

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年9月12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バランスファンド（安定型） 三井住友・DCバランスファンド（安定成長型） 三井住友・DCバランスファンド（成長型）
【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30年9月13日から平成31年3月7日まで) 三井住友・DCバランスファンド（安定型） 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DCバランスファンド（安定成長型） 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友・DCバランスファンド（成長型） 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

三井住友・DCバランスファンド（安定型）

三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）

三井住友・DCバランスファンド（成長型）

以下上記3ファンドを総称して、あるいはそれぞれを「当ファンド」または「各ファンド」ということがあります。また、各ファンドそれぞれ（安定型）、（安定成長型）、（成長型）と略称することがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド2兆5,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、それぞれ「DC安定」、「DC安成」、「DC成長」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="http://www.smam-jp.com">http://www.smam-jp.com</a>

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

## ( 5 ) 【申込手数料】

無手数料です。

## ( 6 ) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社または前記「( 4 ) 発行( 売出 ) 価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

## ( 7 ) 【申込期間】

2018年9月13日から2019年3月7日まで

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

## ( 8 ) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

販売会社によっては一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

## ( 9 ) 【払込期日】

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

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

## ( 10 ) 【払込取扱場所】

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

## ( 11 ) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## ( 12 ) 【その他】

イ 申込証拠金  
ありません。

ロ 日本以外の地域における募集  
ありません。

## ハ スイッチング

販売会社によっては、「スイッチング」（ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること）による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。

## ニ クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用

ありません。

## ホ 振替受益権について

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

（参考：投資信託振替制度）

- ・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われます。
- ・受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます（原則として受益証券を保有することはできません。）。
- ・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。
- ・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、「国内株式マザーファンド（A号）」、「国内債券マザーファンド（B号）」、「外国株式マザーファンド（A号）」、「外国債券マザーファンド（A号）」（以下「マザーファンド」といいます。）への投資を通じて、実質的に、日本を含む世界各国の株式、公社債へ分散投資することにより、収益機会の拡大とリスクの低減効果を狙い、中長期的に信託財産の着実な成長を目指した運用を行います（このほか、各ファンドが内外の株式・公社債へ直接投資、または預金等の金融商品による運用を行うことも約款上認められています。）。
- ロ 各ファンドの運用にあたっては、株式、債券、現預金を各ファンド毎の基本資産配分の比率で加重平均した複合ベンチマークを、中長期的に上回る運用成果を目指します。詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。
- ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドとも金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

##### （イ）当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書または信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 （収益の源泉）	資産複合	目論見書または信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

##### （ロ）当ファンドが該当する属性区分

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

投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり(適時ヘッジ)	目論見書または信託約款において、適時対円で為替ヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載していません。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

## （２）【ファンドの沿革】

2001年10月4日	信託契約締結、設定、運用開始。
2002年12月1日	各ファンドの名称を「MLG・DCバランス（安定型）」、「MLG・DCバランス（安定成長型）」、「MLG・DCバランス（成長型）」から「三井住友・DCバランスファンド（安定型）」、「三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）」、「三井住友・DCバランスファンド（成長型）」に名称を変更。
2014年11月28日	投資対象マザーファンドについて、「国内債券マザーファンド（A号）」から「国内債券マザーファンド（B号）」に変更。

## （３）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

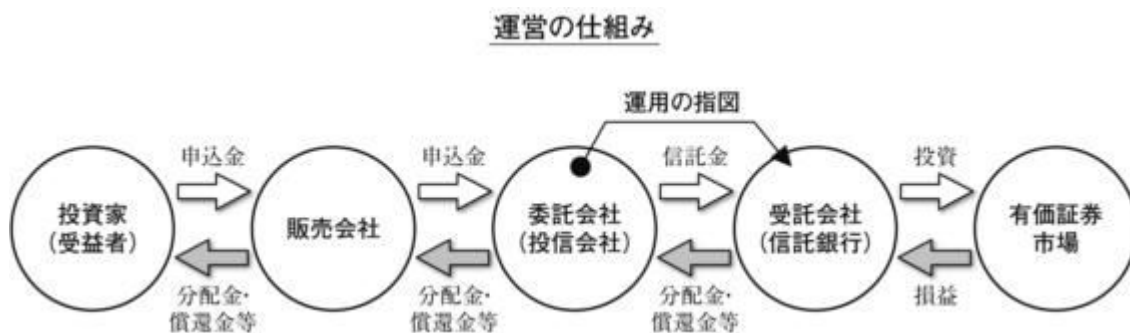
証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

（ロ）受託会社 「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。

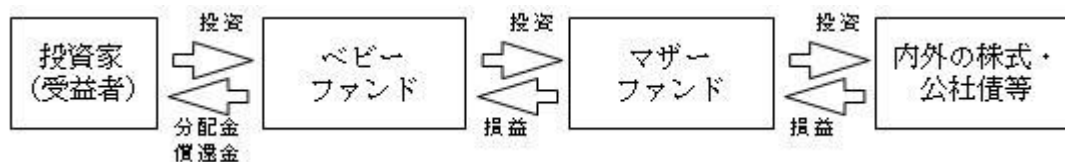
（ハ）販売会社

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け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

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



## □ 委託会社の概況

### (イ) 資本金の額

2,000百万円（2018年6月29日現在）

### (ロ) 会社の沿革

- 1985年7月15日 三生投資顧問株式会社設立
- 1987年2月20日 証券投資顧問業の登録
- 1987年6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可
- 1999年1月1日 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
- 1999年2月5日 三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
- 2000年1月27日 証券投資信託委託業の認可取得
- 2002年12月1日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2013年4月1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併

### (ハ) 大株主の状況

（2018年6月29日現在）

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### イ 基本方針

内外の株式・公社債に投資する4つのマザーファンドの組入れを通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債へ分散投資することにより、収益機会の拡大とリスクの低減効果を狙い、中長期的に信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

#### ロ 投資態度

(イ) 各ファンドにつき、株式、債券、現預金の基本的な資産配分とその上限と下限を定め、その範囲内で変更を行います。

	（安定型）			（安定成長型）			（成長型）		
	下限	基本	上限	下限	基本	上限	下限	基本	上限
株 式	10%	25%	40%	25%	45%	65%	50%	65%	80%
債 券	50%	70%	85%	30%	50%	70%	15%	30%	45%
現 預 金	0%	5%	20%	0%	5%	15%	0%	5%	15%

なお、基本資産配分と組入比率の上限と下限については、マクロ経済環境・金融市場動向



を想定して設定するため5年程度に一度見直します。

- (ロ) 当ファンドの運用は、株式... T O P I X（東証株価指数、配当込み）、債券... ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス総合（「NOMURA - B P I（総合）」）、現預金... 無担保コール翌日物を個別資産のベンチマークとし、それらを基本資産配分の比率で加重平均した複合ベンチマークに対し、資産配分の変更と個別資産毎の運用の両面で超過収益の獲得を目指し、複合ベンチマークを中長期的に上回る運用成果を目標とします。
- (ハ) 当ファンドの実質組入外貨建資産については、為替変動リスクが生じますが、外貨エクスポージャーをコントロールすることにより、ファンド全体の為替変動リスクを管理します。  
また、対円での為替ヘッジに限定せずに、全体的な投資収益を上昇させるため、割高な通貨を売り、割安な通貨を買うことに相当する為替取引を行うことがあります。  
外貨エクスポージャーとは、実質組入外貨建資産のうち対円での為替ヘッジが行われていない部分のファンド全体に対する比率のことで、0%を下限とし外貨建資産の実質組入比率を上限とします。
- (ニ) 運用にあたっては、まずマクロ経済環境分析、各資産市場評価を行い、総合的な検討を行った上で、各資産の配分、市場配分、通貨配分、業種配分の決定を行います。さらに各ファンドマネージャーが個別銘柄の選定を行います（トップダウンアプローチ）。
- (ホ) 資金動向、市場動向によっては、上記のような運用ができない場合やファンドの目的が達成されない場合があります。

## ファンドの特色

1

日本を含む世界各国の株式、債券に分散投資を行い、リスクを軽減しつつ、中長期的に信託財産の着実な成長を目指します。

■ 実際の運用は、内外の株式、債券に投資する4つのマザーファンドへの投資を通じて行います。

2

各ファンドにつき、株式、債券、現預金の基本的な資産配分と、その上限・下限を定め、その範囲内で変更を行います。

### [ 各ファンドの基本資産配分 ]

三井住友・DCバランスファンド		株式(内外)	債券(内外)	現預金
(安定型)	基本資産配分	25%	70%	5%
	変動幅	10~40%	50~85%	0~20%
(安定成長型)	基本資産配分	45%	50%	5%
	変動幅	25~65%	30~70%	0~15%
(成長型)	基本資産配分	65%	30%	5%
	変動幅	50~80%	15~45%	0~15%

\*基本資産配分と、組入比率の上限・下限については、マクロ経済環境・金融市場動向を想定して設定するため5年程度に一度見直します。

\*株式、債券については、各々国内と外国のファンド全体に対する組入比率の上限と下限を定め、その範囲内で組入れを行います。

3

株式、債券、現預金で構成する複合ベンチマークを設け、中長期的にベンチマークを上回る運用成果を目指します。

- 株式……TOPIX（東証株価指数、配当込み）、債券……NOMURA-BPI（総合）、現預金…無担保コール翌日物を個別資産のベンチマークとし、それらを各ファンドの基本資産配分の比率で加重平均した複合ベンチマークを中長期的に上回る運用成果を目指します。
- 各ファンドはそれぞれの複合ベンチマークに対して、資産配分の変更と個別資産毎の運用の両面で超過収益の獲得を目指します。

[ 各ファンドの複合ベンチマーク構成比 ]



4

外貨エクスポージャーのコントロールにより、ファンド全体の為替変動リスクを管理します。

- 各ファンドの実質組入外貨建資産については、為替変動リスクが生じますが、外貨エクスポージャーをコントロールすることにより、ファンド全体の為替変動リスクを把握します。
- 対円での為替ヘッジに限定せず、全体的な投資収益を上昇させるため、割高な通貨を売り、割安な通貨を買うことに相当する為替取引を行うことがあります。



外貨エクスポージャーとは

実質組入外貨建資産のうち対円での為替ヘッジが行われていない部分のファンド全体に対する比率のことで、0%を下限とし外貨建資産の実質組入比率を上限とします。

5

ファンドの運用はトップダウンアプローチにより行われます。

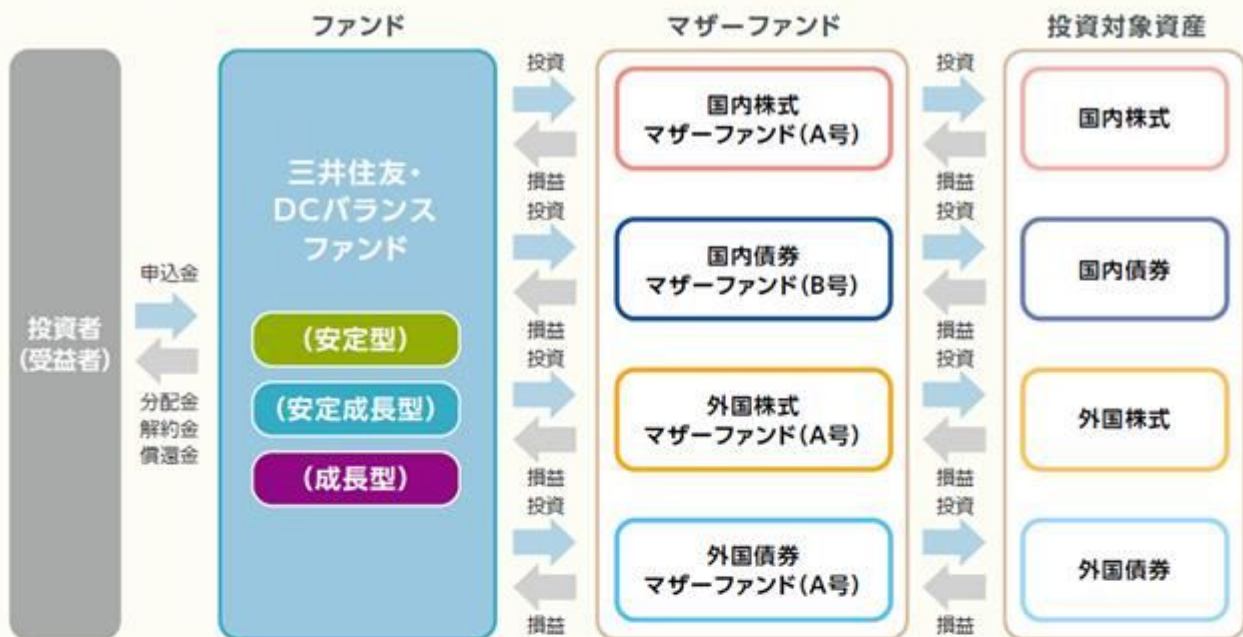
- 運用にあたっては、まずマクロ経済環境分析、各資産市場評価を行い、総合的な検討を行ったうえで、各資産の配分、市場配分、通貨配分、業種配分の決定を行います。さらにファンドマネージャーが個別銘柄の選定を行います。

※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。

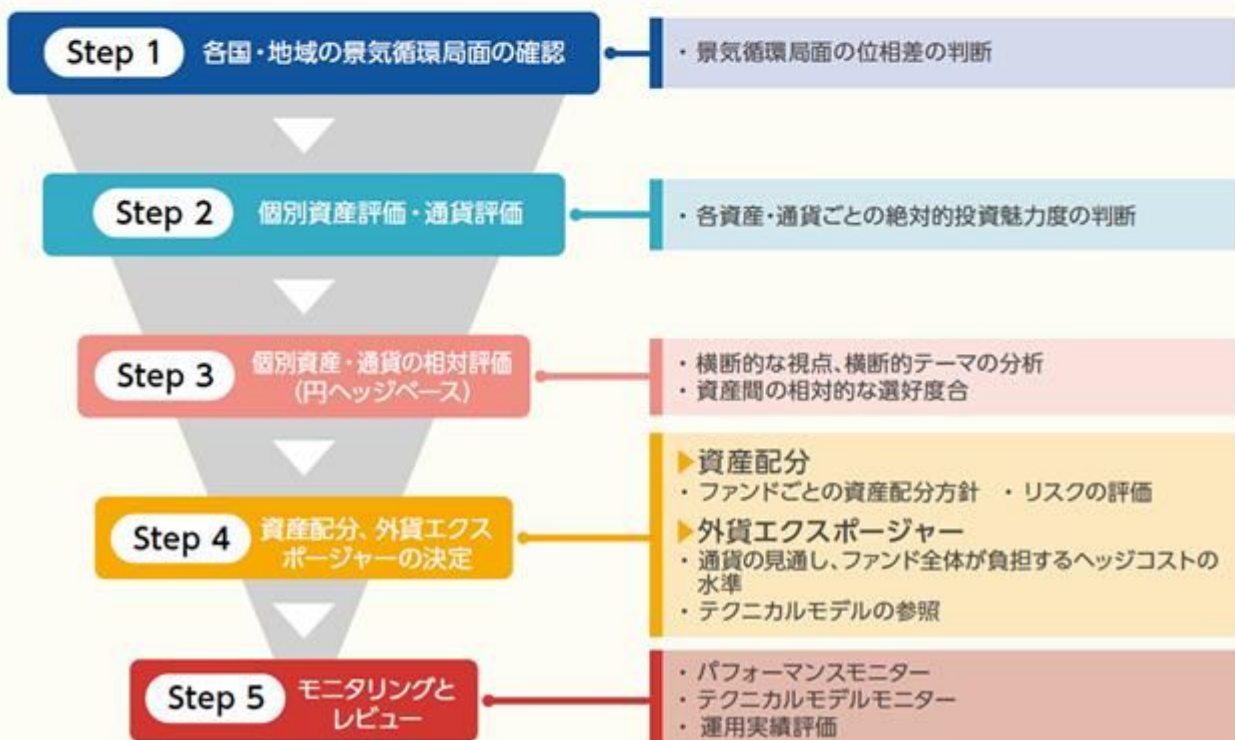


## ファンドのしくみ

■ファミリーファンド方式を採用し、内外の株式、債券に投資する4つのマザーファンドの組入れを通じて、実際の運用を行います。



## 運用(資産配分)プロセス



※上記の運用プロセスは2018年6月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

## ベンチマークおよび分配金再投資基準価額の推移

- ・以下のグラフは、ファンドの値動きのイメージをつかんでいただくため、ベンチマークおよびファンドの分配金再投資基準価額の推移と国内外の主要な出来事を合わせて記載したものです。
- ・分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。
- ・ファンドの将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

### ▶ (安定型)



※データは1998年6月末～2018年6月末。ファンド設定時を100として指数化。

※ベンチマーク(複合ベンチマーク)のデータは、当ファンドの基本資産配分で組み合わせたデータを用いて、委託会社が独自に計算したものであり、ベンチマークを構成する各指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンド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。

※ベンチマークの詳細は、前掲「ファンドの特色 3」をご覧ください。

分配金再投資基準価額とは

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と仮定して計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示します。

- 以下のグラフは、ファンドの値動きのイメージをつかんでいただくため、ベンチマークおよびファンドの分配金再投資基準価額の推移と国内外の主要な出来事を合わせて記載したものです。
- 分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。
- ファンドの将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

## ▶ (安定成長型)



※データは1998年6月末～2018年6月末。ファンド設定時を100として指数化。

※ベンチマーク(複合ベンチマーク)のデータは、当ファンドの基本資産配分で組み合わせたデータを用いて、委託会社が独自に計算したものであり、ベンチマークを構成する各指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンド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。

※ベンチマークの詳細は、前掲「ファンドの特色 3」をご覧ください。



- ・以下のグラフは、ファンドの値動きのイメージをつかんでいただくため、ベンチマークおよびファンドの分配金再投資基準価額の推移と国内外の主要な出来事を合わせて記載したものです。
- ・分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。
- ・ファンドの将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

## ▶ (成長型)



※データは1998年6月末～2018年6月末。ファンド設定時を100として指数化。

※ベンチマーク(複合ベンチマーク)のデータは、当ファンドの基本資産配分で組み合わせたデータを用いて、委託会社が独自に計算したものであり、ベンチマークを構成する各指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンド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。

※ベンチマークの詳細は、前掲「ファンドの特色 3」をご覧ください。

## (2) 【投資対象】

### イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. デリバティブ取引にかかる権利
3. 金銭債権
4. 約束手形

(ロ) 特定資産以外の資産で次に掲げるもの

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主としてマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

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

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

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

9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。）

17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）

20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（ただし、投資法人債券を除きます。以下同じ。）を以下「投資信託証券」といいます。

ハ 投資対象とする金融商品

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

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

### （3）【運用体制】

#### イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

##### （イ）計画（Plan）

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

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

##### （ロ）実行（Do）

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

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

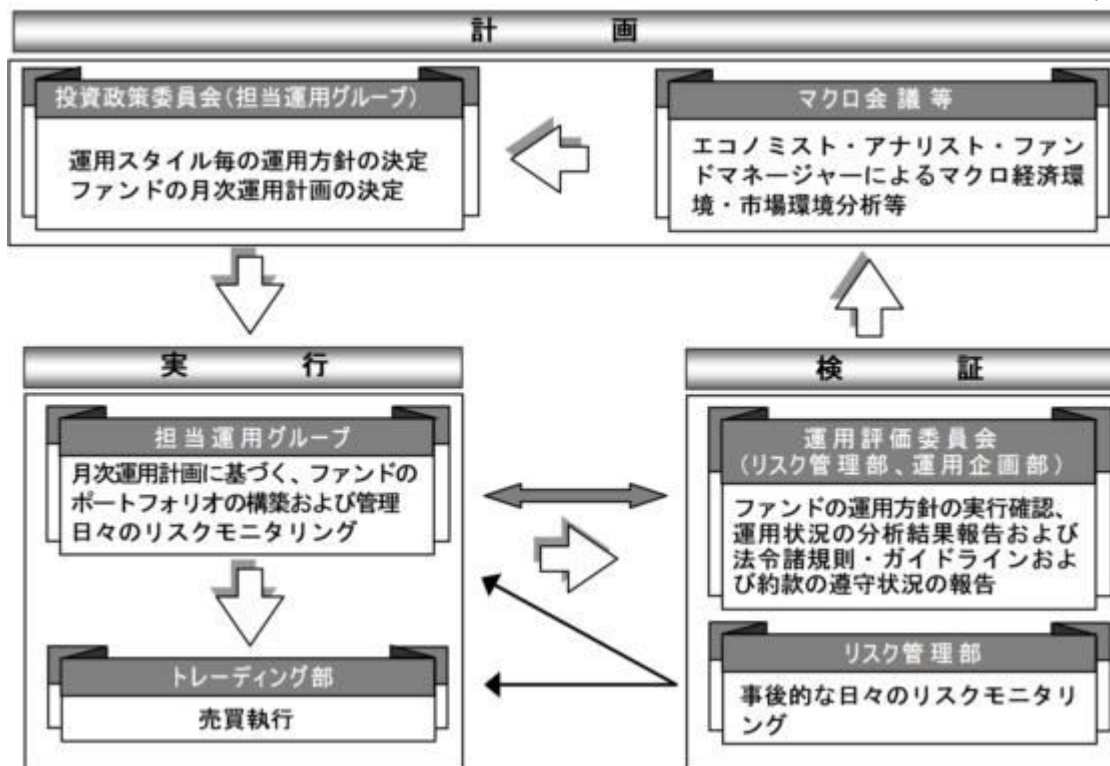
##### （ハ）検証（Check）

運用部門から組織的に分離されたリスク管理部が、約款の遵守状況等、ファンドの運営状況を日々モニタリングし、抵触があった場合直ちに担当運用グループへ状況確認がなされます。担当運用グループは対応結果をリスク管理部へ報告します。

運用評価委員会では、ファンドの運用方針の実行状況、運用状況の分析結果を確認します。また、運用の分析、評価結果、運用リスク状況、法令諸規則、運用ガイドライン、約款の遵守状況についても報告されます。

### 【ファンドの運用体制】





リスク管理部は11名程度、運用企画部は11名程度で構成されています。

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

毎決算時（12月15日。ただし、休業日の場合は翌日以降の最初の営業日とします。）に、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

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

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。

（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

（５）【投資制限】

以下、この「（５）投資制限」の記載は、特にファンドを特定しない限り各ファンド共通です。

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 各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。ただし、各マザーファンド受益証券への投資により実質的に保有する資産が、ロ以下のすべての条件を満たす範囲内とします。

- ロ 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に対して、以下の通りとします。
- |                        |       |
|------------------------|-------|
| 三井住友・DCバランスファンド（安定型）   | 40%以内 |
| 三井住友・DCバランスファンド（安定成長型） | 65%以内 |
| 三井住友・DCバランスファンド（成長型）   | 80%以内 |
- 実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます（以下同じ。）。
- ハ 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、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ニ 各マザーファンド受益証券を除く投資信託証券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。
- ホ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%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、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ト 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

##### イ 投資する株式等の範囲

- （イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- （ロ）上記（イ）にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

##### ロ 信用取引の指図

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

##### ハ 先物取引等の指図

- （イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
- （ロ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するた

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

- (ハ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

## ニ スワップ取引の指図

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

## ホ 金利先渡取引および為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するために、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ニ) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ホ) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。 )における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。 )までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。 )の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (ヘ) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。 )のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。 )を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日にお

ける現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### へ 有価証券の貸付けの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

(ロ) 上記(イ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### ト 公社債の空売りの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

#### チ 公社債の借入れの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。

(ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

(ニ) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁するものとします。

#### リ 特別の場合の外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には制約されることがあります。

#### ヌ 外国為替予約取引の指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

(ハ) 上記(ロ)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。またマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファン

ドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- (二) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するために外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

#### ル 資金の借入れ

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

#### ヲ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### 法令に基づく投資制限

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

（参考情報：マザーファンドの投資方針等）

（国内株式マザーファンド（A号））

（1）投資方針等

イ 基本方針

主として日本の取引所上場株式に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

（イ）TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークに対し同程度のリスクで、安定的に上回るリターンを目指します。

（ロ）実際の運用にあたっては、マクロ経済分析をもとにしたトップダウンアプローチで行い、委託会社独自に定めるユニバースを構成する業種毎の基準ウエイトから一定の範囲内で乖離をとる業種配分と、企業の中長期成長力およびバリュエーションを重視した銘柄選択により超過収益の獲得を目指します。

（ハ）株式の組入比率は、原則として高位とします。ただし、資金動向、市場動向によっては上記のような運用ができない場合やファンドの目的が達成されない場合があります。

（2）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針（2）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする各号（第1号から第21号まで）の有価証券（ただし、第12号は本邦通貨建表示のものとし、また、投資法人債券を除きます。）に投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

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

（3）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（ロ）新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

（ハ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

（ニ）外貨建資産への投資は行いません。

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

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

（国内債券マザーファンド（B号））

（1）投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

(イ) 主として日本の公社債に投資し、中長期的にNOMURA - B P I（総合）（以下「ベンチマーク」といいます。）を上回る投資成果を目指して運用を行います。

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

## (2) 投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

1. 国債証券
2. 地方債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
5. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
6. コマーシャル・ペーパー
7. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券の性質を有するもの
8. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
9. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
10. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
11. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
12. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
13. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

### ハ 投資対象とする金融商品

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

## (3) 投資制限

### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ロ) 国債、地方債および特別の法律により法人の発行する債券以外の債券を取得する場合は、主要格付機関のいずれかよりBBB格相当以上の格付けを得ていることを条件とします。

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



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

(外国株式マザーファンド(A号))

(1) 投資方針等

イ 基本方針

日本を除く世界各国の株式に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) M S C I コクサイインデックス(配当込み、円ベース)をベンチマークとし、中長期的にベンチマークに対し同程度のリスクで、安定的に上回るリターンを目指します。
- (ロ) 委託会社のエコノミスト、アナリストによる綿密かつ広範囲のリサーチにより、トップダウンおよびボトムアップ双方の視点から株価に十分織り込まれていない投資材料を見極め、リスクを取ることで超過収益の獲得を目指します。
- (ハ) 原則として対円で為替ヘッジを行いません。ただし、資産と通貨を別々に管理しており、株式市場の見通しと通貨の見通しとの双方の観点から資産の配分比率と通貨の配分比率との間に一定の範囲内で乖離をとる場合があります。
- (ニ) 株式組入比率は原則として高位とします。ただし資金動向、市場動向によっては上記のような運用ができない場合やファンドの目的が達成されない場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする各号(第1号から第21号まで)の有価証券(ただし、投資法人債券を除きます。)に投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
- (ロ) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ハ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ニ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (ホ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ヘ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率



は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## (外国債券マザーファンド(A号))

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

日本を除く世界各国の公社債に分散投資することにより、安定した成長と収益の確保を目指した運用を行います。

#### ロ 投資態度

- (イ) FTSE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、中長期的にベンチマークに対し同程度のリスクで安定的に上回るリターンを目指します。
- (ロ) 投資対象は欧米の主要格付機関からA格以上の格付けを取得している公社債を主としますが、信用リスクや利回り格差等を考慮して、A格未満の格付けの公社債を信託財産の純資産総額の5%以内で組み入れることもあります。
- (ハ) 実際の運用にあたっては、マクロ経済分析や市場分析による金利予測に基づいて、市場配分、デュレーション、満期構成を決定し、ベンチマークとの乖離が主要な超過収益となるアクティブ運用を行います。ただし、ベンチマークとの乖離は一定の範囲内にとどめることとし、リスクをコントロールします。  
また、市場毎に利回り格差や流動性を考慮して、債券種別の配分、銘柄選択においても超過収益の獲得を目指します。
- (ニ) 原則として対円での為替ヘッジを行いません。ただし、資産と通貨を別々に管理しており、債券市場の見通しと通貨の見通しとの双方の観点から資産の配分比率と通貨の配分比率との間に一定の範囲内で乖離をとる場合があります。
- (ホ) 債券組入比率は原則として高位とします。ただし資金動向、市場動向によっては上記のような運用ができない場合やファンドの目的が達成されない場合があります。

### (2) 投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第2号から第6号、第10号、第12号(ただし、第2号から第6号および第10号の性質を有するものに限り、)から第15号および第18号から第21号に掲げるものに投資します。ただし、投資信託証券については、株券または新株の引受権を表示する証券もしくは証書に投資するものを除きます。また、投資法人債券には投資しません。

#### ハ 投資対象とする金融商品

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

### (3) 投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ロ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (ハ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エク

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

### 3【投資リスク】

#### イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、主に内外の株式や債券を投資対象としています（マザーファンドを通じて間接的に投資する場合を含みます。）。当ファンドの基準価額は、組み入れた株式や債券の値動き、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。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おりません。

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

#### （イ）株式市場リスク

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

#### （ロ）債券市場リスク

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

#### （ハ）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) ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

(チ) 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。

(リ) 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

### 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

#### ■三井住友・DCバランスファンド(安定型)



### 「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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

#### ■ファンド： 2013年7月～2018年6月

#### ■他の資産クラス： 2013年7月～2018年6月



#### ■三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)



#### ■ファンド： 2013年7月～2018年6月

#### ■他の資産クラス： 2013年7月～2018年6月



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。



## 【ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移】

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

### ■三井住友・DCバランスファンド(成長型)



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

## 【ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較】

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



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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 各資産クラスの指数

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

無手数料です。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額に年1.512%（税抜き1.4%）の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日とします。）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。

< 信託報酬の配分（税抜き） >

支払先	料率	役務の内容
委託会社	年0.65%	ファンド運用の指図等の対価
販売会社	年0.65%	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	年0.1%	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

上記の各支払先の料率には別途消費税等相当額がかかります。

(4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0054%（税抜き0.005%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日とします。）と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

- イ 個別元本について

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

#### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

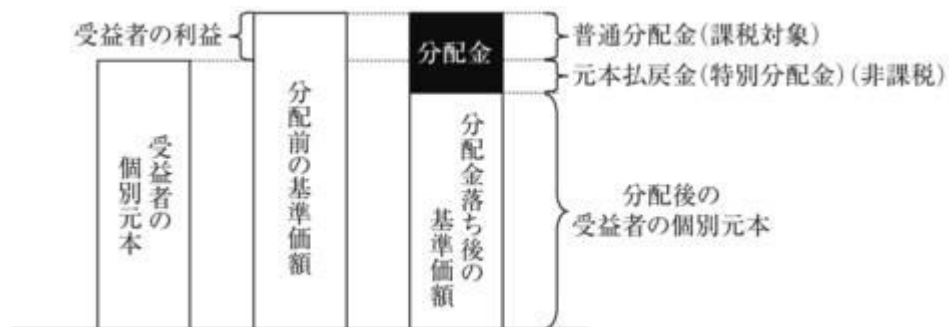
#### ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

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

・一部解約時および償還時

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

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%以内とします。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

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

上記「（5）課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2018年6月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

## 5【運用状況】

### （1）【投資状況】

三井住友・DCバランスファンド（安定型）

2018年 6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	211,390,631	96.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,782,923	3.55
合計(純資産総額)		219,173,554	100.00

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

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		5,673,018	2.58
	売建		32,138,380	14.66

### 三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)

2018年 6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	520,560,243	96.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		16,331,256	3.04
合計(純資産総額)		536,891,499	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		4,220,700	0.78
	売建		71,956,160	13.40

### 三井住友・DCバランスファンド(成長型)

2018年 6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	286,541,624	96.43
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		10,612,407	3.57
合計(純資産総額)		297,154,031	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		2,071,980	0.69

	売建		44,313,610	14.91
--	----	--	------------	-------

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・DCバランスファンド(安定型)

## イ 主要投資銘柄

2018年 6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	国内債券マザーファンド(B号)	84,563,988	1.3913	117,660,338	1.3985	118,262,737	53.96
日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド(A号)	31,717,054	1.2380	39,266,386	1.2227	38,780,441	17.69
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド(A号)	11,423,443	2.6483	30,252,705	2.6027	29,731,795	13.57
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド(A号)	11,062,720	2.2026	24,367,010	2.2251	24,615,658	11.23

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

2018年 6月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.45
合計	96.45

三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)

## イ 主要投資銘柄

2018年 6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	国内債券マザーファンド(B号)	156,115,651	1.3919	217,297,375	1.3985	218,327,737	40.67
日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド(A号)	138,658,990	1.2386	171,751,352	1.2227	169,538,347	31.58
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド(A号)	44,969,609	2.2003	98,949,320	2.2251	100,061,876	18.64
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド(A号)	12,537,858	2.6073	32,689,958	2.6027	32,632,283	6.08

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

2018年 6月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.96
合計	96.96

## 三井住友・DCバランスファンド(成長型)

## イ 主要投資銘柄

2018年 6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	国内株式マザーファンド(A号)	103,555,321	1.2409	128,505,178	1.2227	126,617,090	42.61
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド(A号)	34,996,227	2.1983	76,933,714	2.2251	77,870,104	26.21
日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド(B号)	51,091,545	1.3922	71,129,649	1.3985	71,451,525	24.05
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド(A号)	4,073,810	2.6083	10,625,719	2.6027	10,602,905	3.57

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

2018年 6月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.43
合計	96.43

## 【投資不動産物件】

## 三井住友・DCバランスファンド(安定型)

該当事項はありません。

## 三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)

該当事項はありません。

## 三井住友・DCバランスファンド(成長型)

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バランスファンド(安定型)

2018年 6月29日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	51,400.00	5,626,912	5,673,018	2.58
	米ドル	売建	176,000.00	19,393,123	19,425,120	8.86
	ユーロ	売建	99,400.00	12,838,218	12,713,260	5.80

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

### 三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）

2018年 6月29日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	ユーロ	買建	33,000.00	4,217,367	4,220,700	0.78
	米ドル	売建	448,000.00	49,364,313	49,445,760	9.20
	ユーロ	売建	176,000.00	22,847,246	22,510,400	4.19

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

### 三井住友・DCバランスファンド（成長型）

2018年 6月29日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	ユーロ	買建	16,200.00	2,070,343	2,071,980	0.69
	米ドル	売建	303,000.00	33,387,024	33,442,110	11.25
	ユーロ	売建	85,000.00	11,034,181	10,871,500	3.65

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

### （3）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

### 三井住友・DCバランスファンド（安定型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額 (円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第8期 (2008年12月15日)	162,452,097	162,452,097	9,125	9,125
第9期 (2009年12月15日)	185,411,716	185,411,716	9,656	9,656
第10期 (2010年12月15日)	123,469,191	123,469,191	9,930	9,930

第11期	(2011年12月15日)	132,933,215	132,933,215	9,490	9,490
第12期	(2012年12月17日)	154,234,796	154,234,796	10,123	10,123
第13期	(2013年12月16日)	171,016,147	171,016,147	11,277	11,277
第14期	(2014年12月15日)	193,650,525	193,650,525	12,095	12,095
第15期	(2015年12月15日)	194,962,056	194,962,056	12,239	12,239
第16期	(2016年12月15日)	201,719,250	201,719,250	12,433	12,433
第17期	(2017年12月15日)	213,524,340	213,524,340	12,995	12,995
	2017年 6月末日	199,346,768		12,534	
	7月末日	198,339,503		12,564	
	8月末日	197,897,133		12,621	
	9月末日	200,166,755		12,747	
	10月末日	204,945,494		12,899	
	11月末日	214,275,440		12,971	
	12月末日	213,708,367		13,085	
	2018年 1月末日	217,618,030		13,167	
	2月末日	215,741,606		12,947	
	3月末日	216,136,190		12,783	
	4月末日	217,665,817		12,876	
	5月末日	219,012,071		12,843	
	6月末日	219,173,554		12,825	

## 三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第8期 (2008年12月15日)	238,311,072	238,311,072	8,769	8,769
第9期 (2009年12月15日)	296,721,157	296,721,157	9,543	9,543
第10期 (2010年12月15日)	271,704,608	271,704,608	10,002	10,002
第11期 (2011年12月15日)	268,447,751	268,447,751	9,153	9,153
第12期 (2012年12月17日)	322,872,084	322,872,084	10,036	10,036
第13期 (2013年12月16日)	403,183,809	403,183,809	12,068	12,068
第14期 (2014年12月15日)	420,847,336	420,847,336	13,250	13,250
第15期 (2015年12月15日)	444,047,636	444,047,636	13,581	13,581
第16期 (2016年12月15日)	470,354,291	470,354,291	13,929	13,929
第17期 (2017年12月15日)	531,244,503	531,244,503	15,086	15,086
	2017年 6月末日	485,654,015		14,197
	7月末日	485,175,168		14,256
	8月末日	491,268,892		14,305
	9月末日	500,590,869		14,589
	10月末日	512,827,331		14,920
	11月末日	520,807,630		15,048

12月末日	545,943,587		15,263
2018年 1月末日	550,921,370		15,477
2月末日	537,453,436		15,081
3月末日	533,691,787		14,750
4月末日	540,321,552		14,949
5月末日	536,507,944		14,911
6月末日	536,891,499		14,863

## 三井住友・DCバランスファンド（成長型）

年月日	純資産総額 （円）		1万口当たりの 純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第8期 (2008年12月15日)	147,843,931	147,843,931	8,133	8,133
第9期 (2009年12月15日)	182,351,090	182,351,090	9,090	9,090
第10期 (2010年12月15日)	128,709,073	128,709,073	9,585	9,585
第11期 (2011年12月15日)	127,601,922	127,601,922	8,393	8,393
第12期 (2012年12月17日)	161,560,742	161,560,742	9,448	9,448
第13期 (2013年12月16日)	202,164,000	202,164,000	12,235	12,235
第14期 (2014年12月15日)	218,572,062	218,572,062	13,714	13,714
第15期 (2015年12月15日)	237,546,681	237,546,681	14,214	14,214
第16期 (2016年12月15日)	257,072,805	257,072,805	14,646	14,646
第17期 (2017年12月15日)	276,171,202	276,171,202	16,361	16,361
2017年 6月末日	257,222,606		15,101	
7月末日	261,962,017		15,200	
8月末日	262,806,483		15,234	
9月末日	268,778,189		15,658	
10月末日	279,813,579		16,139	
11月末日	276,224,670		16,313	
12月末日	278,080,876		16,611	
2018年 1月末日	296,916,787		16,943	
2月末日	287,212,275		16,405	
3月末日	287,104,495		15,961	
4月末日	295,435,226		16,273	
5月末日	296,409,396		16,216	
6月末日	297,154,031		16,150	

## 【分配の推移】

## 三井住友・DCバランスファンド（安定型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第8期	2007年12月18日～2008年12月15日	0
第9期	2008年12月16日～2009年12月15日	0
第10期	2009年12月16日～2010年12月15日	0
第11期	2010年12月16日～2011年12月15日	0
第12期	2011年12月16日～2012年12月17日	0
第13期	2012年12月18日～2013年12月16日	0
第14期	2013年12月17日～2014年12月15日	0
第15期	2014年12月16日～2015年12月15日	0
第16期	2015年12月16日～2016年12月15日	0
第17期	2016年12月16日～2017年12月15日	0

## 三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第8期	2007年12月18日～2008年12月15日	0
第9期	2008年12月16日～2009年12月15日	0
第10期	2009年12月16日～2010年12月15日	0
第11期	2010年12月16日～2011年12月15日	0
第12期	2011年12月16日～2012年12月17日	0
第13期	2012年12月18日～2013年12月16日	0
第14期	2013年12月17日～2014年12月15日	0
第15期	2014年12月16日～2015年12月15日	0
第16期	2015年12月16日～2016年12月15日	0
第17期	2016年12月16日～2017年12月15日	0

## 三井住友・DCバランスファンド（成長型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第8期	2007年12月18日～2008年12月15日	0
第9期	2008年12月16日～2009年12月15日	0
第10期	2009年12月16日～2010年12月15日	0
第11期	2010年12月16日～2011年12月15日	0
第12期	2011年12月16日～2012年12月17日	0
第13期	2012年12月18日～2013年12月16日	0
第14期	2013年12月17日～2014年12月15日	0
第15期	2014年12月16日～2015年12月15日	0
第16期	2015年12月16日～2016年12月15日	0
第17期	2016年12月16日～2017年12月15日	0

## 【収益率の推移】

## 三井住友・DCバランスファンド（安定型）

	収益率（％）
第8期	17.0
第9期	5.8
第10期	2.8
第11期	4.4
第12期	6.7
第13期	11.4
第14期	7.3
第15期	1.2
第16期	1.6
第17期	4.5
第18期（中間期）	0.4

（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。

## 三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）

	収益率（％）
第8期	25.8
第9期	8.8
第10期	4.8
第11期	8.5
第12期	9.6
第13期	20.2
第14期	9.8
第15期	2.5
第16期	2.6
第17期	8.3
第18期（中間期）	0.2

（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。

## 三井住友・DCバランスファンド（成長型）

	収益率（％）
第8期	34.4



第9期	11.8
第10期	5.4
第11期	12.4
第12期	12.6
第13期	29.5
第14期	12.1
第15期	3.6
第16期	3.0
第17期	11.7
第18期（中間期）	1.0

（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バランスファンド（安定型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第8期	21,009,295	5,635,743
第9期	27,546,021	13,551,649
第10期	24,021,515	91,696,095
第11期	21,723,883	5,987,063
第12期	24,007,413	11,722,365
第13期	41,863,007	42,582,662
第14期	26,877,673	18,418,719
第15期	19,553,674	20,366,616
第16期	16,903,981	13,945,073
第17期	27,169,884	25,105,893
第18期（中間期）	10,580,580	4,500,462

（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バランスファンド（安定成長型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第8期	45,084,182	41,670,604
第9期	43,592,925	4,442,330
第10期	37,872,808	77,159,914
第11期	41,116,710	19,469,521
第12期	39,563,804	11,128,291
第13期	48,754,311	36,382,217
第14期	43,122,250	59,598,131

第15期	35,396,094	26,051,670
第16期	29,757,139	19,038,681
第17期	38,264,679	23,802,398
第18期(中間期)	21,141,194	13,089,838

(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バランスファンド(成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第8期	20,970,292	8,083,826
第9期	24,954,564	6,134,525
第10期	28,555,737	94,882,802
第11期	25,666,931	7,915,996
第12期	34,549,553	15,574,858
第13期	35,863,506	41,626,888
第14期	17,359,549	23,221,845
第15期	25,035,109	17,286,266
第16期	21,278,735	12,882,481
第17期	24,011,241	30,733,506
第18期(中間期)	18,901,029	4,198,456

(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

#### 国内株式マザーファンド(A号)

2018年 6月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	860,698,100	97.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		19,832,646	2.25
合計(純資産総額)		880,530,746	100.00

#### 国内債券マザーファンド(B号)

2018年 6月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	101,181,969,260	48.69

地方債証券	日本	33,951,631,200	16.34
特殊債証券	日本	38,775,415,582	18.66
社債証券	日本	32,245,324,000	15.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,638,771,658	0.79
合計(純資産総額)		207,793,111,700	100.00

## 外国株式マザーファンド(A号)

2018年 6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	888,159,061	67.82
	イギリス	97,449,653	7.44
	フランス	75,666,821	5.78
	スイス	37,361,521	2.85
	オランダ	20,184,842	1.54
	香港	19,501,475	1.49
	カナダ	19,454,677	1.49
	アイルランド	18,922,513	1.44
	イタリア	17,729,447	1.35
	オーストラリア	14,471,210	1.10
	キュラソー	13,466,445	1.03
	ドイツ	10,607,798	0.81
	スウェーデン	10,565,793	0.81
	オーストリア	7,970,360	0.61
	ルクセンブルグ	6,679,187	0.51
	ジャージー	6,462,034	0.49
	ノルウェー	6,426,008	0.49
シンガポール	6,406,323	0.49	
小計		1,277,485,168	97.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		32,164,108	2.46
合計(純資産総額)		1,309,649,276	100.00

## 外国債券マザーファンド(A号)

2018年 6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	1,818,577,046	43.03
	フランス	637,530,979	15.09
	スペイン	497,109,065	11.76

	イギリス	289,284,495	6.85
	ドイツ	255,932,293	6.06
	ベルギー	193,289,482	4.57
	オーストラリア	89,520,055	2.12
	イタリア	76,315,647	1.81
	カナダ	63,146,743	1.49
	メキシコ	32,437,860	0.77
	ポーランド	26,822,167	0.63
	アイルランド	25,960,255	0.61
	スウェーデン	20,221,170	0.48
	マレーシア	16,834,252	0.40
	シンガポール	16,580,774	0.39
	ノルウェー	10,239,075	0.24
	小計	4,069,801,358	96.30
地方債証券	カナダ	28,302,157	0.67
社債券	アメリカ	42,840,641	1.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		85,209,071	2.02
合計(純資産総額)		4,226,153,227	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		144,255,000	3.41
	売建		145,236,400	3.43

## (2) 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### 国内株式マザーファンド(A号)

##### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2018年 6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 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	4,300	6,980.87	30,017,780	7,170.00	30,831,000	3.50
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	33,500	788.71	26,421,960	631.10	21,141,850	2.40
日本	株式	キーエンス	電気機器	300	63,431.25	19,029,375	62,560.00	18,768,000	2.13
日本	株式	日本電産	電気機器	1,100	15,748.61	17,323,473	16,625.00	18,287,500	2.08
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	3,400	5,286.57	17,974,371	5,036.00	17,122,400	1.94

日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,800	8,861.11	15,949,998	7,973.00	14,351,400	1.63
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	4,900	2,709.29	13,275,521	2,822.50	13,830,250	1.57
日本	株式	関西電力	電気・ガス業	8,200	1,334.07	10,939,423	1,616.00	13,251,200	1.50
日本	株式	スズキ	輸送用機器	2,000	6,278.21	12,556,424	6,118.00	12,236,000	1.39
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	65,200	198.92	12,969,584	186.50	12,159,800	1.38
日本	株式	信越化学工業	化学	1,200	11,359.17	13,631,004	9,873.00	11,847,600	1.35
日本	株式	キリンホールディングス	食料品	3,900	2,826.48	11,023,300	2,963.00	11,555,700	1.31
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	5,600	1,962.93	10,992,454	2,007.50	11,242,000	1.28
日本	株式	エーザイ	医薬品	1,400	6,491.02	9,087,428	7,804.00	10,925,600	1.24
日本	株式	任天堂	その他製品	300	43,030.00	12,909,000	36,200.00	10,860,000	1.23
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,500	3,009.33	10,532,655	3,078.00	10,773,000	1.22
日本	株式	第一三共	医薬品	2,500	3,729.67	9,324,175	4,237.00	10,592,500	1.20
日本	株式	ヤクルト本社	食料品	1,400	7,788.14	10,903,398	7,400.00	10,360,000	1.18
日本	株式	東京瓦斯	電気・ガス業	3,500	2,716.32	9,507,144	2,940.50	10,291,750	1.17
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	3,300	2,622.39	8,653,887	3,066.00	10,117,800	1.15
日本	株式	福山通運	陸運業	1,700	4,462.60	7,586,420	5,660.00	9,622,000	1.09
日本	株式	王子ホールディングス	パルプ・紙	14,000	715.03	10,010,420	687.00	9,618,000	1.09
日本	株式	村田製作所	電気機器	500	16,107.10	8,053,554	18,620.00	9,310,000	1.06
日本	株式	富士電機	電気機器	11,000	799.15	8,790,718	844.00	9,284,000	1.05
日本	株式	D.A.コンソーシアムホールディングス	サービス業	3,000	2,252.48	6,757,445	3,090.00	9,270,000	1.05
日本	株式	三井不動産	不動産業	3,400	2,838.44	9,650,696	2,674.00	9,091,600	1.03
日本	株式	大和ハウス工業	建設業	2,400	4,192.20	10,061,303	3,776.00	9,062,400	1.03
日本	株式	ソニー	電気機器	1,600	5,139.04	8,222,471	5,664.00	9,062,400	1.03
日本	株式	日本ユニシス	情報・通信業	3,200	2,400.35	7,681,120	2,784.00	8,908,800	1.01
日本	株式	三菱電機	電気機器	6,000	1,736.41	10,418,502	1,474.50	8,847,000	1.00

## □ 種類別・業種別の投資比率

2018年 6月29日現在

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	4.96
		食料品	4.10
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	1.09
		化学	5.42
		医薬品	5.88
		石油・石炭製品	1.17
		非鉄金属	1.12
		機械	2.30
		電気機器	14.11

	輸送用機器	7.15
	精密機器	1.22
	その他製品	2.96
	電気・ガス業	2.67
	陸運業	3.57
	海運業	0.33
	空運業	0.54
	情報・通信業	8.75
	卸売業	3.73
	小売業	6.66
	銀行業	5.81
	証券、商品先物取引業	0.63
	保険業	2.82
	その他金融業	0.92
	不動産業	3.62
	サービス業	5.74
合計		97.75

## 国内債券マザーファンド（B号）

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2018年 6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 (%)
日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	19,180,000,000	113.11	21,694,542,200	113.71	21,809,961,600	1.200	2035/9/20	10.50
日本	国債証券	第153回利付国債(20年)	7,780,000,000	114.90	8,939,718,400	115.40	8,978,120,000	1.300	2035/6/20	4.32
日本	地方債証券	第174回共同発行市場公募地方債	6,400,000,000	99.89	6,393,257,000	99.86	6,391,232,000	0.145	2027/9/24	3.08
日本	国債証券	第118回利付国債(20年)	5,200,000,000	122.36	6,362,836,000	122.25	6,357,052,000	2.000	2030/6/20	3.06
日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	4,340,000,000	120.90	5,247,146,800	121.00	5,251,660,400	1.700	2033/6/20	2.53
日本	国債証券	第128回利付国債(20年)	4,100,000,000	122.06	5,004,700,000	122.10	5,006,264,000	1.900	2031/6/20	2.41
日本	国債証券	第111回利付国債(20年)	3,790,000,000	123.43	4,677,997,000	123.04	4,663,519,200	2.200	2029/6/20	2.24
日本	特殊債券	第10回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	4,400,000,000	100.03	4,401,441,000	100.11	4,405,016,000	0.001	2022/2/25	2.12
日本	国債証券	第388回利付国債(2年)	3,950,000,000	100.46	3,968,301,000	100.44	3,967,380,000	0.100	2020/5/15	1.91
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,620,000,000	103.32	3,740,184,000	103.25	3,737,794,800	0.400	2025/6/20	1.80
日本	国債証券	第164回利付国債(20年)	3,500,000,000	99.76	3,491,826,000	100.08	3,503,115,000	0.500	2038/3/20	1.69
日本	国債証券	第141回利付国債(20年)	2,800,000,000	120.58	3,376,492,000	120.66	3,378,704,000	1.700	2032/12/20	1.63
日本	国債証券	第10回利付国債(40年)	2,900,000,000	102.20	2,963,839,000	102.05	2,959,450,000	0.900	2057/3/20	1.42

日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	2,820,000,000	101.00	2,848,200,000	101.16	2,852,740,200	0.100	2026/3/20	1.37
日本	国債証券	第134回利付国債（20年）	2,300,000,000	121.79	2,801,273,000	121.52	2,794,960,000	1.800	2032/3/20	1.35
日本	国債証券	第121回利付国債（20年）	2,100,000,000	121.46	2,550,660,000	121.36	2,548,602,000	1.900	2030/9/20	1.23
日本	国債証券	第138回利付国債（20年）	2,130,000,000	117.48	2,502,387,900	117.58	2,504,517,900	1.500	2032/6/20	1.21
日本	社債券	第5回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	2,000,000,000	100.00	2,000,000,000	99.94	1,998,920,000	0.110	2023/6/6	0.96
日本	社債券	第44回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	2,000,000,000	99.74	1,994,860,000	99.71	1,994,340,000	0.030	2020/6/19	0.96
日本	特殊債券	第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,900,000,000	102.22	1,942,313,000	101.84	1,935,112,000	1.200	2019/12/27	0.93
日本	特殊債券	第31回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	1,900,000,000	100.36	1,906,954,000	100.36	1,907,011,000	0.074	2021/11/17	0.92
日本	国債証券	第147回利付国債（20年）	1,440,000,000	119.50	1,720,857,600	119.74	1,724,371,200	1.600	2033/12/20	0.83
日本	地方債証券	第231回神奈川県公募債	1,700,000,000	100.46	1,707,899,000	100.51	1,708,721,000	0.220	2027/12/20	0.82
日本	社債券	第7回日本電産株式会社無担保社債	1,700,000,000	99.90	1,698,436,000	99.87	1,697,858,000	0.114	2022/8/30	0.82
日本	国債証券	第34回利付国債（30年）	1,260,000,000	133.73	1,685,010,600	134.40	1,693,465,200	2.200	2041/3/20	0.81
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	1,570,000,000	103.36	1,622,830,500	103.33	1,622,359,500	0.400	2025/9/20	0.78
日本	特殊債券	第53回地方公共団体金融機構債券	1,500,000,000	103.70	1,555,545,000	103.49	1,552,425,000	0.739	2023/10/27	0.75
日本	国債証券	第45回利付国債（30年）	1,200,000,000	119.66	1,435,980,000	120.41	1,445,028,000	1.500	2044/12/20	0.70
日本	国債証券	第135回利付国債（20年）	1,200,000,000	120.14	1,441,752,000	120.18	1,442,196,000	1.700	2032/3/20	0.69
日本	国債証券	第150回利付国債（20年）	1,220,000,000	116.50	1,421,348,800	116.92	1,426,448,400	1.400	2034/9/20	0.69

## ロ 種類別の投資比率

2018年 6月29日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	48.69
地方債証券	16.34
特殊債券	18.66
社債券	15.52
合計	99.21

## 外国株式マザーファンド（A号）

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2018年 6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	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	310	117,659.70	36,474,508	124,554.26	38,611,821	2.95
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,778	19,100.99	33,961,563	20,505.16	36,458,192	2.78
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	159	133,985.43	21,303,684	188,078.28	29,904,447	2.28
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	2,006	13,132.10	26,342,999	13,890.45	27,864,255	2.13
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	1,014	24,601.18	24,945,603	27,071.24	27,450,243	2.10
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	4,423	4,872.78	21,552,323	5,444.09	24,079,232	1.84
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	7,589	3,255.48	24,705,882	3,169.18	24,050,921	1.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1,783	11,685.29	20,834,888	11,598.96	20,680,950	1.58
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	710	28,511.10	20,242,884	27,071.24	19,220,585	1.47
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	1,316	15,548.52	20,461,854	13,485.87	17,747,418	1.36
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	794	19,700.48	15,642,184	21,691.26	17,222,864	1.32
アメリカ	株式	BOSTON SCIENTIFIC CORP	ヘルスケア機器・サービス	4,733	2,859.35	13,533,346	3,592.54	17,003,539	1.30
アメリカ	株式	ADOBE SYSTEMS INC	ソフトウェア・サービス	640	19,895.92	12,733,393	26,508.59	16,965,502	1.30
アメリカ	株式	BB & T CORPORATION	銀行	2,961	5,531.84	16,379,799	5,598.85	16,578,198	1.27
アメリカ	株式	UNION PACIFIC CORP	運輸	1,057	14,396.81	15,217,434	15,554.08	16,440,666	1.26
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	712	20,660.17	14,710,046	23,070.80	16,426,412	1.25
アメリカ	株式	AMERICAN EXPRESS COMPANY	各種金融	1,527	10,741.93	16,402,941	10,719.06	16,368,010	1.25
アメリカ	株式	DOWDUPONT INC	素材	2,235	7,758.99	17,341,355	7,312.22	16,342,814	1.25
アメリカ	株式	CMS ENERGY CORPORATION	公益事業	3,102	5,255.46	16,302,461	5,199.80	16,129,785	1.23
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	2,291	6,114.98	14,009,427	6,673.06	15,287,991	1.17
アメリカ	株式	AMERICAN ELECTRIC POWER	公益事業	1,991	8,330.38	16,585,801	7,664.84	15,260,704	1.17
アメリカ	株式	NETAPP INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,769	6,685.26	11,826,236	8,545.84	15,117,604	1.15
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	662	21,075.34	13,951,881	22,728.12	15,046,022	1.15
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	3,737	4,084.60	15,264,154	4,019.23	15,019,879	1.15
アメリカ	株式	CME GROUP INC.	各種金融	823	16,783.73	13,813,012	18,113.08	14,907,068	1.14
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	2,991	5,064.78	15,148,774	4,805.17	14,372,275	1.10
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	エネルギー	3,452	3,643.53	12,577,489	3,945.13	13,618,617	1.04
アメリカ	株式	MARSH & MCLENNAN COS	保険	1,515	9,176.07	13,901,760	8,957.05	13,569,940	1.04



キュラソー	株式	SCHLUMBERGER LTD	エネルギー	1,818	6,936.85	12,611,200	7,407.28	13,466,445	1.03
フランス	株式	SCHNEIDER ELECTRIC SE	資本財	1,503	8,821.25	13,258,346	8,930.67	13,422,806	1.02

## ロ 種類別・業種別の投資比率

2018年 6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	7.71
		素材	5.46
		資本財	8.78
		運輸	1.26
		自動車・自動車部品	1.98
		耐久消費財・アパレル	2.64
		消費者サービス	0.75
		メディア	1.41
		小売	4.76
		食品・生活必需品小売り	1.25
		食品・飲料・タバコ	5.38
		家庭用品・パーソナル用品	0.66
		ヘルスケア機器・サービス	4.21
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.32
		銀行	8.99
		各種金融	4.40
		保険	4.47
		ソフトウェア・サービス	9.23
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.37
電気通信サービス	0.68		
公益事業	3.99		
半導体・半導体製造装置	5.86		
合計			97.54

## 外国債券マザーファンド（A号）

### イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2018年 6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 1.375	5,920,000	10,865.84	643,257,754	10,826.87	640,950,993	1.375	2020/4/30	15.17
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	2,390,000	11,182.14	267,253,180	11,097.17	265,222,594	3.000	2045/11/15	6.28
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	2,360,000	10,996.69	259,522,100	10,997.86	259,549,647	1.500	2019/2/28	6.14

フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0	1,460,000	12,976.46	189,456,454	12,960.35	189,221,151	0.000	2021/5/25	4.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1,620,000	10,971.05	177,731,049	10,829.46	175,437,343	1.750	2020/12/31	4.15
イギリス	国債証券	UK TSY GILT 3.75	1,150,000	15,064.65	173,243,545	14,991.81	172,405,863	3.750	2019/9/7	4.08
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1	1,160,000	13,242.55	153,613,667	13,339.47	154,737,945	1.000	2027/5/25	3.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	1,360,000	10,990.54	149,471,451	10,924.46	148,572,666	2.500	2023/8/15	3.52
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.5	720,000	19,551.72	140,772,386	19,228.96	138,448,556	5.500	2029/4/25	3.28
ベルギー	国債証券	BELGIAN 0325 4.25	900,000	15,573.39	140,160,581	15,281.66	137,534,972	4.250	2022/9/28	3.25
スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 1.6	880,000	13,435.02	118,228,237	13,472.12	118,554,663	1.600	2025/4/30	2.81
スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 1.5	880,000	13,101.76	115,295,567	13,081.61	115,118,181	1.500	2027/4/30	2.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	930,000	10,400.70	96,726,590	10,516.84	97,806,655	2.250	2027/8/15	2.31
ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 2.5	520,000	17,023.76	88,523,557	17,469.82	90,843,064	2.500	2046/8/15	2.15
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	830,000	10,910.37	90,556,114	10,738.78	89,131,943	1.875	2022/3/31	2.11
ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 0.5	640,000	12,809.93	81,983,557	13,011.90	83,276,164	0.500	2028/2/15	1.97
オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	870,000	8,270.11	71,949,963	8,282.43	72,057,183	2.750	2024/4/21	1.71
スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 5.85	420,000	15,633.28	65,659,810	15,440.78	64,851,291	5.850	2022/1/31	1.53
イギリス	国債証券	UK TSY GILT 1.75	390,000	15,097.79	58,881,414	15,035.33	58,637,809	1.750	2057/7/22	1.39
イギリス	国債証券	UK TSY GILT 4.5	260,000	22,423.31	58,300,626	22,400.31	58,240,823	4.500	2042/12/7	1.38
カナダ	国債証券	CANADA-GOV'T 5.75	480,000	11,533.09	55,358,860	11,244.47	53,973,477	5.750	2029/6/1	1.28
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.75	400,000	13,108.74	52,434,995	12,512.60	50,050,439	3.750	2041/8/15	1.18
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 4.375	370,000	14,201.55	52,545,759	13,472.06	49,846,631	4.375	2038/2/15	1.18
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4	260,000	19,198.90	49,917,146	19,074.70	49,594,238	4.000	2038/10/25	1.17
スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 0.25	380,000	12,855.64	48,851,451	12,840.11	48,792,446	0.250	2019/1/31	1.15
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.25	330,000	14,087.45	46,488,609	14,184.32	46,808,268	2.250	2022/10/25	1.11
スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 4.7	250,000	18,525.97	46,314,932	18,274.62	45,686,574	4.700	2041/7/30	1.08
ベルギー	国債証券	BELGIAN 0320 4.25	220,000	20,224.09	44,493,007	19,604.38	43,129,640	4.250	2041/3/28	1.02
アメリカ	社債券	MORGAN STANLEY 2.75	400,000	10,827.39	43,309,572	10,710.16	42,840,641	2.750	2022/5/19	1.01
イタリア	国債証券	BTPS 4.5	280,000	15,321.82	42,901,116	14,307.62	40,061,361	4.500	2023/5/1	0.95

## □ 種類別の投資比率

2018年 6月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	96.30
地方債証券	0.67
社債券	1.01
合計	97.98

## 投資不動産物件

### 国内株式マザーファンド（A号）

該当事項はありません。

## 国内債券マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

## 外国株式マザーファンド（A号）

該当事項はありません。

## 外国債券マザーファンド（A号）

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

## 国内株式マザーファンド（A号）

該当事項はありません。

## 国内債券マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

## 外国株式マザーファンド（A号）

該当事項はありません。

## 外国債券マザーファンド（A号）

2018年 6月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	ユーロ	買建	410,000.00	52,597,077	52,451,300	1.24
	英ポンド	買建	140,000.00	20,381,256	20,199,200	0.47
	スイスフラン	買建	60,000.00	6,709,784	6,659,400	0.15
	スウェーデンクローナ	買建	3,300,000.00	41,693,157	40,392,000	0.95
	デンマーククローネ	買建	1,430,000.00	24,933,480	24,553,100	0.58
	米ドル	売建	760,000.00	82,986,170	83,546,800	1.97
	スウェーデンクローナ	売建	5,040,000.00	62,495,334	61,689,600	1.45

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

## 参考情報

基準日:2018年6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

### ■三井住友・DCバランスファンド(安定型)



## 分配の推移

決算期	分配金
2017年12月	0円
2016年12月	0円
2015年12月	0円
2014年12月	0円
2013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。

### ■三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)



決算期	分配金
2017年12月	0円
2016年12月	0円
2015年12月	0円
2014年12月	0円
2013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。

### ■三井住友・DCバランスファンド(成長型)



決算期	分配金
2017年12月	0円
2016年12月	0円
2015年12月	0円
2014年12月	0円
2013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。

## 主要な資産の状況

### ■三井住友・DCバランスファンド(安定型)

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	96.45
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.55
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド(B号)	53.96
日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド(A号)	17.69
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド(A号)	13.57
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド(A号)	11.23

### ■三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	96.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.04
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド(B号)	40.67
日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド(A号)	31.58
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド(A号)	18.64
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド(A号)	6.08

### ■三井住友・DCバランスファンド(成長型)

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	96.43
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.57
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド(A号)	42.61
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド(A号)	26.21
日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド(B号)	24.05
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド(A号)	3.57

### ■国内株式マザーファンド(A号)

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	97.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.25
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.50
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.40
日本	株式	キーエンス	電気機器	2.13
日本	株式	日本電産	電気機器	2.08
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.94
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.63
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1.57
日本	株式	関西電力	電気・ガス業	1.50
日本	株式	スズキ	輸送用機器	1.39
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.38

※比率は、各ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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



## ■国内債券マザーファンド(B号)

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	48.69
特殊債券	日本	18.66
地方債証券	日本	16.34
社債券	日本	15.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.79
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	1.200	2035/09/20	10.50
日本	国債証券	第153回利付国債(20年)	1.300	2035/06/20	4.32
日本	地方債証券	第174回共同発行市郡公算地方債	0.145	2027/09/24	3.08
日本	国債証券	第118回利付国債(20年)	2.000	2030/06/20	3.06
日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	1.700	2033/06/20	2.53
日本	国債証券	第128回利付国債(20年)	1.900	2031/06/20	2.41
日本	国債証券	第111回利付国債(20年)	2.200	2029/06/20	2.24
日本	特殊債券	第10回政府保証地方 公共団体金融機構債券(4年)	0.001	2022/02/25	2.12
日本	国債証券	第388回利付国債(2年)	0.100	2020/05/15	1.91
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	0.400	2025/06/20	1.80

## ■外国株式マザーファンド(A号)

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	67.82
	イギリス	7.44
	フランス	5.78
	スイス	2.85
	オランダ	1.54
	香港	1.49
	カナダ	1.49
	その他	9.14
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	2.95
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェア および機器	2.78
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2.28
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	2.13
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	2.10
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	1.84
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1.58
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	1.47
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	1.36

## ■外国債券マザーファンド(A号)

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	43.03
	フランス	15.09
	スペイン	11.76
	イギリス	6.85
	ドイツ	6.06
	その他	13.52
	社債券	アメリカ
地方債証券	カナダ	0.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.02
合計(純資産総額)		100.00

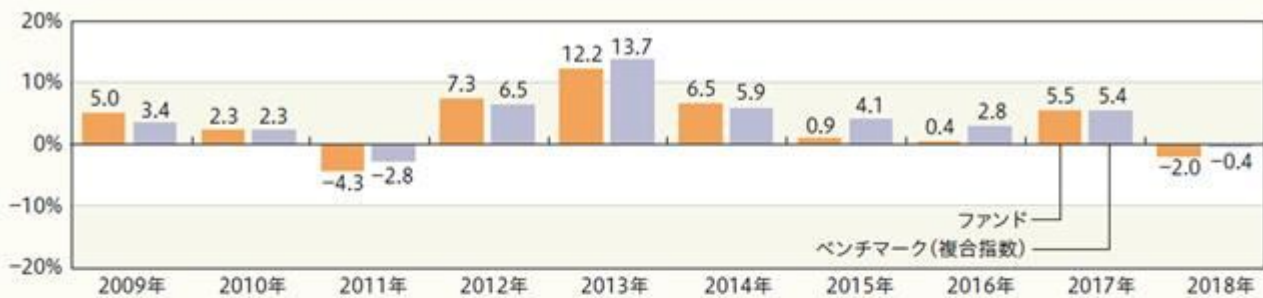
## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	1.375	2020/04/30	15.17
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	3.000	2045/11/15	6.28
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1.500	2019/02/28	6.14
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0	0.000	2021/05/25	4.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1.750	2020/12/31	4.15
イギリス	国債証券	UK TSY GILT 3.75	3.750	2019/09/07	4.08
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1	1.000	2027/05/25	3.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	2.500	2023/08/15	3.52
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.5	5.500	2029/04/25	3.28
ベルギー	国債証券	BELGIAN 0325 4.25	4.250	2022/09/28	3.25

\*比率は、各マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)

### ■三井住友・DCバランスファンド(安定型)



### ■三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)



### ■三井住友・DCバランスファンド(成長型)



※2018年の収益率は、年初から2018年6月29日までの騰落率を表示しています。

※ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### イ 申込方法

(イ) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。販売会社によっては、「スイッチング」（ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること）による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。お申込みの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

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

なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるとき

は、取得申込みの受け付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただきます場合があります。

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

#### ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

#### ハ 申込手数料

無手数料です。

#### ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

#### ホ 照会先

申込単位の詳細についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

#### ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

#### ト 払込期日

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

一部解約価額は、委託会社の営業日において日々算出されますので、委託会社（電話：0120-88-2976）にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせします。

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を



解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### イ 基準価額の算出方法

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

##### ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、それぞれ「DC安定」、「DC安成」、「DC成長」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="http://www.smam-jp.com">http://www.smam-jp.com</a>

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

#### (2)【保管】

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

#### (3)【信託期間】

2001年10月4日から下記「(5)その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

#### (4)【計算期間】

毎年12月16日から翌年12月15日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

#### (5)【その他】

## イ 信託の終了

## (イ) 信託契約の解約

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

## (ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

## (ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

## (ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

## ロ 収益分配金、償還金の支払い

## (イ) 収益分配金

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

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

#### (ロ) 償還金

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

#### 八 信託約款の変更

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- (ハ) 上記(ロ)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (ニ) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、(イ)の信託約款の変更をしません。
- (ホ) 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

#### 二 反対者の買取請求権

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

#### ホ 販売会社との契約の更改等

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

#### へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

#### ト 公告

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

<http://www.smam-jp.com>

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

#### チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

#### 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

##### イ 分配金請求権

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

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

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

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

##### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

##### ハ 一部解約実行請求権

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

##### ニ 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

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

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

##### ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期（平成28年12月16日から平成29年12月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【三井住友・DCバランスファンド（安定型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 （平成28年12月15日現在）	第17期 （平成29年12月15日現在）
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	12,522,437	12,771,395
親投資信託受益証券	195,065,904	201,983,276
派生商品評価勘定	-	300,475
未収入金	1,512,684	1,130,000
<b>流動資産合計</b>	<b>209,101,025</b>	<b>216,185,146</b>
<b>資産合計</b>	<b>209,101,025</b>	<b>216,185,146</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	369,843	-
未払金	5,530,048	15,540
未払解約金	-	1,104,766
未払受託者報酬	105,473	109,651
未払委託者報酬	1,371,109	1,425,392
未払利息	29	36
その他未払費用	5,273	5,421
<b>流動負債合計</b>	<b>7,381,775</b>	<b>2,660,806</b>
<b>負債合計</b>	<b>7,381,775</b>	<b>2,660,806</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	162,251,393	164,315,384
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	39,467,857	49,208,956
<b>元本等合計</b>	<b>201,719,250</b>	<b>213,524,340</b>
<b>純資産合計</b>	<b>201,719,250</b>	<b>213,524,340</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>209,101,025</b>	<b>216,185,146</b>

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第16期		第17期	
	自	平成27年12月16日 至 平成28年12月15日	自	平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
営業収益				
受取利息		55		-
有価証券売買等損益		4,731,557		12,547,372
為替差損益		1,273,218		442,377
営業収益合計		6,004,830		12,104,995
営業費用				
支払利息		3,951		7,672
受託者報酬		210,337		219,381
委託者報酬		2,734,290		2,851,864
その他費用		11,683		12,086
営業費用合計		2,960,261		3,091,003
営業利益又は営業損失 ( )		3,044,569		9,013,992
経常利益又は経常損失 ( )		3,044,569		9,013,992
当期純利益又は当期純損失 ( )		3,044,569		9,013,992
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ( )		255,750		385,927
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		35,669,571		39,467,857
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,614,316		7,232,505
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,614,316		7,232,505
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,116,349		6,119,471
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,116,349		6,119,471
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		39,467,857		49,208,956

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第17期	
	自 平成28年12月16日	至 平成29年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
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>	

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第16期		第17期	
	（平成28年12月15日現在）		（平成29年12月15日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	162,251,393口		164,315,384口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2433円	1口当たり純資産額	1.2995円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,433円	(10,000口当たりの純資産額)	12,995円

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項 目	第16期		第17期	
	自 平成27年12月16日	至 平成28年12月15日	自 平成28年12月16日	至 平成29年12月15日



分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,385,975円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,914,344円）、収益調整金（27,750,213円）、および分配準備積立金（22,621,520円）より、分配対象収益は53,672,052円（1万口当たり3,307.94円）ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,950,398円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（6,677,667円）、収益調整金（32,193,044円）、および分配準備積立金（22,195,205円）より、分配対象収益は63,016,314円（1万口当たり3,835.06円）ですが、分配を行っておりません。
----------	--	--

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	第17期 自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第17期 (平成29年12月15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>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

## 第16期（自 平成27年12月16日 至 平成28年12月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	7,291,809円
合計	7,291,809円

## 第17期（自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	11,266,446円
合計	11,266,446円

（デリバティブ取引に関する注記）

## 第16期（平成28年12月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	21,664,521	-	22,034,364	369,843
	米ドル	14,241,214	-	14,553,294	312,080
	ユーロ	7,423,307	-	7,481,070	57,763
	合計	21,664,521	-	22,034,364	369,843

## 第17期（平成29年12月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	28,359,015	-	28,058,540	300,475
	米ドル	28,091,456	-	27,793,360	298,096
	ユーロ	267,559	-	265,180	2,379

合計	28,359,015	-	28,058,540	300,475
----	------------	---	------------	---------

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

<p>第17期 自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日</p>
<p>市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。</p>

## (その他の注記)

項目	第16期 (平成28年12月15日現在)	第17期 (平成29年12月15日現在)
期首元本額	159,292,485円	162,251,393円
期中追加設定元本額	16,903,981円	27,169,884円
期中一部解約元本額	13,945,073円	25,105,893円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド(A号)	38,403,997	47,682,402	
	外国株式マザーファンド(A号)	9,544,770	21,019,492	
	外国債券マザーファンド(A号)	14,154,620	38,180,671	
	国内債券マザーファンド(B号)	68,388,258	95,100,711	
合計		130,491,645	201,983,276	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 【三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 （平成28年12月15日現在）	第17期 （平成29年12月15日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	29,146,777	30,697,379
親投資信託受益証券	457,236,626	503,610,886
派生商品評価勘定	-	772,668
未収入金	2,751,189	250,000
流動資産合計	489,134,592	535,330,933
資産合計		
	489,134,592	535,330,933
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	883,329	-
未払金	14,494,950	54,527
未払解約金	39,081	235,142
未払受託者報酬	239,344	270,240
未払委託者報酬	3,111,439	3,512,983
未払利息	68	88
その他未払費用	12,090	13,450
流動負債合計	18,780,301	4,086,430
負債合計		
	18,780,301	4,086,430
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	337,683,909	352,146,190
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	132,670,382	179,098,313
元本等合計	470,354,291	531,244,503
純資産合計		
	470,354,291	531,244,503
負債純資産合計		
	489,134,592	535,330,933

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期		第17期	
	自	平成27年12月16日 至 平成28年12月15日	自	平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		84		-
有価証券売買等損益		15,387,990		48,134,260
為替差損益		3,626,604		1,009,203
<b>営業収益合計</b>		<b>19,014,678</b>		<b>47,125,057</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		8,300		17,712
受託者報酬		473,791		525,505
委託者報酬		6,159,160		6,831,324
その他費用		26,422		29,163
<b>営業費用合計</b>		<b>6,667,673</b>		<b>7,403,704</b>
営業利益又は営業損失（ ）		12,347,005		39,721,353
経常利益又は経常損失（ ）		12,347,005		39,721,353
当期純利益又は当期純損失（ ）		12,347,005		39,721,353
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		402,071		639,498
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		117,082,185		132,670,382
剰余金増加額又は欠損金減少額		9,627,382		16,707,850
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		9,627,382		16,707,850
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,788,261		9,361,774
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,788,261		9,361,774
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		132,670,382		179,098,313

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第17期	
	自 平成28年12月16日	至 平成29年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
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>	

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第16期		第17期	
	（平成28年12月15日現在）		（平成29年12月15日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	337,683,909口		352,146,190口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3929円	1口当たり純資産額	1.5086円
	(10,000口当たりの純資産額)	13,929円	(10,000口当たりの純資産額)	15,086円

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項 目	第16期		第17期	
	自 平成27年12月16日	至 平成28年12月15日	自 平成28年12月16日	至 平成29年12月15日



分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,465,232円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(8,283,844円)、収益調整金(88,325,439円)、および分配準備積立金(83,335,345円)より、分配対象収益は184,409,860円(1万口当たり5,461.00円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,161,607円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(32,920,248円)、収益調整金(102,756,465円)、および分配準備積立金(89,608,845円)より、分配対象収益は231,447,165円(1万口当たり6,572.45円)であります。分配を行っておりません。
----------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第17期 自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第17期 (平成29年12月15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>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

## 第16期（自 平成27年12月16日 至 平成28年12月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	22,262,387円
合計	22,262,387円

## 第17期（自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	44,695,773円
合計	44,695,773円

（デリバティブ取引に関する注記）

## 第16期（平成28年12月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	う ち 1 年 超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	売建	47,948,472	-	48,831,801	883,329
	米ドル	36,103,030	-	36,894,186	791,156
	ユーロ	11,845,442	-	11,937,615	92,173
	合計	47,948,472	-	48,831,801	883,329

## 第17期（平成29年12月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	う ち 1 年 超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外の 取引	為替予約取引				
	売建	73,203,038	-	72,430,370	772,668
	米ドル	70,795,000	-	70,043,750	751,250
	ユーロ	2,408,038	-	2,386,620	21,418

合計	73,203,038	-	72,430,370	772,668
----	------------	---	------------	---------

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第17期 自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項目	第16期 (平成28年12月15日現在)	第17期 (平成29年12月15日現在)
期首元本額	326,965,451円	337,683,909円
期中追加設定元本額	29,757,139円	38,264,679円
期中一部解約元本額	19,038,681円	23,802,398円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド(A号)	162,604,819	201,890,143	
	外国株式マザーファンド(A号)	40,753,477	89,747,307	
	外国債券マザーファンド(A号)	23,508,346	63,411,412	
	国内債券マザーファンド(B号)	106,833,039	148,562,024	
合計		333,699,681	503,610,886	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 【三井住友・DCバランスファンド（成長型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 （平成28年12月15日現在）	第17期 （平成29年12月15日現在）
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	16,163,358	16,537,432
親投資信託受益証券	248,731,824	261,264,210
派生商品評価勘定	-	453,045
未収入金	2,311,570	310,000
<b>流動資産合計</b>	<b>267,206,752</b>	<b>278,564,687</b>
<b>資産合計</b>	<b>267,206,752</b>	<b>278,564,687</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	579,052	-
未払金	6,127,094	33,211
未払解約金	1,657,378	328,302
未払受託者報酬	126,008	144,628
未払委託者報酬	1,638,043	1,880,118
未払利息	38	47
その他未払費用	6,334	7,179
<b>流動負債合計</b>	<b>10,133,947</b>	<b>2,393,485</b>
<b>負債合計</b>	<b>10,133,947</b>	<b>2,393,485</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	175,520,079	168,797,814
<b>剰余金</b>		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	81,552,726	107,373,388
<b>元本等合計</b>	<b>257,072,805</b>	<b>276,171,202</b>
<b>純資産合計</b>	<b>257,072,805</b>	<b>276,171,202</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>267,206,752</b>	<b>278,564,687</b>

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第16期		第17期	
	自	平成27年12月16日 至 平成28年12月15日	自	平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
営業収益				
受取利息		58		-
有価証券売買等損益		9,813,623		33,752,386
為替差損益		1,782,326		336,511
営業収益合計		11,596,007		33,415,875
営業費用				
支払利息		4,613		9,761
受託者報酬		249,285		279,502
委託者報酬		3,240,571		3,633,411
その他費用		13,860		15,443
営業費用合計		3,508,329		3,938,117
営業利益又は営業損失 ( )		8,087,678		29,477,758
経常利益又は経常損失 ( )		8,087,678		29,477,758
当期純利益又は当期純損失 ( )		8,087,678		29,477,758
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ( )		724,624		1,785,358
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		70,422,856		81,552,726
剰余金増加額又は欠損金減少額		7,704,274		12,469,754
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		7,704,274		12,469,754
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,386,706		14,341,492
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,386,706		14,341,492
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		81,552,726		107,373,388

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第17期	
	自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
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>	

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第16期		第17期	
	（平成28年12月15日現在）		（平成29年12月15日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	175,520,079口		168,797,814口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.4646円	1口当たり純資産額	1.6361円
	(10,000口当たりの純資産額)	14,646円)	(10,000口当たりの純資産額)	16,361円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項 目	第16期		第17期	
	自 平成27年12月16日 至 平成28年12月15日		自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日	



分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,969,686円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(5,842,616円)、収益調整金(63,096,598円)、および分配準備積立金(49,812,986円)より、分配対象収益は121,721,886円(1万口当たり6,934.90円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,786,192円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(23,906,208円)、収益調整金(68,127,646円)、および分配準備積立金(48,979,186円)より、分配対象収益は144,799,232円(1万口当たり8,578.25円)であります。分配を行っておりません。
----------	---	--

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第17期 自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第17期 (平成29年12月15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>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第16期（自 平成27年12月16日 至 平成28年12月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	13,319,747円
合計	13,319,747円

第17期（自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	30,904,428円
合計	30,904,428円

（デリバティブ取引に関する注記）

第16期（平成28年12月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	30,555,729	-	31,134,781	579,052
	米ドル	24,149,146	-	24,678,346	529,200
	ユーロ	6,406,583	-	6,456,435	49,852
	合計	30,555,729	-	31,134,781	579,052

第17期（平成29年12月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	42,888,115	-	42,435,070	453,045
	米ドル	41,684,096	-	41,241,760	442,336
	ユーロ	1,204,019	-	1,193,310	10,709

合計	42,888,115	-	42,435,070	453,045
----	------------	---	------------	---------

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

<p>第17期 自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日</p>
<p>市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。</p>

## (その他の注記)

項目	第16期 (平成28年12月15日現在)	第17期 (平成29年12月15日現在)
期首元本額	167,123,825円	175,520,079円
期中追加設定元本額	21,278,735円	24,011,241円
期中一部解約元本額	12,882,481円	30,733,506円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド（A号）	105,779,364	131,335,658	
	外国株式マザーファンド（A号）	31,057,770	68,395,421	
	外国債券マザーファンド（A号）	8,101,660	21,853,417	
	国内債券マザーファンド（B号）	28,534,240	39,679,714	
合計		173,473,034	261,264,210	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

（参考）

「三井住友・DCバランスファンド（安定型）」、「三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）」および「三井住友・DCバランスファンド（成長型）」は、「国内株式マザーファンド（A号）」、「国内債券マザーファンド（B号）」、「外国株式マザーファンド（A号）」および「外国債券マザーファンド（A号）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内株式マザーファンド（A号）

## 貸借対照表

（単位：円）

	（平成28年12月15日現在）	（平成29年12月15日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	14,586,325	22,414,140
株式	853,324,260	908,802,630
未収入金	7,520,000	14,867,370
未収配当金	-	125,800
流動資産合計	875,430,585	946,209,940
資産合計	875,430,585	946,209,940
負債の部		
流動負債		
未払金	-	15,195,392
未払解約金	7,213,697	2,222,305
未払利息	34	64
その他未払費用	94	2
流動負債合計	7,213,825	17,417,763
負債合計	7,213,825	17,417,763
純資産の部		
元本等		
元本	838,239,613	748,069,746
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	29,977,147	180,722,431
元本等合計	868,216,760	928,792,177
純資産合計	868,216,760	928,792,177
負債純資産合計	875,430,585	946,209,940

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成28年12月15日現在）	（平成29年12月15日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	838,239,613口	748,069,746口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0358円 (10,000口当たりの純資産額 10,358円)	1口当たり純資産額 1.2416円 (10,000口当たりの純資産額 12,416円)

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
	(1) 金融商品の内容

項目	自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年12月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

(平成28年12月15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	844,140,860円
同期中における追加設定元本額	217,023,615円
同期中における一部解約元本額	222,924,862円
平成28年12月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DCバランスファンド（安定型）	40,874,023円
三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）	163,384,777円
三井住友・DCバランスファンド（成長型）	114,015,044円
三井住友・DC国内株式アクティブS	436,946,636円
S M A M ・ バランスファンド V A 安定型（適格機関投資家専用）	80,356,999円
S M A M ・ バランスファンド V A 株 4 0 型（適格機関投資家専用）	877,051円
S M A M ・ バランスファンド V A 株 6 0 型（適格機関投資家専用）	731,429円
S M A M ・ バランスファンド V A 株 8 0 型（適格機関投資家専用）	1,053,654円
合計	838,239,613円



（平成29年12月15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	838,239,613円
同期中における追加設定元本額	158,340,043円
同期中における一部解約元本額	248,509,910円
平成29年12月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DCバランスファンド（安定型）	38,403,997円
三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）	162,604,819円
三井住友・DCバランスファンド（成長型）	105,779,364円
三井住友・DC国内株式アクティブS	393,610,333円
S M A M ・ バランスファンド V A 安定型（適格機関投資家専用）	45,327,242円
S M A M ・ バランスファンド V A 株 4 0 型（適格機関投資家専用）	756,419円
S M A M ・ バランスファンド V A 株 6 0 型（適格機関投資家専用）	632,364円
S M A M ・ バランスファンド V A 株 8 0 型（適格機関投資家専用）	955,208円
合計	748,069,746円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

（単位：円）

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
コムシスホールディングス	2,100	3,270.00	6,867,000	
前田建設工業	2,200	1,636.00	3,599,200	
大和ハウス工業	2,200	4,295.00	9,449,000	
関電工	6,700	1,129.00	7,564,300	
キリンホールディングス	1,700	2,852.50	4,849,250	
コカ・コーラボトラーズジャパン	1,400	4,280.00	5,992,000	
ニチレイ	1,500	3,190.00	4,785,000	
日本たばこ産業	3,000	3,719.00	11,157,000	
ゲンゼ	700	5,850.00	4,095,000	
王子ホールディングス	14,000	717.00	10,038,000	
昭和電工	1,900	4,470.00	8,493,000	
信越化学工業	800	11,395.00	9,116,000	
住友ベークライト	6,000	921.00	5,526,000	
アイカ工業	1,800	4,145.00	7,461,000	
宇部興産	1,100	3,160.00	3,476,000	
太陽ホールディングス	800	5,030.00	4,024,000	

シーズ・ホールディングス	2,500	5,540.00	13,850,000
協和発酵キリン	1,300	2,159.00	2,806,700
武田薬品工業	500	6,221.00	3,110,500
あすか製薬	4,000	2,077.00	8,308,000
中外製薬	800	5,870.00	4,696,000
小野薬品工業	1,700	2,633.50	4,476,950
出光興産	2,600	4,335.00	11,271,000
J X T Gホールディングス	16,400	685.50	11,242,200
太平洋セメント	1,500	4,780.00	7,170,000
東海カーボン	3,100	1,306.00	4,048,600
東洋炭素	3,900	3,320.00	12,948,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	5,100	2,684.00	13,688,400
住友金属鉱山	1,800	4,298.00	7,736,400
ツガミ	7,000	1,320.00	9,240,000
富士機械製造	3,000	2,218.00	6,654,000
ソディック	2,900	1,388.00	4,025,200
ディスコ	200	24,660.00	4,932,000
オプトラン	300	1,460.00	438,000
新川	3,300	1,040.00	3,432,000
T O W A	2,300	2,091.00	4,809,300
T H K	1,300	4,000.00	5,200,000
スター精密	2,100	1,863.00	3,912,300
三菱電機	5,000	1,803.00	9,015,000
日本電産	1,000	15,305.00	15,305,000
セイコーエプソン	3,000	2,618.00	7,854,000
パナソニック	2,600	1,668.50	4,338,100
ソニー	2,900	5,006.00	14,517,400
ホシデン	5,900	1,640.00	9,676,000
キーエンス	300	63,320.00	18,996,000
コーセル	4,800	1,772.00	8,505,600
スタンレー電気	1,700	4,575.00	7,777,500
ファナック	400	26,170.00	10,468,000
ローム	600	11,650.00	6,990,000
キャノン	4,400	4,312.00	18,972,800
東京エレクトロン	300	20,955.00	6,286,500
デンソー	1,400	6,364.00	8,909,600
トヨタ自動車	4,900	6,966.00	34,133,400
三菱自動車工業	7,600	794.00	6,034,400
K Y B	600	6,430.00	3,858,000
本田技研工業	5,000	3,782.00	18,910,000
スズキ	1,800	6,320.00	11,376,000
テイ・エス テック	1,400	4,515.00	6,321,000

テルモ	900	5,280.00	4,752,000
タカラトミー	4,300	1,517.00	6,523,100
N I S S H A	2,900	3,375.00	9,787,500
任天堂	400	43,030.00	17,212,000
コクヨ	2,200	2,079.00	4,573,800
東武鉄道	1,800	3,745.00	6,741,000
西武ホールディングス	4,200	2,121.00	8,908,200
セイノーホールディングス	2,800	1,784.00	4,995,200
日立物流	2,000	2,939.00	5,878,000
S Gホールディングス	1,500	2,105.00	3,157,500
日本郵船	3,900	2,715.00	10,588,500
伊藤忠テクノソリューションズ	1,500	4,865.00	7,297,500
日本電信電話	3,300	5,351.00	17,658,300
K D D I	2,900	2,922.00	8,473,800
ソフトバンクグループ	1,900	8,931.00	16,968,900
双日	14,700	323.00	4,748,100
伊藤忠商事	4,500	1,913.50	8,610,750
住友商事	6,600	1,807.50	11,929,500
三菱商事	4,000	2,888.00	11,552,000
日鉄住金物産	1,400	6,000.00	8,400,000
ドンキホーテホールディングス	1,700	5,720.00	9,724,000
ユナイテッドアローズ	1,400	4,535.00	6,349,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,800	2,234.00	6,255,200
ケーズホールディングス	3,700	2,940.00	10,878,000
ファーストリテイリング	400	44,600.00	17,840,000
めぶきフィナンシャルグループ	8,800	470.00	4,136,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	13,700	673.00	9,220,100
三菱UFJフィナンシャル・グループ	49,700	798.50	39,685,450
千葉銀行	6,000	913.00	5,478,000
ふくおかフィナンシャルグループ	12,000	619.00	7,428,000
みずほフィナンシャルグループ	55,800	200.80	11,204,640
ジャフコ	700	6,620.00	4,634,000
野村ホールディングス	10,300	656.80	6,765,040
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	5,000	715.00	3,575,000
スパークス・グループ	29,200	324.00	9,460,800
第一生命ホールディングス	8,100	2,286.00	18,516,600
東京海上ホールディングス	2,300	4,999.00	11,497,700
オリックス	6,300	1,875.50	11,815,650
オープンハウス	1,700	5,820.00	9,894,000
平和不動産	1,700	2,042.00	3,471,400
住友不動産	3,000	3,705.00	11,115,000
レオパレス21	8,500	916.00	7,786,000

オリエンタルランド	900	10,610.00	9,549,000	
リクルートホールディングス	1,400	2,750.00	3,850,000	
ベルシステム24ホールディングス	5,300	1,356.00	7,186,800	
合 計	479,200		908,802,630	

## (b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 国内債券マザーファンド（B号）

## 貸借対照表

（単位：円）

（平成28年12月15日現在） （平成29年12月15日現在）

	（平成28年12月15日現在）	（平成29年12月15日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,022,691,523	2,334,970,557
国債証券	85,995,011,980	103,433,868,280
地方債証券	5,959,936,000	12,570,538,800
特殊債券	14,923,505,795	26,119,261,893
社債券	10,927,389,600	24,043,770,000
未収入金	411,192,000	-
未収利息	256,816,111	405,063,170
前払費用	25,355,254	32,240,329
流動資産合計	119,521,898,263	168,939,713,029
資産合計	119,521,898,263	168,939,713,029
負債の部		
流動負債		
未払金	900,004,000	100,000,000
未払解約金	77,292,540	11,646,102
未払利息	2,417	6,717
その他未払費用	12,758	415
流動負債合計	977,311,715	111,653,234
負債合計	977,311,715	111,653,234
純資産の部		
元本等		
元本	85,909,885,942	121,405,654,668
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	32,634,700,606	47,422,405,127
元本等合計	118,544,586,548	168,828,059,795
純資産合計	118,544,586,548	168,828,059,795
負債純資産合計	119,521,898,263	168,939,713,029

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15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12月15日現在）	（平成29年12月15日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	85,909,885,942口	121,405,654,668口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3799円 (10,000口当たりの純資産額 13,799円)	1口当たり純資産額 1.3906円 (10,000口当たりの純資産額 13,906円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p>

項 目	自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
	(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(平成29年12月15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。

項 目	(平成29年12月15日現在)
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

(平成28年12月15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	54,257,209,611円
同期中における追加設定元本額	35,583,859,568円
同期中における一部解約元本額	3,931,183,237円
平成28年12月15日現在における元本の内訳	
三井住友・年金プラン30	793,724,663円
三井住友・年金プラン50	674,938,069円
三井住友・年金プラン70	222,222,815円
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	78,049,580円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	136,046,515円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	43,647,819円
三井住友・DC国内債券アクティブ	299,169,435円
三井住友・日本債券年金ファンド	3,769,671,129円
S M A M・年金国内債券アクティブファンド(適格機関投資家専用)	5,933,585,895円
S M A M・バランスファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	487,753,295円
S M A M・バランスファンドVA株40型(適格機関投資家専用)	1,078,130円
S M A M・バランスファンドVA株60型(適格機関投資家専用)	350,145円

(平成28年12月15日現在)	
S M A M ・ バランスファンドV A 株 8 0 型 ( 適格機関投資家専用 )	133,949円
バランスファンドV A ( 安定運用型 ) < 適格機関投資家限定 >	292,288,886円
三井住友 / F O F s 用日本債 F ( 適格機関投資家限定 )	73,177,225,617円
合計	85,909,885,942円

(平成29年12月15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	85,909,885,942円
同期中における追加設定元本額	41,260,514,282円
同期中における一部解約元本額	5,764,745,556円
平成29年12月15日現在における元本の内訳	
三井住友・年金プラン30	841,672,948円
三井住友・年金プラン50	743,609,699円
三井住友・年金プラン70	227,423,836円
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	68,388,258円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	106,833,039円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	28,534,240円
三井住友・DC国内債券アクティブ	302,866,614円
三井住友・日本債券年金ファンド	3,975,096,272円
S M A M ・ 年金国内債券アクティブファンド(適格機関投資家専用)	3,437,183,154円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定型(適格機関投資家専用)	343,925,519円
S M A M ・ バランスファンドV A 株 4 0 型(適格機関投資家専用)	1,211,535円
S M A M ・ バランスファンドV A 株 6 0 型(適格機関投資家専用)	399,794円
S M A M ・ バランスファンドV A 株 8 0 型(適格機関投資家専用)	166,386円
バランスファンドV A ( 安定運用型 ) < 適格機関投資家限定 >	162,842,775円
三井住友 / F O F s 用日本債 F ( 適格機関投資家限定 )	111,165,500,599円
合計	121,405,654,668円

## 附属明細表

### 有価証券明細表

#### (a) 株式

該当事項はありません。

#### (b) 株式以外の有価証券



(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第379回利付国債(2年)	3,680,000,000	3,695,860,800	
	第126回利付国債(5年)	10,350,000,000	10,423,278,000	
	第127回利付国債(5年)	3,750,000,000	3,778,125,000	
	第133回利付国債(5年)	600,000,000	606,306,000	
	第8回利付国債(40年)	300,000,000	345,702,000	
	第335回利付国債(10年)	1,440,000,000	1,496,188,800	
	第336回利付国債(10年)	750,000,000	780,082,500	
	第338回利付国債(10年)	3,040,000,000	3,142,934,400	
	第339回利付国債(10年)	4,220,000,000	4,362,973,600	
	第340回利付国債(10年)	1,570,000,000	1,623,725,400	
	第341回利付国債(10年)	2,040,000,000	2,094,835,200	
	第342回利付国債(10年)	3,620,000,000	3,657,394,600	
	第343回利付国債(10年)	2,080,000,000	2,100,342,400	
	第347回利付国債(10年)	1,540,000,000	1,551,673,200	
	第348回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,006,800,000	
	第3回利付国債(30年)	148,000,000	187,014,280	
	第20回利付国債(30年)	600,000,000	809,532,000	
	第30回利付国債(30年)	510,000,000	681,747,600	
	第33回利付国債(30年)	570,000,000	733,430,400	
	第34回利付国債(30年)	1,260,000,000	1,678,168,800	
	第36回利付国債(30年)	300,000,000	387,678,000	
	第39回利付国債(30年)	100,000,000	127,623,000	
	第42回利付国債(30年)	500,000,000	615,650,000	
	第45回利付国債(30年)	1,200,000,000	1,421,244,000	
	第46回利付国債(30年)	120,000,000	142,130,400	
	第55回利付国債(30年)	2,280,000,000	2,282,713,200	
	第84回利付国債(20年)	300,000,000	348,714,000	
	第92回利付国債(20年)	400,000,000	475,620,000	
	第111回利付国債(20年)	3,990,000,000	4,942,732,200	
	第118回利付国債(20年)	2,700,000,000	3,312,927,000	
	第126回利付国債(20年)	2,280,000,000	2,815,161,600	
	第132回利付国債(20年)	650,000,000	780,149,500	
第134回利付国債(20年)	400,000,000	486,644,000		

	第135回利付国債(20年)	1,200,000,000	1,442,376,000	
	第138回利付国債(20年)	1,580,000,000	1,856,373,600	
	第141回利付国債(20年)	1,800,000,000	2,169,558,000	
	第142回利付国債(20年)	400,000,000	488,240,000	
	第145回利付国債(20年)	4,340,000,000	5,239,985,800	
	第147回利付国債(20年)	1,440,000,000	1,719,273,600	
	第148回利付国債(20年)	1,300,000,000	1,532,206,000	
	第150回利付国債(20年)	1,220,000,000	1,419,348,000	
	第151回利付国債(20年)	900,000,000	1,017,045,000	
	第153回利付国債(20年)	5,930,000,000	6,791,806,900	
	第154回利付国債(20年)	14,950,000,000	16,862,553,500	
国債証券合計		93,348,000,000	103,433,868,280	
地方債証券	第1回東京都公募公債(6年)	950,000,000	951,406,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	600,000,000	684,108,000	
	第663回東京都公募公債	500,000,000	507,700,000	
	第664回東京都公募公債	500,000,000	506,940,000	
	第670回東京都公募公債	170,000,000	173,984,800	
	第720回東京都公募公債	400,000,000	418,488,000	
	第735回東京都公募公債	500,000,000	518,305,000	
	第762回東京都公募公債	500,000,000	501,775,000	
	第763回東京都公募公債	800,000,000	801,064,000	
	平成20年度第4回広島県公募公債	200,000,000	203,222,000	
	平成20年度第5回広島県公募公債	100,000,000	101,643,000	
	平成20年度第5回埼玉県公募公債	700,000,000	711,312,000	
	平成21年度第4回埼玉県公募公債	400,000,000	409,256,000	
	平成24年度第11回埼玉県公募公債(5年)	700,000,000	700,217,000	
	平成25年度第5回埼玉県公募公債(5年)	500,000,000	500,960,000	
	平成29年度第7回埼玉県公募公債(5年)	1,000,000,000	999,550,000	
	平成21年度第1回千葉県公募公債	1,250,000,000	1,275,475,000	
	平成25年度第1回京都市公募公債	600,000,000	601,128,000	
	平成25年度第6回京都市公募公債	200,000,000	200,458,000	
	平成25年度第10回神戸市公募公債(5年)	300,000,000	300,612,000	
第37回横浜市公募公債(5年)	1,000,000,000	1,001,840,000		
平成25年度第3回福岡市公募公債(5年)	500,000,000	501,095,000		
地方債証券合計		12,370,000,000	12,570,538,800	
特殊債券	第9回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	800,000,000	822,768,000	

第11回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,883,000	
第31回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	1,900,000,000	1,908,132,000	
第73回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	609,018,000	
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	406,420,000	
第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,717,000	
第82回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	152,000,000	155,581,120	
第85回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	270,000,000	276,296,400	
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,900,000,000	1,947,728,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,322,000,000	1,359,584,460	
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	600,000,000	618,096,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,393,000	
第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,807,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,115,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,012,000	
第152回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,586,000	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,035,000,000	1,076,617,350	
第218回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	159,000,000	165,668,460	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	121,000,000	125,692,380	
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,589,000	
第238回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	127,000,000	130,505,200	
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,055,000	
第243回政府保証日本高速道路保有・債務返済	100,000,000	102,617,000	

済機構債券			
第1回政府保証公営企業債券(15年)	1,300,000,000	1,353,547,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	500,000,000	512,620,000	
第2回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	304,515,000	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	800,000,000	817,312,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,586,610	
第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	304,992,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券	180,000,000	186,040,800	
第12回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	300,000,000	301,479,000	
第14回地方公共団体金融機構債券(5年)	700,000,000	701,456,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	380,000,000	390,814,800	
第53回地方公共団体金融機構債券	1,500,000,000	1,558,155,000	
第59回政府保証地方公共団体金融機構債券	234,000,000	243,820,980	
第66回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,285,000	
第71回政府保証地方公共団体金融機構債券	214,000,000	219,591,820	
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	201,000,000	207,665,160	
第75回政府保証地方公共団体金融機構債券	303,000,000	312,141,510	
第882回政府保証公営企業債券	500,000,000	501,425,000	
第13回阪神高速道路株式会社社債	400,000,000	401,160,000	
第30回政府保証日本政策金融公庫債券	500,000,000	502,580,000	
第33回政府保証日本政策金融公庫債券	1,000,000,000	1,005,300,000	
第68回都市再生債券	150,000,000	155,664,000	
第8回政府保証中部国際空港債券	166,000,000	168,762,240	
第21回政府保証中部国際空港債券	169,000,000	174,135,910	
第203回政府保証預金保険機構債	400,000,000	401,128,000	
第208回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,758,000	
第209回政府保証預金保険機構債	900,000,000	903,627,000	
第3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,040,000	103,175,839	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	137,452,000	146,206,317	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	52,257,000	55,526,197	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,902,000	95,039,794	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,672,000	89,553,304	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,388,000	43,894,871	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,018,000	56,996,552	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,342,000	58,412,927	

	第7 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,321,000	58,541,737	
	第8 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	135,424,000	140,154,360	
	第9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,289,000	73,544,583	
	第9 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,315,000	74,471,433	
	第1 2 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,819,000	99,340,764	
	第1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,048,000	
	第1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,190,000	
	第6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,746,000	19,816,771	
	第7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,752,000	20,911,244	
	い第7 7 0 号商工債	200,000,000	200,320,000	
	い第7 5 1 号農林債	200,000,000	200,006,000	
	い第7 5 7 号農林債	200,000,000	200,350,000	
	い第7 6 3 号農林債	100,000,000	100,263,000	
	第2 9 6 回信金中金債(5年)	300,000,000	300,747,000	
	第2 9 9 回信金中金債(5年)	300,000,000	300,750,000	
	第2 0 回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,002,000	
	第2 1 回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,295,000	
	第5 回中日本高速道路株式会社社債	300,000,000	304,260,000	
特殊債券合計		25,566,737,000	26,119,261,893	
社債券	第9 回モルガン・スタンレー円貨社債(2014)	200,000,000	200,346,000	
	第7 回大和ハウス工業株式会社無担保社債	300,000,000	299,160,000	
	株式会社協和エクシオ第3 回無担保社債	100,000,000	100,147,000	
	第1 0 回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	900,000,000	900,819,000	
	第1 1 回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	400,000,000	400,024,000	
	第2 4 回味の素株式会社無担保社債	800,000,000	800,736,000	
	第9 回日本たばこ産業株式会社社債	300,000,000	301,095,000	
	第8 回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,409,000	
	第1 1 回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	300,000,000	303,810,000	
	第3 0 回東レ株式会社無担保社債	900,000,000	891,351,000	
	第5 6 回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,682,000	
	第5 7 回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,775,000	
	第2 1 回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	99,896,000	

第8回テルモ株式会社無担保社債	100,000,000	99,834,000	
第9回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,827,000	
第10回株式会社ブリヂストン無担保社債	600,000,000	600,228,000	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	400,000,000	399,492,000	
第3回愛知製鋼株式会社無担保社債	400,000,000	400,236,000	
第27回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,330,000	
第30回株式会社豊田自動織機無担保社債	500,000,000	499,445,000	
第31回株式会社豊田自動織機無担保社債	500,000,000	499,320,000	
第13回株式会社クボタ無担保社債	200,000,000	201,498,000	
第7回日本電産株式会社無担保社債	1,700,000,000	1,697,994,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,618,000	
第14回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	104,326,000	
第16回パナソニック株式会社無担保社債	500,000,000	501,450,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	400,000,000	402,576,000	
第1回明治安田生命2014基金特定目的会社 特定社債	600,000,000	602,532,000	
第1回日本生命2015基金特定目的会社特定 社債	400,000,000	401,136,000	
明治安田生命2016基金特定目的会社第1回 B号特定社債	500,000,000	499,815,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定 社債	100,000,000	100,086,000	
第1回ユニー・ファミリーマートホールディン グス株式会社無担保社債	1,300,000,000	1,301,898,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ第1回劣 後特約付無担保社債	100,000,000	102,951,000	
三井住友トラストホールディングス株式会社第 1回無担保社債	100,000,000	102,462,000	
第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保 社債	100,000,000	100,452,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	200,000,000	207,654,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	104,096,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	206,444,000	
第14回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	103,453,000	
第38回株式会社日産フィナンシャルサービス 無担保社債	400,000,000	398,968,000	
第44回株式会社日産フィナンシャルサービス 無担保社債	2,000,000,000	1,993,700,000	
第45回株式会社日産フィナンシャルサービス	1,000,000,000	992,870,000	

無担保社債			
第35回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	199,452,000	
第39回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	99,847,000	
第68回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	500,000,000	500,460,000	
第71回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,852,000	
第62回日立キャピタル株式会社無担保社債	400,000,000	399,288,000	
第69回日立キャピタル株式会社無担保社債	400,000,000	399,880,000	
第70回日立キャピタル株式会社無担保社債	200,000,000	200,010,000	
第39回三菱UFJリース株式会社無担保社債	300,000,000	299,481,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	1,200,000,000	1,198,776,000	
第49回三菱UFJリース株式会社無担保社債	1,000,000,000	998,120,000	
第44回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	203,452,000	
第51回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,830,000	
第54回三井不動産株式会社無担保社債	200,000,000	199,628,000	
第79回東京急行電鉄株式会社無担保社債	700,000,000	721,749,000	
第81回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	400,000,000	399,760,000	
第2回日本航空株式会社無担保社債	300,000,000	299,700,000	
株式会社ファーストリテイリング第2回無担保社債	200,000,000	200,544,000	
社債券合計	24,000,000,000	24,043,770,000	
合計		166,167,438,973	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国株式マザーファンド（A号）

## 貸借対照表

（単位：円）

	（平成28年12月15日現在）	（平成29年12月15日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	1,632,385	3,329,554
コール・ローン	20,599,726	18,767,961

	（平成28年12月15日現在）	（平成29年12月15日現在）
株式	1,103,875,569	1,234,208,799
未収配当金	1,910,593	1,441,021
流動資産合計	1,128,018,273	1,257,747,335
資産合計	1,128,018,273	1,257,747,335
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	24,743	-
未払解約金	10,438,814	1,380,086
未払利息	48	53
その他未払費用	147	2
流動負債合計	10,463,752	1,380,141
負債合計	10,463,752	1,380,141
純資産の部		
元本等		
元本	600,339,502	570,510,029
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	517,215,019	685,857,165
元本等合計	1,117,554,521	1,256,367,194
純資産合計	1,117,554,521	1,256,367,194
負債純資産合計	1,128,018,273	1,257,747,335

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成28年12月16日 至平成29年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
	外貨建資産等の会計処理



項目	自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年12月15日現在)	(平成29年12月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	600,339,502口	570,510,029口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8615円 (10,000口当たりの純資産額 18,615円)	1口当たり純資産額 2.2022円 (10,000口当たりの純資産額 22,022円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

項目	自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年12月15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（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成28年12月15日現在）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,270,152	-	1,294,895	24,743
	米ドル	1,027,283	-	1,050,303	23,020
	カナダドル	105,687	-	106,470	783
	ユーロ	137,182	-	138,122	940
	合計	1,270,152	-	1,294,895	24,743

## （注）1．時価の算定方法

## (1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

## 2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（平成29年12月15日現在）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

自 平成28年12月16日

至 平成29年12月15日

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

## （その他の注記）

（平成28年12月15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

586,786,867円

同期中における追加設定元本額

116,296,805円

（平成28年12月15日現在）	
同期中における一部解約元本額	102,744,170円
平成28年12月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DCバランスファンド（安定型）	11,006,341円
三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）	43,623,008円
三井住友・DCバランスファンド（成長型）	35,028,071円
三井住友・DC外国株式アクティブ	487,085,580円
S M A M ・ バランスファンド V A 安定型（適格機関投資家専用）	22,649,549円
S M A M ・ バランスファンド V A 株 4 0 型（適格機関投資家専用）	292,566円
S M A M ・ バランスファンド V A 株 6 0 型（適格機関投資家専用）	297,713円
S M A M ・ バランスファンド V A 株 8 0 型（適格機関投資家専用）	356,674円
合計	600,339,502円

（平成29年12月15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	600,339,502円
同期中における追加設定元本額	91,043,504円
同期中における一部解約元本額	120,872,977円
平成29年12月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DCバランスファンド（安定型）	9,544,770円
三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）	40,753,477円
三井住友・DCバランスファンド（成長型）	31,057,770円
三井住友・DC外国株式アクティブ	475,649,192円
S M A M ・ バランスファンド V A 安定型（適格機関投資家専用）	12,683,372円
S M A M ・ バランスファンド V A 株 4 0 型（適格機関投資家専用）	251,264円
S M A M ・ バランスファンド V A 株 6 0 型（適格機関投資家専用）	250,986円
S M A M ・ バランスファンド V A 株 8 0 型（適格機関投資家専用）	319,198円
合計	570,510,029円

## 附属明細表

### 有価証券明細表

#### (a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	CHEVRON CORPORATION	1,781	119.53	212,882.93	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	1,305	64.66	84,381.30	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	2,630	26.42	69,484.60	
	SCHLUMBERGER LTD	1,737	62.37	108,336.69	

AVERY DENNISON CORP	567	114.28	64,796.76
DOWDUPONT INC	2,158	70.32	151,750.56
MARTIN MARIETTA MATERIALS	413	202.20	83,508.60
DANAHER CORP	939	92.85	87,186.15
EATON CORP PLC	1,706	76.44	130,406.64
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	255	317.01	80,837.55
PACCAR INC	1,421	69.22	98,361.62
RAYTHEON COMPANY	462	188.78	87,216.36
ROCKWELL AUTOMATION INC	584	189.45	110,638.80
STANLEY BLACK & DECKER INC	849	164.94	140,034.06
XYLEM INC	913	66.70	60,897.10
UNION PACIFIC CORP	1,020	129.17	131,753.40
GENERAL MOTORS CO	1,864	40.81	76,069.84
HANESBRANDS INC	2,809	21.26	59,719.34
MOHAWK INDUSTRIES INC	247	273.56	67,569.32
BRUNSWICK CORP	1,358	54.94	74,608.52
CARNIVAL CORP	1,235	65.18	80,497.30
CBS CORP-CL B	1,405	58.13	81,672.65
AMAZON.COM INC	211	1,174.26	247,768.86
LOWE'S COMPANIES INC	1,434	85.58	122,721.72
COSTCO WHOLESALE CORP	687	186.53	128,146.11
COCA-COLA CO/THE	2,887	46.03	132,888.61
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,220	100.24	122,292.80
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	699	107.68	75,268.32
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	530	127.81	67,739.30
BOSTON SCIENTIFIC CORP	4,522	25.62	115,853.64
COOPER COMPANIES INC (THE)	202	224.86	45,421.72
UNITEDHEALTH GROUP INC	978	221.25	216,382.50
ABBVIE INC	1,433	96.30	137,997.90
CELGENE CORP	546	108.24	59,099.04
JOHNSON & JOHNSON	1,590	141.65	225,223.50
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	632	188.32	119,018.24
BANK OF AMERICA CORP	6,203	28.73	178,212.19
BB & T CORPORATION	2,539	48.97	124,334.83
FIRST REPUBLIC BANK/CA	968	88.54	85,706.72
JPMORGAN CHASE & CO	1,934	104.66	202,412.44
AMERICAN EXPRESS COMPANY	992	97.15	96,372.80
CME GROUP INC.	794	150.42	119,433.48
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,079	73.67	79,489.93
MORGAN STANLEY	2,248	52.64	118,334.72
MARSH & MCLENNAN COS	1,447	83.02	120,129.94
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	931	156.53	145,729.43

	ADOBE SYSTEMS INC	617	175.00	107,975.00
	ALPHABET INC-CL A	299	1,057.47	316,183.53
	CADENCE DESIGN SYS INC	1,348	43.19	58,220.12
	ELECTRONIC ARTS INC	840	106.42	89,392.80
	FACEBOOK INC-A	1,113	178.39	198,548.07
	SYNOPSYS INC	1,327	87.98	116,749.46
	VMWARE INC	977	121.25	118,461.25
	APPLE INC	1,986	172.22	342,028.92
	LITTELFUSE INC	350	193.04	67,564.00
	TERADYNE INC	2,195	41.02	90,038.90
	T-MOBILE US INC	1,128	62.56	70,567.68
	AMERICAN ELECTRIC POWER	1,902	76.29	145,103.58
	CMS ENERGY CORPORATION	2,066	49.07	101,378.62
	BROADCOM LTD	679	259.34	176,091.86
	INTEL CORP	4,269	43.26	184,676.94
	XILINX INC	923	68.07	62,828.61
	米ドル 小計	86,383		7,474,398.17 (840,122,354)
カナダドル	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	1,522	54.65	83,177.30
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	1,172	78.03	91,451.16
	カナダドル 小計	2,694		174,628.46 (15,353,334)
ユーロ	TOTAL SA	1,927	47.20	90,964.03
	CRH PLC	2,313	28.78	66,568.14
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	1,468	32.01	46,990.68
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,264	46.86	59,231.04
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,451	70.66	102,527.66
	CONTINENTAL AG	378	223.60	84,520.80
	VALEO SA	1,191	60.32	71,841.12
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	325	244.35	79,413.75
	YOOX NET-A-PORTER GROUP	1,322	30.90	40,849.80
	KERRY GROUP PLC-A	832	93.50	77,792.00
	RECORDATI SPA	1,285	37.02	47,570.70
	SANOFI	1,040	73.77	76,720.80
	INTESA SANPAOLO	20,392	2.80	57,260.73
	SOCIETE GENERALE	1,431	44.02	62,999.77
	ING GROEP NV-CVA	8,149	15.50	126,309.50
	ORANGE S.A.	3,170	14.57	46,202.75
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	2,234	20.84	46,567.73
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	4,344	22.80	99,064.92
	ユーロ 小計	54,516		1,283,395.92 (170,049,959)

英ポンド	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,908	24.29	46,354.86	
	DS SMITH PLC	15,039	5.10	76,774.09	
	GLENCORE PLC	11,855	3.57	42,363.84	
	RIO TINTO PLC	1,240	35.62	44,168.80	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	726	54.95	39,893.70	
	WEIR GROUP PLC/THE	3,075	20.12	61,869.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,051	49.24	51,756.49	
	DIAGEO PLC	2,426	26.32	63,852.32	
	AVIVA PLC	13,929	5.00	69,714.64	
	VODAFONE GROUP PLC	27,441	2.29	63,031.97	
英ポンド 小計		78,690		559,779.71	(84,526,736)
スイスフラン	LONZA GROUP AG-REG	362	264.70	95,821.40	
	NOVARTIS AG-REG SHS	1,216	83.85	101,961.60	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	96	667.50	64,080.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	236	300.50	70,918.00	
スイスフラン 小計		1,910		332,781.00	(37,830,544)
スウェーデンクローナ	ASSA ABLOY AB-B	3,481	169.30	589,333.30	
	SWEDBANK AB - A SHARES	2,356	198.80	468,372.80	
	HEXAGON AB-B SHS	1,647	407.30	670,823.10	
スウェーデンクローナ 小計		7,484		1,728,529.20	(23,024,008)
ノルウェークローネ	ORKLA ASA	7,917	85.05	673,340.85	
ノルウェークローネ 小計		7,917		673,340.85	(9,123,768)
オーストラリアドル	ORIGIN ENERGY LIMITED	10,265	9.17	94,130.05	
	AMCOR LIMITED	4,730	15.27	72,227.10	
	BHP BILLITON LTD	3,427	27.70	94,927.90	
	MACQUARIE GROUP LTD	535	97.40	52,109.00	
オーストラリアドル 小計		18,957		313,394.05	(27,023,968)
香港ドル	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	17,000	39.50	671,500.00	
	AIA GROUP LTD	11,800	62.20	733,960.00	
香港ドル 小計		28,800		1,405,460.00	(20,224,569)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	10,900	7.61	82,949.00	
シンガポールドル 小計		10,900		82,949.00	(6,929,559)
合 計		298,251		1,234,208,799	(1,234,208,799)

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 62銘柄	66.9%	68.1%
カナダドル	株式 2銘柄	1.2%	1.2%
ユーロ	株式 18銘柄	13.5%	13.8%
英ポンド	株式 10銘柄	6.7%	6.8%
スイスフラン	株式 4銘柄	3.0%	3.1%
スウェーデンクローナ	株式 3銘柄	1.8%	1.9%
ノルウェークローネ	株式 1銘柄	0.7%	0.7%
オーストラリアドル	株式 4銘柄	2.2%	2.2%
香港ドル	株式 2銘柄	1.6%	1.6%
シンガポールドル	株式 1銘柄	0.6%	0.6%

#### (b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### 外国債券マザーファンド(A号)

#### 貸借対照表

(単位:円)

	(平成28年12月15日現在)	(平成29年12月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	23,864,399	15,680,745
コール・ローン	21,609,958	35,321,628
国債証券	3,595,462,850	4,175,355,866
地方債証券	46,191,277	45,100,564
社債券	141,525,291	-
派生商品評価勘定	2,286,455	2,563,494
未収入金	70,556,158	134,552,942
未収利息	17,536,610	18,104,595
前払費用	5,305,478	2,263,988
流動資産合計	3,924,338,476	4,428,943,822
資産合計	3,924,338,476	4,428,943,822
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,440,988	1,509,584
未払金	38,670,388	131,638,050
未払解約金	2,482,728	4,142,981
未払利息	51	101
その他未払費用	294	8
流動負債合計	42,594,449	137,290,724
負債合計	42,594,449	137,290,724



(平成28年12月15日現在)

(平成29年12月15日現在)

純資産の部		
元本等		
元本	1,488,446,348	1,591,023,841
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	2,393,297,679	2,700,629,257
元本等合計	3,881,744,027	4,291,653,098
純資産合計	3,881,744,027	4,291,653,098
負債純資産合計	3,924,338,476	4,428,943,822

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成28年12月16日 至平成29年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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12月15日現在)	(平成29年12月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,488,446,348口	1,591,023,841口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 2.6079円 26,079円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 2.6974円 26,974円)

(金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
---------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年12月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券） 「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12月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	109,855,463	-	112,141,918	2,286,455
	米ドル	38,370,904	-	39,848,000	1,477,096
	ユーロ	38,483,569	-	38,837,718	354,149
	スイスフラン	9,026,184	-	9,205,600	179,416
	デンマーククローネ	23,974,806	-	24,250,600	275,794
	売建	139,819,619	-	141,260,607	1,440,988
	米ドル	6,861,706	-	7,007,626	145,920
ユーロ	132,957,913	-	134,252,981	1,295,068	
合計		249,675,082	-	253,402,525	845,467

（平成29年12月15日現在）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	382,312,192	-	381,338,558	973,634
	米ドル	132,647,605	-	132,055,658	591,947
	カナダドル	85,166,097	-	84,962,300	203,797
	英ポンド	42,705,208	-	42,218,400	486,808
	スイスフラン	9,128,556	-	9,117,600	10,956
	デンマーククローネ	27,440,366	-	27,264,600	175,766
	オーストラリアドル	85,224,360	-	85,720,000	495,640
	売建	383,831,958	-	381,804,414	2,027,544
	米ドル	262,433,090	-	261,074,714	1,358,376
	ユーロ	121,398,868	-	120,729,700	669,168
合計	766,144,150	-	763,142,972	1,053,910	

## （注）1．時価の算定方法

## (1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

## 2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

自 平成28年12月16日  
至 平成29年12月15日

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

(その他の注記)

(平成28年12月15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	1,416,336,387円
同期中における追加設定元本額	241,043,395円
同期中における一部解約元本額	168,933,434円
平成28年12月15日現在における元本の内訳	
三井住友・ライフビュー・バランスファンド30(安定型)	117,055,017円
三井住友・ライフビュー・バランスファンド50(標準型)	166,587,875円
三井住友・ライフビュー・バランスファンド70(積極型)	79,854,571円
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	9,409,745円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	7,311,576円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	1,994,196円
三井住友・DC外国債券アクティブ	1,105,854,383円
SMAM・バランスファンドVA株40型(適格機関投資家専用)	191,852円
SMAM・バランスファンドVA株60型(適格機関投資家専用)	113,690円
SMAM・バランスファンドVA株80型(適格機関投資家専用)	73,443円
合計	1,488,446,348円

(平成29年12月15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	1,488,446,348円
同期中における追加設定元本額	244,550,789円
同期中における一部解約元本額	141,973,296円
平成29年12月15日現在における元本の内訳	
三井住友・ライフビュー・バランスファンド30(安定型)	132,939,110円
三井住友・ライフビュー・バランスファンド50(標準型)	192,433,955円
三井住友・ライフビュー・バランスファンド70(積極型)	98,282,358円
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	14,154,620円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	23,508,346円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	8,101,660円
三井住友・DC外国債券アクティブ	1,121,189,406円
SMAM・バランスファンドVA株40型(適格機関投資家専用)	205,976円
SMAM・バランスファンドVA株60型(適格機関投資家専用)	122,592円
SMAM・バランスファンドVA株80型(適格機関投資家専用)	85,818円
合計	1,591,023,841円

附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.75	960,000.00	957,450.00	
		US TREASURY N/B 1.375	5,210,000.00	5,150,980.49	
		US TREASURY N/B 1.75	1,400,000.00	1,392,125.00	
		US TREASURY N/B 1.875	4,830,000.00	4,786,605.48	
		US TREASURY N/B 2.25	210,000.00	209,786.71	
		US TREASURY N/B 2.375	130,000.00	130,934.37	
		US TREASURY N/B 2.5	1,080,000.00	1,098,646.87	
		US TREASURY N/B 3	1,720,000.00	1,817,825.00	
		US TREASURY N/B 3.75	320,000.00	381,800.00	
		US TREASURY N/B 4.375	410,000.00	528,163.27	
	米ドル 小計		16,270,000.00	16,454,317.19 (1,849,465,252)	
カナダドル		CANADA-GOV'T 1.75	40,000.00	40,132.40	
		CANADA-GOV'T 5.75	450,000.00	625,576.50	
	カナダドル 小計		490,000.00	665,708.90 (58,529,126)	
メキシコペソ		MEXICAN BONOS 8	5,000,000.00	5,172,650.00	
	メキシコペソ 小計		5,000,000.00	5,172,650.00 (30,466,908)	
ユーロ		BELGIAN 0318 3.75	340,000.00	381,106.00	
		BELGIAN 0320 4.25	160,000.00	255,712.00	
		BELGIAN 0325 4.25	800,000.00	974,992.00	
		BELGIAN 1	720,000.00	759,852.00	
		BTPS 4.5	280,000.00	335,400.80	
		BTPS 5	230,000.00	310,263.10	
		DEUTSCHLAND REP 0.25	970,000.00	971,600.50	
		DEUTSCHLAND REP 1.5	40,000.00	43,858.00	
		DEUTSCHLAND REP 1.75	90,000.00	100,669.50	
		DEUTSCHLAND REP 2.5	370,000.00	500,265.90	
		DEUTSCHLAND REP 4.75	80,000.00	130,365.60	
		FRANCE O.A.T. 0	1,130,000.00	1,145,763.50	
		FRANCE O.A.T. 0	1,720,000.00	1,745,094.80	
		FRANCE O.A.T. 0.25	220,000.00	224,811.40	
		FRANCE O.A.T. 1	970,000.00	985,238.70	

	FRANCE O.A.T. 1	320,000.00	327,753.60	
	FRANCE O.A.T. 2.5	490,000.00	532,777.00	
	FRANCE O.A.T. 3.25	130,000.00	181,196.60	
	FRANCE O.A.T. 4	620,000.00	936,931.60	
	FRANCE O.A.T. 5.5	670,000.00	1,025,924.10	
	IRISH GOVT 5	850,000.00	986,000.00	
	SPANISH GOV'T 0.25	280,000.00	280,742.00	
	SPANISH GOV'T 1.15	250,000.00	258,495.00	
	SPANISH GOV'T 6	50,000.00	72,495.50	
	ユーロ 小計	11,780,000.00	13,467,309.20 (1,784,418,469)	
英ポンド	UK TSY GILT 1.25	400,000.00	402,152.00	
	UK TSY GILT 1.75	350,000.00	357,294.00	
	UK TSY GILT 1.75	260,000.00	261,492.40	
	UK TSY GILT 1.75	310,000.00	324,886.20	
	UK TSY GILT 4.25	180,000.00	254,043.00	
	UK TSY GILT 4.5	240,000.00	373,740.00	
	英ポンド 小計	1,740,000.00	1,973,607.60 (298,014,747)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	1,150,000.00	1,335,886.00	
	スウェーデンクローナ 小計	1,150,000.00	1,335,886.00 (17,794,001)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 3	700,000.00	772,380.00	
	ノルウェークローネ 小計	700,000.00	772,380.00 (10,465,749)	
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 5.75	710,000.00	797,330.00	
	ポーランドズロチ 小計	710,000.00	797,330.00 (25,012,242)	
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	500,000.00	511,134.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	240,000.00	289,848.00	
	オーストラリアドル 小計	740,000.00	800,982.00 (69,068,677)	
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.75	170,000.00	178,466.00	
	シンガポールドル 小計	170,000.00	178,466.00 (14,909,049)	
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 4.059	620,000.00	624,515.46	
	マレーシアリングgit 小計	620,000.00	624,515.46 (17,211,646)	
国債証券合計			4,175,355,866 (4,175,355,866)	
地方債証券	カナダドル	ONTARIO PROVINCE 3.15	280,000.00	293,048.00
	カナダドル 小計	280,000.00	293,048.00 (25,764,780)	

	オーストラリアドル	NSWTC-DOMESTIC 3.5	220,000.00	224,235.00	
	オーストラリアドル 小計		220,000.00	224,235.00 (19,335,784)	
地方債証券合計				45,100,564 (45,100,564)	
	合計			4,220,456,430 (4,220,456,430)	

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

通貨	銘柄数		組入債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券	10銘柄	43.1%	43.8%
カナダドル	国債証券	2銘柄	1.4%	1.4%
	地方債証券	1銘柄	0.6%	0.6%
メキシコペソ	国債証券	1銘柄	0.7%	0.7%
ユーロ	国債証券	24銘柄	41.6%	42.3%
英ポンド	国債証券	6銘柄	6.9%	7.1%
スウェーデンクローナ	国債証券	1銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券	1銘柄	0.2%	0.2%
ポーランドズロチ	国債証券	1銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	2銘柄	1.6%	1.6%
	地方債証券	1銘柄	0.5%	0.5%
シンガポールドル	国債証券	1銘柄	0.3%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	1銘柄	0.4%	0.4%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。



【中間財務諸表】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期中間計算期間（平成29年12月16日から平成30年6月15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。

## 【三井住友・DCバランスファンド（安定型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第18期中間計算期間 （平成30年 6月15日現在）
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	8,608,906
親投資信託受益証券	212,730,449
派生商品評価勘定	127,561
未収入金	4,793,006
流動資産合計	226,259,922
資産合計	226,259,922
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	37,277
未払金	4,022,784
未払受託者報酬	116,481
未払委託者報酬	1,514,235
未払利息	24
その他未払費用	5,888
流動負債合計	5,696,689
負債合計	5,696,689
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	170,395,502
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	50,167,731
元本等合計	220,563,233
純資産合計	220,563,233
負債純資産合計	226,259,922

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期中間計算期間 自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	7,173
為替差損益	835,300
営業収益合計	842,473
営業費用	
支払利息	2,263
受託者報酬	116,481
委託者報酬	1,514,235
その他費用	6,849
営業費用合計	1,639,828
営業利益又は営業損失（ ）	797,355
経常利益又は経常損失（ ）	797,355
中間純利益又は中間純損失（ ）	797,355
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（ ）	4,271
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	49,208,956
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,107,900
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	3,107,900
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,347,499
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,347,499
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（ ）	50,167,731

## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第18期中間計算期間 自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
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 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>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項 目	第18期中間計算期間 (平成30年 6月15日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	170,395,502口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.2944円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 12,944円)</p>

## ( 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18期中間計算期間 (平成30年 6月15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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

（デリバティブ取引に関する注記）

第18期中間計算期間（平成30年 6月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	28,090,654	-	28,000,370	90,284
	米ドル	19,393,123	-	19,430,400	37,277
	ユーロ	8,697,531	-	8,569,970	127,561
合計		28,090,654	-	28,000,370	90,284

（注）1．時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項 目	第18期中間計算期間 (平成30年 6月15日現在)
期首元本額	164,315,384円
期中追加設定元本額	10,580,580円
期中一部解約元本額	4,500,462円

## 【三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

		第18期中間計算期間 （平成30年 6月15日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		18,232,152
親投資信託受益証券		527,643,741
派生商品評価勘定		335,086
未収入金		14,071,332
流動資産合計		560,282,311
資産合計		
		560,282,311
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定		94,887
未払金		11,854,019
未払受託者報酬		291,109
未払委託者報酬		3,784,344
未払利息		52
その他未払費用		14,689
流動負債合計		16,039,100
負債合計		
		16,039,100
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		360,197,546
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		184,045,665
元本等合計		544,243,211
純資産合計		
		544,243,211
負債純資産合計		
		560,282,311

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

第18期中間計算期間	
自 平成29年12月16日	
至 平成30年 6月15日	
営業収益	
有価証券売買等損益	3,192,855
為替差損益	1,990,701
営業収益合計	5,183,556
営業費用	
支払利息	4,789
受託者報酬	291,109
委託者報酬	3,784,344
その他費用	16,096
営業費用合計	4,096,338
営業利益又は営業損失（ ）	1,087,218
経常利益又は経常損失（ ）	1,087,218
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,087,218
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（ ）	240,923
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	179,098,313
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,761,588
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	10,761,588
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,660,531
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,660,531
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（ ）	184,045,665



## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第18期中間計算期間 自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
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 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>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項 目	第18期中間計算期間 (平成30年 6月15日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	360,197,546口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.5110円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 15,110円)</p>

## ( 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18期中間計算期間 (平成30年 6月15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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

## (デリバティブ取引に関する注記)

第18期中間計算期間（平成30年 6月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	72,211,559	-	71,971,360	240,199
	米ドル	49,364,313	-	49,459,200	94,887
	ユーロ	22,847,246	-	22,512,160	335,086
合計		72,211,559	-	71,971,360	240,199

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項 目	第18期中間計算期間 (平成30年 6月15日現在)
期首元本額	352,146,190円
期中追加設定元本額	21,141,194円
期中一部解約元本額	13,089,838円

## 【三井住友・DCバランスファンド（成長型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

		第18期中間計算期間 (平成30年 6月15日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		11,518,707
親投資信託受益証券		292,372,062
派生商品評価勘定		161,831
未収入金		5,712,785
流動資産合計		309,765,385
資産合計		
		309,765,385
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定		64,176
未払金		4,387,520
未払受託者報酬		156,088
未払委託者報酬		2,029,125
未払利息		33
その他未払費用		7,906
流動負債合計		6,644,848
負債合計		
		6,644,848
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		183,500,387
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		119,620,150
元本等合計		303,120,537
純資産合計		
		303,120,537
負債純資産合計		
		309,765,385

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期中間計算期間 自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	3,687,852
為替差損益	1,145,374
営業収益合計	4,833,226
営業費用	
支払利息	2,974
受託者報酬	156,088
委託者報酬	2,029,125
その他費用	9,161
営業費用合計	2,197,348
営業利益又は営業損失（ ）	2,635,878
経常利益又は経常損失（ ）	2,635,878
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,635,878
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（ ）	99,555
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	107,373,388
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,386,764
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	12,386,764
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,676,325
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,676,325
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（ ）	119,620,150

## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第18期中間計算期間 自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
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 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>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項 目	第18期中間計算期間 (平成30年 6月15日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	183,500,387口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6519円
	(10,000口当たりの純資産額 16,519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18期中間計算期間 (平成30年 6月15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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

（デリバティブ取引に関する注記）

第18期中間計算期間（平成30年 6月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	44,421,205	-	44,323,550	97,655
	米ドル	33,387,024	-	33,451,200	64,176
	ユーロ	11,034,181	-	10,872,350	161,831
合計		44,421,205	-	44,323,550	97,655

（注）1．時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

項目	第18期中間計算期間 （平成30年 6月15日現在）
期首元本額	168,797,814円
期中追加設定元本額	18,901,029円
期中一部解約元本額	4,198,456円

（参考）

「三井住友・DCバランスファンド（安定型）」「三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）」および「三井住友・DCバランスファンド（成長型）」は、「国内株式マザーファンド（A号）」、「国内債券マザーファンド（B号）」、「外国株式マザーファンド（A号）」および「外国債券マザーファンド（A号）」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「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式マザーファンド（A号）

貸借対照表

		（単位：円）
		（平成30年 6月15日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		18,187,890
株式		881,243,420
未収入金		32,251,731
未収配当金		5,810,440
流動資産合計		937,493,481
資産合計		937,493,481
負債の部		
流動負債		
未払金		25,199,699
未払解約金		5,701,837
未払利息		52
その他未払費用		341
流動負債合計		30,901,929
負債合計		30,901,929
純資産の部		
元本等		
元本		718,988,266
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		187,603,286
元本等合計		906,591,552
純資産合計		906,591,552
負債純資産合計		937,493,481

注記表



## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成30年 6月15日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		718,988,266口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2609円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,609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30年 6月15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。

項目	(平成30年 6月15日現在)
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(平成30年 6月15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	748,069,746円
同期中における追加設定元本額	94,070,407円
同期中における一部解約元本額	123,151,887円
平成30年 6月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	31,300,586円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	137,432,476円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	103,031,970円
三井住友・DC国内株式アクティブS	402,705,211円
S M A M・バランスファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	42,289,476円
S M A M・バランスファンドVA株40型(適格機関投資家専用)	727,262円
S M A M・バランスファンドVA株60型(適格機関投資家専用)	596,535円
S M A M・バランスファンドVA株80型(適格機関投資家専用)	904,750円
合計	718,988,266円

## 国内債券マザーファンド(B号)

## 貸借対照表

(単位:円)

(平成30年 6月15日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,105,061,698
国債証券	108,962,937,100
地方債証券	28,295,638,200

(平成30年 6月15日現在)

特殊債券	36,739,554,454
社債券	32,142,522,000
未収入金	11,478,521,200
未収利息	506,033,451
前払費用	61,003,529
流動資産合計	219,291,271,632
資産合計	219,291,271,632
負債の部	
流動負債	
未払金	12,213,591,000
未払解約金	11,288,113
未払利息	3,178
その他未払費用	37,754
流動負債合計	12,224,920,045
負債合計	12,224,920,045
純資産の部	
元本等	
元本	148,122,287,585
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	58,944,064,002
元本等合計	207,066,351,587
純資産合計	207,066,351,587
負債純資産合計	219,291,271,632

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成29年12月16日 至平成30年6月15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30年 6月15日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		148,122,287,585口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3979円
	(10,000口当たりの純資産額)	13,979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30年 6月15日現在)	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(平成30年 6月15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	121,405,654,668円
同期中における追加設定元本額	29,025,196,138円
同期中における一部解約元本額	2,308,563,221円
平成30年 6月15日現在における元本の内訳	
三井住友・年金プラン30	885,585,009円
三井住友・年金プラン50	783,745,419円
三井住友・年金プラン70	249,391,749円
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	84,563,988円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	156,122,808円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	51,098,702円
三井住友・DC国内債券アクティブ	306,815,367円

（平成30年 6月15日現在）	
三井住友・日本債券年金ファンド	4,046,837,230円
S M A M ・ 年金国内債券アクティブファンド（適格機関投資家専用）	4,452,135,221円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定型（適格機関投資家専用）	325,675,970円
S M A M ・ バランスファンドV A 株 4 0 型（適格機関投資家専用）	1,165,529円
S M A M ・ バランスファンドV A 株 6 0 型（適格機関投資家専用）	376,074円
S M A M ・ バランスファンドV A 株 8 0 型（適格機関投資家専用）	159,200円
バランスファンドV A（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	146,982,778円
三井住友 / F O F s 用日本債 F（適格機関投資家限定）	136,631,632,541円
合計	148,122,287,585円

## 外国株式マザーファンド（A号）

### 貸借対照表

（単位：円）

（平成30年 6月15日現在）

#### 資産の部

##### 流動資産

預金	3,098,375
コール・ローン	19,743,429
株式	1,323,527,677
未収入金	13,260,000
未収配当金	1,768,505
流動資産合計	1,361,397,986

##### 資産合計

1,361,397,986

#### 負債の部

##### 流動負債

未払解約金	641,315
未払利息	56
その他未払費用	533
流動負債合計	641,904

##### 負債合計

641,904

#### 純資産の部

##### 元本等

元本	590,907,598
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	769,848,484

元本等合計 1,360,756,082

##### 純資産合計

1,360,756,082

#### 負債純資産合計

1,361,397,986

### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 6月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	590,907,598口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.3028円 (10,000口当たりの純資産額 23,028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30年 6月15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。

項目	(平成30年 6月15日現在)
2.時価の算定方法	(1) 有価証券(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(平成30年 6月15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	570,510,029円
同期中における追加設定元本額	77,337,240円
同期中における一部解約元本額	56,939,671円
平成30年 6月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	11,017,524円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	44,960,569円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	34,932,953円
三井住友・DC外国株式アクティブ	487,668,228円
S M A M・バランスファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	11,542,885円
S M A M・バランスファンドVA株40型(適格機関投資家専用)	244,468円
S M A M・バランスファンドVA株60型(適格機関投資家専用)	237,661円
S M A M・バランスファンドVA株80型(適格機関投資家専用)	303,310円
合計	590,907,598円

## 外国債券マザーファンド(A号)

## 貸借対照表

(単位:円)

(平成30年 6月15日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	48,755,003
コール・ローン	29,265,812
国債証券	4,063,470,509

（平成30年 6月15日現在）

地方債証券	28,549,390
社債券	42,906,515
派生商品評価勘定	1,417,641
未収入金	82,183,424
未収利息	19,296,369
前払費用	6,921,604
流動資産合計	4,322,766,267
資産合計	4,322,766,267
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,658,166
未払金	82,604,087
未払解約金	19,614,539
未払利息	84
その他未払費用	1,486
流動負債合計	106,878,362
負債合計	106,878,362
純資産の部	
元本等	
元本	1,622,604,264
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,593,283,641
元本等合計	4,215,887,905
純資産合計	4,215,887,905
負債純資産合計	4,322,766,267

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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>
	外貨建資産等の会計処理



項目	自 平成29年12月16日 至 平成30年 6月15日
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 6月15日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		1,622,604,264口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.5982円
	(10,000口当たりの純資産額)	25,982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30年 6月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(平成30年 6月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	249,212,734	-	245,795,793	3,416,941
	ユーロ	93,871,138	-	92,389,993	1,481,145
	スイスフラン	6,709,784	-	6,664,800	44,984
	スウェーデンクローナ	41,693,157	-	41,745,000	51,843

デンマーククローネ	24,933,480	-	24,567,400	366,080
オーストラリアドル	82,005,175	-	80,428,600	1,576,575
売建	272,361,010	-	272,184,594	176,416
米ドル	175,953,318	-	177,133,800	1,180,482
ユーロ	96,407,692	-	95,050,794	1,356,898
合計	521,573,744	-	517,980,387	3,240,525

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (その他の注記)

(平成30年 6月15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	1,591,023,841円
同期中における追加設定元本額	182,890,757円
同期中における一部解約元本額	151,310,334円
平成30年 6月15日現在における元本の内訳	
三井住友・ライフビュー・バランスファンド30(安定型)	146,866,501円
三井住友・ライフビュー・バランスファンド50(標準型)	217,978,618円
三井住友・ライフビュー・バランスファンド70(積極型)	108,822,173円
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	11,423,443円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	12,537,858円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	4,073,810円
三井住友・DC外国債券アクティブ	1,120,486,519円
SMAM・バランスファンドVA株40型(適格機関投資家専用)	209,693円
SMAM・バランスファンドVA株60型(適格機関投資家専用)	120,815円
SMAM・バランスファンドVA株80型(適格機関投資家専用)	84,834円
合計	1,622,604,264円

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 三井住友・DCバランスファンド（安定型）

2018年 6月29日現在

資産総額	219,336,823円
負債総額	163,269円
純資産総額（ - ）	219,173,554円
発行済口数	170,894,259口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2825円
（1万口当たり純資産額）	（12,825円）

## 三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）

2018年 6月29日現在

資産総額	537,287,301円
負債総額	395,802円
純資産総額（ - ）	536,891,499円
発行済口数	361,232,990口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4863円
（1万口当たり純資産額）	（14,863円）

## 三井住友・DCバランスファンド（成長型）

2018年 6月29日現在

資産総額	297,383,664円
負債総額	229,633円
純資産総額（ - ）	297,154,031円
発行済口数	183,994,482口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6150円
（1万口当たり純資産額）	（16,150円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

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

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ 受益権の再分割

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

ヘ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### イ 資本金の額および株式数

	2018年6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。

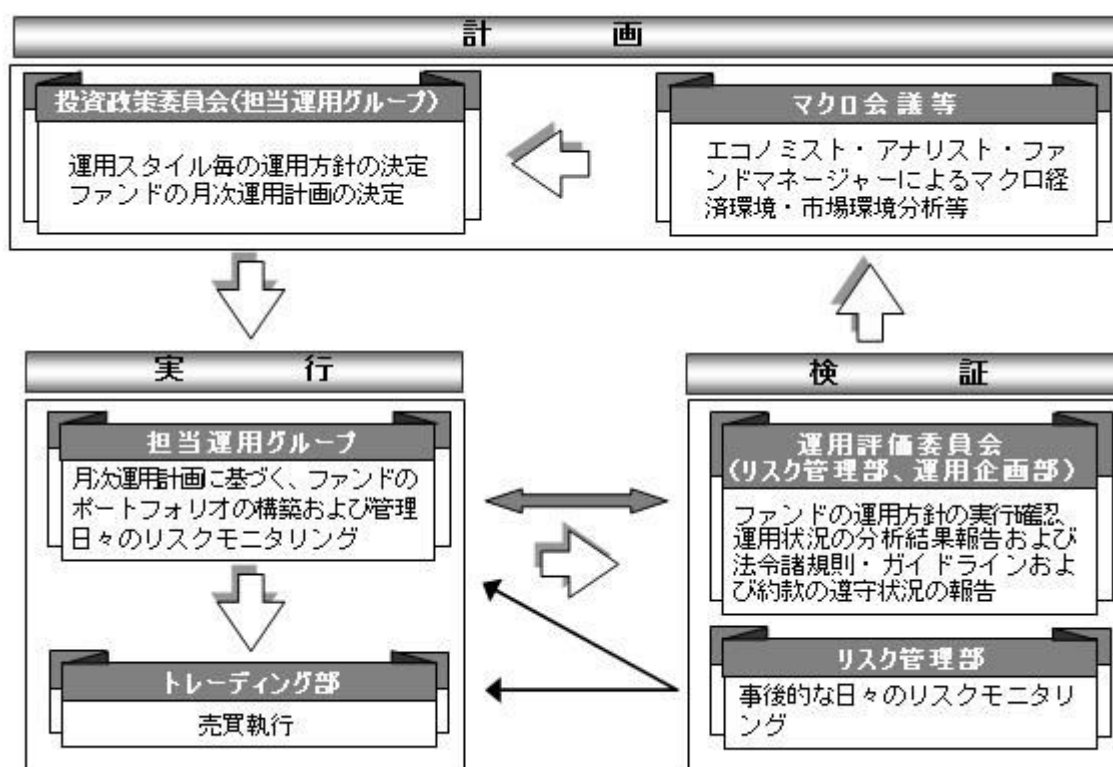
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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。

##### 二 投資信託の運用の流れ



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年6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。

（2018年6月29日現在）

		本数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単位型	88 ( 41)	345,854 ( 262,846)
	追加型	466 ( 198)	5,809,736 ( 2,828,009)
	計	554 ( 239)	6,155,590 ( 3,090,855)
公社債投資信託	単位型	107 ( 107)	300,164 ( 300,164)
	追加型	1 ( 0)	30,353 ( 0)
	計	108 ( 107)	330,517 ( 300,164)
合計		662 ( 346)	6,486,107 ( 3,391,019)

( )内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

## 3【委託会社等の経理状況】

1 当社の財務諸表は、「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29年4月1日から平成30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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,279,384	20,873,870
顧客分別金信託	20,008	20,010
前払費用	351,526	402,249
未収入金	40,544	39,030
未収委託者報酬	5,511,715	6,332,203
未収運用受託報酬	1,297,104	1,725,215
未収投資助言報酬	343,523	316,407

未収収益		20,789	50,321
繰延税金資産		482,535	715,988
その他の流動資産		5,560	10,891
流動資産合計		21,352,691	30,486,188
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		198,767	185,371
器具備品		261,096	300,694
有形固定資産合計		459,864	486,065
無形固定資産			
ソフトウェア		493,806	409,765
ソフトウェア仮勘定		141,025	5,755
電話加入権		68	56
商標権		3	-
無形固定資産合計		634,903	415,576
投資その他の資産			
投資有価証券		12,098,372	10,616,594
関係会社株式		10,412,523	10,412,523
長期差入保証金		677,681	658,505
長期前払費用		61,282	69,423
会員権		7,819	7,819
繰延税金資産		871,577	678,459
投資その他の資産合計		24,129,257	22,443,325
固定資産合計		25,224,025	23,344,968
資産合計		46,576,717	53,831,157

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	304	84
その他の預り金	80,380	92,326
未払金		
未払収益分配金	655	649
未払償還金	140,124	137,522
未払手数料	2,424,318	2,783,763
その他未払金	52,903	236,739
未払費用	2,564,625	3,433,641
未払消費税等	160,571	547,706
未払法人税等	661,467	1,785,341
賞与引当金	1,001,068	1,507,256
その他の流動負債	445	1,408
流動負債合計	7,086,864	10,526,438
固定負債		
退職給付引当金	3,177,131	3,319,830
賞与引当金	40,167	99,721
その他の固定負債	2,174	3,363
固定負債合計	3,219,473	3,422,915
負債合計	10,306,337	13,949,354

純資産の部

株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	23,493,074	26,561,078
利益剰余金合計	25,314,279	28,382,283
株主資本計	35,943,263	39,011,267
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	327,116	870,535
評価・換算差額等合計	327,116	870,535
純資産合計	36,270,379	39,881,802
負債・純資産合計	46,576,717	53,831,157

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	31,628,014		36,538,981	
運用受託報酬	5,649,190		8,362,118	
投資助言報酬	1,726,511		1,440,233	
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	
サービス支援手数料	61,268		128,324	
その他	54,261		55,820	
営業収益計	39,124,246		46,530,479	
営業費用				
支払手数料	14,908,517		16,961,384	
広告宣伝費	366,227		353,971	
公告費	1,140		1,140	
調査費				
調査費	1,325,978		1,654,233	
委託調査費	4,343,104		5,972,473	
営業雑経費				
通信費	46,030		40,066	
印刷費	338,254		339,048	
協会費	21,669		-	
諸会費	20,054		45,465	
情報機器関連費	2,516,497		2,582,734	
販売促進費	24,896		34,333	
その他	149,177		136,669	
営業費用合計	24,061,549		28,121,520	



一般管理費			
給料			
役員報酬		225,885	196,529
給料・手当		6,121,741	6,190,716
賞与		610,533	601,375
賞与引当金繰入額		989,925	1,566,810
交際費		23,136	25,709
事務委託費		317,928	256,413
旅費交通費		229,248	220,569
租税公課		268,527	282,036
不動産賃借料		622,662	654,286
退職給付費用		423,954	419,884
固定資産減価償却費		384,068	329,756
諸経費		335,840	285,490
一般管理費合計		10,553,451	11,029,580
営業利益		4,509,246	7,379,378
営業外収益			
受取配当金	1	106,651	51,335
受取利息	1	745	520
時効成立分配金・償還金		1,721	2,622
原稿・講演料		1,474	894
雑収入		12,592	10,669
営業外収益合計		123,184	66,042
営業外費用			
為替差損		9,737	5,125
雑損失		1,084	913
営業外費用合計		10,821	6,038
経常利益		4,621,608	7,439,383
特別利益			
投資有価証券償還益		353,462	61,842
投資有価証券売却益		2,579	30,980
特別利益合計		356,041	92,822
特別損失			
固定資産除却損	2	8,157	354,695
投資有価証券償還損		43,644	141,666
投資有価証券売却損		15,012	9,634
ゴルフ会員権売却損		3,894	-
事務所移転費用		21,175	-
特別損失合計		91,884	505,996
税引前当期純利益		4,885,765	7,026,209
法人税、住民税及び事業税		1,391,996	2,350,891
法人税等調整額		25,454	280,166
法人税等合計		1,366,541	2,070,725
当期純利益		3,519,223	4,955,483

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本
--	------

	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 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	21,984,811	23,806,015	34,434,999
当期変動額									
剰余金の配当							2,010,960	2,010,960	2,010,960
当期純利益							3,519,223	3,519,223	3,519,223
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,508,263	1,508,263	1,508,263
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074	25,314,279	35,943,263

	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	517,775	517,775	34,952,774
当期変動額			
剰余金の配当			2,010,960
当期純利益			3,519,223
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	190,658	190,658	190,658
当期変動額合計	190,658	190,658	1,317,604
当期末残高	327,116	327,116	36,270,379

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								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	23,493,074	25,314,279	35,943,263
当期変動額									
剰余金の配当							1,887,480	1,887,480	1,887,480
当期純利益							4,955,483	4,955,483	4,955,483
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,068,003	3,068,003	3,068,003
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078	28,382,283	39,011,267

	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	327,116	327,116	36,270,379
当期変動額			
剰余金の配当			1,887,480

当期純利益			4,955,483
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	543,419	543,419	543,419
当期変動額合計	543,419	543,419	3,611,423
当期末残高	870,535	870,535	39,881,802

## [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)並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	3～20年

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

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

## (2) 退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

## (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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
建物	291,976千円	312,784千円
器具備品	651,918千円	768,929千円

## 2 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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	-千円	-千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

## 3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	256,031千円	204,923千円

## (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28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
受取配当金	106,640千円	-千円
受取利息	18千円	-千円

## 2 固定資産除却損

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	6,952千円	-千円
器具備品	1,204千円	0千円
ソフトウェア	-千円	9,000千円
ソフトウェア仮勘定	-千円	345,695千円

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成28年4月1日 至平成29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28年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,010,960	114,000	平成28年 3月31日	平成28年 6月28日

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

平成29年6月27日開催の第32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29年6月27日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,887,480	107,000	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月27日 定時株主総会	普通株式	1,887,480	107,000	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

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

平成30年6月26日開催の第33回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,822,400	160,000	平成30年 3月31日	平成30年 6月27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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
1年以内	626,698	208,187
1年超	191,491	42,916
合計	818,190	251,104

(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29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	13,279,384	13,279,384	-
(2)顧客分別金信託	20,008	20,008	-
(3)未収委託者報酬	5,511,715	5,511,715	-
(4)未収運用受託報酬	1,297,104	1,297,104	-
(5)未収投資助言報酬	343,523	343,523	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	12,098,074	12,098,074	-
(7)長期差入保証金	677,681	677,681	-
資産計	33,227,492	33,227,492	-

(1)顧客からの預り金	304	304	-
(2)未払手数料	2,424,318	2,424,318	-
負債計	2,424,622	2,424,622	-

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	20,873,870	20,873,870	-
(2)顧客分別金信託	20,010	20,010	-
(3)未収委託者報酬	6,332,203	6,332,203	-
(4)未収運用受託報酬	1,725,215	1,725,215	-
(5)未収投資助言報酬	316,407	316,407	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,616,296	10,616,296	-
(7)長期差入保証金	658,505	658,505	-
資産計	40,542,507	40,542,507	-
(1)顧客からの預り金	84	84	-
(2)未払手数料	2,783,763	2,783,763	-
負債計	2,783,847	2,783,847	-

（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29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
その他有価証券 非上場株式	298	298
合計	298	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523	10,412,523
合計	10,412,523	10,412,523

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

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額  
前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	13,279,384	-	-	-
顧客分別金信託	20,008	-	-	-
未収委託者報酬	5,511,715	-	-	-
未収運用受託報酬	1,297,104	-	-	-
未収投資助言報酬	343,523	-	-	-
長期差入保証金	31,201	646,480	-	-
合計	20,482,937	646,480	-	-

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	20,873,870	-	-	-
顧客分別金信託	20,010	-	-	-
未収委託者報酬	6,332,203	-	-	-
未収運用受託報酬	1,725,215	-	-	-
未収投資助言報酬	316,407	-	-	-
長期差入保証金	602,360	56,144	-	-
合計	29,870,067	56,144	-	-

(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29年3月31日）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

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

2. その他有価証券

前事業年度（平成29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	4,921,829	4,267,927	653,902
小計	4,921,829	4,267,927	653,902
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	7,176,244	7,358,662	182,417
小計	7,176,244	7,358,662	182,417
合計	12,098,074	11,626,589	471,485

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

当事業年度（平成30年3月31日）



区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	7,366,669	6,046,232	1,320,437
小計	7,366,669	6,046,232	1,320,437
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,249,626	3,315,328	65,701
小計	3,249,626	3,315,328	65,701
合計	10,616,296	9,361,560	1,254,735

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

### 3.事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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
228,204	2,579	15,012

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
532,099	30,980	9,634

(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28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,028,212	3,177,131
勤務費用	280,524	285,715
利息費用	-	2,922
数理計算上の差異の発生額	15,494	51,212
退職給付の支払額	116,111	94,727
退職給付債務の期末残高	3,177,131	3,319,830

##### (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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,177,131	3,319,830
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	3,177,131	3,319,830

##### (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28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
勤務費用	280,524	285,715
利息費用	-	2,922
数理計算上の差異の費用処理額	15,494	51,212
その他	158,924	182,458
確定給付制度に係る退職給付費用	423,954	419,884

(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。)

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
割引率	0.092%	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137,310千円、当事業年度147,195千円であります。

#### (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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	308,929	461,521
調査費	79,381	90,509
未払金	45,745	59,821
未払事業税	46,406	102,103
その他	2,071	2,032
繰延税金資産合計	482,535	715,988
固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	972,837	1,016,532
ソフトウェア償却	18,718	11,289
賞与引当金	12,299	30,534
投資有価証券評価損	95	95
その他	14,592	6,805
繰延税金資産小計	1,018,544	1,065,256
評価性引当額	2,597	2,597
繰延税金資産合計	1,015,946	1,062,659
繰延税金負債		

その他有価証券評価差額金	144,368	384,200
繰延税金負債合計	144,368	384,200
繰延税金資産の純額	1,354,113	1,394,447

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

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
法定実効税率	30.8%	30.8%
(調整)		
評価性引当額の増減	0.1	-
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.2
受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.8	-
住民税均等割等	0.1	0.1
所得税額控除による税額控除	2.2	1.9
その他	0.0	0.1
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.9	29.4

(セグメント情報等)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	31,628,014	5,649,190	1,726,511	120,529	39,124,246

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

### 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

### 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

### 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

#### 1. セグメント情報

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

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

#### 2. 関連情報

##### (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	36,538,981	8,362,118	1,440,233	189,145	46,530,479

##### (2) 地域ごとの情報

###### 営業収益

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

###### 有形固定資産

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

##### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

### 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

### 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

### 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

#### (関連当事者情報)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

##### 1. 関連当事者との取引

###### (1) 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	SumitomoMitsui AssetManagement (HongKong)Limited	Hong Kong	5,000,000 (ホンコン ドル)	投資運 用業	% (所有) 直接100	投信の助 言業務 役員の 兼任	剰余金 の配当	106,640	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

受取配当金については、剰余金の分配可能額を基礎とした一定の基準に基づき合理的に決定しております。

## (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
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,737,677	未払手数料	489,567
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売委託	委託販売手数料	5,485,934	未払手数料	862,697

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

3. ㈱三井住友銀行の属性が、平成28年7月29日付で、「その他の関係会社」より「親会社」、平成28年10月1日付で「親会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。なお、取引金額の中には、「その他の関係会社」及び「親会社」であった期間の取引金額が含まれております。

4. SMBC日興証券㈱の属性が、平成28年10月1日付で、「その他の関係会社の子会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。なお、取引金額の中には、「その他の関係会社の子会社」であった期間の取引金額が含まれております。

## 2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,761,066	未払手数料	429,436
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	5,685,815	未払手数料	953,752

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1株当たり純資産額	2,056,143.98円	2,260,873.18円
1株当たり当期純利益金額	199,502.47円	280,923.11円

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

2. 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28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	3,519,223	4,955,483
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)	3,519,223	4,955,483
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

#### (重要な後発事象)

前事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する主要株主間での基本合意について

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項

該当ありません。

- 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実  
該当ありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社  
(ロ) 資本金の額 342,037百万円（2018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（2018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 三井生命保険株式会社  
(ロ) 資本金の額 167,280百万円（2018年3月末現在）  
(ハ) 事業の内容 保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

#### イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

#### ロ 販売会社

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

### 3【資本関係】

該当ありません。

## 第3【その他】

1. 目論見書の表紙等にロゴ・マーク、写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用すること、ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマーク、委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該目論見書の使用開始日などを記載することがあります。
2. 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。
3. 目論見書に当ファンドの信託約款を掲載すること、および投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
4. 目論見書は、電子媒体等として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。

- 5．有価証券届出書の表紙記載情報を抜粋して、目論見書に記載することがあります。
- 6．目論見書の冒頭または巻末に届出書記載内容に関連する用語集を掲載することがあります。
- 7．評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
- 8．有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。このため、有価証券届出書に他のファンドの情報を合わせて記載することがあります。
- 9．当ファンドとスイッチング対象ファンドにかかる投資信託説明書（交付目論見書）を一体のものとして使用することがあります。



## 独立監査人の監査報告書

平成30年6月14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29年4月1日から平成30年3月31日までの第33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30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、平成30年5月11日付で会社及び大和住銀投信投資顧問株式会社の主要株主が、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する基本合意書を締結した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

### 利害関係

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

以上

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

**独立監査人の監査報告書**

平成30年1月16日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤 陽一 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCバランスファンド(安定型)の平成28年12月16日から平成29年12月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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・DCバランスファンド(安定型)の平成29年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

**独立監査人の監査報告書**

平成30年1月16日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤 陽一 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）の平成28年12月16日から平成29年12月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

**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・DCバランスファンド（安定成長型）の平成29年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

**独立監査人の監査報告書**

平成30年1月16日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤 陽一 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCバランスファンド（成長型）の平成28年12月16日から平成29年12月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

**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・DCバランスファンド（成長型）の平成29年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

**独立監査人の中間監査報告書**

平成30年7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 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCバランスファンド（安定型）の平成29年12月16日から平成30年6月15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バランスファンド（安定型）の平成30年6月15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29年12月16日から平成30年6月15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。

**独立監査人の中間監査報告書**

平成30年7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 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCバランスファンド（安定成長型）の平成29年12月16日から平成30年6月15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バランスファンド（安定成長型）の平成30年6月15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29年12月16日から平成30年6月15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。

**独立監査人の中間監査報告書**

平成30年7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 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCバランスファンド（成長型）の平成29年12月16日から平成30年6月15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バランスファンド（成長型）の平成30年6月15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29年12月16日から平成30年6月15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。