

## 【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成23年11月18日

【発行者名】 三井住友アセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 前田 良治

【本店の所在の場所】 東京都港区愛宕二丁目5番1号

【事務連絡者氏名】 隠地 保夫

【電話番号】 03-5405-0735

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）  
券に係るファンドの名称】 三井住友・DC年金バランス50（標準型）  
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）  
券の金額】 : 5,000億円を上限とします。  
三井住友・DC年金バランス50（標準型）  
: 5,000億円を上限とします。  
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）  
: 5,000億円を上限とします。  
合計 1兆5,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

**・【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

平成23年5月12日付をもって提出しました「三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）」、「三井住友・DC年金バランス50（標準型）」、「三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）」の有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について、平成23年11月18日に半期報告書を提出したことに伴う関係情報の更新、その他訂正すべき事項がありますので、本訂正届出書により訂正を行うものです。

**・【訂正の内容】**

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

**第一部【証券情報】****（12）【その他】****<訂正前>**

（略）

ハ クーリングオフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用

（略）

**<訂正後>**

（略）

ハ クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用

（略）

**第二部【ファンド情報】****第1【ファンドの状況】****1【ファンドの性格】****（3）【ファンドの仕組み】**

## &lt;訂正前&gt;

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(略)

(ロ) 受託会社「住友信託銀行株式会社」

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

(略)

ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円(平成23年3月31日現在)

(略)

## (八) 大株主の状況

(平成23年3月31日現在)

| 名称             | 住所                  | 所有<br>株式数 | 比率<br>(%) |
|----------------|---------------------|-----------|-----------|
| 住友生命保険相互会社     | 大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号 | 7,056     | 40.0      |
| 三井住友海上火災保険株式会社 | 東京都中央区新川二丁目27番2号    | 4,851     | 27.5      |
| 株式会社三井住友銀行     | 東京都千代田区丸の内一丁目1番2号   | 4,851     | 27.5      |
| 三井生命保険株式会社     | 東京都千代田区大手町二丁目1番1号   | 882       | 5.0       |

## &lt;訂正後&gt;

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(略)

(ロ) 受託会社「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。

ただし、関係当局の認可等を前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および中央三井アセット信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号を変更する予定です。

(略)

ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円(平成23年9月30日現在)

(略)

(ハ) 大株主の状況

(平成23年9月30日現在)

| 名称             | 住所                  | 所有<br>株式数 | 比率<br>(%) |
|----------------|---------------------|-----------|-----------|
| 住友生命保険相互会社     | 大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号 | 7,056     | 40.0      |
| 三井住友海上火災保険株式会社 | 東京都中央区新川二丁目27番2号    | 4,851     | 27.5      |
| 株式会社三井住友銀行     | 東京都千代田区丸の内一丁目1番2号   | 4,851     | 27.5      |
| 三井生命保険株式会社     | 東京都千代田区大手町二丁目1番1号   | 882       | 5.0       |

## 2【投資方針】

### (3)【運用体制】

#### <訂正前>

イ 運用体制

( 略 )

リスク管理部は10名程度、運用企画部は8名程度で構成されています。

( 略 )

#### <訂正後>

イ 運用体制

( 略 )

リスク管理部は7名程度、運用企画部は10名程度で構成されています。

( 略 )

#### （４）【分配方針】

##### <訂正前>

（略）

- 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により収益分配を行わない場合があります。

（略）

##### <訂正後>

（略）

- 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には委託会社の判断により収益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。

（略）

### 3【投資リスク】

##### <訂正前>

#### イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、主に内外の株式や債券を投資対象としています（マザーファンドを通じて間接的に投資する場合を含みます。）。当ファンドの基準価額は、組み入れた株式や債券の値動き、為替相場の変動等の影響により上下しますので、これにより投資元本を割り込むことがあります。また、組み入れた株式や債券の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により、投資元本を割り込むことがあります。

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

（略）

（ト）インデックスに連動しない要因・留意点

（略）

（チ）ファミリーファンド方式にかかる留意点

（略）

## ロ 投資リスクの管理体制

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

## <訂正後>

### 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、預金や保険契約と異なり、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。

（略）

### （ト）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。

受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないしすべてが、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。

### （チ）インデックスに連動しない要因・留意点

（略）

### （リ）ファミリーファンド方式にかかる留意点

（略）

## 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。

## 4【手数料等及び税金】

### (5)【課税上の取扱い】

#### <訂正前>

(略)

#### ニ 個人、法人別の課税の取扱いについて

##### (イ) 個人の受益者に対する課税

###### ・ 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、平成23年12月31日までは10%（所得税7%および地方税3%）、平成24年1月1日以降は20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

###### ・ 一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、平成23年12月31日までは10%（所得税7%および地方税3%）、平成24年1月1日以降は20%（所得税15%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

なお、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、上場株式等にかかる譲渡益との通算が可能です。

##### (ロ) 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、平成23年12月31日までは7%（所得税のみ）、平成24年1月1日以降は15%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

(略)

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成23年3月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

## &lt;訂正後&gt;

(略)

## 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、平成25年12月31日までは10%（所得税7%および地方税3%）、平成26年1月1日以降は20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

## . 一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、平成25年12月31日までは10%（所得税7%および地方税3%）、平成26年1月1日以降は20%（所得税15%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

なお、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、上場株式等にかかる譲渡益との通算が可能です。

## (ロ) 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、平成25年12月31日までは7%（所得税のみ）、平成26年1月1日以降は15%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

(略)

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成23年9月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

## 5【運用状況】

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

### (1)【投資状況】

#### a. 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

平成23年9月30日現在

| 資産の種類                      | 国/地域 | 時価合計<br>(円)   | 投資比率<br>(%) |
|----------------------------|------|---------------|-------------|
| 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)受益証券 | 日本   | 454,037,172   | 20.64       |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券       | 日本   | 1,204,614,036 | 54.76       |
| 外国株式インデックス・マザーファンド受益証券     | 日本   | 221,282,988   | 10.06       |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券       | 日本   | 218,719,337   | 9.94        |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後)        |      | 100,988,556   | 4.59        |
| 合計(純資産総額)                  |      | 2,199,642,089 | 100.00      |

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

#### b. 三井住友・DC年金バランス50（標準型）

平成23年9月30日現在

| 資産の種類                      | 国/地域 | 時価合計<br>(円)   | 投資比率<br>(%) |
|----------------------------|------|---------------|-------------|
| 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)受益証券 | 日本   | 2,206,038,209 | 35.48       |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券       | 日本   | 2,169,312,646 | 34.89       |
| 外国株式インデックス・マザーファンド受益証券     | 日本   | 911,937,470   | 14.67       |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券       | 日本   | 631,821,522   | 10.16       |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後)        |      | 297,991,768   | 4.79        |
| 合計(純資産総額)                  |      | 6,217,101,615 | 100.00      |

#### c. 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

平成23年9月30日現在

| 資産の種類                      | 国/地域 | 時価合計<br>(円)   | 投資比率<br>(%) |
|----------------------------|------|---------------|-------------|
| 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)受益証券 | 日本   | 1,437,410,753 | 50.34       |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券       | 日本   | 435,543,350   | 15.25       |

|                        |    |               |        |
|------------------------|----|---------------|--------|
| 外国株式インデックス・マザーファンド受益証券 | 日本 | 557,865,469   | 19.54  |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券   | 日本 | 288,779,296   | 10.11  |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後)    |    | 135,797,768   | 4.76   |
| 合計(純資産総額)              |    | 2,855,396,636 | 100.00 |

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ 主要投資銘柄

## a . 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

平成23年9月30日現在

| 国/<br>地域 | 種類            | 銘柄名                        | 数量（口）         | 帳簿価額<br>単価 / 金額<br>（円）  | 評価額<br>単価 / 金額<br>（円）   | 投資<br>比率<br>（%） |
|----------|---------------|----------------------------|---------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
| 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 国内債券パッシブ・<br>マザーファンド       | 1,087,884,075 | 1.0820<br>1,177,090,570 | 1.1073<br>1,204,614,036 | 54.76           |
| 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 国内株式インデックス・<br>マザーファンド（B号） | 444,306,852   | 1.2093<br>537,342,505   | 1.0219<br>454,037,172   | 20.64           |
| 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 外国株式インデックス・<br>マザーファンド     | 206,517,021   | 1.3248<br>273,605,815   | 1.0715<br>221,282,988   | 10.06           |
| 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 外国債券パッシブ・<br>マザーファンド       | 201,213,742   | 1.1130<br>223,957,072   | 1.0870<br>218,719,337   | 9.94            |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## b . 三井住友・DC年金バランス50（標準型）

平成23年9月30日現在

| 国/<br>地域 | 種類            | 銘柄名                        | 数量（口）         | 帳簿価額<br>単価 / 金額<br>（円）  | 評価額<br>単価 / 金額<br>（円）   | 投資<br>比率<br>（%） |
|----------|---------------|----------------------------|---------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
| 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 国内株式インデックス・<br>マザーファンド（B号） | 2,158,761,336 | 1.2280<br>2,651,061,296 | 1.0219<br>2,206,038,209 | 35.48           |
| 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 国内債券パッシブ・<br>マザーファンド       | 1,959,101,099 | 1.0816<br>2,118,963,749 | 1.1073<br>2,169,312,646 | 34.89           |
| 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 外国株式インデックス・<br>マザーファンド     | 851,084,900   | 1.3394<br>1,139,971,163 | 1.0715<br>911,937,470   | 14.67           |
| 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 外国債券パッシブ・<br>マザーファンド       | 581,252,551   | 1.1126<br>646,701,589   | 1.0870<br>631,821,522   | 10.16           |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## c . 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

平成23年9月30日現在

| 国/<br>地域 | 種類            | 銘柄名                        | 数量（口）         | 帳簿価額<br>単価／金額<br>（円）    | 評価額<br>単価／金額<br>（円）     | 投資<br>比率<br>（％） |
|----------|---------------|----------------------------|---------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
| 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 国内株式インデックス・<br>マザーファンド（B号） | 1,406,606,080 | 1.2379<br>1,741,307,745 | 1.0219<br>1,437,410,753 | 50.34           |
| 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 外国株式インデックス・<br>マザーファンド     | 520,639,729   | 1.3436<br>699,546,071   | 1.0715<br>557,865,469   | 19.54           |
| 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 国内債券パッシブ・<br>マザーファンド       | 393,338,165   | 1.0816<br>425,434,560   | 1.1073<br>435,543,350   | 15.25           |
| 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 外国債券パッシブ・<br>マザーファンド       | 265,666,326   | 1.1121<br>295,447,522   | 1.0870<br>288,779,296   | 10.11           |

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## □ 種類別の投資比率

## a．三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

平成23年9月30日現在

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 95.41   |
| 合計        | 95.41   |

## b．三井住友・DC年金バランス50（標準型）

平成23年9月30日現在

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 95.21   |
| 合計        | 95.21   |

## c．三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

平成23年9月30日現在

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 95.24   |
| 合計        | 95.24   |

## 【投資不動産物件】

各ファンドにつき、該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

各ファンドにつき、該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

## a．三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

| 年月日                  | 純資産総額<br>（円） | 1万口当たりの<br>純資産額（円） |
|----------------------|--------------|--------------------|
| 第1期（平成18年2月20日）（分配落） | 1,035,569    | 10,356             |
| 第1期（平成18年2月20日）（分配付） | 1,035,569    | 10,356             |

|                      |               |        |
|----------------------|---------------|--------|
| 第2期（平成19年2月19日）（分配落） | 284,591,517   | 10,992 |
| 第2期（平成19年2月19日）（分配付） | 284,591,517   | 10,992 |
| 第3期（平成20年2月18日）（分配落） | 709,939,713   | 10,504 |
| 第3期（平成20年2月18日）（分配付） | 709,939,713   | 10,504 |
| 第4期（平成21年2月18日）（分配落） | 925,997,054   | 8,783  |
| 第4期（平成21年2月18日）（分配付） | 925,997,054   | 8,783  |
| 第5期（平成22年2月18日）（分配落） | 1,428,892,994 | 9,699  |
| 第5期（平成22年2月18日）（分配付） | 1,428,892,994 | 9,699  |
| 第6期（平成23年2月18日）（分配落） | 1,960,814,211 | 10,043 |
| 第6期（平成23年2月18日）（分配付） | 1,960,814,211 | 10,043 |
| 第7期（中間期）（平成23年8月18日） | 2,160,321,801 | 9,555  |
| 平成22年9月末日            | 1,817,271,092 | 9,723  |
| 平成22年10月末日           | 1,807,771,344 | 9,629  |
| 平成22年11月末日           | 1,828,923,667 | 9,707  |
| 平成22年12月末日           | 1,942,671,128 | 9,821  |
| 平成23年1月末日            | 1,988,260,591 | 9,859  |
| 平成23年2月末日            | 1,948,210,495 | 9,969  |
| 平成23年3月末日            | 1,983,315,377 | 9,882  |
| 平成23年4月末日            | 1,995,607,295 | 9,906  |
| 平成23年5月末日            | 2,022,165,826 | 9,840  |
| 平成23年6月末日            | 2,205,451,833 | 9,855  |
| 平成23年7月末日            | 2,215,414,243 | 9,784  |
| 平成23年8月末日            | 2,182,799,198 | 9,563  |
| 平成23年9月末日            | 2,199,642,089 | 9,489  |

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

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

#### b. 三井住友・DC年金バランス50（標準型）

| 年月日 | 純資産総額<br>（円） | 1万口当たりの<br>純資産額（円） |
|-----|--------------|--------------------|
|-----|--------------|--------------------|

|                      |               |        |
|----------------------|---------------|--------|
| 第1期（平成18年2月20日）（分配落） | 1,057,373     | 10,574 |
| 第1期（平成18年2月20日）（分配付） | 1,057,373     | 10,574 |
| 第2期（平成19年2月19日）（分配落） | 1,249,567,567 | 11,564 |
| 第2期（平成19年2月19日）（分配付） | 1,249,567,567 | 11,564 |
| 第3期（平成20年2月18日）（分配落） | 2,650,595,109 | 10,467 |
| 第3期（平成20年2月18日）（分配付） | 2,650,595,109 | 10,467 |
| 第4期（平成21年2月18日）（分配落） | 2,892,759,889 | 7,758  |
| 第4期（平成21年2月18日）（分配付） | 2,892,759,889 | 7,758  |
| 第5期（平成22年2月18日）（分配落） | 4,608,495,307 | 8,983  |
| 第5期（平成22年2月18日）（分配付） | 4,608,495,307 | 8,983  |
| 第6期（平成23年2月18日）（分配落） | 6,082,088,735 | 9,470  |
| 第6期（平成23年2月18日）（分配付） | 6,082,088,735 | 9,470  |
| 第7期（中間期）（平成23年8月18日） | 6,136,965,657 | 8,597  |
| 平成22年9月末日            | 5,625,391,542 | 8,851  |
| 平成22年10月末日           | 5,593,651,006 | 8,743  |
| 平成22年11月末日           | 5,742,940,075 | 8,924  |
| 平成22年12月末日           | 5,986,828,950 | 9,092  |
| 平成23年1月末日            | 6,062,268,814 | 9,165  |
| 平成23年2月末日            | 5,993,987,036 | 9,344  |
| 平成23年3月末日            | 6,016,925,267 | 9,171  |
| 平成23年4月末日            | 6,027,820,194 | 9,171  |
| 平成23年5月末日            | 6,100,591,822 | 9,064  |
| 平成23年6月末日            | 6,438,787,909 | 9,082  |
| 平成23年7月末日            | 6,421,709,027 | 8,977  |
| 平成23年8月末日            | 6,207,058,356 | 8,614  |
| 平成23年9月末日            | 6,217,101,615 | 8,511  |

## c . 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

| 年月日                  | 純資産総額<br>（円）  | 1万口当たりの<br>純資産額（円） |
|----------------------|---------------|--------------------|
| 第1期（平成18年2月20日）（分配落） | 1,079,124     | 10,791             |
| 第1期（平成18年2月20日）（分配付） | 1,079,124     | 10,791             |
| 第2期（平成19年2月19日）（分配落） | 591,109,514   | 12,141             |
| 第2期（平成19年2月19日）（分配付） | 591,109,514   | 12,141             |
| 第3期（平成20年2月18日）（分配落） | 1,189,426,390 | 10,410             |
| 第3期（平成20年2月18日）（分配付） | 1,189,426,390 | 10,410             |
| 第4期（平成21年2月18日）（分配落） | 1,169,406,901 | 6,771              |
| 第4期（平成21年2月18日）（分配付） | 1,169,406,901 | 6,771              |
| 第5期（平成22年2月18日）（分配落） | 2,060,345,540 | 8,216              |
| 第5期（平成22年2月18日）（分配付） | 2,060,345,540 | 8,216              |
| 第6期（平成23年2月18日）（分配落） | 2,906,265,010 | 8,802              |
| 第6期（平成23年2月18日）（分配付） | 2,906,265,010 | 8,802              |
| 第7期（中間期）（平成23年8月18日） | 2,810,603,225 | 7,615              |
| 平成22年9月末日            | 2,551,612,540 | 7,946              |
| 平成22年10月末日           | 2,537,389,308 | 7,828              |
| 平成22年11月末日           | 2,636,730,837 | 8,088              |
| 平成22年12月末日           | 2,771,975,588 | 8,297              |
| 平成23年1月末日            | 2,829,280,157 | 8,399              |
| 平成23年2月末日            | 2,850,898,984 | 8,635              |
| 平成23年3月末日            | 2,850,554,272 | 8,386              |
| 平成23年4月末日            | 2,851,646,556 | 8,365              |
| 平成23年5月末日            | 2,849,241,049 | 8,225              |
| 平成23年6月末日            | 3,002,348,201 | 8,243              |
| 平成23年7月末日            | 2,989,736,950 | 8,114              |
| 平成23年8月末日            | 2,854,241,933 | 7,636              |
| 平成23年9月末日            | 2,855,396,636 | 7,513              |

## 【分配の推移】

## a . 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

| 計算期間                       | 1万口当たり分配金（円） |
|----------------------------|--------------|
| 第1期（平成17年9月30日～平成18年2月20日） | 0            |
| 第2期（平成18年2月21日～平成19年2月19日） | 0            |
| 第3期（平成19年2月20日～平成20年2月18日） | 0            |
| 第4期（平成20年2月19日～平成21年2月18日） | 0            |
| 第5期（平成21年2月19日～平成22年2月18日） | 0            |
| 第6期（平成22年2月19日～平成23年2月18日） | 0            |

**b．三井住友・DC年金バランス50（標準型）**

| 計算期間                       | 1万口当たり分配金（円） |
|----------------------------|--------------|
| 第1期（平成17年9月30日～平成18年2月20日） | 0            |
| 第2期（平成18年2月21日～平成19年2月19日） | 0            |
| 第3期（平成19年2月20日～平成20年2月18日） | 0            |
| 第4期（平成20年2月19日～平成21年2月18日） | 0            |
| 第5期（平成21年2月19日～平成22年2月18日） | 0            |
| 第6期（平成22年2月19日～平成23年2月18日） | 0            |

**c．三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）**

| 計算期間                       | 1万口当たり分配金（円） |
|----------------------------|--------------|
| 第1期（平成17年9月30日～平成18年2月20日） | 0            |
| 第2期（平成18年2月21日～平成19年2月19日） | 0            |
| 第3期（平成19年2月20日～平成20年2月18日） | 0            |
| 第4期（平成20年2月19日～平成21年2月18日） | 0            |
| 第5期（平成21年2月19日～平成22年2月18日） | 0            |
| 第6期（平成22年2月19日～平成23年2月18日） | 0            |

**【収益率の推移】**

**a．三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）**

| 計算期間 | 収益率（％） |
|------|--------|
| 第1期  | 3.6    |
| 第2期  | 6.1    |
| 第3期  | 4.4    |

|          |      |
|----------|------|
| 第4期      | 16.4 |
| 第5期      | 10.4 |
| 第6期      | 3.5  |
| 第7期(中間期) | 4.9  |

(注1) 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。以下同じ。

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

#### b. 三井住友・DC年金バランス50(標準型)

| 計算期間     | 収益率(%) |
|----------|--------|
| 第1期      | 5.7    |
| 第2期      | 9.4    |
| 第3期      | 9.5    |
| 第4期      | 25.9   |
| 第5期      | 15.8   |
| 第6期      | 5.4    |
| 第7期(中間期) | 9.2    |

#### c. 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

| 計算期間     | 収益率(%) |
|----------|--------|
| 第1期      | 7.9    |
| 第2期      | 12.5   |
| 第3期      | 14.3   |
| 第4期      | 35.0   |
| 第5期      | 21.3   |
| 第6期      | 7.1    |
| 第7期(中間期) | 13.5   |

## (4) 【設定及び解約の実績】

## a. 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

| 計算期間     | 設定口数（口）     | 解約口数（口）     |
|----------|-------------|-------------|
| 第1期      | 1,000,000   | 0           |
| 第2期      | 261,744,830 | 3,829,999   |
| 第3期      | 470,245,880 | 53,277,789  |
| 第4期      | 469,037,816 | 90,606,169  |
| 第5期      | 495,358,440 | 76,369,973  |
| 第6期      | 638,803,489 | 159,741,067 |
| 第7期（中間期） | 356,029,964 | 47,411,576  |

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。以下同じ。

## b. 三井住友・DC年金バランス50（標準型）

| 計算期間     | 設定口数（口）       | 解約口数（口）     |
|----------|---------------|-------------|
| 第1期      | 1,000,000     | 0           |
| 第2期      | 1,089,719,269 | 10,113,718  |
| 第3期      | 1,551,597,287 | 99,933,573  |
| 第4期      | 1,456,057,755 | 259,818,063 |
| 第5期      | 1,554,846,560 | 153,223,574 |
| 第6期      | 1,758,746,053 | 466,119,658 |
| 第7期（中間期） | 919,977,548   | 204,100,534 |

## c. 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

| 計算期間     | 設定口数（口）       | 解約口数（口）     |
|----------|---------------|-------------|
| 第1期      | 1,000,000     | 0           |
| 第2期      | 501,029,827   | 15,165,803  |
| 第3期      | 723,490,810   | 67,743,433  |
| 第4期      | 726,637,191   | 142,246,748 |
| 第5期      | 884,174,334   | 103,452,149 |
| 第6期      | 1,002,632,701 | 208,523,447 |
| 第7期（中間期） | 461,678,066   | 72,654,302  |

## 〔参考情報：マザーファンドの投資状況・投資資産〕

## 〔国内株式インデックス・マザーファンド（B号）〕

## （１）投資状況

平成23年9月30日現在

| 資産の種類               | 国 / 地域 | 時価合計<br>(円)     | 投資比率<br>(%) |
|---------------------|--------|-----------------|-------------|
| 株式                  | 日本     | 281,771,600,420 | 97.03       |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |        | 8,638,130,402   | 2.97        |
| 合計(純資産総額)           |        | 290,409,730,822 | 100.00      |

当ファンドは、平成23年9月30日現在、株価指数先物取引を買建てしており、その評価額は8,476,425,000円（投資比率2.92%）です。

## （２）投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成23年9月30日現在

| 国 / 地域 | 種類 | 銘柄名 / 業種                   | 数量<br>(株)  | 帳簿価額<br>単価 / 金額<br>(円)     | 評価額<br>単価 / 金額<br>(円)     | 投資<br>比率<br>(%) |
|--------|----|----------------------------|------------|----------------------------|---------------------------|-----------------|
| 日本     | 株式 | トヨタ自動車<br>〔輸送用機器〕          | 3,526,500  | 3,200.46<br>11,286,432,710 | 2,688.00<br>9,479,232,000 | 3.26            |
| 日本     | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ<br>〔銀行業〕 | 20,512,900 | 391.57<br>8,032,352,322    | 354.00<br>7,261,566,600   | 2.50            |
| 日本     | 株式 | キヤノン<br>〔電気機器〕             | 1,705,100  | 3,895.18<br>6,641,685,824  | 3,550.00<br>6,053,105,000 | 2.08            |
| 日本     | 株式 | 本田技研工業<br>〔輸送用機器〕          | 2,316,000  | 2,984.24<br>6,911,517,195  | 2,299.00<br>5,324,484,000 | 1.83            |
| 日本     | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ<br>〔銀行業〕   | 2,066,400  | 2,546.34<br>5,261,767,669  | 2,206.00<br>4,558,478,400 | 1.57            |

|    |    |                          |            |                             |                             |      |
|----|----|--------------------------|------------|-----------------------------|-----------------------------|------|
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ<br>〔銀行業〕  | 36,384,200 | 132.47<br>4,819,814,974     | 114.00<br>4,147,798,800     | 1.43 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業<br>〔医薬品〕          | 1,077,200  | 3,873.40<br>4,172,436,203   | 3,680.00<br>3,964,096,000   | 1.37 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話<br>〔情報・通信業〕       | 1,017,000  | 3,769.14<br>3,833,220,742   | 3,730.00<br>3,793,410,000   | 1.31 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事<br>〔卸売業〕            | 2,113,500  | 2,100.83<br>4,440,113,829   | 1,592.00<br>3,364,692,000   | 1.16 |
| 日本 | 株式 | エヌ・ティ・ティ・ドコモ<br>〔情報・通信業〕 | 22,294     | 136,803.31<br>3,049,893,000 | 141,700.00<br>3,159,059,800 | 1.09 |
| 日本 | 株式 | ファナック<br>〔電気機器〕          | 285,800    | 12,005.36<br>3,431,132,716  | 10,830.00<br>3,095,214,000  | 1.07 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンク<br>〔情報・通信業〕       | 1,227,600  | 2,894.98<br>3,553,879,004   | 2,292.00<br>2,813,659,200   | 0.97 |
| 日本 | 株式 | 三井物産<br>〔卸売業〕            | 2,339,000  | 1,312.41<br>3,069,735,936   | 1,134.00<br>2,652,426,000   | 0.91 |
| 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス<br>〔小売業〕 | 1,134,000  | 2,042.84<br>2,316,587,029   | 2,189.00<br>2,482,326,000   | 0.85 |
| 日本 | 株式 | パナソニック<br>〔電気機器〕         | 3,195,300  | 1,159.44<br>3,704,780,001   | 754.00<br>2,409,256,200     | 0.83 |
| 日本 | 株式 | 三菱地所<br>〔不動産業〕           | 1,898,000  | 1,405.41<br>2,667,480,640   | 1,268.00<br>2,406,664,000   | 0.83 |
| 日本 | 株式 | 日産自動車<br>〔輸送用機器〕         | 3,466,200  | 775.19<br>2,686,985,292     | 693.00<br>2,402,076,600     | 0.83 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所<br>〔電気機器〕          | 6,166,000  | 398.44<br>2,456,826,080     | 389.00<br>2,398,574,000     | 0.83 |
| 日本 | 株式 | 日本たばこ産業<br>〔食料品〕         | 6,399      | 290,037.91<br>1,855,952,606 | 363,500.00<br>2,326,036,500 | 0.80 |
| 日本 | 株式 | ソニー<br>〔電気機器〕            | 1,541,900  | 2,859.77<br>4,409,479,958   | 1,507.00<br>2,323,643,300   | 0.80 |
| 日本 | 株式 | 小松製作所<br>〔機械〕            | 1,362,200  | 2,326.73<br>3,169,483,766   | 1,699.00<br>2,314,377,800   | 0.80 |

|    |    |                       |           |                             |                             |      |
|----|----|-----------------------|-----------|-----------------------------|-----------------------------|------|
| 日本 | 株式 | KDDI<br>〔情報・通信業〕      | 4,206     | 486,510.23<br>2,046,262,043 | 536,000.00<br>2,254,416,000 | 0.78 |
| 日本 | 株式 | 東日本旅客鉄道<br>〔陸運業〕      | 477,900   | 4,943.39<br>2,362,448,720   | 4,710.00<br>2,250,909,000   | 0.78 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス<br>〔保険業〕 | 1,027,900 | 2,338.42<br>2,403,670,668   | 1,984.00<br>2,039,353,600   | 0.70 |
| 日本 | 株式 | 三菱電機<br>〔電気機器〕        | 2,744,000 | 831.37<br>2,281,295,900     | 695.00<br>1,907,080,000     | 0.66 |
| 日本 | 株式 | アステラス製薬<br>〔医薬品〕      | 638,400   | 2,994.48<br>1,911,681,230   | 2,941.00<br>1,877,534,400   | 0.65 |
| 日本 | 株式 | 信越化学工業<br>〔化学〕        | 479,000   | 4,064.20<br>1,946,753,080   | 3,830.00<br>1,834,570,000   | 0.63 |
| 日本 | 株式 | 任天堂<br>〔その他製品〕        | 156,800   | 22,106.55<br>3,466,307,876  | 11,360.00<br>1,781,248,000  | 0.61 |
| 日本 | 株式 | 東芝<br>〔電気機器〕          | 5,421,000 | 426.07<br>2,309,733,550     | 320.00<br>1,734,720,000     | 0.60 |
| 日本 | 株式 | 新日本製鐵<br>〔鉄鋼〕         | 7,541,000 | 272.21<br>2,052,804,600     | 224.00<br>1,689,184,000     | 0.58 |

## □ 種類別・業種別の投資比率

平成23年 9月30日現在

| 種類     | 業種       | 投資<br>比率<br>(%) | 種類     | 業種         | 投資<br>比率<br>(%) |
|--------|----------|-----------------|--------|------------|-----------------|
| 株式（国内） | 水産・農林業   | 0.11            | 株式（国内） | 精密機器       | 1.54            |
|        | 鉱業       | 0.60            |        | その他製品      | 1.62            |
|        | 建設業      | 2.40            |        | 電気・ガス業     | 3.27            |
|        | 食料品      | 3.52            |        | 陸運業        | 4.01            |
|        | 繊維製品     | 0.95            |        | 海運業        | 0.39            |
|        | パルプ・紙    | 0.44            |        | 空運業        | 0.31            |
|        | 化学       | 5.92            |        | 倉庫・運輸関連業   | 0.23            |
|        | 医薬品      | 5.10            |        | 情報・通信業     | 6.08            |
|        | 石油・石炭製品  | 0.83            |        | 卸売業        | 5.10            |
|        | ゴム製品     | 0.76            |        | 小売業        | 4.17            |
|        | ガラス・土石製品 | 1.23            |        | 銀行業        | 9.38            |
|        | 鉄鋼       | 2.00            |        | 証券、商品先物取引業 | 1.05            |
|        | 非鉄金属     | 1.16            |        | 保険業        | 2.28            |
|        | 金属製品     | 0.77            |        | その他金融業     | 0.76            |
|        | 機械       | 4.69            |        | 不動産業       | 2.27            |
|        | 電気機器     | 12.91           |        | サービス業      | 1.94            |
|        | 輸送用機器    | 9.25            |        | 合計         | 97.03           |

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

平成23年 9月30日現在

| 種類           | 取引所等および<br>資産の名称   | 買建 / 売建 | 数量<br>(枚) | 簿価(円)         | 時価(円)         | 投資<br>比率<br>(%) |
|--------------|--------------------|---------|-----------|---------------|---------------|-----------------|
| 株価指数<br>先物取引 | 東京証券取引所<br>TOPIX先物 | 買建      | 1,119     | 8,383,816,950 | 8,476,425,000 | 2.92            |

## (注) 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

- ・原則として基準日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- ・このような時価が発表されていない場合には、基準日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

## 〔国内債券バッシブ・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成23年9月30日現在

| 資産の種類               | 国/地域    | 時価合計<br>(円)     | 投資比率<br>(%) |
|---------------------|---------|-----------------|-------------|
| 国債証券                | 日本      | 358,677,341,830 | 74.41       |
| 地方債証券               | 日本      | 32,633,057,135  | 6.77        |
| 特殊債券                | 日本      | 51,801,828,756  | 10.75       |
|                     | 韓国      | 201,250,000     | 0.04        |
|                     | 小計      | 52,003,078,756  | 10.79       |
| 社債券                 | 日本      | 32,698,334,600  | 6.78        |
|                     | アメリカ    | 2,184,087,000   | 0.45        |
|                     | オーストラリア | 596,826,000     | 0.12        |
|                     | イギリス    | 694,503,000     | 0.14        |
|                     | オランダ    | 299,142,000     | 0.06        |
|                     | 韓国      | 202,912,000     | 0.04        |
|                     | 小計      | 36,675,804,600  | 7.61        |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |         | 2,059,489,256   | 0.43        |
| 合計(純資産総額)           |         | 482,048,771,577 | 100.00      |

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成23年9月30日現在

| 国/地域 | 種類   | 銘柄名            | 額面金額<br>(円)    | 帳簿価額<br>単価/金額<br>(円)     | 評価額<br>単価/金額<br>(円)      | 利率(%) /<br>償還期限   | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|------|----------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------------------|-----------------|
| 日本   | 国債証券 | 第247回利付国債(10年) | 12,375,000,000 | 101.11<br>12,512,362,500 | 100.98<br>12,497,141,250 | 0.8<br>2013/3/20  | 2.59            |
| 日本   | 国債証券 | 第274回利付国債(10年) | 10,605,000,000 | 105.03<br>11,138,634,100 | 104.92<br>11,126,872,050 | 1.5<br>2015/12/20 | 2.31            |

|    |      |                |                |                          |                          |                   |      |
|----|------|----------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第263回利付国債（10年） | 10,672,000,000 | 104.38<br>11,139,703,800 | 104.13<br>11,113,073,760 | 1.6<br>2014/9/20  | 2.31 |
| 日本 | 国債証券 | 第260回利付国債（10年） | 10,685,000,000 | 104.13<br>11,127,266,000 | 103.83<br>11,095,197,150 | 1.6<br>2014/6/20  | 2.30 |
| 日本 | 国債証券 | 第272回利付国債（10年） | 10,565,000,000 | 104.43<br>11,033,029,500 | 104.34<br>11,023,943,600 | 1.4<br>2015/9/20  | 2.29 |
| 日本 | 国債証券 | 第277回利付国債（10年） | 10,375,000,000 | 105.65<br>10,961,544,750 | 105.57<br>10,953,406,250 | 1.6<br>2016/3/20  | 2.27 |
| 日本 | 国債証券 | 第270回利付国債（10年） | 10,537,000,000 | 103.90<br>10,948,763,000 | 103.78<br>10,935,298,600 | 1.3<br>2015/6/20  | 2.27 |
| 日本 | 国債証券 | 第258回利付国債（10年） | 10,593,000,000 | 103.01<br>10,911,884,700 | 102.78<br>10,888,226,910 | 1.3<br>2014/3/20  | 2.26 |
| 日本 | 国債証券 | 第265回利付国債（10年） | 10,140,000,000 | 104.29<br>10,575,006,000 | 104.07<br>10,553,407,800 | 1.5<br>2014/12/20 | 2.19 |
| 日本 | 国債証券 | 第253回利付国債（10年） | 9,990,000,000  | 103.24<br>10,314,039,000 | 102.87<br>10,276,912,800 | 1.6<br>2013/9/20  | 2.13 |
| 日本 | 国債証券 | 第268回利付国債（10年） | 9,795,000,000  | 104.49<br>10,234,795,500 | 104.31<br>10,217,850,150 | 1.5<br>2015/3/20  | 2.12 |
| 日本 | 国債証券 | 第250回利付国債（10年） | 9,815,000,000  | 100.66<br>9,880,385,900  | 100.63<br>9,877,619,700  | 0.5<br>2013/6/20  | 2.05 |
| 日本 | 国債証券 | 第280回利付国債（10年） | 8,267,000,000  | 107.33<br>8,873,109,600  | 107.20<br>8,862,389,340  | 1.9<br>2016/6/20  | 1.84 |
| 日本 | 国債証券 | 第256回利付国債（10年） | 8,110,000,000  | 103.05<br>8,357,760,500  | 102.76<br>8,333,998,200  | 1.4<br>2013/12/20 | 1.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第313回利付国債（10年） | 6,660,000,000  | 101.54<br>6,763,141,000  | 103.03<br>6,862,197,600  | 1.3<br>2021/3/20  | 1.42 |
| 日本 | 国債証券 | 第310回利付国債（10年） | 6,600,000,000  | 99.57<br>6,571,950,000   | 100.87<br>6,657,420,000  | 1<br>2020/9/20    | 1.38 |
| 日本 | 国債証券 | 第312回利付国債（10年） | 6,370,000,000  | 100.96<br>6,431,152,000  | 102.33<br>6,518,612,100  | 1.2<br>2020/12/20 | 1.35 |
| 日本 | 国債証券 | 第315回利付国債（10年） | 6,330,000,000  | 101.21<br>6,406,932,400  | 101.81<br>6,444,826,200  | 1.2<br>2021/6/20  | 1.34 |

|    |      |                |               |                         |                         |                   |      |
|----|------|----------------|---------------|-------------------------|-------------------------|-------------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第305回利付国債（10年） | 5,970,000,000 | 102.97<br>6,147,309,000 | 104.13<br>6,216,620,700 | 1.3<br>2019/12/20 | 1.29 |
| 日本 | 国債証券 | 第306回利付国債（10年） | 5,850,000,000 | 103.57<br>6,059,351,000 | 104.71<br>6,125,535,000 | 1.4<br>2020/3/20  | 1.27 |
| 日本 | 国債証券 | 第308回利付国債（10年） | 5,070,000,000 | 102.49<br>5,196,293,700 | 103.69<br>5,257,083,000 | 1.3<br>2020/6/20  | 1.09 |
| 日本 | 国債証券 | 第282回利付国債（10年） | 4,600,000,000 | 106.50<br>4,899,134,000 | 106.50<br>4,899,092,000 | 1.7<br>2016/9/20  | 1.02 |
| 日本 | 国債証券 | 第303回利付国債（10年） | 4,655,000,000 | 104.02<br>4,842,131,000 | 105.11<br>4,893,242,900 | 1.4<br>2019/9/20  | 1.02 |
| 日本 | 国債証券 | 第286回利付国債（10年） | 4,110,000,000 | 107.44<br>4,416,034,700 | 107.57<br>4,421,168,100 | 1.8<br>2017/6/20  | 0.92 |
| 日本 | 国債証券 | 第285回利付国債（10年） | 3,988,000,000 | 106.73<br>4,256,698,400 | 106.88<br>4,262,454,160 | 1.7<br>2017/3/20  | 0.88 |
| 日本 | 国債証券 | 第289回利付国債（10年） | 3,994,000,000 | 105.61<br>4,218,063,400 | 106.05<br>4,235,756,820 | 1.5<br>2017/12/20 | 0.88 |
| 日本 | 国債証券 | 第284回利付国債（10年） | 3,967,000,000 | 106.60<br>4,228,822,000 | 106.68<br>4,232,233,620 | 1.7<br>2016/12/20 | 0.88 |
| 日本 | 国債証券 | 第290回利付国債（10年） | 3,997,000,000 | 104.88<br>4,192,088,600 | 105.46<br>4,215,316,140 | 1.4<br>2018/3/20  | 0.87 |
| 日本 | 国債証券 | 第296回利付国債（10年） | 3,913,000,000 | 105.37<br>4,123,128,100 | 106.15<br>4,153,766,890 | 1.5<br>2018/9/20  | 0.86 |
| 日本 | 国債証券 | 第301回利付国債（10年） | 3,765,000,000 | 104.98<br>3,952,497,000 | 106.04<br>3,992,518,950 | 1.5<br>2019/6/20  | 0.83 |

□ 種類別の投資比率

平成23年9月30日現在

| 種類    | 投資比率（％） |
|-------|---------|
| 国債証券  | 74.41   |
| 地方債証券 | 6.77    |
| 特殊債券  | 10.79   |
| 社債券   | 7.61    |
| 合計    | 99.57   |

**投資不動産物件**

該当事項はありません。

**その他投資資産の主要なもの**

該当事項はありません。

## 〔外国株式インデックス・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成23年9月30日現在

| 資産の種類 | 国/地域       | 時価合計<br>(円)     | 投資比率<br>(%) |
|-------|------------|-----------------|-------------|
| 株式    | アメリカ       | 109,158,343,244 | 52.92       |
|       | カナダ        | 11,665,176,307  | 5.66        |
|       | ドイツ        | 7,721,467,004   | 3.74        |
|       | イタリア       | 2,249,960,709   | 1.09        |
|       | フランス       | 8,470,801,179   | 4.11        |
|       | オーストラリア    | 7,517,806,519   | 3.64        |
|       | イギリス       | 20,711,851,889  | 10.04       |
|       | スイス        | 9,167,764,749   | 4.44        |
|       | バミューダ      | 580,538,643     | 0.28        |
|       | 香港         | 2,260,625,115   | 1.10        |
|       | シンガポール     | 1,551,891,394   | 0.75        |
|       | ニュージーランド   | 124,982,359     | 0.06        |
|       | オランダ       | 2,559,053,129   | 1.24        |
|       | スペイン       | 3,431,757,212   | 1.66        |
|       | ベルギー       | 944,393,293     | 0.46        |
|       | スウェーデン     | 2,776,552,347   | 1.35        |
|       | ノルウェー      | 808,913,889     | 0.39        |
|       | オーストリア     | 257,980,718     | 0.13        |
|       | ルクセンブルク    | 426,925,421     | 0.21        |
|       | フィンランド     | 893,025,595     | 0.43        |
|       | デンマーク      | 988,500,255     | 0.48        |
|       | アイルランド     | 1,251,476,753   | 0.61        |
|       | ギリシャ       | 131,375,490     | 0.06        |
|       | キプロス       | 13,820,602      | 0.01        |
|       | イスラエル      | 626,591,237     | 0.30        |
|       | ポルトガル      | 237,963,962     | 0.12        |
|       | ケイマン諸島     | 170,287,694     | 0.08        |
|       | モーリシャス     | 34,035,840      | 0.02        |
|       | リベリア       | 35,147,888      | 0.02        |
|       | ジャージー      | 707,560,517     | 0.34        |
| ガーンジー | 61,216,225 | 0.03            |             |

|      |                     |                 |                 |        |
|------|---------------------|-----------------|-----------------|--------|
|      | アンティル               | 868,664,029     | 0.42            |        |
|      | マン島                 | 77,809,712      | 0.04            |        |
|      | 小計                  | 198,484,260,919 | 96.22           |        |
| 投資証券 | アメリカ                | 2,271,001,339   | 1.10            |        |
|      | カナダ                 | 33,193,741      | 0.02            |        |
|      | フランス                | 268,878,846     | 0.13            |        |
|      | オーストラリア             | 668,158,542     | 0.32            |        |
|      | イギリス                | 254,306,455     | 0.12            |        |
|      | 香港                  | 78,737,562      | 0.04            |        |
|      | シンガポール              | 95,163,295      | 0.05            |        |
|      | オランダ                | 29,783,984      | 0.01            |        |
|      | 小計                  | 3,699,223,764   | 1.79            |        |
|      | 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |                 | 4,093,338,381   | 1.98   |
|      | 合計(純資産総額)           |                 | 206,276,823,064 | 100.00 |

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成23年9月30日現在

| 国/<br>地域 | 種類 | 銘柄名 / 業種                                      | 数量<br>(株) | 帳簿価額<br>単価 / 金額<br>(円)     | 評価額<br>単価 / 金額<br>(円)      | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|----|---|-----------|----------------------------|----------------------------|-----------------|
| アメリカ     | 株式 | EXXON MOBIL CORPORATION<br>〔エネルギー〕            | 670,611   | 5,372.71<br>3,602,998,456  | 5,662.90<br>3,797,604,373  | 1.84            |
| アメリカ     | 株式 | APPLE INC<br>〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕             | 125,863   | 24,853.98<br>3,128,197,701 | 29,937.19<br>3,767,984,607 | 1.83            |
| アメリカ     | 株式 | INTL BUSINESS MACHINES CORP<br>〔ソフトウェア・サービス〕  | 164,899   | 11,199.61<br>1,846,804,643 | 13,733.38<br>2,264,620,711 | 1.10            |
| スイス      | 株式 | NESTLE SA-REGISTERED<br>〔食品・飲料・タバコ〕           | 471,753   | 4,695.21<br>2,214,980,723  | 4,286.07<br>2,021,969,211  | 0.98            |
| アメリカ     | 株式 | MICROSOFT CORP<br>〔ソフトウェア・サービス〕               | 1,032,637 | 1,940.33<br>2,003,661,144  | 1,950.74<br>2,014,408,882  | 0.98            |
| アメリカ     | 株式 | CHEVRON CORPORATION<br>〔エネルギー〕                | 273,578   | 6,423.54<br>1,757,340,714  | 7,234.99<br>1,979,335,051  | 0.96            |
| アメリカ     | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO<br>〔家庭用品・パーソナル用品〕         | 380,035   | 4,764.08<br>1,810,518,725  | 4,882.60<br>1,855,560,791  | 0.90            |
| アメリカ     | 株式 | JOHNSON & JOHNSON<br>〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕 | 373,209   | 4,767.63<br>1,779,323,726  | 4,897.93<br>1,827,953,423  | 0.89            |
| アメリカ     | 株式 | AT&T INC<br>〔電気通信サービス〕                        | 806,424   | 2,136.22<br>1,722,704,054  | 2,210.58<br>1,782,669,604  | 0.86            |
| アメリカ     | 株式 | GENERAL ELECTRIC CO<br>〔資本財〕                  | 1,443,512 | 1,229.21<br>1,774,386,124  | 1,215.66<br>1,754,832,789  | 0.85            |
| イギリス     | 株式 | HSBC HOLDINGS PLC<br>〔銀行〕                     | 2,425,923 | 763.61<br>1,852,466,452    | 614.18<br>1,489,954,746    | 0.72            |
| アメリカ     | 株式 | COCA-COLA CO/THE<br>〔食品・飲料・タバコ〕               | 280,529   | 4,899.33<br>1,374,406,038  | 5,292.68<br>1,484,750,929  | 0.72            |
| アメリカ     | 株式 | PFIZER INC<br>〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕        | 1,075,798 | 1,287.84<br>1,385,457,339  | 1,378.16<br>1,482,629,302  | 0.72            |

|         |    |  |           |                            |                            |      |
|---------|----|--|-----------|----------------------------|----------------------------|------|
| イギリス    | 株式 | VODAFONE GROUP PLC<br>〔電気通信サービス〕                         | 6,983,697 | 190.55<br>1,330,754,862    | 200.19<br>1,398,105,096    | 0.68 |
| アメリカ    | 株式 | GOOGLE INC-CL A<br>〔ソフトウェア・サービス〕                         | 34,447    | 44,140.27<br>1,520,499,923 | 40,432.87<br>1,392,791,245 | 0.68 |
| スイス     | 株式 | NOVARTIS AG-REG SHS<br>〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕          | 317,771   | 4,538.79<br>1,442,298,594  | 4,337.30<br>1,378,269,429  | 0.67 |
| アメリカ    | 株式 | WELLS FARGO & COMPANY<br>〔銀行〕                            | 684,174   | 2,069.17<br>1,415,672,797  | 1,915.48<br>1,310,524,008  | 0.64 |
| アメリカ    | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO<br>〔各種金融〕                            | 541,066   | 2,900.75<br>1,569,500,479  | 2,406.04<br>1,301,828,332  | 0.63 |
| アメリカ    | 株式 | ORACLE CORPORATION<br>〔ソフトウェア・サービス〕                      | 551,261   | 2,099.82<br>1,157,553,482  | 2,272.67<br>1,252,835,715  | 0.61 |
| アメリカ    | 株式 | INTEL CORP<br>〔半導体・半導体製造装置〕                              | 721,909   | 1,630.01<br>1,176,726,054  | 1,702.39<br>1,228,975,354  | 0.60 |
| イギリス    | 株式 | BP PLC<br>〔エネルギー〕  | 2,568,074 | 509.95<br>1,309,593,993    | 469.25<br>1,205,091,477    | 0.58 |
| スイス     | 株式 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN<br>〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕 | 95,668    | 11,793.46<br>1,128,257,663 | 12,499.63<br>1,195,814,794 | 0.58 |
| アメリカ    | 株式 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.<br>〔食品・飲料・タバコ〕          | 242,156   | 4,519.58<br>1,094,443,507  | 4,906.36<br>1,188,106,086  | 0.58 |
| イギリス    | 株式 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS<br>〔エネルギー〕                   | 489,460   | 2,347.57<br>1,149,045,291  | 2,406.77<br>1,178,021,633  | 0.57 |
| オーストラリア | 株式 | BHP BILLITON LTD<br>〔素材〕                                 | 437,683   | 3,214.05<br>1,406,735,483  | 2,633.95<br>1,152,838,114  | 0.56 |
| イギリス    | 株式 | GLAXOSMITHKLINE PLC<br>〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕          | 702,149   | 1,476.39<br>1,036,647,538  | 1,602.52<br>1,125,209,641  | 0.55 |
| アメリカ    | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS INC<br>〔電気通信サービス〕                 | 385,452   | 2,486.23<br>958,324,402    | 2,847.54<br>1,097,592,878  | 0.53 |
| アメリカ    | 株式 | MERCK & CO. INC.<br>〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕             | 420,313   | 2,636.87<br>1,108,311,135  | 2,503.38<br>1,052,206,940  | 0.51 |
| アメリカ    | 株式 | WAL-MART STORES INC<br>〔食品・生活必需品小売り〕                     | 260,080   | 4,110.69<br>1,069,110,510  | 3,980.43<br>1,035,231,404  | 0.50 |

|      |    |                            |         |                           |                           |      |
|------|----|----------------------------|---------|---------------------------|---------------------------|------|
| アメリカ | 株式 | PEPSICO INC<br>〔食品・飲料・タバコ〕 | 215,249 | 4,907.89<br>1,056,420,172 | 4,796.75<br>1,032,497,147 | 0.50 |
|------|----|----------------------------|---------|---------------------------|---------------------------|------|

□ 種類別・業種別の投資比率

平成23年 9月30日現在

| 種類     | 業種           | 投資<br>比率<br>(%) | 種類     | 業種                     | 投資<br>比率<br>(%) |
|--------|--------------|-----------------|--------|------------------------|-----------------|
| 株式（外国） | エネルギー        | 11.55           | 株式（外国） | ヘルスケア機器・サービス           | 2.79            |
|        | 素材           | 7.18            |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.79            |
|        | 資本財          | 7.02            |        | 銀行                     | 7.26            |
|        | 商業・専門サービス    | 0.87            |        | 各種金融                   | 4.46            |
|        | 運輸           | 1.66            |        | 保険                     | 3.89            |
|        | 自動車・自動車部品    | 1.27            |        | 不動産                    | 0.61            |
|        | 耐久消費財・アパレル   | 1.25            |        | ソフトウェア・サービス            | 5.86            |
|        | 消費者サービス      | 1.62            |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 4.58            |
|        | メディア         | 2.52            |        | 電気通信サービス               | 4.34            |
|        | 小売           | 2.77            |        | 公益事業                   | 4.18            |
|        | 食品・生活必需品小売り  | 2.39            |        | 半導体・半導体製造装置            | 1.51            |
|        | 食品・飲料・タバコ    | 6.99            |        | 投資証券                   | 1.79            |
|        | 家庭用品・パーソナル用品 | 1.85            |        | 合計                     | 98.02           |

投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

平成23年9月30日現在

| 種類     | 取引所等および<br>資産の名称                  | 買建/<br>売建 | 数量<br>(枚) | 簿価(円)         | 時価(円)         | 投資<br>比率<br>(%) |
|--------|-----------------------------------|-----------|-----------|---------------|---------------|-----------------|
| 海外金融先物 | シカゴ商業取引所<br>SP500 11/12           | 買建        | 117       | 2,658,667,988 | 2,592,439,054 | 1.26            |
| 海外金融先物 | ロンドン国際金融先物オプション取引所<br>FTSE 11/12  | 買建        | 78        | 494,289,712   | 482,377,268   | 0.23            |
| 海外金融先物 | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所<br>DJ EUR 11/12 | 買建        | 395       | 882,455,100   | 905,127,135   | 0.44            |

(注) 時価の算定方法

海外金融先物取引の時価については以下のように評価しております。

- ・原則として基準日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- ・このような時価が発表されていない場合には、基準日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

平成23年9月30日現在

| 種類     | 取引所等および<br>資産の名称    | 買建/<br>売建 | 数量<br>(枚)     | 簿価(円)         | 時価(円)         | 投資<br>比率<br>(%) |
|--------|---------------------|-----------|---------------|---------------|---------------|-----------------|
| 為替予約取引 | 市場外取引<br>米ドル        | 買建        | 18,627,400.16 | 1,424,558,368 | 1,427,603,948 | 0.69            |
| 為替予約取引 | 市場外取引<br>カナダドル      | 買建        | 1,907,275.04  | 142,437,207   | 141,062,061   | 0.07            |
| 為替予約取引 | 市場外取引<br>英ポンド       | 買建        | 2,229,492.31  | 266,359,675   | 267,003,999   | 0.13            |
| 為替予約取引 | 市場外取引<br>スイスフラン     | 買建        | 1,196,701.48  | 101,863,110   | 102,174,372   | 0.05            |
| 為替予約取引 | 市場外取引<br>シンガポールドル   | 買建        | 249,644.75    | 14,833,466    | 14,749,011    | 0.01            |
| 為替予約取引 | 市場外取引<br>スウェーデンクローナ | 買建        | 3,051,930.95  | 34,480,715    | 34,334,223    | 0.02            |

|        |                    |    |              |             |             |      |
|--------|--------------------|----|--------------|-------------|-------------|------|
| 為替予約取引 | 市場外取引<br>ノルウェークローネ | 買建 | 394,919.49   | 5,235,763   | 5,220,835   | 0.00 |
| 為替予約取引 | 市場外取引<br>デンマーククローネ | 買建 | 1,109,910.99 | 15,482,148  | 15,516,555  | 0.01 |
| 為替予約取引 | 市場外取引<br>ユーロ       | 買建 | 3,245,293.93 | 336,829,056 | 337,835,098 | 0.16 |

(注)

1. 基準日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。
  - (1) 基準日において為替予約の受渡日(以下「当該日」という)の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
  - (2) 基準日において当該日の対顧客先物売買相場が発表されていない場合は、以下の計算方法によっております。
 

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

基準日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 基準日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、基準日の対顧客直物売買相場の仲値で評価しております。

## 〔外国債券バッシブ・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成23年9月30日現在

| 資産の種類               | 国/地域          | 時価合計<br>(円)     | 投資比率<br>(%) |
|---------------------|---------------|-----------------|-------------|
| 国債証券                | アメリカ          | 95,553,916,210  | 39.40       |
|                     | カナダ           | 6,942,919,079   | 2.86        |
|                     | ドイツ           | 22,913,732,022  | 9.45        |
|                     | イタリア          | 21,545,331,050  | 8.88        |
|                     | フランス          | 23,896,342,194  | 9.85        |
|                     | オーストラリア       | 2,939,976,686   | 1.21        |
|                     | イギリス          | 19,283,778,675  | 7.95        |
|                     | スイス           | 1,188,693,658   | 0.49        |
|                     | シンガポール        | 958,890,782     | 0.40        |
|                     | マレーシア         | 1,166,687,310   | 0.48        |
|                     | オランダ          | 6,105,718,135   | 2.52        |
|                     | スペイン          | 10,096,331,533  | 4.16        |
|                     | ベルギー          | 6,558,648,163   | 2.70        |
|                     | スウェーデン        | 1,656,210,429   | 0.68        |
|                     | ノルウェー         | 719,293,932     | 0.30        |
|                     | オーストリア        | 4,013,036,026   | 1.65        |
|                     | フィンランド        | 1,611,216,245   | 0.66        |
|                     | デンマーク         | 2,194,263,200   | 0.90        |
|                     | メキシコ          | 1,972,734,400   | 0.81        |
|                     | アイルランド        | 1,783,170,049   | 0.74        |
| ポーランド               | 1,833,226,546 | 0.76            |             |
| ポルトガル               | 1,611,896,608 | 0.66            |             |
|                     | 小計            | 236,546,012,932 | 97.55       |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |               | 5,950,916,859   | 2.45        |
| 合計(純資産総額)           |               | 242,496,929,791 | 100.00      |

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成23年9月30日現在

| 国/<br>地域 | 種類   | 銘柄名                  | 数量         | 帳簿価額<br>単価 / 金額<br>(円)    | 評価額<br>単価 / 金額<br>(円)      | 利率(%) /<br>償還期限     | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|------|----------------------|------------|---------------------------|----------------------------|---------------------|-----------------|
| アメリカ     | 国債証券 | US T 2.625% 20/11/15 | 18,000,000 | 7,164.66<br>1,289,639,450 | 8,174.00<br>1,471,320,703  | 2.625<br>2020/11/15 | 0.61            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 3.625% 20/02/15 | 15,000,000 | 7,837.46<br>1,175,619,375 | 8,830.31<br>1,324,547,929  | 3.625<br>2020/2/15  | 0.55            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 3.5% 20/05/15   | 15,000,000 | 7,733.26<br>1,159,989,960 | 8,758.46<br>1,313,769,023  | 3.5<br>2020/5/15    | 0.54            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 2.625% 20/8/15  | 15,000,000 | 7,153.60<br>1,073,040,117 | 8,188.37<br>1,228,256,367  | 2.625<br>2020/8/15  | 0.51            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 3.625% 21/02/15 | 13,000,000 | 7,936.29<br>1,031,718,427 | 8,831.51<br>1,148,097,234  | 3.625<br>2021/2/15  | 0.47            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 4.75% 41/02/15  | 11,000,000 | 8,131.67<br>894,483,938   | 10,324.99<br>1,135,749,398 | 4.75<br>2041/2/15   | 0.47            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 4.375% 40/05/15 | 11,000,000 | 7,415.28<br>815,681,758   | 9,720.17<br>1,069,219,593  | 4.375<br>2040/5/15  | 0.44            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 4.25% 40/11/15  | 11,000,000 | 7,345.30<br>807,983,697   | 9,539.33<br>1,049,326,523  | 4.25<br>2040/11/15  | 0.43            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 3.125% 19/05/15 | 12,000,000 | 7,631.27<br>915,752,880   | 8,528.51<br>1,023,421,218  | 3.125<br>2019/5/15  | 0.42            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 4.625% 40/02/15 | 10,000,000 | 7,736.85<br>773,685,937   | 10,095.04<br>1,009,504,453 | 4.625<br>2040/2/15  | 0.42            |
| イギリス     | 国債証券 | UKT 2% 16/01/22      | 8,000,000  | 11,871.92<br>949,754,301  | 12,334.75<br>986,780,239   | 2<br>2016/1/22      | 0.41            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 3.875% 40/8/15  | 11,000,000 | 6,796.38<br>747,602,306   | 8,965.65<br>986,222,015    | 3.875<br>2040/8/15  | 0.41            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 3.375% 19/11/15 | 11,000,000 | 7,714.05<br>848,546,160   | 8,677.01<br>954,472,148    | 3.375<br>2019/11/15 | 0.39            |

|      |      |                      |            |                          |                          |                     |      |
|------|------|----------------------|------------|--------------------------|--------------------------|---------------------|------|
| アメリカ | 国債証券 | US T 3.125% 21/05/15 | 11,000,000 | 7,793.55<br>857,291,213  | 8,484.19<br>933,261,656  | 3.125<br>2021/5/15  | 0.38 |
| フランス | 国債証券 | FRTR 3.0% 15/10/25   | 8,000,000  | 10,692.09<br>855,367,760 | 10,990.16<br>879,213,114 | 3<br>2015/10/25     | 0.36 |
| フランス | 国債証券 | FRTR 3.75% 21/04/25  | 7,700,000  | 10,673.35<br>821,848,504 | 11,406.29<br>878,284,453 | 3.75<br>2021/4/25   | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | US T 4.375% 39/11/15 | 9,000,000  | 7,414.35<br>667,291,905  | 9,709.39<br>873,845,929  | 4.375<br>2039/11/15 | 0.36 |
| イギリス | 国債証券 | UKT 4.5% 13/03/07    | 6,700,000  | 12,829.40<br>859,570,007 | 12,649.62<br>847,525,097 | 4.5<br>2013/3/7     | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | US T 2.125% 14/11/30 | 10,500,000 | 7,819.49<br>821,047,253  | 8,060.22<br>846,323,789  | 2.125<br>2014/11/30 | 0.35 |
| フランス | 国債証券 | FRTR 4.25% 23/10/25  | 7,000,000  | 11,040.78<br>772,855,171 | 11,772.75<br>824,093,116 | 4.25<br>2023/10/25  | 0.34 |
| イギリス | 国債証券 | UKT 2.75% 15/01/22   | 6,500,000  | 12,217.25<br>794,121,331 | 12,657.53<br>822,739,654 | 2.75<br>2015/1/22   | 0.34 |
| アメリカ | 国債証券 | US T 2.5% 15/04/30   | 10,000,000 | 7,893.15<br>789,315,355  | 8,191.36<br>819,136,996  | 2.5<br>2015/4/30    | 0.34 |
| フランス | 国債証券 | FRTR 4.25% 19/04/25  | 6,900,000  | 11,198.07<br>772,666,940 | 11,780.87<br>812,880,677 | 4.25<br>2019/4/25   | 0.34 |
| アメリカ | 国債証券 | US T 2.25% 15/01/31  | 10,000,000 | 7,837.17<br>783,717,539  | 8,108.13<br>810,813,281  | 2.25<br>2015/1/31   | 0.33 |
| アメリカ | 国債証券 | US T 2.375% 14/09/30 | 10,000,000 | 7,913.51<br>791,351,371  | 8,106.93<br>810,693,515  | 2.375<br>2014/9/30  | 0.33 |
| イギリス | 国債証券 | UKT 3.75% 19/09/07   | 6,000,000  | 12,145.39<br>728,723,797 | 13,356.98<br>801,419,396 | 3.75<br>2019/9/7    | 0.33 |
| イギリス | 国債証券 | UKT 3.75% 20/09/07   | 6,000,000  | 11,980.12<br>718,807,799 | 13,341.65<br>800,499,562 | 3.75<br>2020/9/7    | 0.33 |
| フランス | 国債証券 | FRTR 5.5% 29/04/25   | 6,000,000  | 12,681.55<br>760,893,140 | 13,270.69<br>796,241,608 | 5.5<br>2029/4/25    | 0.33 |
| アメリカ | 国債証券 | US T 3.625% 19/08/15 | 9,000,000  | 7,894.95<br>710,545,500  | 8,812.35<br>793,111,921  | 3.625<br>2019/8/15  | 0.33 |

|      |      |                    |           |                         |                         |                  |      |
|------|------|--------------------|-----------|-------------------------|-------------------------|------------------|------|
| アメリカ | 国債証券 | US T 4.5% 39/08/15 | 8,000,000 | 7,630.58<br>610,446,827 | 9,890.24<br>791,219,625 | 4.5<br>2039/8/15 | 0.33 |
|------|------|--------------------|-----------|-------------------------|-------------------------|------------------|------|

□ 種類別の投資比率

平成23年9月30日現在

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 国債証券 | 97.55   |
| 合計   | 97.55   |

**投資不動産物件**

該当事項はありません。

**その他投資資産の主要なもの**

該当事項はありません。

## 〔参考情報〕

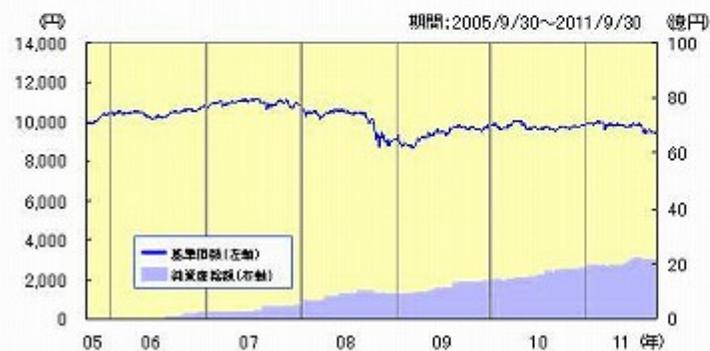
基準日2011年9月30日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

## 基準価額・純資産の推移

## &lt;マイパッケージ30&gt;



|       |        |
|-------|--------|
| 基準価額  | 9,489円 |
| 純資産総額 | 22億円   |

## 分配の推移

| 決算期     | 分配金 |
|---------|-----|
| 2011年2月 | 0円  |
| 2010年2月 | 0円  |
| 2009年2月 | 0円  |
| 2008年2月 | 0円  |
| 2007年2月 | 0円  |
| 設定以来累計  | 0円  |

※分配金は1万円当たり税引前です。  
※直近の決算期間を記載しています。

## &lt;マイパッケージ50&gt;



|       |        |
|-------|--------|
| 基準価額  | 8,511円 |
| 純資産総額 | 62億円   |

## 分配の推移

| 決算期     | 分配金 |
|---------|-----|
| 2011年2月 | 0円  |
| 2010年2月 | 0円  |
| 2008年2月 | 0円  |
| 2006年2月 | 0円  |
| 2007年2月 | 0円  |
| 設定以来累計  | 0円  |

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

## &lt;マイパッケージ70&gt;



|       |        |
|-------|--------|
| 基準価額  | 7,513円 |
| 純資産総額 | 29億円   |

## 分配の推移

| 決算期     | 分配金 |
|---------|-----|
| 2011年2月 | 0円  |
| 2010年2月 | 0円  |
| 2008年2月 | 0円  |
| 2006年2月 | 0円  |
| 2007年2月 | 0円  |
| 設定以来累計  | 0円  |

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
※直近の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。

基準日2011年9月30日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

## 年間収益率の推移（暦年ベース）

## &lt;マイパッケージ30&gt;



## &lt;マイパッケージ50&gt;



## &lt;マイパッケージ70&gt;



2005年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2005年9月30日)から年末までの騰落率を表示しています。

2011年の収益率は、年初から2011年9月30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】

#### <訂正前>

イ 申込方法

（略）

（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。

（略）

#### <訂正後>

イ 申込方法

（略）

（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。

（略）

### 3【資産管理等の概要】

#### （5）【その他】

#### <訂正前>

（略）

ロ 収益分配金、償還金の支払い

（イ）収益分配金

- a . 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。  
分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わないことがあります。

（略）

<訂正後>

（略）

□ 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。

（略）

### 第3【ファンドの経理状況】

#### <訂正前>

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(以下「財務諸表等規則」といいます)(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(以下「投資信託財産計算規則」といいます)(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

また、第5期(平成21年2月19日から平成22年2月18日まで)については、改正前の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づき、第6期(平成22年2月19日から平成23年2月18日まで)については、改正後の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期(平成21年2月19日から平成22年2月18日まで)の財務諸表については、あずさ監査法人により監査を受け、第6期(平成22年2月19日から平成23年2月18日まで)の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

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

#### <訂正後>

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(以下「財務諸表等規則」といいます)(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(以下「投資信託財産計算規則」といいます)(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

また、第5期(平成21年2月19日から平成22年2月18日まで)については、改正前の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づき、第6期(平成22年2月19日から平成23年2月18日まで)については、改正後の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期(平成21年2月19日から平成22年2月18日まで)の財務諸表については、あずさ監査法人により監査を受け、第6期(平成22年2月19日から平成23年2月18日まで)の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

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

3. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(以下「中間財務諸表等規則」といいます)(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」(以下「投資信託財産計算規則」といいます)(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

また、第6期中間計算期間(平成22年2月19日から平成22年8月18日まで)については、改正前の中間財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づき、第7期中間計算期間(平成23年2月19日から平成23年8月18日まで)については、改正後の中間財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

4. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期中間計算期間(平成22年2月19日から平成22年8月18日まで)および第7期中間計算期間(平成23年2月19日から平成23年8月18日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 1【財務諸表】

### [追加]

原届出書「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」に中間財務諸表が追加されます。

## 中間財務諸表

【三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第6期中間計算期間<br>(平成22年8月18日現在) | 第7期中間計算期間<br>(平成23年8月18日現在) |
|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                             |                             |
| 流動資産            |                             |                             |
| コール・ローン         | 78,330,466                  | 103,847,850                 |
| 親投資信託受益証券       | 1,658,919,757               | 2,058,896,961               |
| 未収入金            | -                           | 1,458,000                   |
| 未収利息            | 107                         | 142                         |
| 流動資産合計          | 1,737,250,330               | 2,164,202,953               |
| 資産合計            | 1,737,250,330               | 2,164,202,953               |
| <b>負債の部</b>     |                             |                             |
| 流動負債            |                             |                             |
| 未払解約金           | 11,395                      | 1,476,175                   |
| 未払受託者報酬         | 243,458                     | 320,685                     |
| 未払委託者報酬         | 1,541,834                   | 2,030,908                   |
| その他未払費用         | 40,520                      | 53,384                      |
| 流動負債合計          | 1,837,207                   | 3,881,152                   |
| 負債合計            | 1,837,207                   | 3,881,152                   |
| <b>純資産の部</b>    |                             |                             |
| 元本等             |                             |                             |
| 元本              | 1,794,431,613               | 2,260,983,846               |
| 剰余金             |                             |                             |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 59,018,490                  | 100,662,045                 |
| 元本等合計           | 1,735,413,123               | 2,160,321,801               |
| 純資産合計           | 1,735,413,123               | 2,160,321,801               |
| 負債純資産合計         | 1,737,250,330               | 2,164,202,953               |

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

|  | 第 6 期中間計算期間<br>自 平成22年 2月19日<br>至 平成22年 8月18日 | 第 7 期中間計算期間<br>自 平成23年 2月19日<br>至 平成23年 8月18日 |
|--|---|---|
| <b>営業収益</b>                                |   |   |
| 受取利息                                       | 16,541  | 22,486  |
| 有価証券売買等損益                                  | 3,990,543                                     | 101,254,912                                   |
| 営業収益合計                                     | 3,974,002                                     | 101,232,426                                   |
| <b>営業費用</b>                                |   |   |
| 受託者報酬                                      | 243,458                                       | 320,685                                       |
| 委託者報酬                                      | 1,541,834                                     | 2,030,908                                     |
| その他費用                                      | 40,520  | 53,384  |
| 営業費用合計                                     | 1,825,812                                     | 2,404,977                                     |
| 営業損失 ( )                                   | 5,799,814                                     | 103,637,403                                   |
| 経常損失 ( )                                   | 5,799,814                                     | 103,637,403                                   |
| 中間純損失 ( )                                  | 5,799,814                                     | 103,637,403                                   |
| 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 ( ) | 205,432                                       | 1,061,138                                     |
| 期首剰余金又は期首欠損金 ( )                           | 44,410,042                                    | 8,448,753                                     |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                             | 1,279,811                                     | -   |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                    | 1,279,811                                     | -   |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                             | 9,883,013                                     | 6,534,533                                     |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                    | -   | 133,694                                       |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                    | 9,883,013                                     | 6,400,839                                     |
| 分配金  | -   | -   |
| 中間剰余金又は中間欠損金 ( )                           | 59,018,490                                    | 100,662,045                                   |

**（３）【中間注記表】**

（中間財務諸表作成の基本となる重要な事項に関する注記）

| 項目            | 第 6 期中間計算期間<br>自 平成22年 2月19日<br>至 平成22年 8月18日  | 第 7 期中間計算期間<br>自 平成23年 2月19日<br>至 平成23年 8月18日 |
|---------------|--|---|
| 資産の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券（売買目的有価証券）<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価<br>評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に<br>基づいて評価しております。 | 親投資信託受益証券（売買目的有価証券）<br>同 左                    |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 項目            | 第 6 期中間計算期間<br>（平成22年 8月18日現在）                       | 第 7 期中間計算期間<br>（平成23年 8月18日現在）                        |
|---------------|--|---|
| 1. 受益権総数      | 当中間計算期間の末日における受益権の総数<br>1,794,431,613口               | 当中間計算期間の末日における受益権の総数<br>2,260,983,846口                |
| 2. 元本の欠損      | 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10<br>号に規定する額<br>59,018,490円 | 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10<br>号に規定する額<br>100,662,045円 |
| 3. 1単位当たり純資産額 | 0.9671円<br>（1万口=9,671円）                              | 0.9555円<br>（1万口=9,555円）                               |

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

金融商品の時価等に関する事項

| 項目                   | 第 7 期中間計算期間<br>（平成23年 8月18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<br>せん。    |
| 2. 時価の算定方法           | （1）有価証券（親投資信託受益証券）<br>「中間財務諸表作成の基本となる重要な事項に関する注記」に記載しております。 |

## (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)

デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。

## (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第6期中間計算期間(平成22年8月18日現在)

第6期中間計算期間末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

第7期中間計算期間(平成23年8月18日現在)

第7期中間計算期間末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

## (その他の注記)

| 項目        | 第6期中間計算期間<br>(平成22年8月18日現在) | 第7期中間計算期間<br>(平成23年8月18日現在) |
|-----------|-----------------------------|-----------------------------|
| 期首元本額     | 1,473,303,036円              | 1,952,365,458円              |
| 期中追加設定元本額 | 364,214,692円                | 356,029,964円                |
| 期中一部解約元本額 | 43,086,115円                 | 47,411,576円                 |

## 【三井住友・DC年金バランス50（標準型）】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第6期中間計算期間<br>(平成22年8月18日現在) | 第7期中間計算期間<br>(平成23年8月18日現在) |
|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                             |                             |
| 流動資産            |                             |                             |
| コール・ローン         | 252,553,440                 | 307,585,479                 |
| 親投資信託受益証券       | 5,109,797,899               | 5,836,927,110               |
| 未収入金            | -                           | 4,539,000                   |
| 未収利息            | 345                         | 421                         |
| 流動資産合計          | 5,362,351,684               | 6,149,052,010               |
| 資産合計            | 5,362,351,684               | 6,149,052,010               |
| <b>負債の部</b>     |                             |                             |
| 流動負債            |                             |                             |
| 未払解約金           | 380,543                     | 4,601,453                   |
| 未払受託者報酬         | 771,894                     | 955,536                     |
| 未払委託者報酬         | 5,145,865                   | 6,370,171                   |
| その他未払費用         | 128,581                     | 159,193                     |
| 流動負債合計          | 6,426,883                   | 12,086,353                  |
| 負債合計            | 6,426,883                   | 12,086,353                  |
| <b>純資産の部</b>    |                             |                             |
| 元本等             |                             |                             |
| 元本              | 6,099,321,455               | 7,138,635,352               |
| 剰余金             |                             |                             |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 743,396,654                 | 1,001,669,695               |
| 元本等合計           | 5,355,924,801               | 6,136,965,657               |
| 純資産合計           | 5,355,924,801               | 6,136,965,657               |
| 負債純資産合計         | 5,362,351,684               | 6,149,052,010               |

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

|  | 第 6 期中間計算期間<br>自 平成22年 2月19日<br>至 平成22年 8月18日 | 第 7 期中間計算期間<br>自 平成23年 2月19日<br>至 平成23年 8月18日 |
|--|---|---|
| <b>営業収益</b>                                |   |   |
| 受取利息                                       | 55,624  | 70,752  |
| 有価証券売買等損益                                  | 115,078,558                                   | 586,120,928                                   |
| 営業収益合計                                     | 115,022,934                                   | 586,050,176                                   |
| <b>営業費用</b>                                |   |   |
| 受託者報酬                                      | 771,894                                       | 955,536                                       |
| 委託者報酬                                      | 5,145,865                                     | 6,370,171                                     |
| その他費用                                      | 128,581                                       | 159,193                                       |
| 営業費用合計                                     | 6,046,340                                     | 7,484,900                                     |
| 営業損失 ( )                                   | 121,069,274                                   | 593,535,076                                   |
| 経常損失 ( )                                   | 121,069,274                                   | 593,535,076                                   |
| 中間純損失 ( )                                  | 121,069,274                                   | 593,535,076                                   |
| 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 ( ) | 744,095                                       | 8,474,876                                     |
| 期首剰余金又は期首欠損金 ( )                           | 521,636,636                                   | 340,669,603                                   |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                             | 14,368,754                                    | 11,282,979                                    |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                    | 14,368,754                                    | 11,282,979                                    |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                             | 114,315,403                                   | 87,222,871                                    |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                    | 114,315,403                                   | 87,222,871                                    |
| 分配金  | -   | -   |
| 中間剰余金又は中間欠損金 ( )                           | 743,396,654                                   | 1,001,669,695                                 |

**（３）【中間注記表】**

（中間財務諸表作成の基本となる重要な事項に関する注記）

| 項目            | 第 6 期中間計算期間<br>自 平成22年 2 月19日<br>至 平成22年 8 月18日  | 第 7 期中間計算期間<br>自 平成23年 2 月19日<br>至 平成23年 8 月18日 |
|---------------|--|---|
| 資産の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券（売買目的有価証券）<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価<br>評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に<br>基づいて評価しております。 | 親投資信託受益証券（売買目的有価証券）<br>同 左                      |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 項目             | 第 6 期中間計算期間<br>(平成22年 8 月18日現在)                       | 第 7 期中間計算期間<br>(平成23年 8 月18日現在)                         |
|----------------|---|---|
| 1. 受益権総数       | 当中間計算期間の末日における受益権の総数<br>6,099,321,455口                | 当中間計算期間の末日における受益権の総数<br>7,138,635,352口                  |
| 2. 元本の欠損       | 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10<br>号に規定する額<br>743,396,654円 | 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10<br>号に規定する額<br>1,001,669,695円 |
| 3. 1 単位当たり純資産額 | 0.8781円<br>( 1 万口 = 8,781 円 )                         | 0.8597円<br>( 1 万口 = 8,597 円 )                           |

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

金融商品の時価等に関する事項

| 項目                   | 第 7 期中間計算期間<br>(平成23年 8 月18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<br>せん。     |
| 2. 時価の算定方法           | (1) 有価証券（親投資信託受益証券）<br>「中間財務諸表作成の基本となる重要な事項に関する注記」に記載しております。 |

## (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)

デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。

## (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第6期中間計算期間(平成22年8月18日現在)

第6期中間計算期間末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

第7期中間計算期間(平成23年8月18日現在)

第7期中間計算期間末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

## (その他の注記)

| 項目        | 第6期中間計算期間<br>(平成22年8月18日現在) | 第7期中間計算期間<br>(平成23年8月18日現在) |
|-----------|-----------------------------|-----------------------------|
| 期首元本額     | 5,130,131,943円              | 6,422,758,338円              |
| 期中追加設定元本額 | 1,111,264,317円              | 919,977,548円                |
| 期中一部解約元本額 | 142,074,805円                | 204,100,534円                |

## 【三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第6期中間計算期間<br>(平成22年8月18日現在) | 第7期中間計算期間<br>(平成23年8月18日現在) |
|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                             |                             |
| 流動資産            |                             |                             |
| コール・ローン         | 121,425,206                 | 141,073,615                 |
| 親投資信託受益証券       | 2,299,961,230               | 2,673,322,851               |
| 未収入金            | -                           | 385,000                     |
| 未収利息            | 166                         | 193                         |
| 流動資産合計          | 2,421,386,602               | 2,814,781,659               |
| 資産合計            | 2,421,386,602               | 2,814,781,659               |
| <b>負債の部</b>     |                             |                             |
| 流動負債            |                             |                             |
| 未払解約金           | 94,737                      | 522,712                     |
| 未払受託者報酬         | 349,096                     | 447,657                     |
| 未払委託者報酬         | 2,443,632                   | 3,133,516                   |
| その他未払費用         | 58,119                      | 74,549                      |
| 流動負債合計          | 2,945,584                   | 4,178,434                   |
| 負債合計            | 2,945,584                   | 4,178,434                   |
| <b>純資産の部</b>    |                             |                             |
| 元本等             |                             |                             |
| 元本              | 3,075,401,533               | 3,690,857,047               |
| 剰余金             |                             |                             |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 656,960,515                 | 880,253,822                 |
| 元本等合計           | 2,418,441,018               | 2,810,603,225               |
| 純資産合計           | 2,418,441,018               | 2,810,603,225               |
| 負債純資産合計         | 2,421,386,602               | 2,814,781,659               |

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

|  | 第 6 期中間計算期間<br>自 平成22年 2 月19日<br>至 平成22年 8 月18日 | 第 7 期中間計算期間<br>自 平成23年 2 月19日<br>至 平成23年 8 月18日 |
|--|---|---|
| <b>営業収益</b>                                |   |   |
| 受取利息                                       | 25,829  | 31,656  |
| 有価証券売買等損益                                  | 102,124,470                                     | 412,220,790                                     |
| 営業収益合計                                     | 102,098,641                                     | 412,189,134                                     |
| <b>営業費用</b>                                |   |   |
| 受託者報酬                                      | 349,096   | 447,657   |
| 委託者報酬                                      | 2,443,632                                       | 3,133,516                                       |
| その他費用                                      | 58,119  | 74,549  |
| 営業費用合計                                     | 2,850,847                                       | 3,655,722                                       |
| 営業損失 ( )                                   | 104,949,488                                     | 415,844,856                                     |
| 経常損失 ( )                                   | 104,949,488                                     | 415,844,856                                     |
| 中間純損失 ( )                                  | 104,949,488                                     | 415,844,856                                     |
| 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 ( ) | 257,045   | 3,879,611                                       |
| 期首剰余金又は期首欠損金 ( )                           | 447,378,489                                     | 395,568,273                                     |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                             | 12,672,479                                      | 8,864,587                                       |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                    | 12,672,479                                      | 8,864,587                                       |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                             | 117,047,972                                     | 81,584,891                                      |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                    | 117,047,972                                     | 81,584,891                                      |
| 分配金  | -   | -   |
| 中間剰余金又は中間欠損金 ( )                           | 656,960,515                                     | 880,253,822                                     |

**（３）【中間注記表】**

（中間財務諸表作成の基本となる重要な事項に関する注記）

| 項目            | 第 6 期中間計算期間<br>自 平成22年 2 月19日<br>至 平成22年 8 月18日  | 第 7 期中間計算期間<br>自 平成23年 2 月19日<br>至 平成23年 8 月18日 |
|---------------|--|---|
| 資産の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券（売買目的有価証券）<br>移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価<br>評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に<br>基づいて評価しております。 | 親投資信託受益証券（売買目的有価証券）<br>同 左                      |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 項目             | 第 6 期中間計算期間<br>(平成22年 8 月18日現在)                        | 第 7 期中間計算期間<br>(平成23年 8 月18日現在)                        |
|----------------|--|--|
| 1. 受益権総数       | 当中間計算期間の末日における受益権の総数<br>3,075,401,533口                 | 当中間計算期間の末日における受益権の総数<br>3,690,857,047口                 |
| 2. 元本の欠損       | 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6 第10<br>号に規定する額<br>656,960,515円 | 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6 第10<br>号に規定する額<br>880,253,822円 |
| 3. 1 単位当たり純資産額 | 0.7864円<br>( 1 万口 = 7,864円 )                           | 0.7615円<br>( 1 万口 = 7,615円 )                           |

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

金融商品の時価等に関する事項

| 項目                   | 第 7 期中間計算期間<br>(平成23年 8 月18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<br>せん。     |
| 2. 時価の算定方法           | (1) 有価証券（親投資信託受益証券）<br>「中間財務諸表作成の基本となる重要な事項に関する注記」に記載しております。 |

## (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)

デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。

## (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第6期中間計算期間(平成22年8月18日現在)

第6期中間計算期間末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

第7期中間計算期間(平成23年8月18日現在)

第7期中間計算期間末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

## (その他の注記)

| 項目        | 第6期中間計算期間<br>(平成22年8月18日現在) | 第7期中間計算期間<br>(平成23年8月18日現在) |
|-----------|-----------------------------|-----------------------------|
| 期首元本額     | 2,507,724,029円              | 3,301,833,283円              |
| 期中追加設定元本額 | 638,953,391円                | 461,678,066円                |
| 期中一部解約元本額 | 71,275,887円                 | 72,654,302円                 |

## (参考情報)

三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)、三井住友・DC年金バランス50(標準型)および三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」および「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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。

「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」の状況

## (1) 貸借対照表

| 対象年月日    | (平成22年8月18日現在)  | (平成23年8月18日現在)  |
|----------|-----------------|-----------------|
| 科目       | 金額(円)           | 金額(円)           |
| 資産の部     |                 |                 |
| 流動資産     |                 |                 |
| コール・ローン  | 5,517,076,123   | 5,551,982,375   |
| 株式       | 303,164,490,384 | 269,445,367,200 |
| 派生商品評価勘定 | 1,342,950       | 806,000         |
| 未収入金     | -               | 116,000,000     |
| 未収配当金    | 248,334,025     | 284,329,500     |
| 未収利息     | 7,557           | 7,605           |
| 前払金      | 183,647,000     | 350,843,000     |
| 差入委託証拠金  | 52,090,000      | -               |
| 流動資産合計   | 309,166,988,039 | 275,749,335,680 |
| 資産合計     | 309,166,988,039 | 275,749,335,680 |
| 負債の部     |                 |                 |
| 流動負債     |                 |                 |
| 派生商品評価勘定 | 185,038,250     | 352,002,850     |
| 未払金      | -               | 49,595,000      |
| 未払解約金    | 1,098,954       | -               |
| 流動負債合計   | 186,137,204     | 401,597,850     |
| 負債合計     | 186,137,204     | 401,597,850     |

|             |                 |                 |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 純資産の部       |                 |                 |
| 元本等         |                 |                 |
| 元本          |                 |                 |
| 元本          | 284,632,076,298 | 270,017,523,136 |
| 剰余金         |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金( ) | 24,348,774,537  | 5,330,214,694   |
| 元本等合計       | 308,980,850,835 | 275,347,737,830 |
| 純資産合計       | 308,980,850,835 | 275,347,737,830 |
| 負債純資産合計     | 309,166,988,039 | 275,749,335,680 |

(注)「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」は、毎年11月30日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。上記の貸借対照表は平成22年8月18日ならびに平成23年8月18日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目               | 自平成22年2月19日<br>至平成22年8月18日   | 自平成23年2月19日<br>至平成23年8月18日                 |
|------------------|--|--|
| 1. 資産の評価基準及び評価方法 | (1)株式（売買目的有価証券）<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、取引所もしくは店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。<br><br>(2)先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 | (1)株式（売買目的有価証券）<br>同左<br><br>(2)先物取引<br>同左 |
| 2. 収益及び費用の計上基準   | 受取配当金の計上基準<br>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。  | 受取配当金の計上基準<br>同左                           |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目            | (平成22年8月18日現在)   | (平成23年8月18日現在)                             |           |    |                |  |             |           |    |                |
|---------------|--|--|-----------|----|----------------|--|-------------|-----------|----|----------------|
| 1. 担保資産       | 代用として、担保に供している資産は次の通りであります。<br><br><table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td style="text-align: center;"><u>担保資産</u></td> <td style="text-align: center;"><u>金額</u></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">株式</td> <td style="text-align: center;">3,636,000,000円</td> </tr> </table> | <u>担保資産</u>                                | <u>金額</u> | 株式 | 3,636,000,000円 | 代用として、担保に供している資産は次の通りであります。<br><br><table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td style="text-align: center;"><u>担保資産</u></td> <td style="text-align: center;"><u>金額</u></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">株式</td> <td style="text-align: center;">5,052,600,000円</td> </tr> </table> | <u>担保資産</u> | <u>金額</u> | 株式 | 5,052,600,000円 |
| <u>担保資産</u>   | <u>金額</u>  |  |           |    |                |  |             |           |    |                |
| 株式            | 3,636,000,000円   |  |           |    |                |  |             |           |    |                |
| <u>担保資産</u>   | <u>金額</u>  |  |           |    |                |  |             |           |    |                |
| 株式            | 5,052,600,000円   |  |           |    |                |  |             |           |    |                |
| 2. 受益権総数      | 平成22年8月18日現在における受益権の総数<br>284,632,076,298口   | 平成23年8月18日現在における受益権の総数<br>270,017,523,136口 |           |    |                |  |             |           |    |                |
| 3. 1単位当たり純資産額 | 1.0855円<br>(1万口 = 10,855円)   | 1.0197円<br>(1万口 = 10,197円)                 |           |    |                |  |             |           |    |                |

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

金融商品の時価等に関する事項

| 項目                 | (平成23年8月18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）<br/>「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br/>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<br/>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）

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

株式関連

（平成22年8月18日現在）

（単位：円）

| 区分   | 種類                          | 契約額等            |       | 時価            | 評価損益          |
|------|-----------------------------|-----------------|-------|---------------|---------------|
|      |                             |                 | うち1年超 |               |               |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>(TOPIX先物)<br>買建 | 6,011,947,000   | -     | 5,828,300,000 | 183,647,000   |
|      |                             | (6,011,995,300) | (-)   |               | (183,695,300) |
|      | 買建合計                        | 6,011,947,000   | -     | 5,828,300,000 | 183,647,000   |
|      |                             | (6,011,995,300) | (-)   |               | (183,695,300) |

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

なお、( )内は手数料相当額を含んだ場合の金額を表わしています。

4. 株価指数先物取引の取引市場は、東京証券取引所です。

（平成23年8月18日現在）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

（単位：円）

| 区分   | 種類                    | 契約額等                             |          | 時価            | 評価損益                         |
|------|-----------------------|----------------------------------|----------|---------------|------------------------------|
|      |                       |                                  | うち1年超    |               |                              |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>(TOPIX先物) |                                  |          |               |                              |
|      | 買建                    | 6,790,168,000<br>(6,790,521,850) | -<br>(-) | 6,439,325,000 | 350,843,000<br>(351,196,850) |
|      | 買建合計                  | 6,790,168,000<br>(6,790,521,850) | -<br>(-) | 6,439,325,000 | 350,843,000<br>(351,196,850) |

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

なお、（ ）内は手数料相当額を含んだ場合の金額を表わしています。

4. 株価指数先物取引の取引市場は、東京証券取引所です。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(その他の注記)

| (平成22年8月18日現在)                  |                  |
|---------------------------------|------------------|
| 本半期報告書における開示対象ファンドの             |                  |
| 期首における当該親投資信託の元本額               | 282,243,743,306円 |
| 同期中における追加設定元本額                  | 16,764,407,662円  |
| 同期中における一部解約元本額                  | 14,376,074,670円  |
| 平成22年8月18日現在における元本の内訳           |                  |
| 三井住友・日本株式インデックス年金ファンド           | 7,242,080,019円   |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)          | 313,771,420円     |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)            | 1,700,788,337円   |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)          | 1,107,299,465円   |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)       | 17,579,101円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020         | 3,961,583円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025         | 593,993円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030         | 3,835,500円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035         | 544,662円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040         | 690,058円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045         | 1,084,946円       |
| 国内株式指数ファンド(TOPIX)               | 454,679,123円     |
| SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)   | 75,823,934,070円  |
| バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>    | 1,064,515,211円   |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定> | 50,402,655,339円  |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>    | 17,436,779,221円  |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>  | 8,227,387,583円   |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>    | 27,785,692,011円  |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>    | 180,881,881円     |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>    | 572,559,281円     |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>      | 105,871,413円     |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>    | 2,529,041,826円   |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定> | 124,119,245円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 1,113,391,447円   |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 3,766,963,660円   |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>    | 4,936,901,865円   |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>    | 12,351,723,387円  |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>      | 1,344,168,347円   |
| 三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 10,706,748,008円  |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>   | 230,472,889円     |
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>    | 3,020,721,558円   |

|   |                  |
|---|------------------|
| 三井住友・7資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）             | 45,581,482,297円  |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >   | 313,616,619円     |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >   | 158,132,103円     |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >   | 60,736,387円      |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >   | 940,243,277円     |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >   | 1,638,339,499円   |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >   | 571,621,223円     |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 174,536,558円     |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 71,456,023円      |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 19,092,865円      |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 89,315,669円      |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 1,830,118,397円   |
| S M A M・国内株式インデックスファンド・V A（適格機関投資家専用）         | 546,260,078円     |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 > | 65,688,854円      |
| 合 計   | 284,632,076,298円 |

(平成23年8月18日現在)

## 本半期報告書における開示対象ファンドの

|                                 |                  |
|---------------------------------|------------------|
| 期首における当該親投資信託の元本額               | 261,704,374,197円 |
| 同期中における追加設定元本額                  | 31,162,666,518円  |
| 同期中における一部解約元本額                  | 22,849,517,579円  |
| 平成23年8月18日現在における元本の内訳           |                  |
| 三井住友・日本株式インデックス年金ファンド           | 8,174,556,931円   |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)          | 395,968,503円     |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)            | 2,011,398,856円   |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)          | 1,340,443,502円   |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)       | 35,304,194円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020         | 4,523,468円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025         | 2,998,448円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030         | 4,463,539円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035         | 2,688,362円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040         | 1,114,167円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045         | 3,092,319円       |
| 国内株式指数ファンド(TOPIX)               | 745,469,994円     |
| SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)   | 66,798,872,615円  |
| バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>    | 769,037,535円     |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定> | 49,027,076,548円  |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>    | 16,950,858,024円  |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>  | 7,514,553,876円   |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>    | 26,050,062,412円  |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>    | 183,679,345円     |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>    | 558,863,923円     |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>      | 96,791,129円      |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>    | 2,442,780,033円   |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定> | 121,185,455円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 1,009,965,691円   |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 3,267,658,020円   |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>    | 4,717,771,111円   |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>    | 10,916,737,671円  |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>      | 1,281,575,196円   |
| 三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 10,634,050,437円  |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>   | 224,138,343円     |
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>    | 2,776,424,666円   |
| 三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 43,875,052,907円  |

|   |                  |
|---|------------------|
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >   | 302,941,385円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >   | 154,712,670円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >   | 54,731,586円      |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >   | 851,048,827円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >   | 1,466,023,850円   |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >   | 533,482,721円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 332,670,694円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 137,073,992円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 31,454,017円      |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 307,395,317円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 3,171,110,375円   |
| S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・ V A ( 適格機関投資家専用 )     | 579,784,052円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 > | 125,514,507円     |
| S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20 V A < 適格機関投資家限定 >    | 23,825,507円      |
| S M A M ・ F G グローバルバランス25 V A < 適格機関投資家限定 >     | 6,596,416円       |
| 合 計   | 270,017,523,136円 |

「国内債券パッシブ・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 対象年月日       | (平成22年8月18日現在)  | (平成23年8月18日現在)  |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 科目          | 金額(円)           | 金額(円)           |
| 資産の部        |                 |                 |
| 流動資産        |                 |                 |
| コール・ローン     | 853,535,118     | 817,415,381     |
| 国債証券        | 372,713,682,500 | 365,854,372,950 |
| 地方債証券       | 34,560,958,238  | 33,394,377,031  |
| 特殊債券        | 57,532,447,046  | 53,616,899,753  |
| 社債券         | 42,842,824,800  | 40,893,267,900  |
| 未収入金        | 1,153,336,100   | 1,789,132,400   |
| 未収利息        | 2,185,087,402   | 2,187,970,496   |
| 前払費用        | 57,028,324      | 58,365,947      |
| 流動資産合計      | 511,898,899,528 | 498,611,801,858 |
| 資産合計        | 511,898,899,528 | 498,611,801,858 |
| 負債の部        |                 |                 |
| 流動負債        |                 |                 |
| 未払解約金       | 964,900,172     | 1,384,083,000   |
| 流動負債合計      | 964,900,172     | 1,384,083,000   |
| 負債合計        | 964,900,172     | 1,384,083,000   |
| 純資産の部       |                 |                 |
| 元本等         |                 |                 |
| 元本          |                 |                 |
| 元本          | 463,489,000,526 | 450,116,897,905 |
| 剰余金         |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金( ) | 47,444,998,830  | 47,110,820,953  |
| 元本等合計       | 510,933,999,356 | 497,227,718,858 |
| 純資産合計       | 510,933,999,356 | 497,227,718,858 |

|         |                 |                 |
|---------|-----------------|-----------------|
| 負債純資産合計 | 511,898,899,528 | 498,611,801,858 |
|---------|-----------------|-----------------|

(注)「国内債券パッシブ・マザーファンド」は、毎年5月25日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。上記の貸借対照表は平成22年8月18日ならびに平成23年8月18日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目            | 自平成22年2月19日<br>至平成22年8月18日   | 自平成23年2月19日<br>至平成23年8月18日            |
|---------------|--|---------------------------------------|
| 資産の評価基準及び評価方法 | 国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券（売買目的有価証券）<br>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 | 国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券（売買目的有価証券）<br>同左 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目            | (平成22年8月18日現在)                             | (平成23年8月18日現在)                             |
|---------------|--|--|
| 1. 受益権総数      | 平成22年8月18日現在における受益権の総数<br>463,489,000,526口 | 平成23年8月18日現在における受益権の総数<br>450,116,897,905口 |
| 2. 1単位当たり純資産額 | 1.1024円<br>(1万口 = 11,024円)                 | 1.1047円<br>(1万口 = 11,047円)                 |

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

金融商品の時価等に関する事項

| 項目                 | (平成23年8月18日現在)   |
|--------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。   |
| 2. 時価の算定方法         | (1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券）<br>「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>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。<br>(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<br>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)

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

(平成22年8月18日現在)

平成22年8月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

(平成23年8月18日現在)

平成23年8月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

(その他の注記)

| (平成22年8月18日現在)                                 |                  |
|--|------------------|
| 本半期報告書における開示対象ファンドの                            |                  |
| 期首における当該親投資信託の元本額                              | 481,747,338,777円 |
| 同期中における追加設定元本額                                 | 14,307,835,047円  |
| 同期中における一部解約元本額                                 | 32,566,173,298円  |
| 平成22年8月18日現在における元本の内訳                          |                  |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)                         | 877,026,320円     |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)                           | 1,738,674,413円   |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)                         | 337,206,959円     |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)                      | 37,932,877円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020                        | 10,782,105円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025                        | 985,450円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030                        | 3,534,864円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035                        | 424,373円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040                        | 448,953円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045                        | 672,623円         |
| S M A M ・ バランスファンド V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >       | 48,328,032,421円  |
| S M A M ・ バランスファンド V A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >   | 12,744,823,333円  |
| S M A M ・ バランスファンド V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >       | 28,576,431,263円  |
| S M A M ・ バランスファンド V L 3 0 < 適格機関投資家限定 >       | 566,149,682円     |
| S M A M ・ バランスファンド V L 5 0 < 適格機関投資家限定 >       | 789,983,373円     |
| 世界6資産バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >                | 191,393,402円     |
| S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >       | 379,809,808円     |
| S M A M ・ バランスファンド V L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >     | 128,135,718円     |
| S M A M ・ インデックス・バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >    | 3,078,908,616円   |
| S M A M ・ インデックス・バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >    | 3,743,512,557円   |
| S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >       | 7,651,522,481円   |
| S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >       | 22,018,650,301円  |
| S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >       | 1,367,451,795円   |
| 三井住友・国内債券インデックスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )       | 11,418,953,792円  |
| 三井住友・5資産バランスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )          | 67,405,030,588円  |
| S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >      | 939,783,038円     |
| S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >       | 12,423,069,841円  |
| 三井住友・7資産バランスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )          | 214,996,406,887円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 > | 1,412,539,983円   |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 > | 326,678,573円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 > | 62,285,603円      |

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>  | 4,638,243,909円   |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>  | 5,545,081,154円   |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>  | 4,287,782,378円   |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 740,129,443円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 139,845,172円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 18,666,247円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用> | 211,766,744円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 5,884,198,589円   |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用> | 466,044,898円     |
| 合計                                 | 463,489,000,526円 |

(平成23年8月18日現在)

## 本半期報告書における開示対象ファンドの

|                   |                  |
|-------------------|------------------|
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 467,396,225,367円 |
| 同期中における追加設定元本額    | 18,982,364,741円  |
| 同期中における一部解約元本額    | 36,261,692,203円  |

## 平成23年8月18日現在における元本の内訳

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)             | 1,112,845,880円   |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)               | 2,055,919,768円   |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)             | 413,962,397円     |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)          | 66,719,318円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020            | 12,574,989円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025            | 5,619,676円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030            | 4,804,189円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035            | 2,281,351円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040            | 785,870円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045            | 1,787,512円       |
| SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>      | 9,728,151,927円   |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>       | 44,853,235,058円  |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>     | 11,753,362,903円  |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>       | 25,666,594,448円  |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>       | 543,103,573円     |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>       | 727,687,987円     |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>         | 169,183,835円     |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>       | 366,418,453円     |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>    | 121,465,528円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>    | 2,804,408,190円   |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>    | 3,180,228,852円   |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>       | 7,364,282,371円   |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>       | 19,777,620,714円  |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>         | 1,289,217,089円   |
| 三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 9,903,308,737円   |
| 三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)    | 63,860,900,166円  |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>      | 875,491,386円     |
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>       | 11,582,040,885円  |
| 三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)    | 203,114,874,627円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>  | 1,362,441,017円   |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>  | 323,550,784円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>  | 57,160,629円      |

|   |                  |
|---|------------------|
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >   | 4,248,852,131円   |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >   | 4,935,802,389円   |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >   | 4,048,927,442円   |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 1,482,694,228円   |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 287,268,414円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 32,613,030円      |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 749,057,100円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 10,239,473,464円  |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 > | 951,815,077円     |
| S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20V A < 適格機関投資家限定 >     | 24,452,590円      |
| S M A M ・ F G グローバルバランス25V A < 適格機関投資家限定 >      | 13,911,931円      |
| 合 計   | 450,116,897,905円 |

「外国株式インデックス・マザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

| 対象年月日    | (平成22年8月18日現在)  | (平成23年8月18日現在)  |
|----------|-----------------|-----------------|
| 科目       | 金額(円)           | 金額(円)           |
| 資産の部     |                 |                 |
| 流動資産     |                 |                 |
| 預金       | 434,917,665     | 832,908,165     |
| コール・ローン  | 161,560,362     | 2,150,341,089   |
| 株式       | 223,078,363,284 | 200,250,690,209 |
| 投資証券     | 4,080,788,371   | 3,771,423,523   |
| 派生商品評価勘定 | 2,373,629       | 56,057,456      |
| 未収入金     | 3,323,946       | 801,502,705     |
| 未収配当金    | 470,256,103     | 448,739,530     |
| 未収利息     | 221             | 2,945           |
| 差入委託証拠金  | 351,756,914     | 796,549,930     |
| 流動資産合計   | 228,583,340,495 | 209,108,215,552 |
| 資産合計     | 228,583,340,495 | 209,108,215,552 |
| 負債の部     |                 |                 |
| 流動負債     |                 |                 |
| 派生商品評価勘定 | 12,687,077      | 121,492,863     |
| 未払金      | -               | 2,125,560,930   |
| 未払解約金    | 1,037,174       | -               |
| 流動負債合計   | 13,724,251      | 2,247,053,793   |
| 負債合計     | 13,724,251      | 2,247,053,793   |
| 純資産の部    |                 |                 |
| 元本等      |                 |                 |
| 元本       |                 |                 |
| 元本       | 197,995,993,659 | 181,363,727,860 |
| 剰余金      |                 |                 |

|             |                 |                 |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 剰余金又は欠損金( ) | 30,573,622,585  | 25,497,433,899  |
| 元本等合計       | 228,569,616,244 | 206,861,161,759 |
| 純資産合計       | 228,569,616,244 | 206,861,161,759 |
| 負債純資産合計     | 228,583,340,495 | 209,108,215,552 |

(注)「外国株式インデックス・マザーファンド」は、毎年11月30日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。上記の貸借対照表は平成22年8月18日ならびに平成23年8月18日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                         | 自平成22年2月19日<br>至平成22年8月18日  | 自平成23年2月19日<br>至平成23年8月18日   |
|----------------------------|---|--|
| 1. 資産の評価基準及び評価方法           | <p>(1)株式、新株予約権証券および投資証券（売買目的有価証券）<br/>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、取引所もしくは店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。<br/>なお売買停止措置がとられている銘柄について、必要であると判断された場合は、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> <p>(2)先物取引<br/>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(3)為替予約取引<br/>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> | <p>(1)株式および投資証券（売買目的有価証券）<br/>同左</p> <p>(2)先物取引<br/>同左</p> <p>(3)為替予約取引<br/>同左</p> |
| 2. 収益及び費用の計上基準             | <p>受取配当金の計上基準<br/>受取配当金は原則として、配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>   | <p>受取配当金の計上基準<br/>同左</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<br/>「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>   | <p>外貨建資産等の会計処理<br/>同左</p>  |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目            | (平成22年8月18日現在)                             | (平成23年8月18日現在)                             |
|---------------|--|--|
| 1. 受益権総数      | 平成22年8月18日現在における受益権の総数<br>197,995,993,659口 | 平成23年8月18日現在における受益権の総数<br>181,363,727,860口 |
| 2. 1単位当たり純資産額 | 1.1544円<br>(1万口 = 11,544円)                 | 1.1406円<br>(1万口 = 11,406円)                 |

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

金融商品の時価等に関する事項

| 項目                 | (平成23年8月18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（株式および投資証券）<br/>「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br/>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<br/>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）

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

株式関連

（平成22年8月18日現在）

（単位：円）

| 区分   | 種類       | 契約額等                           |       | 時価                             | 評価損益                      |
|------|----------|--------------------------------|-------|--------------------------------|---------------------------|
|      |          |                                | うち1年超 |                                |                           |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 |                                |       |                                |                           |
|      | 買建       |                                |       |                                |                           |
|      | SP500    | 822,802,838<br>(9,623,425米ドル)  | ( )   | 814,782,937<br>(9,529,625米ドル)  | 8,019,901<br>( 93,800米ドル) |
|      | DJ EUR   | 331,299,141<br>(3,013,180ユーロ)  | ( )   | 327,897,288<br>(2,982,240ユーロ)  | 3,401,853<br>( 30,940ユーロ) |
|      | FTSE     | 169,376,642<br>(1,273,030英ポンド) | ( )   | 170,484,948<br>(1,281,360英ポンド) | 1,108,306<br>(8,330英ポンド)  |

|  |       |               |               |            |
|--|-------|---------------|---------------|------------|
|  |       |               |               |            |
|  | 買建 合計 | 1,323,478,621 | 1,313,165,173 | 10,313,448 |

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

## 通貨関連

(平成22年 8月18日現在)

平成22年 8月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

(平成23年 8月18日現在)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

(単位：円)

| 区分   | 種類       | 契約額等                             |       | 時価                               | 評価損益                        |
|------|----------|----------------------------------|-------|----------------------------------|-----------------------------|
|      |          |                                  | うち1年超 |                                  |                             |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 |                                  |       |                                  |                             |
|      | 買建       |                                  |       |                                  |                             |
|      | SP500    | 2,078,699,705<br>(27,105,225米ドル) | ( )   | 2,053,202,197<br>(26,772,750米ドル) | 25,497,508<br>( 332,475米ドル) |
|      | DJ EUR   | 827,988,857<br>(7,493,790ユーロ)    | ( )   | 792,920,436<br>(7,176,400ユーロ)    | 35,068,421<br>( 317,390ユーロ) |
|      | FTSE     | 417,294,681<br>(3,294,345英ポンド)   | ( )   | 411,842,171<br>(3,251,300英ポンド)   | 5,452,510<br>( 43,045英ポンド)  |
|      | 買建 合計    | 3,323,983,243                    |       | 3,257,964,804                    | 66,018,439                  |

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

## 通貨関連

(単位：円)

| 区分    | 種類         | 契約額等          |       | 時価            | 評価損益      |
|-------|------------|---------------|-------|---------------|-----------|
|       |            |               | うち1年超 |               |           |
| 市場外取引 | 為替予約取引     |               |       |               |           |
|       | 買建         |               |       |               |           |
|       | 米ドル        | 1,588,409,830 | -     | 1,586,746,936 | 1,662,894 |
|       | カナダドル      | 120,744,467   | -     | 120,750,651   | 6,184     |
|       | ユーロ        | 402,075,822   | -     | 402,410,271   | 334,449   |
|       | 英ポンド       | 323,755,677   | -     | 324,633,878   | 878,201   |
|       | スイスフラン     | 84,509,790    | -     | 84,782,408    | 272,618   |
|       | スウェーデンクローナ | 28,333,398    | -     | 28,597,135    | 263,737   |
|       | ノルウェークローネ  | 6,365,115     | -     | 6,406,168     | 41,053    |
|       | デンマーククローネ  | 9,416,363     | -     | 9,423,039     | 6,676     |
|       | オーストラリアドル  | 86,705,350    | -     | 87,181,237    | 475,887   |
|       | ニュージーランドドル | 5,541,428     | -     | 5,555,116     | 13,688    |
|       | シンガポールドル   | 17,490,116    | -     | 17,443,549    | 46,567    |
|       | 買建 合計      | 2,673,347,356 | -     | 2,673,930,388 | 583,032   |

### (注) 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法について

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(その他の注記)

| (平成22年8月18日現在)                     |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 本半期報告書における開示対象ファンドの                |                  |
| 期首における当該親投資信託の元本額                  | 194,883,523,384円 |
| 同期中における追加設定元本額                     | 12,451,821,196円  |
| 同期中における一部解約元本額                     | 9,339,350,921円   |
| 平成22年8月18日現在における元本の内訳              |                  |
| 三井住友・DC外国株式インデックスファンドS             | 2,449,948,197円   |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)             | 150,758,544円     |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)               | 692,724,655円     |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)             | 417,152,878円     |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)          | 9,303,069円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020            | 1,794,995円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025            | 336,597円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030            | 2,597,460円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035            | 375,397円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040            | 483,391円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045            | 883,580円         |
| 外国株式指数ファンド                         | 124,318,550円     |
| SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)      | 41,337,661,455円  |
| バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>       | 498,688,015円     |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>    | 23,601,143,304円  |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>       | 11,006,288,093円  |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>     | 6,853,311,866円   |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>       | 26,371,750,851円  |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>       | 85,483,365円      |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>       | 362,802,898円     |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>         | 74,568,328円      |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>       | 2,727,794,953円   |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>    | 176,063,358円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>    | 685,547,504円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>    | 3,580,095,351円   |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>       | 4,697,678,017円   |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>       | 8,756,093,513円   |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>         | 1,273,386,709円   |
| 三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 3,561,930,694円   |
| 三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)    | 10,214,436,734円  |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>      | 649,907,423円     |

|                                   |                  |
|-----------------------------------|------------------|
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>      | 2,839,203,373円   |
| 三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)   | 43,116,527,416円  |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 96,669,315円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 60,672,123円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 24,434,391円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 294,950,687円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 660,909,518円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用> | 537,317,092円     |
| 合計                                | 197,995,993,659円 |

(平成23年8月18日現在)

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 本半期報告書における開示対象ファンドの                |                  |
| 期首における当該親投資信託の元本額                  | 180,122,951,127円 |
| 同期中における追加設定元本額                     | 14,365,985,014円  |
| 同期中における一部解約元本額                     | 13,125,208,281円  |
| 平成23年8月18日現在における元本の内訳              |                  |
| 三井住友・DC外国株式インデックスファンドS             | 3,677,685,876円   |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)             | 174,082,220円     |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)               | 751,193,849円     |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)             | 472,875,003円     |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)          | 12,545,673円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020            | 1,977,661円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025            | 1,482,340円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030            | 2,784,262円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035            | 1,743,710円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040            | 749,697円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045            | 2,425,336円       |
| 外国株式指数ファンド                         | 201,843,941円     |
| 三井住友・DC全海外株式インデックスファンド             | 613,025円         |
| SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)      | 38,610,795,668円  |
| バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>      | 341,825,865円     |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>   | 20,810,871,058円  |
| SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>      | 9,994,489,720円   |
| SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>    | 5,799,759,302円   |
| SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>      | 24,106,833,837円  |
| SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>      | 84,344,553円      |
| SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>      | 349,492,706円     |
| 世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>        | 64,038,642円      |
| SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>      | 2,592,160,137円   |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型 <適格機関投資家限定>   | 175,549,030円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>   | 595,201,234円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>   | 3,110,948,055円   |
| SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>      | 4,151,503,877円   |
| SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>      | 7,233,829,625円   |
| SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>        | 1,216,698,894円   |
| 三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 3,495,697,519円   |
| 三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)    | 9,614,606,481円   |
| SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>     | 645,651,793円     |

|                                   |                  |
|-----------------------------------|------------------|
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>      | 2,449,995,596円   |
| 三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)   | 39,143,524,395円  |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用> | 89,106,010円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用> | 54,689,203円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用> | 20,691,180円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用> | 249,482,989円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用> | 553,676,733円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用> | 471,335,544円     |
| SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>  | 22,687,017円      |
| SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>   | 12,238,604円      |
| 合計                                | 181,363,727,860円 |

「外国債券パッシブ・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 対象年月日       | (平成22年8月18日現在)  | (平成23年8月18日現在)  |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 科目          | 金額(円)           | 金額(円)           |
| 資産の部        |                 |                 |
| 流動資産        |                 |                 |
| 預金          | 1,436,800,381   | 838,896,504     |
| コール・ローン     | 790,980,806     | 1,733,535,156   |
| 国債証券        | 249,128,344,773 | 248,371,255,273 |
| 未収入金        | -               | 433,562,123     |
| 未収利息        | 2,542,889,629   | 2,550,783,162   |
| 前払費用        | 130,314,114     | 172,839,549     |
| 流動資産合計      | 254,029,329,703 | 254,100,871,767 |
| 資産合計        | 254,029,329,703 | 254,100,871,767 |
| 負債の部        |                 |                 |
| 流動負債        |                 |                 |
| 未払解約金       | 70,266,000      | 234,790,189     |
| 流動負債合計      | 70,266,000      | 234,790,189     |
| 負債合計        | 70,266,000      | 234,790,189     |
| 純資産の部       |                 |                 |
| 元本等         |                 |                 |
| 元本          |                 |                 |
| 元本          | 222,995,610,494 | 227,133,198,373 |
| 剰余金         |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 30,963,453,209  | 26,732,883,205  |
| 元本等合計       | 253,959,063,703 | 253,866,081,578 |
| 純資産合計       | 253,959,063,703 | 253,866,081,578 |
| 負債純資産合計     | 254,029,329,703 | 254,100,871,767 |

(注) 「外国債券パッシブ・マザーファンド」は、毎年12月17日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成22年8月18日ならびに平成23年8月18日現在における同マザーファン

ドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                         | 自平成22年2月19日<br>至平成22年8月18日  | 自平成23年2月19日<br>至平成23年8月18日                     |
|----------------------------|---|--|
| 1. 資産の評価基準及び評価方法           | (1)国債証券（売買目的有価証券）<br>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。<br><br>(2)為替予約取引<br>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。 | (1)国債証券（売買目的有価証券）<br>同左<br><br>(2)為替予約取引<br>同左 |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。   | 外貨建資産等の会計処理<br>同左                              |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目            | (平成22年8月18日現在)                             | (平成23年8月18日現在)                             |
|---------------|--|--|
| 1. 受益権総数      | 平成22年8月18日現在における受益権の総数<br>222,995,610,494口 | 平成23年8月18日現在における受益権の総数<br>227,133,198,373口 |
| 2. 1単位当たり純資産額 | 1.1389円<br>(1万口 = 11,389円)                 | 1.1177円<br>(1万口 = 11,177円)                 |

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

金融商品の時価等に関する事項

| 項目                 | (平成23年8月18日現在)                                     |
|--------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。 |

|            |   |
|------------|---|
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券(国債証券)<br/>「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)<br/>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<br/>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)

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

(平成22年8月18日現在)

平成22年8月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

(平成23年8月18日現在)

平成23年8月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

(その他の注記)

| (平成22年8月18日現在)                     |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 本半期報告書における開示対象ファンドの                |                  |
| 期首における当該親投資信託の元本額                  | 215,320,683,575円 |
| 同期中における追加設定元本額                     | 10,378,662,568円  |
| 同期中における一部解約元本額                     | 2,703,735,649円   |
| 平成22年8月18日現在における元本の内訳              |                  |
| 三井住友・DC外国債券インデックスファンドS             | 1,818,539,882円   |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)             | 155,809,468円     |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)               | 480,460,223円     |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)             | 214,847,158円     |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)          | 10,056,280円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020            | 3,691,875円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025            | 477,916円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030            | 2,490,237円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035            | 339,071円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040            | 406,734円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045            | 547,440円         |
| SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>    | 5,463,895,000円   |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>    | 12,437,485,146円  |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>       | 40,399,218,242円  |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>     | 13,193,654,111円  |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>       | 27,385,692,229円  |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>       | 88,572,092円      |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>       | 187,150,487円     |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>         | 52,168,082円      |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>       | 1,419,215,125円   |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>    | 182,967,297円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>    | 2,574,785,715円   |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>    | 3,605,129,744円   |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>       | 7,314,529,946円   |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>       | 18,294,539,556円  |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>         | 1,326,231,064円   |
| SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>     | 10,870,539,378円  |
| 三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 2,243,739,836円   |
| 三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)    | 10,662,848,200円  |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>      | 449,915,955円     |
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>       | 11,874,429,578円  |

|  |                  |
|--|------------------|
| 三井住友・7資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )             | 45,368,796,242円  |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >   | 307,271,174円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >   | 92,456,501円      |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >   | 25,536,346円      |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >   | 459,835,978円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >   | 1,614,491,151円   |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >   | 412,686,658円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 165,848,985円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 40,734,885円      |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 7,768,103円       |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 1,739,001,078円   |
| S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 > | 46,810,326円      |
| 合 計  | 222,995,610,494円 |

(平成23年8月18日現在)

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 本半期報告書における開示対象ファンドの                |                  |
| 期首における当該親投資信託の元本額                  | 232,040,596,375円 |
| 同期中における追加設定元本額                     | 8,989,842,238円   |
| 同期中における一部解約元本額                     | 13,897,240,240円  |
| 平成23年8月18日現在における元本の内訳              |                  |
| 三井住友・DC外国債券インデックスファンドS             | 2,519,020,953円   |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)             | 203,282,506円     |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)               | 588,635,078円     |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)             | 277,182,720円     |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)          | 21,905,687円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020            | 4,142,870円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025            | 2,666,792円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030            | 3,257,776円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035            | 1,819,333円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040            | 725,968円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045            | 1,588,053円       |
| S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 5,451,829,590円   |
| S M A M・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定> | 12,348,074,686円  |
| S M A M・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>    | 39,072,981,165円  |
| S M A M・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>  | 12,599,506,725円  |
| S M A M・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>    | 25,450,463,008円  |
| S M A M・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>    | 92,440,009円      |
| S M A M・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>    | 191,013,527円     |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>         | 49,321,111円      |
| S M A M・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>    | 1,348,280,384円   |
| S M A M・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定> | 179,124,502円     |
| S M A M・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 2,454,406,217円   |
| S M A M・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 3,167,068,163円   |
| S M A M・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>    | 7,303,100,841円   |
| S M A M・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>    | 16,890,570,704円  |
| S M A M・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>      | 1,281,806,641円   |
| S M A M・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>  | 18,521,418,602円  |
| 三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 2,159,877,011円   |
| 三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)    | 10,829,464,221円  |
| S M A M・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>   | 437,986,058円     |
| S M A M・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>    | 11,514,183,258円  |

|   |                  |
|---|------------------|
| 三井住友・7資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )            | 45,481,367,205円  |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >   | 316,262,074円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >   | 96,999,295円      |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >   | 24,478,086円      |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >   | 443,512,372円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >   | 1,525,827,102円   |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >   | 418,032,611円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 340,975,715円     |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 85,966,040円      |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 13,929,887円      |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 3,114,979,416円   |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 > | 98,348,002円      |
| S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20 V A < 適格機関投資家限定 >    | 149,130,265円     |
| S M A M ・ F G グローバルバランス25 V A < 適格機関投資家限定 >     | 56,246,144円      |
| 合 計   | 227,133,198,373円 |

## 2【ファンドの現況】

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

### 【純資産額計算書】

#### a. 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)

|                | 平成23年9月30日現在    |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 2,200,835,975 円 |
| 負債総額           | 1,193,886 円     |
| 純資産総額( - )     | 2,199,642,089 円 |
| 発行済口数          | 2,318,052,873 口 |
| 1口当たり純資産額( / ) | 0.9489 円        |
| ( 1万口当たり純資産額   | 9,489 円)        |

#### b. 三井住友・DC年金バランス50(標準型)

|                | 平成23年9月30日現在    |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 6,220,719,649 円 |
| 負債総額           | 3,618,034 円     |
| 純資産総額( - )     | 6,217,101,615 円 |
| 発行済口数          | 7,304,809,540 口 |
| 1口当たり純資産額( / ) | 0.8511 円        |
| ( 1万口当たり純資産額   | 8,511 円)        |

#### c. 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

|                | 平成23年9月30日現在    |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 2,856,351,936 円 |
| 負債総額           | 955,300 円       |
| 純資産総額( - )     | 2,855,396,636 円 |
| 発行済口数          | 3,800,413,127 口 |
| 1口当たり純資産額( / ) | 0.7513 円        |
| ( 1万口当たり純資産額   | 7,513 円)        |



## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### <訂正前>

イ 資本金の額および株式数

|              | 平成23年3月31日現在 |
|--------------|--------------|
| 資本金の額        | 2,000百万円     |
| 会社が発行する株式の総数 | 60,000株      |
| 発行済株式総数      | 17,640株      |

( 略 )

##### <訂正後>

イ 資本金の額および株式数

|              | 平成23年9月30日現在 |
|--------------|--------------|
| 資本金の額        | 2,000百万円     |
| 会社が発行する株式の総数 | 60,000株      |
| 発行済株式総数      | 17,640株      |

( 略 )

## 2【事業の内容及び営業の概況】

### <訂正前>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成23年3月31日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成23年3月31日現在、単位：百万円）

|         |     | 本数                  | 純資産総額                           |
|---------|-----|---------------------|---------------------------------|
| 株式投資信託  | 単位型 | $\frac{61}{(1)}$    | $\frac{115,301}{(209)}$         |
|         | 追加型 | $\frac{264}{(128)}$ | $\frac{4,960,570}{(3,198,656)}$ |
|         | 計   | $\frac{325}{(129)}$ | $\frac{5,075,871}{(3,198,865)}$ |
| 公社債投資信託 | 単位型 | $\frac{0}{(0)}$     | $\frac{0}{(0)}$                 |
|         | 追加型 | $\frac{0}{(0)}$     | $\frac{0}{(0)}$                 |
|         | 計   | $\frac{0}{(0)}$     | $\frac{0}{(0)}$                 |
| 合計      |     | $\frac{325}{(129)}$ | $\frac{5,075,871}{(3,198,865)}$ |

（ ）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

### <訂正後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成23年9月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成23年9月30日現在、単位：百万円）

|         |     | 本数                  | 純資産総額                           |
|---------|-----|---------------------|---------------------------------|
| 株式投資信託  | 単位型 | $\frac{49}{(1)}$    | $\frac{60,566}{(161)}$          |
|         | 追加型 | $\frac{289}{(131)}$ | $\frac{4,446,709}{(2,944,862)}$ |
|         | 計   | $\frac{338}{(132)}$ | $\frac{4,507,275}{(2,945,023)}$ |
| 公社債投資信託 | 単位型 | $\frac{0}{(0)}$     | $\frac{0}{(0)}$                 |
|         | 追加型 | $\frac{0}{(0)}$     | $\frac{0}{(0)}$                 |
|         | 計   | $\frac{0}{(0)}$     | $\frac{0}{(0)}$                 |
| 合計      |     | $\frac{338}{(132)}$ | $\frac{4,507,275}{(2,945,023)}$ |

（ ）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

### 3【委託会社等の経理状況】

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

- 1 当社の財務諸表は、第25期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しており、第26期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）については、改正後の「財務諸表等規則」並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、第25期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、あずさ監査法人の監査を受けており、第26期（平成22年4月1日から平成23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。  
なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年7月1日付をもって、名称を有限責任 あずさ監査法人に変更しております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

|            |   | 第 25 期<br>(平成22年3月31日現在) | 第 26 期<br>(平成23年3月31日現在) |
|------------|---|--------------------------|--------------------------|
| (資産の部)     |   |                          |                          |
| 流動資産       |   |                          |                          |
| 現金及び預金     | 2 | 15,484,883               | 17,127,600               |
| 有価証券       |   | 2,999,185                | 3,999,722                |
| 前払費用       |   | 248,594                  | 264,910                  |
| 未収入金       |   | 6,524                    | 607,623                  |
| 未収委託者報酬    |   | 3,405,895                | 3,712,698                |
| 未収運用受託報酬   |   | 456,672                  | 326,523                  |
| 未収投資助言報酬   | 2 | 426,716                  | 412,606                  |
| 未収収益       |   | 7,020                    | 27,051                   |
| 繰延税金資産     |   | 244,770                  | 241,975                  |
| その他の流動資産   |   | 1,392                    | 1,299                    |
| 流動資産計      |   | 23,281,654               | 26,722,012               |
| 固定資産       |   |                          |                          |
| 有形固定資産     |   |                          |                          |
| 建物         | 1 | 173,574                  | 148,698                  |
| 器具備品       |   | 150,631                  | 232,209                  |
| 有形固定資産合計   |   | 324,206                  | 380,907                  |
| 無形固定資産     |   |                          |                          |
| 電話加入権      | 1 | 150                      | 138                      |
| 商標権        |   | 6,160                    | 4,216                    |
| 無形固定資産合計   |   | 6,310                    | 4,354                    |
| 投資その他の資産   |   |                          |                          |
| 投資有価証券     |   | 6,923,150                | 4,980,828                |
| 関係会社株式     |   | 236,178                  | 234,921                  |
| 長期差入保証金    |   | 681,764                  | 681,432                  |
| 長期前払費用     |   | 7,822                    | 10,561                   |
| 会員権        |   | 20,113                   | 20,113                   |
| 繰延税金資産     |   | 524,820                  | 606,449                  |
| 投資その他の資産合計 |   | 8,393,850                | 6,534,307                |
| 固定資産計      |   | 8,724,367                | 6,919,569                |
| 資産合計       |   | 32,006,022               | 33,641,581               |

|              | 第 25 期<br>(平成22年 3月31日現在) | 第 26 期<br>(平成23年 3月31日現在) |
|--------------|---------------------------|---------------------------|
| (負債の部)       |                           |                           |
| 流動負債         |                           |                           |
| 預り金          | 46,362                    | 47,190                    |
| 未払金          |                           |                           |
| 未払収益分配金      | 943                       | 681                       |
| 未払償還金        | 18,453                    | 21,638                    |
| 未払手数料        | 2 1,523,402               | 1,971,626                 |
| その他未払金       | 71,728                    | 64,551                    |
| 未払費用         | 869,497                   | 824,240                   |
| 未払消費税等       | 74,053                    | 126,666                   |
| 未払法人税等       | 1,264,485                 | 1,004,164                 |
| 賞与引当金        | 293,651                   | 327,914                   |
| 流動負債計        | 4,162,578                 | 4,388,674                 |
| 固定負債         |                           |                           |
| 退職給付引当金      | 1,137,766                 | 1,310,821                 |
| 固定負債計        | 1,137,766                 | 1,310,821                 |
| 負債合計         | 5,300,344                 | 5,699,496                 |
| (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      | 14,172,932                | 15,381,398                |
| 利益剰余金合計      | 15,994,137                | 17,202,602                |
| 株主資本計        | 26,623,121                | 27,831,586                |
| 評価・換算差額等     |                           |                           |
| その他有価証券評価差額金 | 82,556                    | 110,498                   |
| 評価・換算差額等計    | 82,556                    | 110,498                   |
| 純資産合計        | 26,705,677                | 27,942,085                |
| 負債・純資産合計     | 32,006,022                | 33,641,581                |

## （２）【損益計算書】

（単位：千円）

|                 | 第 25 期<br>（自 平成21年 4 月 1 日<br>至 平成22年 3 月31日） | 第 26 期<br>（自 平成22年 4 月 1 日<br>至 平成23年 3 月31日） |
|-----------------|---|---|
| 営業収益            |   |   |
| 委託者報酬           | 21,113,167                                    | 27,350,519                                    |
| 運用受託報酬          | 2,492,177                                     | 2,113,027                                     |
| 投資助言報酬          | 1,893,038                                     | 1,828,087                                     |
| その他営業収益         |   |   |
| 情報提供コンサルタント業務報酬 | 5,000   | 5,000   |
| 投資法人運用受託報酬      | 43,853  | 35,635  |
| サービス支援手数料       | -   | 234,885                                       |
| その他             | 12,348  | 26,930  |
| 営業収益計           | 25,559,586                                    | 31,594,086                                    |
| 営業費用            |   |   |
| 支払手数料           | 9,706,627                                     | 14,161,927                                    |
| 広告宣伝費           | 420,508                                       | 482,728                                       |
| 公告費             | 2,339   | 4,634   |
| 調査費             |   |   |
| 調査費             | 579,477                                       | 537,254                                       |
| 委託調査費           | 1,556,961                                     | 2,115,042                                     |
| 営業雑経費           |   |   |
| 通信費             | 31,515  | 34,433  |
| 印刷費             | 278,539                                       | 266,803                                       |
| 協会費             | 19,271  | 23,235  |
| 諸会費             | 12,955  | 11,346  |
| 情報機器関連費         | 2,005,507                                     | 2,066,205                                     |
| 販売促進費           | 13,183  | 27,670  |
| その他             | 66,833  | 79,571  |
| 営業費用計           | 14,693,722                                    | 19,810,852                                    |
| 一般管理費           |   |   |
| 給料              |   |   |
| 役員報酬            | 155,835                                       | 155,867                                       |
| 給料・手当           | 4,192,414                                     | 4,342,937                                     |
| 賞与              | 719,290                                       | 983,434                                       |
| 賞与引当金繰入額        | 293,651                                       | 327,914                                       |
| 交際費             | 19,087  | 21,460  |
| 寄付金             | 23  | 31  |
| 事務委託費           | 195,150                                       | 220,738                                       |
| 旅費交通費           | 197,842                                       | 219,278                                       |
| 租税公課            | 86,095  | 87,674  |
| 不動産賃借料          | 714,209                                       | 677,468                                       |
| 退職給付費用          | 197,352                                       | 199,545                                       |
| 固定資産減価償却費       | 97,916  | 100,356                                       |
| 諸経費             | 280,916                                       | 250,817                                       |
| 一般管理費計          | 7,149,786                                     | 7,587,526                                     |

営業利益

3,716,077

4,195,707

|                |   |           |           |
|----------------|---|-----------|-----------|
| 営業外収益          |   |           |           |
| 受取配当金          |   | 1,710     | 34,115    |
| 有価証券利息         |   | 4,645     | 3,603     |
| 受取利息           | 1 | 16,592    | 7,877     |
| 為替差益           |   | -         | 4,753     |
| 時効成立分配金・償還金    |   | 3,492     | 3,076     |
| 原稿・講演料         |   | 3,255     | 3,485     |
| 還付加算金          |   | 37,708    | 1,645     |
| 雑収入            |   | 6,291     | 7,033     |
| 営業外収益計         |   | 73,696    | 65,590    |
| 営業外費用          |   |           |           |
| 為替差損           |   | 5,113     | -         |
| 時効成立後支払分配金・償還金 |   | -         | 659       |
| 営業外費用計         |   | 5,113     | 659       |
| 経常利益           |   | 3,784,660 | 4,260,638 |
| 特別利益           |   |           |           |
| 投資有価証券償還益      |   | 2,459     | 7         |
| 投資有価証券売却益      |   | 31,117    | 71,400    |
| 特別利益計          |   | 33,577    | 71,407    |
| 特別損失           |   |           |           |
| 固定資産除却損        | 2 | 5,302     | 17,318    |
| 投資有価証券償還損      |   | -         | 2,679     |
| 投資有価証券評価損      |   | 51,557    | -         |
| 投資有価証券売却損      |   | 2,724     | 20,822    |
| 関係会社株式評価損      |   | -         | 1,256     |
| 特別損失計          |   | 59,583    | 42,077    |
| 税引前当期純利益       |   | 3,758,653 | 4,289,968 |
| 法人税、住民税及び事業税   |   | 1,817,726 | 1,852,053 |
| 法人税等調整額        |   | 722,069   | 93,549    |
| 法人税等合計         |   | 1,095,656 | 1,758,503 |
| 当期純利益          |   | 2,662,997 | 2,531,465 |

## （ 3 ） 【 株主資本等変動計算書 】

（ 単位：千円 ）

|          | 第 25 期<br>（ 自 平成21年 4 月 1 日<br>至 平成22年 3 月31日 ） | 第 26 期<br>（ 自 平成22年 4 月 1 日<br>至 平成23年 3 月31日 ） |
|----------|---|---|
| 株主資本     |   |   |
| 資本金      |   |   |
| 前期末残高    | 2,000,000                                       | 2,000,000                                       |
| 当期末残高    | 2,000,000                                       | 2,000,000                                       |
| 資本剰余金    |   |   |
| 資本準備金    |   |   |
| 前期末残高    | 8,628,984                                       | 8,628,984                                       |
| 当期末残高    | 8,628,984                                       | 8,628,984                                       |
| 資本剰余金合計  |   |   |
| 前期末残高    | 8,628,984                                       | 8,628,984                                       |
| 当期末残高    | 8,628,984                                       | 8,628,984                                       |
| 利益剰余金    |   |   |
| 利益準備金    |   |   |
| 前期末残高    | 284,245   | 284,245   |
| 当期末残高    | 284,245   | 284,245   |
| その他利益剰余金 |   |   |
| 配当準備積立金  |   |   |
| 前期末残高    | 60,000  | 60,000  |
| 当期末残高    | 60,000  | 60,000  |
| 別途積立金    |   |   |
| 前期末残高    | 1,476,959                                       | 1,476,959                                       |
| 当期末残高    | 1,476,959                                       | 1,476,959                                       |
| 繰越利益剰余金  |   |   |
| 前期末残高    | 12,356,655                                      | 14,172,932                                      |
| 当期変動額    |   |   |
| 剰余金の配当   | 846,720   | 1,323,000                                       |
| 当期純利益    | 2,662,997                                       | 2,531,465                                       |
| 当期変動額合計  | 1,816,277                                       | 1,208,465                                       |
| 当期末残高    | 14,172,932                                      | 15,381,398                                      |
| 利益剰余金合計  |   |   |
| 前期末残高    | 14,177,860                                      | 15,994,137                                      |
| 当期変動額    |   |   |
| 剰余金の配当   | 846,720   | 1,323,000                                       |
| 当期純利益    | 2,662,997                                       | 2,531,465                                       |
| 当期変動額合計  | 1,816,277                                       | 1,208,465                                       |
| 当期末残高    | 15,994,137                                      | 17,202,602                                      |
| 株主資本合計   |   |   |
| 前期末残高    | 24,806,844                                      | 26,623,121                                      |
| 当期変動額    |   |   |
| 剰余金の配当   | 846,720   | 1,323,000                                       |
| 当期純利益    | 2,662,997                                       | 2,531,465                                       |

|         |            |            |
|---------|------------|------------|
| 当期変動額合計 | 1,816,277  | 1,208,465  |
| 当期末残高   | 26,623,121 | 27,831,586 |

|                     |            |            |
|---------------------|------------|------------|
| 評価・換算差額等            |            |            |
| その他有価証券評価差額金        |            |            |
| 前期末残高               | 5,805      | 82,556     |
| 当期変動額               |            |            |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 88,361     | 27,941     |
| 当期変動額合計             | 88,361     | 27,941     |
| 当期末残高               | 82,556     | 110,498    |
| 評価・換算差額合計           |            |            |
| 前期末残高               | 5,805      | 82,556     |
| 当期変動額               |            |            |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 88,361     | 27,941     |
| 当期変動額合計             | 88,361     | 27,941     |
| 当期末残高               | 82,556     | 110,498    |
| 純資産合計               |            |            |
| 前期末残高               | 24,801,038 | 26,705,677 |
| 当期変動額               |            |            |
| 剰余金の配当              | 846,720    | 1,323,000  |
| 当期純利益               | 2,662,997  | 2,531,465  |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 88,361     | 27,941     |
| 当期変動額合計             | 1,904,639  | 1,236,407  |
| 当期末残高               | 26,705,677 | 27,942,085 |

## 重要な会計方針

| 項目   | 第25期<br>(自平成21年4月1日<br>至平成22年3月31日)   | 第26期<br>(自平成22年4月1日<br>至平成23年3月31日)  |
|--|---|--|
| 1 有価証券の評価基準及び評価方法                          | <p>満期保有目的の債券<br/>償却原価法</p> <p>子会社株式及び関連会社株式<br/>移動平均法による原価法</p> <p>その他有価証券<br/>時価のあるもの<br/>決算日の市場価格等に基づく時価法<br/>(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)</p> <p>時価のないもの<br/>移動平均法による原価法</p>  | <p>満期保有目的の債券<br/>同左</p> <p>子会社株式及び関連会社株式<br/>同左</p> <p>その他有価証券<br/>時価のあるもの<br/>同左</p> <p>時価のないもの<br/>同左</p>                                      |
| 2 固定資産の減価償却の方法                             | <p>有形固定資産<br/>定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)については、定額法によっております。<br/>なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <p>建物 3～50年<br/>器具備品 3～20年</p> <p>無形固定資産<br/>定額法によっております。</p>   | <p>有形固定資産<br/>同左</p> <p>無形固定資産<br/>同左</p>  |
| 3 引当金の計上基準<br>(1) 賞与引当金<br><br>(2) 退職給付引当金 | <p>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。</p> <p>従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき計上しております。<br/>過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。<br/>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。<br/>(会計方針の変更)<br/>当事業年度より、「退職給付に係る会計基準」の一部改正(その3)(企業会計基準第19号平成20年7月31日)を適用しております。この変更が当事業年度の損益に与える影響はありません。また、本会計基準の適用に伴い発生する退職給付債務の差額はありませぬ。</p> | <p>同左</p> <p>従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき計上しております。<br/>過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。<br/>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。</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                  | 消費税等の会計処理は税抜方式によっております。   | 同左   |

## 会計方針の変更

(会計処理の変更)

| 第25期<br>(自平成21年4月1日<br>至平成22年3月31日) | 第26期<br>(自平成22年4月1日<br>至平成23年3月31日)  |
|-------------------------------------|--|
| -                                   | <p>資産除去債務に関する会計基準</p> <p>企業会計基準第18号「資産除去債務に関する会計基準」（平成20年3月31日 企業会計基準委員会）及び企業会計基準適用指針第21号「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（同前）が平成22年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当事業年度から同会計基準及び適用指針を適用しております。</p> <p>これによる損益の影響はありません。</p> |

## 注記事項

(貸借対照表関係)

| 第25期<br>(平成22年3月31日現在)   | 第26期<br>(平成23年3月31日現在)   |
|--|--|
| <p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建 物 172,855千円</p> <p>器具備品 863,358千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>電話加入権 83千円</p> <p>商標権 13,282千円</p>   | <p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建 物 191,415千円</p> <p>器具備品 774,482千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>電話加入権 95千円</p> <p>商標権 15,226千円</p>   |
| <p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p>現金及び預金 10,591,647千円</p> <p>未収投資助言報酬 295,911千円</p> <p>未払手数料 441,536千円</p>  | <p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p>現金及び預金 11,201,422千円</p> <p>未収投資助言報酬 293,061千円</p> <p>未払手数料 469,104千円</p>  |
| <p>3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。</p> <p>当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。</p> <p>当座貸越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p>借入実行残高 - 千円</p> <p>差引額 10,000,000千円</p> | <p>3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。</p> <p>当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。</p> <p>当座貸越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p>借入実行残高 - 千円</p> <p>差引額 10,000,000千円</p> |
| <p>4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額102,815千円の支払保証を行っております。</p>   | <p>4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額74,617千円の支払保証を行っております。</p>  |

## （損益計算書関係）

| 第25期<br>(自平成21年4月1日<br>至平成22年3月31日) | 第26期<br>(自平成22年4月1日<br>至平成23年3月31日)   |
|-------------------------------------|---------------------------------------|
| 1 関係会社との取引に係るもの<br>受取利息 5,916千円     | 1 関係会社との取引に係るもの<br>受取利息 3,867千円       |
| 2 固定資産除却損は、器具備品5,302千円であります。        | 2 固定資産除却損は、建物9,847千円、器具備品7,471千円あります。 |

## （株主資本等変動計算書関係）

第25期(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

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

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

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

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

第26期(自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

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

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

平成23年6月24日開催の第26回定時株主総会において次の通り付議いたします。

| 決議                   | 株式の種類 | 配当の原資 | 配当金の総額<br>(千円) | 一株当たり<br>配当額(円) | 基準日            | 効力発生日          |
|----------------------|-------|-------|----------------|-----------------|----------------|----------------|
| 平成23年6月24日<br>定時株主総会 | 普通株式  | 利益剰余金 | 1,252,440      | 71,000          | 平成23年<br>3月31日 | 平成23年<br>6月27日 |

## (リース取引関係)

| 第25期<br>(自平成21年4月1日<br>至平成22年3月31日)   | 第26期<br>(自平成22年4月1日<br>至平成23年3月31日)   |
|---|---|
| 1.オペレーティング・リース取引<br>(借主側)<br>未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円)<br>1年以内 667,234<br>1年超 1,608,004<br>合計 2,275,239 | 1.オペレーティング・リース取引<br>(借主側)<br>未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円)<br>1年以内 672,700<br>1年超 958,593<br>合計 1,631,293 |

## (金融商品関係)

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

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

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

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

## 市場リスクの管理

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：千円）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収投資助言報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券については業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

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

(6) 長期差入保証金

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

負 債

(1) 未払金

未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

| 区分           | 1年以内       | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|--------------|------------|---------|----------|------|
| 現金及び預金       | 15,484,883 | -       | -        | -    |
| 未収委託者報酬      | 3,405,895  | -       | -        | -    |
| 未収運用受託報酬     | 456,672    | -       | -        | -    |
| 未収投資助言報酬     | 426,716    | -       | -        | -    |
| 有価証券及び投資有価証券 |            |         |          |      |
| 満期保有目的の債券    | 3,000,000  | -       | -        | -    |
| その他有価証券のうち   |            |         |          |      |
| 満期があるもの      | -          | -       | -        | -    |
| 長期差入保証金      | 2,289      | 679,475 | -        | -    |
| 合計           | 22,776,457 | 679,475 | -        | -    |

(追加情報)

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

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### (1) 金融商品に対する取組方針

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

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスクの管理

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

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

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

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

#### 市場リスクの管理

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

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

### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません（（注2）参照）。

（単位：千円）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収投資助言報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券については業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

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

(6) 長期差入保証金

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

負債

(1) 未払金

未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

|         | 貸借対照表計上額 |
|---------|----------|
| その他有価証券 |          |
| 非上場株式   | 298      |
| 投資証券    | 48,443   |
| 合計      | 48,741   |
| 子会社株式   |          |
| 非上場株式   | 234,921  |
| 合計      | 234,921  |

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(5) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。また、上記の表中にある「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、1,256千円です。

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

| 区分           | 1年以内       | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|--------------|------------|---------|----------|------|
| 現金及び預金       | 17,127,600 | -       | -        | -    |
| 未収委託者報酬      | 3,712,698  | -       | -        | -    |
| 未収運用受託報酬     | 326,523    | -       | -        | -    |
| 未収投資助言報酬     | 412,606    | -       | -        | -    |
| 有価証券及び投資有価証券 |            |         |          |      |
| 満期保有目的の債券    | 4,000,000  | -       | -        | -    |
| その他有価証券のうち   |            |         |          |      |
| 満期があるもの      | -          | -       | -        | -    |
| 長期差入保証金      | 13,841     | 667,590 | -        | -    |
| 合計           | 25,593,271 | 667,590 | -        | -    |

## （有価証券関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

## 1．満期保有目的の債券

（単位：千円）

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

## 2．子会社株式及び関連会社株式

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

## 3．その他有価証券

（単位：千円）

| 区分                               | 貸借対照表計上額  | 取得原価      | 差額      |
|----------------------------------|-----------|-----------|---------|
| (1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの<br>投資信託等  | 2,484,337 | 2,253,148 | 231,189 |
| 小計                               | 2,484,337 | 2,253,148 | 231,189 |
| (2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの<br>投資信託等 | 4,390,071 | 4,483,035 | 92,963  |
| 小計                               | 4,390,071 | 4,483,035 | 92,963  |
| 合計                               | 6,874,409 | 6,736,184 | 138,225 |

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

## 4．当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：千円）

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

第26期(平成23年3月31日現在)

## 1. 満期保有目的の債券

(単位：千円)

| 区分                           | 貸借対照表計上額  | 時価        | 差額  |
|------------------------------|-----------|-----------|-----|
| (1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの  | -         | -         | -   |
| 小計                           | -         | -         | -   |
| (2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの | 3,999,722 | 3,999,600 | 122 |
| 小計                           | 3,999,722 | 3,999,600 | 122 |
| 合計                           | 3,999,722 | 3,999,600 | 122 |

## 2. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式234,921千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、1,256千円です。

## 3. その他有価証券

(単位：千円)

| 区分                               | 貸借対照表計上額  | 取得原価      | 差額      |
|----------------------------------|-----------|-----------|---------|
| (1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの<br>投資信託等  | 3,047,395 | 2,801,036 | 246,358 |
| 小計                               | 3,047,395 | 2,801,036 | 246,358 |
| (2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの<br>投資信託等 | 1,884,692 | 1,950,168 | 65,476  |
| 小計                               | 1,884,692 | 1,950,168 | 65,476  |
| 合計                               | 4,932,087 | 4,751,205 | 180,882 |

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

## 4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

| 売却額       | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|-----------|---------|---------|
| 4,845,387 | 71,400  | 20,822  |

(デリバティブ取引関係)

第25期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(退職給付関係)

| 第25期<br>(自 平成21年4月1日<br>至 平成22年3月31日)   | 第26期<br>(自 平成22年4月1日<br>至 平成23年3月31日) |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |        |  |     |               |  |        |                |  |  |        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |       |  |     |               |  |        |                |  |
|---|---------------------------------------|-----------|---------|------------------|------|---------|--|------|--------|--|----------------|--------|--|-----|---------------|--|--------|----------------|--|--|--------|-----------|---------|------------------|------|---------|--|------|--------|--|----------------|-------|--|-----|---------------|--|--------|----------------|--|
| <p>1. 採用している退職給付制度の概要<br/>当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p> <p>2. 退職給付債務の額<br/>(単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,137,766</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;"><u>1,137,766</u></td> </tr> </table> <p>3. 退職給付費用の額<br/>(単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">勤務費用</td> <td style="width: 20%; text-align: right;">154,625</td> <td style="width: 20%;"></td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">14,583</td> <td></td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">12,466</td> <td></td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;"><u>15,677</u></td> <td></td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;"><u>197,352</u></td> <td></td> </tr> </table> <p>(注) その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p> <p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項<br/>退職給付見込額の期間配分方法<br/>勤務期間を基準とする方法<br/>割引率 1.5%<br/>過去勤務債務の額の処理年数<br/>1年(発生時において費用処理する方法)<br/>数理計算上の差異の処理年数<br/>1年(発生時において費用処理する方法)</p> | 退職給付債務                                | 1,137,766 | 退職給付引当金 | <u>1,137,766</u> | 勤務費用 | 154,625 |  | 利息費用 | 14,583 |  | 数理計算上の差異の費用処理額 | 12,466 |  | その他 | <u>15,677</u> |  | 退職給付費用 | <u>197,352</u> |  | <p>1. 採用している退職給付制度の概要<br/>当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p> <p>2. 退職給付債務の額<br/>(単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,310,821</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;"><u>1,310,821</u></td> </tr> </table> <p>3. 退職給付費用の額<br/>(単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">勤務費用</td> <td style="width: 20%; text-align: right;">160,751</td> <td style="width: 20%;"></td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">17,066</td> <td></td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">6,439</td> <td></td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;"><u>15,287</u></td> <td></td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;"><u>199,545</u></td> <td></td> </tr> </table> <p>(注) その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p> <p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項<br/>退職給付見込額の期間配分方法<br/>勤務期間を基準とする方法<br/>割引率 1.5%<br/>過去勤務債務の額の処理年数<br/>1年(発生時において費用処理する方法)<br/>数理計算上の差異の処理年数<br/>1年(発生時において費用処理する方法)</p> | 退職給付債務 | 1,310,821 | 退職給付引当金 | <u>1,310,821</u> | 勤務費用 | 160,751 |  | 利息費用 | 17,066 |  | 数理計算上の差異の費用処理額 | 6,439 |  | その他 | <u>15,287</u> |  | 退職給付費用 | <u>199,545</u> |  |
| 退職給付債務  | 1,137,766                             |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |        |  |     |               |  |        |                |  |  |        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |       |  |     |               |  |        |                |  |
| 退職給付引当金   | <u>1,137,766</u>                      |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |        |  |     |               |  |        |                |  |  |        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |       |  |     |               |  |        |                |  |
| 勤務費用  | 154,625                               |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |        |  |     |               |  |        |                |  |  |        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |       |  |     |               |  |        |                |  |
| 利息費用  | 14,583                                |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |        |  |     |               |  |        |                |  |  |        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |       |  |     |               |  |        |                |  |
| 数理計算上の差異の費用処理額  | 12,466                                |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |        |  |     |               |  |        |                |  |  |        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |       |  |     |               |  |        |                |  |
| その他   | <u>15,677</u>                         |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |        |  |     |               |  |        |                |  |  |        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |       |  |     |               |  |        |                |  |
| 退職給付費用  | <u>197,352</u>                        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |        |  |     |               |  |        |                |  |  |        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |       |  |     |               |  |        |                |  |
| 退職給付債務  | 1,310,821                             |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |        |  |     |               |  |        |                |  |  |        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |       |  |     |               |  |        |                |  |
| 退職給付引当金   | <u>1,310,821</u>                      |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |        |  |     |               |  |        |                |  |  |        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |       |  |     |               |  |        |                |  |
| 勤務費用  | 160,751                               |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |        |  |     |               |  |        |                |  |  |        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |       |  |     |               |  |        |                |  |
| 利息費用  | 17,066                                |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |        |  |     |               |  |        |                |  |  |        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |       |  |     |               |  |        |                |  |
| 数理計算上の差異の費用処理額  | 6,439                                 |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |        |  |     |               |  |        |                |  |  |        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |       |  |     |               |  |        |                |  |
| その他   | <u>15,287</u>                         |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |        |  |     |               |  |        |                |  |  |        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |       |  |     |               |  |        |                |  |
| 退職給付費用  | <u>199,545</u>                        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |        |  |     |               |  |        |                |  |  |        |           |         |                  |      |         |  |      |        |  |                |       |  |     |               |  |        |                |  |

## (税効果会計関係)

| 第25期<br>(平成22年3月31日現在)   | 第26期<br>(平成23年3月31日現在) |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
|--|------------------------|---------|---------|--------|-----------|---------|--------------------|-------|---------|--------------|---------|------------|-------------------|-------------|---|----------------|-----------|----------------|---------|---------|----------|---------|-----------|--------|-------------|---------|-----|--------------|---------|---------|--------|----------------|----------|---------|--------------|---------------|----------|---------------|-----------|----------------|---|-------|---------|---------|--------|-------|--------|--------|-------|-----|--------------|---------|---------|--------|----------|----------|----------------|-----------|----------------|---------|---------|----------|---------|-----------|--------|-------------|---------|-----|--------------|---------|---------|--------|----------------|----------|---------|--------------|---------------|----------|---------------|-----------|----------------|
| <p>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</p> <p style="text-align: center;">(単位：千円)</p> <p>(1) 流動の部</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>賞与引当金</td><td style="text-align: right;">119,486</td></tr> <tr><td>未払社会保険料</td><td style="text-align: right;">12,746</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">100,639</td></tr> <tr><td>未払事業所税</td><td style="text-align: right;">6,089</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>5,807</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;">244,770</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;"><u>-</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;"><u>244,770</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>244,770</u></td></tr> </table> <p>(2) 固定の部</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>退職給付引当金</td><td style="text-align: right;">462,957</td></tr> <tr><td>ソフトウェア償却</td><td style="text-align: right;">111,245</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td style="text-align: right;">73,440</td></tr> <tr><td>特定外国子会社留保金額</td><td style="text-align: right;">213,896</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>8,735</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;">870,274</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;"><u>289,785</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;">580,489</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;"><u>55,668</u></td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;"><u>55,668</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>524,820</u></td></tr> </table> | 賞与引当金                  | 119,486 | 未払社会保険料 | 12,746 | 未払事業税     | 100,639 | 未払事業所税             | 6,089 | その他     | <u>5,807</u> | 繰延税金資産計 | 244,770    | 評価性引当額            | <u>-</u>    | 繰延税金資産合計  | <u>244,770</u> | 繰延税金資産の純額 | <u>244,770</u> | 退職給付引当金 | 462,957 | ソフトウェア償却 | 111,245 | 投資有価証券評価損 | 73,440 | 特定外国子会社留保金額 | 213,896 | その他 | <u>8,735</u> | 繰延税金資産計 | 870,274 | 評価性引当額 | <u>289,785</u> | 繰延税金資産合計 | 580,489 | その他有価証券評価差額金 | <u>55,668</u> | 繰延税金負債合計 | <u>55,668</u> | 繰延税金資産の純額 | <u>524,820</u> | <p>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</p> <p style="text-align: center;">(単位：千円)</p> <p>(1) 流動の部</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>賞与引当金</td><td style="text-align: right;">133,428</td></tr> <tr><td>未払社会保険料</td><td style="text-align: right;">14,807</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">83,126</td></tr> <tr><td>未払事業所税</td><td style="text-align: right;">6,378</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>4,235</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;">241,975</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;"><u>-</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;"><u>241,975</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>241,975</u></td></tr> </table> <p>(2) 固定の部</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>退職給付引当金</td><td style="text-align: right;">533,373</td></tr> <tr><td>ソフトウェア償却</td><td style="text-align: right;">141,119</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td style="text-align: right;">71,023</td></tr> <tr><td>特定外国子会社留保金額</td><td style="text-align: right;">247,489</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>4,925</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;">997,931</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;"><u>321,097</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;">676,833</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;"><u>70,383</u></td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;"><u>70,383</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>606,449</u></td></tr> </table> | 賞与引当金 | 133,428 | 未払社会保険料 | 14,807 | 未払事業税 | 83,126 | 未払事業所税 | 6,378 | その他 | <u>4,235</u> | 繰延税金資産計 | 241,975 | 評価性引当額 | <u>-</u> | 繰延税金資産合計 | <u>241,975</u> | 繰延税金資産の純額 | <u>241,975</u> | 退職給付引当金 | 533,373 | ソフトウェア償却 | 141,119 | 投資有価証券評価損 | 71,023 | 特定外国子会社留保金額 | 247,489 | その他 | <u>4,925</u> | 繰延税金資産計 | 997,931 | 評価性引当額 | <u>321,097</u> | 繰延税金資産合計 | 676,833 | その他有価証券評価差額金 | <u>70,383</u> | 繰延税金負債合計 | <u>70,383</u> | 繰延税金資産の純額 | <u>606,449</u> |
| 賞与引当金  | 119,486                |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 未払社会保険料  | 12,746                 |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 未払事業税  | 100,639                |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 未払事業所税   | 6,089                  |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| その他  | <u>5,807</u>           |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 繰延税金資産計  | 244,770                |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 評価性引当額   | <u>-</u>               |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 繰延税金資産合計   | <u>244,770</u>         |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 繰延税金資産の純額  | <u>244,770</u>         |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 退職給付引当金  | 462,957                |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| ソフトウェア償却   | 111,245                |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 投資有価証券評価損  | 73,440                 |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 特定外国子会社留保金額  | 213,896                |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| その他  | <u>8,735</u>           |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 繰延税金資産計  | 870,274                |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 評価性引当額   | <u>289,785</u>         |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 繰延税金資産合計   | 580,489                |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| その他有価証券評価差額金   | <u>55,668</u>          |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 繰延税金負債合計   | <u>55,668</u>          |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 繰延税金資産の純額  | <u>524,820</u>         |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 賞与引当金  | 133,428                |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 未払社会保険料  | 14,807                 |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 未払事業税  | 83,126                 |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 未払事業所税   | 6,378                  |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| その他  | <u>4,235</u>           |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 繰延税金資産計  | 241,975                |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 評価性引当額   | <u>-</u>               |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 繰延税金資産合計   | <u>241,975</u>         |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 繰延税金資産の純額  | <u>241,975</u>         |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 退職給付引当金  | 533,373                |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| ソフトウェア償却   | 141,119                |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 投資有価証券評価損  | 71,023                 |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 特定外国子会社留保金額  | 247,489                |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| その他  | <u>4,925</u>           |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 繰延税金資産計  | 997,931                |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 評価性引当額   | <u>321,097</u>         |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 繰延税金資産合計   | 676,833                |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| その他有価証券評価差額金   | <u>70,383</u>          |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 繰延税金負債合計   | <u>70,383</u>          |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 繰延税金資産の純額  | <u>606,449</u>         |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <p style="text-align: center;">(%)</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>法定実効税率</td><td style="text-align: right;">40.7</td></tr> <tr><td>(調整)</td><td></td></tr> <tr><td>評価性引当額の増減</td><td style="text-align: right;">11.6</td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td style="text-align: right;">0.2</td></tr> <tr><td>住民税均等割等</td><td style="text-align: right;">0.1</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>0.2</u></td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td style="text-align: right;"><u>29.1</u></td></tr> </table>  | 法定実効税率                 | 40.7    | (調整)    |        | 評価性引当額の増減 | 11.6    | 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 0.2   | 住民税均等割等 | 0.1          | その他     | <u>0.2</u> | 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | <u>29.1</u> | <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <p style="text-align: center;">法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、記載を省略しております。</p> |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 法定実効税率   | 40.7                   |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| (調整)   |                        |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 評価性引当額の増減  | 11.6                   |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目   | 0.2                    |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 住民税均等割等  | 0.1                    |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| その他  | <u>0.2</u>             |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率  | <u>29.1</u>            |         |         |        |           |         |                    |       |         |              |         |            |                   |             |   |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |   |       |         |         |        |       |        |        |       |     |              |         |         |        |          |          |                |           |                |         |         |          |         |           |        |             |         |     |              |         |         |        |                |          |         |              |               |          |               |           |                |

## （資産除去債務関係）

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## （追加情報）

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

## (関連当事者情報)

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

(単位:千円)

| 種類       | 会社等の名称又は氏名 | 所在地               | 資本金、出資金又は基金   | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合    | 関連当事者との関係        | 取引の内容   | 取引金額      | 科目       | 期末残高    |
|----------|------------|-------------------|---------------|-----------|-------------------|------------------|---------|-----------|----------|---------|
| その他の関係会社 | 住友生命保険(相)  | 大阪府<br>大阪市<br>中央区 | 199,000,000   | 生命保険業     | (被所有)%<br>直接 40   | 当社の主要顧客          | 投資助言報酬  | 1,125,661 | 未収投資助言報酬 | 295,911 |
| その他の関係会社 | (株)三井住友銀行  | 東京都<br>千代田区       | 1,770,996,505 | 銀行業       | (被所有)%<br>直接 27.5 | 投信の販売委託<br>役員の兼任 | 委託販売手数料 | 2,495,661 | 未払手数料    | 347,340 |

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(2) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. その他の関係会社の子会社等

(単位:千円)

| 種類           | 会社等の名称又は氏名    | 所在地         | 資本金、出資金又は基金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容   | 取引金額      | 科目    | 期末残高    |
|--------------|---------------|-------------|-------------|-----------|----------------|-----------|---------|-----------|-------|---------|
| その他の関係会社の子会社 | 日興コーディアル証券(株) | 東京都<br>千代田区 | 10,000,000  | 証券業       | - %            | 投信の販売委託   | 委託販売手数料 | 1,019,546 | 未払手数料 | 238,828 |

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

（単位：千円）

| 種類       | 会社等の名称又は氏名 | 所在地               | 資本金、出資金又は基金   | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合    | 関連当事者との関係        | 取引の内容   | 取引金額      | 科目       | 期末残高    |
|----------|------------|-------------------|---------------|-----------|-------------------|------------------|---------|-----------|----------|---------|
| その他の関係会社 | 住友生命保険(相)  | 大阪府<br>大阪市<br>中央区 | 210,000,000   | 生命保険業     | (被所有)%<br>直接 40   | 当社の主要顧客          | 投資助言報酬  | 1,130,782 | 未収投資助言報酬 | 293,061 |
| その他の関係会社 | (株)三井住友銀行  | 東京都<br>千代田区       | 1,770,996,505 | 銀行業       | (被所有)%<br>直接 27.5 | 投信の販売委託<br>役員の兼任 | 委託販売手数料 | 4,558,604 | 未払手数料    | 374,320 |

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(2) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. その他の関係会社の子会社等

（単位：千円）

| 種類           | 会社等の名称又は氏名    | 所在地         | 資本金、出資金又は基金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容   | 取引金額      | 科目    | 期末残高    |
|--------------|---------------|-------------|-------------|-----------|----------------|-----------|---------|-----------|-------|---------|
| その他の関係会社の子会社 | 日興コーディアル証券(株) | 東京都<br>千代田区 | 10,000,000  | 証券業       | - %            | 投信の販売委託   | 委託販売手数料 | 2,174,385 | 未払手数料 | 110,182 |

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## ( 1株当たり情報 )

| 第25期<br>(自平成21年4月1日<br>至平成22年3月31日)  | 第26期<br>(自平成22年4月1日<br>至平成23年3月31日)  |
|--|--|
| 1株当たり純資産額 1,513,927円30銭<br>1株当たり当期純利益 150,963円55銭  | 1株当たり純資産額 1,584,018円42銭<br>1株当たり当期純利益 143,507円12銭  |
| なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。   | なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。   |
| ( 1株当たり純資産額の算定上の基礎 )<br>貸借対照表の純資産の部の合計額 26,705,677千円<br>普通株式に係る純資産額 26,705,677千円<br>普通株式の発行済株式数 17,640株<br>1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数<br>17,640株 | ( 1株当たり純資産額の算定上の基礎 )<br>貸借対照表の純資産の部の合計額 27,942,085千円<br>普通株式に係る純資産額 27,942,085千円<br>普通株式の発行済株式数 17,640株<br>1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数<br>17,640株 |
| ( 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 )<br>損益計算書上の当期純利益 2,662,997千円<br>普通株式に係る当期純利益 2,662,997千円<br>普通株主に帰属しない金額の主要な内訳<br>該当事項はありません。<br>普通株式の期中平均株式数 17,640株     | ( 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 )<br>損益計算書上の当期純利益 2,531,465千円<br>普通株式に係る当期純利益 2,531,465千円<br>普通株主に帰属しない金額の主要な内訳<br>該当事項はありません。<br>普通株式の期中平均株式数 17,640株     |

## ( 重要な後発事象 )

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

該当事項はありません。

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

該当事項はありません。

## 5【その他】

### <訂正前>

イ 定款の変更、その他の重要事項

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

（略）

### <訂正後>

イ 定款の変更、その他の重要事項

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

（略）

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### <訂正前>

##### イ 受託会社

(イ) 名称 住友信託銀行株式会社

(ロ) 資本金の額 342,037百万円（平成22年9月末現在）

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

#### 【参考情報：再信託受託会社の概要】

・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

・ 資本金の額 51,000百万円（平成22年9月末現在）

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

##### ロ 販売会社

| (イ) 名称          | (ロ) 資本金の額    | (ハ) 事業の内容            |
|-----------------|--------------|----------------------|
| 株式会社三井住友銀行      | 1,770,996百万円 | 銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。  |
| 株式会社みずほコーポレート銀行 | 1,404,065百万円 |                      |
| 住友生命保険相互会社      | 439,000百万円   | 保険業法に基づき、保険業を営んでいます。 |
| 三井生命保険株式会社      | 167,280百万円   |                      |

資本金の額は、平成22年9月末現在。

住友生命保険相互会社の資本金の額は、平成22年9月末現在の基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。

#### <訂正後>

##### イ 受託会社

(イ) 名称 住友信託銀行株式会社

(ロ) 資本金の額 342,037百万円（平成23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。

関係当局の認可等を前提に、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および中央三井アセット信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号を変更する予定です。

#### 【参考情報：再信託受託会社の概要】

・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

・ 資本金の額 51,000百万円（平成23年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。

## □ 販売会社

| (イ) 名称          | (ロ) 資本金の額    | (ハ) 事業の内容                       |
|-----------------|--------------|---------------------------------|
| 損保ジャパンDC証券株式会社  | 3,000百万円     | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 株式会社三井住友銀行      | 1,770,996百万円 | 銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。             |
| 株式会社みずほコーポレート銀行 | 1,404,065百万円 |                                 |
| 住友生命保険相互会社      | 439,000百万円   | 保険業法に基づき、保険業を営んでいます。            |
| 三井生命保険株式会社      | 167,280百万円   |                                 |

資本金の額は、平成23年3月末現在。

住友生命保険相互会社の資本金の額は、平成23年3月末現在の基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成23年10月11日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成23年2月19日から平成23年8月18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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成23年8月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年2月19日から平成23年8月18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。

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

以上

---

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

2．中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

---

## 独立監査人の中間監査報告書

平成23年10月11日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成23年2月19日から平成23年8月18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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成23年8月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年2月19日から平成23年8月18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。

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

以上

---

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

2．中間財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

---

## 独立監査人の中間監査報告書

平成23年10月11日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成23年2月19日から平成23年8月18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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成23年8月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年2月19日から平成23年8月18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。

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

以上

---

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

2．中間財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成22年10月12日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成22年2月19日から平成22年8月18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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成22年8月18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22年2月19日から平成22年8月18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。

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

以上

- 
- (注) 1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。
-

## 独立監査人の中間監査報告書

平成22年10月12日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成22年2月19日から平成22年8月18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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成22年8月18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22年2月19日から平成22年8月18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。

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

以上

---

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

2．中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

---

## 独立監査人の中間監査報告書

平成22年10月12日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成22年2月19日から平成22年8月18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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成22年8月18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22年2月19日から平成22年8月18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。

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

以上

- 
- (注) 1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成23年 6月17日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 辰巳 幸久 印  
業務執行社員

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

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成23年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

---

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

## 独立監査人の監査報告書

平成22年 6月18日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員      公認会計士      鈴木 敏夫 印  
業務執行社員指 定 社 員      公認会計士      辰巳 幸久 印  
業務執行社員

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

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

---

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