

**【表紙】**

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年1月13日提出
【計算期間】	第9期中(自 平成28年4月14日至 平成28年10月13日)
【ファンド名】	S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土田 雅央
【連絡場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【電話番号】	03-5405-0740
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【ファンドの運用状況】

## (1)【投資状況】

## S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

平成28年10月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	882,931,959	98.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,935,359	1.33
合計(純資産総額)		894,867,318	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)【運用実績】

## 【純資産の推移】

## S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第8期 (平成28年 4月13日)	796,414,981	796,414,981	12,610	12,610
平成27年10月末日	779,423,445		13,229	
11月末日	804,482,235		13,300	
12月末日	811,509,603		13,138	
平成28年 1月末日	797,144,553		12,766	
2月末日	770,316,167		12,400	
3月末日	802,997,100		12,704	
4月末日	809,075,145		12,682	
5月末日	829,399,386		12,801	
6月末日	822,339,460		12,400	
7月末日	850,086,641		12,598	
8月末日	857,185,912		12,529	
9月末日	858,213,913		12,475	
10月末日	894,867,318		12,613	

## 【分配の推移】

## S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第8期	平成27年 4月14日～平成28年 4月13日	0

## 【収益率の推移】

## S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

	収益率（％）
第8期	5.9
第9期（中間期）	0.7

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

（参考）

## （1）投資状況

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

平成28年10月31日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	日本	193,600,531,850	98.19
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,567,658,401	1.81
合計（純資産総額）		197,168,190,251	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国／地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	買建	日本	3,403,800,000	1.72
合計	買建	-	3,403,800,000	1.72

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

平成28年10月31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	164,009,959,700	75.48
地方債証券	日本	16,256,109,732	7.48
特殊債券	日本	24,950,174,668	11.48
社債券	日本	9,657,807,000	4.44
	オランダ	503,197,000	0.23
	アメリカ	301,523,000	0.14
	オーストラリア	300,834,000	0.14
	小計	10,763,361,000	4.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,308,150,950	0.61
合計(純資産総額)		217,287,756,050	100.00

## 外国株式インデックス・マザーファンド

平成28年10月31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	88,393,678,301	57.59
	イギリス	10,162,942,117	6.62
	カナダ	5,850,780,071	3.81
	スイス	5,721,741,259	3.73
	ドイツ	5,484,991,541	3.57
	フランス	5,428,501,680	3.54
	オーストラリア	3,748,836,388	2.44
	オランダ	2,639,536,056	1.72
	アイルランド	2,490,657,724	1.62
	スペイン	1,937,148,635	1.26
	スウェーデン	1,645,246,202	1.07
	香港	1,481,181,912	0.96
	イタリア	1,059,556,260	0.69
	シンガポール	1,019,073,632	0.66
	デンマーク	1,006,875,203	0.66
	ジャージー	873,230,743	0.57
	ベルギー	785,937,702	0.51
	パミューダ	655,830,155	0.43
	フィンランド	577,872,737	0.38
	キュラソー	551,878,012	0.36

	ノルウェー	393,010,707	0.26
	ケイマン諸島	373,443,751	0.24
	イスラエル	371,364,641	0.24
	ルクセンブルグ	171,869,202	0.11
	オーストリア	122,951,463	0.08
	ニュージーランド	112,282,028	0.07
	ポルトガル	90,310,841	0.06
	リベリア	61,510,896	0.04
	英ヴァージン諸島	45,734,085	0.03
	パプアニューギニア	34,306,695	0.02
	マン島	14,583,782	0.01
	モーリシャス	10,518,698	0.01
	小計	143,317,383,119	93.37
投資証券	アメリカ	2,566,679,204	1.67
	オーストラリア	546,819,928	0.36
	フランス	219,645,597	0.14
	イギリス	142,806,263	0.09
	香港	94,160,580	0.06
	シンガポール	75,819,805	0.05
	カナダ	33,543,609	0.02
	小計	3,679,474,986	2.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,493,598,576	4.23
合計(純資産総額)		153,490,456,681	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,554,249,110	2.96
	買建	ドイツ	1,218,552,075	0.79
	買建	イギリス	480,725,107	0.31
	買建	オーストラリア	324,016,859	0.21
合計	買建	-	6,577,543,151	4.27

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
為替予約取引	買建		400,819,500	0.26

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

平成28年10月31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	72,321,801,599	42.84
	フランス	16,630,654,422	9.85
	イタリア	15,782,808,521	9.35
	ドイツ	12,293,714,736	7.28
	イギリス	11,543,512,899	6.84
	スペイン	9,111,954,019	5.40
	ベルギー	4,170,088,470	2.47
	オランダ	3,974,183,194	2.35
	カナダ	3,381,205,058	2.00
	オーストラリア	3,314,726,912	1.96
	オーストリア	2,451,995,648	1.45
	メキシコ	1,430,285,764	0.85
	アイルランド	1,422,313,127	0.84
	デンマーク	1,121,216,962	0.66
	フィンランド	993,969,182	0.59
	ポーランド	977,898,718	0.58
	南アフリカ	819,172,232	0.49
	スウェーデン	758,502,552	0.45
	マレーシア	671,598,809	0.40
	シンガポール	606,924,570	0.36
スイス	459,051,430	0.27	
ノルウェー	430,287,137	0.25	
	小計	164,667,865,961	97.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,140,882,548	2.45
合計(純資産総額)		168,808,748,509	100.00

## マネーインカム・マザーファンド

平成28年10月31日現在

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

特殊債券	日本	907,571,000	69.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		390,618,030	30.09
合計(純資産総額)		1,298,189,030	100.00

## 2【設定及び解約の実績】

## S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第8期	194,983,589	97,382,992
第9期(中間期)	91,044,294	35,119,079

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

### 3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期中間計算期間(平成28年4月14日から平成28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。

## 【SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 （平成28年 4月13日現在）	第9期中間計算期間 （平成28年10月13日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	12,799,417	-
コール・ローン	-	17,020,083
親投資信託受益証券	786,343,171	847,101,823
未収入金	370,000	790,000
流動資産合計	799,512,588	864,911,906
資産合計	799,512,588	864,911,906
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	564,709	990,092
未払受託者報酬	127,715	135,152
未払委託者報酬	2,383,959	2,522,741
未払利息	-	41
その他未払費用	21,224	22,723
流動負債合計	3,097,607	3,670,749
負債合計	3,097,607	3,670,749
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	631,553,994	687,479,209
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	164,860,987	173,761,948
元本等合計	796,414,981	861,241,157
純資産合計	796,414,981	861,241,157
負債純資産合計	799,512,588	864,911,906

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第8期中間計算期間 自 平成27年 4月14日 至 平成27年10月13日	第9期中間計算期間 自 平成28年 4月14日 至 平成28年10月13日
<b>営業収益</b>		
受取利息	184	-
有価証券売買等損益	17,885,117	2,765,952
営業収益合計	17,884,933	2,765,952
<b>営業費用</b>		
支払利息	-	2,643
受託者報酬	122,332	135,152
委託者報酬	2,283,338	2,522,741
その他費用	20,329	23,123
営業費用合計	2,425,999	2,683,659
営業利益又は営業損失( )	20,310,932	5,449,611
経常利益又は経常損失( )	20,310,932	5,449,611
中間純利益又は中間純損失( )	20,310,932	5,449,611
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( )	507,878	243,772
期首剰余金又は期首欠損金( )	181,831,124	164,860,987
剰余金増加額又は欠損金減少額	34,377,417	23,269,122
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	34,377,417	23,269,122
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,282,599	9,162,322
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,282,599	9,162,322
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	180,122,888	173,761,948

## （ 3 ）【中間注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第9期中間計算期間
	自 平成28年 4月14日 至 平成28年10月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## （ 中間貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第8期	第9期中間計算期間
	(平成28年 4月13日現在)	(平成28年10月13日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	631,553,994口	687,479,209口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.2610円 12,610円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.2528円 12,528円)

## （ 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

該当事項はありません。

## （ 金融商品に関する注記 ）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第9期中間計算期間 (平成28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ぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第8期 (平成28年 4月13日現在)	第9期中間計算期間 (平成28年10月13日現在)
期首元本額	533,953,397円	631,553,994円
期中追加設定元本額	194,983,589円	91,044,294円
期中一部解約元本額	97,382,992円	35,119,079円

## (参考)

SMAM・グローバルバランスファンド(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)

## 貸借対照表

	(平成28年 4月13日現在)	(平成28年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,851,945,023	-

	（平成28年 4月13日現在）	（平成28年10月13日現在）
コール・ローン	-	323,086,158
株式	194,753,607,746	188,183,602,250
派生商品評価勘定	10,560,160	14,413,440
未収入金	-	2,544,217,959
未収配当金	1,957,063,159	1,633,443,821
前払金	41,709,000	19,290,000
差入委託証拠金	110,540,000	-
流動資産合計	198,725,425,088	192,718,053,628
資産合計	198,725,425,088	192,718,053,628
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	52,439,800	33,785,520
未払金	-	14,920,000
未払解約金	75,879,277	362,702,281
未払利息	-	791
その他未払費用	-	49,518
流動負債合計	128,319,077	411,458,110
負債合計	128,319,077	411,458,110
純資産の部		
元本等		
元本	101,243,854,770	96,302,032,574
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	97,353,251,241	96,004,562,944
元本等合計	198,597,106,011	192,306,595,518
純資産合計	198,597,106,011	192,306,595,518
負債純資産合計	198,725,425,088	192,718,053,628

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成28年 4月14日 至平成28年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、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>
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準

受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年 4月13日現在)	(平成28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。 株式 2,811,500,000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。 株式 2,984,500,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	101,243,854,770口	96,302,032,574口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9616円 (10,000口当たりの純資産額 19,616円)	1口当たり純資産額 1.9969円 (10,000口当たりの純資産額 19,969円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年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28年 4月13日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,893,879,640	-	3,852,000,000	41,879,640
	東証株価指数先物	3,893,879,640	-	3,852,000,000	41,879,640

合計	3,893,879,640	-	3,852,000,000	41,879,640
----	---------------	---	---------------	------------

(平成28年10月13日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,938,012,080	-	3,918,640,000	19,372,080
	東証株価指数先物	3,938,012,080	-	3,918,640,000	19,372,080
合計		3,938,012,080	-	3,918,640,000	19,372,080

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成28年 4月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	119,948,691,565円
同期中における追加設定元本額	21,900,549,475円
同期中における一部解約元本額	40,605,386,270円
平成28年 4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	9,877,016,976円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	526,409,568円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,603,617,762円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,871,011,843円
S M A M ・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	82,073,887円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,599,842円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	19,254,141円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	62,363,262円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	47,388,076円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	28,126,160円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	62,046,755円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	2,706,316,638円

三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	897,341,453円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	277,828,450円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	556,342,681円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	760,763,475円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	16,978,928,129円
バランスファンドVA(安定運用型)＜適格機関投資家限定＞	121,263,347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＞	14,348,302,910円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	7,117,159,918円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	4,034,957,665円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	14,756,674,460円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	85,242,090円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	349,430,490円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	23,976,922円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,535,018,129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＞	85,688,096円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	573,208,020円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,715,554,716円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	2,896,392,095円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	5,284,633,258円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	130,398,140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)	3,489,737,244円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	102,988,021円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	187,530,886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)	3,136,160,809円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	170,710,285円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	76,427,722円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	36,368,520円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	373,012,538円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	629,102,601円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T＜適格機関投資家専用＞	267,908,539円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	182,110,004円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	82,740,483円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	13,703,184円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞	134,242,920円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	1,562,934,340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)	272,134,221円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2＜適格機関投資家専用＞	33,498,132円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	305,920円
SMAM・FGグローバルバランス25VA＜適格機関投資家限定＞	1,635,871円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	150,170円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-01＜適格機関投資家限定＞	67,123,006円
合計	101,243,854,770円

(平成28年10月13日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	101,243,854,770円
同期中における追加設定元本額	7,509,536,115円
同期中における一部解約元本額	12,451,358,311円
平成28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	10,219,400,057円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	564,912,083円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,754,260,349円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,977,337,459円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	85,389,275円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,827,446円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	20,708,091円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	62,270,694円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	53,169,524円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	30,502,259円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	72,920,223円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	2,351,671,437円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	1,232,363,714円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,768,633,824円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,897,647,989円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	2,230,832,681円
イオン・バランス戦略ファンド	13,009,459円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	14,790,477,303円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	87,395,679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〉	11,386,434,556円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	6,329,375,483円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	3,684,230,923円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	13,500,429,352円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	78,636,252円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	343,980,291円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	15,430,481円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	1,389,357,139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〉	81,318,128円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	566,966,978円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	1,658,993,445円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	2,833,351,810円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	4,820,888,435円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	129,635,642円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,387,879,381円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	108,796,597円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	180,442,758円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,628,801,335円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	163,659,868円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	72,357,161円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	33,196,127円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	359,330,687円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	595,509,453円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	262,965,806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 >	179,805,893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 >	80,832,950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 >	13,289,922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 >	111,596,768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 >	1,548,390,614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 )	256,507,215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 >	30,223,176円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	24,037円
S M A M ・ F G グローバルバランス2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	496,588円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド（安定成長型）< 適格機関投資家限定 >	515,336円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	213,842円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	129,687,317円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	62,174,245円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	54,577,037円
合計	96,302,032,574円

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

( 単位：円 )

	( 平成28年 4月13日現在 )	( 平成28年10月13日現在 )
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,087,298,169	-
コール・ローン	-	745,292,710
国債証券	187,852,950,690	162,807,881,940
地方債証券	19,705,368,838	16,471,595,710
特殊債券	26,958,862,667	25,364,960,925
社債券	14,582,429,000	10,768,642,000
未収入金	853,942,550	-
未収利息	560,459,266	470,612,691
前払費用	17,708,592	5,108,386
流動資産合計	251,619,019,772	216,634,094,362
資産合計	251,619,019,772	216,634,094,362
負債の部		
流動負債		
未払解約金	678,574,051	95,663,861
未払利息	-	1,826
その他未払費用	-	26,211
流動負債合計	678,574,051	95,691,898
負債合計	678,574,051	95,691,898
純資産の部		
元本等		
元本	197,030,769,648	170,427,735,518
剰余金		
剰余金又は欠損金 ( )	53,909,676,073	46,110,666,946
元本等合計	250,940,445,721	216,538,402,464
純資産合計	250,940,445,721	216,538,402,464
負債純資産合計	251,619,019,772	216,634,094,362

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年 4月14日 至 平成28年10月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成28年 4月13日現在）	（平成28年10月13日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	197,030,769,648口	170,427,735,518口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2736円 (10,000口当たりの純資産額 12,736円)	1口当たり純資産額 1.2706円 (10,000口当たりの純資産額 12,706円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成28年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、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
-----------	--

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(平成28年 4月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	249,296,427,435円
同期中における追加設定元本額	12,491,448,439円
同期中における一部解約元本額	64,757,106,226円
平成28年 4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)	2,239,138,488円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,078,591,494円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	898,514,497円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	335,784,395円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	48,681,261円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	82,366,502円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	159,789,344円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	68,089,290円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	34,119,985円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	62,891,892円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	6,216,322円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,950,209,186円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,038,718,638円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	790,427,719円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	6,086,628,952円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	30,018,527,129円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	9,351,680,801円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	22,548,239,869円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	385,746,395円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	714,264,941円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	66,006,960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 >	330,459,356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 >	133,253,321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 >	2,376,703,215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 >	2,697,590,770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 >	6,873,437,309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 >	14,472,854,467円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	208,544,294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 )	7,581,275,181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 )	33,554,495,091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 >	681,827,212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 >	1,196,087,768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 )	22,100,514,454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 >	1,133,636,491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 >	240,044,186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 >	53,970,912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 >	2,814,410,510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 >	3,237,414,419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 >	3,003,591,941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 >	1,248,810,687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 >	261,712,641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 >	21,167,802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 >	488,152,676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 >	8,064,181,125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 >	382,692,836円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	436,835円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	4,940,968円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型) < 適格機関投資家限定 >	7,619,291円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ファンド < 適格機関投資家限定 >	4,379,659円
S M A M ・ 年金 W リスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	3,164,472円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 1 < 適格機関投資家限定 >	1,888,765,699円
合計	197,030,769,648円

(平成28年10月13日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	197,030,769,648円
同期中における追加設定元本額	7,706,737,516円
同期中における一部解約元本額	34,309,771,646円
平成28年10月13日現在における元本の内訳	
三井住友・ D C 年金バランス 3 0 ( 債券重点型 )	2,410,486,218円
三井住友・ D C 年金バランス 5 0 ( 標準型 )	4,252,119,603円
三井住友・ D C 年金バランス 7 0 ( 株式重点型 )	916,332,962円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	311,197,150円

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	48,566,125円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	91,957,864円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	177,784,501円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	85,413,222円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	38,728,860円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	76,005,761円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	30,990,756円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,748,184,925円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	314,761,030円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	15,239,232円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	6,014,950,155円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	26,474,802,081円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	8,585,142,816円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	20,930,316,785円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	355,969,434円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	681,929,869円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	42,734,733円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	305,116,298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>	124,357,828円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,213,532,960円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,446,232,806円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	6,344,664,849円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	13,161,264,162円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	190,377,917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)	7,018,890,004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)	22,550,622,337円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	667,592,911円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	1,060,524,792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)	18,640,212,969円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,051,526,736円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	216,481,580円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	51,417,447円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,570,366,091円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,913,229,239円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,864,989,429円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,144,697,510円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	249,618,858円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	20,530,460円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	406,364,477円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	7,535,858,273円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	344,368,727円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	34,418円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	1,432,984円
SMAM・グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型)<適格機関投資家限定>	4,779,441円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	2,178,616円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	2,698,249円

S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04 <適格機関投資家限定>	1,430,866,941円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-05 <適格機関投資家限定>	685,743,400円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン <適格機関投資家限定>	603,548,727円
合計	170,427,735,518円

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

	(平成28年 4月13日現在)	(平成28年10月13日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	3,297,537,450	4,260,174,149
金銭信託	233,094,782	-
コール・ローン	-	168,660,698
株式	143,907,141,807	143,366,666,260
投資証券	3,898,944,679	3,757,361,615
派生商品評価勘定	47,286,174	43,003,827
未収入金	1,592,186	328,313,061
未収配当金	271,057,094	178,909,032
差入委託証拠金	1,396,244,955	1,563,965,002
流動資産合計	153,052,899,127	153,667,053,644
資産合計	153,052,899,127	153,667,053,644
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	20,128,882	42,288,136
前受金	27,157,292	3,560,971
未払金	-	55,245,816
未払解約金	123,282,690	443,322,913
未払利息	-	413
その他未払費用	-	8,028
流動負債合計	170,568,864	544,426,277
負債合計	170,568,864	544,426,277
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	60,593,406,071	60,676,008,022
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	92,288,924,192	92,446,619,345
元本等合計	152,882,330,263	153,122,627,367
純資産合計	152,882,330,263	153,122,627,367
負債純資産合計	153,052,899,127	153,667,053,644

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成28年 4月14日 至 平成28年10月13日
-----	--------------------------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年 4月13日現在)	(平成28年10月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	60,593,406,071口	60,676,008,022口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.5231円 (10,000口当たりの純資産額 25,231円)	1口当たり純資産額 2.5236円 (10,000口当たりの純資産額 25,236円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年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	<p>(1) 有価証券(株式、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
-----------	--

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成28年 4月13日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,006,688,873	-	5,033,846,165	27,157,292
	SPMINI 1606	3,433,206,692	-	3,462,590,244	29,383,552
	DJ EUR 1606	946,122,065	-	940,443,421	5,678,644
	FTSE 1606	388,205,431	-	393,444,232	5,238,801
	SPI200 1606	239,154,685	-	237,368,268	1,786,417
合計		5,006,688,873	-	5,033,846,165	27,157,292

(平成28年10月13日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,983,629,129	-	5,987,190,100	3,560,971
	SPMINI 1612	4,185,526,905	-	4,146,168,222	39,358,683
	DJ EUR 1612	1,083,823,923	-	1,096,479,423	12,655,500
	FTSE 1612	425,642,116	-	444,026,505	18,384,389
	SPI200 1612	288,636,185	-	300,515,950	11,879,765
市場取引以外	為替予約取引				

の取引	買建	11,881,100	-	11,814,400	66,700
	ユーロ	11,570,100	-	11,505,000	65,100
	デンマーククローネ	311,000	-	309,400	1,600
	売建	410,443,620	-	413,222,200	2,778,580
	米ドル	288,362,850	-	290,704,600	2,341,750
	カナダドル	14,108,680	-	14,160,600	51,920
	ユーロ	37,748,700	-	37,966,500	217,800
	英ポンド	26,727,940	-	26,712,000	15,940
	スイスフラン	14,704,760	-	14,777,000	72,240
	スウェーデンクローナ	4,002,000	-	4,008,600	6,600
	ノルウェークローネ	1,144,500	-	1,143,000	1,500
	デンマーククローネ	2,153,200	-	2,165,800	12,600
	オーストラリアドル	12,555,350	-	12,590,400	35,050
	ニュージーランドドル	738,240	-	736,100	2,140
	香港ドル	5,878,400	-	5,926,800	48,400
	シンガポールドル	1,503,000	-	1,508,800	5,800
	イスラエルシケル	816,000	-	822,000	6,000
	合計	6,405,953,849	-	6,412,226,700	715,691

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成28年 4月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	69,552,562,996円
同期中における追加設定元本額	14,738,717,221円
同期中における一部解約元本額	23,697,874,146円
平成28年 4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	8,800,201,270円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	200,831,501円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	873,812,975円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	583,556,304円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	30,773,907円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	3,083,623円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	7,205,082円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	29,623,573円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	26,788,007円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	16,067,043円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	36,039,216円
外国株式指数ファンド	437,913,349円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	577,809,227円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	163,530,808円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	239,430,957円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	297,138,696円
S M A M・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	7,705,954,401円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	45,693,152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>	5,296,983,372円
S M A M・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	3,693,008,705円
S M A M・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	2,722,128,231円
S M A M・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	11,262,781,335円
S M A M・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	30,694,337円
S M A M・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	179,966,870円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	13,782,411円
S M A M・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	1,343,045,993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>	100,455,805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>	295,414,154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>	1,324,189,446円
S M A M・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	2,309,545,149円
S M A M・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	3,035,654,992円
S M A M・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	100,751,800円

三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,244,794,128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)	2,728,718,926円
S M A M・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	252,370,098円
S M A M・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	148,942,135円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	2,424,066,062円
S M A M・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	43,589,645円
S M A M・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	23,914,178円
S M A M・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,985,311円
S M A M・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	94,837,863円
S M A M・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	211,165,907円
S M A M・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	205,483,522円
S M A M・F G新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	224,527円
S M A M・F Gグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	2,389,563円
S M A M・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,346,524,379円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	117,335円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-01<適格機関投資家限定>	70,426,801円
合計	60,593,406,071円

(平成28年10月13日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	60,593,406,071円
同期中における追加設定元本額	7,921,679,361円
同期中における一部解約元本額	7,839,077,410円
平成28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	9,727,438,355円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	225,785,286円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	935,994,616円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	628,891,211円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	47,241,298円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	3,313,135円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	7,845,659円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	27,836,334円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	29,659,273円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	17,876,536円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	44,431,159円
外国株式指数ファンド	458,332,908円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	947,730,262円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	825,043,876円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	791,816,682円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	1,242,318,194円
S M A M・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	6,829,207,343円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	34,349,810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>	4,523,459,654円
S M A M・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	3,343,597,331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 >	2,555,693,837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 >	10,711,972,516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 >	30,100,751円
S M A M ・ バランスファンド V L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	175,868,218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 >	9,179,722円
S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	1,276,841,188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 >	97,229,596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 >	289,259,199円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,280,452,799円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	2,182,325,347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 >	2,867,575,631円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	96,806,715円
三井住友・外国株式インデックスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	1,191,469,932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 )	1,892,760,814円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	250,740,901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 >	136,319,836円
三井住友・ 7 資産バランスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	2,086,426,960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 >	42,347,742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 >	22,281,748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 >	11,346,008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 >	88,788,015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 >	198,252,391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 >	200,402,135円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	17,631円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	752,467円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンド S A < 適格機関投資家限定 >	2,117,490,888円
S M A M ・ 年金 W リスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	137,887円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	89,873,501円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	43,141,660円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	37,983,065円
合計	60,676,008,022円

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

### 貸借対照表

( 単位：円 )

	( 平成28年 4月13日現在 )	( 平成28年10月13日現在 )
資産の部		
流動資産		
預金	364,120,525	651,506,989
金銭信託	221,166,178	-
コール・ローン	-	326,319,128
国債証券	174,826,593,847	165,943,200,605
未収利息	1,675,906,330	1,516,860,500
前払費用	37,008,522	21,526,975
流動資産合計	177,124,795,402	168,459,414,197
資産合計	177,124,795,402	168,459,414,197

（平成28年 4月13日現在）

（平成28年10月13日現在）

負債の部		
流動負債		
未払解約金	24,126,508	19,391,992
未払利息	-	799
その他未払費用	-	19,356
流動負債合計	24,126,508	19,412,147
負債合計	24,126,508	19,412,147
純資産の部		
元本等		
元本	105,056,343,629	104,999,736,952
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	72,044,325,265	63,440,265,098
元本等合計	177,100,668,894	168,440,002,050
純資産合計	177,100,668,894	168,440,002,050
負債純資産合計	177,124,795,402	168,459,414,197

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年 4月14日 至 平成28年10月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等の上場されていない有価証券 金融商品取引所等の上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
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28年 4月13日現在）	（平成28年10月13日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	105,056,343,629口	104,999,736,952口

2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	1.6858円 16,858円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	1.6042円 16,042円)
----------------	--------------------------------	---------------------	--------------------------------	---------------------

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年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)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(平成28年 4月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	125,043,526,611円
同期中における追加設定元本額	6,823,302,530円
同期中における一部解約元本額	26,810,485,512円
平成28年 4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	7,346,160,970円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	288,409,692円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	857,455,684円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	442,434,229円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	51,016,068円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,544,101円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	21,533,883円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	58,678,871円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	36,813,376円

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	20,804,114円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	43,801,378円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	1,199,855円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	109,412,792円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	186,889,135円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	251,038,011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>	1,494,949,025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>	3,821,555,609円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	19,243,724,359円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,379,971,636円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,312,945,354円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	45,968,708円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	130,038,973円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	13,644,843円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	939,503,001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>	142,165,035円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,513,583,466円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,924,991,258円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	4,909,027,048円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	9,047,341,588円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	150,974,873円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	14,447,331,155円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,248,309,934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)	4,140,231,510円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	244,324,035円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	861,343,324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)	3,639,387,901円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	185,069,203円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	52,811,680円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,896,401円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	209,180,765円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	717,216,112円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	226,773,526円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	203,301,882円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	57,130,687円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	6,475,605円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,767,576,019円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	27,895,415円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	2,078,450円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	14,227,327円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	395,826円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-01<適格機関投資家限定>	193,809,937円
合計	105,056,343,629円

(平成28年10月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	105,056,343,629円
同期中における追加設定元本額	4,107,998,978円
同期中における一部解約元本額	4,164,605,655円
平成28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	8,028,235,474円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	350,239,406円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	966,498,860円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	487,717,369円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	36,244,229円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	9,213,225円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	24,033,134円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	67,291,474円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	46,251,816円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	24,770,231円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	56,451,376円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	6,673,441円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	623,807,198円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	682,532,423円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	626,329,912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>	1,569,244,926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>	3,454,082,627円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	18,446,150,930円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,386,661,688円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,327,975,950円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	45,061,279円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	128,191,708円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	9,446,740円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	963,937,254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>	148,475,571円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,524,781,806円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,914,812,169円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	5,007,294,140円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,971,166,158円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	150,974,873円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	14,373,754,636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)	1,269,435,828円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,977,356,993円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	263,596,522円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	839,709,739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)	3,278,579,090円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	187,312,245円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	49,044,349円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	17,036,661円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	195,257,179円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	691,932,475円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	222,092,586円

S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	204,687,797円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 >	57,168,789円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A2 < 適格機関投資家専用 >	6,886,535円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	1,774,309,623円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T2 < 適格機関投資家専用 >	27,869,813円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	171,310円
S M A M ・ F G グローバルバランス25VA < 適格機関投資家限定 >	4,647,684円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	390,609円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016 - 04 < 適格機関投資家限定 >	249,273,647円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016 - 05 < 適格機関投資家限定 >	119,445,602円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	105,229,853円
合計	104,999,736,952円

## マネーインカム・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

	(平成28年 4月13日現在)	(平成28年10月13日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	473,493,536	-
コール・ローン	-	441,666,235
国債証券	432,382,400	-
特殊債券	405,524,000	908,290,000
未収利息	2,563,481	1,704,240
前払費用	-	489,315
流動資産合計	1,313,963,417	1,352,149,790
資産合計	1,313,963,417	1,352,149,790
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,000,713	-
未払利息	-	1,082
その他未払費用	-	9,059
流動負債合計	7,000,713	10,141
負債合計	7,000,713	10,141
純資産の部		
元本等		
元本	1,290,985,957	1,336,090,362
剰余金		
剰余金又は欠損金 ( )	15,976,747	16,049,287
元本等合計	1,306,962,704	1,352,139,649
純資産合計	1,306,962,704	1,352,139,649
負債純資産合計	1,313,963,417	1,352,149,790

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成28年 4月14日 至 平成28年10月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>特殊債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年 4月13日現在)	(平成28年10月13日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,290,985,957口	1,336,090,362口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0124円 (10,000口当たりの純資産額 10,124円)	1口当たり純資産額 1.0120円 (10,000口当たりの純資産額 10,120円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年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	<p>(1) 有価証券（特殊債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成28年 4月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,480,579,600円
同期中における追加設定元本額	716,376,125円
同期中における一部解約元本額	905,969,768円
平成28年 4月13日現在における元本の内訳	
S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	33,626,531円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	28,312,486円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	8,934,284円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	9,209,457円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	5,723,760円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	3,286,242円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	6,937,555円
米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型）	297,384円
S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	432,140,183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＞	485,731,667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＞	276,687,280円
合計	1,290,985,957円

(平成28年10月13日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,290,985,957円
同期中における追加設定元本額	264,094,705円
同期中における一部解約元本額	218,990,300円
平成28年10月13日現在における元本の内訳	
S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	102,588,687円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	39,108,981円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	16,885,927円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	9,683,673円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	6,711,630円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	3,592,502円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	8,211,962円
米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型）	297,384円
S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	453,774,841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＞	505,489,633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＞	189,646,014円

合計

1,336,090,362円

## 4【委託会社等の概況】

## (1)【資本金の額】

資本金の額および株式数

	平成28年10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

最近5年間における資本金の額の増減  
該当ありません。

## (2)【事業の内容及び営業の状況】

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

平成28年10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28年10月31日現在)

		本数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単体型	62 ( 17 )	175,733 ( 74,085 )
	追加型	470 ( 195 )	4,969,133 ( 2,740,583 )
	計	532 ( 212 )	5,144,866 ( 2,814,668 )
公社債投資信託	単体型	76 ( 76 )	352,635 ( 352,635 )
	追加型	1 ( 0 )	25,934 ( 0 )
	計	77 ( 76 )	378,569 ( 352,635 )
合計		609 ( 288 )	5,523,434 ( 3,167,303 )

( )内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

## (3)【その他】

## イ 定款の変更、その他の重要事項

平成28年6月27日に開催された定時株主総会において、監査体制の見直しにより監査役の員数を2名増員し6名以内とする定款の変更が決議されました。

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

## 5【委託会社等の経理状況】

1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

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31期（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第32期中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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。

## (1)【貸借対照表】

		(単位：千円)	
		前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>資産の部</b>			
<b>流動資産</b>			
現金及び預金	2	25,021,336	10,857,507
顧客分別金信託		-	20,006
前払費用		291,119	324,934
未収入金		41,860	81,347
未収委託者報酬		4,897,032	5,418,116
未収運用受託報酬		1,000,744	1,635,461
未収投資助言報酬		455,390	382,911
未収収益		13,030	28,813
繰延税金資産		475,859	494,032
その他の流動資産		52,473	6,226
<b>流動資産合計</b>		<b>32,248,847</b>	<b>19,249,357</b>
<b>固定資産</b>			
<b>有形固定資産</b>			
建物	1	120,234	154,246
器具備品		230,712	240,748
<b>有形固定資産合計</b>		<b>350,947</b>	<b>394,995</b>
<b>無形固定資産</b>			
ソフトウェア		497,668	449,034
ソフトウェア仮勘定		77,155	146,452
電話加入権		91	79
商標権		222	60
<b>無形固定資産合計</b>		<b>575,137</b>	<b>595,627</b>
<b>投資その他の資産</b>			
投資有価証券		7,151,933	13,115,106
関係会社株式		509,146	10,412,523
長期差入保証金		600,480	603,625
長期前払費用		36,031	32,533
会員権		17,299	17,299

繰延税金資産	665,425	750,481
投資その他の資産合計	8,980,317	24,931,569
固定資産合計	9,906,402	25,922,192
資産合計	42,155,249	45,171,549

(単位：千円)

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

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益				
委託者報酬	30,094,858		32,339,255	
運用受託報酬	3,862,895		7,401,835	
投資助言報酬	2,106,161		1,909,892	
その他営業収益				
情報提供コンサルタント 業務報酬	5,000		5,000	
投資法人運用受託報酬	27,345		8,546	
サービス支援手数料	18,274		74,038	
その他	52,255		55,319	
営業収益計	36,166,790		41,793,887	
営業費用				
支払手数料	15,123,724		16,006,652	
広告宣伝費	407,991		615,596	
公告費	4,737		4,507	
調査費				
調査費	1,319,743		1,624,477	
委託調査費	3,550,675		4,106,366	
営業雑経費				
通信費	38,911		43,662	
印刷費	294,002		399,236	
協会費	26,955		23,328	
諸会費	18,577		22,650	
情報機器関連費	2,403,857		2,557,200	
販売促進費	28,281		31,271	
その他	144,250		161,974	
営業費用合計	23,361,707		25,596,925	
一般管理費				
給料				
役員報酬	190,241		181,739	
給料・手当	5,186,853		5,824,767	
賞与	569,685		609,597	
賞与引当金繰入額	906,623		1,033,964	
交際費	22,609		26,912	
寄付金	-		23	
事務委託費	366,661		540,251	
旅費交通費	226,254		277,212	
租税公課	108,953		161,628	
不動産賃借料	552,589		595,051	
退職給付費用	387,799		701,070	
固定資産減価償却費	287,833		334,024	
諸経費	283,156		354,884	
一般管理費合計	9,089,262		10,641,129	
営業利益	3,715,820		5,555,832	
営業外収益				

受取配当金		26,821	36,102
有価証券利息		1,187	-
受取利息	1	6,113	3,728
時効成立分配金・償還金		12	1,394
原稿・講演料		1,899	1,766
雑収入		7,324	19,472
営業外収益合計		43,357	62,465
営業外費用			
為替差損		14,361	51,385
営業外費用合計		14,361	51,385
経常利益		3,744,816	5,566,912
特別利益			
投資有価証券償還益		4,181	13,036
投資有価証券売却益		893,251	38,823
投資有価証券清算益		-	29,214
特別利益合計		897,432	81,075
特別損失			
固定資産除却損	2	1,076	5,300
投資有価証券償還損		-	2,313
投資有価証券売却損		1,091	8,184
その他の特別損失	3	973,862	-
特別損失合計		976,030	15,798
税引前当期純利益		3,666,218	5,632,188
法人税、住民税及び事業税		1,574,213	1,598,176
法人税等調整額		166,505	41,999
法人税等合計		1,740,718	1,556,177
当期純利益		1,925,499	4,076,011

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	657,238	657,238	32,334,530
会計方針の変更による 累積的影響額			439,043
会計方針の変更を反映した 当期首残高	657,238	657,238	31,895,486
当期変動額			
剰余金の配当			1,852,200
当期純利益			1,925,499
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	22,759	22,759	22,759
当期変動額合計	22,759	22,759	50,540
当期末残高	634,478	634,478	31,946,027

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 満期保有目的の債券

## 償却原価法

## (2)子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

## (3)その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1)有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

## (2)無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1)賞与引当金

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

## (2)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

## (貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

## 2 関係会社に対する資産及び負債

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

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

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

#### 4 保証債務

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

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

#### (損益計算書関係)

1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

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

#### 2 固定資産除却損

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

#### 3 その他の特別損失

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

#### (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

##### 1. 発行済株式数に関する事項

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

##### 2. 剰余金の配当に関する事項

###### (1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年6月26日 定時株主総会	普通株式	1,852,200	105,000	平成26年 3月31日	平成26年 6月27日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの  
平成27年6月30日開催の第30回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(千円)	一株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年6月30日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	952,560	54,000	平成27年 3月31日	平成27年 7月1日

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

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

2.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	一株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年6月30日 定時株主総会	普通株式	952,560	54,000	平成27年 3月31日	平成27年 7月1日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの  
平成28年6月27日開催の第31回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(千円)	一株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月27日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,010,960	114,000	平成28年 3月31日	平成28年 6月28日

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

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

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

### (3)金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスクの管理

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

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

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

#### 市場リスクの管理

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

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

### (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	10,857,507	10,857,507	-
(2)顧客分別金信託	20,006	20,006	-
(3)未収委託者報酬	5,418,116	5,418,116	-
(4)未収運用受託報酬	1,635,461	1,635,461	-

(5)未収投資助言報酬	382,911	382,911	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	13,114,808	13,114,808	-
(7)長期差入保証金	603,625	603,625	-
資産計	32,032,437	32,032,437	-
(1)顧客からの預り金	0	0	-
(2)未払手数料	2,479,778	2,479,778	-
負債計	2,479,778	2,479,778	-

## (注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

- (6)投資有価証券

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

- (7)長期差入保証金

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

負 債

- (1)顧客からの預り金、(2)未払手数料

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

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

(単位：千円)

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

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

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

## (注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成27年3月31日)

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	25,021,336	-	-	-
顧客分別金信託	-	-	-	-
未収委託者報酬	4,897,032	-	-	-
未収運用受託報酬	1,000,744	-	-	-

未収投資助言報酬	455,390	-	-	-
長期差入保証金	4,148	596,332	-	-
合計	31,378,651	596,332	-	-

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	10,857,507	-	-	-
顧客分別金信託	20,006	-	-	-
未収委託者報酬	5,418,116	-	-	-
未収運用受託報酬	1,635,461	-	-	-
未収投資助言報酬	382,911	-	-	-
長期差入保証金	537,057	66,567	-	-
合計	18,851,060	66,567	-	-

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

2. その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

(単位：千円)

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

当事業年度(自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)

(単位：千円)

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

(退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

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

## (4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

	前事業年度 (平成27年 3月31日)	当事業年度 (平成28年 3月31日)
法定実効税率	35.6%	33.0%
(調整)		
評価性引当額の増減	9.6	5.5
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.1

受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.5	0.0
住民税均等割等	0.2	0.1
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.7	1.3
所得税額控除による税額控除	1.3	1.5
その他	0.1	0.0
税効果会計適用後の法人税等の負担率	47.5	27.6

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

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産および繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.2%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.8%、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、30.6%となります。

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

#### （セグメント情報等）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

##### 1. セグメント情報

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

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

##### 2. 関連情報

###### (1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	30,094,858	3,862,895	2,106,161	102,874	36,166,790

###### (2) 地域ごとの情報

###### 売上高

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

###### 有形固定資産

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

###### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

##### 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

##### 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	32,339,255	7,401,835	1,909,892	142,903	41,793,887

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) 40 % 直接	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,527,962	未払手数料	289,954

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2. 子会社及び関連会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
子会社	ソーラーエナジー投資合同会社	東京都港区	20,000	投資運用業	(所有) 直接100 %	投資事業有限責任組合の運営及び管理	出資の引受	20,000	-	-
関連会社	UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.	Singapore	6,000,000 (シンガポールドル)	投資運用業	(所有) 直接50 %	投信の販売委託役員の兼任	増資の引受	136,110	-	-

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

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

## 3. その他の関係会社の子会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	S M B C 日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託役員の兼任	委託販売手数料	4,705,879	未払手数料	697,658

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) 直接 40 %	投信の販売委託役員の兼任	委託販売手数料	2,740,552	未払手数料	471,118

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2. 兄弟会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	S M B C 日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	-	% 投信の販売委託役員の兼任	子会社株式の取得	9,877,717	-	-
							委託販売手数料	5,483,224	未払手数料	912,899

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (1株当たり情報)

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

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

りません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	1,925,499	4,076,011
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	1,925,499	4,076,011
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

### (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第32期中間会計期間 (平成28年9月30日)		
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		8,667,657
顧客分別金信託		20,007
前払費用		306,916
未収委託者報酬		5,324,329
未収運用受託報酬		1,209,751
未収投資助言報酬		355,952
未収収益		22,873
繰延税金資産		493,517
その他		3,031
流動資産合計		16,404,036
固定資産		
有形固定資産	1	474,760
無形固定資産		615,866
投資その他の資産		
投資有価証券		13,931,717
関係会社株式		10,412,523
その他		1,631,772
投資その他の資産合計		25,976,013
固定資産合計		27,066,640
資産合計		43,470,677
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		98
その他の預り金		79,964

未払金		2,578,503
未払費用		1,682,389
未払法人税等		686,618
前受収益		414
賞与引当金		1,044,361
その他	2	125,455
流動負債合計		6,197,805
固定負債		
退職給付引当金		3,116,174
賞与引当金		30,000
その他		480
固定負債合計		3,146,654
負債合計		9,344,459
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		21,442,639
利益剰余金合計		23,263,844
株主資本合計		33,892,828
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		233,389
評価・換算差額等合計		233,389
純資産合計		34,126,217
負債純資産合計		43,470,677

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第32期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		15,185,419
運用受託報酬		2,663,858
投資助言報酬		869,344
その他の営業収益		63,406
営業収益計		18,782,028
営業費用		11,579,429
一般管理費	1	5,398,630

営業利益		1,803,967
営業外収益	2	116,871
営業外費用	3	3,173
経常利益		1,917,665
特別利益	4	179,785
特別損失	5	27,232
税引前中間純利益		2,070,218
法人税、住民税及び事業税		622,698
法人税等調整額		21,268
法人税等合計		601,429
中間純利益		1,468,788

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,984,811	23,806,015	34,434,999
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,010,960	2,010,960	2,010,960
中間純利益							1,468,788	1,468,788	1,468,788
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	542,171	542,171	542,171
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,442,639	23,263,844	33,892,828

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	517,775	517,775	34,952,774
当中間期変動額			
剰余金の配当			2,010,960
中間純利益			1,468,788
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	284,385	284,385	284,385
当中間期変動額合計	284,385	284,385	826,557
当中間期末残高	233,389	233,389	34,126,217

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	3～20年

### (2)無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3．引当金の計上基準

### (1)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当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。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4．その他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。

### （会計方針の変更）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、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はそれぞれ729千円増加しております。

## （追加情報）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当中間会計期間から適用しております。

## （中間貸借対照表関係）

第32期中間会計期間 (平成28年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,094,757千円
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35年6月までの賃借料総額248,465千円の支払保証を行っております。	

## （中間損益計算書関係）

第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)	
1.減価償却実施額	
有形固定資産	73,172千円
無形固定資産	112,944千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	106,640千円
雑収入	9,734千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	3,173千円
4.特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券償還益	179,784千円
5.特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	10,871千円
事務所移転費用	8,962千円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28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28年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,010,960	114,000	平成28年 3月31日	平成28年 6月28日

## (リース取引関係)

第32期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28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	606,895千円
1年超	785,123千円
合 計	1,392,018千円

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

第32期中間会計期間(平成28年9月30日)

平成28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	8,667,657	8,667,657	-
(2)顧客分別金信託	20,007	20,007	-
(3)未収委託者報酬	5,324,329	5,324,329	-
(4)未収運用受託報酬	1,209,751	1,209,751	-
(5)未収投資助言報酬	355,952	355,952	-
(6)投資有価証券 其他有価証券	13,931,419	13,931,419	-
(7)投資その他の資産 長期差入保証金	662,172	662,172	-
資産計	30,171,290	30,171,290	-
(1)顧客からの預り金	98	98	-
(2)未払金 未払手数料	2,393,062	2,393,062	-
負債計	2,393,160	2,393,160	-

## (注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## 資 産

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

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

- (6)投資有価証券

    其他有価証券

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。

#### (7) 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おります。

#### 負債

##### (1) 顧客からの預り金、及び(2) 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おります。

(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
合計	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523
合計	10,412,523

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

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

(有価証券関係)

第32期中間会計期間(平成28年9月30日)

##### 1. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

##### 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 10,412,523千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

##### 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	5,237,120	4,771,627	465,493
小計	5,237,120	4,771,627	465,493
(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	8,694,298	8,823,400	129,101
小計	8,694,298	8,823,400	129,101

合計	13,931,419	13,595,027	336,392
----	------------	------------	---------

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

(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32期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28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	15,185,419	2,663,858	869,344	63,406	18,782,028

(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。

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第32期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
--

1株当たり純資産額	1,934,592円84銭
1株当たり中間純利益	83,264円67銭

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おりません。

(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	34,126,217千円
普通株式に係る純資産額	34,126,217千円
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	1,468,788千円
普通株式に係る中間純利益	1,468,788千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	17,640株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

**独立監査人の監査報告書**

平成28年 6月17日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小 澤 陽 一 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 池 ヶ 谷 正 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**監査意見**

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以 上

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

**独立監査人の中間監査報告書**

平成28年11月24日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤陽一	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	池ヶ谷正	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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28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28年4月1日から平成28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。

## 利害関係

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

以上

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

**独立監査人の中間監査報告書**

平成28年11月15日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽 一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているS M A M・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）の平成28年4月14日から平成28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、S M A M・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）の平成28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28年4月14日から平成28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 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2 . X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。