

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年9月21日提出
【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 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土田 雅央
【電話番号】	03-5405-0740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	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
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	継続募集額(平成28年3月18日から平成29年3月16日まで) 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010 1兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020 1兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030 1兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040 1兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成28年 3月17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(以下「原届出書」といいます。)について、平成28年 9月21日に半期報告書を提出したことに伴う関係情報の更新、ファンド情報の更新等を行うため、本訂正届出書により訂正を行うものです。

## 2【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、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。また、原届出書の「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。)の記載事項が追加されます。

## 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】

#### (3)【ファンドの仕組み】

<更新後>

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

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

(ロ) 受託会社 「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。

(ハ) 販売会社

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

#### 運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（平成28年 7月29日現在）

(ロ) 会社の沿革

昭和60年 7月15日	三生投資顧問株式会社設立
昭和62年 2月20日	証券投資顧問業の登録
昭和62年 6月10日	投資一任契約にかかる業務の認可
平成11年 1月 1日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
平成11年 2月 5日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
平成12年 1月27日	証券投資信託委託業の認可取得

平成14年12月1日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更

平成25年4月1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併

#### (八) 大株主の状況

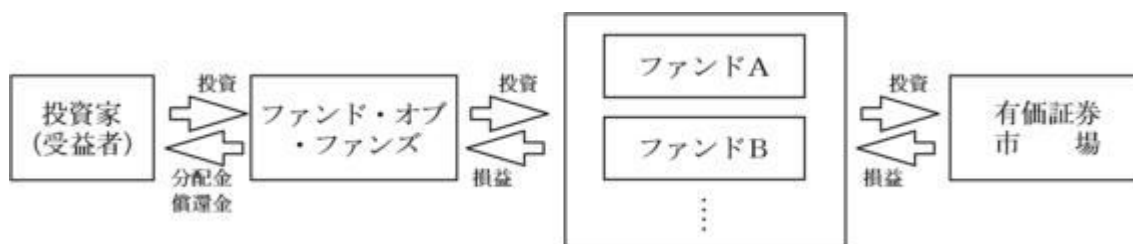
(平成28年7月29日現在)

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
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	10,584	60.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528	20.0
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	3,528	20.0

#### ハ ファンドの運用形態(ファンド・オブ・ファンズによる運用)

一般に、「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券などの有価証券に直接投資するのではなく、複数の他の投資信託(ファンド)を組み入れることにより運用を行います(投資信託に投資する投資信託)。また、種々の特長を持った投資信託を購入することにより、効率的に資産配分を行います。

#### 〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



## 2 【投資方針】

### (1) 【投資方針】

<更新後>

#### イ 基本方針

各ファンドのターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長を目指して運用を行います。ターゲット・イヤー到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。

#### ロ 投資態度

(イ) 投資信託への投資を通じて、国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います(グローバル・バランス型ファンド)。

(ロ) 投資資産配分(基本アロケーション)は、国内外の経済・金融市場動向見通し等の分析を基に、各資産クラスの期待収益率等を予測した結果、ターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長に最適と考えられる比率とし、原則として1年(計算期間)毎に見直します。

各ファンドのターゲット・イヤーに近づくにつれ、安定資産等の比率を引き上げていきます。概ね、ターゲット・イヤーまでの期間が長いほど、リターン(収益)の高い運用を目指しますが、それに伴いリスク(損益の変動幅)が大きくなる傾向があります。

ターゲット・イヤー到達後の安定運用期間においても国内債券および短期金融資産の他、国内外の株式および外国債券への配分が予定されています。

(ハ) 期中の基本アロケーションとの乖離については、原則として四半期毎に見直し、必要に応じて

リバランスを実施します。

(二) 主要投資対象とする投資信託は、下記の通りとします。ただし、運用状況等により変更となる場合があります。

a. 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）

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	国内株式
運用の基本方針	T O P I X（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

b. 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＞

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	国内債券
運用の基本方針	N O M U R A - B P I（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

c. 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）

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	外国株式
運用の基本方針	M S C I コクサイインデックス（配当込み、円ベース）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

d. 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＞

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	外国債券
運用の基本方針	シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目指した運用を行います。

e. S M A M・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	円貨建の短期公社債および短期金融商品
運用の基本方針	安定した収益の確保を目指します。

上記ファンドの詳細に関しましては、後述の〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕をご覧ください。

## ★ ファンドの特色

1

他の投資信託への投資を通じて、国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います（グローバル・バランス型ファンド）。

2

各ファンドのターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長を目指して運用を行います。ターゲット・イヤー到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。

3

ファンド・オブ・ファンズという形態で運用されます。

□ 「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券などの有価証券に直接投資するのではなく、複数の他の投資信託（ファンド）を組み入れることにより運用を行います（投資信託に投資する投資信託）。

種々の特徴を持った投資信託を購入することにより、効率的に資産配分を行います。

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

## ファンドのしくみ

■ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



## 各ファンドのターゲット・イヤー

<2010> …… 西暦2010年、 <2020> …… 西暦2020年

<2030> …… 西暦2030年、 <2040> …… 西暦2040年

■投資資産配分 (基本アロケーション) は、国内外の経済・金融市場動向見通し等の分析を基に、各資産クラスの期待収益率等を予測した結果、ターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長に最適と考えられる比率とし、原則として1年 (計算期間) 毎に見直します。

- ・各ファンドのターゲット・イヤーに近づくにつれ、安定資産等の比率を引き上げていきます。概ね、ターゲット・イヤーまでの期間が長いほど、リターン (収益) の高い運用を目指しますが、それに伴いリスク (損益の変動幅) が大きくなる傾向があります。
- ・ターゲット・イヤー到達後の安定運用期間においても国内債券および短期金融資産の他、国内外の株式および外国債券への配分が予定されています。

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



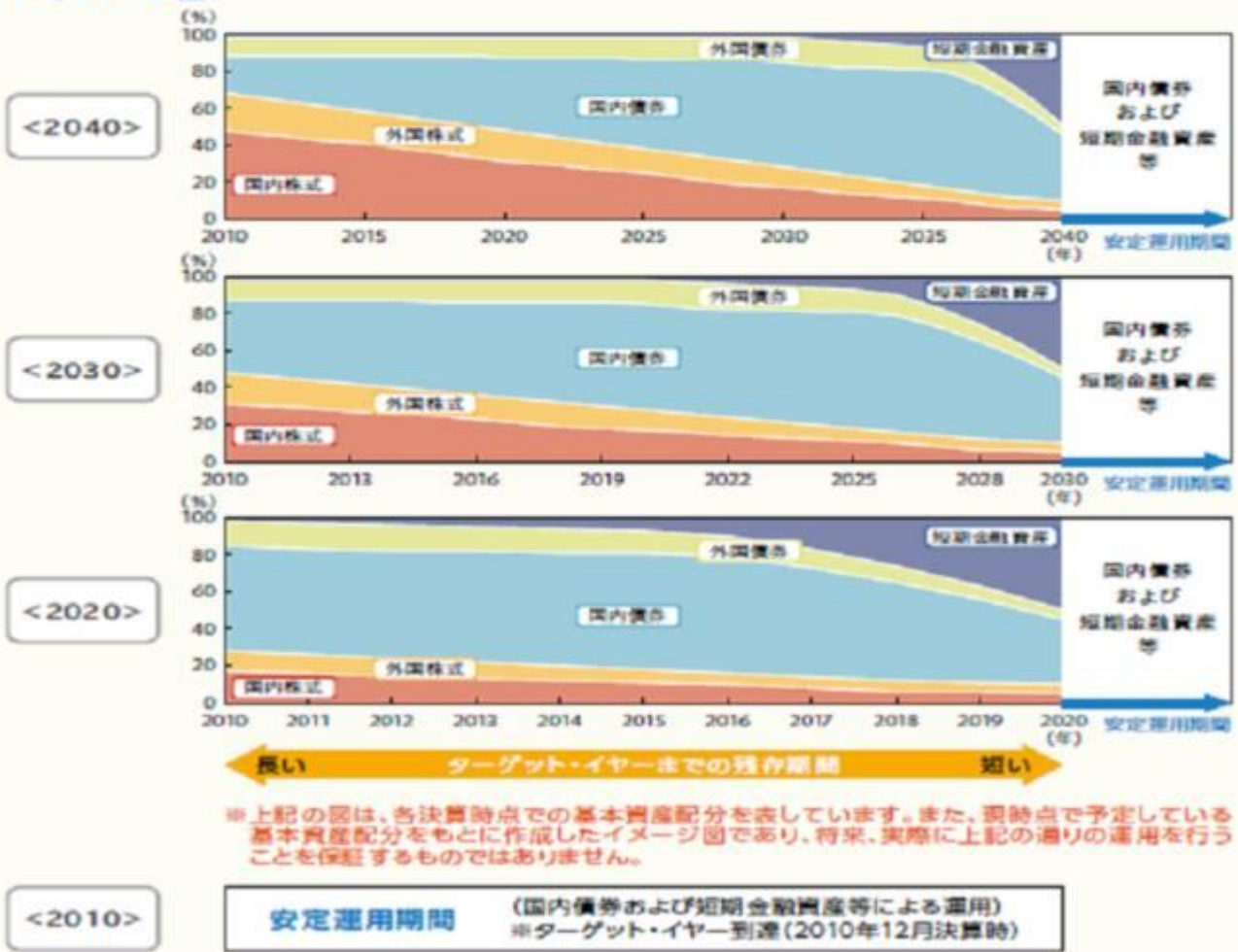
## 基本的な投資資産配分

### ▶基本アロケーション

■2016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。

	<2040>	<2030>	<2020>	<2010> 安定運用期間
国内株式	41%	25%	11%	5%
外国株式	17%	13%	7%	5%
国内債券	30%	48%	63%	35%
外国債券	10%	12%	12%	5%
短期金融資産	2%	2%	7%	50%

### ▶イメージ図



## ★ 追加的記載事項

### ■投資対象とする投資信託の運用プロセス

#### ▶ SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

- 主としてわが国の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数、配当込み)と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、東証1部銘柄の中から、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、マルチファクターモデルを活用した最適化法\*1により、推定トラッキングエラーの低減のみならず制約条件を加えることで、実績トラッキングエラーを抑えることを目指してポートフォリオを構築します。
- TOPIX(東証株価指数、配当込み)との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

#### ▶ SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>

- わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA-BPI(総合)と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、層化抽出法\*2により、マルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを併用して、ファンド規模に応じデュレーション、満期構成、セクター(債券種別)配分、事業債の格付け構成および業種を可能な限りNOMURA-BPI(総合)に近づけたポートフォリオを構築します。なお事業債の銘柄選択については、委託会社クレジットアナリストの調査結果に基づき、将来的に格下げによりベンチマークから外れる可能性が高い銘柄については、組入対象から除外することがあります。
- NOMURA-BPI(総合)との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

#### ▶ SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

- 主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、マルチファクターモデルを活用した最適化法により推定トラッキングエラーの低減のみならず、制約条件を加えることで実績トラッキングエラーを抑えることを目指してポートフォリオを構築します。
- MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。



#### \*1 最適化法とは

計量モデル等に基づいて、インデックスとの連動性を保てるように一部の銘柄を抽出してポートフォリオを構築する方法です。信用不安が懸念される銘柄を排除することや少額でもポートフォリオを構築することができるメリットがあります。

#### \*2 層化抽出法とは

指数を構成する銘柄をいくつかのグループ(層)に分け、それぞれのグループから代表銘柄を抽出してファンドを構築する方法です。指数を構成するすべての銘柄を保有する完全法に比べて、少ない銘柄数でポートフォリオを構築することができるため、銘柄入れ替えに伴う取引コストの抑制や、低流動性銘柄の組入れを避けることができるというメリットがあり、債券パッシブ運用に適しています。



### ▶ SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>

- 主として日本を除く世界各国の債券に投資し、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目指した運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、層化抽出法により、マルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを併用して、通貨配分、国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限りベンチマークに近づけたポートフォリオを構築します。
- ベンチマークとの連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

### ▶ SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>

- 主として円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行います。

※実際の運用は、各投資信託がそれぞれ投資対象とするマザーファンドで行います。

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

## (5) 【投資制限】

### <更新後>

ファンドの信託約款に基づく投資制限

- イ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- ロ 投資信託証券への投資を除いては、CP、預金、指定金銭信託、コール・ローンおよび手形割引市場において売買される手形以外には投資を行いません。
- ハ 外貨建資産への直接投資は行いません。
- ニ 資金の借入れ
  - (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
  - (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
  - (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (二) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

法令に基づく投資制限

- イ 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

- デリバティブ取引にかかる投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

〔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)〕

(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  
□ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

(2) 投資方針等

イ 基本方針

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)(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主としてわが国の株式に投資し、T O P I X(東証株価指数、配当込み)と連動する投資成果を目指して運用を行います。

□ 投資態度

- (イ) 主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、T O P I X(東証株価指数、配当込み)と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ハ) 株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

マザーファンドにおいては、主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、T O P I X(東証株価指数、配当込み)と連動する投資成果を目指して運用を行います。

東証株価指数(T O P I X)は、東京証券取引所の知的財産で、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、T O P I Xの算出もしくは公表の方法の変更、T O P I Xの算出もしくは公表の停止またはT O P I Xの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、東京証券取引所は「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)」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

八 主な投資制限

- (イ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ロ) 株式への実質投資割合には制限を設けません。

(3) その他

- イ 信託報酬 このファンドの信託財産の純資産総額に年0.081%（税抜き0.075%）を乗じて得た額
- ロ 手数料 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。
- ハ 信託財産留保額 取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の翌営業日の基準価額に対して0.08%
- ニ 決算日 毎年1回（原則として11月30日）

〔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

(2) 投資方針等

イ 基本方針

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（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、NOMURA - BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) 主としてマザーファンド受益証券およびわが国の公社債に投資を行い、NOMURA - BPI（総合）に連動する投資成果を目指します。
- (ロ) マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、ファンド設定当初や解約・償還への対応などの事情により変更することもあります。
- (ハ) 運用の効率化を図るため、有価証券先物取引等を利用することもあります。

マザーファンドにおいては、主としてわが国の公社債および短期金融資産に投資し、安定した利子等収益および売買益の確保を目指すとともに、NOMURA - BPI（総合）の動きに連動する投資成果を目指します。

NOMURA - BPI（総合）は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村証券株式会社およびその許諾者は、NOMURA - BPI（総合）を用いて行われる三井住友アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。また、野村証券株式会社およびその許諾者は「SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

ハ 主な投資制限

- (イ) マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- (ロ) 株式への投資は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使による取得に限るものとし、かつ、その投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (ハ) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (ニ) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (ホ) 外貨建資産への投資は行いません。

(3) その他

- イ 信託報酬 このファンドの信託財産の純資産総額に年0.054%（税抜き0.05%）を乗じて得た額
- ロ 手数料 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。

- 八 信託財産留保額 取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の基準価額に対して0.03%
- 二 決算日 毎年1回(原則として6月20日)

## 〔S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)〕

## (1) 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

## イ 基本方針

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(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界各国の株式に投資し、M S C I コクサイインデックス(配当込み、円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。

## ロ 投資態度

- (イ) 主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、世界各国の株式に投資し、M S C I コクサイインデックス(配当込み、円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行わないものとします。
- (ハ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

マザーファンドにおいては、主として日本を除く世界各国の株式に投資し、M S C I コクサイインデックス(配当込み、円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。

M S C I コクサイインデックス(配当込み、円ベース)はM S C I インクの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、M S C I インクが有しています。また、M S C I インクは「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)」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

## 八 主な投資制限

- (イ) 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- (ロ) 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

## (3) その他

- イ 信託報酬 このファンドの信託財産の純資産総額に年0.081%(税抜き0.075%)を乗じて得た額
- ロ 手数料 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。
- 八 信託財産留保額 取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の翌営業日の基準価額に対して0.15%
- 二 決算日 毎年1回(原則として11月30日)

## 〔S M A M・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

## イ 基本方針

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(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目指した運用を行います。

#### ロ 投資態度

マザーファンド受益証券への投資を通じて、あるいは、直接、ベンチマーク採用国の国債等に投資することにより実質的に以下の運用を行います。

- (イ) シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指します。
- (ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。
- (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- (ニ) 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。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

マザーファンドにおいては、シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指した運用を行います。

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)はCitigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。

Citigroup Index LLCは「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>」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

#### ハ 主な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ロ) 投資信託証券(マザーファンド受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ハ) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- (ニ) 同一発行体の発行する債券への実質投資割合は、国債を除き、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ホ) 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ヘ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ト) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

#### (3) その他

- イ 信託報酬 このファンドの信託財産の純資産総額に年0.0648%(税抜き0.06%)を乗じて得た額
- ロ 手数料 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。
- ハ 信託財産留保額 取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の翌営業日の基準価額に対して0.1%
- ニ 決算日 毎年1回(原則として12月17日)

[ S M A M・マネーインカムファンド<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

## (2) 投資方針等

## イ 基本方針

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（以下「マザーファンド」といいます。）を主要投資対象とし、安定した収益の確保を目指して運用を行います。また、市況動向によっては、円貨建の短期公社債および短期金融商品に直接投資を行うことがあります。

## ロ 投資態度

主として、マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。

(イ) 主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

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

マザーファンドにおいては、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指して運用を行います。

## ハ 主な投資制限

(イ) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

(ロ) 投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(ハ) 外貨建資産への投資は行いません。

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

## (3) その他

## イ 信託報酬

このファンドの信託財産の純資産総額に以下の率（信託報酬率）を乗じて得た額。なお、信託報酬率は月次で見直すものとし、各月の最終営業日の翌日から翌月の最終営業日までの信託報酬率は、当該各月の最終5営業日における無担保コール翌日物レート（年率）の平均値（当該平均率）に応じ、次に掲げる率とします。

当該平均率の水準	信託報酬率
当該平均値が0.25%未満の場合	当該平均値に0.4を乗じた率 (下限は0%)
当該平均値が0.25%以上0.50%未満の場合	年0.1%
当該平均値が0.50%以上1.00%未満の場合	年0.14%
当該平均値が1.00%以上の場合	年0.18%

(注) 上記信託報酬率は税抜き

## ロ 手数料

取得申込時および換金時には手数料はかかりません。

## ハ 信託財産留保額

解約請求受付日の基準価額に対して0.01%

## ニ 決算日

毎年1回（原則として4月13日）

## ホ ベンチマーク

ありません。

## 3【投資リスク】

## &lt;更新後&gt;

## イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、投資信託を組み入れることにより運用を行います。当ファンドが組み入れる投資信託は、主として内外の株式や債券を投資対象としており、その価格は、保有する株式や債券の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下します。当ファンドが組み入れる投資信託の価格の変動により、当ファンドの基準価額も上下します。基準

価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

運用の結果としてファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入していません。

当ファンドが有するリスク等（他の投資信託の組入れを通じた実質的なリスク等となります。）のうち主要なものは、以下の通りです。

（イ）株式市場リスク

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

（ロ）債券市場リスク

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

（ハ）信用リスク

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

（ニ）為替変動リスク

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

（ホ）カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

（ヘ）市場流動性リスク

ファンドの資金流出入に伴い、有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ト）換金制限等に関する留意点

投資資産の市場流動性が低下することにより投資資産の取引等が困難となった場合は、ファンドの換金申込みの受け付けを中止すること、および既に受け付けた換金申込みを取り消すことがあります。

（チ）収益分配金に関する留意事項

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



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

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

#### ロ 投資リスクの管理体制

リスク管理の実効性を高め、また、コンプライアンスの徹底を図るために、運用部門から独立した組織（リスク管理部および法務コンプライアンス部）を設置し、ファンドの投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる確認等を行っています。リスク管理部では、主に投資信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングを行います。また、法務コンプライアンス部では、主に法令・諸規則等の遵守状況についての確認等を行います。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価委員会、リスク管理委員会およびコンプライアンス委員会への報告が義務づけられています。

（参考情報）投資リスクの定量的比較



## ▶&lt;2010&gt;

「ファンドの年間騰落率および  
分配金再投資基準価額の推移」



「ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較」



## ▶&lt;2020&gt;

「ファンドの年間騰落率および  
分配金再投資基準価額の推移」



「ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較」



※左グラフは2011年8月～2016年7月の各月末におけるファンドの直近1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。右グラフは同期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

※ファンドの分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額とは異なります。分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金再投資基準価額をもとに計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※右グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものであり、すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## ▶&lt;2030&gt;

〔 ファンドの年間騰落率および  
分配金再投資基準価額の推移 〕〔 ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較 〕

※左グラフは2011年8月～2016年7月の各月末におけるファンドの直近1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。右グラフは同期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

※ファンドの分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額とは異なります。分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金再投資基準価額をもとに計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※右グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものであり、すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## &lt;各資産クラスの指数&gt;

日本株→TOPIX(該当済み)

先進国株→MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース)

新興国株→MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース)

日本国債→NOMURA-BPI(国債)

先進国債→シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債→JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしております。

〔TOPIX(該当済み)〕は、株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象としています。

〔MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース)〕は、MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。

〔MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース)〕は、MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。

〔NOMURA-BPI(国債)〕は、野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。

〔シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)〕は、Citigroup Index LLCが開発した指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。

〔JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース)〕は、J.P. Morganが開出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。



## ▶&lt;2040&gt;

〔 ファンドの年間騰落率および  
分配金再投資基準価額の推移 〕〔 ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較 〕

※左グラフは2011年8月～2016年7月の各月末におけるファンドの直近1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。右グラフは同期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

※ファンドの分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額とは異なります。分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金再投資基準価額をもとに計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※右グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものであり、すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## &lt;各資産クラスの指数&gt;

日本株→TOPIX(該当済み)

先進国株→MSCIロクサイインデックス(グロス配当済み、円ベース)

新興国株→MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当済み、円ベース)

日本国債→NOMURA-BPI(国債)

先進国債→シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債→JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしております。

〔TOPIX(該当済み)〕は、株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象としています。

〔MSCIロクサイインデックス(グロス配当済み、円ベース)〕は、MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。

〔MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当済み、円ベース)〕は、MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。

〔NOMURA-BPI(国債)〕は、野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。

〔シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)〕は、Citigroup Index LLCが開発した指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。

〔JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース)〕は、J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※上記各指数に関する知的財産その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

## 4【手数料等及び税金】

## (3)【信託報酬等】

## &lt; 更新後 &gt;

純資産総額に年0.5292%（税抜き0.49%）の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。なお、各ファンドのターゲット・イヤーに属する決算日の翌日以降年0.432%（税抜き0.4%）となります。

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

## &lt; 信託報酬の配分（税抜き） &gt;

	委託会社	販売会社	受託会社
ターゲットイヤーの 決算日まで	年0.15%	年0.3%	年0.04%
ターゲットイヤーの 決算翌日以降	年0.06%		

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

支払先	役務の内容
委託会社	ファンド運用の指図等の対価
販売会社	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	ファンド財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

投資対象とする投資信託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28年7月末現在）に従った場合、以下の通りとなります。なお、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、信託報酬が変動するため、その上限額である年0.18%（税抜き）で計算しております。

< 2 0 1 0 >	年0.55944%（税抜き0.518%）程度
< 2 0 2 0 >	年0.599184%（税抜き0.5548%）程度
< 2 0 3 0 >	年0.597564%（税抜き0.5533%）程度
< 2 0 4 0 >	年0.602748%（税抜き0.5581%）程度

## （５）【課税上の取扱い】

## &lt; 更新後 &gt;

## イ 個別元本について

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



照。)

□ 一部解約時および償還時の課税について

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

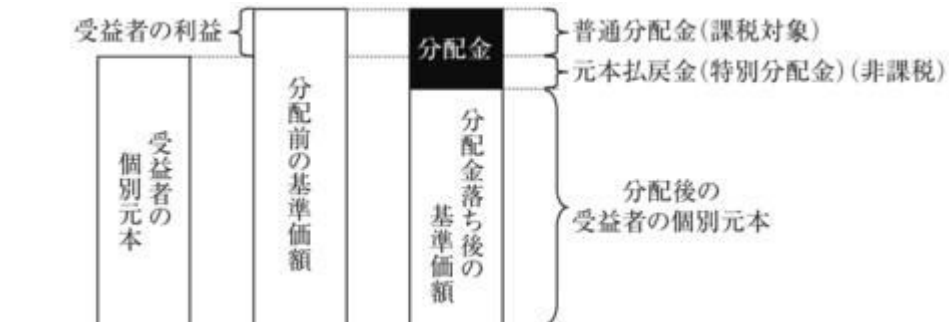
八 収益分配金の課税について

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。

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・ 収益分配時

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

・ 一部解約時および償還時

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

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および利子等、他の上場株式等にかかる譲渡益および配当等との通算が可能です。

(ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAでの取扱い対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、当ファンドは、配当控除の適用はありません。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で、新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。NISA、ジュニアNISAのご利用には、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への直接投資は行いません。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成28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】

<更新後>

### (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28年 7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	日本	537,772,810	99.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,796,411	0.33
合計(純資産総額)		539,569,221	100.00

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

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28年 7月29日現在

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

投資信託受益証券	日本	1,281,085,675	99.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,500,639	0.35
合計(純資産総額)		1,285,586,314	100.00

## 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28年 7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	日本	1,231,451,100	99.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,045,928	0.25
合計(純資産総額)		1,234,497,028	100.00

## 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28年 7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	日本	1,831,214,896	99.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		14,338,057	0.78
合計(純資産総額)		1,845,552,953	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

## イ 主要投資銘柄

平成28年 7月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資信託受益証券	SMAM・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	268,026,098	1.0087	270,383,387	1.0088	270,384,727	50.11
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金国内債券バッシブ ファンド<適格機関投資家限定>	143,124,279	1.2484	178,681,195	1.3225	189,281,858	35.08
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金外国債券バッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	16,162,942	1.7613	28,469,098	1.6239	26,247,001	4.86
日本	投資信託受益証券	SMAM・外国株式バッシブ・ファ ンド(適格機関投資家専用)	13,273,364	2.0871	27,703,660	1.9696	26,143,217	4.85
日本	投資信託受益証券	SMAM・国内株式バッシブ・ファ ンド(適格機関投資家専用)	20,322,434	1.4123	28,702,247	1.2654	25,716,007	4.77

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

平成28年 7月29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

## イ 主要投資銘柄

平成28年 7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	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>	611,916,937	1.2492	764,410,873	1.3225	809,260,149	62.95
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>	93,599,506	1.7675	165,442,613	1.6239	151,996,237	11.82
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）	111,880,927	1.4269	159,645,803	1.2654	141,574,125	11.01
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）	45,386,483	2.1167	96,072,654	1.9696	89,393,216	6.95
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>	88,086,785	1.0087	88,860,853	1.0088	88,861,948	6.91

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

平成28年 7月29日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.65
合計	99.65

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

## イ 主要投資銘柄

平成28年 7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	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>	448,512,219	1.2496	560,502,075	1.3225	593,157,409	48.05
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）	244,724,377	1.4383	352,001,265	1.2654	309,674,226	25.09
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）	81,600,718	2.1236	173,293,530	1.9696	160,720,774	13.02
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>	88,935,168	1.7682	157,260,850	1.6239	144,421,819	11.70
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>	23,272,078	1.0087	23,476,812	1.0088	23,476,872	1.90

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

平成28年 7月29日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.75
合計	99.75

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

##### イ 主要投資銘柄

平成28年 7月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	投資信託受益証券	SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	596,760,517	1.4371	857,639,609	1.2654	755,140,758	40.92
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金国内債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	416,373,760	1.2527	521,610,088	1.3225	550,654,297	29.84
日本	投資信託受益証券	SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	157,920,912	2.1219	335,098,631	1.9696	311,041,028	16.85
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	110,291,922	1.7715	195,390,376	1.6239	179,103,052	9.70
日本	投資信託受益証券	SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	34,968,043	1.0087	35,275,724	1.0088	35,275,761	1.91

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

平成28年 7月29日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.22
合計	99.22

#### 【投資不動産物件】

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

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

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



該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

該当事項はありません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

該当事項はありません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

該当事項はありません。

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

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)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第6期 (平成18年12月20日)	160,590,675	160,590,675	11,048	11,048
第7期 (平成19年12月20日)	217,158,042	217,158,042	11,245	11,245
第8期 (平成20年12月22日)	238,566,878	238,566,878	10,578	10,578
第9期 (平成21年12月21日)	301,495,735	301,495,735	10,921	10,921
第10期 (平成22年12月20日)	324,751,925	324,751,925	10,941	10,941
第11期 (平成23年12月20日)	329,392,588	329,392,588	10,818	10,818
第12期 (平成24年12月20日)	348,417,250	348,417,250	11,198	11,198
第13期 (平成25年12月20日)	406,358,497	406,358,497	11,884	11,884
第14期 (平成26年12月22日)	490,170,412	490,170,412	12,303	12,303
第15期 (平成27年12月21日)	524,035,669	524,035,669	12,346	12,346
平成27年 7月末日	499,892,449		12,405	
8月末日	500,892,786		12,317	
9月末日	504,017,056		12,221	

10月末日	517,956,844		12,362
11月末日	522,800,588		12,380
12月末日	525,325,174		12,360
平成28年 1月末日	523,808,414		12,269
2月末日	530,231,409		12,283
3月末日	535,844,009		12,399
4月末日	536,393,481		12,397
5月末日	535,669,085		12,420
6月末日	537,264,037		12,333
7月末日	539,569,221		12,384

## 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)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第6期 (平成18年12月20日)	156,345,353	156,345,353	12,355	12,355
第7期 (平成19年12月20日)	244,051,631	244,051,631	12,244	12,244
第8期 (平成20年12月22日)	258,579,003	258,579,003	10,124	10,124
第9期 (平成21年12月21日)	364,838,536	364,838,536	10,782	10,782
第10期 (平成22年12月20日)	460,154,017	460,154,017	10,871	10,871
第11期 (平成23年12月20日)	503,354,494	503,354,494	10,466	10,466
第12期 (平成24年12月20日)	605,756,824	605,756,824	11,419	11,419
第13期 (平成25年12月20日)	792,418,477	792,418,477	13,210	13,210
第14期 (平成26年12月22日)	1,042,332,411	1,042,332,411	14,223	14,223
第15期 (平成27年12月21日)	1,219,971,427	1,219,971,427	14,395	14,395
平成27年 7月末日	1,155,191,227		14,542	
8月末日	1,162,350,380		14,336	
9月末日	1,153,473,314		14,096	
10月末日	1,206,044,968		14,426	
11月末日	1,222,349,164		14,482	
12月末日	1,223,649,680		14,419	
平成28年 1月末日	1,211,789,440		14,215	
2月末日	1,213,227,390		14,208	
3月末日	1,240,704,283		14,465	
4月末日	1,245,505,248		14,457	
5月末日	1,262,648,227		14,501	
6月末日	1,260,795,633		14,300	
7月末日	1,285,586,314		14,409	

## 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)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第6期 (平成18年12月20日)	101,147,764	101,147,764	13,183	13,183
第7期 (平成19年12月20日)	149,262,430	149,262,430	12,809	12,809
第8期 (平成20年12月22日)	146,078,912	146,078,912	9,332	9,332
第9期 (平成21年12月21日)	214,049,126	214,049,126	10,168	10,168
第10期 (平成22年12月20日)	266,798,732	266,798,732	10,308	10,308
第11期 (平成23年12月20日)	273,003,638	273,003,638	9,525	9,525
第12期 (平成24年12月20日)	367,329,083	367,329,083	10,766	10,766
第13期 (平成25年12月20日)	541,345,607	541,345,607	13,445	13,445
第14期 (平成26年12月22日)	773,129,050	773,129,050	14,814	14,814
第15期 (平成27年12月21日)	1,197,113,384	1,197,113,384	15,141	15,141
平成27年 7月末日	1,158,727,771		15,531	
8月末日	1,148,238,864		15,107	
9月末日	1,122,462,534		14,550	
10月末日	1,194,202,289		15,234	
11月末日	1,213,566,368		15,372	
12月末日	1,204,043,957		15,206	
平成28年 1月末日	1,172,915,725		14,688	
2月末日	1,165,586,380		14,477	
3月末日	1,210,791,859		14,851	
4月末日	1,213,656,548		14,877	
5月末日	1,230,859,757		14,895	
6月末日	1,196,592,500		14,387	
7月末日	1,234,497,028		14,656	

## 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)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第6期 (平成18年12月20日)	113,160,193	113,160,193	13,668	13,668
第7期 (平成19年12月20日)	143,523,897	143,523,897	13,111	13,111
第8期 (平成20年12月22日)	134,815,396	134,815,396	8,596	8,596
第9期 (平成21年12月21日)	188,270,881	188,270,881	9,559	9,559
第10期 (平成22年12月20日)	231,956,041	231,956,041	9,713	9,713
第11期 (平成23年12月20日)	230,424,744	230,424,744	8,586	8,586
第12期 (平成24年12月20日)	287,659,579	287,659,579	10,038	10,038
第13期 (平成25年12月20日)	445,842,340	445,842,340	13,541	13,541
第14期 (平成26年12月22日)	588,648,311	588,648,311	15,256	15,256
第15期 (平成27年12月21日)	1,837,523,740	1,837,523,740	15,742	15,742

平成27年 7月末日	1,806,373,560		16,402
8月末日	1,765,710,913		15,744
9月末日	1,696,686,598		14,854
10月末日	1,830,075,585		15,892
11月末日	1,864,097,021		16,119
12月末日	1,848,893,834		15,840
平成28年 1月末日	1,761,771,296		14,991
2月末日	1,726,916,770		14,567
3月末日	1,801,645,097		15,042
4月末日	1,831,266,898		15,126
5月末日	1,844,479,130		15,100
6月末日	1,765,539,767		14,300
7月末日	1,845,552,953		14,724

## 【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
第12期	平成23年12月21日～平成24年12月20日	0
第13期	平成24年12月21日～平成25年12月20日	0
第14期	平成25年12月21日～平成26年12月22日	0
第15期	平成26年12月23日～平成27年12月21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
第12期	平成23年12月21日～平成24年12月20日	0
第13期	平成24年12月21日～平成25年12月20日	0

第14期	平成25年12月21日～平成26年12月22日	0
第15期	平成26年12月23日～平成27年12月21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
第12期	平成23年12月21日～平成24年12月20日	0
第13期	平成24年12月21日～平成25年12月20日	0
第14期	平成25年12月21日～平成26年12月22日	0
第15期	平成26年12月23日～平成27年12月21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
第12期	平成23年12月21日～平成24年12月20日	0
第13期	平成24年12月21日～平成25年12月20日	0
第14期	平成25年12月21日～平成26年12月22日	0
第15期	平成26年12月23日～平成27年12月21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

	収益率(%)
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	3.5
第13期	6.1
第14期	3.5
第15期	0.3
第16期(中間期)	0.2

(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。

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

	収益率(%)
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	9.1
第13期	15.7
第14期	7.7
第15期	1.2
第16期(中間期)	0.8

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

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

	収益率(%)
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	13.0
第13期	24.9
第14期	10.2
第15期	2.2
第16期(中間期)	4.5

(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。

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

	収益率（％）
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	16.9
第13期	34.9
第14期	12.7
第15期	3.2
第16期（中間期）	8.1

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

## （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

	設定口数（口）	解約口数（口）
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	33,162,080	26,499,660
第13期	71,424,035	40,643,048
第14期	84,271,259	27,787,920
第15期	81,915,864	55,862,170
第16期（中間期）	36,963,804	26,218,011

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

	設定口数（口）	解約口数（口）
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	85,709,743	36,186,583
第13期	124,684,453	55,291,960
第14期	174,116,846	41,116,178
第15期	173,855,110	59,244,453
第16期（中間期）	60,809,671	29,216,370

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

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

	設定口数（口）	解約口数（口）
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	65,335,257	10,757,941
第13期	97,849,986	36,394,176
第14期	146,378,903	27,109,912
第15期	326,685,857	57,957,924
第16期（中間期）	63,812,919	21,548,713

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

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

	設定口数（口）	解約口数（口）
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	48,930,836	30,725,942
第13期	84,609,174	41,944,386
第14期	92,910,684	36,318,727
第15期	941,205,290	159,802,718
第16期（中間期）	123,533,946	54,610,112

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

## (1) 投資状況

## 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）

平成28年 7月28日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	30,815,991,173	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,115,800	0.01
合計(純資産総額)		30,811,875,373	100.00

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

平成28年 7月28日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	191,066,342,670	98.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,208,808,585	1.14
合計(純資産総額)		193,275,151,255	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	2,343,600,000	1.21
合計	買建		2,343,600,000	1.21

## 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＞

平成28年 7月28日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	32,653,425,632	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,986,775	0.01



合計(純資産総額)	32,651,438,857	100.00
-----------	----------------	--------

## 国内債券(NOMURA - BPI) マザーファンド

平成28年 7月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	89,344,794,550	76.79
地方債証券	日本	9,183,020,540	7.89
特殊債券	日本	11,640,958,118	10.01
社債券	日本	4,529,759,000	3.89
	オランダ	302,876,000	0.26
	オーストラリア	301,270,000	0.26
	アメリカ	201,011,000	0.17
	小計	5,334,916,000	4.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		838,736,686	0.72
合計(純資産総額)		116,342,425,894	100.00

## SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

平成28年 7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	18,033,707,974	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,513,660	0.01
合計(純資産総額)		18,031,194,314	100.00

## 外国株式インデックス・マザーファンド

平成28年 7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	89,570,221,204	59.32
	イギリス	10,837,789,618	7.18
	スイス	5,818,690,223	3.85
	カナダ	5,700,468,892	3.78
	ドイツ	5,257,267,754	3.48
	フランス	5,241,640,329	3.47

	オーストラリア	3,773,086,768	2.50
	オランダ	2,543,305,925	1.68
	アイルランド	2,488,402,752	1.65
	スペイン	1,751,853,311	1.16
	スウェーデン	1,607,902,830	1.06
	香港	1,438,951,098	0.95
	デンマーク	1,173,842,099	0.78
	シンガポール	1,029,031,017	0.68
	イタリア	1,021,102,571	0.68
	ジャージー	878,486,824	0.58
	ベルギー	775,759,988	0.51
	バミューダ	640,774,276	0.42
	フィンランド	588,403,843	0.39
	キュラソー	540,588,976	0.36
	イスラエル	426,193,638	0.28
	ノルウェー	367,090,157	0.24
	ケイマン諸島	353,073,465	0.23
	ルクセンブルグ	150,713,353	0.10
	ニュージーランド	118,463,076	0.08
	オーストリア	100,939,809	0.07
	ポルトガル	88,422,865	0.06
	リベリア	60,241,097	0.04
	英ヴァージン諸島	47,304,987	0.03
	パプアニューギニア	35,408,736	0.02
	マン島	15,673,786	0.01
	モーリシャス	9,843,800	0.01
	小計	144,450,939,067	95.67
投資証券	アメリカ	2,826,652,961	1.87
	オーストラリア	638,695,663	0.42
	フランス	240,903,547	0.16
	イギリス	164,213,072	0.11
	香港	100,663,032	0.07
	シンガポール	84,867,218	0.06
	カナダ	36,737,008	0.02
	小計	4,092,732,501	2.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,450,181,757	1.62

合計(純資産総額)	150,993,853,325	100.00
-----------	-----------------	--------

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,695,284,805	1.12
	買建	ドイツ	439,731,072	0.29
	買建	イギリス	193,042,609	0.12
	買建	オーストラリア	119,189,268	0.07
合計	買建		2,447,247,754	1.60

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		163,823,900	0.10

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>

平成28年 7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	2,536,653,395	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		204,130	0.01
合計(純資産総額)		2,536,449,265	100.00

外国債券パッシブ・マザーファンド

平成28年 7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	73,723,518,001	42.63
	フランス	17,028,267,323	9.85
	イタリア	16,408,344,136	9.49
	イギリス	13,345,784,122	7.72
	ドイツ	12,660,557,553	7.32

スペイン	9,233,937,371	5.34
ベルギー	4,407,190,628	2.55
オランダ	4,114,793,106	2.38
カナダ	3,403,053,292	1.97
オーストラリア	3,293,306,925	1.90
オーストリア	2,594,574,106	1.50
メキシコ	1,463,875,848	0.85
アイルランド	1,460,355,786	0.84
デンマーク	1,162,501,828	0.67
フィンランド	1,021,531,971	0.59
ポーランド	987,090,512	0.57
南アフリカ	801,845,742	0.46
スウェーデン	798,986,389	0.46
マレーシア	696,754,299	0.40
シンガポール	629,284,474	0.36
スイス	468,282,705	0.27
ノルウェー	425,141,211	0.25
小計	170,128,977,328	98.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	2,803,243,661	1.62
合計(純資産総額)	172,932,220,989	100.00

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

平成28年 7月28日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	448,764,951	100.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		991	0.00
合計(純資産総額)		448,765,942	100.00

## マネーインカム・マザーファンド

平成28年 7月28日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	200,576,000	15.43
特殊債券	日本	805,082,000	61.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		294,289,138	22.64
合計(純資産総額)		1,299,947,138	100.00

## ( 2 ) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 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）

## イ 主要投資銘柄

平成28年 7月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	15,985,885,342	2.2510	35,984,227,905	1.9277	30,815,991,173	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。

## ロ 種類別の投資比率

平成28年 7月28日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年 7月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,228,500	7,490.53	9,202,116,105	5,859.00	7,197,781,500	3.72
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,823,300	761.88	5,960,415,804	484.60	3,791,171,180	1.96
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	753,700	4,591.33	3,460,485,421	4,873.00	3,672,780,100	1.90
日本	株式	KDDI	情報・通信業	964,700	3,050.03	2,942,363,941	3,156.00	3,044,593,200	1.58
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	552,500	6,419.14	3,546,574,850	5,366.00	2,964,715,000	1.53
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	888,900	3,895.05	3,462,309,945	2,838.50	2,523,142,650	1.31
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	613,400	4,416.91	2,709,332,594	4,056.00	2,487,950,400	1.29
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	780,400	4,559.70	3,558,389,880	3,070.00	2,395,828,000	1.24
日本	株式	ソニー	電気機器	696,800	3,116.27	2,171,416,936	3,192.00	2,224,185,600	1.15
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,866,100	240.52	3,335,074,372	158.10	2,192,230,410	1.13
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	728,800	2,355.67	1,716,812,296	2,778.00	2,024,606,400	1.05
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,121,800	1,717.64	1,926,848,552	1,694.50	1,900,890,100	0.98
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	411,700	5,910.78	2,433,468,126	4,533.00	1,866,236,100	0.97
日本	株式	ファナック	電気機器	100,100	21,429.17	2,145,059,917	17,690.00	1,770,769,000	0.92

日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	407,400	5,428.37	2,211,517,938	4,270.00	1,739,598,000	0.90
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	180,400	11,448.54	2,065,316,616	9,436.00	1,702,254,400	0.88
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	88,300	21,804.25	1,925,315,275	18,810.00	1,660,923,000	0.86
日本	株式	キーエンス	電気機器	22,400	66,116.81	1,481,016,544	73,390.00	1,643,936,000	0.85
日本	株式	キヤノン	電気機器	530,600	3,667.06	1,945,742,036	2,897.50	1,537,413,500	0.80
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	395,200	4,466.05	1,764,982,960	3,882.00	1,534,166,400	0.79
日本	株式	花王	化学	262,600	6,273.29	1,647,365,954	5,645.00	1,482,377,000	0.77
日本	株式	三菱地所	不動産業	724,000	2,535.90	1,835,991,600	1,979.50	1,433,158,000	0.74
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,346,500	1,283.48	1,728,205,820	1,024.00	1,378,816,000	0.71
日本	株式	村田製作所	電気機器	104,100	18,432.15	1,918,786,815	13,070.00	1,360,587,000	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	731,400	2,050.56	1,499,779,584	1,807.00	1,321,639,800	0.68
日本	株式	信越化学工業	化学	185,500	6,846.73	1,270,068,415	6,998.00	1,298,129,000	0.67
日本	株式	ダイキン工業	機械	143,900	8,576.35	1,234,136,765	8,959.00	1,289,200,100	0.67
日本	株式	任天堂	その他製品	60,800	18,598.39	1,130,782,112	21,080.00	1,281,664,000	0.66
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	349,100	4,330.90	1,511,917,190	3,590.00	1,253,269,000	0.65
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	312,200	4,963.22	1,549,517,284	3,994.00	1,246,926,800	0.65

□ 種類別・業種別の投資比率

平成28年 7月28日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.28
		建設業	3.33
		食料品	5.09
		繊維製品	0.74
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.22
		医薬品	5.72
		石油・石炭製品	0.47
		ゴム製品	0.86
		ガラス・土石製品	0.91
		鉄鋼	1.17
		非鉄金属	0.86
		金属製品	0.65
		機械	4.82
		電気機器	11.89
		輸送用機器	9.50
		精密機器	1.52
		その他製品	1.77
		電気・ガス業	1.89
陸運業	4.52		

	海運業	0.21
	空運業	0.59
	倉庫・運輸関連業	0.20
	情報・通信業	8.33
	卸売業	4.09
	小売業	4.84
	銀行業	7.05
	証券、商品先物取引業	0.94
	保険業	2.28
	その他金融業	1.25
	不動産業	2.66
	サービス業	3.82
合計		98.86

## S M A M ・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;

## イ 主要投資銘柄

平成28年 7月28日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド	22,893,799,083	1.4175	32,452,189,404	1.4263	32,653,425,632	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。

## ロ 種類別の投資比率

平成28年 7月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

## 国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成28年 7月28日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	1,545,000,000	101.65	1,570,569,750	102.14	1,578,109,350	0.100	2021/3/20	1.36
日本	国債証券	第300回利付国債(10年)	1,420,000,000	104.81	1,488,401,400	104.90	1,489,608,400	1.500	2019/3/20	1.28
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	1,325,000,000	105.42	1,396,934,250	105.65	1,399,915,500	1.300	2019/12/20	1.20



日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	1,346,000,000	103.91	1,398,628,600	103.98	1,399,611,180	1.500	2018/9/20	1.20
日本	国債証券	第306回利付国債(10年)	1,310,000,000	106.23	1,391,652,300	106.45	1,394,599,800	1.400	2020/3/20	1.20
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1,225,000,000	107.27	1,314,167,750	107.67	1,319,031,000	1.200	2021/6/20	1.13
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	1,235,000,000	105.34	1,300,973,700	105.66	1,304,975,100	1.000	2020/9/20	1.12
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	1,225,000,000	104.26	1,277,246,250	104.37	1,278,532,500	1.300	2019/3/20	1.10
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	1,200,000,000	104.58	1,255,032,000	105.84	1,270,152,000	0.300	2025/12/20	1.09
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	1,153,000,000	105.29	1,214,051,350	105.39	1,215,158,230	1.500	2019/6/20	1.04
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	1,180,000,000	101.50	1,197,723,600	101.91	1,202,538,000	0.100	2020/9/20	1.03
日本	国債証券	第317回利付国債(10年)	1,100,000,000	107.14	1,178,583,200	107.61	1,183,743,000	1.100	2021/9/20	1.02
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,060,000,000	107.78	1,142,563,400	108.77	1,153,025,600	0.800	2023/9/20	0.99
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	1,020,000,000	107.36	1,095,082,200	107.77	1,099,254,000	1.300	2021/3/20	0.94
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	1,080,000,000	101.23	1,093,284,000	101.55	1,096,837,200	0.100	2019/12/20	0.94
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	1,015,000,000	105.55	1,071,362,950	106.72	1,083,268,900	0.400	2025/9/20	0.93
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	1,015,000,000	105.49	1,070,774,250	106.63	1,082,324,950	0.400	2025/6/20	0.93
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	985,000,000	106.56	1,049,694,800	106.88	1,052,768,000	1.200	2020/12/20	0.90
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	970,000,000	107.51	1,042,847,000	108.38	1,051,286,000	0.800	2023/6/20	0.90
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	1,010,000,000	101.32	1,023,352,200	101.67	1,026,907,400	0.100	2020/3/20	0.88
日本	国債証券	第328回利付国債(10年)	950,000,000	105.86	1,005,717,500	106.70	1,013,688,000	0.600	2023/3/20	0.87
日本	国債証券	第297回利付国債(10年)	914,000,000	104.11	951,565,400	104.19	952,369,720	1.400	2018/12/20	0.82
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	865,000,000	105.43	911,969,500	106.53	921,519,100	0.400	2025/3/20	0.79
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	875,000,000	102.62	897,951,250	103.91	909,265,000	0.100	2026/3/20	0.78
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	820,000,000	106.62	874,284,000	107.66	882,820,200	0.600	2024/3/20	0.76
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	785,000,000	106.49	835,946,500	107.48	843,780,800	0.600	2023/12/20	0.73
日本	国債証券	第43回利付国債(20年)	710,000,000	110.29	783,073,200	110.30	783,186,800	2.900	2019/9/20	0.67
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	595,000,000	126.59	753,210,500	127.84	760,677,750	1.700	2032/9/20	0.65
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	685,000,000	106.80	731,580,000	107.83	738,662,900	0.600	2024/6/20	0.63
日本	特殊債券	第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	104.80	733,600,000	104.70	732,935,000	1.500	2019/8/16	0.63

□ 種類別の投資比率

平成28年 7月28日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	76.79

地方債証券	7.89
特殊債券	10.01
社債券	4.59
合計	99.28

## 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）

## イ 主要投資銘柄

平成28年 7月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	7,103,800,510	2.8856	20,498,726,752	2.5386	18,033,707,974	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。

## ロ 種類別の投資比率

平成28年 7月29日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年 7月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	261,196	12,211.91	3,189,704,395	10,895.18	2,845,778,167	1.88
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	353,956	5,620.92	1,989,561,403	5,869.44	2,077,526,407	1.38
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	195,636	8,475.48	1,658,110,856	9,418.68	1,842,633,663	1.22
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	130,005	10,692.11	1,390,028,160	12,996.11	1,689,559,697	1.12
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	18,861	69,888.02	1,318,157,995	78,587.53	1,482,239,520	0.98
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	439,630	3,162.88	1,390,497,726	3,263.12	1,434,567,644	0.95
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	108,071	11,031.65	1,192,201,760	13,052.49	1,410,596,727	0.93
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	290,033	3,522.04	1,021,509,526	4,446.20	1,289,545,769	0.85
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	149,999	8,119.41	1,217,904,313	8,231.83	1,234,767,168	0.82

アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	173,231	6,972.80	1,207,906,530	6,693.32	1,159,490,863	0.77
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	227,192	5,750.40	1,306,447,012	5,025.73	1,141,806,695	0.76
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	14,652	78,116.36	1,144,561,018	77,887.92	1,141,213,836	0.76
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	127,534	7,925.47	1,010,767,912	8,855.86	1,129,423,275	0.75
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	290,423	3,411.61	990,811,140	3,829.08	1,112,053,307	0.74
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	13,783	80,346.43	1,107,414,908	79,969.01	1,102,212,903	0.73
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	192,011	4,744.48	910,993,822	5,728.48	1,099,931,404	0.73
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	88,608	9,418.40	834,545,883	10,628.91	941,806,617	0.62
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	107,175	9,395.32	1,006,943,524	8,562.38	917,674,041	0.61
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	193,927	4,504.02	873,452,558	4,557.93	883,906,273	0.59
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	33,058	29,284.99	968,103,493	26,177.66	865,381,249	0.57
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	59,707	14,023.52	837,302,694	14,405.78	860,126,098	0.57
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	55,855	14,041.27	784,275,189	15,080.33	842,312,190	0.56
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	114,693	6,408.25	734,982,037	7,085.94	812,707,854	0.54
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	221,501	3,578.24	792,584,853	3,630.68	804,200,004	0.53
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	131,267	5,621.26	737,885,995	6,101.26	800,894,175	0.53
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	68,144	10,516.13	716,611,721	11,290.93	769,409,447	0.51
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	238,262	2,841.56	677,037,586	3,186.89	759,316,787	0.50
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	食品・飲料・タバコ	72,996	9,152.49	668,095,228	10,348.02	755,364,214	0.50
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	90,405	8,304.52	750,770,366	8,269.01	747,560,735	0.50
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	486,411	1,803.33	877,161,203	1,532.88	745,612,418	0.49

## □ 種類別・業種別の投資比率

平成28年 7月29日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.94
		素材	4.70
		資本財	6.98

	商業・専門サービス	0.98
	運輸	1.75
	自動車・自動車部品	1.53
	耐久消費財・アパレル	1.76
	消費者サービス	1.79
	メディア	2.69
	小売	3.98
	食品・生活必需品小売り	2.11
	食品・飲料・タバコ	6.92
	家庭用品・パーソナル用品	1.86
	ヘルスケア機器・サービス	3.95
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.67
	銀行	7.73
	各種金融	3.95
	保険	3.92
	不動産	0.79
	ソフトウェア・サービス	8.88
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.98
	電気通信サービス	3.31
	公益事業	3.54
	半導体・半導体製造装置	1.94
投資証券		2.71
合計		98.38

## S M A M ・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;

## イ 主要投資銘柄

平成28年 7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	1,549,479,809	1.7958	2,782,667,613	1.6371	2,536,653,395	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。

## ロ 種類別の投資比率

平成28年 7月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年 7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	11,000,000	9,980.26	1,097,829,460	11,647.72	1,281,249,716	2.750	2042/11/15	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	11,806.80	708,408,125	13,635.78	818,147,019	3.625	2043/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	7,000,000	10,654.10	745,787,219	11,292.85	790,500,193	2.500	2024/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	7,000,000	10,541.52	737,906,772	11,199.04	783,933,150	2.375	2024/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	7,000,000	10,289.44	720,261,427	10,997.54	769,828,296	2.125	2025/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,000,000	10,189.92	713,294,655	10,891.49	762,404,686	2.000	2025/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,000,000	10,239.60	716,772,654	10,889.04	762,233,369	2.000	2025/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,500,000	10,502.86	682,686,442	11,115.01	722,476,272	2.250	2025/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	10,892.31	675,323,298	11,460.09	710,525,890	2.750	2023/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	11,284.70	677,082,125	11,432.35	685,941,506	3.625	2020/2/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	3,200,000	18,729.86	599,355,672	21,231.69	679,414,118	5.750	2032/10/25	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.5	3,500,000	17,443.96	610,538,647	19,211.86	672,415,157	5.500	2029/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,000,000	10,419.02	625,141,656	11,101.96	666,118,025	2.250	2024/11/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000	13,315.12	665,756,036	13,307.83	665,391,675	3.500	2020/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.875	6,000,000	11,119.91	667,194,857	11,044.04	662,642,794	3.875	2018/5/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	13,263.87	663,193,946	13,173.30	658,665,465	3.750	2019/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	6,000,000	10,603.52	636,211,481	10,594.55	635,673,069	1.875	2017/10/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	6,000,000	10,598.63	635,917,800	10,592.91	635,575,175	1.875	2017/9/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,000,000	10,296.50	617,790,487	10,543.97	632,638,362	1.625	2026/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1	6,000,000	10,202.97	612,178,569	10,479.52	628,771,556	1.000	2019/11/30	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.75	3,100,000	17,866.27	553,854,564	20,183.25	625,681,007	4.750	2035/4/25	0.36
イタリア	国債証券	BTPS 5.25	3,700,000	16,180.48	598,677,845	16,841.32	623,128,864	5.250	2029/11/1	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000	14,362.39	574,495,876	15,411.52	616,460,952	3.500	2026/4/25	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000	14,795.34	591,813,988	15,347.55	613,902,331	4.250	2023/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,500,000	10,853.15	596,923,456	11,136.22	612,492,644	2.625	2020/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,500,000	10,365.31	570,092,410	10,898.02	599,391,197	2.000	2023/2/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.5	4,500,000	12,899.51	580,478,328	13,029.64	586,334,122	2.500	2020/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	11,362.20	568,110,063	11,626.51	581,325,719	3.625	2021/2/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,400,000	13,269.66	583,865,145	13,089.10	575,920,467	4.250	2019/4/25	0.33
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	2,700,000	17,665.70	476,973,920	21,321.56	575,682,303	4.500	2041/4/25	0.33

## ロ 種類別の投資比率

平成28年 7月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.38
合計	98.38

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

## イ 主要投資銘柄

平成28年 7月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	マネーインカム・マザーファンド	443,312,211	1.0121	448,676,982	1.0123	448,764,951	100.00

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

平成28年 7月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

## マネーインカム・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄

平成28年 7月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	特殊債券	第2回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	300,000,000	100.06	300,186,000	100.01	300,048,000	0.130	2016/8/30	23.08
日本	特殊債券	第16回政府保証日本政策投資銀行債券	200,000,000	101.58	203,160,000	101.09	202,180,000	1.800	2017/2/28	15.55
日本	国債証券	第283回利付国債（10年）	200,000,000	100.83	201,670,000	100.28	200,576,000	1.800	2016/9/20	15.43
日本	特殊債券	第875回政府保証公営企業債券	100,000,000	101.82	101,825,000	101.42	101,429,000	1.700	2017/5/22	7.80
日本	特殊債券	第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101.20	101,203,000	100.73	100,734,000	1.700	2016/12/28	7.75
日本	特殊債券	第19回政府保証国民生活債券	100,000,000	101.16	101,161,000	100.69	100,691,000	1.700	2016/12/19	7.75

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

平成28年 7月28日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	15.43
特殊債券	61.93
合計	77.36

参考情報



基準日:2016年7月29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

### <2010>



## ★分配の推移

決算期	分配金
2015年12月	0円
2014年12月	0円
2013年12月	0円
2012年12月	0円
2011年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
 ※直近5計算期間を記載しています。

### <2020>



決算期	分配金
2015年12月	0円
2014年12月	0円
2013年12月	0円
2012年12月	0円
2011年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
 ※直近5計算期間を記載しています。

### <2030>



決算期	分配金
2015年12月	0円
2014年12月	0円
2013年12月	0円
2012年12月	0円
2011年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
 ※直近5計算期間を記載しています。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## ▶&lt;2040&gt;



決算期	分配金
2015年12月	0円
2014年12月	0円
2013年12月	0円
2012年12月	0円
2011年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

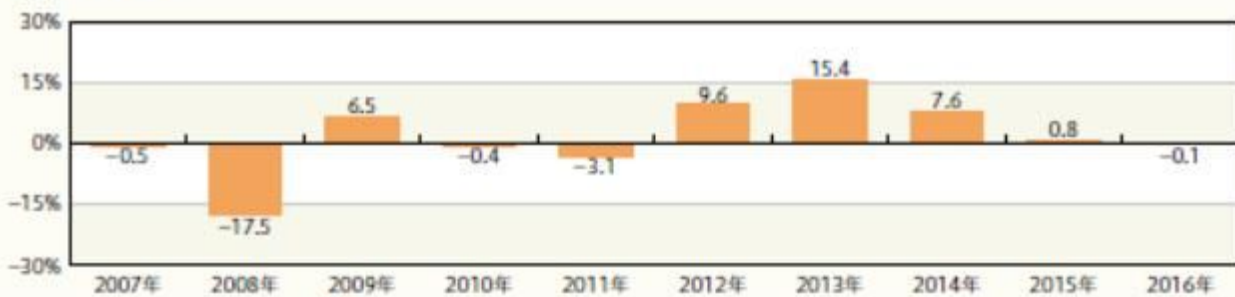
※基準価額は、1万口当たり、税引報酬控除後です。

## ★年間収益率の推移(暦年ベース)

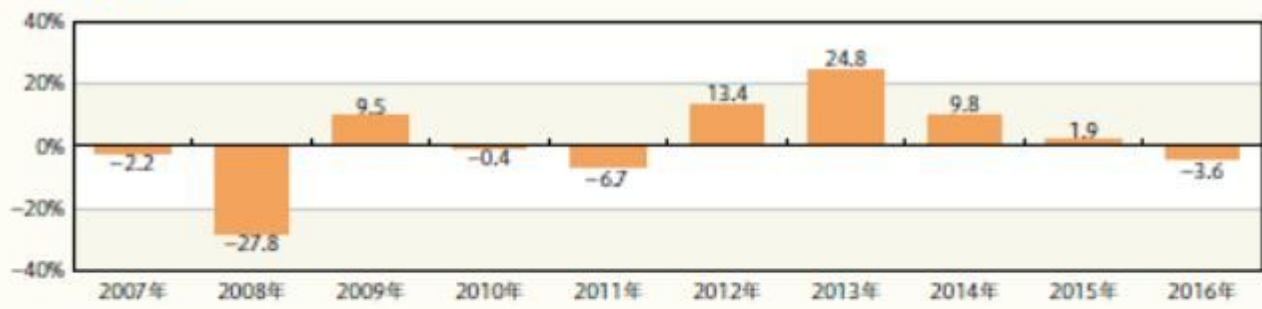
## ▶&lt;2010&gt;



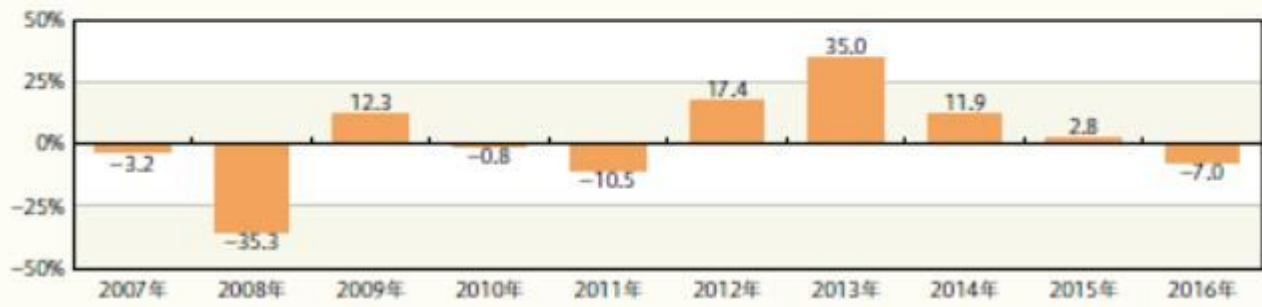
## ▶&lt;2020&gt;



## ▶&lt;2030&gt;



## ▶&lt;2040&gt;



※2016年のファンDの収益率は、年初から2016年7月29日までの実績率を表示しています。

※ファンD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】

&lt;追加&gt;

- 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。
- 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16期中間計算期間(平成27年12月22日から平成28年6月21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。

## 【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16期中間計算期間 (平成28年6月21日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	2,368,542
コール・ローン	4,932,832
投資信託受益証券	533,784,216
流動資産合計	541,085,590
<b>資産合計</b>	<b>541,085,590</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	2,960,000
未払解約金	659,060
未払受託者報酬	114,613
未払委託者報酬	1,031,458
未払利息	14
その他未払費用	8,592
流動負債合計	4,773,737
<b>負債合計</b>	<b>4,773,737</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	435,207,569
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	101,104,284
元本等合計	536,311,853
純資産合計	536,311,853
<b>負債純資産合計</b>	<b>541,085,590</b>

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

第16期中間計算期間 自 平成27年12月22日 至 平成28年6月21日	
営業収益	

第16期中間計算期間 自 平成27年12月22日 至 平成28年 6月21日	
受取利息	40
有価証券売買等損益	227,470
営業収益合計	227,510
<b>営業費用</b>	
支払利息	414
受託者報酬	114,613
委託者報酬	1,031,458
その他費用	8,803
営業費用合計	1,155,288
営業利益又は営業損失（ ）	927,778
経常利益又は経常損失（ ）	927,778
中間純利益又は中間純損失（ ）	927,778
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	49,982
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	99,573,893
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,552,911
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,552,911
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,144,724
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,144,724
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	101,104,284

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第16期中間計算期間 自 平成27年12月22日 至 平成28年 6月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
	計算期間の取扱い

項目	第16期中間計算期間 自 平成27年12月22日 至 平成28年 6月21日
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当中間計算期間は前期末が休日のため、平成27年12月22日から平成28年 6月21日までとなっております。

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項目	第16期中間計算期間 (平成28年 6月21日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	435,207,569口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2323円 (10,000口当たりの純資産額 12,323円)

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第16期中間計算期間 (平成28年 6月21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） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## ( デリバティブ取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

項目	第16期中間計算期間 (平成28年 6月21日現在)
期首元本額	424,461,776円
期中追加設定元本額	36,963,804円
期中一部解約元本額	26,218,011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16期中間計算期間 (平成28年 6月21日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	4,320,190
コール・ローン	8,997,423
投資信託受益証券	1,247,893,339
流動資産合計	1,261,210,952
<b>資産合計</b>	<b>1,261,210,952</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	60,000
未払解約金	2,718,878
未払受託者報酬	265,445
未払委託者報酬	2,986,239
未払利息	25
その他未払費用	20,031
流動負債合計	6,050,618
<b>負債合計</b>	<b>6,050,618</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	879,064,323
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	376,096,011
元本等合計	1,255,160,334
純資産合計	1,255,160,334
<b>負債純資産合計</b>	<b>1,261,210,952</b>

#### （2）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

第16期中間計算期間 自 平成27年12月22日 至 平成28年 6月21日	
<b>営業収益</b>	
受取利息	103
有価証券売買等損益	6,933,317
営業収益合計	6,933,214
<b>営業費用</b>	
支払利息	1,138
受託者報酬	265,445
委託者報酬	2,986,239
その他費用	20,518



第16期中間計算期間 自 平成27年12月22日 至 平成28年 6月21日	
営業費用合計	3,273,340
営業利益又は営業損失（ ）	10,206,554
経常利益又は経常損失（ ）	10,206,554
中間純利益又は中間純損失（ ）	10,206,554
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	287,642
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	372,500,405
剰余金増加額又は欠損金減少額	26,346,035
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	26,346,035
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,831,517
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,831,517
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	376,096,011

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第16期中間計算期間 自 平成27年12月22日 至 平成28年 6月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当中間計算期間は前期末が休日のため、平成27年12月22日から平成28年 6月21日までとなっております。</p>

( 中間貸借対照表に関する注記 )

項目	第16期中間計算期間 (平成28年 6月21日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		879,064,323口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.4278円
	(10,000口当たりの純資産額)	14,278円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第16期中間計算期間 (平成28年 6月21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） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第16期中間計算期間 (平成28年 6月21日現在)
期首元本額	847,471,022円
期中追加設定元本額	60,809,671円
期中一部解約元本額	29,216,370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16期中間計算期間 （平成28年 6月21日現在）	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	3,577,973
コール・ローン	7,451,648
投資信託受益証券	1,199,344,556
未収入金	3,390,000
流動資産合計	1,213,764,177
資産合計	1,213,764,177
負債の部	
流動負債	
未払解約金	6,238,338
未払受託者報酬	257,418
未払委託者報酬	2,895,928
未払利息	21
その他未払費用	19,408
流動負債合計	9,411,113
負債合計	9,411,113
純資産の部	
元本等	
元本	832,897,439
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	371,455,625
元本等合計	1,204,353,064
純資産合計	1,204,353,064
負債純資産合計	1,213,764,177

## （2）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）	
第16期中間計算期間 自 平成27年12月22日 至 平成28年 6月21日	
営業収益	
受取利息	69
有価証券売買等損益	51,858,395
営業収益合計	51,858,326
営業費用	
支払利息	1,067
受託者報酬	257,418
委託者報酬	2,895,928
その他費用	19,896
営業費用合計	3,174,309
営業利益又は営業損失（ ）	55,032,635
経常利益又は経常損失（ ）	55,032,635
中間純利益又は中間純損失（ ）	55,032,635
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,045,894
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	406,480,151
剰余金増加額又は欠損金減少額	30,002,044
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-

第16期中間計算期間  
自 平成27年12月22日  
至 平成28年 6月21日

中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	30,002,044
剰余金減少額又は欠損金増加額	11,039,829
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	11,039,829
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	371,455,625

### （ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針の注記）

項 目	第16期中間計算期間 自 平成27年12月22日 至 平成28年 6月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当中間計算期間は前期末が休日のため、平成27年12月22日から平成28年 6月21日までとなっております。</p>

（中間貸借対照表に関する注記）

項 目	第16期中間計算期間 (平成28年 6月21日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	832,897,439口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4460円
	(10,000口当たりの純資産額 14,460円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第16期中間計算期間 (平成28年 6月21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） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第16期中間計算期間 (平成28年 6月21日現在)
期首元本額	790,633,233円
期中追加設定元本額	63,812,919円
期中一部解約元本額	21,548,713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16期中間計算期間  
(平成28年 6月21日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	4,589,280

第16期中間計算期間  
（平成28年 6月21日現在）

コール・ローン	9,557,842
投資信託受益証券	1,781,260,817
流動資産合計	1,795,407,939
資産合計	1,795,407,939
負債の部	
流動負債	
未払金	2,250,000
未払解約金	5
未払受託者報酬	385,726
未払委託者報酬	4,339,360
未払利息	27
その他未払費用	29,142
流動負債合計	7,004,260
負債合計	7,004,260
純資産の部	
元本等	
元本	1,236,163,892
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	552,239,787
元本等合計	1,788,403,679
純資産合計	1,788,403,679
負債純資産合計	1,795,407,939

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

第16期中間計算期間  
自 平成27年12月22日  
至 平成28年 6月21日

営業収益	
受取利息	202
有価証券売買等損益	147,084,796
営業収益合計	147,084,594
営業費用	
支払利息	1,548
受託者報酬	385,726
委託者報酬	4,339,360
その他費用	29,657
営業費用合計	4,756,291
営業利益又は営業損失（ ）	151,840,885
経常利益又は経常損失（ ）	151,840,885
中間純利益又は中間純損失（ ）	151,840,885
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	4,083,853
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	670,283,682
剰余金増加額又は欠損金減少額	60,901,796
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	60,901,796
剰余金減少額又は欠損金増加額	31,188,659
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	31,188,659
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	552,239,787

## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第16期中間計算期間 自 平成27年12月22日 至 平成28年 6月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当中間計算期間は前期末が休日のため、平成27年12月22日から平成28年 6月21日までとなっております。</p>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項 目	第16期中間計算期間 (平成28年 6月21日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,236,163,892口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4467円
	(10,000口当たりの純資産額 14,467円)

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項



項目	第16期中間計算期間 (平成28年 6月21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) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第16期中間計算期間 (平成28年 6月21日現在)
期首元本額	1,167,240,058円
期中追加設定元本額	123,533,946円
期中一部解約元本額	54,610,112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)

## 貸借対照表

(単位:円)

(平成28年 6月20日現在)

資産の部

(平成28年 6月20日現在)

流動資産	
金銭信託	706
コール・ローン	1,268
親投資信託受益証券	30,501,232,195
流動資産合計	30,501,234,169
資産合計	
	30,501,234,169
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	778,925
未払委託者報酬	681,548
その他未払費用	35,793
流動負債合計	1,496,266
負債合計	
	1,496,266
純資産の部	
元本等	
元本	24,662,151,582
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,837,586,321
元本等合計	30,499,737,903
純資産合計	
	30,499,737,903
負債純資産合計	
	30,501,234,169

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成27年12月1日 至平成28年6月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年 6月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	24,662,151,582口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2367円

(10,000口当たりの純資産額

12,367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28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)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	(平成28年 6月20日現在)
期首元本額	23,955,799,828円
期中追加設定元本額	4,028,975,095円
期中一部解約元本額	3,322,623,341円

## (参考)

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）

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 6月20日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	525,062,564
コール・ローン	943,443,453
株式	185,947,952,830
派生商品評価勘定	135,680
未収配当金	1,329,420,722
前払金	139,993,000
差入委託証拠金	69,615,000
流動資産合計	188,955,623,249
資産合計	188,955,623,249
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	140,368,440
未払解約金	33,799,052
未払利息	2,742
その他未払費用	37,407
流動負債合計	174,207,641
負債合計	174,207,641
純資産の部	
元本等	
元本	100,210,188,012
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	88,571,227,596
元本等合計	188,781,415,608
純資産合計	188,781,415,608
負債純資産合計	188,955,623,249

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成27年12月 1日 至平成28年 6月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
	先物取引

2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年 6月20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。 株式 2,784,000,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	100,210,188,012口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8839円 (10,000口当たりの純資産額 18,839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28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) 「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28年 6月20日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		

市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,974,062,760	-	2,833,830,000	140,232,760
	東証株価指数先物	2,974,062,760	-	2,833,830,000	140,232,760
	合計	2,974,062,760	-	2,833,830,000	140,232,760

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

1) 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (その他の注記)

(平成28年 6月20日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	97,649,281,775円
同期中における追加設定元本額	15,834,241,324円
同期中における一部解約元本額	13,273,335,087円
平成28年 6月20日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,851,661,293円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	539,467,106円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,672,217,156円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,922,838,014円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	83,477,122円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,167,335円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	19,798,499円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	60,690,969円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	49,503,358円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	28,846,172円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	65,967,991円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	2,537,369,192円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	1,018,512,183円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	998,106,279円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,353,543,587円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	1,651,313,634円
S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	16,190,473,059円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	106,046,102円
S M A M・バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	12,948,319,278円
S M A M・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	6,885,524,634円
S M A M・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	3,921,482,578円
S M A M・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	14,353,904,696円
S M A M・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	79,517,751円

S M A M ・ バランスファンド V L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	338,360,668円
世界 6 資産バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	23,925,627円
S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	1,490,632,616円
S M A M ・ バランスファンド V L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	85,688,096円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	568,149,083円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,649,562,315円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	2,876,353,193円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	5,162,267,852円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	124,948,299円
三井住友・ 5 資産バランスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	3,314,831,470円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	107,938,271円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	183,864,959円
三井住友・ 7 資産バランスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	2,927,658,763円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	162,634,433円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	75,881,704円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	35,125,182円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	368,993,989円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	628,248,942円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	257,630,108円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	173,881,662円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	81,579,244円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	13,607,940円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	132,454,060円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,543,966,338円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・ V A ( 適格機関投資家専用 )	268,579,406円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	32,272,219円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	45,996円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	1,184,367円
S M A M ・ グローバル・ マルチアセット・ グロース・ ファンド ( 安定成長型 ) < 適格機関投資家限定 >	1,188,419円
S M A M ・ 年金 W リスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	167,574円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 1 < 適格機関投資家限定 >	95,074,347円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	88,235,984円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	48,506,898円
合計	100,210,188,012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 >

#### 貸借対照表

( 単位 : 円 )

( 平成28年 6月20日現在 )

資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,589
コール・ローン	2,854

(平成28年 6月20日現在)

親投資信託受益証券	32,978,162,558
未収入金	4,189,998
流動資産合計	32,982,356,999
資産合計	32,982,356,999
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,189,998
未払受託者報酬	4,351,346
未払委託者報酬	4,351,274
その他未払費用	486,000
流動負債合計	13,378,618
負債合計	13,378,618
純資産の部	
元本等	
元本	25,082,572,318
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,886,406,063
元本等合計	32,968,978,381
純資産合計	32,968,978,381
負債純資産合計	32,982,356,999

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成27年 6月23日 至平成28年 6月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年 6月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	25,082,572,318口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3144円
	(10,000口当たりの純資産額 13,144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28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）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

項目	（平成28年 6月20日現在）
期首元本額	29,681,762,293円
期中追加設定元本額	3,676,585,798円
期中一部解約元本額	8,275,775,773円

## （参考）

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

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 6月20日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	563,803,255
コール・ローン	1,013,053,541
国債証券	88,561,496,300
地方債証券	8,988,237,820
特殊債券	11,249,083,666
社債券	5,732,968,000
未収入金	73,774,150
未収利息	223,683,974
前払費用	3,908,818
流動資産合計	116,410,009,524
資産合計	116,410,009,524
負債の部	
流動負債	
未払金	744,095,500
未払解約金	270,902,964
未払利息	2,944
その他未払費用	15,438
流動負債合計	1,015,016,846
負債合計	1,015,016,846
純資産の部	
元本等	
元本	81,405,391,010
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	33,989,601,668
元本等合計	115,394,992,678
純資産合計	115,394,992,678
負債純資産合計	116,410,009,524

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成27年 6月23日 至 平成28年 6月20日
-----	--------------------------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

項 目	(平成28年 6月20日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	81,405,391,010口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.4175円
	(10,000口当たりの純資産額)	14,175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28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	<p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成28年 6月20日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	95,148,733,046円
同期中における追加設定元本額	12,062,876,454円
同期中における一部解約元本額	25,806,218,490円
平成28年 6月20日現在における元本の内訳	
三井住友・日本債券インデックス・ファンド	35,678,192,091円
S M A M ・国内債券インデックス・ファンド	22,004,364,723円
国内債券インデックスファンドV A <適格機関投資家限定>	457,816,518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>	23,265,017,678円
合計	81,405,391,010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）

貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 6月21日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	1,332
コール・ローン	2,773
親投資信託受益証券	17,903,502,681
流動資産合計	17,903,506,786
資産合計	17,903,506,786
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払受託者報酬	663,365
未払委託者報酬	241,214
その他未払費用	39,403
流動負債合計	943,982
負債合計	943,982
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	9,409,928,556
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	8,492,634,248
元本等合計	17,902,562,804
純資産合計	17,902,562,804
負債純資産合計	17,903,506,786

注記表

## （重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成27年12月 1日 至 平成28年 6月21日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成28年 6月21日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		9,409,928,556口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.9025円
	(10,000口当たりの純資産額)	19,025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28年 6月21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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	（平成28年 6月21日現在）
期首元本額	10,592,213,751円
期中追加設定元本額	457,009,936円
期中一部解約元本額	1,639,295,131円

（参考）

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

#### 貸借対照表

（単位：円）

（平成28年 6月21日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	2,973,870,788
金銭信託	67,436,849
コール・ローン	140,447,043
株式	140,002,595,068
投資証券	3,857,765,529
派生商品評価勘定	48,336,558
未収入金	1,198,321
未収配当金	292,325,941
差入委託証拠金	1,410,049,489
流動資産合計	148,794,025,586
資産合計	148,794,025,586
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	25,200
前受金	48,186,908
未払解約金	12,606,517
未払利息	400
その他未払費用	6,399
流動負債合計	60,825,424

(平成28年 6月21日現在)

負債合計	60,825,424
純資産の部	
元本等	
元本	60,661,542,157
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	88,071,658,005
元本等合計	148,733,200,162
純資産合計	148,733,200,162
負債純資産合計	148,794,025,586

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成27年12月1日 至平成28年6月21日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年 6月21日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		60,661,542,157口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.4519円
	(10,000口当たりの純資産額)	24,519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28年 6月21日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(平成28年 6月21日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,174,008,918	-	3,222,195,826	48,186,908
	SPMINI 1609	2,160,028,048	-	2,164,201,612	4,173,564
	DJ EUR 1609	553,339,716	-	583,760,476	30,420,760
	FTSE 1609	240,639,790	-	252,482,945	11,843,155
	SPI200 1609	220,001,364	-	221,750,793	1,749,429
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,667,584,650	-	1,667,460,200	124,450
	米ドル	1,084,919,000	-	1,084,814,500	104,500
	カナダドル	73,053,000	-	73,044,000	9,000



ユーロ	181,165,600	-	181,165,600	-
英ポンド	153,540,200	-	153,540,200	-
スイスフラン	68,008,500	-	68,033,700	25,200
スウェーデンク ローナ	20,538,000	-	20,538,000	-
ノルウェークロー ネ	4,632,400	-	4,628,700	3,700
デンマーククロー ネ	15,661,800	-	15,661,800	-
オーストラリアドル	24,434,550	-	24,431,400	3,150
ニュージーランド ドル	739,500	-	739,200	300
香港ドル	25,957,200	-	25,937,800	19,400
シンガポールドル	9,279,600	-	9,278,400	1,200
イスラエルシケ ル	5,655,300	-	5,646,900	8,400
合計	4,841,593,568	-	4,889,656,026	48,311,358

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

1) 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (その他の注記)

（平成28年 6月21日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	59,908,468,477円
同期中における追加設定元本額	9,934,991,656円
同期中における一部解約元本額	9,181,917,976円
平成28年 6月21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	9,062,068,972円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	202,630,383円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	875,160,490円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	588,288,608円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	31,752,236円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	3,083,623円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	7,158,793円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	26,520,031円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	26,385,977円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	16,195,167円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	38,227,656円
外国株式指数ファンド	442,177,065円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	707,472,339円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	451,482,605円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	552,794,968円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	911,403,429円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	7,301,889,425円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	40,029,423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＞	4,969,023,758円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	3,539,580,177円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,643,226,259円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	11,040,685,973円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	30,694,337円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	177,146,494円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	13,782,411円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,323,649,512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＞	100,455,805円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	295,414,154円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,285,458,279円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	2,269,254,041円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	2,974,908,779円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	100,751,800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）	1,226,321,652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）	2,539,431,850円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	254,602,819円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	138,979,146円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	2,253,802,513円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	43,216,191円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	23,748,486円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	11,789,696円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	94,099,239円

S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	211,165,907円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T < 適格機関投資家専用 >	204,637,815円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	34,883円
S M A M ・ F G グローバルバランス25VA < 適格機関投資家限定 >	1,740,267円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドSA < 適格機関投資家限定 >	1,349,687,101円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	155,942円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-01 < 適格機関投資家限定 >	112,473,753円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04 < 適格機関投資家限定 >	104,402,990円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-05 < 適格機関投資家限定 >	42,498,938円
合計	60,661,542,157円

## S M A M ・ 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;

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 6月21日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	21
コール・ローン	44
親投資信託受益証券	2,520,556,931
流動資産合計	2,520,556,996
資産合計	2,520,556,996
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	11,989
未払委託者報酬	5,993
その他未払費用	1,497
流動負債合計	19,479
負債合計	19,479
純資産の部	
元本等	
元本	1,560,914,775
剰余金	
剰余金又は欠損金 ( )	959,622,742
元本等合計	2,520,537,517
純資産合計	2,520,537,517
負債純資産合計	2,520,556,996

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成27年12月18日 至 平成28年 6月21日
----	--------------------------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

項 目	（平成28年 6月21日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		1,560,914,775口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.6148円
	(10,000口当たりの純資産額)	16,148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28年 6月21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)

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	（平成28年 6月21日現在）
期首元本額	1,807,023,919円
期中追加設定元本額	76,023,237円
期中一部解約元本額	322,132,381円

（参考）

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

#### 貸借対照表

（単位：円）

（平成28年 6月21日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	1,333,090,514
金銭信託	458,426,160
コール・ローン	954,739,140
国債証券	168,458,201,895
未収利息	1,444,572,714
前払費用	23,609,993
流動資産合計	172,672,640,416
資産合計	172,672,640,416
負債の部	
流動負債	
未払解約金	13,560,802
未払利息	2,722
その他未払費用	21,169
流動負債合計	13,584,693
負債合計	13,584,693
純資産の部	
元本等	
元本	106,068,095,226
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	66,590,960,497
元本等合計	172,659,055,723
純資産合計	172,659,055,723
負債純資産合計	172,672,640,416

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成27年12月18日 至 平成28年 6月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成28年 6月21日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		106,068,095,226口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.6278円
	(10,000口当たりの純資産額)	16,278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28年 6月21日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「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）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

（平成28年 6月21日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	109,871,226,104円
同期中における追加設定元本額	4,280,071,954円
同期中における一部解約元本額	8,083,202,832円
平成28年 6月21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	7,548,713,705円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	311,033,972円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	897,560,470円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	456,202,334円
S M A M・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	53,335,974円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,292,956円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	21,707,045円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	61,539,566円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	40,506,050円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	21,794,674円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	48,076,343円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	3,218,565円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	339,370,855円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	467,551,904円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	474,989,613円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,548,443,870円
S M A M・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	3,642,312,016円

S M A M ・ バランスファンド V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	19,072,564,012円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	7,380,413,503円
S M A M ・ バランスファンド V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	16,312,945,354円
S M A M ・ バランスファンド V L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	45,968,708円
S M A M ・ バランスファンド V L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	129,163,542円
世界 6 資産バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	13,644,843円
S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	939,503,001円
S M A M ・ バランスファンド V L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	142,165,035円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,513,583,466円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,924,991,258円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	4,894,037,038円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	9,047,674,843円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	150,974,873円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンド V A < 適格機関投資家限定 >	14,447,331,155円
三井住友・外国債券インデックスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	1,233,743,477円
三井住友・ 5 資産バランスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	3,931,284,313円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	250,225,830円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	856,254,834円
三井住友・ 7 資産バランスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	3,489,349,374円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	185,069,203円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	52,443,368円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	16,778,945円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	207,535,594円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	717,216,112円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	226,457,705円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	200,596,974円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	56,308,264円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	6,430,166円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,755,398,903円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	27,981,867円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	346,870円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	10,907,567円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	160,657円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	23,257,690円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	546,555円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 1 < 適格機関投資家限定 >	357,137,952円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	331,654,308円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	171,398,155円
合計	106,068,095,226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 >



## 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 6月20日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	354
コール・ローン	637
親投資信託受益証券	445,044,975
流動資産合計	445,045,966
資産合計	445,045,966
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	441,154,847
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,891,119
元本等合計	445,045,966
純資産合計	445,045,966
負債純資産合計	445,045,966

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成28年 4月14日 至 平成28年 6月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年 6月20日現在)
----	-----------------

1. 当計算期間の末日における受益権の総数		441,154,847口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0088円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,088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28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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	（平成28年 6月20日現在）
期首元本額	433,581,490円
期中追加設定元本額	10,914,317円
期中一部解約元本額	3,340,960円

（参考）

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

## 貸借対照表

		（単位：円）
		（平成28年 6月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託		93,318,445
コール・ローン		167,676,544
国債証券		200,986,000
特殊債券		805,911,000
未収利息		3,603,494
前払費用		229,122
流動資産合計		<u>1,271,724,605</u>
資産合計		<u>1,271,724,605</u>
負債の部		
流動負債		
未払解約金		15,805,692
未払利息		487
その他未払費用		773
流動負債合計		<u>15,806,952</u>
負債合計		<u>15,806,952</u>
純資産の部		
元本等		
元本		1,240,699,301
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		<u>15,218,352</u>
元本等合計		<u>1,255,917,653</u>
純資産合計		<u>1,255,917,653</u>
負債純資産合計		<u>1,271,724,605</u>

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成28年 4月14日 至 平成28年 6月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、特殊債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成28年 6月20日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		1,240,699,301口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0123円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,123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28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、特殊債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

（平成28年 6月20日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,290,985,957円
同期中における追加設定元本額	70,425,713円
同期中における一部解約元本額	120,712,369円

平成28年 6月20日現在における元本の内訳	
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	37,222,218円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	16,312,967円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	9,239,096円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	6,128,740円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	3,365,276円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	7,352,476円
米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	99,128円
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＞	439,637,435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＞	495,610,162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＞	225,434,419円
合計	1,240,699,301円

## 2【ファンドの現況】

<更新後>

### 【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28年 7月29日現在

資産総額	540,298,163円
負債総額	728,942円
純資産総額（ - ）	539,569,221円
発行済口数	435,692,974口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2384円
（1万口当たり純資産額）	（12,384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28年 7月29日現在

資産総額	1,287,657,836円
負債総額	2,071,522円
純資産総額（ - ）	1,285,586,314円
発行済口数	892,209,380口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4409円
（1万口当たり純資産額）	（14,409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28年 7月29日現在

資産総額	1,235,383,038円
負債総額	886,010円
純資産総額( - )	1,234,497,028円
発行済口数	842,289,949口
1口当たり純資産額( / )	1.4656円
(1万口当たり純資産額)	(14,656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28年7月29日現在

資産総額	1,849,201,713円
負債総額	3,648,760円
純資産総額( - )	1,845,552,953円
発行済口数	1,253,430,153口
1口当たり純資産額( / )	1.4724円
(1万口当たり純資産額)	(14,724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】

<更新後>

##### イ 資本金の額および株式数

平成28年 7月29日現在

資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減  
該当ありません。

##### ハ 会社の機構

委託会社の取締役は7名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

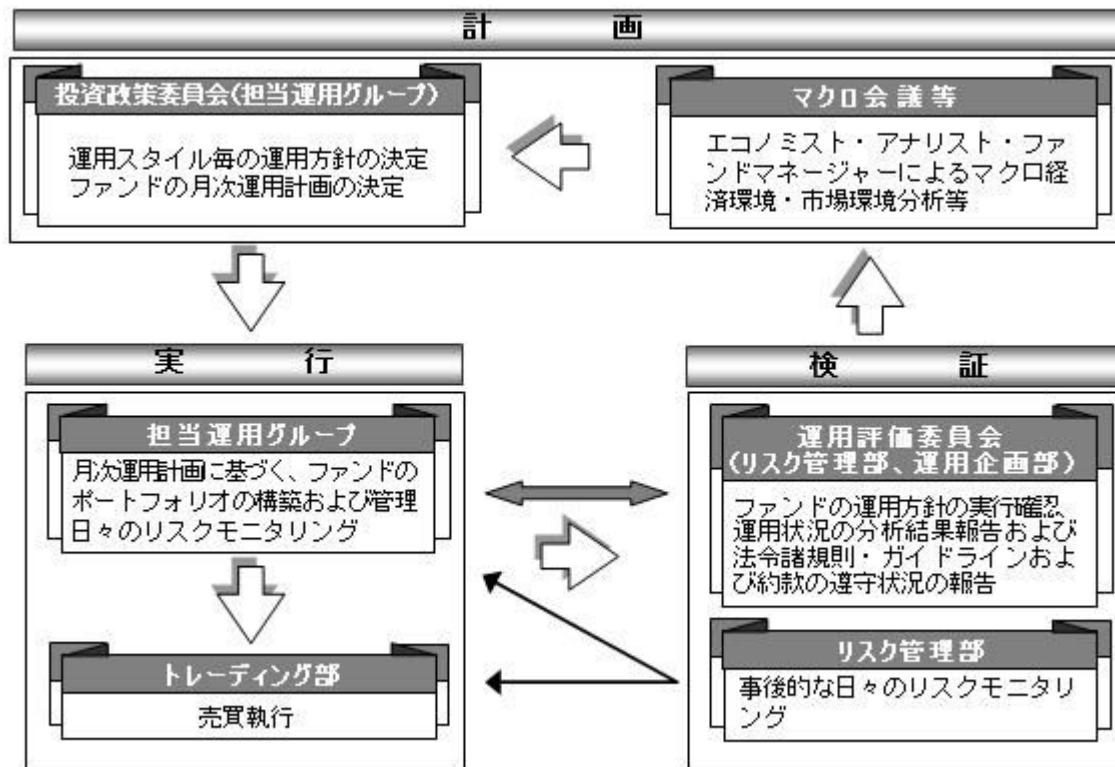
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定します。

##### ニ 投資信託の運用の流れ



## 2【事業の内容及び営業の概況】

### <更新後>

「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投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

平成28年7月29日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成28年 7月29日現在）

		本 数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単体型	57 ( 16 )	145,663 ( 57,836 )
	追加型	466 ( 192 )	4,888,018 ( 2,754,022 )
	計	523 ( 208 )	5,033,681 ( 2,811,858 )
公社債投資信託	単体型	70 ( 70 )	329,867 ( 329,867 )
	追加型	1 ( 0 )	27,551 ( 0 )
	計	71 ( 70 )	357,419 ( 329,867 )
合 計		594 ( 278 )	5,391,100 ( 3,141,725 )

（ ）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】



< 更新後 >

- 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、当事業年度（平成27年4月1日から平成28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)	
		前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金及び預金	2	25,021,336	10,857,507
顧客分別金信託		-	20,006
前払費用		291,119	324,934
未収入金		41,860	81,347
未収委託者報酬		4,897,032	5,418,116
未収運用受託報酬		1,000,744	1,635,461
未収投資助言報酬		455,390	382,911
未収収益		13,030	28,813
繰延税金資産		475,859	494,032
その他の流動資産		52,473	6,226
流動資産合計		32,248,847	19,249,357
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		120,234	154,246
器具備品		230,712	240,748
有形固定資産合計		350,947	394,995
無形固定資産			
ソフトウェア		497,668	449,034
ソフトウェア仮勘定		77,155	146,452
電話加入権		91	79
商標権		222	60
無形固定資産合計		575,137	595,627
投資その他の資産			
投資有価証券		7,151,933	13,115,106
関係会社株式		509,146	10,412,523
長期差入保証金		600,480	603,625
長期前払費用		36,031	32,533
会員権		17,299	17,299
繰延税金資産		665,425	750,481
投資その他の資産合計		8,980,317	24,931,569
固定資産合計		9,906,402	25,922,192
資産合計		42,155,249	45,171,549

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
顧客からの預り金	-	0
その他の預り金	82,723	73,103
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	711	154
未払償還金	143,201	141,808
未払手数料	2,338,432	2,479,778
その他未払金	1,075,587	58,453
未払費用	2,095,111	2,092,669
未払消費税等	478,421	317,444
未払法人税等	454,520	992,491
賞与引当金	906,623	982,654
その他の流動負債	808	-
<b>流動負債合計</b>	<b>7,576,142</b>	<b>7,138,557</b>
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,633,080	3,028,212
賞与引当金	-	51,310
その他の固定負債	-	693
<b>固定負債合計</b>	<b>2,633,080</b>	<b>3,080,216</b>
<b>負債合計</b>	<b>10,209,222</b>	<b>10,218,774</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,000	2,000,000
<b>資本剰余金</b>		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
<b>資本剰余金合計</b>	<b>8,628,984</b>	<b>8,628,984</b>
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	284,245	284,245
<b>その他利益剰余金</b>		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	18,861,359	21,984,811
<b>利益剰余金合計</b>	<b>20,682,564</b>	<b>23,806,015</b>
<b>株主資本計</b>	<b>31,311,548</b>	<b>34,434,999</b>
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	634,478	517,775
<b>評価・換算差額等合計</b>	<b>634,478</b>	<b>517,775</b>
<b>純資産合計</b>	<b>31,946,027</b>	<b>34,952,774</b>
<b>負債・純資産合計</b>	<b>42,155,249</b>	<b>45,171,549</b>

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

営業収益		
委託者報酬	30,094,858	32,339,255
運用受託報酬	3,862,895	7,401,835
投資助言報酬	2,106,161	1,909,892
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	27,345	8,546
サービス支援手数料	18,274	74,038
その他	52,255	55,319
営業収益計	36,166,790	41,793,887
営業費用		
支払手数料	15,123,724	16,006,652
広告宣伝費	407,991	615,596
公告費	4,737	4,507
調査費		
調査費	1,319,743	1,624,477
委託調査費	3,550,675	4,106,366
営業雑経費		
通信費	38,911	43,662
印刷費	294,002	399,236
協会費	26,955	23,328
諸会費	18,577	22,650
情報機器関連費	2,403,857	2,557,200
販売促進費	28,281	31,271
その他	144,250	161,974
営業費用合計	23,361,707	25,596,925
一般管理費		
給料		
役員報酬	190,241	181,739
給料・手当	5,186,853	5,824,767
賞与	569,685	609,597
賞与引当金繰入額	906,623	1,033,964
交際費	22,609	26,912
寄付金	-	23
事務委託費	366,661	540,251
旅費交通費	226,254	277,212
租税公課	108,953	161,628
不動産賃借料	552,589	595,051
退職給付費用	387,799	701,070
固定資産減価償却費	287,833	334,024
諸経費	283,156	354,884
一般管理費合計	9,089,262	10,641,129
営業利益	3,715,820	5,555,832
営業外収益		
受取配当金	26,821	36,102
有価証券利息	1,187	-
受取利息	6,113	3,728
時効成立分配金・償還金	12	1,394
原稿・講演料	1,899	1,766
雑収入	7,324	19,472
営業外収益合計	43,357	62,465
営業外費用		

為替差損		14,361	51,385
営業外費用合計		14,361	51,385
経常利益		3,744,816	5,566,912
特別利益			
投資有価証券償還益		4,181	13,036
投資有価証券売却益		893,251	38,823
投資有価証券清算益		-	29,214
特別利益合計		897,432	81,075
特別損失			
固定資産除却損	2	1,076	5,300
投資有価証券償還損		-	2,313
投資有価証券売却損		1,091	8,184
その他の特別損失	3	973,862	-
特別損失合計		976,030	15,798
税引前当期純利益		3,666,218	5,632,188
法人税、住民税及び事業税		1,574,213	1,598,176
法人税等調整額		166,505	41,999
法人税等合計		1,740,718	1,556,177
当期純利益		1,925,499	4,076,011

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,227,103	21,048,308	31,677,292
会計方針の変更による 累積的影響額							439,043	439,043	439,043
会計方針の変更を反映した 当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,788,060	20,609,264	31,238,248
当期変動額									
剰余金の配当							1,852,200	1,852,200	1,852,200
当期純利益							1,925,499	1,925,499	1,925,499
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	73,299	73,299	73,299
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	657,238	657,238	32,334,530
会計方針の変更による 累積的影響額			439,043
会計方針の変更を反映した 当期首残高	657,238	657,238	31,895,486
当期変動額			

剰余金の配当			1,852,200
当期純利益			1,925,499
株主資本以外の項目 の当期変動額（純 額）	22,759	22,759	22,759
当期変動額合計	22,759	22,759	50,540
当期末残高	634,478	634,478	31,946,027

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548
当期変動額									
剰余金の配当							952,560	952,560	952,560
当期純利益							4,076,011	4,076,011	4,076,011
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,123,451	3,123,451	3,123,451
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,984,811	23,806,015	34,434,999

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	634,478	634,478	31,946,027
当期変動額			
剰余金の配当			952,560
当期純利益			4,076,011
株主資本以外の項目 の当期変動額（純 額）	116,703	116,703	116,703
当期変動額合計	116,703	116,703	3,006,747
当期末残高	517,775	517,775	34,952,774

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 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の見込額に基づき計上しております。

## 退職給付見込額の期間帰属方法

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

## 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

## (貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
建物	258,412千円	281,421千円
器具備品	783,602千円	758,541千円

## 2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
現金及び預金	18,853,119千円	4,716,352千円

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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	-千円	-千円

差引額	10,000,000千円	10,000,000千円
-----	--------------	--------------

## 4 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	355,376千円	296,815千円

## (損益計算書関係)

## 1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
受取利息	2,463千円	1,423千円

## 2 固定資産除却損

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
器具備品	1,076千円	5,300千円

## 3 その他の特別損失

その他の特別損失は、中国において同国国家税務総局が平成26年11月17日付で公布した財税[2014]79号通達に基づき、当社が委託者として運用する証券投資信託に関し、適格国外機関投資家として課される平成21年11月17日から平成26年11月16日までに行われた中国A株投資のキャピタル・ゲインに対して遡及的に徴される源泉所得税等について納付すべきと見込まれる金額を計上したものであります。

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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26年6月26日 定時株主総会	普通株式	1,852,200	105,000	平成26年 3月31日	平成26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27年6月30日開催の第30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27年6月30日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	952,560	54,000	平成27年 3月31日	平成27年 7月1日

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28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27年6月30日 定時株主総会	普通株式	952,560	54,000	平成27年 3月31日	平成27年 7月1日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの  
平成28年6月27日開催の第31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28年6月27日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,010,960	114,000	平成28年 3月31日	平成28年 6月28日

### (リース取引関係)

#### オペレーティング・リース取引

##### (借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
1年以内	572,402	579,592
1年超	1,340,637	756,470
合計	1,913,040	1,336,063

### (金融商品関係)

#### 1. 金融商品の状況に関する事項

##### (1) 金融商品に対する取組方針

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

##### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式及び50%出資した海外関連会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

##### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

###### 信用リスクの管理

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

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

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



## 市場リスクの管理

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

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

## (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	25,021,336	25,021,336	-
(2)顧客分別金信託	-	-	-
(3)未収委託者報酬	4,897,032	4,897,032	-
(4)未収運用受託報酬	1,000,744	1,000,744	-
(5)未収投資助言報酬	455,390	455,390	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	7,131,075	7,131,075	-
(7)長期差入保証金	600,480	600,480	-
資産計	39,106,059	39,106,059	-
(1)顧客からの預り金	-	-	-
(2)未払手数料	2,338,432	2,338,432	-
負債計	2,338,432	2,338,432	-

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	10,857,507	10,857,507	-
(2)顧客分別金信託	20,006	20,006	-
(3)未収委託者報酬	5,418,116	5,418,116	-
(4)未収運用受託報酬	1,635,461	1,635,461	-
(5)未収投資助言報酬	382,911	382,911	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	13,114,808	13,114,808	-
(7)長期差入保証金	603,625	603,625	-
資産計	32,032,437	32,032,437	-
(1)顧客からの預り金	0	0	-
(2)未払手数料	2,479,778	2,479,778	-
負債計	2,479,778	2,479,778	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

- (6)投資有価証券

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

- (7)長期差入保証金

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

負 債

- (1)顧客からの預り金、(2)未払手数料

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
其他有価証券		
非上場株式	298	298
投資証券	20,560	-
合計	20,858	298
子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	509,146	10,412,523
合計	509,146	10,412,523

其他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(6)其他有価証券」には含めておりません。

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成27年3月31日）

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	25,021,336	-	-	-
顧客分別金信託	-	-	-	-
未収委託者報酬	4,897,032	-	-	-
未収運用受託報酬	1,000,744	-	-	-
未収投資助言報酬	455,390	-	-	-
長期差入保証金	4,148	596,332	-	-
合計	31,378,651	596,332	-	-

当事業年度（平成28年3月31日）

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	10,857,507	-	-	-
顧客分別金信託	20,006	-	-	-
未収委託者報酬	5,418,116	-	-	-

未収運用受託報酬	1,635,461	-	-	-
未収投資助言報酬	382,911	-	-	-
長期差入保証金	537,057	66,567	-	-
合計	18,851,060	66,567	-	-

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成27年3月31日）

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式509,146千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（平成28年3月31日）

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式10,412,523千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	5,826,531	4,894,554	931,977
小計	5,826,531	4,894,554	931,977
(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	1,304,543	1,312,300	7,756
小計	1,304,543	1,312,300	7,756
合計	7,131,075	6,206,854	924,220

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 20,858千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（平成28年3月31日）

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	7,852,587	7,058,420	794,166
小計	7,852,587	7,058,420	794,166
(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	5,262,221	5,310,100	47,878
小計	5,262,221	5,310,100	47,878
合計	13,114,808	12,368,520	746,288

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 298千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
3,892,685	893,251	1,091

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
327,278	38,823	8,184

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

## 2. 確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：千円)	
	前事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,802,340	2,633,080
会計方針の変更による累積的影響額	682,168	-
会計方針の変更を反映した期首残高	2,484,508	2,633,080
勤務費用	217,881	225,881
利息費用	18,161	19,247
数理計算上の差異の発生額	276	285,510
退職給付の支払額	87,196	135,507
退職給付債務の期末残高	2,633,080	3,028,212

## (2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成27年 3月31日)	当事業年度 (平成28年 3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,633,080	3,028,212
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	2,633,080	3,028,212

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(単位：千円)	
	前事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)
勤務費用	217,881	225,881
利息費用	18,161	19,247
数理計算上の差異の費用処理額	276	285,510
その他	152,031	170,430
確定給付制度に係る退職給付費用	387,799	701,070

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

## (4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

	(単位：千円)	
	前事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)
割引率	0.731%	0.000%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度105,357千円、当事業年度125,210千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	299,729	303,247
調査費	77,863	74,734
未払金	321,602	44,028
未払事業税	49,504	67,598
その他	48,762	7,369
繰延税金資産小計	797,462	496,977
評価性引当額	321,602	2,945
繰延税金資産合計	475,859	494,032
固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	849,431	927,238
特定外国子会社留保金額	211,024	205,413
ソフトウェア償却	62,560	35,707
賞与引当金	-	15,834
投資有価証券評価損	43,051	95
その他	6,291	5,971
繰延税金資産小計	1,172,360	1,190,261
評価性引当額	217,192	211,267
繰延税金資産合計	955,168	978,994
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	289,742	228,513
繰延税金負債合計	289,742	228,513
繰延税金資産の純額	1,141,285	1,244,513

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	(単位：%)	
	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
法定実効税率	35.6%	33.0%
(調整)		
評価性引当額の増減	9.6	5.5
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.1
受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.5	0.0
住民税均等割等	0.2	0.1
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.7	1.3
所得税額控除による税額控除	1.3	1.5
その他	0.1	0.0
税効果会計適用後の法人税等の負担率	47.5	27.6

## 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等

の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産および繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.2%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.8%、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、30.6%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は62,206千円減少し、法人税等調整額が74,445千円、その他有価証券評価差額金が12,239千円、それぞれ増加しております。

## （セグメント情報等）

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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	30,094,858	3,862,895	2,106,161	102,874	36,166,790

#### (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。

### 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

### 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

### 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28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	32,339,255	7,401,835	1,909,892	142,903	41,793,887

## (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。

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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	(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 40 %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,527,962	未払手数料	289,954

(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。

## 2. 子会社及び関連会社等

(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
子会社	ソーラーエナジー投資合同会社	東京都港区	20,000	投資運用業	(所有) 直接100 %	投資事業有限責任組合の運営及び管理	出資の引受	20,000	-	-
関連会社	UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.	Singapore	6,000,000 (シンガポールドル)	投資運用業	(所有) 直接50 %	投信の販売委託 役員の兼任	増資の引受	136,110	-	-

(注) 1. ソーラーエナジー投資合同会社の出資の引受は、新規法人設立のため行ったものであります。

2. UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.の増資の引受については、当社とUOBアセットマネジメント社がそれぞれ1,500,000(シンガポールドル) 出資しました。

## 3. 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	SMB 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 役員の兼任	委託販売手数料	4,705,879	未払手数料	697,658

(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。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28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	(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 40	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,740,552	未払手数料	471,118

(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。

## 2. 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	SMB 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 役員の兼任	子会社株式の取得	9,877,717	-	-
							委託販売手数料	5,483,224	未払手数料	912,899

(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)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	1,810,999.27円	1,981,449.82円
1株当たり当期純利益金額	109,155.30円	231,066.40円

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

## 2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	1,925,499	4,076,011
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	1,925,499	4,076,011



期中平均株式数(株)	17,640	17,640
------------	--------	--------

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 5【その他】

<更新後>

### イ 定款の変更、その他の重要事項

平成28年6月27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2名増員し6名以内とする定款の変更が決議されました。

### ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

#### 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28年3月末現在)
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

[参考情報：再信託受託会社の概要]

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円(平成28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	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

資本金の額は、平成28年3月末現在。

(注) 損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社は、三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010の取扱いを行いません。

### 3【資本関係】

<更新後>

販売会社である株式会社三井住友銀行は、委託会社株式を10,584株(持株比率60.0%)保有していません。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成28年8月2日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽 一 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27年12月22日から平成28年6月21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28年6月21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27年12月22日から平成28年6月21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 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2 . X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成28年8月2日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽 一 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）2020の平成27年12月22日から平成28年6月21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28年6月21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27年12月22日から平成28年6月21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 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2 . X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成28年8月2日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽 一 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27年12月22日から平成28年6月21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28年6月21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27年12月22日から平成28年6月21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 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2 . X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

**独立監査人の中間監査報告書**

平成28年8月2日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽 一 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27年12月22日から平成28年6月21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28年6月21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27年12月22日から平成28年6月21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 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2 . X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

平成28年 6月17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 小 澤 陽 一 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 池ヶ谷 正 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27年4月1日から平成28年3月31日までの第31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28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

(注) 1．上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。2．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。