833,641	0.56
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	86,925	11,330.89 984,937,943	13,543.75 1,177,291,077	0.55
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	624,633	1,681.27 1,050,181,733	1,799.60 1,124,093,294	0.53
アメリカ	株式	PEPSICO INC 〔食品・飲料・タバコ〕	194,297	4,986.77 968,915,316	5,686.86 1,104,941,294	0.52
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD 〔素材〕	399,257	2,864.29 1,143,591,380	2,596.50 1,036,673,475	0.49

## 〔SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;〕

## 投資有価証券の主要銘柄

## 主要投資銘柄

平成24年7月31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	外国債券パッシブ・ マザーファンド	2,784,119,723	1.1091 3,088,044,674	1.1162 3,107,634,434	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>」は「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要対象としており、「外国債券パッシブ・マザーファンド」の投資有価証券の上位30銘柄は以下の通りです。

平成24年7月31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 (%)
アメリカ	国債証券	US T 2.625% 20/11/15	18,000,000	8,437.47 1,518,745,387	8,682.36 1,562,825,946	2.625 2020/11/15	0.65
アメリカ	国債証券	US T 0.375% 150415	17,000,000	7,816.49 1,328,804,047	7,835.93 1,332,108,412	0.375 2015/4/15	0.55
アメリカ	国債証券	US T 4.75% 41/02/15	11,000,000	10,846.08 1,193,069,625	11,415.87 1,255,746,091	4.75 2041/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 21/02/15	13,000,000	9,094.59 1,182,296,821	9,319.94 1,211,592,255	3.625 2021/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 20/02/15	13,000,000	9,098.98 1,182,868,440	9,274.13 1,205,637,895	3.625 2020/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	US T 4.375% 40/05/15	11,000,000	10,220.72 1,124,280,025	10,771.58 1,184,873,989	4.375 2040/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	US T 4.25% 40/11/15	11,000,000	10,035.07 1,103,858,112	10,576.76 1,163,444,420	4.25 2040/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	US T 3.5% 20/05/15	12,500,000	9,020.03 1,127,504,537	9,210.62 1,151,328,066	3.5 2020/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	US T 2.625% 20/8/15	13,000,000	8,454.08 1,099,031,115	8,687.25 1,129,342,758	2.625 2020/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	US T 1.375% 190228	14,000,000	7,814.87 1,094,082,821	8,045.40 1,126,356,415	1.375 2019/2/28	0.47
アメリカ	国債証券	US T 3.875% 40/8/15	11,000,000	9,429.25 1,037,218,187	9,960.56 1,095,662,476	3.875 2040/8/15	0.46
イギリス	国債証券	UKT 2% 16/01/22	8,000,000	12,884.93 1,030,794,662	12,983.20 1,038,656,422	2 2016/1/22	0.43
アメリカ	国債証券	US T 0.25% 15/01/15	13,000,000	7,806.99 1,014,909,901	7,815.77 1,016,051,217	0.25 2015/1/15	0.42
アメリカ	国債証券	US T 0.25% 15/05/15	13,000,000	7,794.69 1,013,310,315	7,805.39 1,014,701,568	0.25 2015/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US T 3.375% 19/11/15	11,000,000	8,944.35 983,879,376	9,116.57 1,002,823,387	3.375 2019/11/15	0.42

アメリカ	国債証券	US T 3.125% 21/05/15	11,000,000	8,740.38 961,442,143	8,994.43 989,387,918	3.125 2021/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US T 4.375% 39/11/15	9,000,000	10,217.06 919,535,695	10,756.31 968,068,276	4.375 2039/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRTR 3.0% 15/10/25	9,000,000	10,041.56 903,740,892	10,393.07 935,376,746	3 2015/10/25	0.39
アメリカ	国債証券	US T 2.125% 21/08/15	11,000,000	8,029.52 883,247,715	8,318.99 915,089,776	2.125 2021/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US T 3.125% 19/05/15	10,000,000	8,783.96 878,396,290	8,951.07 895,107,574	3.125 2019/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US T 0.875% 16/12/31	11,000,000	7,887.01 867,571,829	7,933.03 872,633,695	0.875 2016/12/31	0.36
アメリカ	国債証券	US T 1% 14/05/15	11,000,000	7,951.72 874,689,702	7,924.48 871,693,212	1 2014/5/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE 3.75% 17/04/25	8,000,000	10,322.29 825,783,914	10,867.05 869,364,499	3.75 2017/4/25	0.36
フランス	国債証券	FRTR 5% 16/10/25	7,600,000	10,889.20 827,579,367	11,308.82 859,470,715	5 2016/10/25	0.36
アメリカ	国債証券	US T 2.125% 14/11/30	10,500,000	8,221.89 863,299,102	8,155.94 856,373,728	2.125 2014/11/30	0.36
イギリス	国債証券	UKT 5% 25/03/07	5,100,000	16,020.86 817,063,872	16,531.43 843,103,372	5 2025/3/7	0.35
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 21/04/25	7,700,000	10,155.02 781,937,290	10,914.32 840,402,651	3.75 2021/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 19/08/15	9,000,000	9,076.26 816,864,285	9,230.77 830,769,999	3.625 2019/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	US T 2.5% 15/04/30	10,000,000	8,357.47 835,747,230	8,290.90 829,090,562	2.5 2015/4/30	0.35
アメリカ	国債証券	US T 2.25% 15/01/31	10,000,000	8,268.30 826,830,964	8,201.13 820,113,230	2.25 2015/1/31	0.34

## 〔SMAM・マネーインカムファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;〕

## 投資有価証券の主要銘柄

## 主要投資銘柄

平成24年7月30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	マネーインカム・ マザーファンド	238,163,610	1.0095 240,426,165	1.0100 240,545,246	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>」は「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要対象としており、「マネーインカム・マザーファンド」の投資有価証券は以下の通りです。

平成24年7月30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241回利付国債 (10年)	811,000,000	100.40 814,308,160	100.16 812,330,040	1.3 2012/9/20	47.43
日本	国債証券	第247回利付国債 (10年)	290,300,000	100.61 292,092,320	100.44 291,583,126	0.8 2013/3/20	17.02
日本	国債証券	第250回利付国債 (10年)	290,300,000	100.41 291,517,379	100.35 291,324,759	0.5 2013/6/20	17.01
日本	国債証券	第244回利付国債 (10年)	290,300,000	100.57 291,976,513	100.34 291,307,341	1 2012/12/20	17.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## 〔参考情報〕

基準日2012年7月31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

## &lt;2010&gt;



基準価額	10,972円
純資産総額	3億円

## 分配の推移

決算期	分配金
2011年12月	0円
2010年12月	0円
2009年12月	0円
2008年12月	0円
2007年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

## &lt;2020&gt;



基準価額	10,796円
純資産総額	5億円

## 分配の推移

決算期	分配金
2011年12月	0円
2010年12月	0円
2009年12月	0円
2008年12月	0円
2007年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

## &lt;2030&gt;



基準価額	9,917円
純資産総額	3億円

## 分配の推移

決算期	分配金
2011年12月	0円
2010年12月	0円
2009年12月	0円
2008年12月	0円
2007年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

## &lt;2040&gt;



基準価額	8,991円
純資産総額	3億円

## 分配の推移

決算期	分配金
2011年12月	0円
2010年12月	0円
2009年12月	0円
2008年12月	0円
2007年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

※基準価額は、1万円当たり、信託報酬控除後です。

基準日2012年7月31日

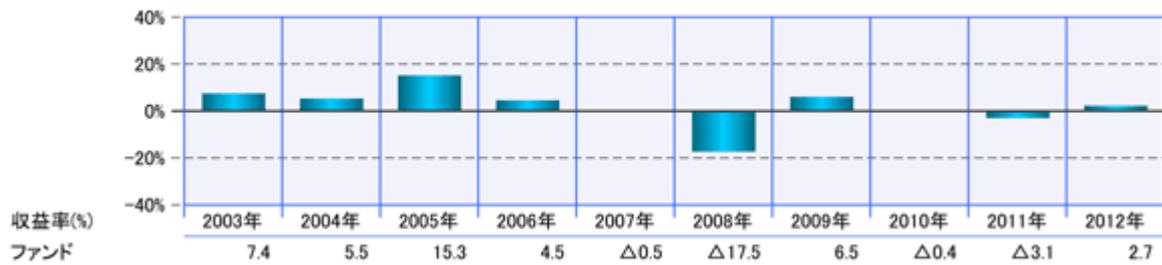
※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。  
 ※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

## 年間収益率の推移 (暦年ベース)

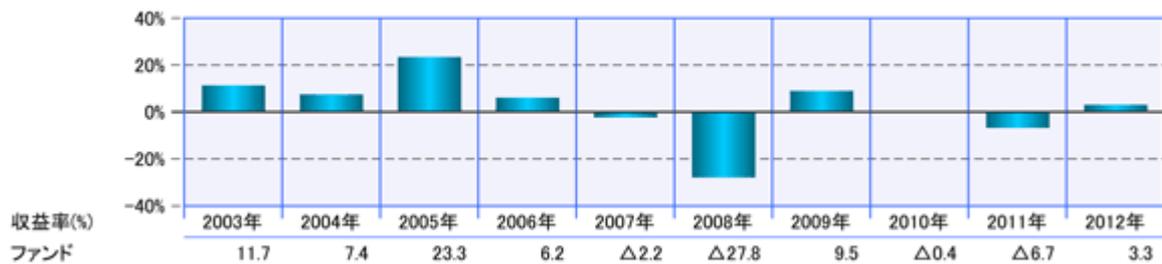
## &lt;2010&gt;



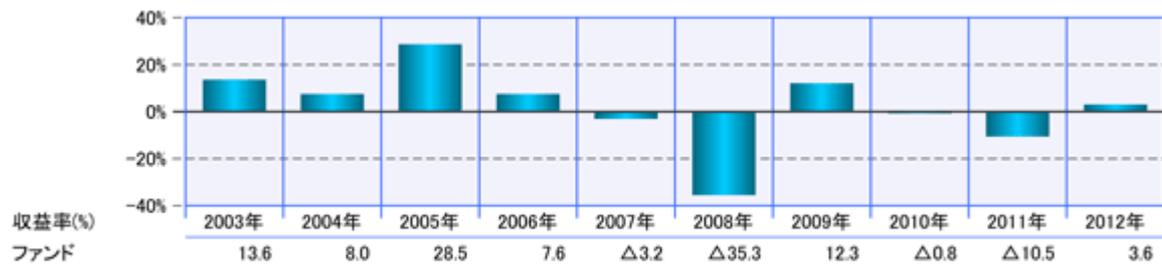
## &lt;2020&gt;



## &lt;2030&gt;



## &lt;2040&gt;



2012年のファンドの収益率は、年初から2012年7月31日までの騰落率を表示しています。  
 ファンドにはベンチマークはありません。

### 第3【ファンドの経理状況】

#### <訂正前>

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期(平成21年12月22日から平成22年12月20日まで)および第11期(平成22年12月21日から平成23年12月20日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### <訂正後>

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期(平成21年12月22日から平成22年12月20日まで)および第11期(平成22年12月21日から平成23年12月20日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。
3. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
4. 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12期中間計算期間(平成23年12月21日から平成24年6月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

### 1【財務諸表】

#### [追加]

原届出書「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」に中間財務諸表(比較情報を除きます。)が追加されます。

## 中間財務諸表

【三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

		第12期中間計算期間 (平成24年6月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		1,426,483
投資信託受益証券		338,071,676
未収入金		180,000
未収利息		1
流動資産合計		339,678,160
資産合計		339,678,160
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金		360,000
未払解約金		173,000
未払受託者報酬		70,692
未払委託者報酬		636,161
その他未払費用		5,247
流動負債合計		1,245,100
負債合計		1,245,100
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		308,809,831
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		29,623,229
元本等合計		338,433,060
純資産合計		338,433,060
負債純資産合計		339,678,160

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第12期中間計算期間 自 平成23年12月21日 至 平成24年 6月20日
営業収益	
受取利息	273
有価証券売買等損益	5,057,560
営業収益合計	5,057,833
営業費用	
受託者報酬	70,692
委託者報酬	636,161
その他費用	5,247
営業費用合計	712,100
営業利益	4,345,733
経常利益	4,345,733
中間純利益	4,345,733
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	195,229
期首剰余金又は期首欠損金( )	24,911,252
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,496,722
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,496,722
剰余金減少額又は欠損金増加額	935,249
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	935,249
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	29,623,229

**（３）【中間注記表】**

（重要な会計方針の注記）

項目	第12期中間計算期間 自 平成23年12月21日 至 平成24年 6 月20日
資産の評価基準及び評価方法	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、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。なお、「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞」および「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については前営業日の基準価額に基づいて評価し、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」および「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については、当日の基準価額に基づいて評価しております。

（追加情報）

第12期中間計算期間 自 平成23年12月21日 至 平成24年 6 月20日
当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第12期中間計算期間 （平成24年 6 月20日現在）
1. 受益権総数	当中間計算期間の末日における受益権の総数 308,809,831口
2. 1単位当たり純資産額	1.0959円 （1万口 = 10,959円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期中間計算期間 （平成24年 6 月20日現在）
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 該当事項はありません。 （3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

第12期中間計算期間(平成24年6月20日現在)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第12期中間計算期間 (平成24年6月20日現在)
期首元本額	304,481,336円
期中追加設定元本額	15,716,180円
期中一部解約元本額	11,387,685円

## 【三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

		第12期中間計算期間 (平成24年6月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		5,137,584
投資信託受益証券		526,961,405
未収利息		7
流動資産合計		532,098,996
資産合計		532,098,996
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金		860,000
未払解約金		746,473
未払受託者報酬		110,242
未払委託者報酬		1,240,154
その他未払費用		8,208
流動負債合計		2,965,077
負債合計		2,965,077
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		490,905,127
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		38,228,792
元本等合計		529,133,919
純資産合計		529,133,919
負債純資産合計		532,098,996

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第12期中間計算期間 自 平成23年12月21日 至 平成24年 6 月20日
営業収益	
受取利息	398
有価証券売買等損益	16,322,827
営業収益合計	16,323,225
営業費用	
受託者報酬	110,242
委託者報酬	1,240,154
その他費用	8,208
営業費用合計	1,358,604
営業利益	14,964,621
経常利益	14,964,621
中間純利益	14,964,621
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	802,571
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	22,410,450
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,804,739
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,804,739
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,148,447
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,148,447
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	38,228,792

**（３）【中間注記表】**

（重要な会計方針の注記）

項目	第12期中間計算期間 自平成23年12月21日 至平成24年6月20日
資産の評価基準及び評価方法	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、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。なお、「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞」および「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については前営業日の基準価額に基づいて評価し、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」および「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については、当日の基準価額に基づいて評価しております。

（追加情報）

第12期中間計算期間 自平成23年12月21日 至平成24年6月20日
当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第12期中間計算期間 （平成24年6月20日現在）
1. 受益権総数	当中間計算期間の末日における受益権の総数 490,905,127口
2. 1単位当たり純資産額	1.0779円 （1万口 = 10,779円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期中間計算期間 （平成24年6月20日現在）
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 該当事項はありません。 （3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

第12期中間計算期間(平成24年6月20日現在)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第12期中間計算期間 (平成24年6月20日現在)
期首元本額	480,944,044円
期中追加設定元本額	34,030,968円
期中一部解約元本額	24,069,885円

## 【三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第12期中間計算期間 (平成24年6月20日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	2,803,466
投資信託受益証券	302,079,525
未収利息	3
流動資産合計	304,882,994
資産合計	304,882,994
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	600,000
未払解約金	91,674
未払受託者報酬	62,492
未払委託者報酬	702,998
その他未払費用	4,618
流動負債合計	1,461,782
負債合計	1,461,782
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	306,508,038
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,086,826
元本等合計	303,421,212
純資産合計	303,421,212
負債純資産合計	304,882,994

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第12期中間計算期間 自 平成23年12月21日 至 平成24年 6 月20日
営業収益	
受取利息	233
有価証券売買等損益	11,133,910
営業収益合計	11,134,143
営業費用	
受託者報酬	62,492
委託者報酬	702,998
その他費用	4,618
営業費用合計	770,108
営業利益	10,364,035
経常利益	10,364,035
中間純利益	10,364,035
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	283,128
期首剰余金又は期首欠損金( )	13,599,545
剰余金増加額又は欠損金減少額	431,812
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	246,709
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	185,103
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	3,086,826

**（3）【中間注記表】**

（重要な会計方針の注記）

項目	第12期中間計算期間 自平成23年12月21日 至平成24年6月20日
資産の評価基準及び評価方法	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、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。なお、「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞」および「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については前営業日の基準価額に基づいて評価し、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」および「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については、当日の基準価額に基づいて評価しております。

（追加情報）

第12期中間計算期間 自平成23年12月21日 至平成24年6月20日
当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第12期中間計算期間 （平成24年6月20日現在）
1. 受益権総数	当中間計算期間の末日における受益権の総数 306,508,038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 3,086,826円
3. 1単位当たり純資産額	0.9899円 （1万口 = 9,899円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期中間計算期間 （平成24年6月20日現在）
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 該当事項はありません。 （3）コール・ローン、未入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

第12期中間計算期間(平成24年6月20日現在)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第12期中間計算期間 (平成24年6月20日現在)
期首元本額	286,603,183円
期中追加設定元本額	25,325,767円
期中一部解約元本額	5,420,912円

【三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040】  
（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第12期中間計算期間 (平成24年6月20日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	2,142,899
投資信託受益証券	246,471,052
未収利息	2
流動資産合計	248,613,953
資産合計	248,613,953
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	170,000
未払解約金	154,653
未払受託者報酬	52,453
未払委託者報酬	590,051
その他未払費用	3,871
流動負債合計	971,028
負債合計	971,028
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	275,753,434
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	28,110,509
元本等合計	247,642,925
純資産合計	247,642,925
負債純資産合計	248,613,953

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第12期中間計算期間 自 平成23年12月21日 至 平成24年 6月20日
営業収益	
受取利息	226
有価証券売買等損益	11,339,108
営業収益合計	11,339,334
営業費用	
受託者報酬	52,453
委託者報酬	590,051
その他費用	3,871
営業費用合計	646,375
営業利益	10,692,959
経常利益	10,692,959
中間純利益	10,692,959
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	1,141,721
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	37,951,103
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,614,919
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,614,919
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,325,563
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,325,563
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	28,110,509

**（3）【中間注記表】**

（重要な会計方針の注記）

項目	第12期中間計算期間 自平成23年12月21日 至平成24年6月20日
資産の評価基準及び評価方法	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、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。なお、「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞」および「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については前営業日の基準価額に基づいて評価し、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」および「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については、当日の基準価額に基づいて評価しております。

（追加情報）

第12期中間計算期間 自平成23年12月21日 至平成24年6月20日
当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第12期中間計算期間 （平成24年6月20日現在）
1. 受益権総数	当中間計算期間の末日における受益権の総数 275,753,434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 28,110,509円
3. 1単位当たり純資産額	0.8981円 （1万口＝8,981円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期中間計算期間 （平成24年6月20日現在）
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 該当事項はありません。 （3）コール・ローン、未入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

第12期中間計算期間(平成24年6月20日現在)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第12期中間計算期間 (平成24年6月20日現在)
期首元本額	268,375,847円
期中追加設定元本額	26,106,921円
期中一部解約元本額	18,729,334円

（参考）

「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030」および「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040」は、「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>」、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>」および「SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>」投資信託受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」はこれらの投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外です。

「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」の状況

### （1）貸借対照表

対象年月日	（平成24年6月19日現在）
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	23,648
親投資信託受益証券	65,907,661,846
未収入金	30,000
流動資産合計	65,907,715,494
資産合計	65,907,715,494
負債の部	
流動負債	
未払解約金	30,000
未払受託者報酬	1,480,953
未払委託者報酬	1,295,824
その他未払費用	33,140
流動負債合計	2,839,917
負債合計	2,839,917
純資産の部	
元本等	
元本	
元本	100,209,602,233
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	34,304,726,656
元本等合計	65,904,875,577
純資産合計	65,904,875,577
負債純資産合計	65,907,715,494

（注）「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」は、毎年11月30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24年6月19日現在における同ファンドの状況です。

**（２）注記表**

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成23年12月1日 至平成24年6月19日
資産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。

（追加情報）

自平成23年12月1日 至平成24年6月19日	
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。	

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成24年6月19日現在）
1. 受益権総数	平成24年6月19日現在における受益権の総数 100,209,602,233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 34,304,726,656円
3. 1単位当たり純資産額	0.6577円 （1万口 = 6,577円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成24年6月19日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 （3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成24年6月19日現在）

平成24年6月19日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（その他の注記）

（平成24年6月19日現在）	
期首	平成23年12月1日
期首元本額	104,135,014,350円
期首より平成24年6月19日現在までの追加設定元本額	6,687,603,720円
期首より平成24年6月19日現在までの一部解約元本額	10,613,015,837円

（参考情報）

S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）は、「国内株式インデックス・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。

「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」の状況

（1）貸借対照表

対象年月日	（平成24年6月19日現在）
科目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,591,753,190
株式	272,359,632,810
派生商品評価勘定	270,331,350
未収配当金	2,701,059,439
未収利息	3,550
流動資産合計	277,922,780,339
資産合計	277,922,780,339
負債の部	
流動負債	
前受金	271,080,000
未払金	35,650,000
未払解約金	4,870,112
流動負債合計	311,600,112
負債合計	311,600,112
純資産の部	
元本等	
元本	
元本	277,941,736,402
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	330,556,175
元本等合計	277,611,180,227
純資産合計	277,611,180,227
負債純資産合計	277,922,780,339

（注）「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」は、毎年11月30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24年6月19日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成23年12月1日 至平成24年6月19日
1. 資産の評価基準及び評価方法	(1)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。 (2)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。
2. 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。

(追加情報)

自平成23年12月1日 至平成24年6月19日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年6月19日現在)				
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。  <table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">担保資産</th> <th style="text-align: center;">金額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">株式</td> <td style="text-align: right;">5,427,000,000円</td> </tr> </tbody> </table>	担保資産	金額	株式	5,427,000,000円
担保資産	金額				
株式	5,427,000,000円				
2. 受益権総数	平成24年6月19日現在における受益権の総数  277,941,736,402口				
3. 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  330,556,175円				
4. 1単位当たり純資産額	0.9988円 (1万円 = 9,988円)				

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年6月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

（平成24年6月19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  
株式関連

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 (TOPIX先物) 買建	4,973,035,000	-	5,244,115,000	271,080,000 (270,331,350)
		(4,973,783,650)	(-)		
	買建合計	4,973,035,000 (4,973,783,650)	- (-)	5,244,115,000	271,080,000 (270,331,350)

## （注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

なお、( )内は手数料相当額を含んだ場合の金額を表わしています。

4. 株価指数先物取引の取引市場は、東京証券取引所です。

## 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。

(その他の注記)

(平成24年6月19日現在)	
期首	平成23年12月1日
期首元本額	286,916,852,202円
期首より平成24年6月19日現在までの追加設定元本額	17,641,179,978円
期首より平成24年6月19日現在までの一部解約元本額	26,616,295,778円
平成24年6月19日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	8,956,510,942円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	505,824,121円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,442,524,854円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,603,050,859円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	48,142,790円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	5,300,358円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	6,525,826円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	6,074,476円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	7,589,725円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	2,054,541円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	4,361,874円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	953,160,569円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	30,835,807円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	65,986,846,062円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	742,841,438円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	50,610,404,233円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	17,487,080,406円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	7,642,208,565円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	26,413,535,619円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	192,247,980円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	582,982,006円
世界6資産バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	94,387,257円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	2,516,959,451円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	131,651,184円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	1,056,443,602円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	3,212,571,715円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	5,074,391,355円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	10,962,252,744円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	1,363,822,933円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	11,003,841,272円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	235,883,869円
SMAM・バランスファンドVA20 < 適格機関投資家専用 >	2,957,495,921円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	46,266,770,870円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	332,224,312円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	169,913,149円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	59,238,101円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	871,557,967円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	1,500,956,252円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T < 適格機関投資家専用 >	577,923,283円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	388,934,255円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 >	169,579,440円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 < 適格機関投資家専用 >	32,560,898円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 < 適格機関投資家専用 >	367,648,952円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	3,662,002,643円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	539,474,037円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2 < 適格機関投資家専用 >	133,116,649円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	21,299,090円
SMAM・FGグローバルバランス25VA < 適格機関投資家限定 >	8,732,150円
合計	277,941,736,402円

「S M A M ・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>」の状況

(1) 貸借対照表

対象年月日	(平成24年6月19日現在)
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,168
親投資信託受益証券	57,808,247,225
流動資産合計	57,808,248,393
資産合計	57,808,248,393
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	7,527,229
未払委託者報酬	7,527,174
流動負債合計	15,054,403
負債合計	15,054,403
純資産の部	
元本等	
元本	
元本	49,907,837,074
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	7,885,356,916
元本等合計	57,793,193,990
純資産合計	57,793,193,990
負債純資産合計	57,808,248,393

(注) 「S M A M ・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>」は、毎年6月20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24年6月19日現在における同ファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成23年6月21日 至平成24年6月19日
資産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。

(追加情報)

自平成23年6月21日 至平成24年6月19日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成24年6月19日現在）
1. 受益権総数	平成24年6月19日現在における受益権の総数 49,907,837,074口
2. 1単位当たり純資産額	1.1580円 （1万口 = 11,580円）

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成24年6月19日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （デリバティブ取引に関する注記）

（平成24年6月19日現在）

平成24年6月19日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

## （その他の注記）

（平成24年6月19日現在）	
期首	平成23年6月21日
期首元本額	51,507,648,326円
期首より平成24年6月19日現在までの追加設定元本額	1,793,052,904円
期首より平成24年6月19日現在までの一部解約元本額	3,392,864,156円

（参考情報）

S M A M ・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞は、「国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外です。

「国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド」の状況

（１）貸借対照表

対象年月日	（平成24年6月19日現在）
科目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	706,079,796
国債証券	120,806,630,050
地方債証券	10,777,058,905
特殊債券	16,785,028,666
社債券	10,942,238,170
未収入金	100,025,000
未収利息	794,200,324
前払費用	48,670,646
流動資産合計	160,959,931,557
資産合計	160,959,931,557
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,809,173
流動負債合計	2,809,173
負債合計	2,809,173
純資産の部	
元本等	
元本	
元本	129,171,281,953
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	31,785,840,431
元本等合計	160,957,122,384
純資産合計	160,957,122,384
負債純資産合計	160,959,931,557

（注）「国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド」は、毎年6月20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24年6月19日現在における同マザーファンドの状況です。

**（２）注記表****（重要な会計方針の注記）**

項目	自平成23年6月21日 至平成24年6月19日
資産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。

**（追加情報）**

自平成23年6月21日 至平成24年6月19日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

**（貸借対照表に関する注記）**

項目	（平成24年6月19日現在）
1. 受益権総数	平成24年6月19日現在における受益権の総数 129,171,281,953口
2. 1単位当たり純資産額	1.2461円 （1万口 = 12,461円）

**（金融商品に関する注記）****金融商品の時価等に関する事項**

項目	（平成24年6月19日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 （3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

**（デリバティブ取引に関する注記）**

（平成24年6月19日現在）

平成24年6月19日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

(その他の注記)

(平成24年6月19日現在)	
期首	平成23年6月21日
期首元本額	135,996,949,897円
期首より平成24年6月19日現在までの追加設定元本額	13,205,022,209円
期首より平成24年6月19日現在までの一部解約元本額	20,030,690,153円
平成24年6月19日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンド	18,462,849,957円
S M A M ・国内債券インデックス・ファンド	63,295,863,618円
国内債券インデックスファンドVA <適格機関投資家限定>	1,021,229,621円
S M A M ・年金国内債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	46,391,338,757円
合計	129,171,281,953円

「S M A M ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」の状況

## (1) 貸借対照表

対象年月日	(平成24年6月20日現在)
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,169,323
親投資信託受益証券	43,905,308,275
未収入金	111,149,999
未収利息	1
流動資産合計	44,017,627,598
資産合計	44,017,627,598
負債の部	
流動負債	
未払解約金	111,149,999
未払受託者報酬	1,410,732
未払委託者報酬	512,984
その他未払費用	36,561
流動負債合計	113,110,276
負債合計	113,110,276
純資産の部	
元本等	
元本	
元本	45,332,590,611
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,428,073,289
元本等合計	43,904,517,322
純資産合計	43,904,517,322
負債純資産合計	44,017,627,598

(注) 「S M A M ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」は、毎年11月30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24年6月20日現在における同ファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成23年12月1日 至平成24年6月20日
資産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。

## (追加情報)

自 平成23年12月 1日 至 平成24年 6月20日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項 目	(平成24年 6月20日現在)
1. 受益権総数	平成24年 6月20日現在における受益権の総数 45,332,590,611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 1,428,073,289円
3. 1単位当たり純資産額	0.9685円 (1万口=9,685円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項 目	(平成24年 6月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(平成24年 6月20日現在)

平成24年 6月20日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

## (その他の注記)

(平成24年 6月20日現在)	
期 首	平成23年12月 1日
期首元本額	48,392,577,055円
期首より平成24年 6月20日現在までの追加設定元本額	2,473,192,163円
期首より平成24年 6月20日現在までの一部解約元本額	5,533,178,607円

（参考情報）

S M A M ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）は、「外国株式インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外です。

「外国株式インデックス・マザーファンド」の状況

（１）貸借対照表

対象年月日	(平成24年6月20日現在)
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	454,807,762
コール・ローン	143,654,822
株式	204,347,748,128
新株予約権証券	10,671,668
投資証券	4,741,453,793
派生商品評価勘定	59,249,723
未収入金	476,819
未収配当金	442,861,250
未収利息	196
差入委託証拠金	680,923,058
流動資産合計	210,881,847,219
資産合計	210,881,847,219
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	850
未払金	11,872,077
未払解約金	117,708,482
流動負債合計	129,581,409
負債合計	129,581,409
純資産の部	
元本等	
元本	
元本	169,359,898,628
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	41,392,367,182
元本等合計	210,752,265,810
純資産合計	210,752,265,810
負債純資産合計	210,881,847,219

（注）「外国株式インデックス・マザーファンド」は、毎年11月30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24年6月20日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成23年12月1日 至平成24年6月20日
1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式、新株予約権証券および投資証券（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。 なお売買停止措置がとられている銘柄について、必要であると判断された場合は、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> <p>(2)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(3)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(追加情報)

自平成23年12月1日 至平成24年6月20日
<p>当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年6月20日現在)
1. 受益権総数	平成24年6月20日現在における受益権の総数 169,359,898,628口
2. 1単位当たり純資産額	1.2444円 (1万口 = 12,444円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年6月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(株式、新株予約権証券および投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成24年6月20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

株式関連

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建				
	SP500	1,130,149,502 (14,309,312.5米ドル)	( )	1,173,374,268 (14,856,600米ドル)	43,224,766 (547,287.5米ドル)
	DJ EUR	344,346,855 (3,442,780ユーロ)	( )	354,526,891 (3,544,560ユーロ)	10,180,036 (101,780ユーロ)
	FTSE	200,836,989 (1,617,045英ポンド)	( )	206,681,220 (1,664,100英ポンド)	5,844,231 (47,055英ポンド)
	買建 合計	1,675,333,346		1,734,582,379	59,249,033

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

## 通貨関連

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場外取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	78,970,600	-	78,970,000	600
	ユーロ	30,003,090	-	30,003,000	90
	英ポンド	12,418,150	-	12,419,000	850
	売建 合計	121,391,840	-	121,392,000	160

(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

- 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。  
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。  
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。
  - 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
  - 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。
- 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。

(その他の注記)

(平成24年6月20日現在)	
期首	平成23年12月1日
期首元本額	189,363,992,089円
期首より平成24年6月20日現在までの追加設定元本額	4,769,481,328円
期首より平成24年6月20日現在までの一部解約元本額	24,773,574,789円
平成24年6月20日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	4,581,334,280円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	204,975,698円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	844,104,535円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	518,145,423円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	18,376,402円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	2,088,801円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	2,891,757円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	3,319,775円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	4,445,389円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,264,872円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	2,947,702円
外国株式指数ファンド	254,068,536円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	610,533円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	35,282,311,375円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	302,020,582円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	20,175,227,743円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	9,311,177,616円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,391,176,335円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	21,245,058,019円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	75,073,768円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	308,121,247円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	56,453,694円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	2,340,134,317円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	159,650,624円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	553,475,831円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,594,444,791円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	4,082,812,451円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,604,905,233円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,084,653,424円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,985,685,273円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	8,842,968,085円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	575,155,617円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	2,386,266,868円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	37,171,209,978円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	87,253,515円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	53,468,143円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	20,196,605円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	227,108,334円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	511,442,631円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	462,372,708円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	17,295,519円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	14,204,599円
合計	169,359,898,628円

「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;」の状況

## (1) 貸借対照表

対象年月日	(平成24年6月20日現在)
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	57
親投資信託受益証券	2,665,411,784
流動資産合計	2,665,411,841
資産合計	2,665,411,841
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	3,057
未払委託者報酬	1,528
流動負債合計	4,585
負債合計	4,585
純資産の部	
元本等	
元本	
元本	2,381,143,795
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	284,263,461
元本等合計	2,665,407,256
純資産合計	2,665,407,256
負債純資産合計	2,665,411,841

(注) 「SMAM・年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>」は、毎年12月17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24年6月20日現在における同ファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成23年12月20日 至平成24年6月20日
資産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。

(追加情報)

自平成23年12月20日 至平成24年6月20日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年6月20日現在)
1. 受益権総数	平成24年6月20日現在における受益権の総数 2,381,143,795口
2. 1単位当たり純資産額	1.1194円 (1万口 = 11,194円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年6月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(平成24年6月20日現在)

平成24年6月20日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

## (その他の注記)

(平成24年6月20日現在)	
期首	平成23年12月20日
期首元本額	5,453,470,323円
期首より平成24年6月20日現在までの追加設定元本額	404,000,486円
期首より平成24年6月20日現在までの一部解約元本額	3,476,327,014円

（参考情報）

S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>は、「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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。

「外国債券パッシブ・マザーファンド」の状況

（１）貸借対照表

対象年月日	(平成24年6月20日現在)
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	626,792,724
コール・ローン	191,301,166
国債証券	238,033,829,726
未収入金	539,586,650
未収利息	2,632,354,023
前払費用	86,831,454
流動資産合計	242,110,695,743
資産合計	242,110,695,743
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,006,334
未払解約金	62,010,063
流動負債合計	63,016,397
負債合計	63,016,397
純資産の部	
元本等	
元本	
元本	215,071,931,664
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	26,975,747,682
元本等合計	242,047,679,346
純資産合計	242,047,679,346
負債純資産合計	242,110,695,743

（注）「外国債券パッシブ・マザーファンド」は、毎年12月17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24年6月20日現在における同マザーファンドの状況です。

**( 2 ) 注記表**

( 重要な会計方針の注記 )

項目	自 平成23年12月20日 至 平成24年 6 月20日
1. 資産の評価基準及び評価方法	(1)国債証券（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。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
2. 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。

( 追加情報 )

自 平成23年12月20日 至 平成24年 6 月20日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

( 貸借対照表に関する注記 )

項目	( 平成24年 6 月20日現在 )
1. 受益権総数	平成24年 6 月20日現在における受益権の総数 215,071,931,664口
2. 1 単位当たり純資産額	1.1254円 ( 1 万口 = 11,254円 )

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年6月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

（平成24年6月20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		時価	評価損益
			うち1年超		
市場外取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	260,588,161	-	260,589,811	1,650
	ユーロ	180,637,274	-	181,399,985	762,711
	英ポンド	102,671,357	-	102,913,330	241,973
	売建 合計	543,896,792	-	544,903,126	1,006,334

## (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

- 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。  
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。  
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。
  - 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
  - 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。
- 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。

(その他の注記)

(平成24年6月20日現在)	
期首	平成23年12月20日
期首元本額	224,957,760,630円
期首より平成24年6月20日現在までの追加設定元本額	2,355,278,623円
期首より平成24年6月20日現在までの一部解約元本額	12,241,107,589円
平成24年6月20日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	3,034,132,070円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	220,999,982円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	618,536,613円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	281,615,195円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	32,237,989円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	4,177,244円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	5,144,434円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	3,850,051円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	4,316,923円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,117,679円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	2,149,964円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,368,412,817円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	11,756,880,190円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	36,950,145,777円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	11,150,502,742円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	23,650,334,096円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	85,985,806円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	176,913,226円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	42,509,029円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,265,006,547円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	177,237,439円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,221,478,744円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,826,676,735円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	6,904,230,308円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	14,760,599,439円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,228,006,866円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	23,246,322,516円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,081,510,811円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	10,047,273,025円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	414,017,303円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	10,806,443,520円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	42,215,328,702円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	294,003,741円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	90,136,498円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	22,632,014円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	383,390,593円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,344,668,843円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	383,151,547円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	344,139,271円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	91,396,793円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	12,218,025円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	3,260,134,903円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	89,443,849円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	111,665,447円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	60,856,358円
合計	215,071,931,664円

## 「SMAM・マネーインカムファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;」の状況

## (1) 貸借対照表

対象年月日	(平成24年6月19日現在)
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1
親投資信託受益証券	238,807,725
流動資産合計	238,807,726
資産合計	238,807,726
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	1,501
未払委託者報酬	13,626
流動負債合計	15,127
負債合計	15,127
純資産の部	
元本等	
元本	
元本	237,026,995
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,765,604
元本等合計	238,792,599
純資産合計	238,792,599
負債純資産合計	238,807,726

(注) 「SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>」は、毎年4月13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24年6月19日現在における同ファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成24年4月14日 至平成24年6月19日
資産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。

(追加情報)

自平成24年4月14日 至平成24年6月19日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年6月19日現在)
1. 受益権総数	平成24年6月19日現在における受益権の総数 237,026,995口
2. 1単位当たり純資産額	1.0074円 (1万口 = 10,074円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年6月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(平成24年6月19日現在)

平成24年6月19日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

## (その他の注記)

(平成24年6月19日現在)	
期首	平成24年4月14日
期首元本額	239,513,968円
期首より平成24年6月19日現在までの追加設定元本額	1,611,032円
期首より平成24年6月19日現在までの一部解約元本額	4,098,005円

（参考情報）

S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>は、「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外です。

「マネーインカム・マザーファンド」の状況

（１）貸借対照表

対象年月日	(平成24年6月19日現在)
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	14,104,229
国債証券	1,811,821,050
未収利息	3,070,984
前払費用	2,702,938
流動資産合計	1,831,699,201
資産合計	1,831,699,201
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,400,000
流動負債合計	1,400,000
負債合計	1,400,000
純資産の部	
元本等	
元本	
元本	1,812,464,416
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	17,834,785
元本等合計	1,830,299,201
純資産合計	1,830,299,201
負債純資産合計	1,831,699,201

（注）「マネーインカム・マザーファンド」は、毎年4月13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24年6月19日現在における同マザーファンドの状況です。

**（２）注記表**

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成24年4月14日 至平成24年6月19日
資産の評価基準及び評価方法	国債証券（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。

（追加情報）

自平成24年4月14日 至平成24年6月19日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成24年6月19日現在）
1. 受益権総数	平成24年6月19日現在における受益権の総数 1,812,464,416口
2. 1単位当たり純資産額	1.0098円 （1万口 = 10,098円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成24年6月19日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 （3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成24年6月19日現在）

平成24年6月19日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

(その他の注記)

(平成24年6月19日現在)	
期首	平成24年4月14日
期首元本額	1,686,382,428円
期首より平成24年6月19日現在までの追加設定元本額	538,617,007円
期首より平成24年6月19日現在までの一部解約元本額	412,535,019円
平成24年6月19日現在における元本の内訳	
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	14,156,149円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	3,317,332円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	574,199円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	424,590円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	475,995円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	119,185円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	252,414円
三井住友・ロシア株式オープン	999,001円
S M A M円高期待ファンド(豪ドル安型)	8,342,304円
S M A M円高期待ファンド(米ドル安型)	5,669,222円
S M A M円高期待ファンド(ユーロ安型)	11,905,188円
アジア高成長国CBファンド	29,767,812円
日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
S M A M・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	236,490,122円
S M A M・バランス先物ファンドV A 2 0<適格機関投資家限定>	676,383,826円
S M A M・F GマネーファンドV A<適格機関投資家限定>	823,190,565円
合計	1,812,464,416円

## 2【ファンドの現況】

原届出書「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」の記載は、下記の通り更新されます。

### 【純資産額計算書】

#### 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010〕

平成24年7月31日現在

資産総額	342,104,621 円
負債総額	783,911 円
純資産総額( - )	341,320,710 円
発行済口数	311,096,351 口
1口当たり純資産額( / )	1.0972 円
( 1万口当たり純資産額	10,972 円)

#### 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020〕

平成24年7月31日現在

資産総額	538,861,779 円
負債総額	1,429,604 円
純資産総額( - )	537,432,175 円
発行済口数	497,804,645 口
1口当たり純資産額( / )	1.0796 円
( 1万口当たり純資産額	10,796 円)

#### 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030〕

平成24年7月31日現在

資産総額	314,418,043 円
負債総額	710,388 円
純資産総額( - )	313,707,655 円
発行済口数	316,325,763 口
1口当たり純資産額( / )	0.9917 円
( 1万口当たり純資産額	9,917 円)

#### 〔三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040〕

平成24年7月31日現在

資産総額	251,342,203 円
負債総額	585,487 円
純資産総額( - )	250,756,716 円
発行済口数	278,890,004 口
1口当たり純資産額( / )	0.8991 円
( 1万口当たり純資産額	8,991 円)

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### <訂正前>

###### イ 資本金の額および株式数

	平成24年1月31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

( 略 )

##### <訂正後>

###### イ 資本金の額および株式数

	平成24年7月31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

( 略 )

## 2【事業の内容及び営業の概況】

### <訂正前>

「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24年1月31日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成24年1月31日現在、単位：百万円）

		本数	純資産総額
株式投資信託	単位型	<u>42</u> ( 2 )	<u>54,123</u> ( 5,170 )
	追加型	<u>303</u> ( 132 )	<u>4,485,907</u> ( 2,950,917 )
	計	<u>345</u> ( 134 )	<u>4,540,030</u> ( 2,956,087 )
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		<u>345</u> ( 134 )	<u>4,540,030</u> ( 2,956,087 )

( ) 内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

### <訂正後>

「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24年7月31日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成24年7月31日現在、単位：百万円）

		本数	純資産総額
株式投資信託	単位型	<u>28</u> ( 1 )	<u>31,601</u> ( 5,180 )
	追加型	<u>317</u> ( 137 )	<u>4,550,786</u> ( 2,982,095 )
	計	<u>345</u> ( 138 )	<u>4,582,387</u> ( 2,987,275 )
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		<u>345</u> ( 138 )	<u>4,582,387</u> ( 2,987,275 )

( ) 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】

原届出書「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」の記載は、下記の通り更新されます。

- 1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、第27期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

		第 26 期 (平成23年3月31日)	第 27 期 (平成24年3月31日)
(資産の部)			
流動資産			
現金及び預金	2	17,127,600	15,970,870
有価証券		3,999,722	3,999,305
前払費用		264,910	259,411
未収入金		607,623	32,426
未収委託者報酬		3,712,698	3,392,765
未収運用受託報酬		326,523	305,910
未収投資助言報酬	2	412,606	452,618
未収収益		27,051	14,092
繰延税金資産		241,975	155,946
その他の流動資産		1,299	9,011
流動資産計		26,722,012	24,592,358
固定資産			
有形固定資産			
有形固定資産	1		
建物		148,698	130,525
器具備品		232,209	201,264
有形固定資産合計		380,907	331,789
無形固定資産			
無形固定資産	1		
ソフトウェア		-	241,251
ソフトウェア仮勘定		-	32,852
電話加入権		138	126
商標権		4,216	2,271
無形固定資産合計		4,354	276,502
投資その他の資産			
投資有価証券		4,980,828	6,720,330
関係会社株式		234,921	234,921
長期差入保証金		681,432	681,196
長期前払費用		10,561	16,958
会員権		20,113	9,480
繰延税金資産		606,449	589,332
投資その他の資産合計		6,534,307	8,252,219
固定資産計		6,919,569	8,860,511
資産合計		33,641,581	33,452,870

	第 26 期 (平成23年 3月31日)	第 27 期 (平成24年 3月31日)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	47,190	47,840
未払金		
未払収益分配金	681	403
未払償還金	21,638	106,771
未払手数料	1,971,626	1,893,658
その他未払金	64,551	86,141
未払費用	824,240	930,998
未払消費税等	126,666	35,683
未払法人税等	1,004,164	264,114
賞与引当金	327,914	279,981
その他の流動負債	-	10
流動負債計	4,388,674	3,645,603
固定負債		
退職給付引当金	1,310,821	1,489,315
固定負債計	1,310,821	1,489,315
負債合計	5,699,496	5,134,919
(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	15,381,398	15,791,435
利益剰余金合計	17,202,602	17,612,639
株主資本計	27,831,586	28,241,623
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	110,498	76,327
評価・換算差額等計	110,498	76,327
純資産合計	27,942,085	28,317,951
負債・純資産合計	33,641,581	33,452,870

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第 26 期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	第 27 期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	27,350,519	25,467,198
運用受託報酬	2,113,027	2,001,039
投資助言報酬	1,828,087	1,743,437
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	35,635	31,647
サービス支援手数料	234,885	99,134
その他	26,930	48,776
営業収益計	31,594,086	29,396,234
営業費用		
支払手数料	14,161,927	13,259,090
広告宣伝費	482,728	475,028
公告費	4,634	4,092
調査費		
調査費	537,254	503,839
委託調査費	2,115,042	2,285,064
営業雑経費		
通信費	34,433	35,155
印刷費	266,803	199,733
協会費	23,235	28,233
諸会費	11,346	12,025
情報機器関連費	2,066,205	1,855,475
販売促進費	27,670	28,021
その他	79,571	123,714
営業費用計	19,810,852	18,809,475
一般管理費		
給料		
役員報酬	155,867	154,738
給料・手当	4,342,937	4,427,312
賞与	983,434	937,970
賞与引当金繰入額	327,914	279,981
交際費	21,460	20,938
寄付金	31	10,026
事務委託費	220,738	245,311
旅費交通費	219,278	230,691
租税公課	87,674	80,136
不動産賃借料	677,468	683,098
退職給付費用	199,545	205,957
固定資産減価償却費	100,356	170,410
諸経費	250,817	268,760
一般管理費計	7,587,526	7,715,334

営業利益		4,195,707	2,871,423
営業外収益			
受取配当金		34,115	29,042
有価証券利息		3,603	3,731
受取利息	1	7,877	5,916
為替差益		4,753	-
時効成立分配金・償還金		3,076	3,563
原稿・講演料		3,485	2,745
還付加算金		1,645	-
雑収入		7,033	5,096
営業外収益計		65,590	50,095
営業外費用			
為替差損		-	15,834
時効成立後支払分配金・償還金		659	-
営業外費用計		659	15,834
経常利益		4,260,638	2,905,684
特別利益			
投資有価証券償還益		7	-
投資有価証券売却益		71,400	13,806
受取和解金		-	108,451
特別利益計		71,407	122,258
特別損失			
固定資産除却損	2	17,318	12,873
投資有価証券償還損		2,679	3,180
投資有価証券評価損		-	301
投資有価証券売却損		20,822	6,578
関係会社株式評価損		1,256	-
ゴルフ会員権評価損		-	10,633
特別損失計		42,077	33,566
税引前当期純利益		4,289,968	2,994,376
法人税、住民税及び事業税		1,852,053	1,195,768
法人税等調整額		93,549	136,130
法人税等合計		1,758,503	1,331,898
当期純利益		2,531,465	1,662,477

## （ 3 ） 【 株主資本等変動計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第 26 期 （ 自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月 31日 ）	第 27 期 （ 自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月 31日 ）
株主資本		
資本金		
当期首残高	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		
当期首残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	60,000	60,000
当期末残高	60,000	60,000
別途積立金		
当期首残高	1,476,959	1,476,959
当期末残高	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金		
当期首残高	14,172,932	15,381,398
当期変動額		
剰余金の配当	1,323,000	1,252,440
当期純利益	2,531,465	1,662,477
当期変動額合計	1,208,465	410,037
当期末残高	15,381,398	15,791,435
利益剰余金合計		
当期首残高	15,994,137	17,202,602
当期変動額		
剰余金の配当	1,323,000	1,252,440
当期純利益	2,531,465	1,662,477
当期変動額合計	1,208,465	410,037
当期末残高	17,202,602	17,612,639
株主資本合計		
当期首残高	26,623,121	27,831,586
当期変動額		
剰余金の配当	1,323,000	1,252,440
当期純利益	2,531,465	1,662,477

当期変動額合計	1,208,465	410,037
当期末残高	27,831,586	28,241,623
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	82,556	110,498
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	27,941	34,170
当期変動額合計	27,941	34,170
当期末残高	110,498	76,327
評価・換算差額合計		
当期首残高	82,556	110,498
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	27,941	34,170
当期変動額合計	27,941	34,170
当期末残高	110,498	76,327
純資産合計		
当期首残高	26,705,677	27,942,085
当期変動額		
剰余金の配当	1,323,000	1,252,440
当期純利益	2,531,465	1,662,477
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	27,941	34,170
当期変動額合計	1,236,407	375,866
当期末残高	27,942,085	28,317,951

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 満期保有目的の債券

償却原価法

#### (2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

#### (3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

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

#### (2) 退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務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。

### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

## 追加情報

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

## 注 記 事 項

## (貸借対照表関係)

第26期 (平成23年3月31日)	第27期 (平成24年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建 物 191,415千円</p> <p>器具備品 774,482千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>電話加入権 95千円</p> <p>商標権 15,226千円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建 物 210,710千円</p> <p>器具備品 624,552千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>ソフトウェア 127,910千円</p> <p>電話加入権 107千円</p> <p>商標権 17,170千円</p>
<p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p>現金及び預金 11,201,422千円</p> <p>未収投資助言報酬 293,061千円</p> <p>未払手数料 469,104千円</p>	<p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p>現金及び預金 10,360,214千円</p> <p>未収投資助言報酬 283,244千円</p> <p>未払手数料 436,830千円</p>
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>当座貸越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p>借入実行残高 - 千円</p> <p>差引額 10,000,000千円</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>当座貸越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p>借入実行残高 - 千円</p> <p>差引額 10,000,000千円</p>
<p>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74,617千円の支払保証を行っております。</p>	<p>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56,653千円の支払保証を行っております。</p>

## (損益計算書関係)

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
<p>1 関係会社との取引に係るもの</p> <p>受取利息 3,867千円</p>	<p>1 関係会社との取引に係るもの</p> <p>受取利息 2,455千円</p>
<p>2 固定資産除却損は、建物9,847千円、器具備品7,471千円であります。</p>	<p>2 固定資産除却損は、器具備品12,873千円でありませす。</p>

(株主資本等変動計算書関係)

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

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

## (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23年6月24日開催の第26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23年6月24日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,252,440	71,000	平成23年 3月31日	平成23年 6月27日

第27期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成23年6月24日 定時株主総会	普通株式	1,252,440	71,000	平成23年 3月31日	平成23年 6月27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24年6月25日開催の第27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24年6月25日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	829,080	47,000	平成24年 3月31日	平成24年 6月26日

## (リース取引関係)

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31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)(単位:千円) 1年以内           672,700 1年超             958,593 合計               1,631,293	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           672,641 1年超             286,301 合計               958,942

## (金融商品関係)

## 1.金融商品の状況に関する事項

## (1)金融商品に対する取組方針

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

## (2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

## 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。

## 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

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

平成23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	17,127,600	17,127,600	-
(2)未収委託者報酬	3,712,698	3,712,698	-
(3)未収運用受託報酬	326,523	326,523	-
(4)未収投資助言報酬	412,606	412,606	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	3,999,722	3,999,600	122
その他有価証券	4,932,087	4,932,087	-
(6)長期差入保証金	681,432	681,432	-
資産計	31,192,671	31,192,549	122
(1)未払金			
未払手数料	1,971,626	1,971,626	-
負債計	1,971,626	1,971,626	-

(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

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	234,921
合計	234,921

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) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式については、市場価格がなく、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。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、1,256千円です。

(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	17,127,600	-	-	-
未収委託者報酬	3,712,698	-	-	-
未収運用受託報酬	326,523	-	-	-
未収投資助言報酬	412,606	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	4,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち				
満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	13,841	667,590	-	-
合計	25,593,271	667,590	-	-

第27期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

平成24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	15,970,870	15,970,870	-
(2)未収委託者報酬	3,392,765	3,392,765	-
(3)未収運用受託報酬	305,910	305,910	-
(4)未収投資助言報酬	452,618	452,618	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	3,999,305	3,999,200	105
その他有価証券	6,671,589	6,671,589	-
(6)長期差入保証金	681,196	681,196	-
資産計	31,474,256	31,474,150	105
(1)未払金			
未払手数料	1,893,658	1,893,658	-
負債計	1,893,658	1,893,658	-

(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

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	234,921
合計	234,921

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) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式については、市場価格がなく、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	15,970,870	-	-	-
未収委託者報酬	3,392,765	-	-	-
未収運用受託報酬	305,910	-	-	-
未収投資助言報酬	452,618	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	4,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち				
満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	13,877	667,318	-	-
合計	24,136,043	667,318	-	-

(有価証券関係)

第26期(平成23年3月31日)

## 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	3,999,722	3,999,600	122
小計	3,999,722	3,999,600	122
合計	3,999,722	3,999,600	122

## 2. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式234,921千円）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。また、上記「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、1,256千円です。

## 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	3,047,395	2,801,036	246,358
小計	3,047,395	2,801,036	246,358
(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	1,884,692	1,950,168	65,476
小計	1,884,692	1,950,168	65,476
合計	4,932,087	4,751,205	180,882

(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
4,845,387	71,400	20,822

第27期(平成24年3月31日)

## 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	3,999,305	3,999,200	105
小計	3,999,305	3,999,200	105
合計	3,999,305	3,999,200	105

## 2.子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式234,921千円）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	4,635,097	4,387,713	247,384
小計	4,635,097	4,387,713	247,384
(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	2,036,491	2,170,148	133,657
小計	2,036,491	2,170,148	133,657
合計	6,671,589	6,557,862	113,727

(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。また、上記「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、301千円です。

## 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
1,012,727	13,806	6,578

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(退職給付関係)

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)																				
<p>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。</p>	<p>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。</p>																				
<p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,310,821</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,310,821</td> </tr> </table>	退職給付債務	1,310,821	退職給付引当金	1,310,821	<p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,489,315</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,489,315</td> </tr> </table>	退職給付債務	1,489,315	退職給付引当金	1,489,315												
退職給付債務	1,310,821																				
退職給付引当金	1,310,821																				
退職給付債務	1,489,315																				
退職給付引当金	1,489,315																				
<p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">160,751</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">17,066</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">6,439</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">15,287</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">199,545</td> </tr> </table> <p>(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。</p>	勤務費用	160,751	利息費用	17,066	数理計算上の差異の費用処理額	6,439	その他	15,287	退職給付費用	199,545	<p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">167,222</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">19,662</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">5,053</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">14,018</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">205,957</td> </tr> </table> <p>(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。</p>	勤務費用	167,222	利息費用	19,662	数理計算上の差異の費用処理額	5,053	その他	14,018	退職給付費用	205,957
勤務費用	160,751																				
利息費用	17,066																				
数理計算上の差異の費用処理額	6,439																				
その他	15,287																				
退職給付費用	199,545																				
勤務費用	167,222																				
利息費用	19,662																				
数理計算上の差異の費用処理額	5,053																				
その他	14,018																				
退職給付費用	205,957																				
<p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <p>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</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">割引率</td> <td style="text-align: right;">1.5%</td> </tr> </table> <p>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）</p> <p>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）</p>	割引率	1.5%	<p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <p>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</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">割引率</td> <td style="text-align: right;">1.5%</td> </tr> </table> <p>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）</p> <p>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）</p>	割引率	1.5%																
割引率	1.5%																				
割引率	1.5%																				

(税効果会計関係)

第26期 (平成23年3月31日)	第27期 (平成24年3月31日)
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	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)	(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	賞与引当金
133,428	106,421
未払社会保険料	未払社会保険料
14,807	12,691
未払事業税	未払事業税
83,126	27,381
未払事業所税	未払事業所税
6,378	5,808
その他	その他
4,235	3,644
繰延税金資産計	繰延税金資産計
241,975	155,946
評価性引当額	評価性引当額
-	-
繰延税金資産合計	繰延税金資産合計
241,975	155,946
繰延税金資産の純額	繰延税金資産の純額
241,975	155,946
(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	退職給付引当金
533,373	530,792
ソフトウェア償却	ソフトウェア償却
141,119	95,129
投資有価証券評価損	投資有価証券評価損
71,023	61,204
特定外国子会社留保金額	特定外国子会社留保金額
247,489	222,604
その他	その他
4,925	7,328
繰延税金資産計	繰延税金資産計
997,931	917,059
評価性引当額	評価性引当額
321,097	290,326
繰延税金資産合計	繰延税金資産合計
676,833	626,732
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金	その他有価証券評価差額金
70,383	37,399
繰延税金負債合計	繰延税金負債合計
70,383	37,399
繰延税金資産の純額	繰延税金資産の純額
606,449	589,332
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
	(%)
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、記載を省略しております。	法定実効税率
	40.6
	(調整)
	評価性引当額の増減
	1.0
	交際費等永久に損金に算入されない項目
	0.3
	住民税均等割等
	0.2
	外国税額控除
	0.5
	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正
	4.5
	その他
	0.2
	税効果会計適用後の法人税等の負担率
	44.4

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の修正

平成23年12月2日に「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」(平成23年法律第114号)及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」(平成23年法律第117号)が公布され、平成24年4月1日以降開始する事業年度より法人税率が変更されることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用される法定実効税率は、前事業年度の40.6%から、一時差異等に係る解消時期に応じて以下のとおりとなります。

平成24年4月1日から平成27年3月31日 38.0%

平成27年4月1日以降 35.6%

この税率の変更により繰延税金資産の純額が88,362千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が93,662千円、その他有価証券評価差額金が5,299千円、それぞれ増加しております。

(資産除去債務関係)

該当事項はありません。

## (セグメント情報等)

第26期（自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日）

## 1.セグメント情報

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

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

## 2.関連情報

## (1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	27,350,519	2,113,027	1,828,087	302,451	31,594,086

## (2)地域ごとの情報

## 売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が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。

## 有形固定資産

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

## (3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、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。

第27期(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

## 1.セグメント情報

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

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

## 2.関連情報

## (1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	25,467,198	2,001,039	1,743,437	184,558	29,396,234

## (2)地域ごとの情報

## 売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が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。

## 有形固定資産

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

## (3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、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。

## (関連当事者情報)

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23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	210,000,000	生命保険業	(被所有)% 直接 40	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,130,782	未収投資助言報酬	293,061
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	4,558,604	未払手数料	374,320

(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	日興コーポリアル証券(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	2,174,385	未払手数料	110,182

(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。

第27期(自平成23年4月1日至平成24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	220,000,000	生命保険業	(被所有) % 直接 40	当社の 主要顧客	投資助言 報酬	1,082,284	未収投資 助言報酬	283,244
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	4,294,733	未払手数料	345,061

(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	S M B C 日興証券(株)	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の 販売委託	委託販売 手数料	1,765,986	未払手数料	264,970

(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26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1株当たり純資産額 1,584,018円42銭 1株当たり当期純利益 143,507円12銭	1株当たり純資産額 1,605,326円06銭 1株当たり当期純利益 94,244円73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。	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 27,942,085千円 普通株式に係る純資産額 27,942,085千円 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 28,317,951千円 普通株式に係る純資産額 28,317,951千円 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 2,531,465千円 普通株式に係る当期純利益 2,531,465千円 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 1,662,477千円 普通株式に係る当期純利益 1,662,477千円 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)

該当事項はありません。

## 5【その他】

### <訂正前>

イ 定款の変更、その他の重要事項

平成23年6月24日に開催された定時株主総会において、監査体制の見直しにより監査役の員数を1名減員し、4名以内とする定款の変更が決議されました。

（略）

### <訂正後>

イ 定款の変更、その他の重要事項

該当ありません。

（略）

## 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】

#### <訂正前>

イ 受託会社

(イ) 名称 中央三井アセット信託銀行株式会社

(ロ) 資本金の額 11,000百万円(平成23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。

関係当局の認可等を前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および住友信託銀行株式会社と合併し、新商号を三井住友信託銀行株式会社とする予定です。

#### 【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23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 株式会社三井住友銀行

(ロ) 資本金の額 1,770,996百万円(平成23年9月末現在)

(ハ) 事業の内容 銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

#### <訂正後>

イ 受託会社

(イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社

(ロ) 資本金の額 342,037百万円(平成24年4月1日現在)

(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24年3月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

(イ) 名称 株式会社三井住友銀行

(ロ) 資本金の額 1,770,996百万円(平成24年3月末現在)

(ハ) 事業の内容 銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成24年8月10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・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010の平成23年12月21日から平成24年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010の平成24年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年12月21日から平成24年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

三井住友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、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

---

## 独立監査人の中間監査報告書

平成24年8月10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

公認会計士 鈴木 敏夫 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020の平成23年12月21日から平成24年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020の平成24年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年12月21日から平成24年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

三井住友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、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．中間財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

---

## 独立監査人の中間監査報告書

平成24年8月10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・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030の平成23年12月21日から平成24年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030の平成24年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年12月21日から平成24年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

三井住友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、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．中間財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

---

## 独立監査人の中間監査報告書

平成24年8月10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・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040の平成23年12月21日から平成24年6月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040の平成24年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年12月21日から平成24年6月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

三井住友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、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．中間財務諸表の範囲にはXBR L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24年 6月15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23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成24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。

### 利害関係

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

以上

---

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。