

**【表紙】**

**【提出書類】** 有価証券届出書の訂正届出書

**【提出先】** 関東財務局長

**【提出日】** 平成23年1月7日

**【発行者名】** 三井住友アセットマネジメント株式会社

**【代表者の役職氏名】** 代表取締役社長 前田 良治

**【本店の所在の場所】** 東京都港区愛宕二丁目5番1号

**【事務連絡者氏名】** 隠地 保夫

**【電話番号】** 03-5405-0735

**【届出の対象とした募集内国投資信託受益証 スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045  
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22年7月8日付をもって提出しました「スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045」の有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について、平成23年1月7日に半期報告書を提出したことに伴う関係情報の更新、その他訂正すべき事項がありますので、本訂正届出書により訂正を行うものです。

**【訂正の内容】**

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

**第一部【証券情報】****（2）【内国投資信託受益証券の形態等】****<訂正前>**

追加型証券投資信託の受益権です。

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

当初元本は1口当たり1円です。格付けは取得しておりません。

**<訂正後>**

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (3)【ファンドの仕組み】

###### <訂正前>

(略)

□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（平成22年5月31日現在）

(略)

(ハ) 大株主の状況

（平成22年5月31日現在）

| 名称             | 住所                  | 所有<br>株式数 | 比率<br>(%) |
|----------------|---------------------|-----------|-----------|
| 住友生命保険相互会社     | 大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号 | 7,056     | 40.0      |
| 三井住友海上火災保険株式会社 | 東京都中央区新川二丁目27番2号    | 4,851     | 27.5      |
| 株式会社三井住友銀行     | 東京都千代田区有楽町一丁目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22年11月30日現在）

(略)

(ハ) 大株主の状況

（平成22年11月30日現在）

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

## 2【投資方針】

### (3)【運用体制】

#### <訂正前>

##### イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

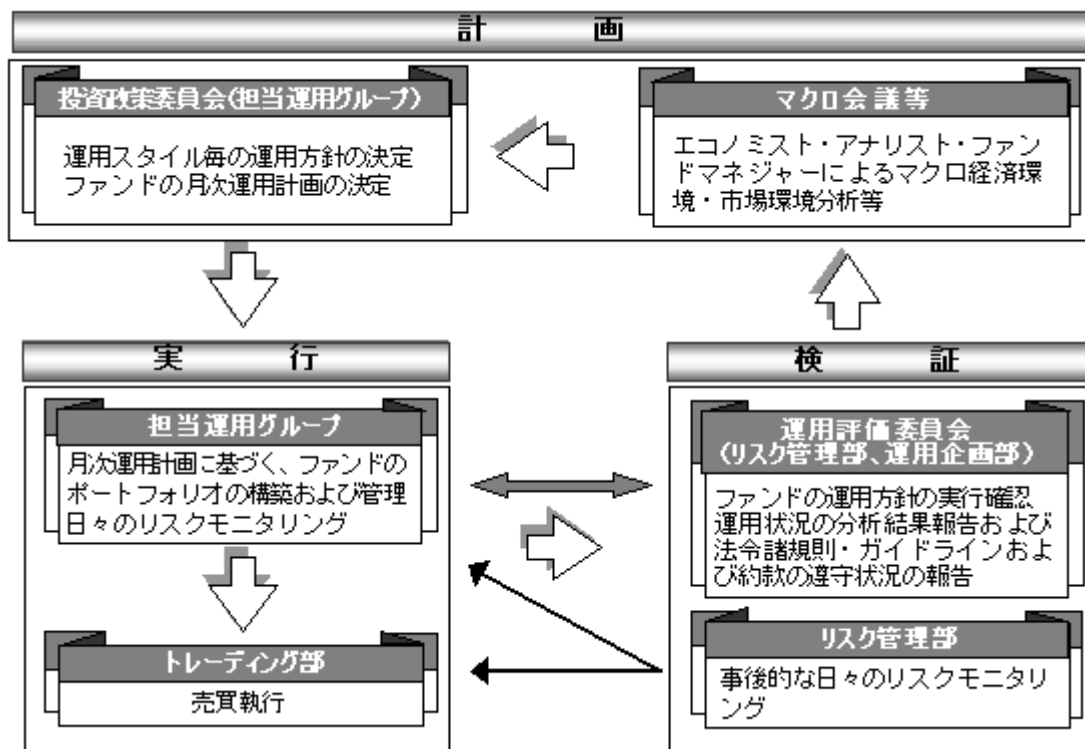
##### (イ) 計画 (Plan)

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

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

(略)

#### 【ファンドの運用体制】



リスク管理部は8名程度、運用企画部は9名程度で構成されています。

(略)

## &lt;訂正後&gt;

## イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

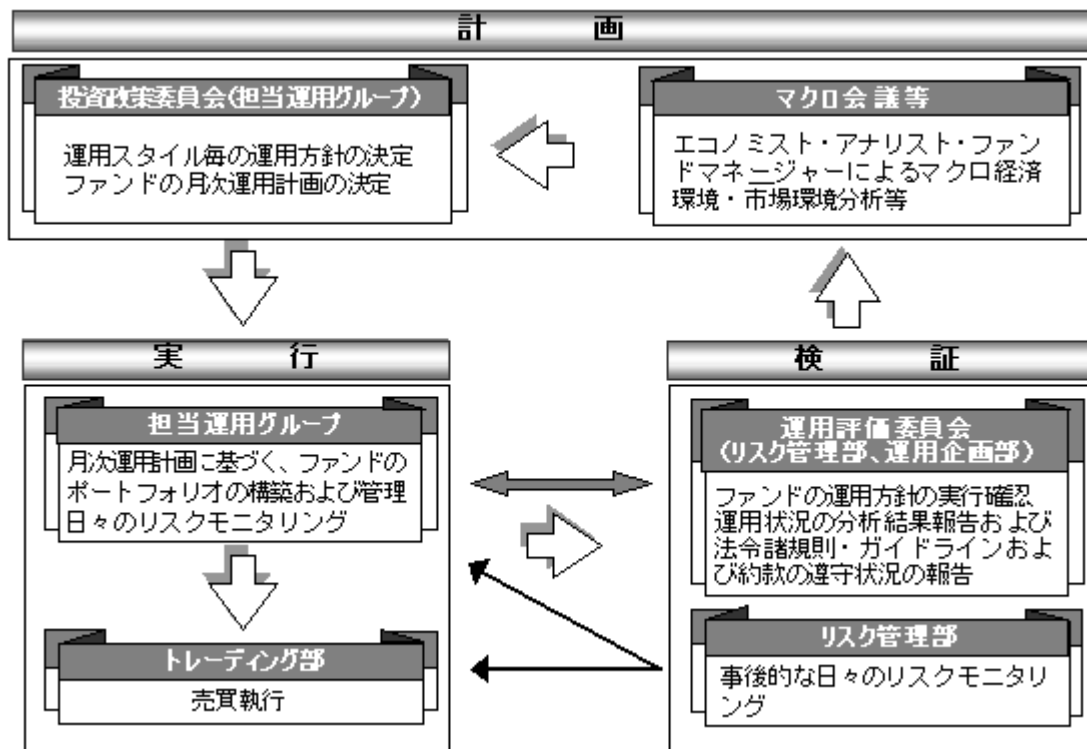
## (イ) 計画 (Plan)

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

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

(略)

## 【ファンドの運用体制】



リスク管理部は10名程度、運用企画部は8名程度で構成されています。

(略)

## 4【手数料等及び税金】

### (5)【課税上の取扱い】

#### <訂正前>

(略)

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22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)

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22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22年11月30日現在

| 資産の種類                      | 国/地域 | 時価合計<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|----------------------------|------|-------------|-------------|
| 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)受益証券 | 日本   | 1,475,101   | 32.33       |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券       | 日本   | 915,156     | 20.06       |
| 外国株式インデックス・マザーファンド受益証券     | 日本   | 1,300,278   | 28.50       |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券       | 日本   | 779,313     | 17.08       |
| マネーインカム・マザーファンド受益証券        | 日本   | 91,508      | 2.01        |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後)        |      | 1,129       | 0.02        |
| 合計(純資産総額)                  |      | 4,562,485   | 100.00      |

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

### (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22年11月30日現在

| 国/地域 | 種類            | 銘柄名                        | 数量(口)     | 帳簿価額<br>単価/金額<br>(円) | 評価額<br>単価/金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|---------------|----------------------------|-----------|----------------------|---------------------|-----------------|
| 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 国内株式インデックス・<br>マザーファンド(B号) | 1,307,366 | 1.2248<br>1,601,367  | 1.1283<br>1,475,101 | 32.33           |
| 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 外国株式インデックス・<br>マザーファンド     | 1,057,739 | 1.3016<br>1,376,829  | 1.2293<br>1,300,278 | 28.50           |
| 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 国内債券パッシブ・<br>マザーファンド       | 843,540   | 1.0747<br>906,610    | 1.0849<br>915,156   | 20.06           |
| 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 外国債券パッシブ・<br>マザーファンド       | 697,684   | 1.1925<br>832,037    | 1.1170<br>779,313   | 17.08           |
| 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | マネーインカム・<br>マザーファンド        | 90,791    | 1.0073<br>91,461     | 1.0079<br>91,508    | 2.01            |

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22年11月30日現在

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 99.98   |
| 合計        | 99.98   |

【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<br>(円) | 1万口当たりの<br>純資産額(円) |
|-----------------------|--------------|--------------------|
| 第1期(平成21年4月13日)(分配落)  | 894,628      | 7,744              |
| 第1期(平成21年4月13日)(分配付)  | 894,628      | 7,744              |
| 第2期(平成22年4月13日)(分配落)  | 3,447,652    | 9,032              |
| 第2期(平成22年4月13日)(分配付)  | 3,447,652    | 9,032              |
| 第3期(中間期)(平成22年10月13日) | 3,832,030    | 8,212              |
| 平成21年11月末日            | 2,252,324    | 8,167              |
| 平成21年12月末日            | 2,754,248    | 8,612              |
| 平成22年1月末日             | 2,734,242    | 8,361              |
| 平成22年2月末日             | 2,719,990    | 8,318              |
| 平成22年3月末日             | 3,406,301    | 8,923              |
| 平成22年4月末日             | 3,508,478    | 9,031              |
| 平成22年5月末日             | 3,554,527    | 8,298              |
| 平成22年6月末日             | 3,509,628    | 8,015              |
| 平成22年7月末日             | 3,671,262    | 8,207              |
| 平成22年8月末日             | 3,613,629    | 7,904              |
| 平成22年9月末日             | 3,848,833    | 8,248              |
| 平成22年10月末日            | 4,263,266    | 8,136              |
| 平成22年11月末日            | 4,562,485    | 8,326              |

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

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

【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            |

【収益率の推移】

| 計算期間 | 収益率(%) |
|------|--------|
|------|--------|

|          |      |
|----------|------|
| 第1期      | 22.6 |
| 第2期      | 16.6 |
| 第3期（中間期） | 9.1  |

（注1）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付基準価額を控除した額を前期末分配付基準価額で除したものをいいます。

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

#### （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      | 1,155,193 | -       |
| 第2期      | 2,663,553 | 1,488   |
| 第3期（中間期） | 849,196   | -       |

（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：マザーファンドの投資状況・投資資産】

##### 【国内株式インデックス・マザーファンド\*（B号）】

#### （1）投資状況

平成22年11月30日現在

| 資産の種類               | 国/地域 | 時価合計<br>（円）     | 投資比率<br>（%） |
|---------------------|------|-----------------|-------------|
| 株式                  | 日本   | 307,712,735,726 | 97.08       |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |      | 9,244,346,937   | 2.92        |
| 合計(純資産総額)           |      | 316,957,082,663 | 100.00      |

当ファンドは、平成22年11月30日現在、株価指数先物取引を買建てしており、その評価額は9,146,280,000円（投資比率2.89%）です。

#### （2）投資資産

##### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成22年11月30日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名/業種                     | 数量<br>（株）  | 帳簿価額<br>単価/金額<br>（円）       | 評価額<br>単価/金額<br>（円）        | 投資<br>比率<br>（%） |
|------|----|----------------------------|------------|----------------------------|----------------------------|-----------------|
| 日本   | 株式 | トヨタ自動車<br>〔輸送用機器〕          | 3,433,000  | 3,416.23<br>11,727,917,590 | 3,220.00<br>11,054,260,000 | 3.49            |
| 日本   | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ<br>〔銀行業〕 | 19,967,500 | 476.30<br>9,510,520,250    | 396.00<br>7,907,130,000    | 2.49            |
| 日本   | 株式 | 本田技研工業<br>〔輸送用機器〕          | 2,254,500  | 2,709.49<br>6,108,545,205  | 3,010.00<br>6,786,045,000  | 2.14            |
| 日本   | 株式 | キヤノン<br>〔電気機器〕             | 1,659,900  | 3,379.90<br>5,610,296,010  | 3,945.00<br>6,548,305,500  | 2.07            |
| 日本   | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ<br>〔銀行業〕   | 1,996,100  | 2,854.58<br>5,698,027,138  | 2,569.00<br>5,127,980,900  | 1.62            |
| 日本   | 株式 | 三菱商事<br>〔卸売業〕              | 2,111,500  | 1,949.59<br>4,116,559,285  | 2,116.00<br>4,467,934,000  | 1.41            |
| 日本   | 株式 | ソニー<br>〔電気機器〕              | 1,500,700  | 2,366.09<br>3,550,791,263  | 2,971.00<br>4,458,579,700  | 1.41            |



|    |    |                            |            |                             |                             |      |
|----|----|----------------------------|------------|-----------------------------|-----------------------------|------|
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ<br>〔銀行業〕    | 32,184,800 | 152.64<br>4,912,687,872     | 133.00<br>4,280,578,400     | 1.35 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話<br>〔情報・通信業〕         | 1,126,000  | 3,742.26<br>4,213,784,760   | 3,790.00<br>4,267,540,000   | 1.35 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業<br>〔医薬品〕            | 1,048,100  | 3,620.32<br>3,794,457,392   | 3,890.00<br>4,077,109,000   | 1.29 |
| 日本 | 株式 | 東京電力<br>〔電気・ガス業〕           | 1,968,600  | 2,269.23<br>4,467,206,178   | 1,950.00<br>3,838,770,000   | 1.21 |
| 日本 | 株式 | 任天堂<br>〔その他製品〕             | 152,900    | 21,420.96<br>3,275,264,784  | 22,730.00<br>3,475,417,000  | 1.10 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンク<br>〔情報・通信業〕         | 1,168,900  | 2,111.34<br>2,467,945,326   | 2,900.00<br>3,389,810,000   | 1.07 |
| 日本 | 株式 | ファナック<br>〔電気機器〕            | 278,200    | 7,418.69<br>2,063,879,558   | 11,990.00<br>3,335,618,000  | 1.05 |
| 日本 | 株式 | パナソニック<br>〔電気機器〕           | 2,646,900  | 1,114.97<br>2,951,214,093   | 1,204.00<br>3,186,867,600   | 1.01 |
| 日本 | 株式 | 小松製作所<br>〔機械〕              | 1,325,100  | 1,721.99<br>2,281,808,949   | 2,318.00<br>3,071,581,800   | 0.97 |
| 日本 | 株式 | 三井物産<br>〔卸売業〕              | 2,277,800  | 1,149.28<br>2,617,829,984   | 1,307.00<br>2,977,084,600   | 0.94 |
| 日本 | 株式 | エヌ・ティ・ティ・ドコモ<br>〔情報・通信業〕   | 21,790     | 131,527.13<br>2,865,976,162 | 135,800.00<br>2,959,082,000 | 0.93 |
| 日本 | 株式 | 野村ホールディングス<br>〔証券、商品先物取引業〕 | 5,561,900  | 602.66<br>3,351,934,654     | 482.00<br>2,680,835,800     | 0.85 |
| 日本 | 株式 | 日産自動車<br>〔輸送用機器〕           | 3,375,300  | 635.47<br>2,144,901,891     | 785.00<br>2,649,610,500     | 0.84 |
| 日本 | 株式 | 三菱地所<br>〔不動産業〕             | 1,849,000  | 1,345.98<br>2,488,717,020   | 1,412.00<br>2,610,788,000   | 0.82 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所<br>〔電気機器〕            | 5,998,000  | 243.54<br>1,460,752,920     | 396.00<br>2,375,208,000     | 0.75 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス<br>〔保険業〕      | 1,001,400  | 2,479.13<br>2,482,600,782   | 2,367.00<br>2,370,313,800   | 0.75 |
| 日本 | 株式 | 東日本旅客鉄道<br>〔陸運業〕           | 465,100    | 6,067.55<br>2,822,017,505   | 5,000.00<br>2,325,500,000   | 0.73 |
| 日本 | 株式 | 東芝<br>〔電気機器〕               | 5,278,000  | 457.09<br>2,412,521,020     | 436.00<br>2,301,208,000     | 0.73 |
| 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス<br>〔小売業〕   | 1,104,100  | 1,938.54<br>2,140,342,014   | 2,045.00<br>2,257,884,500   | 0.71 |
| 日本 | 株式 | 三菱電機<br>〔電気機器〕             | 2,672,000  | 627.68<br>1,677,160,960     | 829.00<br>2,215,088,000     | 0.70 |
| 日本 | 株式 | 関西電力<br>〔電気・ガス業〕           | 1,090,200  | 2,143.62<br>2,336,974,524   | 2,013.00<br>2,194,572,600   | 0.69 |
| 日本 | 株式 | 新日本製鐵<br>〔鉄鋼〕              | 7,347,000  | 319.36<br>2,346,337,920     | 277.00<br>2,035,119,000     | 0.64 |
| 日本 | 株式 | K D D I<br>〔情報・通信業〕        | 4,097      | 463,831.36<br>1,900,317,081 | 478,500.00<br>1,960,414,500 | 0.62 |

## □ 種類別・業種別の投資比率

平成22年11月30日現在

| 種類     | 業種       | 投資比率 (%) | 種類     | 業種         | 投資比率 (%) |
|--------|----------|----------|--------|------------|----------|
| 株式（国内） | 水産・農林業   | 0.09     | 株式（国内） | 精密機器       | 1.41     |
|        | 鉱業       | 0.48     |        | その他製品      | 2.09     |
|        | 建設業      | 1.93     |        | 電気・ガス業     | 4.78     |
|        | 食料品      | 2.93     |        | 陸運業        | 3.48     |
|        | 繊維製品     | 0.85     |        | 海運業        | 0.63     |
|        | パルプ・紙    | 0.36     |        | 空運業        | 0.34     |
|        | 化学       | 5.62     |        | 倉庫・運輸関連業   | 0.22     |
|        | 医薬品      | 4.11     |        | 情報・通信業     | 5.60     |
|        | 石油・石炭製品  | 0.83     |        | 卸売業        | 5.13     |
|        | ゴム製品     | 0.60     |        | 小売業        | 3.48     |
|        | ガラス・土石製品 | 1.23     |        | 銀行業        | 8.77     |
|        | 鉄鋼       | 2.30     |        | 証券、商品先物取引業 | 1.50     |
|        | 非鉄金属     | 1.29     |        | 保険業        | 2.43     |
|        | 金属製品     | 0.63     |        | その他金融業     | 0.69     |
|        | 機械       | 4.79     |        | 不動産業       | 2.31     |
|        | 電気機器     | 14.81    |        | サービス業      | 1.63     |
|        | 輸送用機器    | 9.77     |        | 合計         | 97.08    |

## 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22年11月30日現在

| 種類           | 取引所等および資産の名称       | 買建 / 売建 | 数量 (枚) | 簿価 (円)        | 時価 (円)        | 投資比率 (%) |
|--------------|--------------------|---------|--------|---------------|---------------|----------|
| 株価指数<br>先物取引 | 東京証券取引所<br>TOPIX先物 | 買建      | 1,066  | 9,306,194,350 | 9,146,280,000 | 2.89     |

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

## 〔国内債券パッシブ・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成22年11月30日現在

| 資産の種類               | 国/地域 | 時価合計<br>(円)     | 投資比率<br>(%) |
|---------------------|------|-----------------|-------------|
| 国債証券                | 日本   | 368,487,586,750 | 73.62       |
| 地方債証券               | 日本   | 33,672,388,004  | 6.73        |
| 特殊債券                | 日本   | 53,696,717,453  | 10.73       |
|                     | 韓国   | 202,706,000     | 0.04        |
|                     | 小計   | 53,899,423,453  | 10.77       |
| 社債券                 | 日本   | 37,702,147,100  | 7.53        |
|                     | アメリカ | 2,815,607,000   | 0.56        |
|                     | イギリス | 706,769,000     | 0.14        |
|                     | オランダ | 100,480,000     | 0.02        |
|                     | 韓国   | 204,940,000     | 0.04        |
|                     | 小計   | 41,529,943,100  | 8.30        |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |      | 2,969,319,615   | 0.59        |
| 合計(純資産総額)           |      | 500,558,660,922 | 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22年11月30日現在

| 国/地域 | 種類   | 銘柄名            | 額面金額<br>(円)    | 帳簿価額<br>単価/金額<br>(円)     | 評価額<br>単価/金額<br>(円)      | 利率(%) /<br>償還期限   | 投資<br>比率<br>(%) |
|------|------|----------------|----------------|--------------------------|--------------------------|-------------------|-----------------|
| 日本   | 国債証券 | 第263回利付国債(10年) | 11,842,000,000 | 105.37<br>12,477,915,400 | 104.70<br>12,398,929,260 | 1.6<br>2014/9/20  | 2.48            |
| 日本   | 国債証券 | 第270回利付国債(10年) | 11,387,000,000 | 104.44<br>11,893,133,950 | 103.94<br>11,836,558,760 | 1.3<br>2015/6/20  | 2.36            |
| 日本   | 国債証券 | 第247回利付国債(10年) | 11,485,000,000 | 101.67<br>11,676,831,500 | 101.35<br>11,640,966,300 | 0.8<br>2013/3/20  | 2.33            |
| 日本   | 国債証券 | 第244回利付国債(10年) | 11,352,000,000 | 102.08<br>11,588,121,600 | 101.65<br>11,539,421,520 | 1<br>2012/12/20   | 2.31            |
| 日本   | 国債証券 | 第265回利付国債(10年) | 10,650,000,000 | 105.04<br>11,187,612,000 | 104.48<br>11,127,546,000 | 1.5<br>2014/12/20 | 2.22            |
| 日本   | 国債証券 | 第268回利付国債(10年) | 10,415,000,000 | 105.16<br>10,952,603,000 | 104.64<br>10,898,464,300 | 1.5<br>2015/3/20  | 2.18            |
| 日本   | 国債証券 | 第239回利付国債(10年) | 10,288,000,000 | 102.53<br>10,548,448,200 | 101.87<br>10,481,311,520 | 1.4<br>2012/6/20  | 2.09            |
| 日本   | 国債証券 | 第272回利付国債(10年) | 9,545,000,000  | 105.16<br>10,038,189,500 | 104.55<br>9,980,156,550  | 1.4<br>2015/9/20  | 1.99            |
| 日本   | 国債証券 | 第260回利付国債(10年) | 9,215,000,000  | 105.11<br>9,686,306,500  | 104.46<br>9,626,726,200  | 1.6<br>2014/6/20  | 1.92            |
| 日本   | 国債証券 | 第258回利付国債(10年) | 9,203,000,000  | 103.84<br>9,556,431,200  | 103.29<br>9,506,146,820  | 1.3<br>2014/3/20  | 1.90            |
| 日本   | 国債証券 | 第253回利付国債(10年) | 9,110,000,000  | 104.49<br>9,519,757,000  | 103.79<br>9,455,542,300  | 1.6<br>2013/9/20  | 1.89            |

|    |      |                |               |                         |                         |                   |      |
|----|------|----------------|---------------|-------------------------|-------------------------|-------------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第250回利付国債(10年) | 9,165,000,000 | 100.86<br>9,243,819,000 | 100.70<br>9,229,888,200 | 0.5<br>2013/6/20  | 1.84 |
| 日本 | 国債証券 | 第256回利付国債(10年) | 7,810,000,000 | 104.06<br>8,127,086,000 | 103.44<br>8,079,054,500 | 1.4<br>2013/12/20 | 1.61 |
| 日本 | 国債証券 | 第274回利付国債(10年) | 7,245,000,000 | 105.39<br>7,635,850,500 | 105.18<br>7,620,363,450 | 1.5<br>2015/12/20 | 1.52 |
| 日本 | 国債証券 | 第306回利付国債(10年) | 7,200,000,000 | 101.55<br>7,311,950,000 | 102.39<br>7,372,728,000 | 1.4<br>2020/3/20  | 1.47 |
| 日本 | 国債証券 | 第305回利付国債(10年) | 7,060,000,000 | 101.02<br>7,132,298,400 | 101.81<br>7,187,997,800 | 1.3<br>2019/12/20 | 1.44 |
| 日本 | 国債証券 | 第242回利付国債(10年) | 6,980,000,000 | 102.36<br>7,144,937,400 | 101.81<br>7,106,896,400 | 1.2<br>2012/9/20  | 1.42 |
| 日本 | 国債証券 | 第238回利付国債(10年) | 6,450,000,000 | 102.23<br>6,593,877,500 | 101.58<br>6,552,361,500 | 1.4<br>2012/3/20  | 1.31 |
| 日本 | 国債証券 | 第303回利付国債(10年) | 6,195,000,000 | 102.38<br>6,342,441,000 | 102.98<br>6,379,858,800 | 1.4<br>2019/9/20  | 1.27 |
| 日本 | 国債証券 | 第243回利付国債(10年) | 6,150,000,000 | 102.06<br>6,277,257,000 | 101.63<br>6,250,798,500 | 1.1<br>2012/9/20  | 1.25 |
| 日本 | 国債証券 | 第280回利付国債(10年) | 5,217,000,000 | 107.93<br>5,630,754,600 | 107.52<br>5,609,527,080 | 1.9<br>2016/6/20  | 1.12 |
| 日本 | 国債証券 | 第310回利付国債(10年) | 5,700,000,000 | 99.58<br>5,676,086,000  | 98.37<br>5,607,432,000  | 1<br>2020/9/20    | 1.12 |
| 日本 | 国債証券 | 第301回利付国債(10年) | 5,045,000,000 | 103.55<br>5,224,097,500 | 104.05<br>5,249,776,550 | 1.5<br>2019/6/20  | 1.05 |
| 日本 | 国債証券 | 第308回利付国債(10年) | 5,150,000,000 | 102.37<br>5,272,454,500 | 101.33<br>5,218,649,500 | 1.3<br>2020/6/20  | 1.04 |
| 日本 | 国債証券 | 第285回利付国債(10年) | 4,588,000,000 | 106.81<br>4,900,442,800 | 106.60<br>4,891,037,400 | 1.7<br>2017/3/20  | 0.98 |
| 日本 | 国債証券 | 第297回利付国債(10年) | 4,623,000,000 | 103.31<br>4,776,021,300 | 103.71<br>4,794,605,760 | 1.4<br>2018/12/20 | 0.96 |
| 日本 | 国債証券 | 第282回利付国債(10年) | 4,500,000,000 | 106.82<br>4,806,900,000 | 106.49<br>4,792,050,000 | 1.7<br>2016/9/20  | 0.96 |
| 日本 | 国債証券 | 第293回利付国債(10年) | 4,460,000,000 | 107.04<br>4,774,321,500 | 107.11<br>4,777,329,000 | 1.8<br>2018/6/20  | 0.95 |
| 日本 | 国債証券 | 第296回利付国債(10年) | 4,493,000,000 | 104.39<br>4,690,242,700 | 104.71<br>4,704,800,020 | 1.5<br>2018/9/20  | 0.94 |
| 日本 | 国債証券 | 第284回利付国債(10年) | 4,367,000,000 | 106.82<br>4,664,992,900 | 106.57<br>4,654,042,910 | 1.7<br>2016/12/20 | 0.93 |

□ 種類別の投資比率

平成22年11月30日現在

| 種類    | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 国債証券  | 73.62   |
| 地方債証券 | 6.73    |
| 特殊債券  | 10.77   |
| 社債券   | 8.30    |
| 合計    | 99.41   |

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22年11月30日現在

| 資産の種類 | 国／地域            | 時価合計<br>（円）     | 投資比率<br>（％） |
|-------|-----------------|-----------------|-------------|
| 株式    | アメリカ            | 121,598,756,208 | 51.78       |
|       | カナダ             | 13,305,127,458  | 5.67        |
|       | ドイツ             | 9,550,175,384   | 4.07        |
|       | イタリア            | 2,962,326,590   | 1.26        |
|       | フランス            | 10,463,171,484  | 4.46        |
|       | オーストラリア         | 9,248,938,196   | 3.94        |
|       | イギリス            | 23,968,573,089  | 10.21       |
|       | スイス             | 10,259,341,810  | 4.37        |
|       | バミューダ           | 743,764,351     | 0.32        |
|       | 香港              | 3,149,990,886   | 1.34        |
|       | シンガポール          | 1,864,491,188   | 0.79        |
|       | ニュージーランド        | 123,341,607     | 0.05        |
|       | オランダ            | 2,976,364,827   | 1.27        |
|       | スペイン            | 3,776,030,651   | 1.61        |
|       | ベルギー            | 1,059,447,473   | 0.45        |
|       | スウェーデン          | 3,577,844,761   | 1.52        |
|       | ノルウェー           | 909,482,754     | 0.39        |
|       | オーストリア          | 370,615,565     | 0.16        |
|       | ルクセンブルク         | 574,752,443     | 0.24        |
|       | フィンランド          | 1,251,853,203   | 0.53        |
|       | デンマーク           | 1,155,170,638   | 0.49        |
|       | アイルランド          | 1,310,640,195   | 0.56        |
|       | ギリシャ            | 294,627,871     | 0.13        |
|       | キプロス            | 33,986,452      | 0.01        |
|       | イスラエル           | 942,781,891     | 0.40        |
|       | ポルトガル           | 306,407,067     | 0.13        |
|       | ケイマン諸島          | 151,876,455     | 0.06        |
|       | モーリシャス          | 41,960,523      | 0.02        |
|       | リベリア            | 65,041,600      | 0.03        |
|       | ジャージー           | 684,533,928     | 0.29        |
| ガーンジー | 57,926,330      | 0.02            |             |
| アンティル | 1,193,509,099   | 0.51            |             |
| マン島   | 106,064,414     | 0.05            |             |
| 小計    | 228,078,916,391 | 97.11           |             |

|                     |         |                 |        |
|---------------------|---------|-----------------|--------|
| 投資証券                | アメリカ    | 2,121,686,456   | 0.90   |
|                     | カナダ     | 348,433,525     | 0.15   |
|                     | フランス    | 294,439,326     | 0.13   |
|                     | オーストラリア | 800,305,651     | 0.34   |
|                     | イギリス    | 280,481,201     | 0.12   |
|                     | 香港      | 77,541,966      | 0.03   |
|                     | シンガポール  | 62,520,172      | 0.03   |
|                     | オランダ    | 39,465,139      | 0.02   |
|                     | 小計      | 4,024,873,436   | 1.71   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |         | 2,751,482,380   | 1.17   |
| 合計(純資産総額)           |         | 234,855,272,207 | 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22年11月30日現在

| 国/<br>地域 | 種類 | 銘柄名 / 業種                                      | 数量<br>(株) | 帳簿価額<br>単価 / 金額<br>(円)     | 評価額<br>単価 / 金額<br>(円)      | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|----|---|-----------|----------------------------|----------------------------|-----------------|
| アメリカ     | 株式 | EXXON MOBIL CORPORATION<br>〔エネルギー〕            | 686,493   | 6,122.21<br>4,202,858,085  | 5,852.55<br>4,017,735,636  | 1.71            |
| アメリカ     | 株式 | APPLE INC<br>〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕             | 122,557   | 17,271.13<br>2,116,698,676 | 26,702.63<br>3,272,594,825 | 1.39            |
| アメリカ     | 株式 | MICROSOFT CORP<br>〔ソフトウェア・サービス〕               | 1,061,702 | 2,438.77<br>2,589,251,021  | 2,132.87<br>2,264,476,273  | 0.96            |
| スイス      | 株式 | NESTLE SA-REGISTERED<br>〔食品・飲料・タバコ〕           | 467,000   | 4,097.46<br>1,913,516,622  | 4,700.28<br>2,195,031,927  | 0.93            |
| アメリカ     | 株式 | INTL BUSINESS MACHINES CORP<br>〔ソフトウェア・サービス〕  | 172,686   | 10,602.85<br>1,830,963,996 | 12,041.34<br>2,079,370,891 | 0.89            |
| アメリカ     | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO<br>〔家庭用品・パーソナル用品〕         | 387,670   | 5,257.60<br>2,038,215,846  | 5,235.69<br>2,029,721,919  | 0.86            |
| イギリス     | 株式 | HSBC HOLDINGS PLC<br>〔銀行〕                     | 2,357,303 | 917.01<br>2,161,689,518    | 854.57<br>2,014,484,337    | 0.86            |
| アメリカ     | 株式 | JOHNSON & JOHNSON<br>〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕 | 371,376   | 5,275.30<br>1,959,120,555  | 5,217.15<br>1,937,526,415  | 0.82            |
| アメリカ     | 株式 | GENERAL ELECTRIC CO<br>〔資本財〕                  | 1,437,243 | 1,341.57<br>1,928,174,164  | 1,345.79<br>1,934,229,987  | 0.82            |
| アメリカ     | 株式 | CHEVRON CORPORATION<br>〔エネルギー〕                | 270,407   | 6,564.63<br>1,775,122,715  | 6,884.01<br>1,861,486,195  | 0.79            |
| アメリカ     | 株式 | AT&T INC<br>〔電気通信サービス〕                        | 795,751   | 2,264.33<br>1,801,846,761  | 2,334.27<br>1,857,504,848  | 0.79            |
| アメリカ     | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO<br>〔各種金融〕                 | 535,863   | 3,466.86<br>1,857,766,179  | 3,194.67<br>1,711,908,504  | 0.73            |
| アメリカ     | 株式 | GOOGLE INC-CL A<br>〔ソフトウェア・サービス〕              | 33,061    | 48,156.09<br>1,592,088,541 | 49,054.40<br>1,621,787,839 | 0.69            |
| オーストラリア  | 株式 | BHP BILLITON LTD<br>〔素材〕                      | 451,830   | 3,279.18<br>1,481,634,655  | 3,521.03<br>1,590,908,430  | 0.68            |
| アメリカ     | 株式 | WELLS FARGO & COMPANY<br>〔銀行〕                 | 666,332   | 2,280.34<br>1,519,467,644  | 2,292.14<br>1,527,328,895  | 0.65            |

|               |    |   |           |                           |                           |      |
|---------------|----|---|-----------|---------------------------|---------------------------|------|
| アメリカ          | 株式 | PFIZER INC<br>〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕          | 1,086,416 | 1,519.38<br>1,650,687,542 | 1,395.51<br>1,516,105,695 | 0.65 |
| アメリカ          | 株式 | COCA-COLA CO/THE<br>〔食品・飲料・タバコ〕                 | 279,487   | 4,796.64<br>1,340,600,871 | 5,341.87<br>1,492,984,701 | 0.64 |
| イギリス          | 株式 | VODAFONE GROUP PLC<br>〔電気通信サービス〕                | 7,097,038 | 179.73<br>1,275,552,768   | 208.98<br>1,483,179,240   | 0.63 |
| イギリス          | 株式 | BP PLC<br>〔エネルギー〕                               | 2,529,818 | 747.78<br>1,891,754,893   | 561.82<br>1,421,305,320   | 0.61 |
| アメリカ          | 株式 | INTEL CORP<br>〔半導体・半導体製造装置〕                     | 749,022   | 1,617.14<br>1,211,274,410 | 1,797.47<br>1,346,351,390 | 0.57 |
| スイス           | 株式 | NOVARTIS AG-REG SHS<br>〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕 | 284,083   | 4,674.98<br>1,328,085,042 | 4,556.95<br>1,294,553,589 | 0.55 |
| アメリカ          | 株式 | BANK OF AMERICA CORP<br>〔各種金融〕                  | 1,351,279 | 1,310.39<br>1,770,713,974 | 953.09<br>1,287,895,501   | 0.55 |
| アメリカ          | 株式 | CISCO SYSTEMS INC<br>〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕       | 768,631   | 1,965.17<br>1,510,495,501 | 1,638.20<br>1,259,178,068 | 0.54 |
| アメリカ          | 株式 | WAL-MART STORES INC<br>〔食品・生活必需品小売り〕            | 274,640   | 4,585.13<br>1,259,260,295 | 4,537.93<br>1,246,299,704 | 0.53 |
| アメリカ          | 株式 | ORACLE CORPORATION<br>〔ソフトウェア・サービス〕             | 540,429   | 1,867.42<br>1,009,209,652 | 2,293.82<br>1,239,651,928 | 0.53 |
| アメリカ          | 株式 | MERCK & CO. INC.<br>〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕    | 419,811   | 3,046.36<br>1,278,895,647 | 2,923.32<br>1,227,244,537 | 0.52 |
| イギリス          | 株式 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS<br>〔エネルギー〕          | 477,906   | 2,398.15<br>1,146,091,803 | 2,552.30<br>1,219,760,176 | 0.52 |
| アメリカ          | 株式 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.<br>〔食品・飲料・タバコ〕 | 249,252   | 4,195.80<br>1,045,812,364 | 4,872.49<br>1,214,478,226 | 0.52 |
| アン<br>テ<br>ィル | 株式 | SCHLUMBERGER LTD<br>〔エネルギー〕                     | 183,934   | 5,052.82<br>929,387,086   | 6,488.78<br>1,193,509,099 | 0.51 |
| アメリカ          | 株式 | PEPSICO INC<br>〔食品・飲料・タバコ〕                      | 216,974   | 5,255.91<br>1,140,397,964 | 5,394.12<br>1,170,384,378 | 0.50 |

## □ 種類別・業種別の投資比率

平成22年11月30日現在

| 種類 | 業種 | 投資<br>比率<br>(%) | 種類 | 業種 | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----|-----------------|----|----|-----------------|
|    |    |                 |    |    |                 |

|        |              |       |        |                        |       |
|--------|--------------|-------|--------|------------------------|-------|
| 株式(外国) | エネルギー        | 11.32 | 株式(外国) | ヘルスケア機器・サービス           | 2.58  |
|        | 素材           | 7.87  |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.21  |
|        | 資本財          | 7.49  |        | 銀行                     | 8.08  |
|        | 商業・専門サービス    | 0.81  |        | 各種金融                   | 5.38  |
|        | 運輸           | 1.79  |        | 保険                     | 4.09  |
|        | 自動車・自動車部品    | 1.33  |        | 不動産                    | 0.74  |
|        | 耐久消費財・アパレル   | 1.29  |        | ソフトウェア・サービス            | 5.42  |
|        | 消費者サービス      | 1.57  |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 4.61  |
|        | メディア         | 2.54  |        | 電気通信サービス               | 4.23  |
|        | 小売           | 2.73  |        | 公益事業                   | 3.89  |
|        | 食品・生活必需品小売り  | 2.45  |        | 半導体・半導体製造装置            | 1.62  |
|        | 食品・飲料・タバコ    | 6.31  |        | 投資証券                   | 1.71  |
|        | 家庭用品・パーソナル用品 | 1.76  |        | 合計                     | 98.83 |

**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22年11月30日現在

| 種類           | 取引所等および<br>資産の名称                       | 買建/<br>売建 | 数量<br>(枚) | 簿価(円)         | 時価(円)         | 投資<br>比率<br>(%) |
|--------------|--|-----------|-----------|---------------|---------------|-----------------|
| 海外金融<br>先物取引 | シカゴ商業取引所<br>S P 500 10 / 12            | 買建        | 68        | 1,713,223,762 | 1,699,768,035 | 0.72            |
| 海外金融<br>先物取引 | ロンドン国際金融先物オプション取引所<br>F T S E 10 / 12  | 買建        | 46        | 347,512,732   | 336,074,670   | 0.14            |
| 海外金融<br>先物取引 | ユーレックス・ドイツ金融先物取引所<br>D J E U R 10 / 12 | 買建        | 220       | 687,570,417   | 651,234,100   | 0.28            |

(注) 時価の算定方法

海外金融先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

## 〔外国債券バッシブ・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成22年11月30日現在

| 資産の種類               | 国/地域            | 時価合計<br>(円)     | 投資比率<br>(%) |
|---------------------|-----------------|-----------------|-------------|
| 国債証券                | アメリカ            | 102,600,965,330 | 40.79       |
|                     | カナダ             | 6,989,152,636   | 2.78        |
|                     | ドイツ             | 23,572,955,996  | 9.37        |
|                     | イタリア            | 24,100,836,488  | 9.58        |
|                     | フランス            | 22,989,028,938  | 9.14        |
|                     | オーストラリア         | 2,455,182,753   | 0.98        |
|                     | イギリス            | 19,384,345,532  | 7.71        |
|                     | スイス             | 1,345,486,428   | 0.53        |
|                     | シンガポール          | 940,394,244     | 0.37        |
|                     | マレーシア           | 1,269,879,019   | 0.50        |
|                     | オランダ            | 6,059,914,228   | 2.41        |
|                     | スペイン            | 9,923,574,929   | 3.94        |
|                     | ベルギー            | 6,462,343,482   | 2.57        |
|                     | スウェーデン          | 1,616,379,034   | 0.64        |
|                     | ノルウェー           | 628,005,260     | 0.25        |
|                     | オーストリア          | 4,290,006,017   | 1.71        |
|                     | フィンランド          | 1,345,486,168   | 0.53        |
|                     | デンマーク           | 2,129,328,194   | 0.85        |
|                     | メキシコ            | 2,307,852,608   | 0.92        |
|                     | アイルランド          | 1,940,556,998   | 0.77        |
| ポーランド               | 2,183,727,485   | 0.87            |             |
| ポルトガル               | 2,122,525,196   | 0.84            |             |
| 小計                  | 246,657,926,963 | 98.05           |             |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |                 | 4,903,302,399   | 1.95        |

|           |                 |        |
|-----------|-----------------|--------|
| 合計(純資産総額) | 251,561,229,362 | 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22年11月30日現在

| 国/<br>地域 | 種類   | 銘柄名                  | 数量         | 帳簿価額<br>単価 / 金額<br>(円)     | 評価額<br>単価 / 金額<br>(円)      | 利率(%) /<br>償還期限     | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|------|----------------------|------------|----------------------------|----------------------------|---------------------|-----------------|
| アメリカ     | 国債証券 | US T 3.625% 19/08/15 | 16,000,000 | 8,442.88<br>1,350,861,267  | 9,127.49<br>1,460,399,100  | 3.625<br>2019/8/15  | 0.58            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 3.125% 19/05/15 | 16,000,000 | 8,128.10<br>1,300,496,775  | 8,816.74<br>1,410,679,800  | 3.125<br>2019/5/15  | 0.56            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 3.625% 20/02/15 | 15,000,000 | 8,408.28<br>1,261,242,860  | 9,087.99<br>1,363,198,921  | 3.625<br>2020/2/15  | 0.54            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 3.375% 19/11/15 | 15,000,000 | 8,189.02<br>1,228,353,754  | 8,933.93<br>1,340,090,507  | 3.375<br>2019/11/15 | 0.53            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 2.75% 19/02/15  | 15,000,000 | 7,906.89<br>1,186,034,414  | 8,607.39<br>1,291,108,570  | 2.75<br>2019/2/15   | 0.51            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 2.625% 20/8/15  | 15,000,000 | 8,469.28<br>1,270,392,295  | 8,312.44<br>1,246,866,820  | 2.625<br>2020/8/15  | 0.50            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 3.75% 18/11/15  | 13,000,000 | 8,582.37<br>1,115,708,465  | 9,277.60<br>1,206,088,040  | 3.75<br>2018/11/15  | 0.48            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 3.5% 20/05/15   | 13,000,000 | 8,792.28<br>1,142,996,503  | 8,977.38<br>1,167,060,496  | 3.5<br>2020/5/15    | 0.46            |
| イギリス     | 国債証券 | UKT 5% 12/03/07      | 7,560,000  | 14,109.48<br>1,066,677,028 | 13,830.57<br>1,045,591,436 | 5<br>2012/3/7       | 0.42            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 0.875% 12/01/31 | 12,000,000 | 8,440.49<br>1,012,859,563  | 8,478.02<br>1,017,362,744  | 0.875<br>2012/1/31  | 0.40            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 0.75% 11/11/30  | 12,000,000 | 8,421.62<br>1,010,594,807  | 8,463.86<br>1,015,664,175  | 0.75<br>2011/11/30  | 0.40            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 2.375% 15/02/28 | 11,000,000 | 8,484.42<br>933,286,837    | 8,828.59<br>971,145,914    | 2.375<br>2015/2/28  | 0.39            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 4.375% 40/05/15 | 11,000,000 | 8,921.02<br>981,312,857    | 8,760.12<br>963,614,282    | 4.375<br>2040/5/15  | 0.38            |
| イタリア     | 国債証券 | BTPS 6% 31/05/01     | 7,900,000  | 13,001.44<br>1,027,114,028 | 12,067.47<br>953,330,367   | 6<br>2031/5/1       | 0.38            |
| イギリス     | 国債証券 | UKT 4.5% 13/03/07    | 6,700,000  | 14,113.05<br>945,574,752   | 14,145.82<br>947,770,216   | 4.5<br>2013/3/7     | 0.38            |
| イギリス     | 国債証券 | UKT 2.25% 14/03/07   | 7,000,000  | 12,962.88<br>907,401,873   | 13,455.63<br>941,894,347   | 2.25<br>2014/3/7    | 0.37            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 1% 12/03/31     | 11,000,000 | 8,453.33<br>929,866,781    | 8,496.12<br>934,574,055    | 1<br>2012/3/31      | 0.37            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 1% 11/10/31     | 11,000,000 | 8,448.98<br>929,388,012    | 8,480.65<br>932,872,194    | 1<br>2011/10/31     | 0.37            |
| フランス     | 国債証券 | FRTR 3.0% 15/10/25   | 8,000,000  | 11,289.23<br>903,139,196   | 11,497.57<br>919,805,920   | 3<br>2015/10/25     | 0.37            |
| アメリカ     | 国債証券 | US T 2.125% 14/11/30 | 10,500,000 | 8,279.77<br>869,376,721    | 8,758.81<br>919,675,378    | 2.125<br>2014/11/30 | 0.37            |

|      |      |                        |            |                          |                          |                     |      |
|------|------|------------------------|------------|--------------------------|--------------------------|---------------------|------|
| アメリカ | 国債証券 | US T 4.625% 40/02/15   | 10,000,000 | 8,610.37<br>861,037,973  | 9,131.44<br>913,144,453  | 4.625<br>2040/2/15  | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | US T 2.625% 14/07/31   | 10,000,000 | 8,581.05<br>858,105,609  | 8,920.11<br>892,011,121  | 2.625<br>2014/7/31  | 0.35 |
| フランス | 国債証券 | FRTR 3.75% 21/04/25    | 7,700,000  | 11,454.10<br>881,965,733 | 11,548.47<br>889,232,775 | 3.75<br>2021/4/25   | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | US T 2.5% 15/04/30     | 10,000,000 | 8,685.03<br>868,503,136  | 8,870.73<br>887,073,421  | 2.5<br>2015/4/30    | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | US T 2.375% 14/09/30   | 10,000,000 | 8,472.42<br>847,242,683  | 8,842.42<br>884,242,480  | 2.375<br>2014/9/30  | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | US T 1.75% 13/04/15    | 10,000,000 | 8,475.71<br>847,571,859  | 8,657.42<br>865,742,578  | 1.75<br>2013/4/15   | 0.34 |
| アメリカ | 国債証券 | US T 1.75% 12/08/15    | 10,000,000 | 8,549.45<br>854,945,484  | 8,610.02<br>861,002,390  | 1.75<br>2012/8/15   | 0.34 |
| アメリカ | 国債証券 | US T 1.375% 13/02/15   | 10,000,000 | 8,432.92<br>843,292,523  | 8,577.76<br>857,776,433  | 1.375<br>2013/2/15  | 0.34 |
| アメリカ | 国債証券 | US T 1.375% 2013/01/15 | 10,000,000 | 8,425.61<br>842,561,744  | 8,572.49<br>857,249,746  | 1.375<br>2013/1/15  | 0.34 |
| アメリカ | 国債証券 | US T 1.375% 12/11/15   | 10,000,000 | 8,439.90<br>843,990,384  | 8,566.57<br>856,657,218  | 1.375<br>2012/11/15 | 0.34 |

□ 種類別の投資比率

平成22年11月30日現在

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.05   |
| 合計   | 98.05   |

**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。

**〔マネーインカム・マザーファンド〕**

**（１）投資状況**

平成22年11月30日現在

| 資産の種類               | 国／地域 | 時価合計<br>（円） | 投資比率<br>（％） |
|---------------------|------|-------------|-------------|
| 国債証券                | 日本   | 238,397,695 | 96.53       |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) |      | 8,575,334   | 3.47        |
| 合計(純資産総額)           |      | 246,973,029 | 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22年11月30日現在

| 国/<br>地域 | 種類   | 銘柄名            | 額面金額<br>(円) | 帳簿価額<br>単価 / 金額<br>(円) | 評価額<br>単価 / 金額<br>(円) | 利率(%) /<br>償還期限   | 投資<br>比率<br>(%) |
|----------|------|----------------|-------------|------------------------|-----------------------|-------------------|-----------------|
| 日本       | 国債証券 | 第225回利付国債(10年) | 123,500,000 | 100.63<br>124,283,090  | 100.08<br>123,601,270 | 1.9<br>2010/12/20 | 50.05           |
| 日本       | 国債証券 | 第234回利付国債(10年) | 37,500,000  | 101.34<br>38,002,898   | 100.99<br>37,874,625  | 1.4<br>2011/9/20  | 15.34           |
| 日本       | 国債証券 | 第231回利付国債(10年) | 37,500,000  | 101.18<br>37,943,101   | 100.63<br>37,738,875  | 1.3<br>2011/6/20  | 15.28           |
| 日本       | 国債証券 | 第227回利付国債(10年) | 37,500,000  | 101.23<br>37,963,209   | 100.43<br>37,663,500  | 1.6<br>2011/3/21  | 15.25           |
| 日本       | 国債証券 | 第235回利付国債(10年) | 1,500,000   | 101.30<br>1,519,635    | 101.29<br>1,519,425   | 1.4<br>2011/12/20 | 0.62            |

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22年11月30日現在

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 96.53   |
| 合計   | 96.53   |

**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2010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



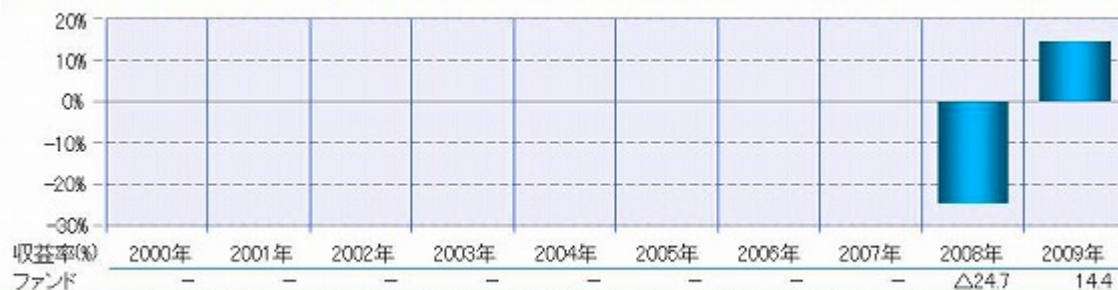
## 分配の推移

| 決算期     | 分配金 |
|---------|-----|
| 2010年4月 | 0円  |
| 2009年4月 | 0円  |
| 設定来累計   | 0円  |

※分配金は1万円当たり、税引前です。

※基準価額は、1万円当たり、信託報酬控除後です。

## 年間収益率の推移（暦年ベース）



2006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。  
 ファンドにはベンチマークはありません。

## 第2【管理及び運営】

### 4【受益者の権利等】

#### <訂正前>

( 略 )

#### 八 一部解約実行請求権

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

( 略 )

#### <訂正後>

( 略 )

#### 八 一部解約実行請求権

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

( 略 )

### 第3【ファンドの経理状況】

#### <訂正前>

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

また、第1期（平成20年3月31日から平成21年4月13日まで）については、改正前の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づき、第2期（平成21年4月14日から平成22年4月13日まで）については、改正後の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期（平成20年3月31日から平成21年4月13日まで）および第2期（平成21年4月14日から平成22年4月13日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

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

#### <訂正後>

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

また、第1期（平成20年3月31日から平成21年4月13日まで）については、改正前の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づき、第2期（平成21年4月14日から平成22年4月13日まで）については、改正後の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期（平成20年3月31日から平成21年4月13日まで）および第2期（平成21年4月14日から平成22年4月13日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

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

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

また、第2期中間計算期間（平成21年4月14日から平成21年10月13日まで）については、改正前の中間財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づき、第3期中間計算期間（平成22年4月14日から平成22年10月13日まで）については、改正後の中間財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

4. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期中間計算期間（平成21年4月14日から平成21年10月13日まで）の中間財務諸表については、あずさ監査法人により中間監査を受け、第3期中間計算期間（平成22年4月14日から平成22年10月13日まで）の中間財務諸表については、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。

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

## 1【財務諸表】

### [追加]

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



## 中間財務諸表

【スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 第2期中間計算期間<br>(平成21年10月13日現在) | 第3期中間計算期間<br>(平成22年10月13日現在) |
|-----------------|------------------------------|------------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                              |                              |
| 流動資産            |                              |                              |
| コール・ローン         | 4,316                        | 9,024                        |
| 親投資信託受益証券       | 1,858,390                    | 3,830,908                    |
| 流動資産合計          | 1,862,706                    | 3,839,932                    |
| 資産合計            | 1,862,706                    | 3,839,932                    |
| <b>負債の部</b>     |                              |                              |
| 流動負債            |                              |                              |
| 未払受託者報酬         | 251                          | 557                          |
| 未払委託者報酬         | 3,033                        | 7,313                        |
| その他未払費用         | 2                            | 32                           |
| 流動負債合計          | 3,286                        | 7,902                        |
| 負債合計            | 3,286                        | 7,902                        |
| <b>純資産の部</b>    |                              |                              |
| 元本等             |                              |                              |
| 元本              | 2,205,478                    | 4,666,454                    |
| 剰余金             |                              |                              |
| 中間剰余金又は中間欠損金( ) | 346,058                      | 834,424                      |
| 元本等合計           | 1,859,420                    | 3,832,030                    |
| 純資産合計           | 1,859,420                    | 3,832,030                    |
| 負債純資産合計         | 1,862,706                    | 3,839,932                    |

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

|                         | 第 2 期中間計算期間<br>自 平成21年 4 月14日<br>至 平成21年10月13日 | 第 3 期中間計算期間<br>自 平成22年 4 月14日<br>至 平成22年10月13日 |
|-------------------------|--|--|
| 営業収益                    |  |  |
| 有価証券売買等損益               | 120,262  | 312,841  |
| 営業収益合計                  | 120,262  | 312,841  |
| 営業費用                    |  |  |
| 受託者報酬                   | 251  | 557  |
| 委託者報酬                   | 3,033  | 7,313  |
| その他費用                   | 2  | 32   |
| 営業費用合計                  | 3,286  | 7,902  |
| 営業利益又は営業損失( )           | 116,976  | 320,743  |
| 経常利益又は経常損失( )           | 116,976  | 320,743  |
| 中間純利益又は中間純損失( )         | 116,976  | 320,743  |
| 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )   | -  | -  |
| 期首剰余金又は期首欠損金( )         | 260,565  | 369,606  |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額          | -  | -  |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額          | 202,469  | 144,075  |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 202,469  | 144,075  |
| 分配金                     | -  | -  |
| 中間剰余金又は中間欠損金( )         | 346,058  | 834,424  |

**（３）【中間注記表】**

（中間財務諸表作成の基本となる重要な事項に関する注記）

| 項目            | 第２期中間計算期間<br>自平成21年４月14日<br>至平成21年10月13日   | 第３期中間計算期間<br>自平成22年４月14日<br>至平成22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）<br>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。 | 親投資信託受益証券（売買目的有価証券）<br>同左                |

（中間貸借対照表に関する注記）

| 項目           | 第２期中間計算期間<br>（平成21年10月13日現在）                  | 第３期中間計算期間<br>（平成22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<br>2,205,478口            | 当中間計算期間の末日における受益権の総数<br>4,666,454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<br>346,058円 | 「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<br>834,424円 |
| ３．１単位当たり純資産額 | 0.8431円<br>（１万口＝8,431円）                       | 0.8212円<br>（１万口＝8,212円）                       |

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

金融商品の時価等に関する事項

| 項目                  | 第３期中間計算期間<br>自平成22年４月14日<br>至平成22年10月13日  |
|---------------------|---|
| 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）<br>「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。<br>（２）派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>（３）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

## (デリバティブ取引に関する注記)

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

## 第2期中間計算期間(平成21年10月13日現在)

第2期中間計算期間末現在、デリバティブ取引は行っていません。

## 第3期中間計算期間(平成22年10月13日現在)

第3期中間計算期間末現在、デリバティブ取引は行っていません。

## (その他の注記)

| 項目        | 第2期中間計算期間<br>(平成21年10月13日現在) | 第3期中間計算期間<br>(平成22年10月13日現在) |
|-----------|------------------------------|------------------------------|
| 期首元本額     | 1,155,193円                   | 3,817,258円                   |
| 期中追加設定元本額 | 1,050,285円                   | 849,196円                     |
| 期中一部解約元本額 | -円                           | -円                           |

## （参考情報）

当ファンドは、「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21年10月13日現在） | （平成22年10月13日現在） |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 科目          | 金額(円)           | 金額(円)           |
| 資産の部        |                 |                 |
| 流動資産        |                 |                 |
| コール・ローン     | 8,075,176,664   | 3,182,708,224   |
| 株式          | 321,275,107,113 | 306,760,878,745 |
| 新株予約権証券     | 3,857,000       | -               |
| 派生商品評価勘定    | 109,468,300     | 14,682,150      |
| 未収入金        | 16,624,324      | 200,700         |
| 未収配当金       | 2,153,287,076   | 2,580,589,898   |
| 未収利息        | 17,699          | 4,359           |
| 前払金         | -               | 98,124,000      |
| 差入委託証拠金     | 41,590,000      | -               |
| 流動資産合計      | 331,675,128,176 | 312,637,188,076 |
| 資産合計        | 331,675,128,176 | 312,637,188,076 |
| 負債の部        |                 |                 |
| 流動負債        |                 |                 |
| 前受金         | 106,603,000     | -               |
| 派生商品評価勘定    | 2,892,600       | 113,358,450     |
| 未払金         | 5,880,469,651   | 20,967,000      |
| 未払解約金       | 5,566,753       | 73,713,568      |
| 流動負債合計      | 5,995,532,004   | 208,039,018     |
| 負債合計        | 5,995,532,004   | 208,039,018     |
| 純資産の部       |                 |                 |
| 元本等         |                 |                 |
| 1 元本        |                 |                 |
| 元本          | 280,981,495,411 | 289,747,700,286 |
| 2 剰余金       |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 44,698,100,761  | 22,681,448,772  |
| 元本等合計       | 325,679,596,172 | 312,429,149,058 |
| 純資産合計       | 325,679,596,172 | 312,429,149,058 |
| 負債・純資産合計    | 331,675,128,176 | 312,637,188,076 |

（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21年10月13日ならびに平成22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

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目               | 自平成21年4月14日<br>至平成21年10月13日   | 自平成22年4月14日<br>至平成22年10月13日                          |
|------------------|---|--|
| 1. 資産の評価基準及び評価方法 | (1)株式および新株予約権証券（売買目的有価証券）<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。<br><br>(2)先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 | (1)株式および新株予約権証券（売買目的有価証券）<br>同左<br><br>(2)先物取引<br>同左 |
| 2. 収益及び費用の計上基準   | 受取配当金の計上基準<br>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。   | 受取配当金の計上基準<br>同左                                     |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目            | (平成21年10月13日現在)   | (平成22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。<br><br><table border="0"> <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;">4,332,000,000円</td> </tr> </table> | <u>担保資産</u>                                     | <u>金額</u> | 株式 | 4,332,000,000円 | 代用として、担保に供している資産は次の通りであります。<br><br><table border="0"> <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;">3,415,200,000円</td> </tr> </table> | <u>担保資産</u> | <u>金額</u> | 株式 | 3,415,200,000円 |
| <u>担保資産</u>   | <u>金額</u>   |   |           |    |                |   |             |           |    |                |
| 株式            | 4,332,000,000円  |   |           |    |                |   |             |           |    |                |
| <u>担保資産</u>   | <u>金額</u>   |   |           |    |                |   |             |           |    |                |
| 株式            | 3,415,200,000円  |   |           |    |                |   |             |           |    |                |
| 2. 受益権総数      | 平成21年10月13日現在における受益権の総数<br><br>280,981,495,411口   | 平成22年10月13日現在における受益権の総数<br><br>289,747,700,286口 |           |    |                |   |             |           |    |                |
| 3. 1単位当たり純資産額 | 1.1591円<br>(1万口 = 11,591円)  | 1.0783円<br>(1万口 = 10,783円)                      |           |    |                |   |             |           |    |                |

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

#### 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                 | 自 平成22年4月14日<br>至 平成22年10月13日   |
|--------------------|---|
| 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(株式および新株予約権証券)<br>「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

株式関連

（平成21年10月13日現在）

（単位：円）

| 区分   | 種類                          | 契約額等                             |          | 時価            | 評価損益                         |
|------|-----------------------------|----------------------------------|----------|---------------|------------------------------|
|      |                             |                                  | うち1年超    |               |                              |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>（TOPIX先物）<br>買建 | 7,282,397,000<br>(7,282,424,300) | -<br>(-) | 7,389,000,000 | 106,603,000<br>(106,575,700) |
|      | 買建合計                        | 7,282,397,000<br>(7,282,424,300) | -<br>(-) |               |                              |

（平成22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<br>（TOPIX先物）<br>買建 | 5,740,474,000<br>(5,741,026,300) | -<br>(-) | 5,642,350,000 | 98,124,000<br>(98,676,300) |
|      | 買建合計                        | 5,740,474,000<br>(5,741,026,300) | -<br>(-) |               |                            |

（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21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                 | 254,319,939,520円 |
| 同期中における追加設定元本額                    | 48,363,106,666円  |
| 同期中における一部解約元本額                    | 21,701,550,775円  |
| 平成21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             | 6,389,348,708円   |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)            | 240,084,442円     |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)              | 1,337,107,655円   |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)            | 843,875,579円     |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)         | 9,161,912円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020           | 2,327,200円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025           | 195,627円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030           | 2,883,987円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035           | 232,684円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040           | 239,821円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045           | 534,196円         |
| SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)     | 74,930,180,060円  |
| バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉      | 1,311,358,493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〉   | 50,001,056,388円  |
| SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉      | 17,750,753,987円  |
| SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉    | 8,511,883,995円   |
| SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉      | 29,068,101,947円  |
| SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉      | 181,316,592円     |
| SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉      | 577,963,998円     |
| 世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉        | 113,939,019円     |
| SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉      | 2,702,641,274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〉   | 122,727,127円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉   | 821,867,272円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉   | 3,102,449,555円   |
| SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉      | 4,990,693,640円   |
| SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉      | 12,983,199,706円  |
| SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉        | 1,357,425,082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)   | 10,985,584,960円  |
| SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉     | 228,361,572円     |
| SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉      | 3,076,192,140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)   | 47,052,758,523円  |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉 | 145,335,673円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉 | 84,162,986円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉 | 39,548,960円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉 | 672,628,670円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉 | 975,403,296円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉 | 367,968,685円     |
| 合 計                               | 280,981,495,411円 |

(平成22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                  | 275,836,932,817円 |
| 同期中における追加設定元本額                     | 21,276,917,507円  |
| 同期中における一部解約元本額                     | 7,366,150,038円   |
| 平成22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              | 7,489,569,729円   |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)             | 331,403,193円     |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)               | 1,794,107,249円   |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)             | 1,164,460,118円   |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)          | 18,761,555円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020            | 4,085,333円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025            | 615,638円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030            | 3,942,185円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035            | 568,709円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040            | 739,316円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045            | 1,137,389円       |
| 国内株式指数ファンド(TOPIX)                  | 476,319,977円     |
| SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)      | 75,545,977,884円  |
| バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉       | 1,008,348,652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〉    | 52,090,893,944円  |
| SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉       | 17,833,374,215円  |
| SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉     | 8,329,986,059円   |
| SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉       | 28,142,042,218円  |
| SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉       | 186,670,394円     |
| SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉       | 583,293,941円     |
| 世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉         | 107,339,058円     |
| SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉       | 2,566,338,547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〉    | 126,819,759円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉    | 1,127,020,505円   |
| SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉    | 3,734,279,613円   |
| SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉       | 5,037,618,949円   |
| SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉       | 12,421,406,941円  |
| SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉         | 1,364,424,983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)    | 11,021,486,200円  |
| SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉      | 233,173,403円     |
| SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉       | 3,062,345,351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)    | 46,864,365,325円  |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉  | 320,254,874円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉  | 160,727,873円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉  | 61,423,362円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉  | 933,759,468円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉  | 1,663,143,454円   |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉  | 582,339,087円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2〈適格機関投資家専用〉 | 224,198,387円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉 | 82,615,193円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2〈適格機関投資家専用〉 | 19,958,244円      |

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用> | 176,697,645円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 2,169,898,213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)  | 578,881,893円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用> | 100,886,261円     |
| 合 計                                | 289,747,700,286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21年10月13日現在) | (平成22年10月13日現在) |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 科 目         | 金額(円)           | 金額(円)           |
| 資産の部        |                 |                 |
| 流動資産        |                 |                 |
| コール・ローン     | 12,167,808,005  | 1,147,713,286   |
| 国債証券        | 369,236,799,230 | 374,192,388,330 |
| 地方債証券       | 33,362,721,898  | 34,190,866,630  |
| 特殊債券        | 59,504,663,572  | 55,210,033,847  |
| 社債券         | 40,625,230,500  | 41,319,507,400  |
| 未収入金        | 104,166,000     | -               |
| 未収利息        | 1,232,500,717   | 1,404,391,376   |
| 前払費用        | 217,692,331     | 43,152,407      |
| 流動資産合計      | 516,451,582,253 | 507,508,053,276 |
| 資産合計        | 516,451,582,253 | 507,508,053,276 |
| 負債の部        |                 |                 |
| 流動負債        |                 |                 |
| 未払金         | 11,262,639,500  | -               |
| 未払解約金       | -               | 130,899,967     |
| 流動負債合計      | 11,262,639,500  | 130,899,967     |
| 負債合計        | 11,262,639,500  | 130,899,967     |
| 純資産の部       |                 |                 |
| 元本等         |                 |                 |
| 1 元本        |                 |                 |
| 元本          | 476,669,848,812 | 460,914,647,699 |
| 2 剰余金       |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金( ) | 28,519,093,941  | 46,462,505,610  |
| 元本等合計       | 505,188,942,753 | 507,377,153,309 |
| 純資産合計       | 505,188,942,753 | 507,377,153,309 |
| 負債・純資産合計    | 516,451,582,253 | 507,508,053,276 |

(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21年10月13日ならびに平成22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

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目            | 自平成21年4月14日<br>至平成21年10月13日   | 自平成22年4月14日<br>至平成22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証券（売買目的有価証券）<br>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 | 国債証券、地方債証券、特殊債券および社債証券（売買目的有価証券）<br>同左 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目            | (平成21年10月13日現在)                             | (平成22年10月13日現在)                             |
|---------------|---|---|
| 1. 受益権総数      | 平成21年10月13日現在における受益権の総数<br>476,669,848,812口 | 平成22年10月13日現在における受益権の総数<br>460,914,647,699口 |
| 2. 1単位当たり純資産額 | 1.0598円<br>(1万口 = 10,598円)                  | 1.1008円<br>(1万口 = 11,008円)                  |

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

金融商品の時価等に関する事項

| 項目                 | 自平成22年4月14日<br>至平成22年10月13日   |
|--------------------|---|
| 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証券）<br>「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

(平成21年10月13日現在)

平成21年10月13日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

(平成22年10月13日現在)

平成22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21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                  | 250,471,635,464円 |
| 同期中における追加設定元本額                     | 230,806,469,494円 |
| 同期中における一部解約元本額                     | 4,608,256,146円   |
| 平成21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)             | 699,524,155円     |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)               | 1,429,361,635円   |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)             | 270,774,775円     |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)          | 23,846,932円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020            | 6,291,166円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025            | 306,133円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030            | 2,694,578円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035            | 186,449円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040            | 160,737円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045            | 340,619円         |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>       | 52,488,124,372円  |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>     | 13,964,894,891円  |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>       | 31,775,967,696円  |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>       | 581,496,300円     |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>       | 832,644,590円     |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>         | 212,113,415円     |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>       | 422,498,099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>    | 132,691,403円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>    | 2,382,246,524円   |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>    | 3,342,131,983円   |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>       | 8,246,838,528円   |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>       | 24,795,387,672円  |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>         | 1,479,312,569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) | 9,953,373,764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)    | 70,901,957,389円  |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>      | 1,018,464,446円   |
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>       | 13,818,344,615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)    | 227,184,879,700円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>  | 665,033,093円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>  | 180,618,466円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>  | 41,850,849円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>  | 3,497,521,196円   |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>  | 3,448,106,493円   |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>  | 2,869,863,580円   |
| 合計                                 | 476,669,848,812円 |

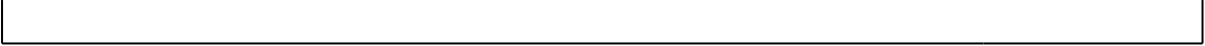
(平成22年10月13日現在)

## 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 | 483,635,046,295円 |
| 同期中における追加設定元本額    | 15,701,407,084円  |
| 同期中における一部解約元本額    | 38,421,805,680円  |

## 平成22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)             | 911,522,358円     |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)               | 1,801,794,886円   |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)             | 352,660,565円     |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)          | 37,195,117円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020            | 11,083,686円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025            | 1,018,133円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030            | 3,627,104円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035            | 441,621円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040            | 480,780円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045            | 703,447円         |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>       | 47,791,624,588円  |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>     | 12,552,387,274円  |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>       | 28,189,768,820円  |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>       | 557,922,799円     |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>       | 778,066,896円     |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>         | 188,636,654円     |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>       | 367,376,911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>    | 127,080,522円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>    | 3,013,888,488円   |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>    | 3,758,675,953円   |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>       | 7,592,148,748円   |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>       | 21,783,312,104円  |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>         | 1,368,265,383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) | 11,036,559,384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)    | 66,723,204,032円  |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>      | 937,468,828円     |
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>       | 12,291,378,461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)    | 213,330,763,125円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>  | 1,392,357,152円   |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>  | 322,106,779円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>  | 61,296,948円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>  | 4,521,070,309円   |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>  | 5,462,652,474円   |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>  | 4,234,586,266円   |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 976,246,758円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 165,528,327円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 19,554,314円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用> | 406,139,397円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 7,114,215,395円   |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用> | 729,836,913円     |
| 合計                                 | 460,914,647,699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21年10月13日現在) | (平成22年10月13日現在) |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 科目          | 金額(円)           | 金額(円)           |
| 資産の部        |                 |                 |
| 流動資産        |                 |                 |
| 預金          | 1,561,108,259   | 643,759,676     |
| コール・ローン     | 1,989,874,701   | 184,107,589     |
| 株式          | 244,125,406,559 | 229,563,264,986 |
| 新株予約権証券     | 613,585         | 1,331,318       |
| 投資証券        | 3,790,007,343   | 4,161,291,166   |
| 派生商品評価勘定    | 161,178,350     | 19,436,014      |
| 未収入金        | 43,678,925      | 1,280,201       |
| 未収配当金       | 254,758,668     | 232,583,371     |
| 未収利息        | 4,361           | 252             |
| 差入委託証拠金     | 2,847,796,707   | 523,361,271     |
| 流動資産合計      | 254,774,427,458 | 235,330,415,844 |
| 資産合計        | 254,774,427,458 | 235,330,415,844 |
| 負債の部        |                 |                 |
| 流動負債        |                 |                 |
| 派生商品評価勘定    | 215,000         | 1,845,801       |
| 未払金         | 6,269,231       | 5,391,322       |
| 未払解約金       | 219,909,000     | 5,289,339       |
| 流動負債合計      | 226,393,231     | 12,526,462      |
| 負債合計        | 226,393,231     | 12,526,462      |
| 純資産の部       |                 |                 |
| 元本等         |                 |                 |
| 1 元本        |                 |                 |
| 元本          | 209,300,435,473 | 195,821,730,987 |
| 2 剰余金       |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金( ) | 45,247,598,754  | 39,496,158,395  |
| 元本等合計       | 254,548,034,227 | 235,317,889,382 |
| 純資産合計       | 254,548,034,227 | 235,317,889,382 |
| 負債・純資産合計    | 254,774,427,458 | 235,330,415,844 |

(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21年10月13日ならびに平成22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

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                         | 自平成21年4月14日<br>至平成21年10月13日   | 自平成22年4月14日<br>至平成22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）<br/>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、取引所もしくは店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお売買停止措置がとられている銘柄について、必要であると判断された場合は、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> <p>(2)先物取引<br/>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(3)為替予約取引<br/>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> | <p>(1)株式、新株予約権証券および投資証券（売買目的有価証券）<br/>同左</p> <p>(2)先物取引<br/>同左</p> <p>(3)為替予約取引<br/>同左</p> |
| 2. 収益及び費用の計上基準             | <p>受取配当金の計上基準<br/>受取配当金は原則として、配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>   | <p>受取配当金の計上基準<br/>同左</p>   |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理<br/>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>   | <p>外貨建資産等の会計処理<br/>同左</p>  |

## (貸借対照表に関する注記)

| 項目            | (平成21年10月13日現在)                                 | (平成22年10月13日現在)                                 |
|---------------|---|---|
| 1. 受益権総数      | 平成21年10月13日現在における受益権の<br>総数<br>209,300,435,473口 | 平成22年10月13日現在における受益権の<br>総数<br>195,821,730,987口 |
| 2. 1単位当たり純資産額 | 1.2162円<br>(1万円 = 12,162円)                      | 1.2017円<br>(1万円 = 12,017円)                      |

## (金融商品に関する注記)

## (追加情報)

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

## 金融商品の時価等に関する事項

| 項目                 | 自平成22年4月14日<br>至平成22年10月13日  |
|--------------------|--|
| 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、新株予約権証券および投資証券)<br>「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。<br>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(デリバティブ取引に関する注記)

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

株式関連

(平成21年10月13日現在)

(単位：円)

| 区分    | 種類             | 契約額等                             |       | 時価                               | 評価損益                         |
|-------|----------------|----------------------------------|-------|----------------------------------|------------------------------|
|       |                |                                  | うち1年超 |                                  |                              |
| 市場取引  | 株価指数先物取引<br>買建 |                                  |       |                                  |                              |
|       | SP500          | 3,779,511,380<br>(42,088,100米ドル) | ( )   | 3,872,883,175<br>(43,127,875米ドル) | 93,371,795<br>(1,039,775米ドル) |
|       | DJ EUR         | 1,747,593,293<br>(13,171,490ユーロ) | ( )   | 1,795,646,008<br>(13,533,660ユーロ) | 48,052,715<br>(362,170ユーロ)   |
|       | FTSE           | 782,100,500<br>(5,507,750英ポンド)   | ( )   | 801,450,840<br>(5,644,020英ポンド)   | 19,350,340<br>(136,270英ポンド)  |
| 買建 合計 |                | 6,309,205,173                    |       | 6,469,980,023                    | 160,774,850                  |

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

通貨関連

(平成21年10月13日現在)

(単位：円)

| 区分    | 種類           | 契約額等        |       | 時価          | 評価損益    |
|-------|--------------|-------------|-------|-------------|---------|
|       |              |             | うち1年超 |             |         |
| 市場外取引 | 為替予約取引<br>売建 |             |       |             |         |
|       | 米ドル          | 359,482,400 | -     | 359,160,000 | 322,400 |
|       | カナダドル        | 86,880,300  | -     | 86,830,000  | 50,300  |
|       | ユーロ          | 132,700,800 | -     | 132,670,000 | 30,800  |
|       | 英ポンド         | 212,853,000 | -     | 212,985,000 | 132,000 |
|       | オーストラリアドル    | 81,397,000  | -     | 81,480,000  | 83,000  |
|       | 売建 合計        | 873,313,500 | -     | 873,125,000 | 188,500 |

(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。

（平成22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<br>買建 |                                |       |                                |                            |
|       | S P 5 0 0      | 936,067,690<br>(11,439,175米ドル) | ( )   | 952,910,349<br>(11,645,000米ドル) | 16,842,659<br>(205,825米ドル) |
|       | D J E U R      | 401,956,020<br>(3,525,930ユーロ)  | ( )   | 400,316,700<br>(3,511,550ユーロ)  | 1,639,320<br>( 14,380ユーロ)  |
|       | F T S E        | 194,417,931<br>(1,506,065英ポンド) | ( )   | 196,804,805<br>(1,524,555英ポンド) | 2,386,874<br>(18,490英ポンド)  |
| 買建 合計 |                | 1,532,441,641                  |       | 1,550,031,854                  | 17,590,213                 |

（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。

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。

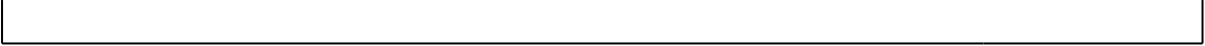
(その他の注記)

(平成21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                  | 198,715,843,917円 |
| 同期中における追加設定元本額                     | 40,895,443,505円  |
| 同期中における一部解約元本額                     | 30,310,851,949円  |
| 平成21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             | 1,481,620,954円   |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)             | 115,008,177円     |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)               | 559,834,243円     |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)             | 331,935,033円     |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)          | 4,795,914円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020            | 1,154,536円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025            | 121,826円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030            | 2,011,887円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035            | 171,999円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040            | 180,654円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045            | 462,062円         |
| SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)      | 43,756,762,188円  |
| バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉       | 651,866,910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〉    | 26,010,988,381円  |
| SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉       | 12,092,111,107円  |
| SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉     | 7,546,470,579円   |
| SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉       | 29,520,096,192円  |
| SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉       | 90,365,971円      |
| SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉       | 383,216,801円     |
| 世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉         | 84,432,167円      |
| SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉       | 3,064,233,751円   |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型〈適格機関投資家限定〉    | 182,490,375円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉    | 539,423,733円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉    | 3,040,816,195円   |
| SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉       | 5,002,312,811円   |
| SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉       | 9,873,773,005円   |
| SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉         | 1,359,976,522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) | 2,479,743,418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)    | 10,666,666,599円  |
| SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉      | 700,747,771円     |
| SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉       | 3,113,614,107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)    | 45,566,405,847円  |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉  | 46,733,892円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉  | 32,568,169円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉  | 16,434,639円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉  | 217,705,304円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉  | 405,894,179円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉  | 357,287,575円     |
| 合 計                                | 209,300,435,473円 |

(平成22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                  | 192,707,244,458円 |
| 同期中における追加設定元本額                     | 15,511,089,592円  |
| 同期中における一部解約元本額                     | 12,396,603,063円  |
| 平成22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             | 2,619,796,575円   |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)             | 152,427,476円     |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)               | 709,058,404円     |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)             | 431,076,318円     |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)          | 9,721,909円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020            | 1,828,314円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025            | 341,181円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030            | 2,641,031円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035            | 386,711円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040            | 514,852円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045            | 915,186円         |
| 外国株式指数ファンド                         | 132,482,362円     |
| SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)      | 40,243,499,384円  |
| バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉       | 460,738,357円     |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型〈適格機関投資家限定〉    | 23,900,587,905円  |
| SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉       | 10,832,653,529円  |
| SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉     | 6,653,410,275円   |
| SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉       | 25,770,614,542円  |
| SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉       | 85,853,413円      |
| SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉       | 357,465,351円     |
| 世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉         | 73,677,966円      |
| SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉       | 2,698,057,255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〉    | 174,760,801円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉    | 688,647,941円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉    | 3,423,656,342円   |
| SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉       | 4,607,432,734円   |
| SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉       | 8,515,317,334円   |
| SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉         | 1,249,564,515円   |
| 三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 3,558,489,447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)    | 10,151,664,217円  |
| SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉      | 644,142,344円     |
| SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉       | 2,808,805,307円   |
| 三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)    | 43,210,512,394円  |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉  | 98,068,296円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉  | 58,944,819円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉  | 24,076,307円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉  | 285,434,164円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉  | 651,698,317円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉  | 532,767,412円     |
| 合 計                                | 195,821,730,987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21年10月13日現在) | (平成22年10月13日現在) |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 科目          | 金額(円)           | 金額(円)           |
| 資産の部        |                 |                 |
| 流動資産        |                 |                 |
| 預金          | 663,987,356     | 594,208,929     |
| コール・ローン     | 3,285,322,303   | 567,867,054     |
| 国債証券        | 248,635,327,007 | 250,710,077,236 |
| 派生商品評価勘定    | 26,464,795      | -               |
| 未収利息        | 3,103,830,013   | 3,136,371,354   |
| 前払費用        | 513,371,013     | 153,859,684     |
| 流動資産合計      | 256,228,302,487 | 255,162,384,257 |
| 資産合計        | 256,228,302,487 | 255,162,384,257 |
| 負債の部        |                 |                 |
| 流動負債        |                 |                 |
| 派生商品評価勘定    | 615,465         | -               |
| 未払金         | 2,294,750,988   | 231,646,511     |
| 未払解約金       | -               | 60,747,416      |
| 流動負債合計      | 2,295,366,453   | 292,393,927     |
| 負債合計        | 2,295,366,453   | 292,393,927     |
| 純資産の部       |                 |                 |
| 元本等         |                 |                 |
| 1 元本        |                 |                 |
| 元本          | 208,705,562,709 | 222,496,597,985 |
| 2 剰余金       |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金( ) | 45,227,373,325  | 32,373,392,345  |
| 元本等合計       | 253,932,936,034 | 254,869,990,330 |
| 純資産合計       | 253,932,936,034 | 254,869,990,330 |
| 負債・純資産合計    | 256,228,302,487 | 255,162,384,257 |

(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21年10月13日ならびに平成22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

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 項目                         | 自平成21年4月14日<br>至平成21年10月13日   | 自平成22年4月14日<br>至平成22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）<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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）、または価格情報会社の提供する価額で評価しております。<br><br>(2)為替予約取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 | (1)国債証券（売買目的有価証券）<br>同左<br><br>(2)為替予約取引<br>同左 |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建資産等の会計処理<br>「投資信託財産の計算に関する規則」<br>第60条および第61条に基づいて処理しております。   | 外貨建資産等の会計処理<br>同左                              |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目            | (平成21年10月13日現在)                                     | (平成22年10月13日現在)                                     |
|---------------|---|---|
| 1. 受益権総数      | 平成21年10月13日現在における受益権の<br>総数<br><br>208,705,562,709口 | 平成22年10月13日現在における受益権の<br>総数<br><br>222,496,597,985口 |
| 2. 1単位当たり純資産額 | 1.2167円<br>(1万円 = 12,167円)                          | 1.1455円<br>(1万円 = 11,455円)                          |

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

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

金融商品の時価等に関する事項

| 項目                 | 自平成22年4月14日<br>至平成22年10月13日   |
|--------------------|---|
| 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）<br>「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。<br><br>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br><br>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

通貨関連

（平成21年10月13日現在）

（単位：円）

| 区分    | 種類     | 契約額等          |       | 時価            | 評価損益       |
|-------|--------|---------------|-------|---------------|------------|
|       |        |               | うち1年超 |               |            |
| 市場外取引 | 為替予約取引 |               |       |               |            |
|       | 買建     |               |       |               |            |
|       | 米ドル    | 996,395,701   | -     | 1,004,277,917 | 7,882,216  |
|       | カナダドル  | 84,319,714    | -     | 87,389,363    | 3,069,649  |
|       | ユーロ    | 1,519,675,866 | -     | 1,534,252,585 | 14,576,719 |
|       | 英ポンド   | 351,748,169   | -     | 352,068,915   | 320,746    |
|       | 買建 合計  | 2,952,139,450 | -     | 2,977,988,780 | 25,849,330 |

（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

- 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。
- 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。

（平成22年10月13日現在）

平成22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21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                  | 151,497,648,151円 |
| 同期中における追加設定元本額                     | 58,064,338,134円  |
| 同期中における一部解約元本額                     | 856,423,576円     |
| 平成21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             | 1,129,595,872円   |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)             | 113,762,930円     |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)               | 361,618,462円     |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)             | 160,392,678円     |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)          | 5,515,788円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020            | 2,038,429円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025            | 143,771円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030            | 1,780,309円       |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035            | 139,273円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040            | 137,268円         |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045            | 231,638円         |
| SMAM・年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>     | 5,246,769,835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>    | 11,648,080,707円  |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>       | 39,888,371,941円  |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>     | 13,176,738,984円  |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>       | 27,357,116,018円  |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>       | 83,750,647円      |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>       | 182,036,777円     |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>         | 52,920,395円      |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>       | 1,462,910,267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>    | 172,581,168円     |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>    | 1,813,916,993円   |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>    | 2,909,527,104円   |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>       | 7,085,069,730円   |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>       | 18,440,915,846円  |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>         | 1,274,673,374円   |
| SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>     | 5,572,924,274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) | 1,607,476,336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)    | 10,423,767,083円  |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>      | 447,359,777円     |
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>       | 11,857,402,694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)    | 44,521,070,185円  |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>  | 134,759,077円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>  | 47,723,740円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>  | 15,824,901円      |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>  | 319,116,722円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>  | 925,544,177円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>  | 261,857,539円     |
| 合 計                                | 208,705,562,709円 |

(平成22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 | 218,330,196,293円 |
| 同期中における追加設定元本額    | 9,227,425,571円   |
| 同期中における一部解約元本額    | 5,061,023,879円   |

## 平成22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             | 1,922,195,883円  |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)             | 159,295,134円    |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型)               | 493,817,711円    |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)             | 225,103,458円    |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)          | 11,678,959円     |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020            | 3,802,460円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025            | 490,884円        |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030            | 2,559,981円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035            | 351,182円        |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040            | 436,316円        |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045            | 569,909円        |
| SMAM・年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>     | 5,409,141,075円  |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>    | 12,526,169,077円 |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>       | 40,006,490,544円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>     | 12,981,660,869円 |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>       | 26,957,265,770円 |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>       | 88,572,092円     |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>       | 185,555,394円    |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>         | 51,279,509円     |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>       | 1,407,208,330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>    | 181,358,682円    |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>    | 2,516,824,264円  |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>    | 3,596,471,735円  |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>       | 7,247,616,685円  |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>       | 17,791,294,989円 |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>         | 1,308,873,865円  |
| SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>     | 11,725,509,170円 |
| 三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 2,243,064,112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)    | 10,608,302,745円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>      | 448,644,059円    |
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>       | 11,725,300,545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)    | 45,377,211,617円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>  | 306,531,327円    |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>  | 92,456,501円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>  | 25,215,656円     |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>  | 447,144,395円    |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>  | 1,589,377,503円  |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>  | 418,070,809円    |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用> | 214,186,004円    |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用> | 47,386,281円     |

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用> | 7,992,094円       |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用> | 2,071,867,343円   |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用> | 72,253,067円      |
| 合 計                                | 222,496,597,985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21年10月13日現在) | (平成22年10月13日現在) |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 科 目         | 金額(円)           | 金額(円)           |
| 資産の部        |                 |                 |
| 流動資産        |                 |                 |
| コール・ローン     | 5,783,461       | 7,727,990       |
| 国債証券        | 129,191,477     | 226,777,050     |
| 未収利息        | 242,041         | 510,511         |
| 前払費用        | 274,743         | 432,094         |
| 流動資産合計      | 135,491,722     | 235,447,645     |
| 資産合計        | 135,491,722     | 235,447,645     |
| 負債の部        |                 |                 |
| 流動負債        |                 |                 |
| 未払解約金       | 90,000          | -               |
| 流動負債合計      | 90,000          | -               |
| 負債合計        | 90,000          | -               |
| 純資産の部       |                 |                 |
| 元本等         |                 |                 |
| 1 元本        |                 |                 |
| 元本          | 134,510,105     | 233,620,490     |
| 2 剰余金       |                 |                 |
| 剰余金又は欠損金( ) | 891,617         | 1,827,155       |
| 元本等合計       | 135,401,722     | 235,447,645     |
| 純資産合計       | 135,401,722     | 235,447,645     |
| 負債・純資産合計    | 135,491,722     | 235,447,645     |

(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21年10月13日ならびに平成22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**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| 項目            | 自平成21年4月14日<br>至平成21年10月13日   | 自平成22年4月14日<br>至平成22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）<br>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 | 国債証券（売買目的有価証券）<br>同左        |

（貸借対照表に関する注記）

| 項目            | （平成21年10月13日現在）                             | （平成22年10月13日現在）                             |
|---------------|---|---|
| 1. 受益権総数      | 平成21年10月13日現在における受益権の<br>総数<br>134,510,105口 | 平成22年10月13日現在における受益権の<br>総数<br>233,620,490口 |
| 2. 1単位当たり純資産額 | 1.0066円<br>（1万口 = 10,066円）                  | 1.0078円<br>（1万口 = 10,078円）                  |

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

金融商品の時価等に関する事項

| 項目                 | 自平成22年4月14日<br>至平成22年10月13日  |
|--------------------|--|
| 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）<br>「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。<br>（2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引）<br>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。<br>（3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等<br>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

（デリバティブ取引に関する注記）

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年10月13日現在）

平成21年10月13日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成22年10月13日現在）

平成22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21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              | 21,902,962円  |
| 同期中における追加設定元本額                 | 145,947,481円 |
| 同期中における一部解約元本額                 | 33,340,338円  |
| 平成21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)      | 2,528,949円   |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020        | 269,982円     |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025        | 17,007円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030        | 220,277円     |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035        | 17,004円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040        | 17,004円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045        | 34,199円      |
| 三井住友・ロシア株式オープン                 | 999,001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> | 130,406,682円 |
| 合 計                            | 134,510,105円 |

| (平成22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              | 172,477,387円 |
| 同期中における追加設定元本額                 | 76,006,199円  |
| 同期中における一部解約元本額                 | 14,863,096円  |
| 平成22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)      | 3,169,219円   |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020        | 1,088,464円   |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025        | 53,748円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030        | 292,752円     |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035        | 39,848円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040        | 46,779円      |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045        | 76,900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)         | 8,340,735円   |
| S M A M円高期待ファンド(米ドル安型)         | 9,336,148円   |
| S M A M円高期待ファンド(ユーロ安型)         | 4,072,283円   |
| アジア高成長国C Bファンド                 | 29,767,812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> | 176,336,801円 |
| 合 計                            | 233,620,490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22年11月30日現在

|                |             |
|----------------|-------------|
| 資産総額           | 4,564,912 円 |
| 負債総額           | 2,427 円     |
| 純資産総額( - )     | 4,562,485 円 |
| 発行済口数          | 5,479,682 口 |
| 1口当たり純資産額( / ) | 0.8326 円    |
| ( 1万口当たり純資産額   | 8,326 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>

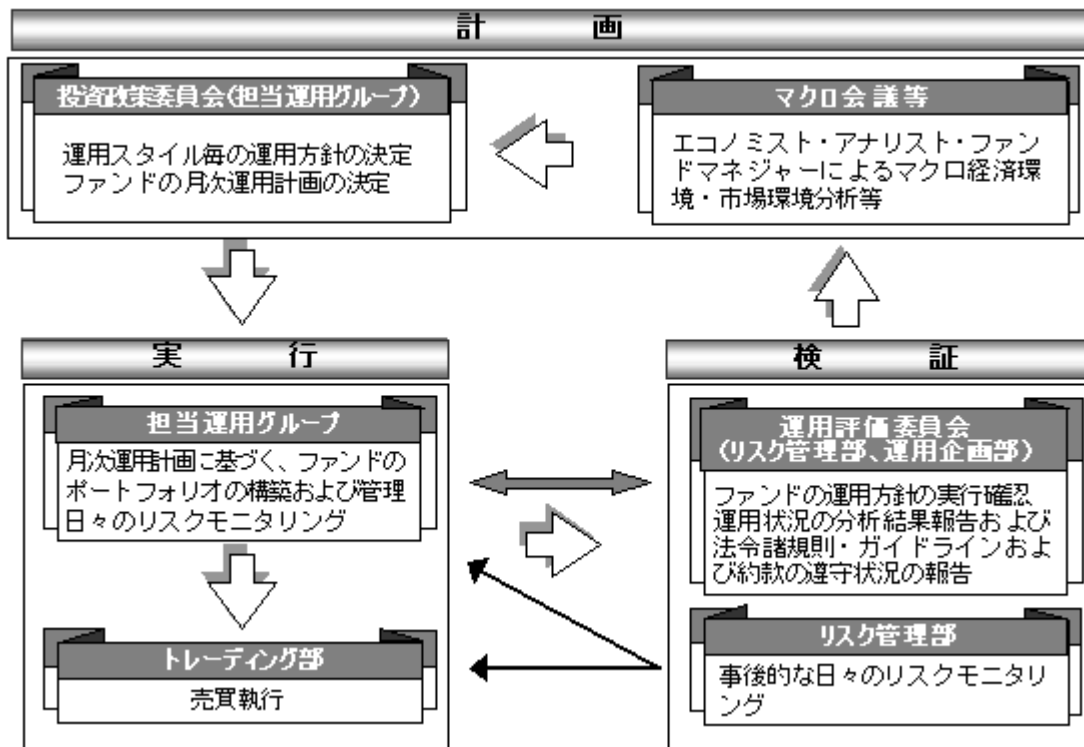
イ 資本金の額および株式数

平成22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 )

二 投資信託の運用の流れ



## &lt;訂正後&gt;

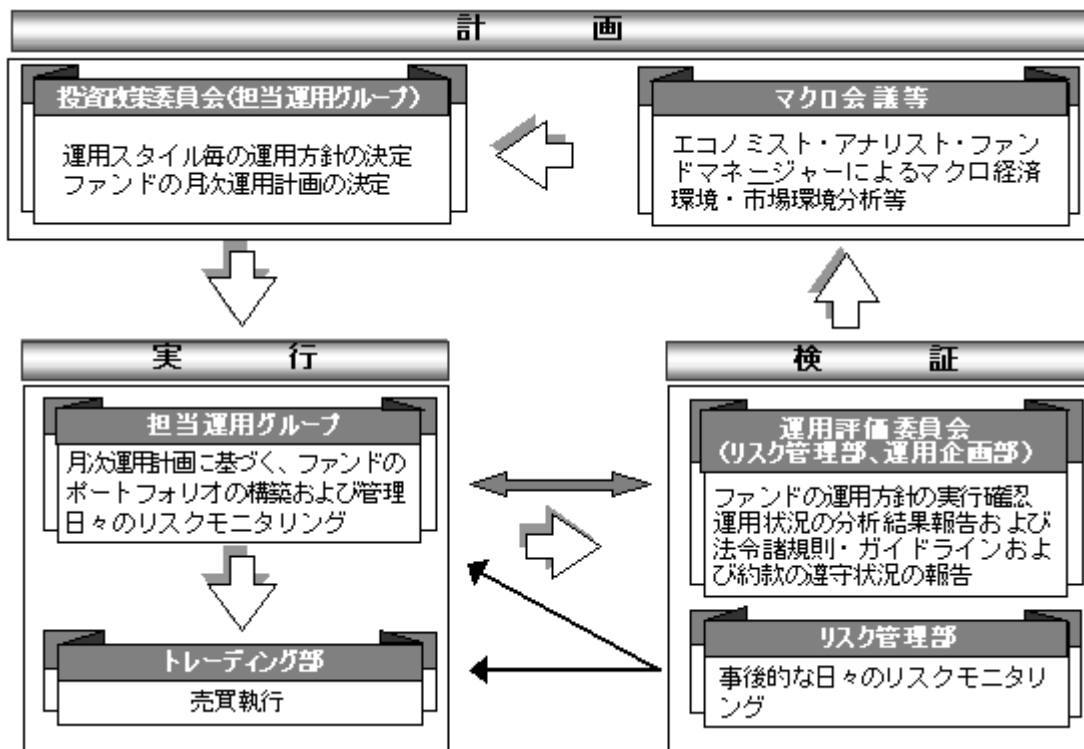
## イ 資本金の額および株式数

平成22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)

## 二 投資信託の運用の流れ



## 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22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22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 | $\frac{67}{(1)}$    | $\frac{162,998}{(182)}$         |
|         | 追加型 | $\frac{245}{(111)}$ | $\frac{4,166,499}{(2,421,610)}$ |
|         | 計   | $\frac{312}{(112)}$ | $\frac{4,329,497}{(2,421,791)}$ |
| 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      |     | $\frac{312}{(112)}$ | $\frac{4,329,497}{(2,421,791)}$ |

（ ）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22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22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 | $\frac{64}{(1)}$    | $\frac{145,628}{(205)}$         |
|         | 追加型 | $\frac{256}{(121)}$ | $\frac{4,927,373}{(3,184,221)}$ |
|         | 計   | $\frac{320}{(122)}$ | $\frac{5,073,001}{(3,184,426)}$ |
| 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      |     | $\frac{320}{(122)}$ | $\frac{5,073,001}{(3,184,426)}$ |

（ ）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、第24期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しており、第25期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）については、改正後の「財務諸表等規則」並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、第24期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）及び第25期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、あずさ監査法人の監査を受けております。  
なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年7月1日をもって有限責任 あずさ監査法人となっております。

#### <訂正後>

- 1 当社の財務諸表は、第24期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しており、第25期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）については、改正後の「財務諸表等規則」並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。  
また、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24期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）及び第25期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、あずさ監査法人の監査を受けており、第26期中間会計期間(平成22年4月1日から平成22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。  
なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年7月1日付をもって、名称を有限責任 あずさ監査法人に変更しております。

**【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26期中間会計期間末<br>(平成22年9月30日現在) |
|------------|---|-------------------------------|
| 資産の部       |   |                               |
| 流動資産       |   |                               |
| 現金及び預金     |   | 16,070,989                    |
| 有価証券       |   | 4,943,990                     |
| 前払費用       |   | 251,072                       |
| 未収委託者報酬    |   | 3,680,857                     |
| 未収運用受託報酬   |   | 476,281                       |
| 未収投資助言報酬   |   | 424,563                       |
| 未収収益       |   | 28,359                        |
| 繰延税金資産     |   | 238,094                       |
| その他        |   | 3,965                         |
| 流動資産合計     |   | 26,118,172                    |
| 固定資産       |   |                               |
| 有形固定資産     | 1 | 282,221                       |
| 無形固定資産     |   | 5,332                         |
| 投資その他の資産   |   |                               |
| 投資有価証券     |   | 4,108,176                     |
| その他        |   | 1,523,074                     |
| 投資その他の資産合計 |   | 5,631,251                     |
| 固定資産合計     |   | 5,918,806                     |
| 資産合計       |   | 32,036,978                    |
| 負債の部       |   |                               |
| 流動負債       |   |                               |
| 預り金        |   | 44,787                        |
| 未払金        |   | 1,890,909                     |

|         |   |           |
|---------|---|-----------|
| 未払費用    |   | 764,737   |
| 未払法人税等  |   | 980,584   |
| 前受収益    |   | 6,563     |
| 賞与引当金   |   | 322,819   |
| その他     | 2 | 115,673   |
| 流動負債合計  |   | 4,126,076 |
| 固定負債    |   |           |
| 退職給付引当金 |   | 1,226,435 |
| 固定負債合計  |   | 1,226,435 |
| 負債合計    |   | 5,352,511 |

|              |            |
|--------------|------------|
| 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      | 14,195,382 |
| 利益剰余金合計      | 16,016,587 |
| 株主資本合計       | 26,645,571 |
| 評価・換算差額等     |            |
| その他有価証券評価差額金 | 38,896     |
| 評価・換算差額等合計   | 38,896     |
| 純資産合計        | 26,684,467 |
| 負債純資産合計      | 32,036,978 |



## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

|              |   | 第26期中間会計期間<br>(自 平成22年 4月 1日<br>至 平成22年 9月30日) |            |
|--------------|---|--|------------|
| 営業収益         |   |  |            |
| 委託者報酬        |   |  | 13,415,979 |
| 運用受託報酬       |   |  | 1,026,282  |
| 投資助言報酬       |   |  | 929,636    |
| その他の営業収益     |   |  | 137,538    |
| 営業収益計        |   |  | 15,509,437 |
| 営業費用         |   |  | 9,566,713  |
| 一般管理費        | 1 |  | 3,742,792  |
| 営業利益         |   |  | 2,199,930  |
| 営業外収益        | 2 |  | 37,736     |
| 営業外費用        |   |  | 659        |
| 経常利益         |   |  | 2,237,008  |
| 特別利益         |   |  | 42,823     |
| 特別損失         |   |  | 26,822     |
| 税引前中間純利益     |   |  | 2,253,008  |
| 法人税、住民税及び事業税 |   |  | 923,945    |
| 法人税等調整額      |   |  | 16,386     |
| 法人税等合計       |   |  | 907,558    |
| 中間純利益        |   |  | 1,345,450  |

## (3)中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

| 第26期中間会計期間<br>(自 平成22年 4月 1日<br>至 平成22年 9月30日) |            |
|--|------------|
| 株主資本   |            |
| 資本金  |            |
| 前期末残高  | 2,000,000  |
| 当中間期末残高  | 2,000,000  |
| 資本剰余金  |            |
| 資本準備金  |            |
| 前期末残高  | 8,628,984  |
| 当中間期末残高  | 8,628,984  |
| 資本剰余金合計  |            |
| 前期末残高  | 8,628,984  |
| 当中間期末残高  | 8,628,984  |
| 利益剰余金  |            |
| 利益準備金  |            |
| 前期末残高  | 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  |            |
| 前期末残高  | 60,000     |
| 当中間期末残高  | 60,000     |
| 別途積立金  |            |
| 前期末残高  | 1,476,959  |
| 当中間期末残高  | 1,476,959  |
| 繰越利益剰余金  |            |
| 前期末残高  | 14,172,932 |
| 当中間期変動額  |            |
| 剰余金の配当   | 1,323,000  |
| 中間純利益  | 1,345,450  |

|           |            |
|-----------|------------|
| 当中間期変動額合計 | 22,450     |
| 当中間期末残高   | 14,195,382 |
| 利益剰余金合計   |            |
| 前期末残高     | 15,994,137 |
| 当中間期変動額   |            |
| 剰余金の配当    | 1,323,000  |
| 中間純利益     | 1,345,450  |
| 当中間期変動額合計 | 22,450     |
| 当中間期末残高   | 16,016,587 |
| 株主資本合計    |            |
| 前期末残高     | 26,623,121 |
| 当中間期変動額   |            |
| 剰余金の配当    | 1,323,000  |
| 中間純利益     | 1,345,450  |
| 当中間期変動額合計 | 22,450     |
| 当中間期末残高   | 26,645,571 |

|                       |            |
|-----------------------|------------|
| 評価・換算差額等              |            |
| その他有価証券評価差額金          |            |
| 前期末残高                 | 82,556     |
| 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） | 43,660     |
| 当中間期変動額合計             | 43,660     |
| 当中間期末残高               | 38,896     |
| 評価・換算差額等合計            |            |
| 前期末残高                 | 82,556     |
| 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） | 43,660     |
| 当中間期変動額合計             | 43,660     |
| 当中間期末残高               | 38,896     |
| 純資産合計                 |            |
| 前期末残高                 | 26,705,677 |
| 当中間期変動額               |            |
| 剰余金の配当                | 1,323,000  |
| 中間純利益                 | 1,345,450  |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | 43,660     |
| 当中間期変動額合計             | 21,210     |
| 当中間期末残高               | 26,684,467 |

## 中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

## 第26期中間会計期間

(自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)

## 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
- ・其他有価証券

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

## (2) 無形固定資産

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

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、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

従業員の退職給付に備えるため、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、発生時において全額を費用処理しております。

数理計算上の差異については、発生時において全額を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

##### (1) 消費税等の会計処理

税抜方式によっております。

## 中間財務諸表作成の基本となる重要な事項の変更

|  |
|--|
| <p>第26期中間会計期間<br/>(自平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)</p>  |
| <p>資産除去債務に関する会計基準</p> <p>企業会計基準第18号「資産除去債務に関する会計基準」(平成20年3月31日 企業会計基準委員会)及び企業会計基準適用指針第21号「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」(同前)が平成22年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当中間会計期間から同会計基準及び適用指針を適用しております。</p> <p>これによる損益の影響はありません。</p> |

## 注 記 事 項

(中間貸借対照表関係)

|   |
|---|
| <p>第26期中間会計期間末<br/>(平成22年9月30日現在)</p>   |
| <p>1.有形固定資産の減価償却累計額<br/>908,018千円</p>   |
| <p>2.消費税等の取扱い</p> <p>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。</p>   |
| <p>3. 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座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。</p> <p>当座借越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p>借入実行残高 <u>                  -</u></p> <p>差引額 10,000,000千円</p> |
| <p>4. 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額83,897千円の支払保証を行っております。</p>  |

(中間損益計算書関係)

|   |
|---|
| <p>第26期中間会計期間<br/>(自平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)</p> |
|---|

|                 |          |
|-----------------|----------|
| 1．減価償却実施額       |          |
| 有形固定資産          | 38,651千円 |
| 無形固定資産          | 977千円    |
| 2．営業外収益のうち主要なもの |          |
| 受取利息            | 4,445千円  |
| 受取配当金           | 12,720千円 |
| 為替差益            | 10,801千円 |



## （中間株主資本等変動計算書関係）

| 第26期中間会計期間<br>（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日） |               |                  |                     |                 |                |
|--|---------------|------------------|---------------------|-----------------|----------------|
| 1. 発行済株式数に関する事項                          |               |                  |                     |                 |                |
|  | 前事業年度末<br>株式数 | 当中間会計期間<br>増加株式数 | 当中間会計期間<br>減少株式数    | 当中間会計期間末<br>株式数 |                |
| 普通株式                                     | 17,640株       | -                | -                   | 17,640株         |                |
| 2. 配当に関する事項                              |               |                  |                     |                 |                |
| （決議）                                     | 株式の種類         | 配当金の総額<br>（千円）   | 一株当たり<br>配当額<br>（円） | 基準日             | 効力発生日          |
| 平成22年6月24日<br>定時株主総会                     | 普通株式          | 1,323,000        | 75,000              | 平成22年<br>3月31日  | 平成22年<br>6月25日 |

## （リース取引関係）

| 第26期中間会計期間<br>（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）       |             |
|--|-------------|
| 1. オペレーティング・リース取引<br>（借主側）<br>未経過リース料（解約不能のもの） |             |
| 1年以内   | 670,670千円   |
| 1年超  | 1,274,557千円 |
| 合計   | 1,945,227千円 |

（金融商品関係）

1. 金融商品の時価等に関する事項

平成22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）

| 第26期中間会計期間末<br>（平成22年9月30日現在） |            |            |     |
|-------------------------------|------------|------------|-----|
| 区分                            | 中間貸借対照表計上額 | 時価         | 差額  |
| (1) 現金及び預金                    | 16,070,989 | 16,070,989 | -   |
| (2) 未収委託者報酬                   | 3,680,857  | 3,680,857  | -   |
| (3) 未収運用受託報酬                  | 476,281    | 476,281    | -   |
| (4) 未収投資助言報酬                  | 424,563    | 424,563    | -   |
| (5) 有価証券及び投資有価証券              |            |            |     |
| 満期保有目的の債券                     | 2,999,963  | 2,999,700  | 263 |
| その他有価証券                       | 6,003,462  | 6,003,462  | -   |
| (6) 投資その他の資産                  |            |            |     |
| 長期差入保証金                       | 681,418    | 681,418    | -   |
| 資産計                           | 30,337,535 | 30,337,271 | 263 |
| (1) 未払金                       |            |            |     |
| 未払手数料                         | 1,839,602  | 1,839,602  | -   |
| 負債計                           | 1,839,602  | 1,839,602  | -   |

（注1）金融商品の時価の算定方法及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）

| 第26期中間会計期間末<br>（平成22年9月30日現在） |            |
|-------------------------------|------------|
| 内容                            | 中間貸借対照表計上額 |
| (1) 子会社株式                     | 236,178    |
| 合計                            | 236,178    |
| (2) その他有価証券                   |            |
| 非上場株式                         | 298        |
| 投資証券                          | 48,443     |
| 合計                            | 48,741     |

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。

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。

（追加情報）

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

（有価証券関係）

1. 満期保有目的の債券

（単位：千円）

| 第26期中間会計期間末<br>（平成22年9月30日現在）    |                |    |    |
|----------------------------------|----------------|----|----|
| 区分                               | 中間貸借対照表<br>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 | 2,999,963 | 2,999,700 | 263 |
| 小計                                | 2,999,963 | 2,999,700 | 263 |
| 合計                                | 2,999,963 | 2,999,700 | 263 |

## 2. 子会社株式及び関連会社株式

|   |
|---|
| 第26期中間会計期間末<br>(平成22年9月30日現在)   |
| 子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 236,178千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。 |

## 3. その他有価証券

(単位：千円)

| 第26期中間会計期間末<br>(平成22年9月30日現在)           |                |           |         |
|---|----------------|-----------|---------|
| 区分                                      | 中間貸借対照表<br>計上額 | 取得原価      | 差額      |
| (1) 中間貸借対照表計上額が取得<br>原価を超えるもの<br>投資信託等  | 2,912,845      | 2,755,148 | 157,696 |
| 小計                                      | 2,912,845      | 2,755,148 | 157,696 |
| (2) 中間貸借対照表計上額が取得原<br>価を超えないもの<br>投資信託等 | 3,090,617      | 3,182,865 | 92,248  |
| 小計                                      | 3,090,617      | 3,182,865 | 92,248  |
| 合計                                      | 6,003,462      | 5,938,014 | 65,447  |

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

## (デリバティブ取引関係)

| 第26期中間会計期間<br>(自平成22年4月1日至平成22年9月30日) |
|---------------------------------------|
| 当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。   |

## (持分法損益等)

| 第26期中間会計期間<br>(自平成22年4月1日至平成22年9月30日) |
|---------------------------------------|
| 該当事項はありません。                           |

## （資産除去債務等）

|  |
|--|
| 第26期中間会計期間<br>（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日） |
| 該当事項はありません。                              |

## （セグメント情報等）

|   |            |           |         |         |            |
|---|------------|-----------|---------|---------|------------|
| 第26期中間会計期間<br>（自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）  |            |           |         |         |            |
| （セグメント情報）   |            |           |         |         |            |
| <p>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。</p> <p>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。</p> |            |           |         |         |            |
| （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   | 13,415,979 | 1,026,282 | 929,636 | 137,538 | 15,509,437 |
| 2．地域ごとの情報   |            |           |         |         |            |
| （1）売上高  |            |           |         |         |            |
| <p>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。</p>  |            |           |         |         |            |
| （2）有形固定資産   |            |           |         |         |            |
| <p>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。</p>  |            |           |         |         |            |
| 3．主要な顧客ごとの情報  |            |           |         |         |            |
| <p>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。</p>   |            |           |         |         |            |
| （追加情報）  |            |           |         |         |            |

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



## ( 1株当たり情報 )

| 第26期中間会計期間<br>( 自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日 )       |               |
|--|---------------|
| 1株当たり純資産額  | 1,512,724円91銭 |
| 1株当たり中間純利益                                       | 76,272円68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                                | 26,684,467千円  |
| 普通株式に係る純資産額                                      | 26,684,467千円  |
| 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                                   | 1,345,450千円   |
| 普通株式に係る中間純利益                                     | 1,345,450千円   |
| 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 )

| 第26期中間会計期間<br>( 自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日 ) |  |
|--|--|
| 該当事項はありません。                                |  |

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### <訂正前>

イ 受託会社

(イ) 名称 住友信託銀行株式会社

(ロ) 資本金の額 342,037百万円（平成22年3月末現在）

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

#### 【参考情報：再信託受託会社の概要】

・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

・ 資本金の額 51,000百万円（平成22年3月末現在）

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

ロ 販売会社

(イ) 名称 住友生命保険相互会社

(ロ) 資本金の額 369,000百万円（平成22年3月末現在の基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。）

(ハ) 事業の内容 保険業法に基づき、保険業を営んでいます。

#### <訂正後>

イ 受託会社

(イ) 名称 住友信託銀行株式会社

(ロ) 資本金の額 342,037百万円（平成22年9月末現在）

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

#### 【参考情報：再信託受託会社の概要】

・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

・ 資本金の額 51,000百万円（平成22年9月末現在）

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

ロ 販売会社

(イ) 名称 住友生命保険相互会社

(ロ) 資本金の額 439,000百万円（平成22年9月末現在の基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。）

(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22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 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」に掲げられているスミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045の平成22年4月14日から平成22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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045の平成22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22年4月14日から平成22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。

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21年12月9日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員            公認会計士 鈴木 敏夫 印  
業 務 執 行 社 員

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ターゲットイヤーファンド2045の平成21年4月14日から平成21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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045の平成21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21年4月14日から平成21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。

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

以 上

---

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

2．中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成22年12月16日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 辰巳 幸久 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22年4月1日から平成23年3月31日までの第26期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22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、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成22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22年4月1日から平成22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。

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、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。