

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年1月23日提出
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土田 雅央
【電話番号】	03-5405-0740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	アセットアロケーション・ファンド（安定型） アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） アセットアロケーション・ファンド（成長型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	継続募集額(平成28年7月22日から平成29年7月20日まで) アセットアロケーション・ファンド（安定型） 2兆5,000億円を上限とします。 アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） 2兆5,000億円を上限とします。 アセットアロケーション・ファンド（成長型） 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成28年 7月21日付をもって提出しました「アセットアロケーション・ファンド（安定型）」、「アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）」、「アセットアロケーション・ファンド（成長型）」の有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について、平成29年 1月23日に半期報告書を提出したことに伴う関係情報の更新、ファンド情報の更新等を行うため、本訂正届出書により訂正を行うものです。

## 2【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、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。また、原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」に中間財務諸表（比較情報を除きます。）の記載事項が追加されます。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

#### (3)【ファンドの仕組み】

<更新後>

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

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

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

(ハ) 販売会社

委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

〔参考情報：投資顧問会社〕

以下の各法人は当ファンドの関係法人には該当しませんが、当ファンドの運用に関し助言等を行う投資顧問会社であり、間接的に当ファンドの運用に関与します。

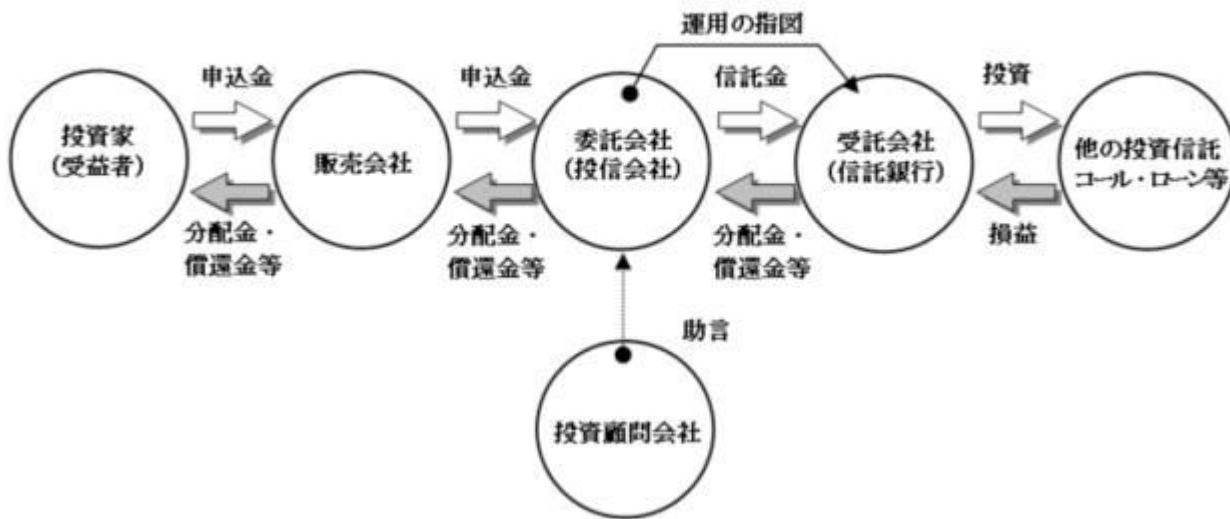
日興グローバルラップ株式会社

「安定型」・「安定成長型」・「成長型」の各ファンドの「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分に関する投資助言を行います。

エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント（ルクセンブルグ）

世界経済の見通しと組入資産の投資見通しに関する投資助言を行います。

### 運営の仕組み



#### □ 委託会社の概況

##### (イ) 資本金の額

2,000百万円（平成28年11月30日現在）

##### (ロ) 会社の沿革

昭和60年7月15日	三生投資顧問株式会社設立
昭和62年2月20日	証券投資顧問業の登録
昭和62年6月10日	投資一任契約にかかる業務の認可
平成11年1月1日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
平成11年2月5日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
平成12年1月27日	証券投資信託委託業の認可取得
平成14年12月1日	住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
平成25年4月1日	トヨタアセットマネジメント株式会社と合併

##### (ハ) 大株主の状況

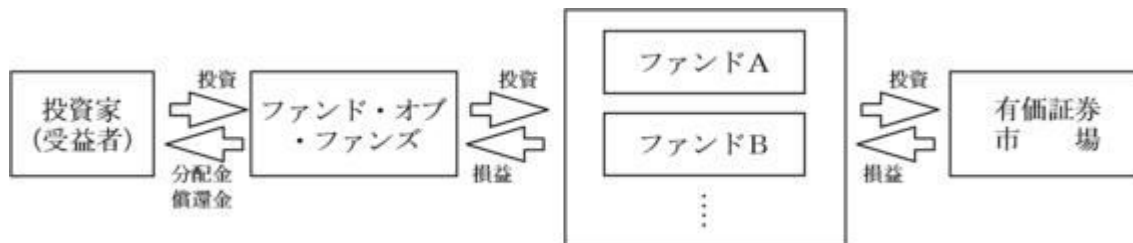
（平成28年11月30日現在）

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	10,584	60.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528	20.0
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	3,528	20.0

#### 八 ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

一般に、「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券などの有価証券に直接投資するのではなく、複数の他の投資信託（ファンド）を組み入れることにより運用を行います（投資信託に投資する投資信託）。また、種々の特長を持った投資信託を購入することにより、効率的に資産配分を行います。

#### 〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

<更新後>

#### イ 基本方針

当ファンドは、投資信託証券等への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

#### ロ 投資態度

- (イ) 主として投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、安定型は信託財産の安定性を、安定成長型は信託財産の安定性と収益性のバランスを、成長型は信託財産の収益性を重視した運用を行います。
- ( ) 主として、国内株式、先進国株式（除く日本）、新興国株式、国内リート、外国リート、国内債券、先進国債券（除く日本）、為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）、新興国債券、為替ヘッジ付き新興国債券、ハイイールド債券、為替ヘッジ付きハイイールド債券に投資します。
- ( ) 投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い必要な場合は追加・入替えも行います。
- (ロ) 運用にあたっては、市場のリスク選好状況を定量的に捉え、一定の範囲で資産配分を調整することにより、下方リスクを抑制しつつ、中長期的に収益の獲得を目指します。
- (ハ) 対円での為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れることがあります。また、投資対象とする投資信託証券の外貨建資産に対して対円での為替ヘッジを行うことがあります。
- (ニ) 投資信託証券への投資は、高位を保つことを原則とします。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ヘ) 主要投資対象とする投資信託証券は、下記の通りとします。ただし、運用状況等により変更となる場合があります。

## ■投資対象とする投資信託の投資方針等

●すべての投資信託証券に投資するとは限りません。

### ▶債券

#### 国内債券

ファンド名	国内債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>●NOMURA-BPI(総合)に連動する投資成果を目指します。</li> <li>●わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.03%

#### 先進国債券(除く日本)…為替ヘッジなし

ファンド名	外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>●シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指します。</li> <li>●ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。</li> <li>●保有する外貨建て資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%

#### 為替ヘッジ付き先進国債券(除く日本)…為替ヘッジあり

ファンド名	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>●シティ世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジベース)をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指します。</li> <li>●ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。</li> <li>●保有する外貨建て資産については、対円での為替のフルヘッジを原則とします。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%

## 新興国債券…為替ヘッジなし\*

ファンド名	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF
形態	米国籍外国投資信託
運用会社	ザ・バンガード・グループ・インク
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>●パークレイズ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。</li> <li>●ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。</li> </ul>
取引通貨	米ドル
管理報酬等**	年0.34%程度

ファンド名	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF
形態	米国籍外国投資信託
運用会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>●J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。</li> <li>●ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。</li> </ul>
取引通貨	米ドル
管理報酬等**	年0.40%程度

## ハイイールド債券…為替ヘッジなし\*

ファンド名	SPDR ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド債券ETF
形態	米国籍外国投資信託
運用会社	SSgA ファンズ・マネジメント・インク
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>●ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド・ベリー・リキッド・インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。</li> <li>●ベンチマークの値動きと利回りに、経費控除前で、概ね連動する投資成果を上げることがを目標とします。</li> </ul>
取引通貨	米ドル
管理報酬等**	年0.40%程度

\*上記の投資信託証券を組み入れた場合、安定型・安定成長型・成長型の各ファンドにおいて対円での為替ヘッジを行うことがあります。

\*\*管理報酬等とは各ETFの運用管理費用およびその他費用を各ETFの平均純資産総額で除したもので、本書の数値は各ETFの直近の目論見書で開示されているものです（以下同じ。）。

## ▶ 株式

## 国内株式

ファンド名	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)と連動する投資成果を目指して運用を行います。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08%

## 先進国株式(除く日本)…為替ヘッジなし

ファンド名	外国株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。</li> <li>外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

## 新興国株式…為替ヘッジなし

ファンド名	エマージング株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として新興国の株式指数を対象とした先物取引、新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券および新興国の株式(預託証書(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)の中長期的な動きに概ね連動する投資成果を目指して運用を行います。</li> <li>外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%



## ▶リート

## 国内リート

ファンド名	Jリート・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 東証REIT指数(配当込み)をベンチマークとし、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。</li> <li>● わが国の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託(REIT)を主要投資対象とします。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

## 外国リート…為替ヘッジなし

ファンド名	外国リート・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>● S&amp;P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。</li> <li>● 日本を除く世界各国の不動産投資信託(REIT)などを主要投資対象とします。</li> <li>● 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

## ファンドの特色

1

投資信託証券等への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資します。

- 主として、インデックスファンドや上場投資信託証券（ETF）への投資を通じて、以下の資産等に投資します。

債券

国内債券

先進国債券(除く日本)\*1

新興国債券\*2

ハイイールド債券\*2

株式

国内株式

先進国株式(除く日本)

新興国株式

リート

国内リート

外国リート

\*1 対円での為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れることがあります。

\*2 当該資産を投資対象とする外貨建投資信託証券に対して対円での為替ヘッジを行うことがあります。

2

資産配分比率は、ラップ口座の投資助言に実績を持つ日興グローバルラップおよびエドモン・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント（ルクセンブルグ）からの投資助言を基に決定します。

- 日興グローバルラップから、「安定型」・「安定成長型」・「成長型」の各ファンドの3つの基本資産配分（「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分）に関する投資助言を受けます。また、エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント（ルクセンブルグ）から、世界経済の見通しと組入資産の投資見通しに関する投資助言を受けます。
- 市場のリスク選好状況に応じて、「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分のいずれかに調整します。市場のリスク選好状況の判断には、三井住友アセットマネジメント独自のリスク態度指数を使用します。

3

目標リスク水準の異なる「安定型」・「安定成長型」・「成長型」の3つのファンドからお選びいただけます。  
各ファンド間でのスイッチングが可能です。

**安定型** 信託財産の安定性を重視した運用を行います。

**安定成長型** 信託財産の安定性と収益性のバランスを重視した運用を行います。

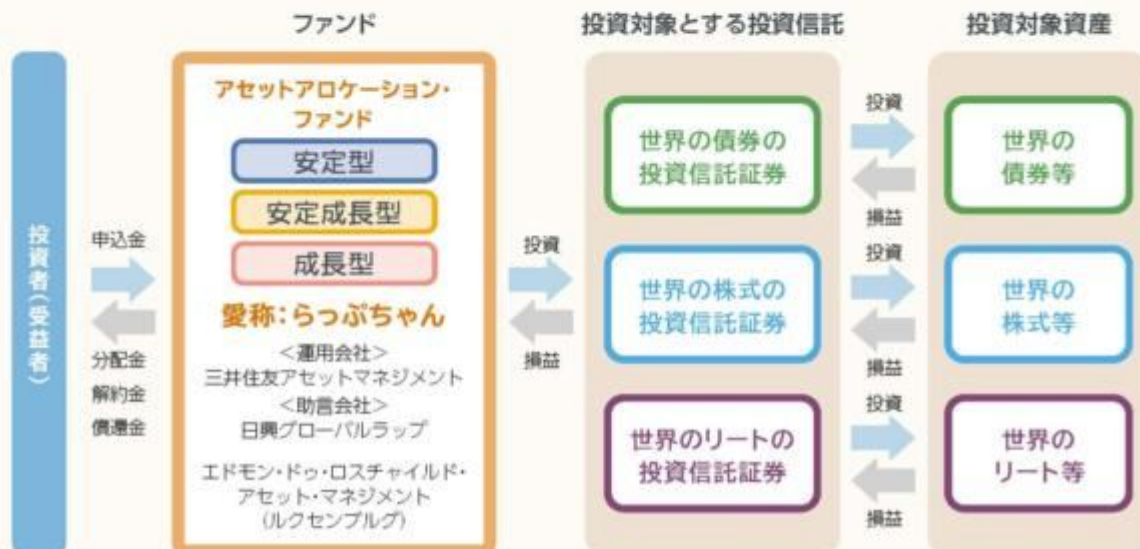
**成長型** 信託財産の収益性を重視した運用を行います。

□ 一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。また、スイッチングが行えない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

## ファンドのしくみ

- ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。
- 各ファンド間でのスイッチングが可能です。

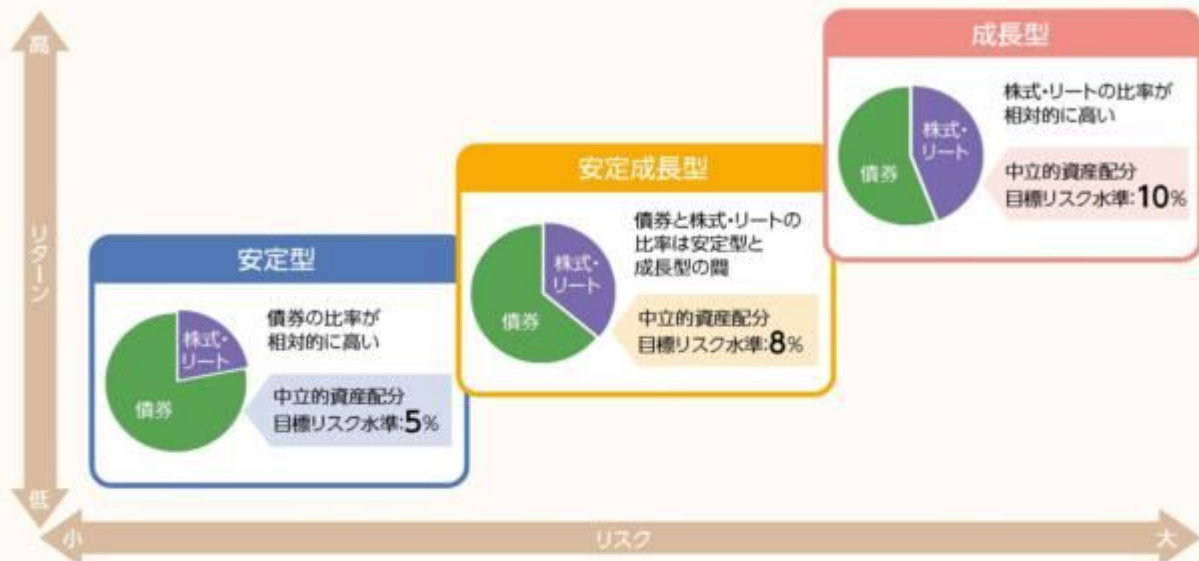


※一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。また、スイッチングが行えない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## お客様の投資スタイルに合わせて3つのファンドから選択

■お客様の投資スタイルに合わせて3つのファンド（安定型、安定成長型、成長型）からお選びいただけます。

〔 3つのファンド（安定型、安定成長型、成長型）のリスク・リターン特性のイメージ 〕



〔 各ファンドの3つの基本資産配分の目標リスク水準について 〕

### 各ファンドの目標リスク水準

	安定型	安定成長型	成長型
保守的資産配分	3%	5.5%	7%
中立的資産配分	5%	8%	10%
積極的資産配分	7%	10.5%	13%

- 中立的資産配分の目標リスク水準は、現時点で想定される各ファンドの中長期的な騰落率の変動率(年率標準偏差)を示します。
- 当ファンドでは、市場のリスク選好状況に応じて一定の範囲内で資産配分を調整するため、年1回(原則として毎年2月)、中立的資産配分に加えて、保守的資産配分、積極的資産配分の3つの基本資産配分を策定します。

(出所)日興グローバルラップ

※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。各ファンドの基準価額の騰落率の変動率(年率標準偏差)が目標リスク水準通りになるとは限りません。また、一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

※上記の目標リスク水準は2016年11月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

## 資産配分の調整について

- 市場のリスク選好状況に応じて、「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分のいずれかに資産配分を調整することで、中長期的な収益の獲得を目指します。

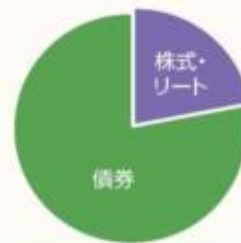
### [ 市場のリスク選好状況に応じた資産配分の調整 ]

#### 保守的資産配分

債券の比率が相対的に高い



#### 中立的資産配分



#### 積極的資産配分

株式・リートの比率が相対的に高い



### 市場のリスク選好状況

低

市場のリスク選好状況に応じて、「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分のいずれかに調整します。市場のリスク選好状況の判断には、当社独自のリスク態度指数を使用します。

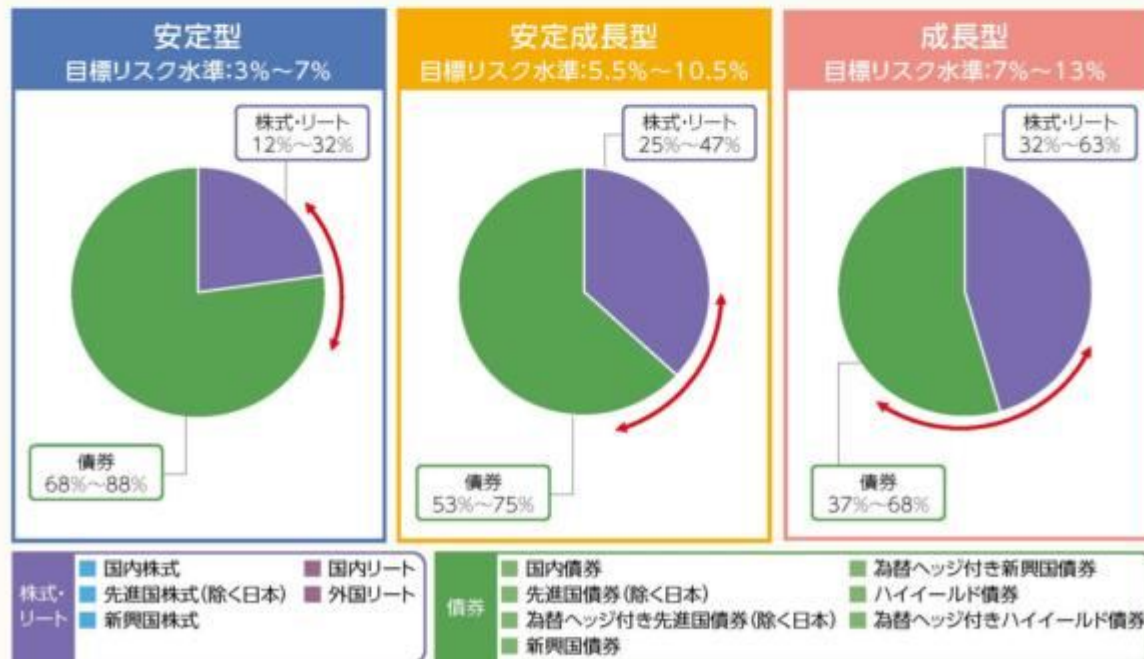
高

※資産配分の決定にあたっては、エドモンド・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント(ルクセンブルグ)から投資助言を受けます。

※上記は、安定型を例にした資産配分の調整のイメージであり、実際とは異なる場合があります。

## ポートフォリオのイメージ

### ▶ 資産配分



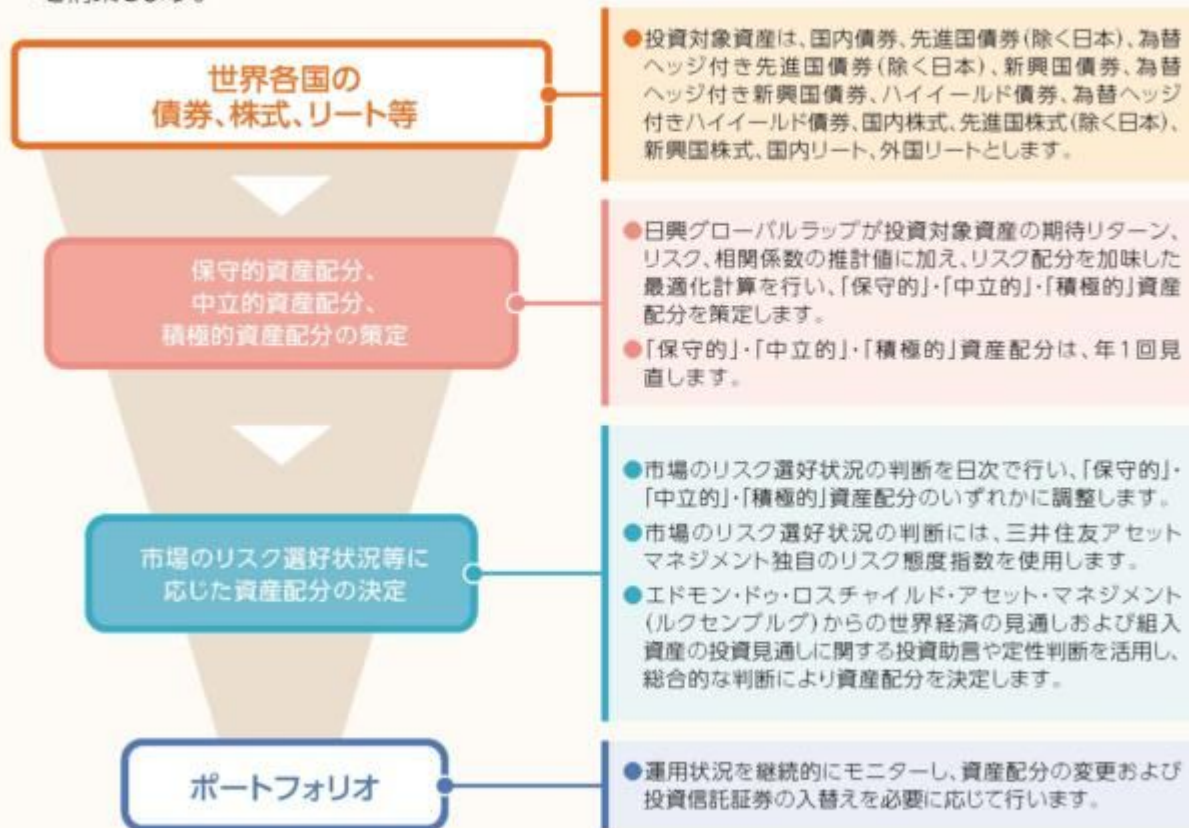
(出所)日興グローバルラップ

※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

※上記は2016年2月に日興グローバルラップから受けた投資助言に基づく資産配分であり、今後変更される場合があります。

## 運用プロセス

- 世界各国の債券、株式およびリート等を投資対象資産とし、各ファンドについて、「保守的」・「中立的」・「積極的」資産配分を策定します。市場のリスク選好状況等に応じて資産配分を決定し、ポートフォリオを構築します。



※上記の運用プロセスは2016年11月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

### (3) 【運用体制】

<更新後>

#### イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

##### (イ) 計画 (Plan)

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

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

##### (ロ) 実行 (Do)

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

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

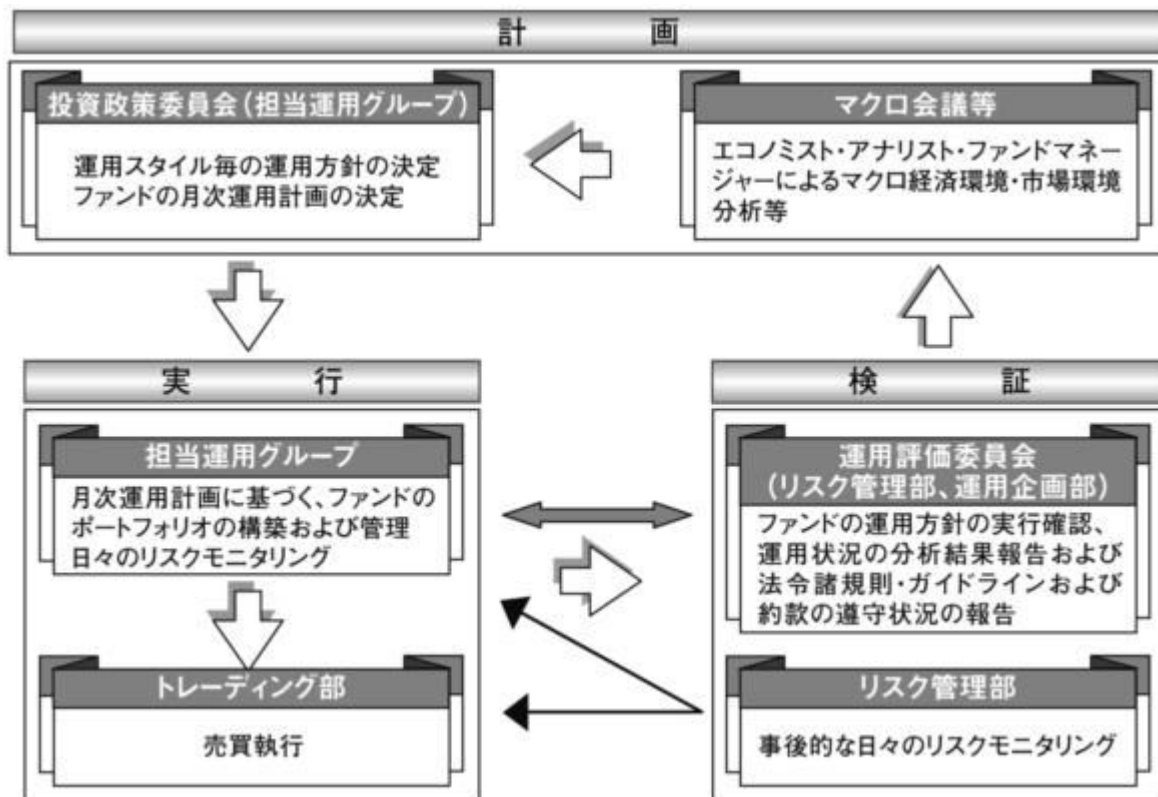
##### (ハ) 検証 (Check)

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

当運用グループは対応結果をリスク管理部へ報告します。

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

### 【ファンドの運用体制】



リスク管理部は10名程度、運用企画部は8名程度で構成されています。

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

他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）の組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断します。

#### □ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

### （４）【分配方針】

#### <更新後>

年1回（原則として毎年4月26日。ただし、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額は、経費控除後の利息、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。
- 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

八 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。(基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)

### 3【投資リスク】

<更新後>

#### イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、投資信託を組み入れることにより運用を行います。当ファンドが組み入れる投資信託は、主として内外の株式、債券および不動産投資信託(リート)を投資対象としており、その価格は、保有する株式、債券および不動産投資信託(リート)の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下します。当ファンドが組み入れる投資信託の価格の変動により、当ファンドの基準価額も上下します。基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

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

当ファンドが有するリスク等(他の投資信託の組入れを通じた実質的なリスク等となります。)のうち主要なものは、以下の通りです。

#### (イ) 株式市場リスク

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

#### (ロ) 債券市場リスク

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

#### (ハ) 不動産投資信託(リート)に関するリスク

リートの価格は、不動産市況や金利・景気動向、関連法制度(税制、建築規制、会計制度等)の変更等の影響を受け変動します。また、リートに組み入れられている個々の不動産等の市場価値、賃貸収入等がマーケット要因によって上下するほか、自然災害等により個々の不動産等の毀損・滅失が生じる可能性もあります。さらに個々のリートは一般の法人と同様、運営如何によっては倒産の可能性もあります。これらの影響により、ファンドが組み入れているリートの価格が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

#### (ニ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

#### (ホ) 為替変動リスク

外貨建資産への投資は、円建資産に投資する場合の通常のリスクのほかに、為替変動による影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落(円高)する場合、円ベースでの評価額は下落することがあ



ります。為替の変動(円高)は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

実質外貨建資産の一部に対し、原則として対円での為替ヘッジを行うため、為替の変動による影響は限定的と考えられます。なお、対円での為替ヘッジ比率は、資産配分の調整に伴い変動します。

#### (ヘ) カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

#### (ト) 市場流動性リスク

ファンドの資金流出入に伴い、有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

#### (チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは一部、実質的に「ファミリーファンド方式」により運用します。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入る有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

#### (リ) 換金制限等に関する留意点

投資資産の市場流動性が低下することにより投資資産の取引等が困難となった場合は、ファンドの換金申込みの受け付けを中止すること、および既に受け付けた換金申込みを取り消すことがあります。

#### (ヌ) 収益分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

#### ロ 投資リスクの管理体制

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

ク管理委員会およびコンプライアンス委員会への報告が義務づけられています。

(参考情報) 投資リスクの定量的比較

「ファンドの年間騰落率および  
分配金再投資基準価額の推移」

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

■アセットアロケーション・ファンド (安定型)



「ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較」

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



■アセットアロケーション・ファンド (安定成長型)



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

### ■アセットアロケーション・ファンド(成長型)



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

## 「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

日本株	TOPIX(配当込み) 株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース) Citigroup Index LLCが開発した指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

## (5) 【課税上の取扱い】

## &lt; 更新後 &gt;

## イ 個別元本について

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

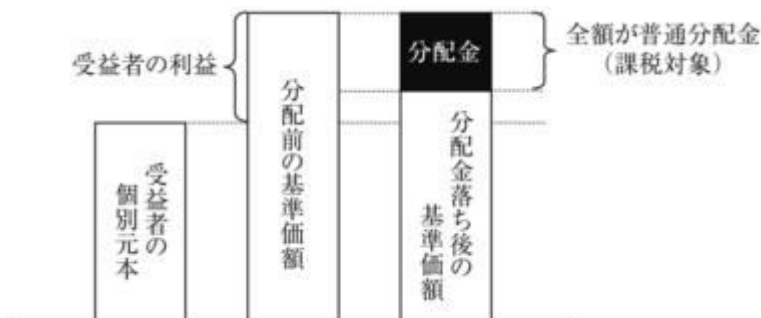
## ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

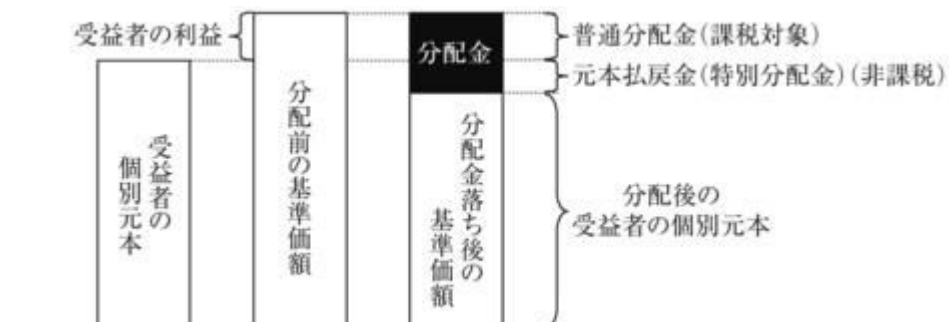
## ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・ 収益分配時

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

#### ・ 一部解約時および償還時

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

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および利子等、他の上場株式等にかかる譲渡益および配当等との通算が可能です。

### (ロ) 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAでの適用対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドは、配当控除の適用はありません。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で、新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。NISA、ジュニアNISAのご利用には、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成28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】

<更新後>

### (1)【投資状況】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

平成28年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	7,630,593,304	22.70
親投資信託受益証券	日本	25,657,709,871	76.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		325,136,398	0.97
合計(純資産総額)		33,613,439,573	100.00

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

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		155,426,248	0.46
	売建		6,344,373,900	18.87

#### アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

平成28年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	7,818,620,708	34.50
親投資信託受益証券	日本	14,656,181,225	64.66
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		190,095,753	0.84
合計(純資産総額)		22,664,897,686	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		330,989,043	1.46
	売建		6,436,651,620	28.39

#### アセットアロケーション・ファンド(成長型)

平成28年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	6,708,548,485	30.67
親投資信託受益証券	日本	14,888,049,300	68.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		277,393,893	1.27
合計(純資産総額)		21,873,991,678	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		354,661,722	1.62
	売建		4,983,109,140	22.78

## (2) 【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

#### イ 主要投資銘柄

平成28年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受 益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マ ザーファンド	7,942,571,558	1.4088	11,189,809,483	1.3825	10,980,605,178	32.67
日本	親投資信託受 益証券	国内株式インデックス・マザーファ ンド(B号)	1,927,229,409	1.9780	3,812,237,783	2.1863	4,213,501,656	12.54
アメリカ	投資信託受益 証券	S P D R ブルームバーグ・パーク レイズ・ハイ・イールド債券 E T F	868,389	4,014.83	3,486,439,908	4,052.74	3,519,355,704	10.47
アメリカ	投資信託受益 証券	i シェアーズ J . P . モルガン・米 ドル建てエマージング・マーケット 債券 E T F	259,310	12,802.67	3,319,861,516	12,318.98	3,194,435,637	9.50
日本	親投資信託受 益証券	外国株式インデックス・マザーファ ンド	994,055,925	2.5390	2,523,910,080	2.7558	2,739,419,318	8.15
日本	親投資信託受 益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	2,109,844,044	1.2745	2,689,088,497	1.2618	2,662,201,214	7.92
日本	親投資信託受 益証券	エマージング株式インデックス・マ ザーファンド	1,822,508,051	1.0077	1,836,541,363	1.0817	1,971,406,958	5.86
日本	親投資信託受 益証券	J リート・インデックス・マザー ファンド	696,705,569	1.9785	1,378,438,371	1.9337	1,347,219,558	4.01
日本	親投資信託受 益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	724,915,103	1.6435	1,191,437,349	1.6615	1,204,446,443	3.58
アメリカ	投資信託受益 証券	バンガード・米ドル建て新興国政府 債券 E T F	105,500	8,914.90	940,522,583	8,690.06	916,801,963	2.73
日本	親投資信託受 益証券	外国リート・インデックス・マザー ファンド	294,196,717	1.8288	538,040,584	1.8318	538,909,546	1.60

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28年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	22.70
親投資信託受益証券	76.33
合計	99.03

## アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

## イ 主要投資銘柄

平成28年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	1,980,111,432	1.9855	3,931,631,096	2.1863	4,329,117,623	19.10
アメリカ	投資信託受益証券	S P D R ブルームバーグ・パーク レイズ・ハイ・イールド債券 E T F	835,994	3,988.49	3,334,354,576	4,052.74	3,388,067,159	14.95
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	933,578,652	2.5590	2,389,107,682	2.7558	2,572,756,049	11.35
アメリカ	投資信託受益証券	バンガード・米ドル建て新興国政府 債券 E T F	289,506	8,844.45	2,560,524,207	8,690.06	2,515,826,247	11.10
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マ ザーファンド	1,590,452,413	1.4025	2,230,703,905	1.3825	2,198,800,460	9.70
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マ ザーファンド	1,790,244,679	1.0135	1,814,412,983	1.0817	1,936,507,669	8.54
アメリカ	投資信託受益証券	i シェアーズ J . P .モルガン・米 ドル建てエマージング・マーケット 債券 E T F	155,429	12,748.48	1,981,484,090	12,318.98	1,914,727,302	8.45
日本	親投資信託受益証券	J リート・インデックス・マザー ファンド	709,584,815	1.9912	1,412,988,058	1.9337	1,372,124,156	6.05
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	770,438,347	1.6568	1,276,517,393	1.6615	1,280,083,313	5.65
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザー ファンド	282,692,964	1.8440	521,295,480	1.8318	517,836,971	2.28
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	355,805,187	1.2746	453,543,358	1.2618	448,954,984	1.98

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28年11月30日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	34.50
親投資信託受益証券	64.66
合計	99.16

## アセットアロケーション・ファンド（成長型）

## イ 主要投資銘柄

平成28年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	2,323,999,880	1.9878	4,619,727,649	2.1863	5,080,960,937	23.23
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	1,507,553,574	2.5607	3,860,397,654	2.7558	4,154,516,139	18.99
アメリカ	投資信託受益証券	バンガード・米ドル建て新興国政府 債券 E T F	350,567	8,828.18	3,094,868,799	8,690.06	3,046,450,367	13.93



アメリカ	投資信託受益証券	i シェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 E T F	196,944	12,729.10	2,506,919,871	12,318.98	2,426,149,906	11.09
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	2,004,165,829	1.0129	2,030,019,569	1.0817	2,167,906,177	9.91
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	768,693,088	1.6573	1,273,955,055	1.6615	1,277,183,565	5.84
アメリカ	投資信託受益証券	S P D R ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド債券 E T F	304,966	3,991.91	1,217,397,200	4,052.74	1,235,948,212	5.65
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	649,868,004	1.8315	1,190,244,398	1.8318	1,190,428,209	5.44
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	508,315,433	2.0008	1,017,086,761	1.9337	982,929,552	4.49
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	15,239,232	1.2759	19,445,233	1.2618	19,228,862	0.09
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	10,774,582	1.4047	15,135,775	1.3825	14,895,859	0.07

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28年11月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	30.67
親投資信託受益証券	68.06
合計	98.73

### 【投資不動産物件】

#### アセットアロケーション・ファンド（安定型）

該当事項はありません。

#### アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

該当事項はありません。

#### アセットアロケーション・ファンド（成長型）

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

#### アセットアロケーション・ファンド（安定型）

平成28年11月30日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価（円）	時価（円）	投資比率（％）
為替予約取引	米ドル	買建	1,382,752.37	154,912,124	155,426,248	0.46
	米ドル	売建	56,515,000.00	6,167,683,204	6,344,373,900	18.87

（注）わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

## アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

平成28年11月30日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	2,944,643.62	329,875,921	330,989,043	1.46
	米ドル	売建	57,337,000.00	6,259,760,599	6,436,651,620	28.39

（注）わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

## アセットアロケーション・ファンド（成長型）

平成28年11月30日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	3,155,200.09	353,330,227	354,661,722	1.62
	米ドル	売建	44,389,000.00	4,848,695,958	4,983,109,140	22.78

（注）わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

## （3）【運用実績】

## 【純資産の推移】

## アセットアロケーション・ファンド（安定型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (平成28年 4月26日)	13,358,665,467	13,358,665,467	9,514	9,514
平成27年11月末日	7,260,780,273		9,779	
12月末日	8,389,350,919		9,643	
平成28年 1月末日	9,031,231,248		9,485	
2月末日	10,317,312,442		9,346	
3月末日	12,564,866,802		9,504	
4月末日	13,909,919,576		9,493	
5月末日	15,525,145,852		9,595	
6月末日	16,140,842,491		9,458	
7月末日	18,133,954,572		9,679	
8月末日	21,388,592,035		9,705	
9月末日	26,616,623,115		9,642	
10月末日	30,226,731,207		9,643	

11月末日	33,613,439,573		9,722	
-------	----------------	--	-------	--

## アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (平成28年 4月26日)	12,391,100,166	12,391,100,166	9,296	9,296
平成27年11月末日	8,144,963,181		9,743	
12月末日	8,836,834,129		9,563	
平成28年 1月末日	9,224,169,739		9,259	
2月末日	9,777,568,939		9,018	
3月末日	11,769,804,534		9,274	
4月末日	12,600,023,476		9,260	
5月末日	13,793,632,176		9,359	
6月末日	13,981,366,577		9,068	
7月末日	15,131,533,939		9,377	
8月末日	16,906,850,609		9,420	
9月末日	18,954,401,097		9,343	
10月末日	20,594,824,792		9,429	
11月末日	22,664,897,686		9,617	

## アセットアロケーション・ファンド（成長型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (平成28年 4月26日)	12,509,183,920	12,509,183,920	9,159	9,159
平成27年11月末日	7,931,214,974		9,740	
12月末日	8,529,241,101		9,531	
平成28年 1月末日	8,898,013,902		9,132	
2月末日	9,660,009,830		8,813	
3月末日	11,922,588,999		9,116	
4月末日	12,716,145,143		9,112	
5月末日	14,012,104,420		9,213	
6月末日	13,887,937,961		8,817	
7月末日	15,368,032,100		9,197	
8月末日	16,885,294,606		9,221	
9月末日	18,276,176,294		9,115	
10月末日	19,917,672,373		9,247	
11月末日	21,873,991,678		9,545	

## 【分配の推移】

## アセットアロケーション・ファンド（安定型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	平成27年 4月17日～平成28年 4月26日	0

## アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	平成27年 4月17日～平成28年 4月26日	0

## アセットアロケーション・ファンド（成長型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	平成27年 4月17日～平成28年 4月26日	0

## 【収益率の推移】

## アセットアロケーション・ファンド（安定型）

	収益率（％）
第1期	4.9
第2期（中間期）	2.0

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

## アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

	収益率（％）
第1期	7.0
第2期（中間期）	2.0

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

## アセットアロケーション・ファンド（成長型）

	収益率（％）

第1期	8.4
第2期（中間期）	1.5

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

#### （４）【設定及び解約の実績】

##### アセットアロケーション・ファンド（安定型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	14,471,203,211	430,595,693
第2期（中間期）	17,256,839,721	884,974,653

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

##### アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	13,473,777,867	144,788,717
第2期（中間期）	8,519,689,445	447,205,648

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

##### アセットアロケーション・ファンド（成長型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	13,883,023,089	225,050,831
第2期（中間期）	8,135,199,331	574,024,137

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

#### （１）投資状況

##### 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

平成28年11月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	日本	200,450,853,880	97.92
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		4,247,917,341	2.08

合計(純資産総額)	204,698,771,221	100.00
-----------	-----------------	--------

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,274,600,000	2.08
合計	買建	-	4,274,600,000	2.08

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	99,625,532,554	60.17
	イギリス	10,916,284,736	6.59
	カナダ	6,502,257,921	3.93
	スイス	6,057,350,662	3.66
	フランス	5,732,097,258	3.46
	ドイツ	5,727,286,578	3.46
	オーストラリア	4,178,703,465	2.52
	オランダ	2,812,271,789	1.70
	アイルランド	2,648,976,917	1.60
	スペイン	1,928,778,419	1.16
	スウェーデン	1,757,898,423	1.06
	香港	1,552,326,974	0.94
	シンガポール	1,125,801,204	0.68
	イタリア	1,036,518,402	0.63
	デンマーク	1,013,169,581	0.61
	ジャージー	986,009,102	0.60
	ベルギー	795,124,525	0.48
	バミューダ	748,994,824	0.45
キュラソー	604,726,903	0.37	
フィンランド	600,036,085	0.36	
ノルウェー	418,036,831	0.25	

	ケイマン諸島	406,051,872	0.25
	イスラエル	390,123,854	0.24
	ルクセンブルグ	190,686,852	0.12
	オーストリア	125,635,687	0.08
	ニュージーランド	119,335,750	0.07
	ポルトガル	92,695,028	0.06
	リベリア	73,428,342	0.04
	英ヴァージン諸島	46,673,683	0.03
	パプアニューギニア	35,359,906	0.02
	マン島	19,676,402	0.01
	モーリシャス	12,146,850	0.01
	小計	158,279,997,379	95.59
投資証券	アメリカ	2,762,295,286	1.67
	オーストラリア	591,622,393	0.36
	フランス	224,505,679	0.14
	イギリス	161,490,778	0.10
	香港	96,445,880	0.06
	シンガポール	75,766,736	0.05
	カナダ	35,514,295	0.02
	小計	3,947,641,047	2.38
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,355,573,496	2.03
合計(純資産総額)		165,583,211,922	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,353,636,362	1.42
	買建	ドイツ	581,263,200	0.35
	買建	イギリス	237,588,090	0.14
	買建	オーストラリア	160,850,438	0.09
合計	買建	-	3,333,338,090	2.00

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
為替予約取引	売建		269,987,540	0.16

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
国債証券	アメリカ	4,711,959,706	69.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,094,668,127	30.77
合計(純資産総額)		6,806,627,833	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	6,849,739,358	100.63
合計	買建	-	6,849,739,358	100.63

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
為替予約取引	買建		49,526,682	0.72

## Jリート・インデックス・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
投資証券	日本	12,447,219,200	99.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		72,078,034	0.58
合計(純資産総額)		12,519,297,234	100.00



## 外国リート・インデックス・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	3,733,904,916	73.18
	オーストラリア	405,241,165	7.94
	イギリス	254,336,761	4.98
	フランス	215,999,740	4.23
	シンガポール	158,432,092	3.11
	カナダ	96,279,058	1.89
	香港	88,793,360	1.74
	スペイン	42,057,144	0.82
	ベルギー	33,955,119	0.67
	ニュージーランド	26,029,103	0.51
	オランダ	25,364,422	0.50
	アイルランド	11,414,705	0.22
	ドイツ	7,124,348	0.14
	イタリア	3,600,073	0.07
	マン島	2,078,372	0.04
ガーンジー	1,992,776	0.04	
	小計	5,106,603,154	100.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,252,265	0.08
合計(純資産総額)		5,102,350,889	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		59,235,888	1.16
	売建		2,810,000	0.05

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	162,264,101,600	75.89
地方債証券	日本	15,585,724,891	7.29
特殊債券	日本	24,404,676,430	11.41
社債券	日本	9,528,496,000	4.46
	オランダ	502,862,000	0.24
	アメリカ	301,236,000	0.14
	オーストラリア	200,106,000	0.09
	小計	10,532,700,000	4.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,036,575,802	0.48
合計(純資産総額)		213,823,778,723	100.00

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	76,225,905,139	43.32
	フランス	16,719,294,897	9.50
	イタリア	16,573,678,413	9.42
	ドイツ	12,731,731,107	7.24
	イギリス	12,514,363,481	7.11
	スペイン	9,499,765,105	5.40
	ベルギー	4,310,854,374	2.45
	オランダ	4,102,699,185	2.33
	カナダ	3,636,310,801	2.07
	オーストラリア	3,588,039,319	2.04
	オーストリア	2,523,275,520	1.43
	アイルランド	1,397,497,381	0.79
	メキシコ	1,326,389,826	0.75
	デンマーク	1,156,346,433	0.66
	フィンランド	1,026,728,305	0.58
ポーランド	975,011,212	0.55	
南アフリカ	915,004,350	0.52	

	スウェーデン	786,803,657	0.45
	マレーシア	648,462,604	0.37
	シンガポール	619,869,645	0.35
	スイス	476,295,237	0.27
	ノルウェー	443,575,536	0.25
	小計	172,197,901,527	97.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,762,640,114	2.14
合計(純資産総額)		175,960,541,641	100.00

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

平成28年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	16,290,300,887	43.95
	フランス	3,591,725,984	9.69
	イタリア	3,478,674,476	9.39
	ドイツ	2,754,938,690	7.43
	イギリス	2,694,521,854	7.27
	スペイン	2,022,321,923	5.46
	ベルギー	933,666,344	2.52
	オランダ	846,046,901	2.28
	カナダ	774,353,164	2.09
	オーストラリア	741,279,912	2.00
	オーストリア	548,059,615	1.48
	アイルランド	296,058,079	0.80
	シンガポール	289,234,574	0.78
	メキシコ	287,101,645	0.77
	デンマーク	231,845,990	0.63
	フィンランド	221,047,955	0.60
	ポーランド	198,460,276	0.54
	南アフリカ	169,113,015	0.46
	スウェーデン	150,054,598	0.40
	ノルウェー	99,441,782	0.27
スイス	92,257,966	0.25	

	小計	36,710,505,630	99.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		354,810,914	0.96
合計(純資産総額)		37,065,316,544	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		37,749,738,000	101.84

## (2) 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

##### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成28年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,162,400	7,457.62	8,668,737,488	6,649.00	7,728,797,600	3.78
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,991,500	761.88	5,326,684,020	669.80	4,682,906,700	2.29
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	740,600	4,596.00	3,403,797,600	4,625.00	3,425,275,000	1.67
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	738,600	4,555.44	3,364,647,984	4,206.00	3,106,551,600	1.52
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	841,200	3,891.46	3,273,496,152	3,332.00	2,802,878,400	1.37
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	415,300	6,419.14	2,665,868,842	6,712.00	2,787,493,600	1.36
日本	株式	KDDI	情報・通信業	912,800	3,050.28	2,784,295,584	2,999.00	2,737,487,200	1.34
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	12,522,000	239.88	3,003,777,360	202.60	2,536,957,200	1.24
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	580,200	4,414.58	2,561,339,316	3,946.00	2,289,469,200	1.12
日本	株式	ソニー	電気機器	659,700	3,117.22	2,056,430,034	3,288.00	2,169,093,600	1.06
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	373,200	4,463.81	1,665,893,892	4,899.00	1,828,306,800	0.89
日本	株式	ファナック	電気機器	94,700	21,421.66	2,028,631,202	19,305.00	1,828,183,500	0.89
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	689,400	2,356.74	1,624,736,556	2,624.00	1,808,985,600	0.88
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	180,600	11,310.97	2,042,761,182	9,766.00	1,763,739,600	0.86
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	366,600	5,910.78	2,166,891,948	4,685.00	1,717,521,000	0.84
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	385,700	5,424.12	2,092,083,084	4,435.00	1,710,579,500	0.84
日本	株式	三菱商事	卸売業	692,100	2,051.77	1,420,030,017	2,471.50	1,710,525,150	0.84
日本	株式	キーエンス	電気機器	21,200	66,168.52	1,402,772,624	78,230.00	1,658,476,000	0.81

日本	株式	キヤノン	電気機器	502,400	3,664.55	1,841,069,920	3,261.00	1,638,326,400	0.80
日本	株式	任天堂	その他製品	57,600	18,618.64	1,072,433,664	27,775.00	1,599,840,000	0.78
日本	株式	三菱地所	不動産業	686,000	2,532.99	1,737,631,140	2,305.50	1,581,573,000	0.77
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	999,600	1,717.64	1,716,952,944	1,579.50	1,578,868,200	0.77
日本	株式	三菱電機	電気機器	996,100	1,341.13	1,335,899,593	1,576.50	1,570,351,650	0.77
日本	株式	村田製作所	電気機器	98,000	18,432.15	1,806,350,700	15,425.00	1,511,650,000	0.74
日本	株式	信越化学工業	化学	175,400	6,850.50	1,201,577,700	8,460.00	1,483,884,000	0.72
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	77,600	21,804.25	1,692,009,800	18,680.00	1,449,568,000	0.71
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	330,000	4,329.45	1,428,718,500	4,367.00	1,441,110,000	0.70
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,243,000	702.39	1,575,460,770	609.30	1,366,659,900	0.67
日本	株式	ダイキン工業	機械	127,400	8,576.35	1,092,626,990	10,715.00	1,365,091,000	0.67
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	290,100	4,957.69	1,438,225,869	4,645.00	1,347,514,500	0.66

□ 種類別・業種別の投資比率

平成28年11月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.33
		建設業	3.07
		食料品	4.44
		繊維製品	0.68
		パルプ・紙	0.24
		化学	6.26
		医薬品	4.66
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.95
		ガラス・土石製品	0.92
		鉄鋼	1.23
		非鉄金属	0.90
		金属製品	0.68
		機械	4.98
		電気機器	12.28
		輸送用機器	9.58
		精密機器	1.48
		その他製品	1.88
		電気・ガス業	1.79
		陸運業	4.22
		海運業	0.21
空運業	0.55		
倉庫・運輸関連業	0.19		
情報・通信業	7.40		
卸売業	4.33		

	小売業	4.68
	銀行業	8.13
	証券、商品先物取引業	1.13
	保険業	2.58
	その他金融業	1.30
	不動産業	2.65
	サービス業	3.62
合計		97.92

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	263,437	13,121.30	3,456,636,936	12,530.33	3,300,953,387	1.99
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	359,167	6,068.69	2,179,673,834	6,867.73	2,466,664,782	1.49
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	199,431	9,140.94	1,822,987,166	9,656.87	1,925,880,836	1.16
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	132,292	11,572.43	1,530,941,124	12,645.00	1,672,832,552	1.01
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	19,289	75,668.16	1,459,563,322	85,722.49	1,653,501,272	1.00
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	176,015	7,511.90	1,322,207,410	8,872.18	1,561,637,889	0.94
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	443,220	3,406.04	1,509,629,004	3,490.64	1,547,121,904	0.93
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	111,409	11,968.79	1,333,431,769	13,588.20	1,513,848,375	0.91
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	232,585	6,165.09	1,433,908,097	5,830.10	1,355,994,088	0.82
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	296,539	3,812.29	1,130,494,356	4,438.34	1,316,141,380	0.79
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	14,902	84,211.71	1,254,922,949	86,657.83	1,291,375,024	0.78
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	14,159	86,640.62	1,226,744,621	88,748.84	1,256,594,894	0.76
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	153,732	8,461.40	1,300,788,219	7,588.81	1,166,643,400	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	123,095	8,577.73	1,055,876,584	9,318.49	1,147,059,994	0.69
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	495,712	1,936.52	959,957,270	2,281.00	1,130,719,964	0.68
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	196,636	5,131.87	1,009,110,632	5,728.92	1,126,512,542	0.68
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	90,930	10,184.24	926,053,212	12,292.00	1,117,711,815	0.68
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	292,414	3,676.76	1,075,138,340	3,588.44	1,049,311,966	0.63

アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	57,566	15,178.79	873,782,637	17,726.38	1,020,437,113	0.62
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	133,593	6,084.43	812,837,561	6,991.39	934,002,073	0.56
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	116,745	6,912.60	807,011,489	7,885.13	920,550,529	0.56
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	197,665	4,848.89	958,457,495	4,626.08	914,414,696	0.55
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	227,923	3,857.91	879,306,707	3,969.55	904,751,790	0.55
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	141,726	6,005.07	851,075,655	6,241.55	884,591,106	0.53
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	59,977	15,078.08	904,338,572	14,571.88	873,977,671	0.53
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	33,790	30,377.56	1,026,457,873	25,155.30	849,997,722	0.51
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	956,275	747.06	714,396,327	887.42	848,623,566	0.51
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	107,795	9,731.19	1,048,973,977	7,783.25	838,996,027	0.51
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	74,433	12,759.38	949,719,210	11,204.90	834,014,426	0.50
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	91,958	8,951.87	823,196,274	8,898.04	818,246,238	0.49

## □ 種類別・業種別の投資比率

平成28年11月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	7.21
		素材	4.87
		資本財	7.16
		商業・専門サービス	1.02
		運輸	1.84
		自動車・自動車部品	1.45
		耐久消費財・アパレル	1.70
		消費者サービス	1.78
		メディア	2.78
		小売	3.96
		食品・生活必需品小売り	2.01
		食品・飲料・タバコ	6.14
		家庭用品・パーソナル用品	1.72
		ヘルスケア機器・サービス	3.80
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.42
		銀行	9.03
各種金融	4.42		
保険	4.20		

	不動産	0.80
	ソフトウェア・サービス	8.99
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.99
	電気通信サービス	3.02
	公益事業	3.23
	半導体・半導体製造装置	2.04
投資証券		2.38
合計		97.97

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄

平成28年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	9,000,000	11,213.07	1,009,177,195	11,210.35	1,008,932,049	0.000	2017/5/25	14.82
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	9,000,000	11,199.59	1,007,963,537	11,198.70	1,007,883,663	0.000	2017/7/20	14.81
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	6,000,000	11,217.05	673,023,502	11,228.27	673,696,664	0.000	2017/3/2	9.90
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	6,000,000	11,206.81	672,408,837	11,216.75	673,005,468	0.000	2017/4/27	9.89
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	4,000,000	11,227.93	449,117,388	11,241.66	449,666,510	0.000	2016/12/8	6.61
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	4,000,000	11,221.45	448,858,110	11,235.70	449,428,241	0.000	2017/1/26	6.60
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	4,000,000	11,219.17	448,767,150	11,233.67	449,347,111	0.000	2017/2/2	6.60

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28年11月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	69.23
合計	69.23

## Jリート・インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	1,512	632,468.89	956,292,962	637,000	963,144,000	7.69
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,402	607,171.39	851,254,291	619,000	867,838,000	6.93
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4,480	169,194.01	757,989,165	170,500	763,840,000	6.10
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	2,734	239,649.81	655,202,590	232,200	634,834,800	5.07
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	3,164	185,159.69	585,845,281	174,400	551,801,600	4.41



日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	2,702	180,261.25	487,065,908	173,100	467,716,200	3.74
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	1,973	243,642.97	480,707,582	236,900	467,403,700	3.73
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,627	294,582.97	479,286,496	284,700	463,206,900	3.70
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	935	454,810.07	425,247,418	465,000	434,775,000	3.47
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,444	280,180.29	404,580,346	288,200	416,160,800	3.32
日本	投資証券	G L P 投資法人	3,053	128,178.02	391,327,513	128,300	391,699,900	3.13
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,028	85,382.01	343,918,759	79,600	320,628,800	2.56
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	627	535,629.96	335,839,985	503,000	315,381,000	2.52
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	533	604,369.88	322,129,148	579,000	308,607,000	2.47
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,877	154,802.49	290,564,288	151,200	283,802,400	2.27
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	531	511,360.43	271,532,393	509,000	270,279,000	2.16
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	434	601,497.45	261,049,894	610,000	264,740,000	2.11
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	519	456,316.58	236,828,307	472,000	244,968,000	1.96
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	1,415	179,710.72	254,290,680	172,200	243,663,000	1.95
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	3,929	63,855.96	250,890,106	57,000	223,953,000	1.79
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	941	234,899.4	221,040,343	225,200	211,913,200	1.69
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,117	178,828.7	199,751,661	185,900	207,650,300	1.66
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	377	524,677.91	197,803,575	529,000	199,433,000	1.59
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	1,395	139,164.63	194,134,668	142,600	198,927,000	1.59
日本	投資証券	プレミアム投資法人	1,410	138,011.06	194,595,601	135,100	190,491,000	1.52
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,404	128,974.21	181,079,793	122,800	172,411,200	1.38
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	1,049	141,655.96	148,597,104	141,800	148,748,200	1.19
日本	投資証券	福岡リート投資法人	799	201,046.32	160,636,012	182,700	145,977,300	1.17
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	1,760	83,100.35	146,256,625	82,000	144,320,000	1.15
日本	投資証券	積水ハウス・S I 投資法人	1,179	120,545.98	142,123,721	121,800	143,602,200	1.15

## ロ 種類別の投資比率

平成28年11月30日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	99.42
合計	99.42

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年11月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（％）
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	13,988	23,616.26	330,344,279	20,494.16	286,672,394	5.62
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	6,616	24,882.93	164,625,515	23,564.35	155,901,781	3.06
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	23,337	5,962.75	139,152,805	5,782.88	134,955,183	2.64
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,023	19,542.09	117,702,059	18,522.31	111,559,929	2.19
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	15,424	8,488.09	130,920,393	7,216.23	111,303,283	2.18
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	4,375	28,897.57	126,426,878	25,244.73	110,445,694	2.16

アメリカ	投資証券	VENTAS INC	15,960	8,015.94	127,934,477	6,865.48	109,573,211	2.15
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	16,100	7,224.72	116,318,051	6,800.28	109,484,601	2.15
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	6,805	15,607.57	106,209,554	14,081.72	95,826,167	1.88
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	7,648	11,448.97	87,561,735	11,140.82	85,205,007	1.67
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	232,413	420.34	97,694,381	354.22	82,327,518	1.61
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	26,876	3,196.36	85,905,383	2,884.69	77,529,122	1.52
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	7,127	10,953.08	78,062,622	10,511.26	74,913,821	1.47
香港	投資証券	LINK REIT	94,100	815.65	76,752,675	767.05	72,179,405	1.41
アメリカ	投資証券	HCP, INC.	21,618	3,955.24	85,504,489	3,327.63	71,936,749	1.41
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORPORATION	10,884	7,422.83	80,790,084	6,378.71	69,425,888	1.36
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,829	24,961.67	70,616,571	24,268.10	68,654,470	1.35
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	33,483	2,006.29	67,176,617	1,944.86	65,119,948	1.28
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	81,369	855.91	69,644,905	767.35	62,439,055	1.22
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORPORATION	18,847	3,291.21	62,029,529	2,927.41	55,173,024	1.08
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	4,606	12,778.60	58,858,271	11,919.89	54,903,025	1.08
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,202	17,529.64	56,129,933	15,941.15	51,043,582	1.00
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	35,600	1,545.51	55,020,306	1,369.48	48,753,666	0.96
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,014	8,901.05	53,530,916	7,964.95	47,901,251	0.94
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	15,515	3,112.01	48,282,974	2,901.56	45,017,707	0.88
アメリカ	投資証券	UDR INC	11,612	3,997.06	46,413,874	3,843.63	44,632,345	0.87
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	11,700	4,193.20	49,060,537	3,791.92	44,365,541	0.87
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	3,311	12,241.39	40,531,245	12,559.56	41,584,711	0.82
アメリカ	投資証券	MACERICH COMPANY/THE	5,037	9,229.41	46,488,575	7,773.84	39,156,847	0.77
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	45,900	920.72	42,261,183	842.76	38,682,684	0.76

## ロ 種類別の投資比率

平成28年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	100.08
合計	100.08

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成28年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	3,080,000,000	105.31	3,243,794,400	104.25	3,211,054,000	1.000	2020/9/20	1.50
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	2,970,000,000	105.48	3,132,845,100	104.40	3,100,947,300	1.300	2019/12/20	1.45
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,545,000,000	107.26	2,729,767,000	105.75	2,691,515,650	0.800	2023/6/20	1.26
日本	国債証券	第128回利付国債(5年)	2,605,000,000	101.45	2,642,948,500	100.93	2,629,382,800	0.100	2021/6/20	1.23

日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	2,285,000,000	105.35	2,407,407,450	104.24	2,382,021,100	1.500	2019/6/20	1.11
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	2,330,000,000	101.26	2,359,358,000	100.77	2,348,104,100	0.100	2020/3/20	1.10
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	2,245,000,000	104.31	2,341,939,100	103.36	2,320,521,800	1.300	2019/3/20	1.09
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	2,295,000,000	101.12	2,320,904,150	100.83	2,314,071,450	0.100	2026/9/20	1.08
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	2,245,000,000	103.96	2,333,902,000	102.76	2,306,984,450	0.300	2025/12/20	1.08
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	2,145,000,000	106.55	2,285,518,950	105.32	2,259,285,600	1.200	2020/12/20	1.06
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	107.36	2,260,117,450	106.08	2,233,089,250	1.300	2021/3/20	1.04
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	2,040,000,000	101.35	2,067,540,000	100.80	2,056,340,400	0.100	2020/6/20	0.96
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	2,025,000,000	102.35	2,072,717,450	100.90	2,043,346,500	0.100	2026/6/20	0.96
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	1,900,000,000	104.94	1,993,860,000	103.61	1,968,609,000	0.400	2025/9/20	0.92
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	1,880,000,000	104.91	1,972,308,000	103.55	1,946,758,800	0.400	2025/6/20	0.91
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1,800,000,000	107.27	1,930,860,000	105.93	1,906,902,000	1.200	2021/6/20	0.89
日本	国債証券	第306回利付国債(10年)	1,670,000,000	106.27	1,774,725,700	105.08	1,754,852,700	1.400	2020/3/20	0.82
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	1,620,000,000	101.41	1,642,842,000	100.83	1,633,591,800	0.100	2020/9/20	0.76
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	1,545,000,000	106.05	1,638,486,850	104.75	1,618,526,550	0.600	2024/3/20	0.76
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	1,600,000,000	102.12	1,634,058,700	100.92	1,614,864,000	0.100	2026/3/20	0.76
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	112.71	1,640,046,900	110.88	1,613,405,850	1.700	2022/12/20	0.75
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	1,550,000,000	101.20	1,568,677,500	100.75	1,561,625,000	0.100	2019/12/20	0.73
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	1,345,000,000	105.59	1,420,261,200	104.18	1,401,274,800	0.500	2024/9/20	0.66
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	1,310,000,000	101.61	1,331,091,000	100.90	1,321,868,600	0.100	2021/3/20	0.62
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	108.40	1,317,072,150	106.90	1,298,847,150	1.000	2023/3/20	0.61
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,220,000,000	107.42	1,310,524,000	105.94	1,292,516,800	0.800	2023/9/20	0.60
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	1,220,000,000	104.86	1,279,292,000	103.53	1,263,102,600	0.400	2025/3/20	0.59
日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	1,070,000,000	117.94	1,261,969,150	114.48	1,225,021,600	1.200	2035/9/20	0.57
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	1,160,000,000	106.45	1,234,863,200	105.15	1,219,832,800	0.800	2022/9/20	0.57
日本	国債証券	第43回利付国債(20年)	1,120,000,000	110.44	1,236,995,200	108.59	1,216,219,200	2.900	2019/9/20	0.57

## □ 種類別の投資比率

平成28年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	75.89
地方債証券	7.29
特殊債券	11.41

社債券	4.93
合計	99.52

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	11,000,000	10,744.89	1,181,938,210	10,839.74	1,192,372,191	2.750	2042/11/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	7,000,000	11,470.35	802,924,719	11,497.57	804,830,593	2.500	2024/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	7,000,000	11,349.15	794,440,522	11,381.64	796,715,274	2.375	2024/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	7,000,000	11,077.76	775,443,303	11,113.77	777,963,966	2.125	2025/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,000,000	10,970.61	767,942,780	11,027.69	771,938,956	2.000	2025/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,000,000	11,024.10	771,687,241	10,986.42	769,049,415	2.000	2025/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	12,711.36	762,681,875	12,739.46	764,368,175	3.625	2043/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,500,000	11,307.53	734,989,560	11,200.72	728,046,854	2.250	2025/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	11,726.81	727,062,297	11,703.09	725,592,057	2.750	2023/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	12,149.26	728,955,875	12,013.13	720,787,856	3.625	2020/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.875	6,000,000	11,971.85	718,311,106	11,711.88	702,712,831	3.875	2018/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	6,000,000	11,415.89	684,953,981	11,348.27	680,896,325	1.875	2017/10/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,000,000	11,217.26	673,036,056	11,259.56	675,573,938	2.250	2024/11/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	13,725.99	686,299,950	13,482.40	674,120,475	3.750	2019/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1	6,000,000	10,984.66	659,079,819	11,124.31	667,458,619	1.000	2019/11/30	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.5	3,500,000	18,051.71	631,810,116	18,568.22	649,887,809	5.500	2029/4/25	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	3,200,000	19,382.42	620,237,520	20,208.35	646,667,280	5.750	2032/10/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,500,000	11,684.65	642,655,956	11,664.45	641,544,933	2.625	2020/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,000,000	11,085.36	665,121,688	10,601.73	636,103,981	1.625	2026/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,000,000	11,281.62	676,897,683	10,584.16	635,050,044	1.625	2026/5/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	3,200,000	18,898.31	604,745,945	19,672.33	629,514,748	4.500	2041/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,500,000	11,159.44	613,769,285	11,211.26	616,619,311	2.000	2023/2/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000	15,310.82	612,433,080	15,404.19	616,167,720	4.250	2023/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	12,232.70	611,635,063	12,128.18	606,409,292	3.625	2021/2/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000	14,862.78	594,511,596	15,158.08	606,323,592	3.500	2026/4/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.5	4,500,000	13,348.94	600,702,480	13,328.35	599,776,002	2.500	2020/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	12,086.90	604,345,328	11,941.11	597,055,594	3.625	2019/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	5,000,000	11,963.94	598,197,359	11,905.98	595,299,031	3.125	2021/5/15	0.34

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.375	5,000,000	12,022.79	601,139,604	11,900.71	595,035,547	3.375	2019/11/15	0.34
イタリア	国債証券	BTPS 5.25	3,700,000	16,744.21	619,536,078	16,078.70	594,911,992	5.250	2029/11/1	0.34

## □ 種類別の投資比率

平成28年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.86
合計	97.86

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成28年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,600,000	11,619.16	185,906,671	11,027.69	176,443,190	2.000	2025/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,600,000	11,597.93	185,566,916	10,986.42	175,782,722	2.000	2025/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	1,500,000	12,107.10	181,606,605	11,497.57	172,463,698	2.500	2024/5/15	0.47
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	1,100,000	15,770.59	173,476,542	15,404.19	169,446,123	4.250	2023/10/25	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	1,400,000	11,871.41	166,199,760	11,658.30	163,216,274	2.625	2020/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,500,000	11,298.21	169,473,150	10,601.73	159,025,995	1.625	2026/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	1,400,000	11,902.46	166,634,545	11,259.56	157,633,919	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1,500,000	11,073.22	166,098,303	10,441.88	156,628,287	1.500	2026/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.75	1,200,000	14,293.11	171,517,349	13,022.27	156,267,313	3.750	2043/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	1,400,000	11,790.92	165,072,961	11,113.77	155,592,793	2.125	2025/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	1,300,000	12,281.88	159,664,505	11,703.09	152,140,269	2.750	2023/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	1,300,000	11,941.31	155,237,089	11,664.45	151,637,892	2.625	2020/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	1,300,000	11,910.37	154,834,836	11,200.72	145,609,370	2.250	2025/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	1,300,000	11,217.40	145,826,305	11,182.27	145,369,599	0.625	2018/4/30	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	1,200,000	11,972.65	143,671,882	11,381.64	136,579,761	2.375	2024/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,200,000	11,680.48	140,165,781	11,211.26	134,535,121	2.000	2023/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	1,200,000	11,393.94	136,727,311	11,196.32	134,355,952	1.375	2020/4/30	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	1,000,000	14,599.66	145,996,693	12,735.95	127,359,565	3.625	2044/2/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	900,000	14,325.69	128,931,263	14,111.07	126,999,665	3.750	2021/4/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	900,000	14,254.74	128,292,665	14,029.31	126,263,869	3.000	2022/4/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	1,100,000	13,078.48	143,863,347	11,315.77	124,473,532	3.000	2045/11/15	0.34

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.375	1,000,000	13,845.88	138,458,843	12,172.09	121,720,999	3.375	2044/5/15	0.33
イタリア	国債証券	BTPS 6	700,000	19,122.07	133,854,525	17,372.65	121,608,617	6.000	2031/5/1	0.33
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	600,000	21,767.20	130,603,234	20,208.35	121,250,115	5.750	2032/10/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	1,000,000	12,263.44	122,634,411	12,013.13	120,131,309	3.625	2020/2/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.875	1,000,000	11,851.52	118,515,272	11,711.88	117,118,805	3.875	2018/5/15	0.32
ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 4	600,000	20,746.20	124,477,226	19,477.34	116,864,067	4.000	2037/1/4	0.32
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.75	600,000	20,626.66	123,759,985	19,067.61	114,405,669	4.750	2035/4/25	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	1,000,000	11,527.44	115,274,415	11,375.49	113,754,988	1.750	2019/9/30	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,000,000	11,686.41	116,864,103	11,363.20	113,632,028	2.000	2021/5/31	0.31

## ロ 種類別の投資比率

平成28年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	99.04
合計	99.04

### 投資不動産物件

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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

該当事項はありません。

#### エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

#### Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

平成28年11月30日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	290	日本円	4,146,346,000	4,274,600,000	2.08

（注）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。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

平成28年11月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SPMINI 1612	買建	190	米ドル	20,382,195	2,291,366,362	20,936,100	2,353,636,362	1.42
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EUR 1612	買建	160	ユーロ	4,827,810	577,888,857	4,856,000	581,263,200	0.35
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200 1612	買建	14	オーストラリアドル	1,874,638	157,732,041	1,911,700	160,850,438	0.09
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 1612	買建	25	英ポンド	1,722,140	241,891,784	1,691,500	237,588,090	0.14

（注）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。

平成28年11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	1,590,000.00	177,889,200	178,731,900	0.10
	カナダドル	売建	130,000.00	10,843,430	10,877,100	0.00
	ユーロ	売建	200,000.00	23,742,000	23,938,000	0.01
	英ポンド	売建	230,000.00	31,912,500	32,303,500	0.01
	スイスフラン	売建	70,000.00	7,731,500	7,777,700	0.00
	スウェーデンクローナ	売建	240,000.00	2,916,000	2,940,000	0.00
	ノルウェークローネ	売建	60,000.00	784,860	790,200	0.00
	デンマーククローネ	売建	90,000.00	1,436,040	1,447,200	0.00
	オーストラリアドル	売建	58,000.00	4,859,820	4,879,540	0.00
	香港ドル	売建	340,000.00	4,902,800	4,926,600	0.00
	シンガポールドル	売建	10,000.00	786,000	789,600	0.00
	イスラエルシェケル	売建	20,000.00	582,240	586,200	0.00

（注）わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

平成28年11月30日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCIE 1612	買建	1,415	米ドル	65,386,960	7,350,802,043	60,929,900	6,849,739,358	100.63

（注）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。

平成28年11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	440,692.59	49,500,000	49,526,682	0.72

（注）わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

## Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

平成28年11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	373,696.40	42,000,000	42,007,212	0.82
	ユーロ	買建	30,925.62	3,700,000	3,701,487	0.07
	英ポンド	買建	24,936.71	3,500,000	3,502,360	0.06
	オーストラリアドル	買建	89,441.37	7,525,040	7,524,402	0.14
	シンガポールドル	買建	31,667.02	2,500,000	2,500,427	0.04
	米ドル	売建	25,000.00	2,818,200	2,810,000	0.05

（注）わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド



該当事項はありません。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

平成28年11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	149,500,000.00	15,654,858,050	16,796,325,000	45.31
	カナダドル	売建	9,500,000.00	742,364,000	794,580,000	2.14
	メキシコペソ	売建	57,200,000.00	317,071,040	311,168,000	0.83
	ユーロ	売建	125,800,000.00	14,465,145,920	15,057,002,000	40.62
	英ポンド	売建	19,600,000.00	2,514,100,550	2,752,036,000	7.42
	スイスフラン	売建	900,000.00	95,385,690	99,999,000	0.26
	スウェーデンクローナ	売建	12,600,000.00	146,279,700	154,350,000	0.41
	ノルウェークローネ	売建	7,700,000.00	97,566,700	101,409,000	0.27
	デンマーククローネ	売建	14,900,000.00	230,301,850	239,592,000	0.64
	ポーランドズロチ	売建	7,500,000.00	199,965,000	202,200,000	0.54
	オーストラリアドル	売建	9,100,000.00	725,183,550	765,037,000	2.06
	シンガポールドル	売建	3,800,000.00	286,117,200	299,896,000	0.80
	南アフリカランド	売建	21,800,000.00	168,252,400	176,144,000	0.47

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

### 参考情報

基準日:2016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

### ■アセットアロケーション・ファンド(安定型)



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## 分配の推移

決算期	分配金
2016年4月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2016年4月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■アセットアロケーション・ファンド(成長型)



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2016年4月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

## 主要な資産の状況

### ▶ 投資対象とする投資信託の現況

#### ■ 国内債券パッシブ・マザーファンド

##### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	1.000	2020/09/20	1.50
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	1.300	2019/12/20	1.45
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	0.800	2023/06/20	1.26
日本	国債証券	第128回利付国債(5年)	0.100	2021/06/20	1.23
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	1.500	2019/06/20	1.11
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	0.100	2020/03/20	1.10
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	1.300	2019/03/20	1.09
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	0.100	2026/09/20	1.08
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	0.300	2025/12/20	1.08
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	1.200	2020/12/20	1.06

#### ■ 外国債券パッシブ・マザーファンド

##### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	2.750	2042/11/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	2.500	2024/05/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	2.375	2024/08/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2.125	2025/05/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2.000	2025/02/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2.000	2025/08/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	3.625	2043/08/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2025/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	2.750	2023/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	3.625	2020/02/15	0.41

#### ■ ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

##### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2.000	2025/02/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2.000	2025/08/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	2.500	2024/05/15	0.47
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4.250	2023/10/25	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	2.625	2020/08/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1.625	2026/02/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1.500	2026/08/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.75	3.750	2043/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2.125	2025/05/15	0.42

※比率は、各マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## ■バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
ロシア	国債証券	Russian Federation 7.5 03/31/2030	7.500	2030/03/31	0.80
サウジアラビア	国債証券	Kingdom of Saudi Arabia 4.5 10/26/2046	4.500	2046/10/26	0.52
アルゼンチン	国債証券	Republic of Argentina 7.5 04/22/2026	7.500	2026/04/22	0.51
ブラジル	社債券	Petrobras Global Finance BV 8.375 05/23/2021	8.375	2021/05/23	0.49
ロシア	国債証券	Russian Federation 4.875 09/16/2023	4.875	2023/09/16	0.46
ロシア	国債証券	Russian Federation 5 04/29/2020	5.000	2020/04/29	0.45
サウジアラビア	国債証券	Kingdom of Saudi Arabia 2.375 10/26/2021	2.375	2021/10/26	0.44
サウジアラビア	国債証券	Kingdom of Saudi Arabia 3.25 10/26/2026	3.250	2026/10/26	0.43
ポーランド	国債証券	Republic of Poland 6.375 07/15/2019	6.375	2019/07/15	0.41
ペルー	国債証券	Republic of Peru 8.75 11/21/2033	8.750	2033/11/21	0.40

※比率は、当該投資信託証券の純資産総額に対する時価の比率です。

※「バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF」の公開情報を基に三井住友アセットマネジメント作成

※国・地域は発行国基準です。

## ■iシェアーズJPモルガン米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
ロシア	国債証券	RUSSIAN (FEDERATION OF) Reg57.5%3/31/2030	7.500	2030/03/31	1.70
ウルグアイ	国債証券	URUGUAY (ORIENTAL REPUBLIC OF)5.1%12/31/2033	5.100	2050/06/18	1.03
ハンガリー	国債証券	HUNGARY (REPUBLIC OF)6.38%11/21/2033	6.380	2021/03/29	0.93
マレーシア	政府機関債	PETRONAS CAPITAL LTD. Reg55.25%12/31/2038	5.250	2019/08/12	0.89
ペルー	国債証券	PERU (REPUBLIC OF)8.75%6/18/2050	8.750	2033/11/21	0.85
アルゼンチン	国債証券	ARGENTINA REPUBLIC OF GOVERNMENT Reg57.5%11/18/2050	7.500	2026/04/22	0.84
ペルー	国債証券	PERU (REPUBLIC OF)5.63%8/12/2019	5.630	2050/11/18	0.82
ポーランド	国債証券	POLAND (REPUBLIC OF)6.38%3/29/2021	6.380	2019/07/15	0.78
ポーランド	国債証券	POLAND (REPUBLIC OF)5%3/23/2022	5.000	2022/03/23	0.77
バーミンガム諸島	政府機関債	1MDB GLOBAL INVESTMENTS LTD4.4%3/23/2023	4.400	2023/03/09	0.71

※比率は、当該投資信託証券の純資産総額に対する時価の比率です。

※「iシェアーズJPモルガン米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF」の公開情報およびホームページの情報を基に三井住友アセットマネジメント作成

※国・地域は発行国基準です。

## ■SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
フランス	社債券	SFR GROUP SA 7.375 05/01/2026	7.375	2026/05/01	0.74
アメリカ	社債券	SPRINT CORP 7.875 09/15/2023	7.875	2023/09/15	0.59
フランス	社債券	SFR GROUP SA 6 05/15/2022	6.000	2022/05/15	0.58
アメリカ	社債券	WESTERN DIGITAL CORP 10.5 04/01/2024	10.500	2024/04/01	0.55
アメリカ	社債券	FRONTIER COMMUNICATIONS 11 09/15/2025	11.000	2025/09/15	0.52
アメリカ	社債券	FIRST DATA CORPORATION 7 12/01/2023	7.000	2023/12/01	0.51
ルクセンブルグ	社債券	ALTICE LUXEMBOURG SA 7.75 05/15/2022	7.750	2022/05/15	0.48
アメリカ	社債券	PRIME SECSRVC BRW/FINANC 9.25 05/15/2023	9.250	2023/05/15	0.48
アメリカ	社債券	REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD 5.75 10/15/2020	5.750	2020/10/15	0.46
アメリカ	社債券	NIELSEN FINANCE LLC/CO 5 04/15/2022	5.000	2022/04/15	0.43

※比率は、当該投資信託証券の純資産総額に対する時価の比率です。

※「SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF」の公開情報を基に三井住友アセットマネジメント作成

※国・地域は発行国基準です。

## ■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.78
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.29
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.67
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.52
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1.37
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.36
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1.34
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.24
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1.12
日本	株式	ソニー	電気機器	1.06

## ■外国株式インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.99
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1.49
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	1.16
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品/バイオテクノロジー/ライフサイエンス	1.01
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1.00
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.94
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	0.93
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	0.91
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	0.82
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	0.79

## ■エマージング株式インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	0.000	2017/05/25	14.82
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	0.000	2017/07/20	14.81
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	0.000	2017/03/02	9.90
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	0.000	2017/04/27	9.89
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	0.000	2016/12/08	6.61
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	0.000	2017/01/26	6.60
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	0.000	2017/02/02	6.60

※上記のほか、当マザーファンドにおいて、株価指数先物取引の買建て(100.63%)を行っています。

※比率は、各マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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

## ■リート・インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	7.69
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.93
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	6.10
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	5.07
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	4.41
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3.74
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	3.73
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3.70
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	3.47
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3.32

## ■外国リート・インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	5.62
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.06
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	2.64
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2.19
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	2.18
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	2.16
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	2.15
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	2.15
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	1.88
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	1.67

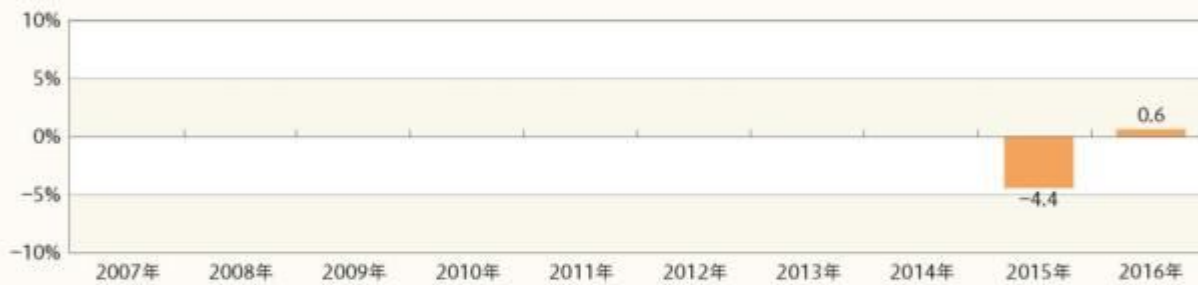
※比率は、各マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)

### ■アセットアロケーション・ファンド(安定型)



### ■アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)



### ■アセットアロケーション・ファンド(成長型)



※ファンド購入時には、購入時手数料がかかる場合があります。また、換金時にも費用・税金などがかかる場合があります。したがって、ファンドの収益率は実際の投資家利回りとは異なります。

※2015年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2015年4月17日)から年末までの騰落率を表示しています。

※2016年のファンドの収益率は、年初から2016年11月30日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3【ファンドの経理状況】

&lt;追加&gt;

- 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 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28年4月27日から平成28年10月26日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【アセットアロケーション・ファンド(安定型)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

第2期中間計算期間 (平成28年10月26日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	48,631,433
コール・ローン	669,481,342
投資信託受益証券	6,863,842,929
親投資信託受益証券	22,279,179,381
派生商品評価勘定	251,020
流動資産合計	29,861,386,105
<b>資産合計</b>	
29,861,386,105	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,475,403
未払金	194,961,379
未払解約金	26,653,559
未払受託者報酬	3,143,220
未払委託者報酬	95,344,213
未払利息	1,718
その他未払費用	635,822
流動負債合計	343,215,314
<b>負債合計</b>	
343,215,314	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	30,412,472,586
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	894,301,795
元本等合計	29,518,170,791
<b>純資産合計</b>	
29,518,170,791	
<b>負債純資産合計</b>	
29,861,386,105	

## (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	
自 平成28年 4月27日	
至 平成28年10月26日	
<b>営業収益</b>	
受取配当金	95,479,519
有価証券売買等損益	450,412,303
為替差損益	36,753,681
<b>営業収益合計</b>	<b>509,138,141</b>
<b>営業費用</b>	
支払利息	151,975
受託者報酬	3,143,220
委託者報酬	95,344,213
その他費用	888,929
<b>営業費用合計</b>	<b>99,528,337</b>
営業利益又は営業損失（ ）	409,609,804
経常利益又は経常損失（ ）	409,609,804
中間純利益又は中間純損失（ ）	409,609,804
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,879,119
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	681,942,051
剰余金増加額又は欠損金減少額	41,437,968
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	41,437,968
中間追加信託に伴う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	659,528,397
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	659,528,397
<b>分配金</b>	<b>-</b>
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	894,301,795

## (3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期中間計算期間
	自 平成28年 4月27日 至 平成28年10月26日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

項目	第2期中間計算期間	
	自	至
	平成28年 4月27日	平成28年10月26日
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。	
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。	
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。	

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項目	第2期中間計算期間	
	(平成28年10月26日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		30,412,472,586口
2. 「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	元本の欠損	894,301,795円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9706円
	(10,000口当たりの純資産額)	9,706円

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期中間計算期間	
	(平成28年10月26日現在)	
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありせん。	

項目	第2期中間計算期間 (平成28年10月26日現在)	
	2.時価の算定方法	(1) 有価証券（投資信託受益証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

第2期中間計算期間（平成28年10月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	36,038,150	-	36,016,483	21,667
	米ドル	36,038,150	-	36,016,483	21,667
	売建	5,521,801,904	-	5,544,004,620	22,202,716
	米ドル	5,521,801,904	-	5,544,004,620	22,202,716
合計		5,557,840,054	-	5,580,021,103	22,224,383

（注）1.時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

項目	第2期中間計算期間 (平成28年10月26日現在)
期首元本額	14,040,607,518円

項目	第2期中間計算期間 (平成28年10月26日現在)
期中追加設定元本額	17,256,839,721円
期中一部解約元本額	884,974,653円

## 【アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

第2期中間計算期間 (平成28年10月26日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	33,832,433
コール・ローン	533,329,524
投資信託受益証券	7,055,474,619
親投資信託受益証券	12,991,542,227
派生商品評価勘定	182,952
流動資産合計	20,614,361,755
<b>資産合計</b>	
20,614,361,755	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	23,032,111
未払金	196,593,345
未払解約金	17,586,267
未払受託者報酬	2,531,317
未払委託者報酬	76,783,152
未払利息	1,368
その他未払費用	510,416
流動負債合計	317,037,976
<b>負債合計</b>	
317,037,976	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	21,401,472,947
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,104,149,168
元本等合計	20,297,323,779
<b>純資産合計</b>	
20,297,323,779	
<b>負債純資産合計</b>	
20,614,361,755	

## (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 自 平成28年 4月27日 至 平成28年10月26日	
<b>営業収益</b>	
受取配当金	116,629,417
有価証券売買等損益	410,542,725
為替差損益	70,176,930
営業収益合計	456,995,212
<b>営業費用</b>	
支払利息	114,629
受託者報酬	2,531,317
委託者報酬	76,783,152
その他費用	846,518

第2期中間計算期間  
自 平成28年 4月27日  
至 平成28年10月26日

営業費用合計	80,275,616
営業利益又は営業損失（ ）	376,719,596
経常利益又は経常損失（ ）	376,719,596
中間純利益又は中間純損失（ ）	376,719,596
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,217,100
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	937,888,984
剰余金増加額又は欠損金減少額	31,468,290
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	31,468,290
中間追加信託に伴う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	571,230,970
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	571,230,970
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,104,149,168

### （ 3 ）【中間注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第2期中間計算期間 自 平成28年 4月27日 至 平成28年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
	外貨建資産等の会計処理

項目	第2期中間計算期間 自 平成28年 4月27日 至 平成28年10月26日
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項目	第2期中間計算期間 (平成28年10月26日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		21,401,472,947口
2. 「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	元本の欠損	1,104,149,168円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9484円
	(10,000口当たりの純資産額)	9,484円)

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期中間計算期間 (平成28年10月26日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資信託受益証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## ( デリバティブ取引に関する注記 )

第2期中間計算期間（平成28年10月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	48,990,020	-	48,982,805	7,215
	米ドル	48,990,020	-	48,982,805	7,215
	売建	5,656,544,736	-	5,679,386,680	22,841,944
	米ドル	5,656,544,736	-	5,679,386,680	22,841,944
	合計	5,705,534,756	-	5,728,369,485	22,849,159

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (その他の注記)

項 目	第2期中間計算期間 (平成28年10月26日現在)
期首元本額	13,328,989,150円
期中追加設定元本額	8,519,689,445円
期中一部解約元本額	447,205,648円

## 【アセットアロケーション・ファンド（成長型）】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

第2期中間計算期間 (平成28年10月26日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	40,945,308
コール・ローン	495,739,657
投資信託受益証券	6,097,968,766
親投資信託受益証券	13,323,806,853
派生商品評価勘定	117,964
流動資産合計	19,958,578,548
資産合計	19,958,578,548

第2期中間計算期間  
(平成28年10月26日現在)

負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	17,238,984
未払金	128,544,687
未払解約金	5,206,017
未払受託者報酬	2,512,613
未払委託者報酬	76,216,011
未払利息	1,272
その他未払費用	505,785
流動負債合計	230,225,369
負債合計	230,225,369
純資産の部	
元本等	
元本	21,219,147,452
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,490,794,273
元本等合計	19,728,353,179
純資産合計	19,728,353,179
負債純資産合計	19,958,578,548

## (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	
自 平成28年 4月27日	
至 平成28年10月26日	
営業収益	
受取配当金	108,104,983
有価証券売買等損益	363,052,074
為替差損益	74,274,649
営業収益合計	396,882,408
営業費用	
支払利息	108,669
受託者報酬	2,512,613
委託者報酬	76,216,011
その他費用	853,219
営業費用合計	79,690,512
営業利益又は営業損失（ ）	317,191,896
経常利益又は経常損失（ ）	317,191,896
中間純利益又は中間純損失（ ）	317,191,896
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,886,484
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,148,788,338
剰余金増加額又は欠損金減少額	48,987,661
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	48,987,661
中間追加信託に伴う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	712,071,976
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	712,071,976
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,490,794,273

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)



項目	第2期中間計算期間	
	自 平成28年 4月27日	至 平成28年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項目	第2期中間計算期間	
	( 平成28年10月26日現在 )	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		21,219,147,452口
2. 「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	元本の欠損	1,490,794,273円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9297円
	(10,000口当たりの純資産額	9,297円)

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期中間計算期間 (平成28年10月26日現在)	
	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資信託受益証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

（デリバティブ取引に関する注記）

第2期中間計算期間（平成28年10月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	7,990,367	-	7,990,367	-
	米ドル	7,990,367	-	7,990,367	-
	売建	4,214,062,640	-	4,231,183,660	17,121,020
	米ドル	4,214,062,640	-	4,231,183,660	17,121,020
	合計	4,222,053,007	-	4,239,174,027	17,121,020

（注）1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第2期中間計算期間 (平成28年10月26日現在)
期首元本額	13,657,972,258円
期中追加設定元本額	8,135,199,331円
期中一部解約元本額	574,024,137円

(参考)

「アセットアロケーション・ファンド(安定型)」「アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)」および「アセットアロケーション・ファンド(成長型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「リート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF」、「iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF」および「SPDR バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF」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」および「投資信託受益証券」はこれらの親投資信託および投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

貸借対照表

(単位：円)

(平成28年10月26日現在)

資産の部

流動資産

コール・ローン

1,241,194,795

株式

192,190,726,490

派生商品評価勘定

37,868,920

未収入金

3,611,357,895

未収配当金

1,621,174,871

差入委託証拠金

7,480,000

流動資産合計

198,709,802,971

資産合計

198,709,802,971

負債の部

流動負債

前受金

37,870,000

未払金

1,943,961,500

未払解約金

604,125,516

未払利息

3,185

その他未払費用

21,357

流動負債合計

2,585,981,558

負債合計

2,585,981,558

純資産の部

元本等

元本

95,345,705,735

(平成28年10月26日現在)

剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	100,778,115,678
元本等合計	196,123,821,413
純資産合計	196,123,821,413
負債純資産合計	198,709,802,971

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成28年4月27日 至平成28年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年10月26日現在)
1. 担保資産	<p>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。</p> <p>株式 3,012,500,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	95,345,705,735口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.0570円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 20,570円)</p>

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年10月26日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

（平成28年10月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,636,920,000	-	3,674,790,000	37,870,000
	東証株価指数先物	3,636,920,000	-	3,674,790,000	37,870,000
	合計	3,636,920,000	-	3,674,790,000	37,870,000

## （注）1.時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## （その他の注記）

(平成28年10月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	100,093,353,772円
同期中における追加設定元本額	7,687,931,049円
同期中における一部解約元本額	12,435,579,086円

(平成28年10月26日現在)

平成28年10月26日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	10,212,294,731円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	564,300,674円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	2,751,010,851円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,976,505,070円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	102,333,686円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,827,446円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	21,583,854円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	62,270,694円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	53,392,330円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	30,502,259円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	73,068,760円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	2,312,070,998円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	1,251,835,047円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,845,155,969円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,932,482,241円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	2,283,775,597円
イオン・バランス戦略ファンド	15,823,235円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	14,537,635,195円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	83,912,431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＞	11,237,137,539円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	6,176,929,349円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	3,638,717,717円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	13,399,364,262円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	75,027,281円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	331,154,246円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	15,430,481円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,381,922,194円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	81,318,128円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	542,429,509円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,609,918,507円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	2,822,997,015円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	4,728,682,454円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	125,665,893円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	2,331,940,107円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	106,629,971円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	172,572,615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）	2,613,538,146円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	157,770,875円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	71,365,343円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	33,196,127円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	346,722,136円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	577,174,885円

（平成28年10月26日現在）	
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	259,957,131円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	172,444,652円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	80,832,950円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	13,043,980円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	110,828,130円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,479,095,776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）	256,507,215円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	28,921,651円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	24,037円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	496,588円
SMAM・グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド（安定成長型）<適格機関投資家限定>	515,336円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	213,842円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	129,687,317円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	62,174,245円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	54,577,037円
合計	95,345,705,735円

## 外国株式インデックス・マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

（平成28年10月26日現在）

#### 資産の部

##### 流動資産

預金	3,953,630,430
コール・ローン	202,488,525
株式	143,243,978,457
投資証券	3,788,118,820
派生商品評価勘定	65,235,563
未収配当金	155,568,606
差入委託証拠金	1,591,825,239
流動資産合計	153,000,845,640

##### 資産合計

153,000,845,640

#### 負債の部

##### 流動負債

派生商品評価勘定	25,681,971
前受金	39,542,192
未払金	28,309,402
未払解約金	49,296,842
未払利息	519
その他未払費用	3,708
流動負債合計	142,834,634

##### 負債合計

142,834,634

#### 純資産の部

##### 元本等

元本	60,594,133,848
剰余金	

(平成28年10月26日現在)

剰余金又は欠損金（ ）	92,263,877,158
元本等合計	152,858,011,006
純資産合計	152,858,011,006
負債純資産合計	153,000,845,640

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成28年4月27日 至平成28年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	60,594,133,848口



項目	(平成28年10月26日現在)	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2,522円
	(10,000口当たりの純資産額)	25,227円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(平成28年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,871,328,869	-	5,910,871,061	39,542,192
	SPMINI 1612	4,123,527,744	-	4,098,357,856	25,169,888
	DJ EUR 1612	1,045,418,456	-	1,083,611,857	38,193,401
	FTSE 1612	408,238,819	-	424,909,660	16,670,841
	SPI200 1612	294,143,850	-	303,991,688	9,847,838
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	104,562,000	-	104,575,800	13,800
	米ドル	55,204,800	-	55,210,100	5,300
	カナダドル	2,339,700	-	2,340,000	300
	ユーロ	37,382,400	-	37,392,300	9,900
	スイスフラン	2,093,000	-	2,093,400	400
	スウェーデンクローナ	1,399,200	-	1,399,200	-
	ノルウェークローネ	503,200	-	502,800	400

デンマーククローネ	1,218,400	-	1,218,400	-
オーストラリアドル	1,601,000	-	1,601,400	400
香港ドル	2,820,300	-	2,818,200	2,100
売建	7,602,600	-	7,605,000	2,400
英ポンド	7,602,600	-	7,605,000	2,400
合計	5,983,493,469	-	6,023,051,861	39,553,592

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## (2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (その他の注記)

(平成28年10月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	60,595,656,831円
同期中における追加設定元本額	7,259,213,500円
同期中における一部解約元本額	7,260,736,483円
平成28年10月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	9,730,044,226円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	224,685,070円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	935,994,616円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	630,587,800円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	47,545,543円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	3,313,135円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	8,321,281円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	27,836,334円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	29,959,418円

（平成28年10月26日現在）	
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	17,876,536円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	44,775,325円
外国株式指数ファンド	460,834,698円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	975,873,265円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	860,415,777円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	806,073,935円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	1,277,550,100円
S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	6,773,107,553円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	33,394,270円
S M A M ・ バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	4,483,775,539円
S M A M ・ バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	3,302,857,455円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,548,729,274円
S M A M ・ バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	10,693,983,568円
S M A M ・ バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	30,100,751円
S M A M ・ バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	174,369,745円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	9,179,722円
S M A M ・ バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,268,870,520円
S M A M ・ バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	97,229,596円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	289,259,199円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	1,280,452,799円
S M A M ・ バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	2,180,782,435円
S M A M ・ バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	2,851,639,838円
S M A M ・ バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	96,806,715円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,189,243,465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）	1,882,931,852円
S M A M ・ グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	250,740,901円
S M A M ・ バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	136,319,836円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	2,086,238,807円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	42,347,742円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	22,281,748円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	11,346,008円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	88,547,532円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	198,110,685円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T＜適格機関投資家専用＞	200,402,135円
S M A M ・ F G新興国重視型バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	17,631円
S M A M ・ F Gグローバルバランス25VA＜適格機関投資家限定＞	752,467円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドSA＜適格機関投資家限定＞	2,117,490,888円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	137,887円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04＜適格機関投資家限定＞	89,873,501円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-05＜適格機関投資家限定＞	43,141,660円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	37,983,065円

(平成28年10月26日現在)	
合計	60,594,133,848円

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	2,248,502,541
コール・ローン	93,264,674
国債証券	4,782,979,819
派生商品評価勘定	15,679,526
前払金	54,044,418
差入委託証拠金	1,984,079,592
流動資産合計	9,178,550,570
資産合計	9,178,550,570
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	69,846,282
未払金	1,869,291,244
未払解約金	148,357
未払利息	239
その他未払費用	2,034
流動負債合計	1,939,288,156
負債合計	1,939,288,156
純資産の部	
元本等	
元本	6,765,034,589
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	474,227,825
元本等合計	7,239,262,414
純資産合計	7,239,262,414
負債純資産合計	9,178,550,570

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成28年 4月27日 至 平成28年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	6,765,034,589口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0701円 (10,000口当たりの純資産額 10,701円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

項目	(平成28年10月26日現在)
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成28年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	7,351,922,176	-	7,297,877,758	54,044,418
	MSCIE 1612	7,351,922,176	-	7,297,877,758	54,044,418
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	119,300,000	-	119,177,662	122,338
	米ドル	119,300,000	-	119,177,662	122,338
合計		7,471,222,176	-	7,417,055,420	54,166,756

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

（平成28年10月26日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,006,026,513円
同期中における追加設定元本額	4,970,083,796円
同期中における一部解約元本額	211,075,720円
平成28年10月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	304,243,183円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	338,171,318円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,880,036,615円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,896,074,500円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	2,337,114,520円
イオン・バランス戦略ファンド	9,042,461円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	351,992円
合計	6,765,034,589円

## Jリート・インデックス・マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

（平成28年10月26日現在）

#### 資産の部

##### 流動資産

コール・ローン

105,107,635

投資証券

11,810,924,852

未収入金

4,312,106

未収配当金

77,431,287

流動資産合計

11,997,775,880

##### 資産合計

11,997,775,880

#### 負債の部

##### 流動負債

未払金

193,251,272

未払利息

269

その他未払費用

2,394

流動負債合計

193,253,935

##### 負債合計

193,253,935

#### 純資産の部

##### 元本等

元本

6,148,715,257

剰余金

剰余金又は欠損金（ ）

5,655,806,688

元本等合計

11,804,521,945

##### 純資産合計

11,804,521,945

#### 負債純資産合計

11,997,775,880

### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年 4月27日 至 平成28年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成28年10月26日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		6,148,715,257口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.9198円
	(10,000口当たりの純資産額)	19,198円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成28年10月26日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>



## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

（平成28年10月26日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	6,025,953,718円
同期中における追加設定元本額	2,233,688,220円
同期中における一部解約元本額	2,110,926,681円
平成28年10月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	583,448,308円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	598,275,258円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	427,680,004円
イオン・バランス戦略ファンド	11,126,486円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	45,601,039円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	8,101,795円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	2,474,086,925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）	1,343,355,341円
SMAM・グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド（安定成長型）<適格機関投資家限定>	461,694円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	584,001円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	226,496,917円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	411,961円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	225,707,781円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	108,129,147円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	95,248,600円
合計	6,148,715,257円

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

（平成28年10月26日現在）

## 資産の部

（平成28年10月26日現在）

流動資産	
預金	136,597,601
コール・ローン	1,449,693
投資証券	4,549,329,722
派生商品評価勘定	4,481
未収入金	31,293
未収配当金	4,199,462
流動資産合計	4,691,612,252
資産合計	4,691,612,252
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	522
未払金	117,620,939
未払利息	3
その他未払費用	51
流動負債合計	117,621,515
負債合計	117,621,515
純資産の部	
元本等	
元本	2,599,338,285
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,974,652,452
元本等合計	4,573,990,737
純資産合計	4,573,990,737
負債純資産合計	4,691,612,252

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成28年4月27日 至平成28年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準

項目	自 平成28年 4月27日 至 平成28年10月26日
	受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年10月26日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		2,599,338,285口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.7597円
	(10,000口当たりの純資産額)	17,597円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## (平成28年10月26日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	35,400,000	-	35,403,959	3,959
	米ドル	25,850,000	-	25,852,481	2,481

カナダドル	700,000	-	700,089	89
ユーロ	2,450,000	-	2,450,648	648
英ポンド	1,750,000	-	1,750,551	551
オーストラリアドル	2,850,000	-	2,850,712	712
香港ドル	700,000	-	699,478	522
シンガポールドル	1,100,000	-	1,100,000	-
合計	35,400,000	-	35,403,959	3,959

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (その他の注記)

(平成28年10月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,897,750,493円
同期中における追加設定元本額	1,304,202,897円
同期中における一部解約元本額	602,615,105円
平成28年10月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	252,315,395円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	253,827,671円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	577,719,999円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	58,559,738円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	8,373,821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）	1,401,150,600円
S M A M・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	113,214円
S M A M・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	47,036,642円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	241,205円
合計	2,599,338,285円

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	803,471,139
国債証券	163,309,538,250
地方債証券	16,469,332,307
特殊債券	25,361,510,788
社債券	10,767,152,000
未収利息	550,318,821
前払費用	4,140,303
流動資産合計	217,265,463,608
資産合計	217,265,463,608
負債の部	
流動負債	
未払金	410,019,700
未払解約金	47,746,072
未払利息	2,062
その他未払費用	10,236
流動負債合計	457,778,070
負債合計	457,778,070
純資産の部	
元本等	
元本	170,456,046,904
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	46,351,638,634
元本等合計	216,807,685,538
純資産合計	216,807,685,538
負債純資産合計	217,265,463,608

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成28年 4月27日 至 平成28年10月26日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	170,456,046,904口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2719円 (10,000口当たりの純資産額 12,719円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## （その他の注記）

（平成28年10月26日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	195,629,774,814円
同期中における追加設定元本額	7,889,803,957円
同期中における一部解約元本額	33,063,531,867円
平成28年10月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	2,448,748,559円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,311,320,484円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	930,431,621円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	312,740,555円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	49,415,917円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	98,808,075円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	177,784,501円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	87,429,011円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	38,728,860円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	77,242,079円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	31,006,531円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,822,172,553円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	322,630,090円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	15,239,232円
S M A M ・ 年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	5,988,950,785円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 ＜適格機関投資家専用＞	26,437,416,531円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 ＜適格機関投資家専用＞	8,585,142,816円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 ＜適格機関投資家専用＞	20,930,316,785円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 ＜適格機関投資家限定＞	355,969,434円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 ＜適格機関投資家限定＞	683,859,452円
世界6資産バランスファンドV A ＜適格機関投資家限定＞	42,734,733円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 ＜適格機関投資家専用＞	305,116,298円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型＜適格機関投資家限定＞	124,357,828円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 ＜適格機関投資家専用＞	2,229,269,840円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 ＜適格機関投資家専用＞	2,485,575,005円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 ＜適格機関投資家専用＞	6,340,080,891円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 ＜適格機関投資家専用＞	13,161,264,162円
S M A M ・ バランスV A 株4 0 T ＜適格機関投資家限定＞	191,952,721円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	7,009,039,891円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	22,404,363,118円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A ＜適格機関投資家限定＞	667,394,376円

(平成28年10月26日現在)	
S M A M ・ バランスファンドV A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	1,060,524,792円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	18,616,651,163円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	1,057,034,644円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	218,449,744円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	51,417,447円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	2,567,464,891円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	2,913,229,239円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	2,872,853,538円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	1,152,565,950円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	249,618,858円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	20,687,829円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	405,928,838円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	7,534,557,760円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	337,276,701円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	34,418円
S M A M ・ F G グローバルバランス2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	1,432,984円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型) < 適格機関投資家限定 >	4,779,441円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ファンド < 適格機関投資家限定 >	2,178,616円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	2,698,249円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	1,430,866,941円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	685,743,400円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	603,548,727円
合計	170,456,046,904円

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(平成28年10月26日現在)

### 資産の部

#### 流動資産

預金	927,180,274
コール・ローン	755,715,322
国債証券	164,520,875,675
未収入金	35,000,000
未収利息	1,375,311,603
前払費用	18,426,269
流動資産合計	167,632,509,143

#### 資産合計

167,632,509,143

### 負債の部

#### 流動負債

未払解約金	6,074,548
未払利息	1,939



(平成28年10月26日現在)

その他未払費用	10,401
流動負債合計	6,086,888
負債合計	6,086,888
純資産の部	
元本等	
元本	105,094,174,870
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	62,532,247,385
元本等合計	167,626,422,255
純資産合計	167,626,422,255
負債純資産合計	167,632,509,143

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成28年4月27日 至平成28年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	105,094,174,870口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.5950円
	(10,000口当たりの純資産額 15,950円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成28年10月26日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

（平成28年10月26日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	105,109,279,423円
同期中における追加設定元本額	4,248,953,296円
同期中における一部解約元本額	4,264,057,849円
平成28年10月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	8,019,270,640円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	351,342,620円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	966,498,860円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	490,882,380円
S M A M ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	58,108,297円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	9,238,240円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	25,716,764円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	67,291,474円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	46,965,409円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	24,770,231円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	56,971,088円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	6,629,630円

（平成28年10月26日現在）	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	655,070,406円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	703,163,997円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	645,711,267円
S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,572,048,840円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型＜適格機関投資家限定＞	3,454,082,627円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 ＜適格機関投資家専用＞	18,354,876,425円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 ＜適格機関投資家専用＞	7,386,661,688円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 ＜適格機関投資家専用＞	16,327,975,950円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 ＜適格機関投資家限定＞	45,061,279円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 ＜適格機関投資家限定＞	133,275,755円
世界6資産バランスファンドV A ＜適格機関投資家限定＞	9,446,740円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 ＜適格機関投資家専用＞	963,937,254円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型＜適格機関投資家限定＞	148,475,571円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 ＜適格機関投資家専用＞	1,549,882,208円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 ＜適格機関投資家専用＞	1,977,563,174円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 ＜適格機関投資家専用＞	5,003,649,267円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 ＜適格機関投資家専用＞	8,971,166,158円
S M A M ・ バランスV A 株4 0 T ＜適格機関投資家限定＞	152,226,438円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンドV A ＜適格機関投資家限定＞	14,373,754,636円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	1,263,679,177円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	2,977,131,110円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A ＜適格機関投資家限定＞	263,596,522円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 0 ＜適格機関投資家専用＞	839,709,739円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	3,278,579,090円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A ＜適格機関投資家専用＞	190,449,796円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A ＜適格機関投資家専用＞	50,608,944円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A ＜適格機関投資家専用＞	17,036,661円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L ＜適格機関投資家専用＞	195,269,069円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L ＜適格機関投資家専用＞	691,546,534円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T ＜適格機関投資家専用＞	222,092,586円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 ＜適格機関投資家専用＞	207,825,348円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 ＜適格機関投資家専用＞	57,168,789円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 ＜適格機関投資家専用＞	6,886,535円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 ＜適格機関投資家専用＞	1,773,995,110円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 ＜適格機関投資家専用＞	27,725,842円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス2 0 V A ＜適格機関投資家限定＞	171,310円
S M A M ・ F G グローバルバランス2 5 V A ＜適格機関投資家限定＞	4,647,684円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	390,609円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 ＜適格機関投資家限定＞	249,273,647円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 ＜適格機関投資家限定＞	119,445,602円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	105,229,853円

(平成28年10月26日現在)	
合計	105,094,174,870円

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成28年10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	993,004,094
コール・ローン	807,614,922
国債証券	33,817,790,603
派生商品評価勘定	160,315,070
未収利息	236,015,842
前払費用	32,089,886
流動資産合計	36,046,830,417
資産合計	36,046,830,417
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	464,633,950
未払金	557,790,370
未払利息	2,072
その他未払費用	11,889
流動負債合計	1,022,438,281
負債合計	1,022,438,281
純資産の部	
元本等	
元本	24,677,312,308
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	10,347,079,828
元本等合計	35,024,392,136
純資産合計	35,024,392,136
負債純資産合計	36,046,830,417

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成28年 4月27日 至 平成28年10月26日
-----	--------------------------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年 4月26日現在)		(平成28年10月26日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	28,443,896,912口		24,677,312,308口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	1.3918円 13,918円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	1.4193円 14,193円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成28年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	38,759,226,510	-	38,213,710,000	545,516,510
	米ドル	16,389,166,200	-	16,216,504,000	172,662,200
	カナダドル	794,111,800	-	805,092,000	10,980,200
	メキシコペソ	394,938,180	-	384,930,000	10,008,180
	ユーロ	16,116,282,660	-	15,776,262,000	340,020,660
	英ポンド	3,026,066,800	-	3,021,912,000	4,154,800
	スイスフラン	81,757,200	-	79,702,000	2,055,200
	スウェーデンク ローナ	171,448,600	-	169,012,000	2,436,600
	ノルウェークロー ネ	121,951,800	-	121,590,000	361,800
	デンマーククロー ネ	251,841,870	-	246,960,000	4,881,870
	ポーランドズロチ	243,004,050	-	229,473,000	13,531,050
	オーストラリアドル	679,494,800	-	675,450,000	4,044,800
	シンガポールドル	316,004,200	-	311,638,000	4,366,200
	南アフリカランド	173,158,350	-	175,185,000	2,026,650
	合計		38,759,226,510	-	38,213,710,000

(平成28年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	34,197,950,120	-	34,502,269,000	304,318,880
	米ドル	14,642,828,050	-	15,046,785,000	403,956,950

カナダドル	709,946,500	-	717,416,000	7,469,500
メキシコペソ	281,049,500	-	303,501,000	22,451,500
ユーロ	14,112,254,800	-	14,039,109,000	73,145,800
英ポンド	2,578,358,960	-	2,496,581,000	81,777,960
スイスフラン	72,977,800	-	73,283,000	305,200
スウェーデンク ローナ	149,985,730	-	148,082,000	1,903,730
ノルウェークロー ネ	98,912,580	-	98,046,000	866,580
デンマーククロー ネ	233,738,100	-	233,019,000	719,100
ポーランドズロチ	203,795,900	-	201,894,000	1,901,900
オーストラリアドル	673,626,400	-	696,087,000	22,460,600
シンガポールドル	281,979,000	-	284,848,000	2,869,000
南アフリカランド	158,496,800	-	163,618,000	5,121,200
合計	34,197,950,120	-	34,502,269,000	304,318,880

## (注) 1. 時価の算定方法

## (1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (その他の注記)

(平成28年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	18,788,550,964円
同期中における追加設定元本額	19,329,357,560円
同期中における一部解約元本額	9,674,011,612円

平成28年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	4,699,301,222円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	3,800,933,413円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	2,824,867,699円
S M A M ・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,338,668,542円
S M A M ・バランスV A 株 4 0 T <適格機関投資家限定>	188,811,848円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	6,651,950,699円
S M A M ・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	3,587,481,324円
S M A M ・グローバル・マルチアセット・グロス・ファンド（安定成長型）<適格機関投資家限定>	796,470円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	2,266,011円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 1 <適格機関投資家限定>	1,348,819,684円
合計	28,443,896,912円

（平成28年10月26日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	28,443,896,912円
同期中における追加設定元本額	7,527,890,542円
同期中における一部解約元本額	11,294,475,146円
平成28年10月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	6,605,181,050円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,287,131,011円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	10,774,582円
イオン・バランス戦略ファンド	49,378,343円
S M A M ・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,348,792,851円
S M A M ・バランスV A 株 4 0 T <適格機関投資家限定>	172,568,541円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S（適格機関投資家専用）	5,501,263,142円
S M A M ・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	3,577,078,192円
S M A M ・グローバル・マルチアセット・グロス・ファンド（安定成長型）<適格機関投資家限定>	1,175,026円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	2,102,977円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 <適格機関投資家限定>	1,116,173,053円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 <適格機関投資家限定>	534,884,825円
S M A M ・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	470,808,715円
合計	24,677,312,308円

バンガード・米ドル建て新興国政府債券 E T F は、米国籍の上場外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

バンガード・米ドル建て新興国政府債券 E T F



## （純資産計算書）

区分	2015年10月31日現在
	金額（千米ドル）
債券	-
短期金融資産	-
投資総額	-
その他資産及び負債	-
純資産額	500,693

## （1口当たり情報）

（2015年10月31日現在）	
1口当たり純資産額	
（一般投資家クラス） 75.81米ドル	

i シェアーズ J . P . モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 E T F は、米国籍の上場外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

## i シェアーズ J . P . モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 E T F

## （純資産計算書）

区分	2015年10月31日現在
	金額（千米ドル）
債券	4,396,332
短期金融資産	7,532
投資総額	4,403,864
その他資産及び負債	60,578
純資産額	4,464,443

## （1口当たり情報）

（2015年10月31日現在）	
1口当たり純資産額	
（一般投資家クラス） 108.36米ドル	

S P D R バークレイズ・ハイ・イールド債券 E T F は、米国籍の上場外国投資信託で、現地での監査を受けております。

なお、以下の財務諸表は、入手しうる直近の現地監査済み財務諸表を委託会社において抜粋して翻訳したものです。

## S P D R バークレイズ・ハイ・イールド債券 E T F

## （純資産計算書）

区分	2016年6月30日現在
	金額（千米ドル）
債券	10,954,600
短期金融資産	927,826

投資総額	11,882,427
その他資産及び負債	644,145
純資産額	11,238,281

(1口当たり情報)

(2016年6月30日現在)
1口当たり純資産額 (一般投資家クラス) 35.28米ドル

## 2【ファンドの現況】

&lt;更新後&gt;

## 【純資産額計算書】

## アセットアロケーション・ファンド(安定型)

平成28年11月30日現在

資産総額	34,012,518,714円
負債総額	399,079,141円
純資産総額( - )	33,613,439,573円
発行済口数	34,575,564,697口
1口当たり純資産額( / )	0.9722円
(1万口当たり純資産額)	(9,722円)

## アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

平成28年11月30日現在

資産総額	23,204,632,240円
負債総額	539,734,554円
純資産総額( - )	22,664,897,686円
発行済口数	23,568,674,322口
1口当たり純資産額( / )	0.9617円
(1万口当たり純資産額)	(9,617円)

## アセットアロケーション・ファンド(成長型)

平成28年11月30日現在

資産総額	22,394,738,224円
負債総額	520,746,546円
純資産総額( - )	21,873,991,678円
発行済口数	22,917,317,280口
1口当たり純資産額( / )	0.9545円

(1万口当たり純資産額)	(9,545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】

<更新後>

###### イ 資本金の額および株式数

	平成28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

ロ 最近5年間における資本金の額の増減  
該当ありません。

###### ハ 会社の機構

委託会社の取締役は7名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

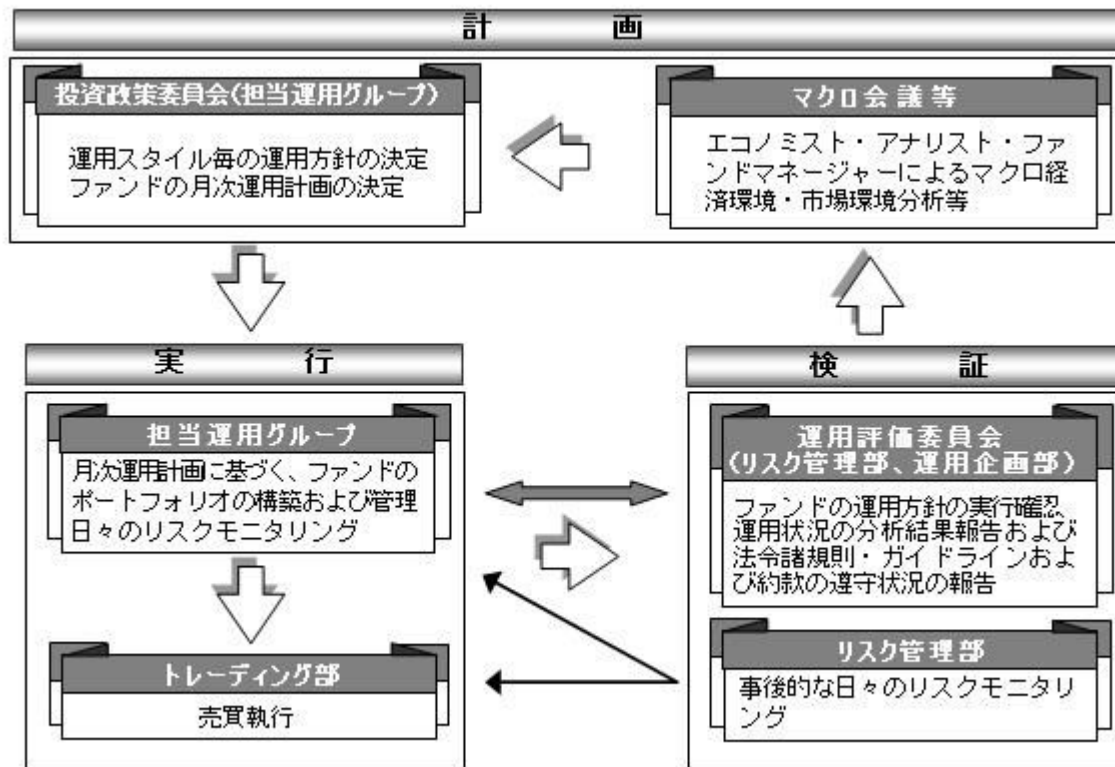
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定します。

###### ニ 投資信託の運用の流れ



## 2【事業の内容及び営業の概況】

### < 更新後 >

「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投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

平成28年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28年11月30日現在）

		本 数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単位型	62 ( 17 )	165,921 ( 66,962 )
	追加型	457 ( 193 )	5,058,907 ( 2,763,617 )
	計	519 ( 210 )	5,244,827 ( 2,830,579 )
公社債投資信託	単位型	79 ( 79 )	359,242 ( 359,242 )
	追加型	1 ( 0 )	26,661 ( 0 )
	計	80 ( 79 )	385,903 ( 359,242 )
合 計		599 ( 289 )	5,610,730 ( 3,189,821 )

（ ）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】

< 更新後 >

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

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2 当社は、第31期（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第32期中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

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

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

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
顧客からの預り金	-	0
その他の預り金	82,723	73,103
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	711	154
未払償還金	143,201	141,808
未払手数料	2,338,432	2,479,778
その他未払金	1,075,587	58,453
<b>未払費用</b>		
未払消費税等	2,095,111	2,092,669
未払法人税等	478,421	317,444
賞与引当金	454,520	992,491
賞与引当金	906,623	982,654
その他の流動負債	808	-
流動負債合計	7,576,142	7,138,557
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,633,080	3,028,212
賞与引当金	-	51,310
その他の固定負債	-	693
固定負債合計	2,633,080	3,080,216
負債合計	10,209,222	10,218,774
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,000	2,000,000
<b>資本剰余金</b>		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	284,245	284,245
<b>その他利益剰余金</b>		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	18,861,359	21,984,811
利益剰余金合計	20,682,564	23,806,015
株主資本計	31,311,548	34,434,999
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	634,478	517,775
評価・換算差額等合計	634,478	517,775
純資産合計	31,946,027	34,952,774
負債・純資産合計	42,155,249	45,171,549

## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：千円)

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



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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 満期保有目的の債券

## 償却原価法

## (2)子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

## (3)その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1)有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	3～20年

## (2)無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1)賞与引当金

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

## (2)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

## (貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

## 2 関係会社に対する資産及び負債

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

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

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

#### 4 保証債務

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

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

#### (損益計算書関係)

1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

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

#### 2 固定資産除却損

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

#### 3 その他の特別損失

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

#### (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

##### 1. 発行済株式数に関する事項

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

##### 2. 剰余金の配当に関する事項

###### (1) 配当金支払額等

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

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

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

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

2.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

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

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

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

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

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

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

### (3)金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスクの管理

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

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

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

#### 市場リスクの管理

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

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

### (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

## (注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

負 債

(1)顧客からの預り金、(2)未払手数料

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

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

(単位：千円)

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

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

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

## (注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成27年3月31日）

(単位：千円)

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

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

2. その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券



前事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

(単位：千円)

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

当事業年度(自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)

(単位：千円)

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

(退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

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

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

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

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

#### (セグメント情報等)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

##### 1. セグメント情報

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

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

##### 2. 関連情報

###### (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

###### (2) 地域ごとの情報

###### 売上高

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

###### 有形固定資産

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

###### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

##### 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

(単位：千円)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2. 子会社及び関連会社等

(単位：千円)

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

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

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

## 3. その他の関係会社の子会社等

(単位：千円)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

(単位：千円)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2. 兄弟会社等

(単位：千円)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (1株当たり情報)

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

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

りません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

### (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

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

未払金		2,578,503
未払費用		1,682,389
未払法人税等		686,618
前受収益		414
賞与引当金		1,044,361
その他	2	125,455
流動負債合計		6,197,805
固定負債		
退職給付引当金		3,116,174
賞与引当金		30,000
その他		480
固定負債合計		3,146,654
負債合計		9,344,459
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
資本剰余金合計		8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		60,000
別途積立金		1,476,959
繰越利益剰余金		21,442,639
利益剰余金合計		23,263,844
株主資本合計		33,892,828
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		233,389
評価・換算差額等合計		233,389
純資産合計		34,126,217
負債純資産合計		43,470,677

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

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

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

（単位：千円）

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

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

## （重要な会計方針）

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## (1) 有価証券



満期保有目的の債券  
償却原価法

子会社株式及び関連会社株式  
移動平均法による原価法

その他有価証券  
時価のあるもの  
中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法  
（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）  
時価のないもの  
移動平均法による原価法

## 2．固定資産の減価償却の方法

### (1)有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	3～20年

### (2)無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3．引当金の計上基準

### (1)賞与引当金

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

### (2)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

### （会計方針の変更）

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

この結果、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ729千円増加しております。

## （追加情報）

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

## （中間貸借対照表関係）

第32期中間会計期間 (平成28年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,094,757千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。	当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。
	当座借越極度額の総額 10,000,000千円
	借入実行残高 -
	差引額 10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年6月までの賃借料総額248,465千円の支払保証を行っております。	

## （中間損益計算書関係）

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

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

## 1.発行済株式数に関する事項

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

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

## (リース取引関係)

第32期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
1. オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	606,895千円
1年超	785,123千円
合 計	1,392,018千円

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

第32期中間会計期間(平成28年9月30日)

平成28年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。  
なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

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

## (注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## 資 産

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

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

- (6)投資有価証券  
    其他有価証券

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

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

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

#### (7) 投資その他の資産

##### 長期差入保証金

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

#### 負債

##### (1) 顧客からの預り金、及び(2) 未払金 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	298
合計	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523
合計	10,412,523

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

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

(有価証券関係)

第32期中間会計期間(平成28年9月30日)

##### 1. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

##### 2. 子会社株式及び関連会社株式

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

##### 3. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	5,237,120	4,771,627	465,493
小計	5,237,120	4,771,627	465,493
(2) 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	8,694,298	8,823,400	129,101
小計	8,694,298	8,823,400	129,101

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

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

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(資産除去債務等)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第32期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	15,185,419	2,663,858	869,344	63,406	18,782,028

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

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

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎

中間貸借対照表の純資産の部の合計額	34,126,217千円
普通株式に係る純資産額	34,126,217千円
普通株式の発行済株式数	17,640株
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640株

1株当たり中間純利益の算定上の基礎

中間損益計算書上の中間純利益	1,468,788千円
普通株式に係る中間純利益	1,468,788千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	17,640株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 5【その他】

<更新後>

イ 定款の変更、その他の重要事項

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

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

## 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】

<更新後>

イ 受託会社

(イ) 名称	三井住友信託銀行株式会社
(ロ) 資本金の額	342,037百万円(平成28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28年9月末現在)
・ 事業の内容	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	47,937百万円	
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社 栃木銀行	27,408百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社 福岡中央銀行	2,500百万円	

資本金の額は、平成28年9月末現在。

### 第3【その他】

<更新後>

- 目論見書の表紙等にロゴ・マーク、写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用すること、ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマーク、委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該目論見書の使用開始日などを記載することがあります。
- 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。
- 目論見書に当ファンドの信託約款を掲載すること、および投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- 目論見書は、電子媒体等として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。
- 有価証券届出書の表紙記載情報を抜粋して、目論見書に記載することがあります。
- 目論見書の冒頭または巻末に届出書記載内容に関連する用語集を掲載することがあります。
- 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
- 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。このため、有価証券届出書に他のファンドの情報を合わせて記載することがあります。
- 当ファンドとスイッチング対象ファンドにかかる投資信託説明書（交付目論見書）を一体のものとして使用することがあります。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月6日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽 一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定型）の平成28年4月27日から平成28年10月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（安定型）の平成28年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年4月27日から平成28年10月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)



## 独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月6日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽 一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の平成28年4月27日から平成28年10月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の平成28年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年4月27日から平成28年10月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月6日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽 一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（成長型）の平成28年4月27日から平成28年10月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（成長型）の平成28年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年4月27日から平成28年10月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

**独立監査人の監査報告書**

平成28年 6月17日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽 一 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 池ヶ谷 正 印

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**監査意見**

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

**利害関係**

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

以 上

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

**独立監査人の中間監査報告書**

平成28年11月24日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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