

【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25年1月11日

【発行者名】 三井住友アセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 前田 良治

【本店の所在の場所】 東京都港区愛宕二丁目5番1号

【事務連絡者氏名】 三島 克哉

【電話番号】 03-5405-0228

**【届出の対象とした募集内国投資信託受益証 スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）
券に係るファンドの名称】**

**【届出の対象とした募集内国投資信託受益証 1兆円を上限とします。
券の金額】**

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

・【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成24年7月12日付をもって提出しました「スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）」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25年1月11日に半期報告書を提出したことに伴う関係情報の更新、その他訂正すべき事項がありますので、本訂正届出書により訂正を行うものです。

・【訂正の内容】

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

(略)

八 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

(略)

(口) 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

(略)

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

<訂正後>

(略)

八 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

(略)

(口) 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、 <u>対円での為替</u> のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは <u>対円での為替</u> のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

(略)

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

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

(3) 【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（平成24年5月31日現在）

(略)

(八) 大株主の状況

(平成24年5月31日現在)

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

<訂正後>

(略)

□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（平成24年11月30日現在）

(略)

(八) 大株主の状況

(平成24年11月30日現在)

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

2 【投資方針】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針 (1) 投資方針」の記載は、下記の通り更新されます。

(1) 【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、マザーファンドの受益証券への投資を通じて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

□ 投資態度

(イ) 国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産を主要投資対象とする5つ

のマザーファンドに分散投資を行います。

国内株式	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
国内債券	国内債券パッシブ・マザーファンド
外国株式	外国株式インデックス・マザーファンド
外国債券	外国債券パッシブ・マザーファンド
短期金融資産	マネーインカム・マザーファンド

- (ロ) 委託会社が独自に作成する基本資産配分に対し一定の許容変動幅内で機動的に資産配分を変更します。

ファンドの基本資産配分ならびに各資産の許容変動幅

資産配分					
	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
基本	20%	50%	10%	15%	5%
上限	35%	65%	25%	30%	20%
下限	5%	35%	0%	0%	0%

(注) 基本資産配分は、5年に一回程度検証を行い、必要であれば見直しを行います。

- (ハ) 運用にあたっては、基本資産配分に基づいて、以下の指数を合成したベンチマークを上回る投資成果を目指します。

国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
TOPIX (東証株価指数) 配当込み	NOMURA - BPI(総合)	MSCI - KOKUSAI インデックス(円 ベース)	シティグループ世界 国債インデックス (除く日本、円ベ ース)	無担保コール 翌日物
20%	50%	10%	15%	5%

(注) 基本資産配分の見直しに伴い見直しを行います。

- (ニ) 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

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

ファンドの特色

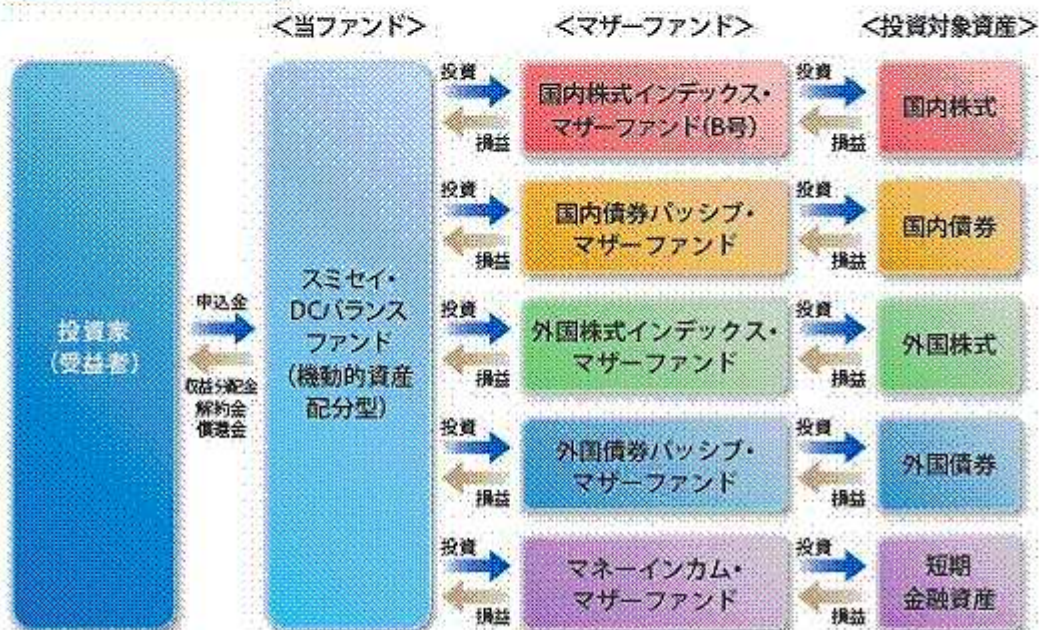
1

日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

実際の運用は、各資産に投資する5つのマザーファンドへの投資を通じて行います（ファミリーファンド方式）。

国内株式	国内株式インデックス・マザーファンド (B号)
国内債券	国内債券バッシブ・マザーファンド
外国株式	外国株式インデックス・マザーファンド
外国債券	外国債券バッシブ・マザーファンド
短期金融資産	マネーインカム・マザーファンド

ファミリーファンド方式



2 委託会社が独自に作成する基本資産配分に対し、一定の許容変動幅内で機動的に資産配分を変更します。

ファンドの基本資産配分ならびに各資産の許容変動幅

資産配分					
	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
基本	20%	50%	10%	15%	5%
上限	35%	65%	25%	30%	20%
下限	5%	35%	0%	0%	0%

(注) 基本資産配分は、5年に一回程度検証を行い、必要であれば見直しを行います。

3 運用にあたっては、基本資産配分に基づいて、以下の指数を合成したベンチマークを上回る投資成果を目指します。

国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
TOPIX (東証株価指数) 配当込み	NOMURA－BPI (総合)	MSCI－ KOKUSAI インデックス (円ベース)	シティグループ 世界国債 インデックス (除く日本、 円ベース)	無担保コール 翌日物
20%	50%	10%	15%	5%

(注) 基本資産配分の見直しに伴い、ベンチマークの見直しも行います。

4 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

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

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

世界分散投資と各資産の投資元本成長比較 (期間2002年10月末～2012年10月末)



(注1)「国内株式」はTOPIX(東証株価指数)配当込み、「国内債券」はNOMURA-BPI(総合)、「外国株式」はMSCI-KOKUSAIインデックス(円ベース)、「外国債券」はシティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)、「短期金融資産」は無担保コール翌日物を使用。2002年10月末を100として指数化。

(注2)「5資産」は、基本資産配分比率(国内株式20%、国内債券50%、外国株式10%、外国債券15%、短期金融資産5%)で組み合わせたデータ。

(出所)FactSetのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

※グラフ・データは、参考情報として記載した上記指数の過去の実績およびシミュレーションであり、当ファンドの将来の運用成果等を示唆、あるいは保証するものではありません。

各マザーファンドの運用プロセス

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

国内債券バッシブ・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国債券バッシブ・マザーファンド

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

マネーインカム・マザーファンド

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

（3）【運用体制】

< 訂正前 >

イ 運用体制

（略）

リスク管理部は7名程度、運用企画部は10名程度で構成されています。

（略）

<訂正後>

イ 運用体制

(略)

リスク管理部は8名程度、運用企画部は8名程度で構成されています。

(略)

4【手数料等及び税金】

(4)【その他の手数料等】

<訂正前>

イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.00525%（税抜き0.005%）の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。

(略)

<訂正後>

イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.00525%（税抜き0.005%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。

(略)

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

(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、以下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。

時期	税率
平成24年12月31日まで	10%（所得税7%および地方税3%）
平成25年1月1日から 平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7.147%および地方税3%）
平成26年1月1日以降	20.315%（所得税15.315%および地方税5%）

・ 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、以下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。

時期	税率
----	----

平成24年12月31日まで	10% (所得税7%および地方税3%)
平成25年1月1日から 平成25年12月31日まで	10.147% (所得税7.147%および地方税3%)
平成26年1月1日以降	20.315% (所得税15.315%および地方税5%)

(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、以下の税率で源泉徴収されます。

時期	税率
平成24年12月31日まで	7% (所得税のみ)
平成25年1月1日から 平成25年12月31日まで	7.147% (所得税のみ)
平成26年1月1日以降	15.315% (所得税のみ)

(略)

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成24年5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。

<訂正後>

(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、以下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。

時期	税率
平成25年12月31日まで	10.147% (所得税7.147%および地方税3%)
平成26年1月1日以降	20.315% (所得税15.315%および地方税5%)

・ 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、以下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。

時期	税率
平成25年12月31日まで	10.147% (所得税7.147%および地方税3%)
平成26年1月1日以降	20.315% (所得税15.315%および地方税5%)

(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、以下の税率で源泉徴収されます。

時期	税率
平成25年12月31日まで	7.147% (所得税のみ)
平成26年1月1日以降	15.315% (所得税のみ)

(略)

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成24年11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】

平成24年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
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	61,007,222	21.51
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	128,735,476	45.39
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	37,268,370	13.14
外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	38,340,035	13.52
マネーインカム・マザーファンド受益証券	日本	18,311,482	6.46
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		18,889	0.01
合計(純資産総額)		283,643,696	100.00

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ 主要投資銘柄

平成24年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	113,293,564	1.1219	127,110,237	1.1363	128,735,476	45.39
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	56,782,597	1.0725	60,900,351	1.0744	61,007,222	21.51
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	31,326,118	1.1555	36,199,933	1.2239	38,340,035	13.52
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	26,489,708	1.3119	34,753,898	1.4069	37,268,370	13.14
日本	親投資信託受益証券	マネーインカム・マザーファンド	18,126,591	1.0098	18,306,044	1.0102	18,311,482	6.46

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別の投資比率

平成24年11月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

【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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

年月日	純資産総額 (円)	1万口当たりの 純資産額(円)
第1期(平成21年 4月13日) (分配落)	16,686,392	8,941
(分配付)	16,686,392	8,941
第2期(平成22年 4月13日) (分配落)	68,468,980	9,680
(分配付)	68,468,980	9,680
第3期(平成23年 4月13日) (分配落)	128,503,036	9,450
(分配付)	128,503,036	9,450
第4期(平成24年 4月13日) (分配落)	220,003,408	9,507
(分配付)	220,003,408	9,507
平成23年11月末日	178,330,909	8,951
12月末日	188,491,103	9,010
平成24年 1月末日	197,032,124	9,124
2月末日	220,242,245	9,556
3月末日	225,680,262	9,655
4月末日	220,258,345	9,507
5月末日	219,107,151	9,117
6月末日	227,511,064	9,286
7月末日	256,165,339	9,234
8月末日	263,560,511	9,264
9月末日	269,535,061	9,335
10月末日	277,937,346	9,396
11月末日	283,643,696	9,616

【分配の推移】

計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期（平成20年 3月31日～平成21年 4月13日）	0
第2期（平成21年 4月14日～平成22年 4月13日）	0
第3期（平成22年 4月14日～平成23年 4月13日）	0
第4期（平成23年 4月14日～平成24年 4月13日）	0

【収益率の推移】

計算期間	収益率（％）
第1期	10.6
第2期	8.3
第3期	2.4
第4期	0.6
第5期（中間期）	2.2

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

（４）【設定及び解約の実績】

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	19,697,539	1,034,910
第2期	55,385,703	3,317,301
第3期	74,934,583	9,676,704
第4期	108,988,282	13,561,540
第5期（中間期）	65,227,037	6,530,795

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

〔参考情報〕

〔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24年11月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	日本	289,850,383,360	98.20
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,309,241,000	1.80
合計（純資産総額）		295,159,624,360	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	国 / 地域	買建 / 売建	投資比率 (%)
株価指数先物取引	日本	買建	1.79
		買建合計	1.79

(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24年11月30日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額単価 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3,461,700	2,541.51	8,797,945,167	3,535.00	12,237,109,500	4.15
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	20,145,700	329.23	6,632,568,811	377.00	7,594,928,900	2.57
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,274,100	2,400.02	5,457,885,482	2,732.00	6,212,841,200	2.10
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2,012,000	2,104.00	4,233,248,000	2,654.00	5,339,848,000	1.81
日本	株式	キヤノン	電気機器	1,674,200	3,414.01	5,715,735,542	2,883.00	4,826,718,600	1.64
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	34,233,200	100.97	3,456,526,204	132.00	4,518,782,400	1.53
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,119,800	3,757.10	4,207,200,580	3,685.00	4,126,463,000	1.40
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,057,100	3,154.40	3,334,516,240	3,770.00	3,985,267,000	1.35
日本	株式	ファナック	電気機器	280,500	12,343.26	3,462,284,430	13,900.00	3,898,950,000	1.32
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,211,900	2,532.90	3,069,621,510	3,090.00	3,744,771,000	1.27
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,339,200	1,844.39	2,470,007,088	2,470.00	3,307,824,000	1.12
日本	株式	三菱商事	卸売業	2,075,300	1,544.66	3,205,640,359	1,561.00	3,239,543,300	1.10
日本	株式	日立製作所	電気機器	6,303,000	427.56	2,694,937,080	476.00	3,000,228,000	1.02
日本	株式	三菱地所	不動産業	1,862,000	1,261.39	2,348,708,180	1,589.00	2,958,718,000	1.00
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	3,407,500	693.06	2,361,601,950	799.00	2,722,592,500	0.92
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	502,500	4,744.30	2,384,015,596	5,410.00	2,718,525,000	0.92
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1,112,400	2,141.27	2,381,948,748	2,402.00	2,671,984,800	0.91
日本	株式	三井物産	卸売業	2,297,900	1,179.19	2,709,660,701	1,139.00	2,617,308,100	0.89
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	626,700	2,947.76	1,847,361,192	4,170.00	2,613,339,000	0.89
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	21,913	134,587.21	2,949,209,532	118,900.00	2,605,455,700	0.88
日本	株式	信越化学工業	化学	506,600	3,821.08	1,935,759,128	4,850.00	2,457,010,000	0.83
日本	株式	小松製作所	機械	1,317,400	1,897.43	2,499,674,282	1,847.00	2,433,237,800	0.82
日本	株式	KDDI	情報・通信業	375,400	5,046.29	1,894,377,266	6,100.00	2,289,940,000	0.78
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	11,933,000	181.68	2,167,996,150	189.00	2,255,337,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,030,400	1,844.54	1,900,620,101	2,114.00	2,178,265,600	0.74
日本	株式	三井不動産	不動産業	1,255,000	1,244.27	1,561,564,000	1,719.00	2,157,345,000	0.73
日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	5,443,200	249.19	1,356,391,008	341.00	1,856,131,200	0.63
日本	株式	デンソー	輸送用機器	666,800	2,163.34	1,442,515,112	2,709.00	1,806,361,200	0.61
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	884,700	1,749.65	1,547,915,355	1,989.00	1,759,668,300	0.60
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	2,122,000	768.55	1,630,863,100	824.00	1,748,528,000	0.59

ロ 種類別・業種別の投資比率

平成24年11月30日現在

種類	業種	投資比率 (%)
----	----	----------

株式（国内）	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.62
	建設業	2.54
	食料品	4.10
	繊維製品	0.84
	パルプ・紙	0.28
	化学	5.75
	医薬品	5.20
	石油・石炭製品	0.76
	ゴム製品	0.81
	ガラス・土石製品	0.98
	鉄鋼	1.57
	非鉄金属	1.05
	金属製品	0.69
	機械	4.96
	電気機器	11.64
	輸送用機器	10.80
	精密機器	1.41
	その他製品	1.46
	電気・ガス業	2.44
	陸運業	4.14
	海運業	0.29
	空運業	0.61
	倉庫・運輸関連業	0.23
	情報・通信業	6.33
	卸売業	5.21
	小売業	4.19
	銀行業	9.75
	証券、商品先物取引業	1.22
	保険業	2.28
	その他金融業	0.91
不動産業	2.93	
サービス業	2.12	
合計	98.20	

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24年11月30日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	東京証券 取引所	東証株価指 数先物	買建	675	4,931,271,900	5,271,750,000	1.79

	買建合計	675	4,931,271,900	5,271,750,000	1.79
--	------	-----	---------------	---------------	------

(注) 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。

〔国内債券パッシブ・マザーファンド〕

(1) 投資状況

平成24年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	367,141,903,140	77.24
地方債証券	日本	30,181,119,518	6.35
特殊債券	日本	45,863,239,739	9.65
社債券	日本	25,847,079,300	5.44
	アメリカ	1,534,071,000	0.32
	オーストラリア	609,537,000	0.13
	オランダ	602,211,000	0.13
	イギリス	503,627,000	0.11
	小計		29,096,525,300
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,021,037,220	0.64
合計(純資産総額)		475,303,824,917	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24年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第268回利付 国債(10年)	13,845,000,000	103.92	14,387,724,000	103.21	14,289,562,950	1.500	2015/03/20	3.01
日本	国債証券	第265回利付 国債(10年)	12,040,000,000	103.57	12,470,670,800	102.86	12,385,066,400	1.500	2014/12/20	2.61
日本	国債証券	第263回利付 国債(10年)	10,872,000,000	103.45	11,247,952,200	102.69	11,165,109,120	1.600	2014/09/20	2.35
日本	国債証券	第284回利付 国債(10年)	10,467,000,000	106.73	11,172,323,900	106.29	11,125,792,980	1.700	2016/12/20	2.34
日本	国債証券	第272回利付 国債(10年)	9,985,000,000	104.21	10,406,162,500	103.62	10,346,656,700	1.400	2015/09/20	2.18
日本	国債証券	第277回利付 国債(10年)	9,745,000,000	105.48	10,279,501,000	104.90	10,222,699,900	1.600	2016/03/20	2.15
日本	国債証券	第282回利付 国債(10年)	9,370,000,000	106.45	9,974,501,000	105.94	9,927,327,600	1.700	2016/09/20	2.09
日本	国債証券	第280回利付 国債(10年)	9,317,000,000	106.97	9,966,394,900	106.29	9,903,691,490	1.900	2016/06/20	2.08
日本	国債証券	第274回利付 国債(10年)	9,305,000,000	104.85	9,757,167,500	104.24	9,700,276,400	1.500	2015/12/20	2.04
日本	国債証券	第286回利付 国債(10年)	8,500,000,000	107.77	9,160,875,000	107.42	9,130,700,000	1.800	2017/06/20	1.92
日本	国債証券	第260回利付 国債(10年)	8,865,000,000	103.07	9,137,936,000	102.31	9,070,490,700	1.600	2014/06/20	1.91
日本	国債証券	第270回利付 国債(10年)	8,367,000,000	103.62	8,670,392,700	103.05	8,622,695,520	1.300	2015/06/20	1.81
日本	国債証券	第285回利付 国債(10年)	7,163,000,000	106.97	7,662,470,100	106.63	7,637,906,900	1.700	2017/03/20	1.61

日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	6,230,000,000	103.51	6,448,673,000	105.38	6,565,734,700	1.200	2021/06/20	1.38
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	6,090,000,000	102.51	6,242,859,000	104.14	6,342,186,900	1.000	2020/09/20	1.33
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	5,920,000,000	105.33	6,235,536,000	106.45	6,302,254,400	1.300	2019/12/20	1.33
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	5,900,000,000	104.58	6,170,220,000	106.32	6,273,234,000	1.300	2021/03/20	1.32
日本	国債証券	第306回利付国債(10年)	5,750,000,000	106.00	6,095,000,000	107.23	6,166,012,500	1.400	2020/03/20	1.30
日本	国債証券	第288回利付国債(10年)	5,655,000,000	107.39	6,073,428,000	107.30	6,067,871,550	1.700	2017/09/20	1.28
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	5,420,000,000	103.95	5,634,306,800	105.61	5,724,441,400	1.200	2020/12/20	1.20
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	5,294,000,000	106.56	5,641,735,000	106.62	5,644,674,560	1.500	2017/12/20	1.19
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	5,000,000,000	100.61	5,030,973,500	100.87	5,043,500,000	0.800	2022/09/20	1.06
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	4,717,000,000	106.05	5,002,595,100	106.36	5,017,237,050	1.400	2018/03/20	1.06
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	4,780,000,000	101.32	4,843,382,800	103.38	4,941,850,800	1.000	2021/12/20	1.04
日本	国債証券	第297回利付国債(10年)	3,793,000,000	106.12	4,025,131,600	106.81	4,051,492,950	1.400	2018/12/20	0.85
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	3,745,000,000	106.12	3,974,194,000	107.11	4,011,269,500	1.400	2019/09/20	0.84
日本	国債証券	第322回利付国債(10年)	3,750,000,000	100.74	3,778,012,500	102.27	3,835,462,500	0.900	2022/03/20	0.81
日本	国債証券	第308回利付国債(10年)	3,450,000,000	105.09	3,625,605,000	106.51	3,674,629,500	1.300	2020/06/20	0.77
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	3,363,000,000	106.73	3,589,329,900	107.26	3,607,221,060	1.500	2018/09/20	0.76
日本	国債証券	第318回利付国債(10年)	3,200,000,000	101.55	3,249,824,000	103.55	3,313,824,000	1.000	2021/09/20	0.70

□ 種類別の投資比率

平成24年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	77.24
地方債証券	6.35
特殊債券	9.65
社債券	6.12
合計	99.36

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24年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	120,922,246,274	53.71
	イギリス	22,387,368,754	9.94
	カナダ	11,926,756,787	5.30
	スイス	9,909,333,940	4.40

	フランス	9,079,428,443	4.03
	ドイツ	8,764,241,019	3.89
	オーストラリア	8,112,265,949	3.60
	スウェーデン	3,166,863,103	1.41
	スペイン	2,998,504,313	1.33
	オランダ	2,924,678,094	1.30
	香港	2,758,324,573	1.23
	イタリア	2,216,975,697	0.98
	シンガポール	1,759,655,243	0.78
	アイルランド	1,491,288,294	0.66
	デンマーク	1,184,533,959	0.53
	ベルギー	1,182,415,289	0.53
	ジャージー	1,073,333,645	0.48
	アンティル	907,631,349	0.40
	ノルウェー	898,101,796	0.40
	フィンランド	794,223,067	0.35
	バミューダ	698,641,313	0.31
	イスラエル	612,439,552	0.27
	ルクセンブルク	421,543,299	0.19
	オーストリア	293,869,267	0.13
	ケイマン諸島	252,105,867	0.11
	ポルトガル	170,018,664	0.08
	ニュージーランド	129,069,850	0.06
	ギリシャ	65,058,916	0.03
	マン島	59,139,875	0.03
	ガーンジー	52,530,178	0.02
	リベリア	45,035,480	0.02
	モーリシャス	35,651,434	0.02
	小計	217,293,273,283	96.52
投資証券	アメリカ	3,288,050,830	1.46
	オーストラリア	883,068,509	0.39
	フランス	309,536,851	0.14
	イギリス	277,765,308	0.12
	香港	121,605,850	0.05
	シンガポール	112,066,466	0.05
	カナダ	57,995,361	0.03
	オランダ	30,530,357	0.01
	小計	5,080,619,532	2.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,755,646,026	1.22
合計(純資産総額)		225,129,538,841	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	国/地域	買建/ 売建	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	買建	0.77
株価指数先物取引	ドイツ	買建	0.26
株価指数先物取引	イギリス	買建	0.14
		買建合計	1.18

(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24年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー ・ハードウェア および機器	109,764	31,139.08	3,417,950,284	48,398.24	5,312,384,766	2.36
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	548,996	6,328.16	3,474,138,480	7,236.41	3,972,762,559	1.76
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	1,244,045	1,235.90	1,537,522,679	1,735.19	2,158,661,410	0.96
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・ タバコ	387,190	4,498.20	1,741,661,658	5,400.32	2,090,953,772	0.93
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア ・サービス	128,616	14,890.81	1,915,197,653	15,728.44	2,022,929,502	0.90
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	231,535	8,006.69	1,853,831,284	8,687.47	2,011,454,477	0.89
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア ・サービス	887,665	2,048.89	1,818,731,492	2,213.13	1,964,521,592	0.87
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サー ビス	688,224	2,318.24	1,595,473,636	2,786.33	1,917,620,279	0.85
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル用 品	321,575	5,135.78	1,651,539,997	5,707.33	1,835,337,860	0.82
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイ オテクノロジー ・ライフサイ エンス	322,364	5,140.71	1,657,180,483	5,684.34	1,832,428,642	0.81
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイ オテクノロジー ・ライフサイ エンス	878,801	1,598.05	1,404,372,507	2,040.68	1,793,353,382	0.80
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	2,131,261	641.57	1,367,361,218	832.06	1,773,357,998	0.79
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア ・サービス	30,506	47,911.27	1,461,581,251	56,818.00	1,733,290,115	0.77
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	592,619	1,995.51	1,182,580,696	2,723.09	1,613,760,324	0.72
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	446,785	2,361.77	1,055,203,945	3,384.98	1,512,361,148	0.67
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・ タバコ	476,874	2,727.20	1,300,533,252	3,118.09	1,486,939,102	0.66
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	食品・飲料・ タバコ	200,150	6,136.82	1,228,286,044	7,417.89	1,484,692,604	0.66
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイ オテクノロジー ・ライフサイ エンス	269,858	4,324.69	1,167,052,328	5,103.75	1,377,288,981	0.61
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイ オテクノロジー ・ライフサイ エンス	82,465	12,568.60	1,036,469,937	16,130.16	1,330,174,139	0.59
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイ オテクノロジー ・ライフサイ エンス	357,122	2,839.70	1,014,122,771	3,671.58	1,311,203,849	0.58
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必 需品小売り	218,358	4,785.13	1,044,871,940	5,816.55	1,270,092,321	0.56
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	2,232,550	577.02	1,288,228,680	567.86	1,267,787,607	0.56
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サー ビス	5,790,697	222.64	1,289,244,254	211.17	1,222,874,875	0.54
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア ・サービス	467,347	2,437.32	1,139,074,937	2,614.70	1,221,972,574	0.54
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サー ビス	333,417	3,020.37	1,007,043,904	3,614.10	1,205,002,779	0.54
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	433,813	2,816.60	1,221,878,216	2,750.07	1,193,017,200	0.53
オースト リア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	378,257	2,989.02	1,130,620,121	2,930.77	1,108,584,532	0.49
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・ タバコ	183,597	5,238.43	961,760,913	5,773.85	1,060,062,860	0.47
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイ オテクノロジー ・ライフサイ エンス	588,633	1,802.20	1,060,836,276	1,779.80	1,047,653,369	0.47

アメリカ	株式	QUALCOMM INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	201,365	4,377.81	881,539,160	5,202.30	1,047,561,542	0.47
------	----	--------------	--------------------	---------	----------	-------------	----------	---------------	------

□ 種類別・業種別の投資比率

平成24年11月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式（外国）	医薬品	0.06
	エネルギー	11.03
	素材	6.84
	資本財	7.27
	商業・専門サービス	0.91
	運輸	1.69
	自動車・自動車部品	1.37
	耐久消費財・アパレル	1.42
	消費者サービス	1.57
	メディア	2.75
	小売	3.07
	食品・生活必需品小売り	2.32
	食品・飲料・タバコ	7.02
	家庭用品・パーソナル用品	1.83
	ヘルスケア機器・サービス	2.72
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.03
	銀行	7.64
	各種金融	4.74
	保険	4.22
	不動産	0.72
ソフトウェア・サービス	6.02	
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.74	
電気通信サービス	3.78	
公益事業	3.49	
半導体・半導体製造装置	1.25	
投資証券	-	2.26
合計		98.78

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24年11月30日現在

種類	取引所等	名称	買建 / 売建	数量	簿価 （円）	時価 （円）	投資 比率 （％）
----	------	----	---------	----	-----------	-----------	-----------------

株価指数 先物取引	シカゴ商業取引 所	SP500 12/12	買建	60	1,734,358,386	1,743,859,260	0.77
株価指数 先物取引	ユーレックス・ ドイツ金融先物 取引所	DJ EUR 12/12	買建	214	568,999,162	588,055,843	0.26
株価指数 先物取引	ロンドン国際金 融先物オプショ ン取引所	FTSE 12/12	買建	41	312,621,259	317,328,725	0.14
			買建合計	315	2,615,978,807	2,649,243,828	1.18

(注) 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。

〔外国債券パッシブ・マザーファンド〕

(1) 投資状況

平成24年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	104,805,183,996	41.24
	フランス	24,314,823,721	9.57
	イタリア	22,645,905,915	8.91
	ドイツ	22,318,429,490	8.78
	イギリス	19,799,186,013	7.79
	スペイン	10,238,468,447	4.03
	カナダ	7,115,817,948	2.80
	オランダ	6,819,584,108	2.68
	ベルギー	6,617,490,318	2.60
	オーストリア	4,327,837,989	1.70
	オーストラリア	3,936,275,373	1.55
	メキシコ	2,443,863,567	0.96
	デンマーク	2,233,176,468	0.88
	ポーランド	1,876,426,846	0.74
	アイルランド	1,809,806,036	0.71
	フィンランド	1,538,047,544	0.61
	南アフリカ	1,474,833,167	0.58
	スウェーデン	1,450,152,333	0.57
	マレーシア	1,316,128,100	0.52
	シンガポール	1,050,965,586	0.41
スイス	1,036,426,021	0.41	
ノルウェー	630,821,508	0.25	
	小計	249,799,650,494	98.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,356,588,671	1.71
合計(純資産総額)		254,156,239,165	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24年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債 証券	US T 2.625% 20/11/15	18,000,000	8,863.82	1,595,488,950	9,085.16	1,635,329,988	2.625	2020/11/15	0.64
アメリカ	国債 証券	US T 0.375% 150415	17,000,000	8,211.46	1,395,949,704	8,226.11	1,398,439,443	0.375	2015/04/15	0.55
アメリカ	国債 証券	US T 4.75% 41/02/15	11,000,000	11,394.15	1,253,356,500	11,587.90	1,274,669,206	4.750	2041/02/15	0.50
アメリカ	国債 証券	US T 3.625% 21/02/15	13,000,000	9,554.14	1,242,039,337	9,725.44	1,264,307,977	3.625	2021/02/15	0.50
アメリカ	国債 証券	US T 3.625% 20/02/15	13,000,000	9,558.76	1,242,639,840	9,675.40	1,257,802,533	3.625	2020/02/15	0.49
アメリカ	国債 証券	US T 1.375% 190228	14,000,000	8,209.77	1,149,367,804	8,456.43	1,183,900,949	1.375	2019/02/28	0.47
アメリカ	国債 証券	US T 4.25% 40/11/15	11,000,000	10,542.15	1,159,637,050	10,737.19	1,181,090,900	4.250	2040/11/15	0.46
アメリカ	国債 証券	UST 0.25 2015/07/15	14,000,000	8,202.81	1,148,394,002	8,196.60	1,147,524,350	0.250	2015/07/15	0.45
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 0.25	14,000,000	8,184.98	1,145,897,794	8,192.75	1,146,985,437	0.250	2015/09/15	0.45
アメリカ	国債 証券	US T 3.875% 40/8/15	11,000,000	9,905.72	1,089,629,750	10,105.25	1,111,577,607	3.875	2040/08/15	0.44
アメリカ	国債 証券	US T 4.375% 40/05/15	10,000,000	10,737.19	1,073,719,000	10,942.49	1,094,249,000	4.375	2040/05/15	0.43
アメリカ	国債 証券	US T 0.25% 15/01/15	13,000,000	8,201.49	1,066,194,206	8,206.22	1,066,809,377	0.250	2015/01/15	0.42
アメリカ	国債 証券	US T 0.25% 15/05/15	13,000,000	8,188.56	1,064,513,792	8,199.81	1,065,975,345	0.250	2015/05/15	0.42
フランス	国債 証券	FRTR 3.0% 15/10/25	9,000,000	11,160.20	1,004,418,401	11,497.81	1,034,802,945	3.000	2015/10/25	0.41
アメリカ	国債 証券	US T 3.125% 21/05/15	11,000,000	9,182.04	1,010,024,675	9,395.04	1,033,454,537	3.125	2021/05/15	0.41
アメリカ	国債 証券	US T 3.5% 20/05/15	10,500,000	9,475.82	994,961,814	9,614.45	1,009,517,840	3.500	2020/05/15	0.40
ドイツ	国債 証券	OBL 2.25% 15/04/10	9,000,000	11,292.00	1,016,280,293	11,215.45	1,009,390,770	2.250	2015/04/10	0.40
アメリカ	国債 証券	US T 2.625% 20/8/15	11,000,000	8,881.27	976,940,580	9,087.73	999,650,613	2.625	2020/08/15	0.39
フランス	国債 証券	BTNS 2.5% 15/01/15	8,700,000	11,158.66	970,803,474	11,190.41	973,565,996	2.500	2015/01/15	0.38
イギリス	国債 証券	UKT 2% 16/01/22	7,000,000	13,818.20	967,274,602	13,809.64	966,675,185	2.000	2016/01/22	0.38
フランス	国債 証券	FRANCE 3.75% 17/04/25	8,000,000	11,472.21	917,776,949	12,079.89	966,391,452	3.750	2017/04/25	0.38
アメリカ	国債 証券	US T 2.125% 21/08/15	11,000,000	8,435.26	927,879,012	8,711.77	958,295,495	2.125	2021/08/15	0.38
フランス	国債 証券	FRTR 5% 16/10/25	7,600,000	12,102.26	919,772,417	12,495.43	949,653,299	5.000	2016/10/25	0.37
フランス	国債 証券	FRTR 4.25% 19/04/25	7,400,000	11,781.79	871,853,153	12,644.82	935,716,772	4.250	2019/04/25	0.37
アメリカ	国債 証券	US T 3.125% 19/05/15	10,000,000	9,227.82	922,782,440	9,352.69	935,269,812	3.125	2019/05/15	0.37
フランス	国債 証券	FRTR 3.0% 220425	8,000,000	10,923.88	873,910,633	11,633.66	930,692,940	3.000	2022/04/25	0.37
アメリカ	国債 証券	US T 0.875% 16/12/31	11,000,000	8,285.55	911,411,010	8,339.02	917,293,231	0.875	2016/12/31	0.36
アメリカ	国債 証券	US T 1% 14/05/15	11,000,000	8,353.53	918,888,555	8,301.81	913,200,062	1.000	2014/05/15	0.36
フランス	国債 証券	FRTR 4.25% 23/10/25	7,000,000	11,726.89	820,882,510	12,798.57	895,900,103	4.250	2023/10/25	0.35
アメリカ	国債 証券	US T 2.125% 14/11/30	10,500,000	8,637.35	906,922,377	8,515.45	894,123,205	2.125	2014/11/30	0.35

ロ 種類別の投資比率

平成24年11月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.29
合計	98.29

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24年11月30日現在

種類	取引所等	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	市場外取引	米ドル	売建	6,060,045.40	496,005,625	497,590,327	0.20
為替予約 取引	市場外取引	ユーロ	売建	4,333,047.40	458,699,864	461,642,869	0.18
為替予約 取引	市場外取引	英ポンド	売建	1,029,727.46	134,941,664	135,645,998	0.05
-			売建合計	11,422,820.26	1,089,647,153	1,094,879,194	0.43

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

〔マネーインカム・マザーファンド〕

(1) 投資状況

平成24年11月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	1,522,659,605	98.71
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		19,884,835	1.29
合計（純資産総額）		1,542,544,440	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

平成24年11月30日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債 証券	第247回利付国 債(10年)	738,500,000	100.36	741,172,830	100.20	739,999,155	0.800	2013/03/20	47.97
日本	国債 証券	第256回利付国 債(10年)	258,500,000	101.40	262,124,170	101.36	262,015,600	1.400	2013/12/20	16.99
日本	国債 証券	第253回利付国 債(10年)	258,500,000	101.62	262,710,890	101.19	261,586,490	1.600	2013/09/20	16.96
日本	国債 証券	第250回利付国 債(10年)	258,500,000	100.41	259,582,239	100.21	259,058,360	0.500	2013/06/20	16.79

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成24年11月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.71
合計	98.71

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

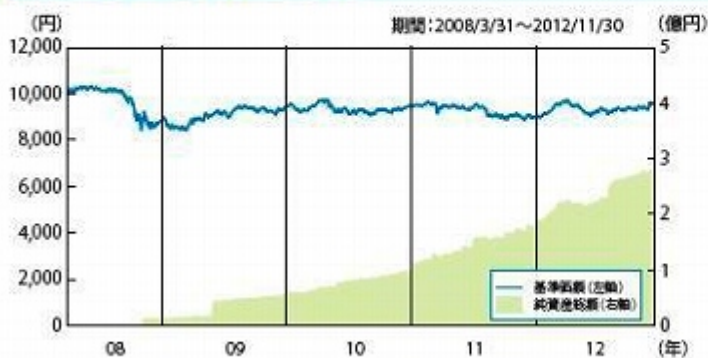
該当事項はありません。

〔参考情報〕

基準日2012年11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



分配の推移

決算期	分配金
2012年4月	0円
2011年4月	0円
2010年4月	0円
2009年4月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

年間収益率の推移（暦年ベース）



2008年のファンドの収益率は、ファンドの設定日（2008年3月31日）から年末までの騰落率を表示しています。
 2012年の収益率は、年初から2012年11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】

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

<訂正前>

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。）を法令および社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

なお、外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとし、予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

（略）

<訂正後>

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

なお、外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとし、予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

（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」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期（平成23年4月14日から平成24年4月13日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

<訂正後>

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期（平成23年4月14日から平成24年4月13日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

3. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

4. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期中間計算期間（平成24年4月14日から平成24年10月13日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1 【財務諸表】

[追加]

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

中間財務諸表

【スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

第5期中間計算期間 （平成24年10月13日現在）	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	505,026
コール・ローン	778,733
親投資信託受益証券	269,334,016
未収利息	2
流動資産合計	270,617,777
資産合計	270,617,777
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	37,882
未払委託者報酬	707,216
その他未払費用	6,248
流動負債合計	751,346
負債合計	751,346
純資産の部	
元本等	
元本	290,111,894
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	20,245,463
元本等合計	269,866,431
純資産合計	269,866,431
負債純資産合計	270,617,777

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

第5期中間計算期間 自 平成24年 4月14日 至 平成24年10月13日	
営業収益	
受取利息	57
有価証券売買等損益	3,520,780
営業収益合計	3,520,723
営業費用	
受託者報酬	37,882
委託者報酬	707,216

その他費用	6,248
営業費用合計	751,346
営業損失（ ）	4,272,069
経常損失（ ）	4,272,069
中間純損失（ ）	4,272,069
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	131,812
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	11,412,244
剰余金増加額又は欠損金減少額	334,770
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	334,770
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,027,732
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,027,732
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	20,245,463

(3) 【中間注記表】
(重要な会計方針の注記)

項目	第 5 期中間計算期間 自 平成24年 4 月14日 至 平成24年10月13日
資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第 5 期中間計算期間 (平成24年10月13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 290,111,894口
2 . 元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 20,245,463円
3 . 1 単位当たり純資産額	0.9302円 (1 万口 = 9,302円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第 5 期中間計算期間 (平成24年10月13日現在)
1 . 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 . 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

第 5 期中間計算期間（平成24年10月13日現在）

第 5 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 5 期中間計算期間 (平成24年10月13日現在)
期首元本額	231,415,652円
期中追加設定元本額	65,227,037円
期中一部解約元本額	6,530,795円

（参考情報）

スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）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」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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24年10月13日現在）
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,252,910,314
株式	266,550,950,981
派生商品評価勘定	551,600
未収配当金	2,886,969,253
未収利息	4,456
前払金	110,596,000
差入委託証拠金	42,860,000
流動資産合計	272,844,842,604
資産合計	272,844,842,604
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	111,718,800
流動負債合計	111,718,800
負債合計	111,718,800
純資産の部	
元本等	
元本	
元本	276,063,760,114
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,330,636,310
元本等合計	272,733,123,804
純資産合計	272,733,123,804
負債純資産合計	272,844,842,604

（注）「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」は、毎年11月30日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成24年10月13日現在における同マザーファンドの状況です。

（2）注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成24年4月14日 至 平成24年10月13日

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年10月13日現在)				
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 <table 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: right;">5,281,200,000円</td> </tr> </table>	<u>担保資産</u>	<u>金額</u>	株式	5,281,200,000円
<u>担保資産</u>	<u>金額</u>				
株式	5,281,200,000円				
2. 受益権総数	平成24年10月13日現在における受益権の総数 276,063,760,114口				
3. 元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 3,330,636,310円				
4. 1単位当たり純資産額	0.9879円 (1万口=9,879円)				

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年10月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2)派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3)コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成24年10月13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	うち1年超	時価	評価損益

市場取引	株価指数先物取引 (TOPIX先物) 買建	6,288,196,000	-	6,177,600,000	110,596,000
		(6,288,767,200)	(-)		(111,167,200)
	買建 合計	6,288,196,000	-	6,177,600,000	110,596,000
		(6,288,767,200)	(-)		(111,167,200)

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

なお、()内は手数料相当額を含んだ場合の金額を表わしています。

4. 株価指数先物取引の取引市場は、東京証券取引所です。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成24年10月13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	261,559,293,680円
同期中における追加設定元本額	17,688,438,723円
同期中における一部解約元本額	3,183,972,289円
平成24年10月13日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,074,565,067円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	522,901,235円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,499,529,816円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,655,217,961円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	60,653,201円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	5,873,469円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	7,533,600円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	6,863,376円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	8,021,009円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	2,330,387円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	4,747,822円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,054,561,110円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	40,908,288円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	65,314,243,605円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	701,008,241円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>	50,610,404,233円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	17,346,369,503円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	7,482,820,548円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	25,924,294,947円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	189,056,624円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	576,348,463円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	91,898,255円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	2,509,901,596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>	130,681,722円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,022,231,606円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,083,898,114円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	5,065,106,696円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	10,650,151,703円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,342,684,288円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	11,003,841,272円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	229,880,493円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	2,940,253,301円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	46,266,770,870円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	332,224,312円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	163,796,304円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	59,094,662円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	832,836,134円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,471,492,704円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	576,194,479円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	388,934,255円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	165,293,313円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	32,513,408円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	355,776,059円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	3,560,835,577円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA（適格機関投資家専用）	534,524,657円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	133,116,649円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	22,496,524円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	9,078,656円
合計	276,063,760,114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24年10月13日現在）
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	954,244,176
国債証券	365,712,310,570
地方債証券	30,733,858,460
特殊債券	48,362,294,549
社債券	29,002,028,300
未収利息	1,317,126,212
前払費用	28,271,423
流動資産合計	476,110,133,690
資産合計	476,110,133,690
負債の部	
流動負債	
未払金	20,143,800
未払解約金	53,919,536
流動負債合計	74,063,336
負債合計	74,063,336
純資産の部	
元本等	

元本	
元本	419,828,076,678
剰余金	
剰余金又は欠損金()	56,207,993,676
元本等合計	476,036,070,354
純資産合計	476,036,070,354
負債純資産合計	476,110,133,690

(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24年10月13日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成24年4月14日 至 平成24年10月13日
資産の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券(売買目的有価証券)個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年10月13日現在)
1. 受益権総数	平成24年10月13日現在における受益権の総数 419,828,076,678口
2. 1単位当たり純資産額	1.1339円 (1万口=11,339円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年10月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成24年10月13日現在)

平成24年10月13日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（その他の注記）

(平成24年10月13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	445,931,665,232円
同期中における追加設定元本額	1,025,171,959円
同期中における一部解約元本額	27,128,760,513円
平成24年10月13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）	1,284,286,739円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	2,264,216,446円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	453,569,019円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	108,552,997円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	16,050,897円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	13,388,046円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	7,279,096円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	6,098,335円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,444,778円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	2,659,933円
SMAM・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	9,978,404,914円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	41,869,038,860円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	10,105,501,941円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	23,193,695,962円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	511,620,839円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	693,945,806円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	144,781,936円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	317,843,360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＞	118,604,029円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	2,492,649,253円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	2,799,925,688円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	6,820,481,048円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	16,809,309,757円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,223,241,916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）	9,608,789,938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）	60,440,983,028円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	822,913,406円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	10,701,440,343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）	189,564,367,842円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	1,276,951,206円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	292,222,765円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	52,266,185円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	3,605,994,080円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	4,347,398,478円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T＜適格機関投資家専用＞	3,833,064,546円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	1,516,944,280円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	303,713,332円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	28,434,516円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞	741,048,282円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	10,550,317,160円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2＜適格機関投資家専用＞	868,949,260円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	19,716,542円
SMAM・FGグローバルバランス25VA＜適格機関投資家限定＞	15,969,894円
合計	419,828,076,678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24年10月13日現在)
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,435,493,896
コール・ローン	302,472,953
株式	209,464,034,292
投資証券	4,907,397,679
派生商品評価勘定	3,424,714
未収入金	3,182,697
未収配当金	305,432,942
未収利息	414
差入委託証拠金	715,033,204
流動資産合計	217,136,472,791
資産合計	217,136,472,791
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,313,326
未払解約金	336,136,151
流動負債合計	348,449,477
負債合計	348,449,477
純資産の部	
元本等	
元本	
元本	161,824,484,300
剰余金	
剰余金又は欠損金()	54,963,539,014
元本等合計	216,788,023,314
純資産合計	216,788,023,314
負債純資産合計	217,136,472,791

(注)「外国株式インデックス・マザーファンド」は、毎年11月30日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。上記の貸借対照表は平成24年10月13日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成24年4月14日 至平成24年10月13日
----	-----------------------------

1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式、新株予約権証券および投資証券(売買目的有価証券) 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、取引所もしくは店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)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。 なお売買停止措置がとられている銘柄について、必要であると判断された場合は、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> <p>(2)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(3)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年10月13日現在)
1. 受益権総数	<p>平成24年10月13日現在における受益権の総数 161,824,484,300口</p>
2. 1単位当たり純資産額	<p>1.3396円 (1万口 = 13,396円)</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年10月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>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。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券(株式および投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2)派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成24年10月13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				
	S P 5 0 0	1,574,852,086 (20,056,700米ドル)	()	1,570,211,552 (19,997,600米ドル)	4,640,534 (59,100米ドル)
	D J E U R	522,720,179 (5,146,910ユーロ)	()	516,747,436 (5,088,100ユーロ)	5,972,743 (58,810ユーロ)
	F T S E	283,629,317 (2,251,205英ポンド)	()	285,333,332 (2,264,730英ポンド)	1,704,015 (13,525英ポンド)
	買建 合計	2,381,201,582		2,372,292,320	8,909,262

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

通貨関連

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場外取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	157,039,000	-	157,020,000	19,000
	オーストラリアドル	16,119,400	-	16,118,000	1,400
	ニュージーランドドル	3,211,250	-	3,211,000	250
	売建 合計	176,369,650	-	176,349,000	20,650

(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24年10月13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	165,644,585,873円
同期中における追加設定元本額	4,648,003,352円
同期中における一部解約元本額	8,468,104,925円
平成24年10月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	4,883,593,171円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	201,188,711円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	828,910,389円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	510,214,280円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	20,968,049円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	2,172,169円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	3,078,386円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	3,536,914円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	4,431,369円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,322,612円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	3,019,856円
外国株式指数ファンド	248,054,391円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	610,533円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	33,122,519,950円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	262,503,175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＞	20,016,641,426円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	8,912,174,764円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	5,056,701,286円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	19,985,909,075円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	72,389,950円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	294,600,440円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	52,079,054円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	2,223,748,335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＞	158,139,717円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	531,978,112円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	2,417,789,413円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	3,945,271,225円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	6,081,994,010円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,044,128,518円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	2,756,216,476円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	8,548,070,022円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	526,870,172円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	2,295,694,502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）	35,469,654,174円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	87,253,515円

SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	51,814,791円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	19,393,171円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	209,941,827円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	480,703,545円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	457,945,186円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	17,506,484円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	13,751,155円
合計	161,824,484,300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24年10月13日現在)
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	665,036,123
コール・ローン	881,839,814
国債証券	241,317,150,369
未収入金	157,965,002
未収利息	2,640,491,552
前払費用	95,410,681
流動資産合計	245,757,893,541
資産合計	245,757,893,541
負債の部	
流動負債	
未払解約金	235,815,752
流動負債合計	235,815,752
負債合計	235,815,752
純資産の部	
元本等	
元本	
元本	211,973,561,542
剰余金	
剰余金又は欠損金()	33,548,516,247
元本等合計	245,522,077,789
純資産合計	245,522,077,789
負債純資産合計	245,757,893,541

(注) 「外国債券パッシブ・マザーファンド」は、毎年12月17日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。上記の貸借対照表は平成24年10月13日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成24年4月14日 至平成24年10月13日
----	-----------------------------

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年10月13日現在)
1. 受益権総数	平成24年10月13日現在における受益権の総数 211,973,561,542口
2. 1単位当たり純資産額	1.1583円 (1万口=11,583円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年10月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2)派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3)コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成24年10月13日現在)

平成24年10月13日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

(その他の注記)

(平成24年10月13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	217,156,318,934円
同期中における追加設定元本額	1,041,971,063円
同期中における一部解約元本額	6,224,728,455円
平成24年10月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	3,239,958,518円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	234,334,041円

三井住友・DC年金バランス50(標準型)	645,505,426円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	300,494,757円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	35,308,219円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	4,728,509円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	5,988,583円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	4,492,270円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	4,723,603円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,294,826円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	2,423,959円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,374,445,524円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	11,580,978,694円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	36,224,191,335円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	10,905,460,967円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	23,291,991,336円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	84,758,873円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	172,601,358円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	41,201,790円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,272,698,099円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	177,237,439円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,143,904,713円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,817,050,369円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	6,858,747,318円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	14,172,141,936円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,218,287,296円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	23,225,992,486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)	2,050,318,088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)	10,000,729,761円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	408,474,370円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	10,627,707,449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)	41,495,729,285円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	294,003,741円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	88,214,320円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	22,574,010円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	368,024,769円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,307,394,571円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	383,151,547円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	344,139,271円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	89,900,088円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	12,218,025円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	3,166,585,298円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	89,443,849円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	120,833,253円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	63,177,603円
合計	211,973,561,542円

「マネーインカム・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

対象年月日	(平成24年10月13日現在)
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	18,845,811
国債証券	1,573,325,925

未収利息	2,334,132
前払費用	921,728
流動資産合計	1,595,427,596
資産合計	1,595,427,596
負債の部	
流動負債	
未払解約金	500,000
流動負債合計	500,000
負債合計	500,000
純資産の部	
元本等	
元本	
元本	1,579,002,296
剰余金	
剰余金又は欠損金()	15,925,300
元本等合計	1,594,927,596
純資産合計	1,594,927,596
負債純資産合計	1,595,427,596

(注)「マネーインカム・マザーファンド」は、毎年4月13日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。上記の貸借対照表は平成24年10月13日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成24年4月14日 至 平成24年10月13日
資産の評価基準及び評価方法	国債証券(売買目的有価証券) 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年10月13日現在)
1. 受益権総数	平成24年10月13日現在における受益権の総数 1,579,002,296口
2. 1単位当たり純資産額	1.0101円 (1万口=10,101円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年10月13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	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成24年10月13日現在)

平成24年10月13日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

(その他の注記)

(平成24年10月13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	1,686,382,428円
同期中における追加設定元本額	593,936,805円
同期中における一部解約元本額	701,316,937円
平成24年10月13日現在における元本の内訳	
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	17,166,784円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	3,723,289円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	653,407円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	483,999円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	515,598円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	129,086円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	282,118円
三井住友・ロシア株式オープン	999,001円
S M A M円高期待ファンド(豪ドル安型)	8,342,304円
S M A M円高期待ファンド(米ドル安型)	6,560,497円
S M A M円高期待ファンド(ユーロ安型)	11,905,188円
アジア高成長国C Bファンド	29,767,812円
日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
S M A M・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	241,203,020円
S M A M・バランス先物ファンドV A 2 0 <適格機関投資家限定>	673,415,391円
S M A M・F GマネーファンドV A <適格機関投資家限定>	583,458,290円
合計	1,579,002,296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】

平成24年11月30日現在

資産総額

284,061,511円

負債総額	417,815 円
純資産総額 (-)	283,643,696 円
発行済口数	294,972,376 口
1口当たり純資産額 (/)	0.9616 円
(1万口当たり純資産額	9,616 円)

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<訂正前>

イ 資本金の額および株式数

	平成24年5月31日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

(略)

<訂正後>

イ 資本金の額および株式数

	平成24年11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24年5月31日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成24年5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	$\frac{36}{(2)}$	$\frac{41,133}{(5,287)}$
	追加型	$\frac{311}{(135)}$	$\frac{4,452,836}{(2,943,374)}$
	計	$\frac{347}{(137)}$	$\frac{4,493,969}{(2,948,661)}$
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		$\frac{347}{(137)}$	$\frac{4,493,969}{(2,948,661)}$

（ ）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

<訂正後>

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

平成24年11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24年11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	$\frac{25}{(4)}$	$\frac{39,242}{(18,550)}$
	追加型	$\frac{318}{(135)}$	$\frac{4,667,924}{(3,094,938)}$
	計	$\frac{343}{(139)}$	$\frac{4,707,166}{(3,113,488)}$
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		$\frac{343}{(139)}$	$\frac{4,707,166}{(3,113,488)}$

（ ）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】

<訂正前>

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

<訂正後>

- 1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、第26期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）及び第27期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第28期中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

[追加]

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」に下記の記載が「中間財務諸表」として追加されます。

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

（単位：千円）

	第28期中間会計期間 (平成24年9月30日)
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	16,703,596
有価証券	3,999,207
前払費用	257,951
未収委託者報酬	3,221,255
未収運用受託報酬	414,813
未収投資助言報酬	455,610
未収収益	18,523
繰延税金資産	166,931
その他	2,597
流動資産合計	25,240,487

固定資産		
有形固定資産	1	278,883
無形固定資産		387,892
投資その他の資産		
投資有価証券		5,955,910
その他		1,603,125
投資その他の資産合計		7,559,035
固定資産合計		8,225,811
資産合計		33,466,298
負債の部		
流動負債		
預り金		46,700
未払金		1,967,237
未払費用		962,591
未払法人税等		527,043
前受収益		7,481
賞与引当金		264,855
その他	2	80,694
流動負債合計		3,856,605
固定負債		
退職給付引当金		1,583,169
固定負債合計		1,583,169
負債合計		5,439,775
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
資本剰余金合計		8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		60,000
別途積立金		1,476,959
繰越利益剰余金		15,729,295
利益剰余金合計		17,550,500
株主資本合計		28,179,484
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		152,960
評価・換算差額等合計		152,960
純資産合計		28,026,523
負債純資産合計		33,466,298

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第28期中間会計期間

（自 平成24年 4月 1日
至 平成24年 9月30日）

営業収益		
委託者報酬		12,101,664
運用受託報酬		947,312
投資助言報酬		834,061
その他の営業収益		62,525
営業収益計		13,945,563
営業費用		8,998,609
一般管理費	1	3,693,404
営業利益		1,253,548
営業外収益	2	24,695
営業外費用	3	5,196
経常利益		1,273,048
特別利益		336
特別損失	4	57,288
税引前中間純利益		1,216,096
法人税、住民税及び事業税		497,151
法人税等調整額		47,995
法人税等合計		449,155
中間純利益		766,940

(3) 中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

	第28期中間会計期間 （自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日）	
株主資本		
資本金		
当期首残高		2,000,000
当中間期末残高		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高		8,628,984
当中間期末残高		8,628,984
資本剰余金合計		
当期首残高		8,628,984
当中間期末残高		8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高		284,245
当中間期末残高		284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		

当期首残高	60,000
当中間期末残高	60,000
別途積立金	
当期首残高	1,476,959
当中間期末残高	1,476,959
繰越利益剰余金	
当期首残高	15,791,435
当中間期変動額	
剰余金の配当	829,080
中間純利益	766,940
当中間期変動額合計	62,139
当中間期末残高	15,729,295
利益剰余金合計	
当期首残高	17,612,639
当中間期変動額	
剰余金の配当	829,080
中間純利益	766,940
当中間期変動額合計	62,139
当中間期末残高	17,550,500
株主資本合計	
当期首残高	28,241,623
当中間期変動額	
剰余金の配当	829,080
中間純利益	766,940
当中間期変動額合計	62,139
当中間期末残高	28,179,484
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	76,327
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	229,288
当中間期変動額合計	229,288
当中間期末残高	152,960
評価・換算差額等合計	
当期首残高	76,327
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	229,288
当中間期変動額合計	229,288
当中間期末残高	152,960
純資産合計	
当期首残高	28,317,951
当中間期変動額	
剰余金の配当	829,080
中間純利益	766,940
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	229,288
当中間期変動額合計	291,428
当中間期末残高	28,026,523

重要な会計方針

1．資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

満期保有目的の債券

償却原価法

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

（会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。これによる当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に与える影響は軽微であります。

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

3．引当金の計上基準

(1)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(2)退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間において発生していると認められる額を計上しております。

過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第28期中間会計期間 (平成24年9月30日)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	885,491千円
2. 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3. 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。	
	当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。
	当座借越極度額の総額 10,000,000千円
	借入実行残高 -
	差引額 10,000,000千円
4. 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額45,460千円の支払保証を行っております。	

（中間損益計算書関係）

第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日至平成24年9月30日)	
1. 減価償却実施額	
有形固定資産	54,001千円
無形固定資産	34,225千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	3,069千円
受取配当金	15,103千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	5,196千円
4. 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	36,226千円
投資有価証券評価損	17,803千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日至平成24年9月30日）

1. 発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

2. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年6月25日 定時株主総会	普通株式	829,080	47,000	平成24年 3月31日	平成24年 6月26日

(リース取引関係)

第28期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
1. オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	583,720千円
1年超	1,469,547千円
合計	2,053,268千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第28期中間会計期間(平成24年9月30日)

平成24年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	16,703,596	16,703,596	-
(2)未収委託者報酬	3,221,255	3,221,255	-
(3)未収運用受託報酬	414,813	414,813	-
(4)未収投資助言報酬	455,610	455,610	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	3,999,207	3,998,800	407
その他有価証券	5,922,072	5,922,072	-
(6)投資その他の資産			
長期差入保証金	680,513	680,513	-
資産計	31,397,067	31,396,660	407
(1)未払金			
未払手数料	1,768,995	1,768,995	-
負債計	1,768,995	1,768,995	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

(1)現金及び預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収運用受託報酬及び

(4)未収投資助言報酬

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

(5)有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券については取引金融機関から提示された価格及び業界団体が

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

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

（6）投資その他の資産

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）

	中間貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	33,540
合計	33,838
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。また、上記の表中にある「中間貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当中間会計期間における減損処理額は、14,903千円です。

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

（有価証券関係）

第28期中間会計期間（平成24年9月30日）

1．満期保有目的の債券

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2) 中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えないもの	3,999,207	3,998,800	407
小計	3,999,207	3,998,800	407

合計	3,999,207	3,998,800	407
----	-----------	-----------	-----

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(中間貸借対照表計上額 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、記載していません。

3. その他有価証券

(単位:千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	2,793,142	2,705,290	87,851
小計	2,793,142	2,705,290	87,851
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,128,929	3,369,742	240,812
小計	3,128,929	3,369,742	240,812
合計	5,922,072	6,075,033	152,960

(注)非上場株式等(中間貸借対照表計上額 33,838千円)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、記載していません。また、上記の表中にある「中間貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当中間会計期間における減損処理額は、2,900千円です。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(資産除去債務等)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第28期中間会計期間(自平成24年4月1日至平成24年9月30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	12,101,664	947,312	834,061	62,525	13,945,563

(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中間損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高の記載を省略しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(1 株当たり情報)

第28期中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)	
1株当たり純資産額	1,588,805円19銭
1株当たり中間純利益	43,477円35銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。</p>	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	28,026,523千円
普通株式に係る純資産額	28,026,523千円
普通株式の発行済株式数	17,640株
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640株
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益	766,940千円
普通株式に係る中間純利益	766,940千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	17,640株

(追加情報)

第28期中間会計期間(自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)

1. トヨタアセットマネジメント株式会社との経営統合

当社は、平成24年9月28日に、トヨタアセットマネジメント株式会社、トヨタファイナンシャルサービス株式会社、あいおいニッセイ同和損害保険株式会社、三井住友海上火災保険株式会社と、平成25年4月1日を効力発生日としてトヨタアセットマネジメント株式会社と経営統合する旨の合意書を締結致しました。

(1) 目的

当社とトヨタアセットマネジメント株式会社の経営統合により、地域性や商品性などの相互補完関係を活かすことで、国内における事業基盤の飛躍的な拡大と運用・商品開発力の強化、更に、経営におけるシナジー発揮などを通じ、お客様サービスのより一層の向上が行えるとの

判断に至り、この度合意いたしました。

(2) 合併する相手会社の名称

トヨタアセットマネジメント株式会社

(3) 合併の方法、合併後の会社名

当該合併は、当社がトヨタアセットマネジメント株式会社の全株式を取得した後に行い、当社を存続会社とする吸収合併方式であり、トヨタアセットマネジメント株式会社は解散いたします。合併後の名称に変更はありません。

(4) 合併比率、合併交付金の額、合併により発行する株式の種類及び数

当社は、トヨタアセットマネジメント株式会社の発行済株式の全てを所有する予定となっているため、合併に際しては新株の発行及び金銭等の交付はいたしません。

(5) 相手会社の主な事業の内容、規模（平成24年3月期）

名称	トヨタアセットマネジメント株式会社
事業の内容	投資運用業等
資本金	600,000千円
純資産	1,385,963千円
総資産	1,833,325千円
営業収益	1,980,544千円
当期純利益	5,635千円

(6) 合併の時期

平成25年4月1日（予定）

第2【その他の関係法人の概況】

原届出書「第三部 委託会社等の情報 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」の記載は、下記の通り更新されます。

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円（平成24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24年9月末現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

- (イ) 名称 住友生命保険相互会社
- (ロ) 資本金の額 639,000百万円（平成24年9月末現在の基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。）
- (ハ) 事業の内容 保険業法に基づき、保険業を営んでいます。

独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月4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」に掲げられているスミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）の平成24年4月14日から平成24年10月13日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）の平成24年10月13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24年4月14日から平成24年10月13日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2．中間財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

[委託会社の中間監査報告書へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年11月30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
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	辰 巳 幸 久

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24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成24年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成24年9月28日に、トヨタアセットマネジメント株式会社、トヨタファイナンシャルサービス株式会社、あいおいニッセイ同和損害保険株式会社、三井住友海上火災保険株式会社と、平成25年4月1日を効力発生日としてトヨタアセットマネジメント株式会社と経営統合する旨の合意書を締結した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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。