

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成22年 2 月19日
【計算期間】	第 8 期（自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日）
【ファンド名】	大和住銀 D C 年金設計ファンド 3 0 大和住銀 D C 年金設計ファンド 5 0 大和住銀 D C 年金設計ファンド 7 0
【発行者名】	大和住銀投信投資顧問株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 大村 信明
【本店の所在の場所】	東京都千代田区霞が関三丁目 2 番 1 号
【事務連絡者氏名】	宮崎 洋行
【連絡場所】	ディスクロージャー部
【電話番号】	03-6205-0200
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて世界各国の株式および公社債へバランス運用を行うことにより、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

ファンドの基本的性格

当ファンドにおける社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は以下の通りです。

< 商品分類表 >

大和住銀DC年金設計ファンド30

大和住銀DC年金設計ファンド50

大和住銀DC年金設計ファンド70

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式
	海外	債券
		不動産投信
追加型	内外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類表の各項目の定義について

追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

資産複合...目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

上記以外の各区分の定義の詳細については、社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

< 属性区分表 >

大和住銀ＤＣ年金設計ファンド３０

大和住銀ＤＣ年金設計ファンド５０

大和住銀ＤＣ年金設計ファンド７０

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年１回	グローバル (日本を含む)		
	年２回	日本		
	年４回	北米	ファミリーファンド	あり ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年６回 (隔月)	欧州		
	年１２回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式、債券)、 資産配分固定 型))		アフリカ		
		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

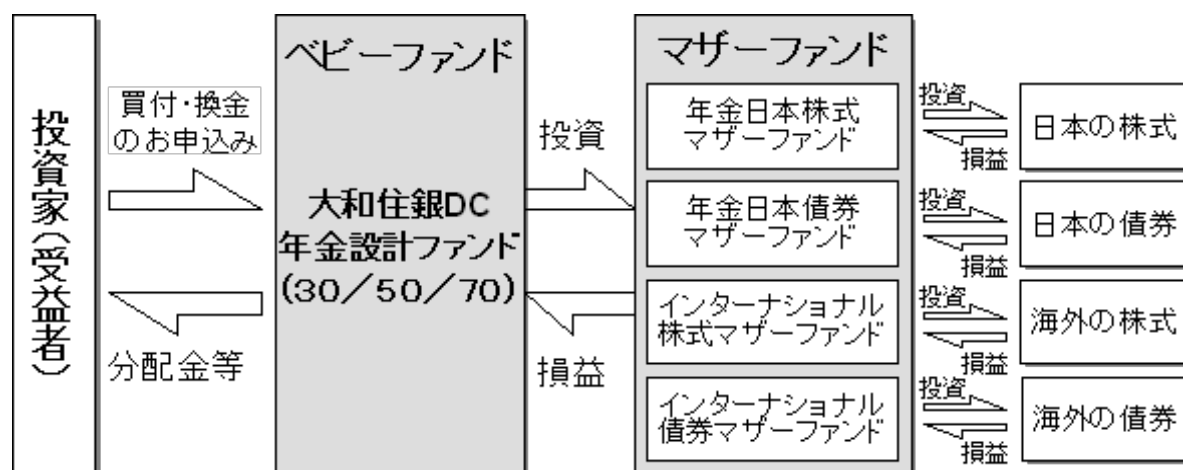
属性区分表の各項目の定義について

その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）、資産配分固定型））

...目論見書又は投資信託約款において、投資信託証券（マザーファンド）
を通じて実質的に複数資産（株式、債券）を投資対象とし、組入比率に
ついては固定的とする旨の記載があるものをいいます。年１回...目論見書又は投資信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをい
います。グローバル（日本を含む）...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資
収益が世界の資産（日本を含む）を源泉とする旨の記載
があるものをいいます。ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オ
ブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として
投資するものをいいます。為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の
記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをい
います。上記以外の各区分の定義の詳細については、社団法人投資信託協会のホームページ（
<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

ファンドの特色

イ．主として国内株式、国内債券、海外株式、海外債券へ分散投資を行う各マザーファンドへ投資を行うことにより、リスクの低減を図りつつ、信託財産の中長期的な成長を目指します。



年金日本株式マザーファンド、年金日本債券マザーファンド、インターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンドを主要投資対象とします。なお、株式・公社債等に直接投資することがあります。

ロ．資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

< 基本資産配分 >

資産	国内株式	国内債券	海外株式	海外債券
対象マザーファンド	年金日本株式マザーファンド	年金日本債券マザーファンド	インターナショナル株式マザーファンド	インターナショナル債券マザーファンド
年金設計30	25%	60%	5%	10%
年金設計50	35%	40%	15%	10%
年金設計70	50%	20%	20%	10%

資産配分は、基本資産配分より、原則としてそれぞれ±5%の範囲内で行います。

ハ．海外資産の運用は、T・ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドが行います。

インターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンドにおける運用指図にかかる権限をT・ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドへ委託します。

＜Ｔ．ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドの
概要＞

同社（所在地：英国ロンドン）は、米国Ｔ．ロウ・プライス・グループの運用会社です。同グループの代表的な会社であるＴ．ロウ・プライス・アソシエイツ・インクは、1937年に設立された会社で、グローバルに資産運用業務を行っております。Ｔ．ロウ・プライス・アソシエイツ・インクおよびＴ．ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドの親会社であるＴ．ロウ・プライス・グループ・インクは、米国の上場会社であり、また、Ｓ＆Ｐ５００インデックスの採用銘柄です。Ｔ．ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドは、Ｔ．ロウ・プライス・グループの運用技術および調査能力を活用することができます。

ニ．実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

ホ．各マザーファンドの運用は、各資産のベンチマーク（下記参照）を中長期的に上回る投資成果を目指して運用を行います。

資産	ベンチマーク
国内株式 （年金日本株式マザーファンド）	ＴＯＰＩＸ（東証株価指数・配当込み）
国内債券 （年金日本債券マザーファンド）	ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合
海外株式 （インターナショナル株式マザーファンド）	ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算）
海外債券 （インターナショナル債券マザーファンド）	シティグループ世界国債インデックス （除く日本、円換算）

ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）は、東証市場第一部の時価総額の動きをあらわす株価指数であり、株式会社東京証券取引所が算出、公表を行っています。ＴＯＰＩＸは東証市場第一部に上場しているすべての銘柄を計算の対象としており、東証市場第一部の時価総額を基準時価総額（昭和43年1月4日における東証市場第一部全銘柄の時価総額を100とする。）で除して算出されます。有償増資、新規上場や上場廃止など、市況変動以外の要因で時価総額が変動する場合には、連続性を維持するために、基準時価総額がその都度修正されます。

ＴＯＰＩＸは、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。

株式会社東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの算出もしくは公表の方法の変更、ＴＯＰＩＸの算出もしくは公表の停止、またはＴＯＰＩＸの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

NOMURA - BPI 総合は、野村證券株式会社が公表している債券指数で、野村證券株式会社の知的財産です。当該指数に関する一切の知的財産権とその他の一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、野村證券株式会社は当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

MSCI コクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、平成21年12月末時点で日本を除く世界22カ国で構成されています。MSCI インデックスに関する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属しており、その許諾なしにコピーを含め電子的、機械的な一切の手段その他、あらゆる形態を用い、インデックスの全部または一部を複製、配付、使用することは禁じられています。またこれらの情報は信頼のおける情報源から得たものでありますが、その確実性および完結性をMSCI Inc.は何ら保証するものではありません。MSCI コクサイ・インデックス（円換算）とは、米ドルベースのMSCI コクサイ・インデックスを委託会社が円換算したものです。

■ ベンチマーク構成国（2009年12月末現在）

オーストラリア、オーストリア、ベルギー、カナダ、デンマーク、フィンランド、フランス、ドイツ、香港、アイルランド、イタリア、オランダ、ニュージーランド、ノルウェー、アメリカ、ポルトガル、シンガポール、スペイン、スウェーデン、スイス、イギリス、ギリシャ

（注1）ベンチマーク構成国以外の国の株式へ投資する場合があります。

（注2）ベンチマーク構成国は今後変更になる場合があります。

シティグループ世界国債インデックス（除く日本）とは、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した債券指数で、平成21年12月末時点で世界22カ国で構成されています。同指数に関する著作権等の知的財産権およびその他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクは同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算）とは、米ドルベースのシティグループ世界国債インデックス（除く日本）を委託会社が円換算したものです。

■ ベンチマーク構成国（2009年12月末現在）

アメリカ、カナダ、オーストラリア、オーストリア、ベルギー、デンマーク、フィンランド、フランス、ドイツ、アイルランド、イタリア、オランダ、ポルトガル、スペイン、スウェーデン、スイス、イギリス、ギリシャ、ポーランド、ノルウェー、シンガポール、マレーシア

（注1）ベンチマーク構成国以外の国の債券へ投資する場合があります。

（注2）ベンチマーク構成国は今後変更になる場合があります。

へ、資金動向、市況動向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。

（参考）マザーファンドの特色

1 年金日本株式マザーファンド

- (1) わが国の株式を主要投資対象とし、ファンダメンタル価値比割安性（バリュエーション）を重視し、収益性・成長性を勘案したアクティブ運用により信託財産の長期的な成長を目指します。
- (2) T O P I X（東証株価指数）をベンチマークとし、バリュエーション・アプローチを基本としたアクティブ運用により中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。

● 銘柄選択

「バリュエーション比較」と「ファンダメンタル判断」の組み合わせで銘柄選択をします。銘柄選定に関しては、バリュエーション銘柄に重点をおき、ファンダメンタル価値対比の割高／割安判断を業種・規模毎に行います。

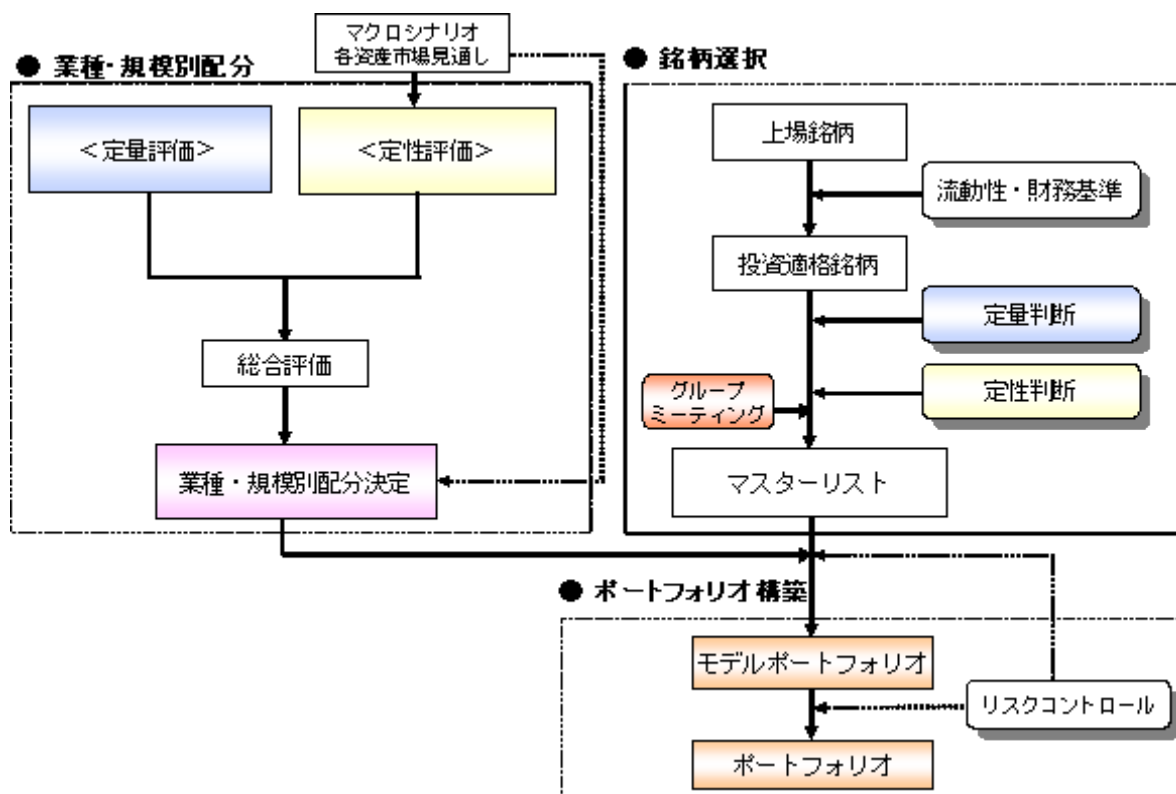
● 業種規模別配分

トップダウンアプローチとアナリスト等によるボトムアップを融合することで業種配分等を決定します。

● リスクコントロール

ベンチマーク特性との乖離および組み入れ制限の管理等

< 銘柄選択及びポートフォリオ構築プロセス >



2 年金日本債券マザーファンド

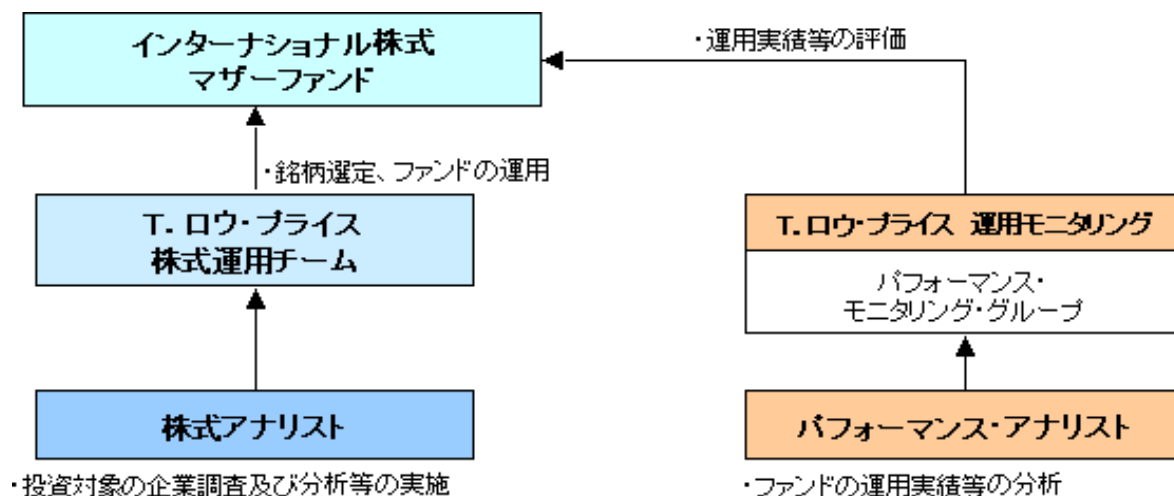
- (1) わが国の公社債を主要投資対象とし、金利予測（デュレーション・コントロール等）等を重視したアクティブ運用により信託財産の長期的な成長を目指します。
- (2) NOMURA - BPI 総合をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。
 - デュレーション、残存期間別構成の決定
マクロ分析等に基づき、金利およびイールドカーブの予測を行い、デュレーションおよび残存期間別構成比率を決定します。
 - 債券の種類別比率の決定
債券種別による収益予測（スプレッド予測）と社内のクレジットアナリストグループによるクレジット分析等に基づいて、債券種別構成比の決定をします。
 - 銘柄選択
個別銘柄の割安・割高分析により、割安な銘柄を選択します。
 - リスクコントロール
ベンチマーク特性との乖離および組入銘柄の信用リスクをチェックします。

3 インターナショナル株式マザーファンド

- (1) 海外の株式へ分散投資を行い、リスクの低減とグローバルな投資機会の獲得により信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
- (2) MSCI コクサイ・インデックス（円換算）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。また、ベンチマーク構成国の株式以外へ投資を行うこともあります。
- (3) 運用の指図に関する権限をT・ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービス・リミテッドに委託します。
- (4) 投資プロセス
 - 銘柄選択およびポートフォリオ構築プロセス
 - 個々の企業の経営戦略、業績予想等のファンダメンタル分析およびバリュエーションを考慮し、ボトムアップ・アプローチにより、以下の2つの観点から銘柄を選択します。
 - ・ 地域固有の要因に基づく「地域（国）別銘柄選択」
 - ・ グローバルな視点に基づく「セクター別銘柄選択」
 - 運用チームにおいて、上記の2つのプロセスで選定された銘柄の検討を行い組入銘柄の決定を行います。
 - 各国のマクロ経済分析とセクター動向分析との整合性を勘案し、国別配分（カンントリー・アロケーション）・セクターアロケーションの調整等を行い、最終的にポートフォリオを構築します。
 - リスクコントロール
幅広く分散投資を行うことによりリスクの低減を図ります。

< 運用体制 >

T. ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドの運用体制は以下の通りです。



* 運用体制は今後変更になることがあります。

4 インターナショナル債券マザーファンド

- (1) 海外の公社債へ分散投資を行い、リスクの低減とグローバルな投資機会の獲得により信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
- (2) シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。
- (3) 債券と為替の運用に関しては、異なる資産としてそれぞれ独立した運用を行い、世界債券および通貨の分散投資を図ります。
- (4) 運用の指図に関する権限をT. ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドに委託します。

● 国別・通貨別配分

各国市場のマクロ分析を基に金利・為替見通し、相対的魅力度を策定し、十分分散効果が働くような国別・通貨別配分をそれぞれ決定します。

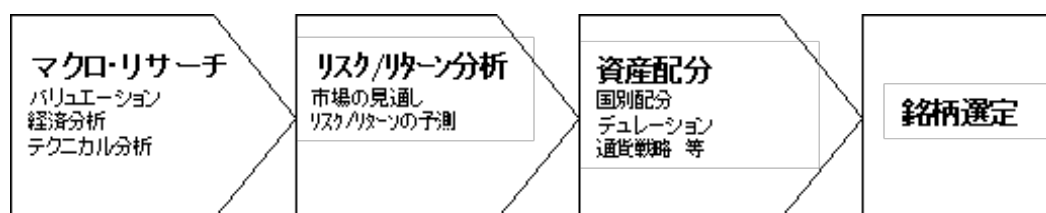
● 銘柄選択

T. ロウ・プライス・グループにおける調査能力を活用し、個別銘柄を選択します。

● リスクコントロール

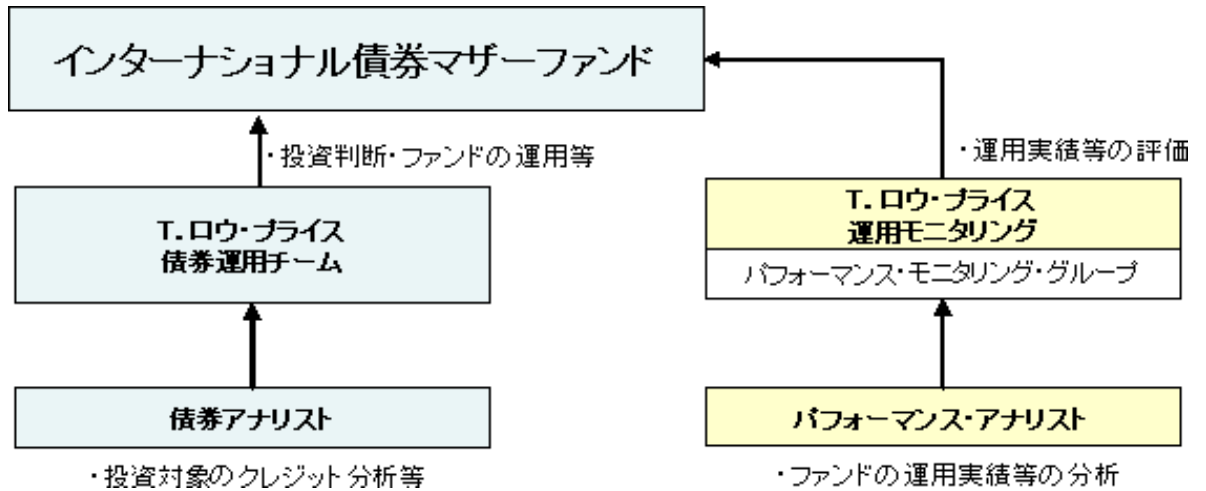
構築されたポートフォリオにおけるベンチマークに対する予想変動率等のリスクを随時把握します。リスクは金利リスクと為替リスクに分離して把握します。

< 運用プロセス >



< 運用体制 >

T．ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドの運用体制は以下の通りです。

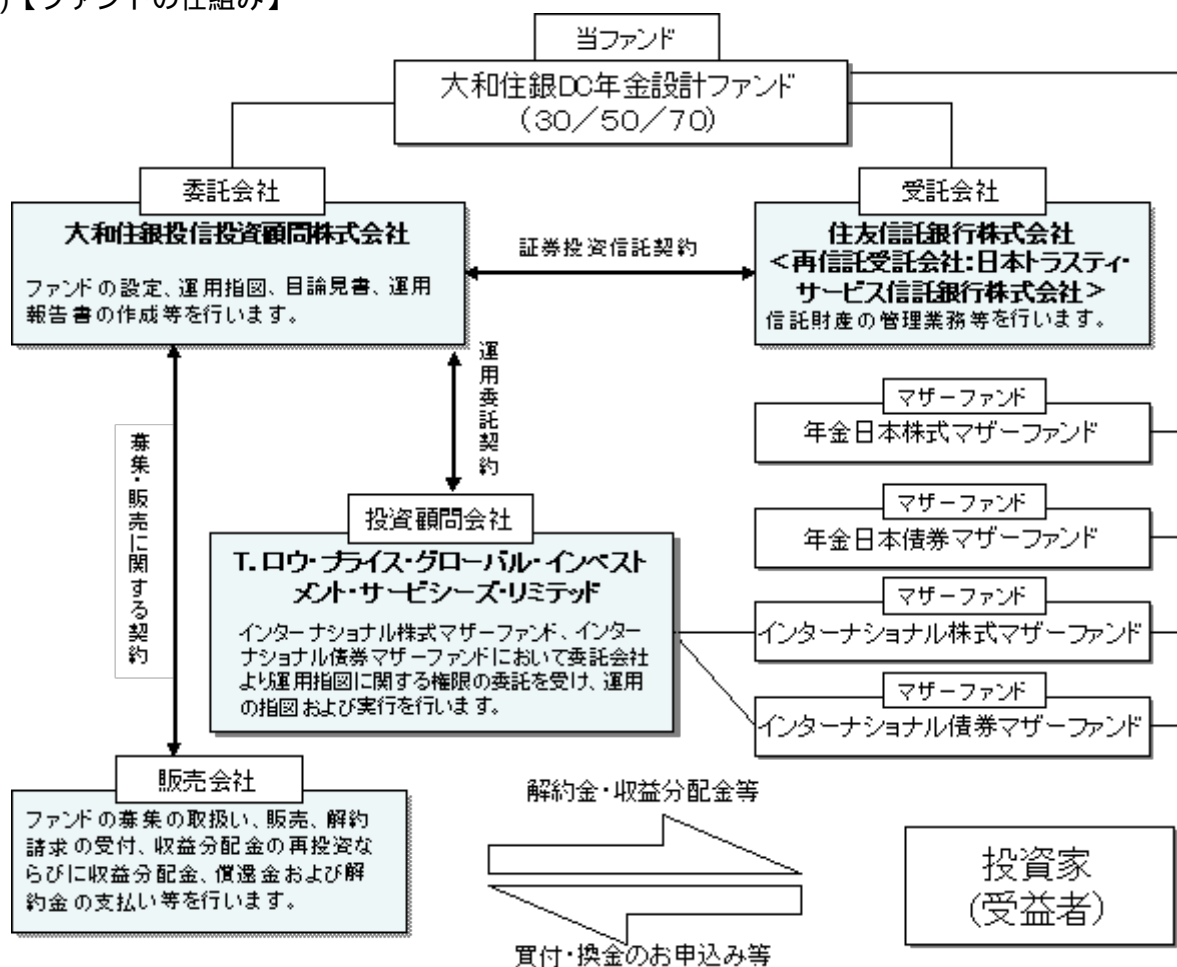


* 運用体制は今後変更になることがあります。

信託金の限度額

信託金の限度額は、各ファンドにつき1兆円とします。委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

(2)【ファンドの仕組み】



委託会社等が関係法人と締結している契約等の概要

関係法人	契約等の概要
受託会社	ファンドの運用方針、投資制限、信託報酬の総額、ファンドの基準価額の算出方法、ファンドの設定・解約等のファンドの運営上必要な事項が規定されている信託契約を締結しています。
販売会社	販売会社に委託するファンドの募集・販売に係る業務の内容、解約に係る事務の内容、およびこれらに関する手続き等について規定した契約を締結しています。
投資顧問会社	インターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンドの運用指図に関する権限等を規定した運用委託契約（投資一任契約）を締結しています。

委託会社等の概況（平成22年2月19日現在）

- ・ 名称 大和住銀投信投資顧問株式会社
- ・ 代表者の役職氏名 代表取締役社長 大村 信明
- ・ 本店の所在の場所 東京都千代田区霞が関三丁目2番1号
- ・ 資本金の額 20億円
- ・ 会社の沿革 昭和48年6月 大和投資顧問株式会社設立

平成11年 2 月 証券投資信託委託業の認可取得

平成11年 4 月 住銀投資顧問株式会社及びエス・ビー・アイ・エム投信株式会社と合併し、大和住銀投信投資顧問株式会社へ商号を変更

・大株主の状況

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内1-9-1 グラントウキョウ ノースタワー	1,692,500	44.0
株式会社三井住友フィナンシャル グループ	東京都千代田区有楽町1-1-2	1,692,500	44.0
ティー・アール・ピー・ エイチ・コーポレーション	アメリカ合衆国21202,メリーランド州ボルチモア イースト プラットストリート100	385,000	10.0

2【投資方針】

(1)【投資方針】

主として、国内株式、国内債券、海外株式、海外債券へ分散投資を行う各マザーファンドへ投資を行うことにより、リスクの低減を図りつつ、信託財産の中長期的な成長を目指します。

年金日本株式マザーファンド、年金日本債券マザーファンド、インターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンドを主要投資対象とします。なお、株式・公社債等に直接投資することがあります。

各資産（マザーファンド）への基本的な投資比率（「基本資産配分」）は、以下の通りです。投資期間やリスクに応じて、資産配分の異なる3つのファンドからご選択いただけます。

資産	国内株式	国内債券	海外株式	海外債券
対象マザー ファンド	年金日本株式 マザーファンド	年金日本債券 マザーファンド	インターナショナル 株式マザーファン ド	インターナショナル 債券マザーファン ド
年金設計30	25%	60%	5%	10%
年金設計50	35%	40%	15%	10%
年金設計70	50%	20%	20%	10%

* 資産配分は、基本資産配分より、原則としてそれぞれ±5%の範囲内で行います。

	株式の実質組入比率の上限	外貨建資産の実質組入比率の上限
年金設計30	40%	25%
年金設計50	60%	35%
年金設計70	80%	40%

実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

資金動向、市況動向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。

（２）【投資対象】

投資対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

１．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、信託約款に定めるものに限りま。

ハ．金銭債権

ニ．約束手形（金融商品取引法第２条第１項第15号に掲げるものを除きます。）

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

運用の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として大和住銀投信投資顧問株式会社を委託会社とし、住友信託銀行株式会社を受託会社として締結された年金日本株式マザーファンド、年金日本債券マザーファンド、インターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）ならびに次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．株券または新株引受権証券

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

６．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）

７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）

８．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）

９．特別目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金

融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

17．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

18．外国法人が発行する譲渡性預金証書

19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

20．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22．外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、1の証券または証書、12ならびに17の証券または証書のうち1の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2から6までの証券および12ならびに17の証券または証書のうち2から6までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13の証券および14の証券を以下「投資信託証券」といいます。

その他の金融商品の運用の指図

委託会社は、信託金を、前記の有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1．預金

2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

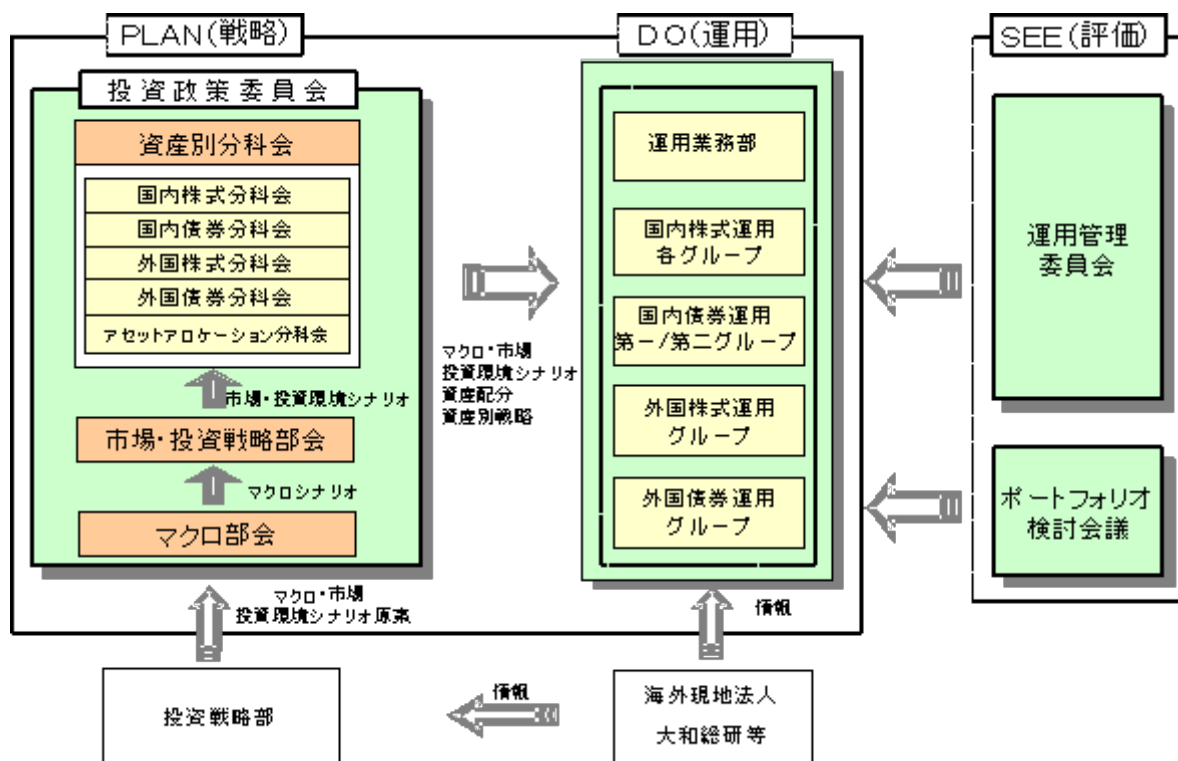
3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

- 5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

また、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、主として前記の1から6までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（3）【運用体制】



- * 当ファンドの運用体制に係る運用本部の人員数は、平成21年12月末現在で約100名です。
- * 運用体制および人員数は、今後変更になる場合があります。
- * 運用リスク管理体制についての詳細は、後述の「3 投資リスク<リスクに関する管理体制>」に記載しております。
- * 当社は、社内業務規程等でファンドの運用におけるファンドマネージャーの権限および責任、また信託財産の適正な運用とリスク管理を行うことを目的として運用に関する基本的事項を定めております。

（４）【分配方針】

毎決算時（毎年11月19日。ただし、休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

イ．分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。

ロ．収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額な場合には分配を行わないことがあります。

ハ．留保益の運用については特に制限を設けず、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。

信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

イ．配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積立てることができます。

ロ．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下、「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、分配準備積立金として積立てることができます。

ハ．毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払いは、次の方法により行います。

イ．収益分配金は、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に支払います。なお、信託約款に規定する時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。

収益分配金の支払いは、原則として決算日から起算して５営業日までに開始します。

ロ．前項の規定にかかわらず、販売会社との間で締結した累積投資約款に基づく契約により収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社へ交付されます。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。当該売付けにより増加した受益権は、信託約款の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。収益分配金を再投

資する場合の受益権の価額は、原則として、信託約款に定める各計算期間終了日（決算日）の基準価額とします。

ハ．上記イ．に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

（５）【投資制限】

当ファンドは、委託会社による当ファンドの運用に関して以下のような一定の制限および限度を定めています。

信託約款に定める投資制限

イ．株式等への投資制限

（イ）委託会社は、取得時において信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドに属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、下記の割合を超えることとなる投資の指図をしません。

- 大和住銀ＤＣ年金設計ファンド３０……………信託財産の純資産総額の１００分の４０
- 大和住銀ＤＣ年金設計ファンド５０……………信託財産の純資産総額の１００分の６０
- 大和住銀ＤＣ年金設計ファンド７０……………信託財産の純資産総額の１００分の８０

* 信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。以下同じです。

（ロ）委託会社は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の１００分の３０を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場（上場予定を含みます。）されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

金融商品取引法第２条第１６項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じです。

（ロ）前記にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ハ．同一銘柄の株式等への投資制限

(イ)委託会社は、取得時において信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

(ロ)委託会社は、取得時において信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

二．投資信託証券への投資制限

委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドを除きます。）の時価総額とマザーファンドに属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

ホ．信用取引の運用指図

(イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(ロ)前項の信用取引の指図は、当該売付にかかる建玉の時価総額とマザーファンドに属する当該売付にかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ)信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付にかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

ヘ．先物取引等の運用指図

(イ)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。

(ロ)委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

(ハ)委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ト．スワップ取引の運用指図

(イ)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下、「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

(ロ)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(ハ)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

(ニ)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

チ．金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図

(イ)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

(ロ)金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(ハ)金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市

場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

(二)委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

- (ホ)金利先渡取引とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (ヘ)為替先渡取引とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本項において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本項において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

リ．同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債等への投資制限

委託会社は、取得時において信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

ヌ．有価証券の貸付の指図および範囲

(イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

- a．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- b．公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で

保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

(ロ)前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(ハ)委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ル．公社債の空売りの指図

(イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けるとの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(ロ)前項の売付の指図は、当該売付にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ)信託財産の一部解約等の事由により、前項の売付にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

ヲ．公社債の借入れ

(イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認められたときは、担保の提供の指図を行うことができます。

(ロ)前項の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ)信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

(二)上記(イ)の借入れにかかる品借料は信託財産から支弁するものとします。

ワ．外貨建資産への投資制限および特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

委託会社は、取得時において信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドに属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、下記の割合を超えることとなる投資の指図をしません。

□大和住銀DC年金設計ファンド30.....信託財産の純資産総額の100分の25

- 大和住銀DC年金設計ファンド50.....信託財産の純資産総額の100分の35
- 大和住銀DC年金設計ファンド70.....信託財産の純資産総額の100分の40

なお、外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

カ．外国為替予約の指図および範囲

(イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

(ロ)前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

(ハ)前項の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

コ．資金の借入れ

(イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(ロ)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%の範囲内とします。

(ハ)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(ニ)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

ク．受託会社による資金の立替え

(イ)信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株主割当がある場合で、委託会社の申し出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。

(ロ)信託財産に属する有価証券にかかる償還金等、株式の清算分配金、有価証券等にかかる利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

(ハ)上記(イ)および(ロ)の立替金の決済および利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

法令による投資制限

デリバティブ取引等に係る投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令）

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産総額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引等（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

[次へ](#)

（参考）マザーファンドの投資方針

年金日本株式マザーファンドの信託約款の運用の基本方針の概要

（１）運用の基本方針

当ファンドは、わが国の株式へ投資を行うことにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

（２）運用方法

投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．ＴＯＰＩＸ（東証株価指数・配当込み）をベンチマークとし、バリュー・アプローチを基本としたアクティブ運用により中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。
- ロ．マクロ経済動向および産業動向等の分析により、業種・規模別配分等を行います。
- ハ．資金動向、市況動向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。

（３）運用の指図

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- １．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、信託約款に定めるものに限りません。）
 - ハ．金銭債権
- 二．約束手形（金融商品取引法第２条第１項第15号に掲げるものを除きます。）
- ２．次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- １．株券又は新株引受権証券
- ２．国債証券
- ３．地方債証券
- ４．特別の法律により法人の発行する債券
- ５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、転換社債型新株予約権付社債に限りません。）
- ６．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
- ７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
- ８．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
- ９．特別目的会社にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
- １０．コマーシャル・ペーパー
- １１．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）

および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前各号の証券の性質を有するもの
13. 証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、ます。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、ます。）
19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、1の証券または証書、12ならびに17の証券または証書のうち1の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2から6までの証券および12ならびに17の証券または証書のうち2から6までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13の証券および14の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前記の有価証券の他、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

前記にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、主として前記1から5までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(4) 主な投資制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託

財産の純資産総額の10%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
- ロ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

[次へ](#)

（参考）マザーファンドの投資方針
年金日本債券マザーファンドの信託約款の運用の基本方針の概要

（１）運用の基本方針

当ファンドは、わが国の公社債へ投資を行うことにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

（２）運用方法

投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．NOMURA - BPI 総合をベンチマークとし、デュレーション・コントロールを重視したアクティブ運用により中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。
- ロ．資金動向、市況動向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。

（３）運用の指図

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- １．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、信託約款に定めるものに限ります。）
 - ハ．金銭債権
 - ニ．約束手形（金融商品取引法第２条第１項第15号に掲げるものを除きます。）
- ２．次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- １．国債証券
- ２．地方債証券
- ３．特別の法律により法人の発行する債券
- ４．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、転換社債型新株予約権付社債に限り、新株予約権行使により取得した株券）
- ５．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
- ６．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
- ７．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
- ８．特別目的会社にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
- ９．転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使により取得した株券
- １０．コマーシャル・ペーパー
- １１．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前各号の証券の性質を有するもの
- １２．証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）

す。)

13. 投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
14. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
15. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、ます。）
16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
17. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、ます。）
18. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
19. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、9の証券または証書、11ならびに16の証券または証書のうち9の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、1から5までの証券および11ならびに16の証券または証書のうち1から5までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、12の証券および13の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前記 の有価証券の他、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

前記 にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、主として前記 1から5までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(4) 主な投資制限

株式への投資割合には、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使により取得したものに限り、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は、以下の範囲で行います。

- イ. 委託会社は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれ

らの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。

- ロ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

[前へ](#) [次へ](#)

（参考）マザーファンドの投資方針

インターナショナル株式マザーファンドの信託約款の運用の基本方針の概要

（１）運用の基本方針

当ファンドは、世界各国の株式へ投資することにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

（２）運用方法

投資対象

世界各国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．MSCIコクサイ・インデックス（円換算）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。
- ロ．運用の指図に関する権限をＴ．ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドに委託します。
- ハ．国別資産配分に関しては、各国の経済成長率、金利、為替レート、金融政策、資金需給や各市場間の企業の相対的魅力度分析により決定されます。
- ニ．銘柄選択については、個々の企業の経営戦略、業績予想等のファンダメンタル分析およびバリュエーションを考慮し、ボトムアップ・アプローチにより行います。
- ホ．外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ヘ．資金動向、市況動向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。

（３）運用の指図

委託会社（委託会社より運用の指図にかかる権限を委託されたものを含みます。）は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- １．株券または新株引受権証券
- ２．国債証券
- ３．地方債証券
- ４．特別の法律により法人の発行する債券
- ５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- ６．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
- ７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
- ８．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
- ９．特別目的会社にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
- １０．コマーシャル・ペーパー
- １１．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- １２．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- １３．証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第１０号

- で定めるものをいいます。)
14. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、ます。)
 17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、ます。)
 20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、1の証券または証書、12ならびに17の証券または証書のうち1の証券または証書の性質を有するものおよび14の証券のうちクローズド・エンド型のものを以下「株式」といい、2から6までの証券および12ならびに17の証券または証書のうち2から6までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13の証券および14の証券のうちクローズド・エンド型以外のものを以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前記の有価証券の他、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

前記にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、主として前記1から6までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(4) 主な投資制限

株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託

財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
- ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

[前へ](#) [次へ](#)

（参考）マザーファンドの投資方針

インターナショナル債券マザーファンドの信託約款の運用の基本方針の概要

（１）運用の基本方針

当ファンドは、日本を除く世界各国の公社債を中心に投資することにより、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

（２）運用方法

投資対象

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。
- ロ．債券と為替の運用に関しては、異なる資産としてそれぞれ独立した運用を行い、世界債券および通貨の分散投資を図ります。
- ハ．運用の指図に関する権限をＴ．ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドに委託します。
- ニ．外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ホ．資金動向、市況動向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。

（３）運用の指図

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- １．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、信託約款に定めるものに限りま。
 - ハ．金銭債権
 - ニ．約束手形（金融商品取引法第２条第１項第15号に掲げるものを除きます。）
- ２．次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

委託会社（委託会社より運用の指図にかかる権限を委託されたものを含みます。）は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- １．国債証券
- ２．地方債証券
- ３．特別の法律により法人の発行する債券
- ４．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、転換社債型新株予約権付社債に限りま。
- ５．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
- ６．転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使により取得した株券
- ７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）

8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．特別目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）および新株予約権証券

12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14．投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

17．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

18．外国法人が発行する譲渡性預金証書

19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

20．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22．外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、6の証券または証書、12ならびに17の証券または証書のうち6の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、1から5までの証券および12ならびに17の証券または証書のうち1から5までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13の証券および14の証券を「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前記の有価証券の他、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1．預金

2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

前記にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、主として前記1から6までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（4）主な投資制限

株式への投資割合には、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使

により取得したものに限り、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
- ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引は、以下の範囲で行います。

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託約款に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

[前へ](#)

3【投資リスク】

<当ファンドの有するリスク>

- 当ファンドは、マザーファンドを通じて、実質的に株式、債券など値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。また、外貨建資産は、為替の変動による影響も受けます。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割り込むことがあります。
- 信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。
- 当ファンドの投資目的は確実に達成されるものではなく、元本および元本からの収益を確保する保証はありません。
- 投資家の皆様におかれましては、当ファンドの内容とリスクを十分ご理解のうえお申込みくださいますよう、よろしくお願いいたします。

<当ファンドの主なリスク>

基準価額を変動させる主なリスクは次のとおりです。ただし、以下の説明はすべてのリスクを表したものではありません。

(1) 価格変動リスク

当ファンドは、マザーファンドを通じて、実質的に株式、債券等の値動きのある有価証券等に投資します。実質的な投資対象である有価証券等の価格が下落した場合には、ファンドの基準価額も下落するおそれがあります。

(2) 流動性リスク

実質的な投資対象となる有価証券等の需給、市場に対する相場見通し、経済・金融情勢等の変化や、当該有価証券等が売買される市場の規模や厚み、市場参加者の差異等は、当該有価証券等の流動性に大きく影響します。当該有価証券等の流動性が低下した場合、売買が実行できなくなったり、不利な条件での売買を強いられることとなったり、デリバティブ等の決済の場合に反対売買が困難になったりする可能性があります。その結果、ファンドの基準価額が下落するおそれがあります。

(3) 株価変動に伴うリスク

株価は、発行企業の業績や市場での需給等の影響を受け変動します。また、発行企業の信用状況にも影響されます。これらの要因により、株価が下落した場合、ファンドの基準価額も下落するおそれがあります。

(4) 金利変動に伴うリスク

投資対象の債券等は、経済情勢の変化等を受けた金利水準の変動に伴い価格が変動します。通常、金利が低下すると債券価格は上昇し、金利が上昇すると債券価格は下落します。債券価格が下落した場合、ファンドの基準価額も下落するおそれがあります。また、債券の種類や特定の銘柄に関わる格付け等の違い、利払い等の仕組みの違いなどにより、価格の変動度合いが大きくなる場合と小さくなる場合があります。

□デュレーションについて

金利の変動に伴う債券価格の変動の度合いは、「デュレーション」で表されます。デュレーションとは、投資資金の平均回収期間（年）のことで、債券のクーポンおよび償還金の現在価値

を、受け取るまでの期間に応じて加重平均した値です。一般的にデューレーションの値が大きいほど、金利の変動に対する債券価格の変動度合いが大きくなります。

(5)信用リスク

投資対象となる債券等の発行体において、万一、元利金の債務不履行や支払い遅延（デフォルト）が起きると、債券価格は大幅に下落します。この場合、ファンドの基準価額が下落するおそれがあります。また、格付機関により格下げされた場合は、債券価格が下落し、ファンドの基準価額が下落するおそれがあります。

株式の発行企業の財務状況等が悪化し、当該企業が経営不安や倒産等に陥ったときには、当該企業の株価は大きく下落し、投資資金が回収できなくなることもあります。この場合、ファンドの基準価額が下落するおそれがあります。

(6)外国証券投資のリスク

<為替リスク>

当ファンドは、マザーファンドを通じて外貨建資産に投資するため、為替変動のリスクが生じます。また、当ファンドは原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を直接受けます。したがって、円高局面では、その資産価値が大きく減少する可能性があり、この場合、ファンドの基準価額が下落するおそれがあります。

<カントリーリスク>

投資対象となる国と地域によっては、政治・経済情勢が不安定になったり、証券取引・外国為替取引等に関する規制が変更されたりする場合があります。さらに、外国政府が資産の没収、国有化、差押えなどを行う可能性もあります。これらの場合、ファンドの基準価額が下落するおそれがあります。

(7)ファミリーファンド方式に関わる基準価額の変動について

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用します。当ファンドや当ファンドの投資対象となるマザーファンドに投資する他のベビーファンドで解約申込みがあった際に、マザーファンドに属する有価証券を売却しなければならない場合があります。この場合、市場規模、市場動向によっては当該売却により市場実勢が押し下げられ、当初期待されていた価格で売却できないこともあります。この際に、当ファンドの基準価額が下落するおそれがあります。

<主な留意点>

(1)繰上償還について

当ファンドは、各ファンドにおいて信託財産の純資産総額が30億円を下回ることとなった場合等には、当該ファンドが繰上償還されることがあります。

(2)資産および投資先の配分について

当ファンドの実質的な資産配分は、基本的な資産配分比率と乖離を生じる場合があります。この結果、運用成果は、基本資産配分で運用を行った場合を上回ったり下回ったりすることがありますので、ご注意ください。

(3)換金請求の受付に関する留意点

取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の受付を中止させていただくことがあります。また、信託財産の資金管理等を円滑に行うため、大口の換金請求には制限を設ける場合があります。

(4)法令・税制・会計等の変更可能性について

法令・税制・会計等は、変更される可能性があります。

(5)その他の留意点

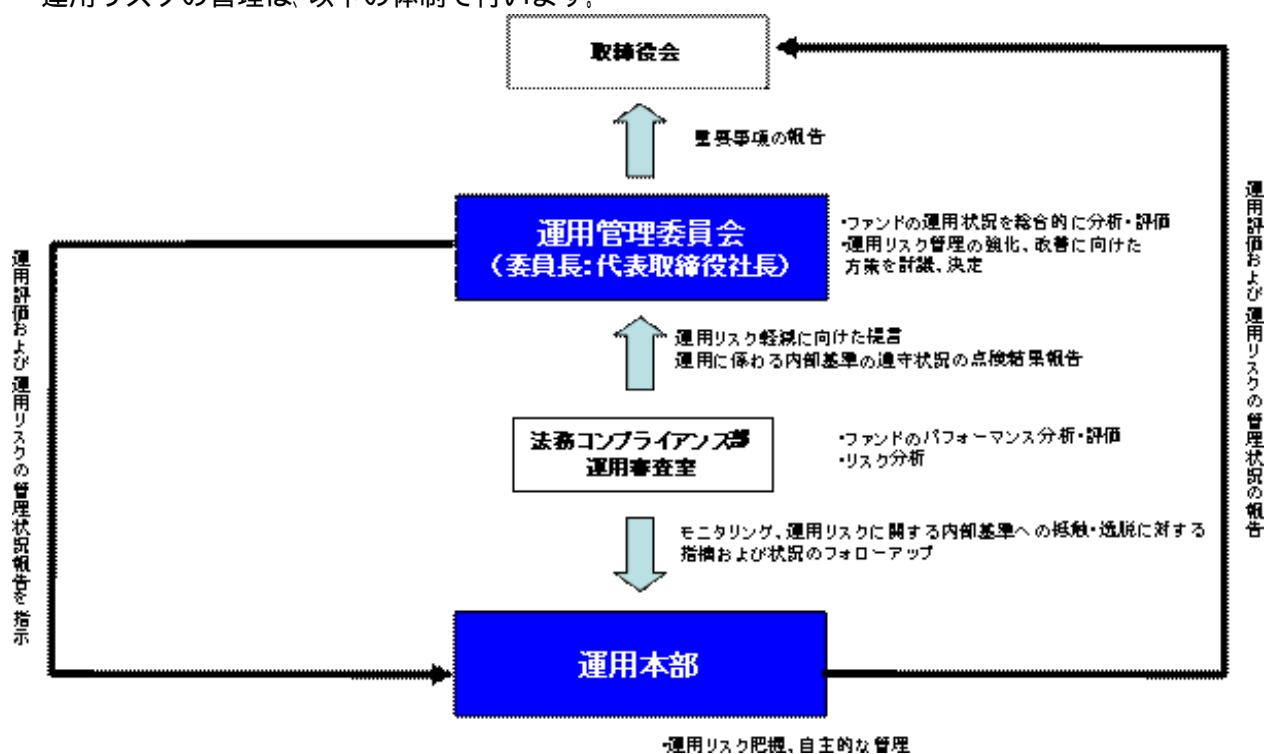
委託会社と投資顧問会社（Ｔ・ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービス・リミテッド）との合意等により、インターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンドの運用指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

< リスクに関する管理体制 >

当社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。

名称および人員数	内容
運用管理委員会 (20名程度)	ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定します。
リスク管理委員会 (20名程度)	運用リスクを除く経営リスクを適時、的確に把握し、適切な具体的措置を講じ、リスクの軽減・管理に努めます。
監査部 (6名程度)	取締役会直轄として、各部室の業務が適正な内部管理態勢のもと、法令等に従って行われているかを点検します。
コンプライアンス・オフィサー (1名)	コンプライアンスの観点から各部室の指導・監督を行うと同時に、法令等の遵守体制の維持・強化に向けた役職員の啓蒙・教化に努めます。
法務コンプライアンス部 (8名程度)	社内規則の制定・改廃の点検を行うほか、インサイダー情報の管理や広報内容のチェック等、法令違反等を未然に防止するために日常的な活動を行います。
運用審査室 (3名程度)	ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用本部に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行います。
売買管理室 (2名程度)	約定内容と取引報告書を照合する等、発注業務の監視および約定価格の妥当性を点検します。
トレーディング部 (20名程度)	有価証券の売買発注は、トレーディング部が最良執行の観点を踏まえて行います。

運用リスクの管理は、以下の体制で行います。



* リスクに関する管理体制は、今後変更になる場合があります。

4【手数料等及び税金】

■お買付け時、ご換金時等に直接ご負担いただく費用

時期	項目	費用
お買付け時	申込手数料	ありません。
解約請求時	解約手数料	ありません。
	信託財産留保額	ありません。

(注1) 前払退職金等の積立を目的とした定時定額購入等により当ファンドを取得した場合の解約の際は、解約時の譲渡益に対して課税されます。詳細については、後記「(5) 課税上の取扱い」をご覧ください。

(注2) 確定拠出年金制度および税法等が変更・改正された場合には、上記の内容が変更になることがあります。

■信託財産で間接的にご負担いただく（信託財産が支払う）費用・税金

時期	項目	費用				
毎日	信託報酬	ファンド	委託会社	販売会社	受託会社	合計
			純資産総額 に対して	純資産総額 に対して	純資産総額 に対して	純資産総額 に対して
		年金設計 30	年率0.441%	年率0.42%	年率0.084%	年率0.945%
			(税抜0.42%)	(税抜0.40%)	(税抜0.08%)	(税抜0.90%)
		年金設計 50	純資産総額 に対して	純資産総額 に対して	純資産総額 に対して	純資産総額 に対して
			年率0.546%	年率0.525%	年率0.084%	年率1.155%
			(税抜0.52%)	(税抜0.50%)	(税抜0.08%)	(税抜1.10%)
		年金設計 70	純資産総額 に対して	純資産総額 に対して	純資産総額 に対して	純資産総額 に対して
			年率0.651%	年率0.63%	年率0.084%	年率1.365%
			(税抜0.62%)	(税抜0.60%)	(税抜0.08%)	(税抜1.30%)

(注1) 信託報酬や売買委託手数料等のほか、売買委託手数料等に対する消費税等相当額、外国における資産の保管等に要する費用および当ファンドの財務諸表の監査に要する費用等を信託財産でご負担いただきます。

有価証券の売買委託手数料、外国における資産の保管等に要する費用などについては、取引または請求のつど、信託財産で負担することになります。これらの費用および当ファンドが投資対象とするマザーファンドにおける信託財産で間接的にご負担いただく費用は、事前に計算できないため、その総額や計算方法を具体的に記載しておりません。

(注2) 委託会社の信託報酬には、T・ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービス・リミテッドへの投資顧問報酬が含まれます。

(注3) 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年率0.0084%（税抜0.0080%）以内の率を乗じて得た額とします。また、監査報酬は変更になる場合があります。

(注4) 上記の内容は、今後変更になる場合があります。

（１）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

ありません。

（３）【信託報酬等】

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に前述の率を乗じて得た金額とし、委託会社と受託会社との間の配分は前述の表のとおりです。

マザーファンドでは信託報酬は収受されませんので、当ファンドにおける実質的な信託報酬は上記と同じです。

信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬にかかる消費税等相当額を信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します（税額は、税法改正時には変更となります。）。

信託報酬の販売会社への配分は、販売会社の行う業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、取扱残高に応じて支払います。委託会社は、信託報酬を収受したときは、販売会社に対して代行手数料を遅滞なく支払うものとします。なお、販売会社への配分には、消費税等相当額がかかります。

委託会社の報酬には、インターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンドにおけるＴ．ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービス・リミテッドへの投資顧問報酬が含まれます。なお、投資顧問報酬の額は、以下イ．およびロ．の合計額とし、委託会社が報酬を受取った後、当該報酬から支弁するものとします。

イ．信託財産に属するとみなされるインターナショナル株式マザーファンドの時価総額に年10,000分の51の率を乗じて得た金額とします。

ロ．信託財産に属するとみなされるインターナショナル債券マザーファンドの時価総額に年10,000分の36の率を乗じて得た金額とします。

（４）【その他の手数料等】

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料に対する消費税等相当額、先物取引・オプション取引・コール取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担します。信託財産の証券取引等に伴う手数料や税金は信託財産が負担しますが、売買委託手数料等の証券取引に伴う手数料等は国や市場によって異なります。また、売買金額によっても異なります。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸経費、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産の財務諸表の監査費用等は、委託会社が金額をあらかじめ合理的に見積もったうえ、実際の費用額を上限として定率または定額にて日々計算し、毎計算期末または信託終了時に信託財産中から支弁します。また、委託会社は信託財産の規模等を考慮してその率または金額を変更することができます。

（５）【課税上の取扱い】

確定拠出年金制度の加入者に対する課税については、確定拠出年金の積立金への運用にかかる税制が適用されます。なお、上記以外の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。また、確定拠出年金制度および税法等が変更・改正された場合は、以下の内容が変更になることがあります。

ただし、非課税扱いの投資家については、下記の課税対象については、課税されません。

個人の受益者に対する課税

<平成23年12月31日まで>

・収益分配金の課税

収益分配金のうち課税対象となる普通分配金については、10%（所得税7%および地方税3%）の税率で源泉徴収され確定申告不要となります。なお、確定申告を行い、申告分離課税または総合課税（当ファンドは、配当控除の適用がありません。）を選択することができます。

・解約時および償還時の課税

譲渡益（解約価額および償還価額から取得費を控除した利益をいいます。）については、譲渡所得として10%（所得税7%および地方税3%）の税率が適用され、申告分離課税となります。なお、源泉徴収選択口座を選択した場合には、原則として確定申告不要となります。

<平成24年1月1日以降>

・収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税対象となる普通分配金については、20%（所得税15%および地方税5%）の税率で源泉徴収され確定申告不要となります。なお、確定申告を行い、申告分離課税または総合課税（当ファンドは、配当控除の適用があり

ません。)を選択することができます。

・解約時および償還時の課税

譲渡益（解約価額および償還価額から取得費を控除した利益をいいます。）については、譲渡所得として20%（所得税15%および地方税5%）の税率が適用され、申告分離課税となります。なお、源泉徴収選択口座を選択した場合には確定申告不要となります。

< 損益通算について >

解約時および償還時の譲渡損失（または譲渡益）については、上場株式等の譲渡益（または譲渡損失）との相殺が可能です。当該相殺後の譲渡損失については、確定申告により、申告分離課税を選択した場合の上場株式等の配当所得との損益通算が可能です。

また、源泉徴収選択口座内においても、解約時および償還時の譲渡損失（または譲渡益）については、上場株式等の譲渡益（または譲渡損失）と相殺され、当該相殺後の譲渡損失については、上場株式等の配当所得との損益通算が可能です。

法人の受益者に対する課税

< 平成23年12月31日まで >

収益分配金のうち課税対象となる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額に対しては、7%（所得税7%）の税率で源泉徴収されます。

< 平成24年1月1日以降 >

収益分配金のうち課税対象となる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額に対しては、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収されます。

< 益金不算入制度について >

当ファンドは、益金不算入制度の適用はありません。

（参考）

< 個別元本について >

・追加型株式投資信託を保有する受益者毎の取得元本が個別元本にあたります。

・受益者が同一ファンド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。

・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る場合があります。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一

ファンドを取得する場合は当該支店毎に、「分配金受取型」と「分配金自動再投資型」の両コースで取得する場合にはコース別に、個別元本の算出が行われる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

・受益者が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（「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）。

＜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「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）の区別があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、当該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、当該収益分配金落ち後の基準価額が個別元本を下回っている場合は、その下回る部分の額が特別分配金、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。

* 上記の内容は、確定拠出年金制度および税法等が変更・改正された場合には、変更になることがあります。

* 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

(平成21年12月末日現在)

大和住銀DC年金設計ファンド30

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
親投資信託受益証券 （年金日本債券マザーファンド）	日本	985,209,672	60.20%
親投資信託受益証券 （年金日本株式マザーファンド）	日本	407,534,618	24.90%
親投資信託受益証券 （国際ナショナル債券マザーファンド）	日本	156,452,275	9.56%
親投資信託受益証券 （国際ナショナル株式マザーファンド）	日本	89,545,963	5.47%
純資産総額		1,636,533,182	-

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

大和住銀DC年金設計ファンド50

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
親投資信託受益証券 （年金日本債券マザーファンド）	日本	1,045,932,932	37.19%
親投資信託受益証券 （年金日本株式マザーファンド）	日本	1,031,665,108	36.68%
親投資信託受益証券 （国際ナショナル株式マザーファンド）	日本	472,052,556	16.79%
親投資信託受益証券 （国際ナショナル債券マザーファンド）	日本	266,226,741	9.47%
純資産総額		2,812,292,344	-

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

大和住銀DC年金設計ファンド70

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
親投資信託受益証券 （年金日本株式マザーファンド）	日本	1,103,877,727	49.79%
親投資信託受益証券 （国際ナショナル株式マザーファンド）	日本	492,686,599	22.22%
親投資信託受益証券 （年金日本債券マザーファンド）	日本	413,556,799	18.65%

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
親投資信託受益証券 （国際ナショナル債券マザーファンド）	日本	210,253,193	9.48%
純資産総額		2,217,087,410	-

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

<参考：マザーファンドの投資状況>

（平成21年12月末日現在）

年金日本株式マザーファンド

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
株式	日本	60,539,481,700	98.80%
純資産総額		61,273,533,343	-

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

年金日本債券マザーファンド

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
国債証券	日本	9,565,457,120	63.81%
特殊債券	韓国	200,567,000	1.34%
	日本	191,909,807	1.28%
社債券	日本	4,272,660,700	28.50%
	アメリカ	197,320,000	1.32%
	オランダ	95,413,000	0.64%
純資産総額		14,989,566,046	-

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国際ナショナル株式マザーファンド

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
株式	アメリカ	20,425,922,803	50.82%
	イギリス	4,087,756,924	10.17%
	イタリア	1,665,830,826	4.14%
	フランス	1,481,617,740	3.69%
	ブラジル	1,474,981,374	3.67%
	メキシコ	1,309,668,667	3.26%
	インド	1,254,485,681	3.12%
	ドイツ	1,202,920,868	2.99%
	スイス	979,006,152	2.44%
	バミューダ	955,430,664	2.38%
	ジャージー	826,789,663	2.06%
	スペイン	648,131,220	1.61%
	ロシア	502,713,469	1.25%
	イスラエル	501,443,055	1.25%
	ケイマン諸島	487,128,621	1.21%
	中国	458,322,796	1.14%
	オランダ領アンチル	455,172,936	1.13%
	アイルランド	185,885,614	0.46%
純資産総額		40,189,476,169	-

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国際ナショナル債券マザーファンド

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
国債証券	アメリカ	1,060,035,943	17.12%
	イタリア	754,420,590	12.18%
	フランス	601,200,669	9.71%
	ドイツ	488,240,464	7.88%
	イギリス	289,343,574	4.67%
	カナダ	215,196,119	3.47%
	ギリシャ	209,686,237	3.39%
	マレーシア	181,981,224	2.94%
	スペイン	164,483,189	2.66%
	オランダ	163,137,942	2.63%
	メキシコ	160,864,176	2.60%
	ベルギー	126,882,348	2.05%
	オーストリア	115,789,531	1.87%
	ポルトガル	71,301,545	1.15%
	ブラジル	45,556,344	0.74%
	デンマーク	40,013,064	0.65%
	スウェーデン	38,938,585	0.63%
	ポーランド	32,740,567	0.53%
	南アフリカ	30,124,068	0.49%
	フィンランド	24,077,130	0.39%
	リトアニア	16,091,481	0.26%
	韓国	10,719,942	0.17%
地方債証券	オーストラリア	42,400,529	0.68%
特殊債券	オランダ	72,846,347	1.18%
	国際機関	63,001,944	1.02%
	ドイツ	56,330,314	0.91%
	ルクセンブルグ	35,010,228	0.57%
社債券	アメリカ	110,057,071	1.78%
	イギリス	74,645,901	1.21%
	カナダ	57,707,232	0.93%
	オランダ	38,261,517	0.62%
	フランス	36,135,270	0.58%
	ルクセンブルグ	23,620,634	0.38%
	アイルランド	19,262,562	0.31%
	スペイン	14,652,330	0.24%
	スウェーデン	13,972,992	0.23%
	オーストラリア	13,853,466	0.22%
	イタリア	13,717,770	0.22%
	ドイツ	12,155,312	0.20%
	ベルギー	8,341,740	0.13%
	ガーンジィ	7,241,190	0.12%
	スイス	7,195,320	0.12%
	オーストリア	2,204,334	0.04%
	ジャージー	1,241,460	0.02%
純資産総額		6,193,296,687	-

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

（平成21年12月末日現在）

イ．主要銘柄の明細

大和住銀ＤＣ年金設計ファンド３０

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	年金日本債券マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	985,998,471	0.9911 977,249,257	0.9992 985,209,672	- -	60.20%
2	年金日本株式マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	419,619,665	0.8830 370,534,303	0.9712 407,534,618	- -	24.90%
3	インターナショナル債券マ ザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	91,247,099	1.7194 156,890,678	1.7146 156,452,275	- -	9.56%
4	インターナショナル株式マ ザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	69,216,946	1.2460 86,248,574	1.2937 89,545,963	- -	5.47%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

大和住銀ＤＣ年金設計ファンド５０

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	年金日本債券マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	1,046,770,349	0.9911 1,037,483,402	0.9992 1,045,932,932	- -	37.19%
2	年金日本株式マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	1,062,258,143	0.8829 937,916,982	0.9712 1,031,665,108	- -	36.68%
3	インターナショナル株式マ ザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	364,885,643	1.2460 454,652,460	1.2937 472,052,556	- -	16.79%
4	インターナショナル債券マ ザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	155,270,466	1.7194 266,978,473	1.7146 266,226,741	- -	9.47%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

大和住銀ＤＣ年金設計ファンド７０

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	年金日本株式マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	1,136,612,158	0.8833 1,003,978,893	0.9712 1,103,877,727	- -	49.79%
2	インターナショナル株式マ ザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	380,835,278	1.2459 474,503,190	1.2937 492,686,599	- -	22.22%
3	年金日本債券マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	413,887,910	0.9911 410,235,542	0.9992 413,556,799	- -	18.65%

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
4	インターナショナル債券マ ザーファンド 日本	親投資信託受 益証券 -	122,625,215	1.7192 210,821,571	1.7146 210,253,193	- -	9.48%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

<参考：マザーファンドの主要銘柄の明細>

年金日本株式マザーファンド

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	746,600	3,110 2,322,151,091	3,880 2,896,808,000	- -	4.73%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	5,614,500	489 2,750,929,006	452 2,537,754,000	- -	4.14%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	591,700	4,522 2,676,180,436	3,650 2,159,705,000	- -	3.52%
4	三菱商事 日本	株式 卸売業	871,400	1,260 1,098,567,992	2,305 2,008,577,000	- -	3.28%
5	東京瓦斯 日本	株式 電気・ガス業	4,647,000	403 1,875,952,795	371 1,724,037,000	- -	2.81%
6	三井物産 日本	株式 卸売業	1,153,600	1,138 1,313,183,929	1,311 1,512,369,600	- -	2.47%
7	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	251,000	3,266 819,832,855	5,920 1,485,920,000	- -	2.43%
8	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	432,600	2,217 959,288,665	3,110 1,345,386,000	- -	2.20%
9	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 日本	株式 情報・通信業	10,208	154,635 1,578,515,070	129,600 1,322,956,800	- -	2.16%
10	キヤノン 日本	株式 電気機器	337,100	3,576 1,205,554,514	3,910 1,318,061,000	- -	2.15%
11	住友電気工業 日本	株式 非鉄金属	1,070,200	847 907,101,153	1,150 1,230,730,000	- -	2.01%
12	日本精工 日本	株式 機械	1,763,000	472 832,618,466	680 1,198,840,000	- -	1.96%
13	住友信託銀行 日本	株式 銀行業	2,568,000	485 1,246,191,619	453 1,163,304,000	- -	1.90%
14	コニカミノルタホールディン グス 日本	株式 電気機器	1,220,000	715 872,551,354	952 1,161,440,000	- -	1.90%
15	ジェイ エフ イー ホール ディングス 日本	株式 鉄鋼	311,800	2,368 738,613,670	3,650 1,138,070,000	- -	1.86%
16	パナソニック電工 日本	株式 電気機器	938,000	734 689,149,212	1,122 1,052,436,000	- -	1.72%
17	任天堂 日本	株式 その他製品	46,500	26,804 1,246,425,600	22,040 1,024,860,000	- -	1.67%
18	ミネベア 日本	株式 電気機器	1,964,000	411 807,576,283	502 985,928,000	- -	1.61%
19	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,374,000	465 639,289,640	685 941,190,000	- -	1.54%
20	オリックス 日本	株式 その他金融業	150,060	5,153 773,389,669	6,270 940,876,200	- -	1.54%
21	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	1,495	605,091 904,612,441	622,000 929,890,000	- -	1.52%
22	三菱ケミカルホールディン グス 日本	株式 化学	2,342,500	372 871,413,266	394 922,945,000	- -	1.51%
23	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	358,500	2,624 940,727,518	2,530 907,005,000	- -	1.48%
24	ファナック 日本	株式 電気機器	104,200	7,652 797,379,401	8,630 899,246,000	- -	1.47%
25	日立化成工業 日本	株式 化学	474,700	1,518 720,857,759	1,881 892,910,700	- -	1.46%
26	新日鉱ホールディングス 日本	株式 石油・石炭製 品	2,238,000	378 848,013,565	397 888,486,000	- -	1.45%
27	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先物 取引業	1,283,500	549 705,007,534	681 874,063,500	- -	1.43%

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
28	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	241,200	3,324 801,853,763	3,460 834,552,000	- -	1.36%
29	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	2,665	246,500 656,924,547	313,000 834,145,000	- -	1.36%
30	日産化学工業 日本	株式 化学	628,000	854 536,476,926	1,321 829,588,000	- -	1.35%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

年金日本債券マザーファンド

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	301 10年国債 日本	国債証券 -	2,070,000,000	101.75 2,106,356,900	102.46 2,121,008,940	1.5000 2019/06/20	14.15%
2	289 10年国債 日本	国債証券 -	2,010,000,000	102.42 2,058,708,300	104.07 2,091,931,620	1.5000 2017/12/20	13.96%
3	264 10年国債 日本	国債証券 -	1,930,000,000	103.83 2,004,100,000	104.85 2,023,724,660	1.5000 2014/09/20	13.50%
4	13 30年国債 日本	国債証券 -	990,000,000	99.53 985,355,310	96.25 952,940,340	2.0000 2033/12/20	6.36%
5	12 物価連動国債 日本	国債証券 -	820,000,000	90.52 742,277,120	96.25 793,196,250	1.2000 2017/06/10	5.29%
6	105 20年国債 日本	国債証券 -	620,000,000	102.43 635,105,200	100.67 624,194,300	2.1000 2028/09/20	4.16%
7	JWBSF FR 1911 日本	社債券 -	600,000,000	85.93 515,586,000	98.52 591,132,000	6.3600 2019/11/15	3.94%
8	70 5年国債 日本	国債証券 -	490,000,000	101.54 497,546,000	101.74 498,574,510	0.8000 2013/03/20	3.33%
9	51 アコム 日本	社債券 -	400,000,000	88.32 353,280,000	90.69 362,786,000	2.0700 2013/06/04	2.42%
10	69 20年国債 日本	国債証券 -	300,000,000	104.69 314,072,700	104.82 314,461,500	2.1000 2024/03/20	2.10%
11	1 東日本BK劣後FR 日本	社債券 -	300,000,000	95.66 286,980,000	100.27 300,810,000	2.6200 2016/12/16	2.01%
12	2 荘内銀行劣後FR 日本	社債券 -	300,000,000	93.88 281,652,000	98.38 295,146,000	1.1300 2015/09/27	1.97%
13	15 ポケットカード 日本	社債券 -	300,000,000	95.64 286,946,700	96.48 289,448,100	3.1200 2010/11/09	1.93%
14	20 三洋電機 日本	社債券 -	200,000,000	102.34 204,683,000	104.33 208,668,600	2.0200 2014/08/26	1.39%
15	50 伊藤忠商事 日本	社債券 -	200,000,000	100.00 200,000,000	102.66 205,326,600	1.4900 2014/05/23	1.37%
16	39 トヨタファイナンス 日本	社債券 -	200,000,000	100.00 200,000,000	101.97 203,942,600	1.1750 2012/06/20	1.36%
17	1-A 日本生命2009 日本	社債券 -	200,000,000	100.00 200,000,000	101.53 203,062,000	1.6000 2013/08/07	1.35%
18	5 中小企業銀行 韓国	特殊債券 -	200,000,000	100.00 200,000,000	100.28 200,567,000	2.2000 2011/11/09	1.34%
19	1 イー・アクセス 日本	社債券 -	200,000,000	94.69 189,394,400	99.83 199,666,400	1.9500 2010/03/24	1.33%
20	AMERICAN HONDA FINANCE アメリカ	社債券 -	200,000,000	97.94 195,880,000	98.66 197,320,000	0.4375 2012/06/25	1.32%
21	S14 住宅機構RMBS 日本	特殊債券 -	188,962,000	100.00 188,962,000	101.56 191,909,807	1.7000 2032/05/10	1.28%
22	38 プロミス 日本	社債券 -	200,000,000	85.76 171,520,000	82.17 164,358,600	2.0500 2013/02/15	1.10%
23	39 プロミス 日本	社債券 -	200,000,000	82.05 164,100,000	73.63 147,265,000	2.0600 2014/03/20	0.98%
24	37 15年国債FR	国債証券	150,000,000	93.15	96.95	0.6900	0.97%

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
	日本	-		139,725,000	145,425,000	2020/11/20	
25	70 丸紅 日本	社債券 -	100,000,000	100.00 100,000,000	102.76 102,761,700	1.7200 2014/06/02	0.69%
26	49 日産自動車 日本	社債券 -	100,000,000	100.00 100,000,000	102.72 102,729,600	1.9310 2014/09/19	0.69%
27	24 富士通 日本	社債券 -	100,000,000	101.25 101,250,000	102.36 102,364,000	1.4900 2012/09/25	0.68%
28	62 新日本製鐵 日本	社債券 -	100,000,000	100.00 100,000,000	102.21 102,211,100	1.1630 2014/06/20	0.68%
29	1 日東電工 日本	社債券 -	100,000,000	100.00 100,000,000	101.85 101,854,700	1.2330 2014/06/03	0.68%
30	48 日産自動車 日本	社債券 -	100,000,000	100.00 100,000,000	101.51 101,513,100	1.4530 2012/09/20	0.68%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

インターナショナル株式マザーファンド

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 各種金融	448,400	3,123 1,400,658,997	3,821 1,713,439,083	- -	4.26%
2	INTESA SANPAOLO SPA イタリア	株式 銀行	3,949,900	315 1,244,891,729	421 1,665,830,826	- -	4.14%
3	ROLLS-ROYCE GROUP PLC イギリス	株式 資本財	2,138,300	542 1,160,409,415	716 1,531,219,758	- -	3.81%
4	APPLE INC アメリカ	株式 テクノロジー ・ハードウェアおよび機器	70,800	13,374 946,947,217	19,258 1,363,474,188	- -	3.39%
5	GOOGLE INC-CL A アメリカ	株式 ソフトウェア ・サービス	23,600	40,213 949,036,637	57,046 1,346,303,064	- -	3.35%
6	WAL-MART STORES INC アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	256,600	4,503 1,155,701,817	4,983 1,278,774,054	- -	3.18%
7	JUNIPER NETWORKS INC アメリカ	株式 テクノロジー ・ハードウェアおよび機器	475,200	2,183 1,037,486,472	2,471 1,174,239,633	- -	2.92%
8	BAC 10% 12/31/49 アメリカ	株式 各種金融	755,900	1,393 1,053,698,697	1,381 1,044,275,850	- -	2.60%
9	AMERICA MOVIL SAB DE CV-ADR SERIES L メキシコ	株式 電気通信サービス	234,600	3,652 856,879,233	4,363 1,023,723,550	- -	2.55%
10	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	62,063	13,035 809,052,946	15,774 979,006,152	- -	2.44%
11	PERNOD-RICARD SA フランス	株式 食品・飲料・タバコ	121,518	6,310 766,848,630	7,918 962,262,156	- -	2.39%
12	ACCENTURE PLC-CL A バミューダ	株式 ソフトウェア・サービス	248,000	3,662 908,371,939	3,852 955,430,664	- -	2.38%
13	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	70,900	7,523 533,408,353	12,839 910,331,964	- -	2.27%
14	RIO TINTO イギリス	株式 素材	181,200	4,683 848,671,904	5,011 908,052,271	- -	2.26%
15	E.ON AG ドイツ	株式 公益事業	221,608	3,260 722,486,575	3,908 866,159,300	- -	2.16%
16	MASTERCARD INC-CLASS A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	35,600	15,656 557,375,401	23,794 847,100,433	- -	2.11%
17	GOLDMAN SACHS アメリカ	株式 各種金融	55,700	15,157 844,247,485	15,115 841,930,676	- -	2.09%
18	WELLPOINT INC アメリカ	株式 ヘルスケア機器・サービス	153,300	4,541 696,281,775	5,394 826,945,730	- -	2.06%
19	WPP PLC ジャージー	株式 メディア	928,800	581 540,502,116	890 826,789,663	- -	2.06%
20	GILEAD SCIENCES INC アメリカ	株式 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	197,700	4,224 835,254,741	4,003 791,509,149	- -	1.97%
21	QUALCOMM INC	株式	181,200	3,990	4,296	-	1.94%

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		723,166,181	778,519,458	-	
22	LOWE'S COS INC アメリカ	株式 小売	333,000	1,983 660,627,301	2,174 724,102,173	- -	1.80%
23	STANDARD CHARTERD PLC イギリス	株式 銀行	292,000	2,247 656,173,963	2,329 680,309,484	- -	1.69%
24	NIKE INC アメリカ	株式 耐久消費財・アパレル	111,400	4,814 536,308,858	6,097 679,310,627	- -	1.69%
25	YUM! BRANDS INC アメリカ	株式 消費者サービス	201,200	3,165 636,854,850	3,243 652,644,914	- -	1.62%
26	IBERDROLA RENOVABLES スペイン	株式 公益事業	1,474,500	418 616,880,392	439 648,131,220	- -	1.61%
27	PETROLEO BRASILEIRO S.A. -ADR ブラジル	株式 エネルギー	142,900	2,978 425,588,435	3,910 558,819,881	- -	1.39%
28	MURPHY OIL CORP アメリカ	株式 エネルギー	109,900	4,801 527,713,542	5,012 550,827,811	- -	1.37%
29	FIFTH THIRD BANCORP アメリカ	株式 銀行	594,000	940 558,916,749	913 542,697,408	- -	1.35%
30	VODAFONE GROUP PLC イギリス	株式 電気通信サービス	2,533,673	182 462,629,988	210 533,870,591	- -	1.33%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

インターナショナル債券マザーファンド

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	US TREASURY NOTE アメリカ	国債証券 -	2,864,000	9,990.44 286,126,390	9,860.41 282,402,148	4.0000 2012/11/15	4.56%
2	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	1,666,000	14,550.78 242,416,122	14,787.96 246,367,413	5.2500 2017/08/01	3.98%
3	UK GILT イギリス	国債証券 -	1,330,000	14,651.02 194,858,646	14,125.49 187,869,043	4.2500 2032/06/07	3.03%
4	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	1,296,000	14,031.40 181,847,017	14,075.16 182,414,073	5.0000 2012/02/01	2.95%
5	US TREASURY BOND アメリカ	国債証券 -	1,777,000	10,827.74 192,409,005	10,180.64 180,910,006	5.3750 2031/02/15	2.92%
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券 -	1,990,000	8,937.74 177,861,139	8,838.65 175,889,190	2.3750 2016/03/31	2.84%
7	FRANCE O.A.T. フランス	国債証券 -	888,000	16,292.74 144,679,587	16,137.00 143,296,560	5.7500 2032/10/25	2.31%
8	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	1,023,000	13,185.12 134,883,872	12,934.68 132,321,776	4.0000 2037/01/04	2.14%
9	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券 -	1,411,000	9,482.01 133,791,212	9,284.04 130,997,922	2.6250 2014/07/31	2.12%
10	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券 -	1,159,000	10,340.49 119,846,380	10,162.59 117,784,421	4.7500 2014/05/15	1.90%
11	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	752,000	14,870.29 111,824,589	14,784.00 111,175,680	5.0000 2016/10/25	1.80%
12	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	885,000	11,287.53 99,894,676	11,843.04 104,810,904	4.0000 2037/02/01	1.69%
13	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	703,000	14,305.13 100,565,065	14,261.28 100,256,798	4.2500 2014/07/04	1.62%

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
14	US TREASURY BOND アメリカ	国債証券 -	888,000	11,001.40 97,692,443	9,987.78 88,691,526	5.2500 2029/02/15	1.43%
15	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	560,000	14,234.88 79,715,328	15,445.32 86,493,792	6.0000 2031/05/01	1.40%
16	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	597,000	14,067.24 83,981,422	14,114.62 84,264,329	4.2500 2017/10/25	1.36%
17	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	590,000	13,795.05 81,390,830	14,045.32 82,867,435	4.4000 2015/01/31	1.34%
18	HELLENIC REPUBLIC ギリシャ	国債証券 -	615,000	13,263.36 81,569,664	13,088.72 80,495,652	4.6000 2013/05/20	1.30%
19	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	551,000	13,859.03 76,363,257	13,770.24 75,874,022	3.5000 2016/01/04	1.23%
20	MEXICAN FIXED RATE BONDS メキシコ	国債証券 -	10,205,000	721.87 73,667,236	731.47 74,647,054	8.0000 2013/12/19	1.21%
21	NETHERLANDS GOVERNMENT オランダ	国債証券 -	520,000	14,322.00 74,474,400	14,306.16 74,392,032	5.0000 2012/07/15	1.20%
22	MALAYSIA T-BILL マレーシア	国債証券 -	2,770,000	2,637.40 73,056,156	2,642.98 73,210,640	- 2010/07/30	1.18%
23	BK NEDERLANDSE GEMEENTEN オランダ	特殊債券 -	737,000	10,051.29 74,078,028	9,884.17 72,846,347	5.2500 2017/01/31	1.18%
24	REPUBLIC OF AUSTRIA オーストリア	国債証券 -	528,000	13,981.03 73,819,880	13,762.98 72,668,534	5.2500 2011/01/04	1.17%
25	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	525,000	13,968.24 73,333,260	13,702.92 71,940,330	5.5000 2010/11/01	1.16%
26	FRANCE O.A.T. フランス	国債証券 -	425,000	15,542.87 66,057,199	15,452.05 65,671,221	5.5000 2029/04/25	1.06%
27	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	444,000	13,743.39 61,020,669	14,052.72 62,394,076	4.2500 2014/08/01	1.01%
28	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	423,000	14,564.12 61,606,242	14,397.24 60,900,325	4.7500 2034/07/04	0.98%
29	HELLENIC REPUBLIC ギリシャ	国債証券 -	432,000	14,058.59 60,733,127	13,959.00 60,302,880	6.5000 2014/01/11	0.97%
30	FRANCE O.A.T. フランス	国債証券 -	450,000	13,832.28 62,245,260	13,395.36 60,279,120	5.5000 2010/04/25	0.97%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

大和住銀DC年金設計ファンド30

種類別	投資比率
親投資信託受益証券	100.14%
合計	100.14%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

大和住銀DC年金設計ファンド50

種類別	投資比率
親投資信託受益証券	100.13%
合計	100.13%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

大和住銀DC年金設計ファンド70

種類別	投資比率
親投資信託受益証券	100.15%
合計	100.15%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

<参考：マザーファンドの投資有価証券の種類別投資比率>

年金日本株式マザーファンド

種類別	投資比率
株式	98.80%
合計	98.80%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

年金日本債券マザーファンド

種類別	投資比率
国債証券	63.81%
社債券	30.46%
特殊債券	2.62%
合計	96.89%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

インターナショナル株式マザーファンド

種類別	投資比率
株式	96.80%
合計	96.80%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

インターナショナル債券マザーファンド

種類別	投資比率
国債証券	78.16%
社債券	7.33%
特殊債券	3.67%
地方債証券	0.68%
合計	89.85%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

八．投資株式の業種別投資比率

大和住銀ＤＣ年金設計ファンド３０
該当事項はありません。

大和住銀ＤＣ年金設計ファンド５０
該当事項はありません。

大和住銀ＤＣ年金設計ファンド７０
該当事項はありません。

<参考：マザーファンドの投資株式の業種別投資比率>
年金日本株式マザーファンド

業種別	投資比率
(国内)	
電気機器	16.87%
輸送用機器	10.33%
銀行業	9.18%
卸売業	7.10%
情報・通信業	7.02%
化学	6.24%
医薬品	4.40%
機械	3.92%
小売業	3.50%
食料品	2.96%
電気・ガス業	2.81%
不動産業	2.44%
陸運業	2.39%
証券、商品先物取引業	2.32%
鉄鋼	2.32%
保険業	2.09%
非鉄金属	2.01%
その他製品	1.77%
建設業	1.75%
その他金融業	1.54%
石油・石炭製品	1.45%
ガラス・土石製品	1.05%
パルプ・紙	0.81%
ゴム製品	0.80%
サービス業	0.76%
精密機器	0.54%
空運業	0.44%
小計	98.80%
合計	98.80%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

年金日本債券マザーファンド
該当事項はありません。

インターナショナル株式マザーファンド

業種別	投資比率
(海外)	
各種金融	12.01%
ソフトウェア・サービス	11.52%
銀行	9.32%
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.25%
エネルギー	8.06%
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.19%
小売	5.19%
公益事業	4.83%
素材	4.55%
食品・生活必需品小売り	4.26%
電気通信サービス	4.26%
食品・飲料・タバコ	4.12%
資本財	3.81%
ヘルスケア機器・サービス	2.88%
メディア	2.06%

業種別	投資比率
耐久消費財・アパレル	1.69%
消費者サービス	1.62%
運輸	0.87%
保険	0.30%
小計	96.80%
合計	96.80%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

インターナショナル債券マザーファンド
該当事項はありません。

【投資不動産物件】

（平成21年12月末日現在）

大和住銀ＤＣ年金設計ファンド３０

該当事項はありません。

大和住銀ＤＣ年金設計ファンド５０

該当事項はありません。

大和住銀ＤＣ年金設計ファンド７０

該当事項はありません。

< 参考：マザーファンドの投資不動産物件 >

年金日本株式マザーファンド

該当事項はありません。

年金日本債券マザーファンド

該当事項はありません。

インターナショナル株式マザーファンド

該当事項はありません。

インターナショナル債券マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

（平成21年12月末日現在）

大和住銀DC年金設計ファンド30

該当事項はありません。

大和住銀DC年金設計ファンド50

該当事項はありません。

大和住銀DC年金設計ファンド70

該当事項はありません。

<参考：マザーファンドのその他投資資産の主要なもの>
年金日本株式マザーファンド

該当事項はありません。

年金日本債券マザーファンド

種類	地域	資産名	買建 / 売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率
債券先物取引	日本	長国2203月限	買建	3	418,934,410	419,100,000	2.80%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

インターナショナル株式マザーファンド

該当事項はありません。

インターナショナル債券マザーファンド

種類	地域	資産名	買建 / 売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率
債券先物取引	ドイツ	EURO-BUND FUTURE Mar10	売建	3	48,762,707	48,110,040	0.78%
債券先物取引	アメリカ	US 10YR NOTE FUT Mar10	売建	4	43,767,885	42,607,762	0.69%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

大和住銀ＤＣ年金設計ファンド３０

	純資産総額（百万円）		１口当りの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
設定時 （平成13年９月21日）	10	-	1.0000	-
第１計算期間末 （平成14年11月19日）	16	-	1.0085	-
第２計算期間末 （平成15年11月19日）	46	-	1.0649	-
第３計算期間末 （平成16年11月19日）	192	-	1.1543	-
第４計算期間末 （平成17年11月21日）	584	-	1.3130	-
第５計算期間末 （平成18年11月20日）	1,001	-	1.3336	-
第６計算期間末 （平成19年11月19日）	1,414	-	1.3400	-
第７計算期間末 （平成20年11月19日）	1,281	-	0.9967	-
平成21年１月末日	1,273	-	0.9836	-
平成21年２月末日	1,263	-	0.9735	-
平成21年３月末日	1,312	-	0.9874	-
平成21年４月末日	1,364	-	1.0130	-
平成21年５月末日	1,424	-	1.0362	-
平成21年６月末日	1,466	-	1.0569	-
平成21年７月末日	1,541	-	1.0683	-
平成21年８月末日	1,567	-	1.0807	-
平成21年９月末日	1,561	-	1.0698	-
平成21年10月末日	1,581	-	1.0676	-
第８計算期間末 （平成21年11月19日）	1,575	-	1.0609	-
平成21年11月末日	1,569	-	1.0583	-
平成21年12月末日	1,636	-	1.0918	-

（注）純資産総額は百万円未満切捨てで表記しております。

大和住銀ＤＣ年金設計ファンド５０

	純資産総額（百万円）		１口当りの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
設定時 （平成13年９月21日）	10	-	1.0000	-
第１計算期間末 （平成14年11月19日）	13	-	0.9923	-
第２計算期間末 （平成15年11月19日）	37	-	1.0751	-
第３計算期間末 （平成16年11月19日）	222	-	1.1859	-
第４計算期間末 （平成17年11月21日）	755	-	1.4398	-
第５計算期間末 （平成18年11月20日）	1,668	-	1.4900	-
第６計算期間末 （平成19年11月19日）	2,452	-	1.5055	-
第７計算期間末 （平成20年11月19日）	2,032	-	1.0129	-
平成21年１月末日	2,034	-	0.9913	-
平成21年２月末日	2,011	-	0.9790	-
平成21年３月末日	2,147	-	1.0024	-
平成21年４月末日	2,270	-	1.0493	-
平成21年５月末日	2,389	-	1.0880	-
平成21年６月末日	2,459	-	1.1101	-
平成21年７月末日	2,603	-	1.1341	-
平成21年８月末日	2,655	-	1.1475	-
平成21年９月末日	2,639	-	1.1296	-
平成21年10月末日	2,675	-	1.1305	-
第８計算期間末 （平成21年11月19日）	2,647	-	1.1149	-
平成21年11月末日	2,631	-	1.1062	-
平成21年12月末日	2,812	-	1.1627	-

（注）純資産総額は百万円未満切捨てで表記しております。

大和住銀ＤＣ年金設計ファンド７０

	純資産総額（百万円）		１口当りの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
設定時 （平成13年９月21日）	10	-	1.0000	-
第１計算期間末 （平成14年11月19日）	12	-	0.9866	-
第２計算期間末 （平成15年11月19日）	34	-	1.0936	-
第３計算期間末 （平成16年11月19日）	196	-	1.2415	-
第４計算期間末 （平成17年11月21日）	661	-	1.6070	-
第５計算期間末 （平成18年11月20日）	1,389	-	1.6872	-
第６計算期間末 （平成19年11月19日）	1,965	-	1.6979	-
第７計算期間末 （平成20年11月19日）	1,480	-	1.0593	-
平成21年１月末日	1,475	-	1.0265	-
平成21年２月末日	1,456	-	1.0097	-
平成21年３月末日	1,576	-	1.0436	-
平成21年４月末日	1,709	-	1.1147	-
平成21年５月末日	1,842	-	1.1726	-
平成21年６月末日	1,899	-	1.1991	-
平成21年７月末日	2,039	-	1.2341	-
平成21年８月末日	2,076	-	1.2494	-
平成21年９月末日	2,058	-	1.2225	-
平成21年10月末日	2,102	-	1.2246	-

	純資産総額（百万円）		1口当りの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第8計算期間末 （平成21年11月19日）	2,058	-	1.1968	-
平成21年11月末日	2,038	-	1.1845	-
平成21年12月末日	2,217	-	1.2644	-

（注）純資産総額は百万円未満切捨てて表記しております。

【分配の推移】

大和住銀DC年金設計ファンド30

該当事項はありません。

大和住銀DC年金設計ファンド50

該当事項はありません。

大和住銀DC年金設計ファンド70

該当事項はありません。

【収益率の推移】

大和住銀DC年金設計ファンド30

期間	収益率
第1期（平成13年9月21日～平成14年11月19日）	0.9%
第2期（平成14年11月20日～平成15年11月19日）	5.6%
第3期（平成15年11月20日～平成16年11月19日）	8.4%
第4期（平成16年11月20日～平成17年11月21日）	13.7%
第5期（平成17年11月22日～平成18年11月20日）	1.6%
第6期（平成18年11月21日～平成19年11月19日）	0.5%
第7期（平成19年11月20日～平成20年11月19日）	25.6%
第8期（平成20年11月20日～平成21年11月19日）	6.4%

（注）収益率＝（当計算期末分配付基準価額－前計算期末分配落基準価額）÷前計算期末分配落基準価額×100

大和住銀DC年金設計ファンド50

期間	収益率
第1期（平成13年9月21日～平成14年11月19日）	0.8%
第2期（平成14年11月20日～平成15年11月19日）	8.3%
第3期（平成15年11月20日～平成16年11月19日）	10.3%
第4期（平成16年11月20日～平成17年11月21日）	21.4%
第5期（平成17年11月22日～平成18年11月20日）	3.5%

期間	収益率
第 6 期（平成18年11月21日～平成19年11月19日）	1.0%
第 7 期（平成19年11月20日～平成20年11月19日）	32.7%
第 8 期（平成20年11月20日～平成21年11月19日）	10.1%

（注）収益率＝（当計算期末分配付基準価額－前計算期末分配落基準価額）÷前計算期末分配落基準価額×100

大和住銀DC年金設計ファンド70

期間	収益率
第 1 期（平成13年 9 月21日～平成14年11月19日）	1.3%
第 2 期（平成14年11月20日～平成15年11月19日）	10.8%
第 3 期（平成15年11月20日～平成16年11月19日）	13.5%
第 4 期（平成16年11月20日～平成17年11月21日）	29.4%
第 5 期（平成17年11月22日～平成18年11月20日）	5.0%
第 6 期（平成18年11月21日～平成19年11月19日）	0.6%
第 7 期（平成19年11月20日～平成20年11月19日）	37.6%
第 8 期（平成20年11月20日～平成21年11月19日）	13.0%

（注）収益率＝（当計算期末分配付基準価額－前計算期末分配落基準価額）÷前計算期末分配落基準価額×100

第二部【ファンドの詳細情報】

第1【ファンドの沿革】

平成13年9月21日 信託契約締結

平成13年9月21日 当ファンドの設定・運用開始

平成19年1月4日 投資信託振替制度へ移行

なお、投資対象である年金日本株式マザーファンドおよび年金日本債券マザーファンドは平成13年5月28日に、インターナショナル株式マザーファンドは平成11年7月30日に、インターナショナル債券マザーファンドは平成13年2月23日にそれぞれ設定され、運用が開始されています。

第2【手続等】

1【申込（販売）手続等】

(1) 当ファンドの取得申込者は、販売会社において申込期間における毎営業日にお申込みいただけます。お申込みの受付は原則として午後3時までとします。これらの受付時間を過ぎてからのお申込みは翌営業日の取扱いとします。

(2) 取得のお申込みは、確定拠出年金、これに類する前払退職金等の積立を目的とした定時定額購入等による取得のお申込みのみを対象としています。

(3) 申込価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。申込手数料はありません。当ファンドの申込単位は1口または1円の整数倍で販売会社毎に定めた単位です。

(4) 販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定の期間毎に定時定額購入（積立）を行うことができる場合があります。

* 販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。詳細については、販売会社にお問い合わせください。

(5) 確定拠出年金、またはこれに類する前払退職金等の積立を目的とした定時定額購入等を通じての取得のお申込みについては、当該定めに従うものとします。

（注）当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

2【換金（解約）手続等】

受益者は、販売会社に対して毎営業日に解約のお申込みをすることができます。解約の受付は原則として午後３時までとします。これらの受付時間を過ぎてからの解約請求は翌営業日の取扱いとします。

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することがあります。その場合、受益者は解約の受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、解約の受付の中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にその請求を受付けたものとして取扱うこととします。また、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求には制限を設ける場合があります。

< 解約請求による換金手続き >

受益者は、委託会社に1口または1円の整数倍で販売会社毎に定めた単位をもって解約を請求することができます。解約価額は、当該請求受付日の翌営業日の基準価額です（解約価額については、お申込みを受付けた販売会社までお問い合わせください。）。

解約代金の支払いは原則として解約請求を受付けた日から起算して5営業日目から販売会社の申込場所で支払われます。解約にかかる手数料はありません。

（注）当ファンドの換金請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

換金請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行うものとします。

受益証券をお手許で保有されている方は、換金のお申込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

第3【管理及び運営】

1【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。外国為替予約の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

< 主要投資対象の評価方法 >

有価証券等	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日の取引所の終値で評価します。 外国で取引される資産については、原則として基準価額計算日の前日とします。

公社債等	原則として、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。 ・日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者等の提示する価額 ・価格情報会社の提供する価額 残存期間が１年以内の公社債については、一部償却原価法により評価することができます。 外国で取引される資産については、原則として基準価額計算日の前日とします。
------	---

基準価額は、便宜上１万口あたりに換算した価額で表示されます。原則として委託会社の各営業日に計算され、翌日の日本経済新聞に掲載されます。また、お申込みの各販売会社または下記の照会先まで問い合わせることにより知ることができます。

大和住銀投信投資顧問株式会社

<インターネットホームページ> <http://www.daiwasbi.co.jp/>

<お電話によるお問い合わせ先> 受付窓口：（電話番号）0120-286104

受付時間：午前９時から午後５時まで（土、日、祝日除く。）

（２）【保管】

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、受益証券を発行しませんので、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

（３）【信託期間】

当ファンドの信託の期間は、信託契約締結日（平成13年９月21日）から、無期限とします。

ただし、信託期間の終了前に信託財産の純資産総額が30億円を下回ることとなった場合、あるいは信託期間終了前にこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、信託契約の解約の規定にしたがい、信託契約を解約し、この信託を終了させることができます（後記「（５）その他 信託契約の解約」をご参照ください。）。

（４）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎年11月20日から翌年11月19日までとします。前記にかかわらず各計算期間終了日に該当する日（以下、「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降最初の営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

信託契約の解約

イ．委託会社は、信託契約の一部を解約することにより、信託財産の純資産総額が30億

円を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、あらかじめ、監督官庁に届け出ることにより、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

ロ．委託会社は、信託期間終了前にこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁へ届け出ます。

ハ．信託契約を解約し信託を終了させる場合、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつその旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

ニ．前ハ．の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は、1月を下らないものとします。また、信託契約の解約を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、法令に基づき、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

ホ．前ニ．の一定の期間内に異議を申し出た受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前イ．および前ロ．の信託契約の解約をしません。

ヘ．委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

ト．前ニ．から前ヘ．までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前ニ．の一定の期間が1月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

チ．信託契約の解約時の償還価額は、信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した額となります。償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から受益証券と引換えに当該受益者に支払います。受益者が償還金の支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、時効によりその権利を失います。

信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。また、委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、信託約款の変更の規定にしたがいます。

委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し信託を終了させるものとします。

ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、当該約款変更について異議を申し出た受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超える場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の変更の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

イ．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更できるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。委託会社は、信託約款の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、当ファンドの信託約款にかかる知られたる受益者に対してこれらの事項を記載した書面を交付します。ただし、当ファンドの信託約款にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

ロ．前イ．の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は、1月を下らないものとします。また、信託約款の変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、法令に基づき、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

ハ．前ロ．の一定の期間内に異議を申し出た受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前イ．の信託約款の変更をしません。

ニ．委託会社は、この信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

反対者の買取請求権

信託契約の解約または信託約款の変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、法令に基づき、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

運用にかかる報告等開示方法

委託会社は、決算日から3ヵ月以内に有価証券報告書を、半期該当日から3ヵ月以内に半期報告書を提出します。また、委託会社は決算時に運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者へ交付します。

（注）計算期間終了日を「決算日」ということがあります。

委託会社と関係法人との契約の変更

イ．募集・販売契約

委託会社と販売会社との間の募集・販売の取扱い等に関する契約は、当事者の別段の意思表示のない限り、1年毎に自動的に更新されます。募集・販売の取扱い等に関する契約は、当事者間の合意により変更することができます。なお、販売会社に異動があれば、委託会社は有価証券届出書の訂正届出書を提出します。

ロ．運用委託契約

委託会社とT・ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービシーズ・リミテッドとの間の運用委託契約には期限の定めがありません。運用委託契約は、当事者間の合意により変更することができます。なお、当ファンドの投資顧問会社に異動があれば、委託会社は、有価証券届出書の訂正届出書を提出します。

2【受益者の権利等】

当ファンドの受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。この受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。受益者の有する主な権利は次のとおりです。なお、信託約款には受益者集会に関する規定はありません。また、ファンド資産に生じた利益および損失は、全て受益者に帰属します。

（1）収益分配金に対する請求権

受益者は、収益分配金を持分にに応じて委託会社に請求する権利を有します。

収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から保有口数に応じて、販売会社を通じて決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。なお、信託約款に規定する時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。

上記にかかわらず、販売会社との間で締結した累積投資約款に基づく契約により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金を販売会社に交付します。この場合、販売会社は受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、信託約款の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金の請求権は、支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

（2）償還金に対する請求権

受益者は、償還金を持分に应じて委託会社に請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から受益者に支払われます。償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

償還金の請求権は、支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

（3）受益権の換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、解約の実行を販売会社を通じて委託会社に請求する権利を有しています。権利行使の方法等については、前述の「換金（解約）手続等」をご参照ください。

（4）帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求することができます。

（5）反対者の買取請求権

信託契約の解約または信託約款の変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、法令に基づき、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

第4【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載されている金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間（平成19年11月20日から平成20年11月19日まで）及び第8期計算期間（平成20年11月20日から平成21年

11月19日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【大和住銀DC年金設計ファンド30】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 平成20年11月19日現在	第8期 平成21年11月19日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,288,651,130	1,582,774,073
未収入金	-	41,126
流動資産合計	1,288,651,130	1,582,815,199
資産合計	1,288,651,130	1,582,815,199
負債の部		
流動負債		
未払解約金	52,952	41,126
未払受託者報酬	622,694	645,483
未払委託者報酬	6,383,074	6,616,722
その他未払費用	122,149	118,579
流動負債合計	7,180,869	7,421,910
負債合計	7,180,869	7,421,910
純資産の部		
元本等		
元本	1,285,763,120	1,485,003,286
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,292,859	90,390,003
（分配準備積立金）	47,096,923	43,498,184
元本等合計	1,281,470,261	1,575,393,289
純資産合計	1,281,470,261	1,575,393,289
負債純資産合計	1,288,651,130	1,582,815,199

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日	第8期 自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日
営業収益		
有価証券売買等損益	409,779,569	100,831,787
営業収益合計	409,779,569	100,831,787
営業費用		
受託者報酬	1,223,136	1,187,621
委託者報酬	12,537,931	12,174,035
その他費用	122,149	118,579
営業費用合計	13,883,216	13,480,235
営業利益又は営業損失（ ）	423,662,785	87,351,552
経常利益又は経常損失（ ）	423,662,785	87,351,552
当期純利益又は当期純損失（ ）	423,662,785	87,351,552
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	17,157,281	1,463,089
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	358,848,344	4,292,859
剰余金増加額又は欠損金減少額	90,451,561	8,794,399
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	259,909
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	90,451,561	8,534,490
剰余金減少額又は欠損金増加額	47,087,260	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	47,087,260	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,292,859	90,390,003

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第 7 期	第 8 期
	自 平成19年11月20日	自 平成20年11月20日
	至 平成20年11月19日	至 平成21年11月19日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左
２．収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。	有価証券売買等損益 同左

（貸借対照表に関する注記）

項目	第 7 期	第 8 期
	平成20年11月19日現在	平成21年11月19日現在
１．元本状況		
期首元本額	1,055,529,801円	1,285,763,120円
期中追加設定元本額	373,468,531円	305,461,538円
期中一部解約元本額	143,235,212円	106,221,372円
２．受益権の総数	1,285,763,120口	1,485,003,286口
３．元本の欠損	4,292,859円	-

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第 7 期	第 8 期
自 平成19年11月20日	自 平成20年11月20日
至 平成20年11月19日	至 平成21年11月19日
１．親投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 952,541円	１．親投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 884,083円
２．分配金の計算過程 該当事項はありません。	２．分配金の計算過程 該当事項はありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第 7 期（自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日）

種類	貸借対照表計上額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,288,651,130	378,440,208
合計	1,288,651,130	378,440,208

第 8 期（自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日）

種類	貸借対照表計上額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,582,774,073	87,818,516
合計	1,582,774,073	87,818,516

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

第7期（自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日）

該当事項はありません。

第8期（自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第7期（自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日）

該当事項はありません。

第8期（自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

第7期 平成20年11月19日現在	第8期 平成21年11月19日現在
1口当たり純資産額 0.9967円 「1口＝1円（10,000口＝9,967円）」	1口当たり純資産額 1.0609円 「1口＝1円（10,000口＝10,609円）」

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

< 株式以外の有価証券 >

株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	親投資信託	年金日本株式マザーファンド	417,565,762	368,293,002	
	受益証券				
	親投資信託	年金日本債券マザーファンド	981,326,689	972,494,748	
	受益証券				
	親投資信託	インターナショナル株式マザーファンド	68,872,980	85,857,056	
	受益証券				
	親投資信託	インターナショナル債券マザーファンド	90,767,553	156,129,267	
	受益証券				
合計（日本）4銘柄			1,558,532,984	1,582,774,073	

【大和住銀DC年金設計ファンド50】
（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 平成20年11月19日現在	第8期 平成21年11月19日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	2,047,312,741	2,663,184,814
未収入金	-	72,906
流動資産合計	2,047,312,741	2,663,257,720
資産合計	2,047,312,741	2,663,257,720
負債の部		
流動負債		
未払解約金	295,020	190,837
未払受託者報酬	1,050,218	1,086,592
未払委託者報酬	13,390,860	13,854,397
その他未払費用	207,189	196,134
流動負債合計	14,943,287	15,327,960
負債合計	14,943,287	15,327,960
純資産の部		
元本等		
元本	2,006,546,343	2,375,140,046
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	25,823,111	272,789,714
（分配準備積立金）	112,038,213	103,253,300
元本等合計	2,032,369,454	2,647,929,760
純資産合計	2,032,369,454	2,647,929,760
負債純資産合計	2,047,312,741	2,663,257,720

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日	第8期 自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日
営業収益		
有価証券売買等損益	913,103,202	248,714,849
営業収益合計	913,103,202	248,714,849
営業費用		
受託者報酬	2,073,724	1,963,011
委託者報酬	26,441,043	25,029,244
その他費用	207,189	196,134
営業費用合計	28,721,956	27,188,389
営業利益又は営業損失（ ）	941,825,158	221,526,460
経常利益又は経常損失（ ）	941,825,158	221,526,460
当期純利益又は当期純損失（ ）	941,825,158	221,526,460
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	32,588,753	9,091,207
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	823,331,609	25,823,111
剰余金増加額又は欠損金減少額	199,764,161	37,389,749
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	199,764,161	37,389,749
剰余金減少額又は欠損金増加額	88,036,254	2,858,399
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	88,036,254	2,858,399
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	25,823,111	272,789,714

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第 7 期	第 8 期
	自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日	自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左
２．収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。	有価証券売買等損益 同左

（貸借対照表に関する注記）

項目	第 7 期	第 8 期
	平成20年11月19日現在	平成21年11月19日現在
１．元本状況		
期首元本額	1,628,813,942円	2,006,546,343円
期中追加設定元本額	557,795,727円	545,720,178円
期中一部解約元本額	180,063,326円	177,126,475円
２．受益権の総数	2,006,546,343口	2,375,140,046口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第 7 期	第 8 期
自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日	自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日
１．親投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 2,811,501円	１．親投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 2,596,668円
２．分配金の計算過程 該当事項はありません。	２．分配金の計算過程 該当事項はありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第 7 期（自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日）

種類	貸借対照表計上額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,047,312,741	851,408,064
合計	2,047,312,741	851,408,064

第 8 期（自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日）

種類	貸借対照表計上額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,663,184,814	238,425,284
合計	2,663,184,814	238,425,284

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

第 7 期（自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日）

該当事項はありません。

第 8 期（自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
第 7 期（自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日）
該当事項はありません。

第 8 期（自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日）
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

第 7 期 平成20年11月19日現在	第 8 期 平成21年11月19日現在
1 口当たり純資産額 1.0129円 「 1 口 = 1 円 (10,000口 = 10,129円) 」	1 口当たり純資産額 1.1149円 「 1 口 = 1 円 (10,000口 = 11,149円) 」

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

< 株式以外の有価証券 >

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	親投資信託 受益証券	年金日本株式マザーファンド	1,049,819,720	925,940,993	
	親投資信託 受益証券	年金日本債券マザーファンド	1,033,271,701	1,023,972,255	
	親投資信託 受益証券	インターナショナル株式マザーファンド	360,693,517	449,640,538	
	親投資信託 受益証券	インターナショナル債券マザーファンド	153,264,943	263,631,028	
	合計（日本）4 銘柄		2,597,049,881	2,663,184,814	

【大和住銀DC年金設計ファンド70】
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 平成20年11月19日現在	第8期 平成21年11月19日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,494,256,380	2,072,293,700
流動資産合計	1,494,256,380	2,072,293,700
資産合計	1,494,256,380	2,072,293,700
負債の部		
流動負債		
未払解約金	405,961	357,029
未払受託者報酬	805,814	846,166
未払委託者報酬	12,289,301	12,904,852
その他未払費用	160,859	148,832
流動負債合計	13,661,935	14,256,879
負債合計	13,661,935	14,256,879
純資産の部		
元本等		
元本	1,397,770,362	1,719,579,513
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	82,824,083	338,457,308
（分配準備積立金）	98,462,090	89,077,692
元本等合計	1,480,594,445	2,058,036,821
純資産合計	1,480,594,445	2,058,036,821
負債純資産合計	1,494,256,380	2,072,293,700

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日	第8期 自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日
営業収益		
有価証券売買等損益	826,940,856	235,197,224
営業収益合計	826,940,856	235,197,224
営業費用		
受託者報酬	1,610,408	1,489,973
委託者報酬	24,560,053	22,723,538
その他費用	160,859	148,832
営業費用合計	26,331,320	24,362,343
営業利益又は営業損失（　）	853,272,176	210,834,881
経常利益又は経常損失（　）	853,272,176	210,834,881
当期純利益又は当期純損失（　）	853,272,176	210,834,881
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（　）	43,028,469	10,365,830
期首剰余金又は期首欠損金（　）	807,700,221	82,824,083
剰余金増加額又は欠損金減少額	230,277,084	65,093,452
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	230,277,084	65,093,452
剰余金減少額又は欠損金増加額	144,909,515	9,929,278
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	144,909,515	9,929,278
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（　）	82,824,083	338,457,308

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第 7 期	第 8 期
	自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日	自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左
２．収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。	有価証券売買等損益 同左

（貸借対照表に関する注記）

項目	第 7 期	第 8 期
	平成20年11月19日現在	平成21年11月19日現在
１．元本状況		
期首元本額	1,157,379,298円	1,397,770,362円
期中追加設定元本額	453,744,672円	475,417,177円
期中一部解約元本額	213,353,608円	153,608,026円
２．受益権の総数	1,397,770,362口	1,719,579,513口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第 7 期	第 8 期
自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日	自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日
１．親投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 2,608,471円	１．親投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 2,459,772円
２．分配金の計算過程 該当事項はありません。	２．分配金の計算過程 該当事項はありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第 7 期（自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日）

種類	貸借対照表計上額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,494,256,380	768,828,740
合計	1,494,256,380	768,828,740

第 8 期（自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日）

種類	貸借対照表計上額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,072,293,700	223,188,602
合計	2,072,293,700	223,188,602

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

第 7 期（自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日）

該当事項はありません。

第 8 期（自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
第 7 期（自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日）
該当事項はありません。

第 8 期（自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日）
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

第 7 期 平成20年11月19日現在	第 8 期 平成21年11月19日現在
1口当たり純資産額 1.0593円 「 1口 = 1円（10,000口 = 10,593円）」	1口当たり純資産額 1.1968円 「 1口 = 1円（10,000口 = 11,968円）」

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

< 株式以外の有価証券 >

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	親投資信託	年金日本株式マザーファンド	1,122,569,202	990,106,036	
	受益証券				
	親投資信託	年金日本債券マザーファンド	408,505,207	404,828,660	
	受益証券				
	親投資信託	インターナショナル株式マザーファンド	376,386,215	469,203,055	
	受益証券				
	親投資信託	インターナショナル債券マザーファンド	121,013,865	208,155,949	
	受益証券				
	合計（日本）4銘柄		2,028,474,489	2,072,293,700	

[次へ](#)

< 参考 >

当ファンドは、「年金日本株式マザーファンド」、「年金日本債券マザーファンド」、「インターナショナル株式マザーファンド」及び「インターナショナル債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券であります。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

財務諸表

年金日本株式マザーファンド

(1) 貸借対照表

区 分	平成20年11月19日現在 金 額（円）	平成21年11月19日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,095,582,868	1,482,819,394
株式	50,510,657,500	54,486,681,300
未収入金	582,511,717	661,924,809
未収配当金	554,211,216	423,354,988
流動資産合計	52,742,963,301	57,054,780,491
資産合計	52,742,963,301	57,054,780,491
負債の部		
流動負債		
未払金	537,839,195	509,953,716
未払解約金	1,176,326	11,141,809
流動負債合計	539,015,521	521,095,525
負債合計	539,015,521	521,095,525
純資産の部		
元本等		
元本	64,351,897,270	64,099,519,008
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	12,147,949,490	7,565,834,042
元本等合計	52,203,947,780	56,533,684,966
純資産合計	52,203,947,780	56,533,684,966
負債純資産合計	52,742,963,301	57,054,780,491

[次へ](#)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成19年11月20日	自 平成20年11月20日
	至 平成20年11月19日	至 平成21年11月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等の提示する気配相場に基づいて評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	株式 同左 同左
2. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 国内株式についての受取配当金は、原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。	(1)受取配当金 同左 (2)有価証券売買等損益 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成20年11月19日現在	平成21年11月19日現在
1. 元本状況		
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	58,720,726,730円	64,351,897,270円
期中追加設定元本額	12,987,793,813円	7,226,279,678円
期中一部解約元本額	7,356,623,273円	7,478,657,940円
元本の内訳		
大和住銀DC日本株式ファンド	7,572,170,649円	8,552,257,177円
大和住銀DC年金設計ファンド30	416,925,086円	417,565,762円
大和住銀DC年金設計ファンド50	901,044,931円	1,049,819,720円
大和住銀DC年金設計ファンド70	924,433,422円	1,122,569,202円
大和住銀ライフプラン・バランス30	2,222,207円	2,215,713円
大和住銀ライフプラン・バランス50	5,443,648円	6,480,976円
大和住銀ライフプラン・バランス70	5,251,825円	5,345,297円
大和住銀DC国内株式ファンド	520,639,419円	887,489,255円
大和住銀年金専用日本株式F-1（適格機関投資家限定）	29,313,883,421円	27,990,037,466円
大和住銀日本株式ファンドVA（適格機関投資家限定）	24,000,140,074円	23,375,217,472円
大和住銀年金設計ファンド30VA（適格機関投資家専用）	9,657,997円	9,280,737円
大和住銀年金設計ファンド50VA（適格機関投資家専用）	24,091,493円	28,275,005円
大和住銀年金設計ファンド70VA（適格機関投資家専用）	8,550,456円	10,521,490円
大和住銀バランスファンド60（適格機関投資家限定）	548,539,221円	529,223,371円
大和住銀世界資産バランスVA（適格機関投資家限定）	98,903,421円	113,220,365円
合計	64,351,897,270円	64,099,519,008円
2. 受益権の総数	64,351,897,270口	64,099,519,008口
3. 元本の欠損	12,147,949,490円	7,565,834,042円

（有価証券に関する注記）
 売買目的有価証券
 （平成20年11月19日現在）

種類	貸借対照表計上額（円）	計算期間 の損益に 含まれた評価差額（円）
株 式	50,510,657,500	22,237,687,666
合計	50,510,657,500	22,237,687,666

「計算期間」とは、「年金日本株式マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成20年1月29日から平成20年11月19日まで）を指しております。

（平成21年11月19日現在）

種類	貸借対照表計上額（円）	計算期間 の損益に 含まれた評価差額（円）
株 式	54,486,681,300	1,641,797,459
合計	54,486,681,300	1,641,797,459

「計算期間」とは、「年金日本株式マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成21年1月28日から平成21年11月19日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
 （自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日）
 該当事項はありません。

（自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日）
 該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
 （自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日）
 該当事項はありません。

（自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日）
 該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成20年11月19日現在	平成21年11月19日現在
1口当たり純資産額 0.8112円 「1口 = 1円（10,000口 = 8,112円）」	1口当たり純資産額 0.8820円 「1口 = 1円（10,000口 = 8,820円）」

（３）附属明細表

有価証券明細表

<株式>

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
円	清水建設	845,000	310	261,950,000	
	大和ハウス工業	828,000	893	739,404,000	
	きんでん	315,000	754	237,510,000	
	キリンホールディングス	324,000	1,393	451,332,000	
	味の素	490,000	800	392,000,000	
	東洋水産	115,000	2,360	271,400,000	
	日本たばこ産業	2,665	248,100	661,186,500	
	グンゼ	199,000	326	64,874,000	
	レンゴー	904,000	549	496,296,000	
	クラレ	172,500	1,018	175,605,000	
	日産化学工業	949,000	1,174	1,114,126,000	
	トクヤマ	523,000	505	264,115,000	
	信越化学工業	87,300	4,680	408,564,000	
	J S R	176,100	1,634	287,747,400	
	三菱ケミカルホールディングス	887,000	294	260,778,000	
	日立化成工業	614,100	1,680	1,031,688,000	
	武田薬品工業	169,000	3,550	599,950,000	
	アステラス製薬	241,200	3,280	791,136,000	
	塩野義製薬	130,900	1,828	239,285,200	
	田辺三菱製薬	350,000	1,060	371,000,000	
	参天製薬	101,700	2,725	277,132,500	
	第一三共	78,800	1,719	135,457,200	
	新日鉱ホールディングス	1,848,500	344	635,884,000	
	ブリヂストン	300,400	1,413	424,465,200	
	日本電気硝子	916,000	991	907,756,000	
	ジェイ エフ イー ホールディングス	311,800	2,885	899,543,000	
	日本冶金工業	1,059,000	348	368,532,000	
	住友電気工業	724,300	1,023	740,958,900	
	アマダ	316,000	500	158,000,000	
	小松製作所	390,200	1,725	673,095,000	
	住友重機械工業	674,000	404	272,296,000	
	クボタ	202,000	763	154,126,000	
	日本精工	1,876,000	572	1,073,072,000	
	コニカミノルタホールディングス	1,290,000	823	1,061,670,000	
	ミネベア	1,837,000	422	775,214,000	
	東芝	863,000	461	397,843,000	
	三菱電機	1,553,000	601	933,353,000	
	ソニー	187,400	2,470	462,878,000	
	スタンレー電気	150,000	1,686	252,900,000	
	ウシオ電機	76,200	1,438	109,575,600	
	ファナック	104,200	7,530	784,626,000	
	京セラ	113,800	7,110	809,118,000	
	村田製作所	78,700	3,970	312,439,000	
	パナソニック電工	1,153,000	991	1,142,623,000	
	キヤノン	337,100	3,350	1,129,285,000	
	東京エレクトロン	254,100	5,010	1,273,041,000	
	デンソー	281,500	2,430	684,045,000	
	東海理化電機製作所	298,100	1,740	518,694,000	
	トヨタ自動車	751,300	3,490	2,622,037,000	
	ダイハツ工業	270,000	815	220,050,000	
	本田技研工業	413,200	2,740	1,132,168,000	
	シチズンホールディングス	617,200	492	303,662,400	
	タカラトミー	78,600	784	61,622,400	
	任天堂	32,600	22,200	723,720,000	
	東京瓦斯	5,158,000	345	1,779,510,000	
	東日本旅客鉄道	186,600	5,820	1,086,012,000	
	東海旅客鉄道	1,495	588,000	879,060,000	
	全日本空輸	1,071,000	228	244,188,000	
	ネットワンシステムズ	2,374	104,500	248,083,000	

日本テレビ放送網	40,770	12,100	493,317,000	
日本電信電話	596,600	3,660	2,183,556,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	10,208	129,700	1,323,977,600	
東宝	86,800	1,348	117,006,400	
第一興商	222,800	1,040	231,712,000	
丸紅	1,160,000	449	520,840,000	
三井物産	1,153,600	1,145	1,320,872,000	
三菱商事	879,400	1,905	1,675,257,000	
ローソン	112,600	4,060	457,156,000	
J．フロント リテイリング	644,000	381	245,364,000	
マツモトキヨシホールディングス	82,000	2,180	178,760,000	
ドン・キホーテ	90,900	2,255	204,979,500	
西松屋チェーン	239,100	822	196,540,200	
コメリ	96,900	2,455	237,889,500	
プレナス	124,300	1,166	144,933,800	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	3,210,700	466	1,496,186,200	
中央三井トラスト・ホールディングス	2,647,000	301	796,747,000	
横浜銀行	1,206,000	430	518,580,000	
住友信託銀行	2,568,000	443	1,137,624,000	
紀陽ホールディングス	1,329,000	110	146,190,000	
野村ホールディングス	1,283,500	585	750,847,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,508,000	293	441,844,000	
三井住友海上グループホールディングス	181,400	2,220	402,708,000	
東京海上ホールディングス	380,900	2,390	910,351,000	
オリックス	150,060	5,920	888,355,200	
野村不動産ホールディングス	405,000	1,223	495,315,000	
東急不動産	1,206,000	290	349,740,000	
ディー・エヌ・エー	518	377,000	195,286,000	
みらかホールディングス	31,700	2,745	87,016,500	
ダスキン	60,800	1,629	99,043,200	
ラウンドワン	258,300	538	138,965,400	
ベネッセホールディングス	81,900	3,810	312,039,000	
合計（日本）91銘柄	56,329,690	-	54,486,681,300	

[前へ](#) [次へ](#)

年金日本債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

区 分	平成20年11月19日現在 金 額（円）	平成21年11月19日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	249,552,509	172,852,453
国債証券	10,681,189,140	9,648,278,720
特殊債券	-	392,856,420
社債券	5,662,754,500	4,592,903,900
派生商品評価勘定	2,857,060	2,247,060
未収利息	72,188,916	60,321,443
前払費用	2,681,093	7,282,542
差入委託証拠金	2,860,000	1,200,000
流動資産合計	16,674,083,218	14,877,942,538
資産合計	16,674,083,218	14,877,942,538
負債の部		
流動負債		
前受金	2,420,000	2,350,000
未払解約金	-	53,838
流動負債合計	2,420,000	2,403,838
負債合計	2,420,000	2,403,838
純資産の部		
元本等		
元本	17,194,100,882	15,010,290,694
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	522,437,664	134,751,994
元本等合計	16,671,663,218	14,875,538,700
純資産合計	16,671,663,218	14,875,538,700
負債純資産合計	16,674,083,218	14,877,942,538

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成19年11月20日	自 平成20年11月20日
	至 平成20年11月19日	至 平成21年11月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は採用しない）又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	国債証券、特殊債券及び社債券 同左 同左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。	同左
3. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。	有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成20年11月19日現在	平成21年11月19日現在
1. 元本状況		
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	28,696,977,734円	17,194,100,882円
期中追加設定元本額	5,121,918,139円	1,243,703,308円
期中一部解約元本額	16,624,794,991円	3,427,513,496円
元本の内訳		
大和住銀DC日本債券ファンド	90,855,169円	112,393,718円
大和住銀DC年金設計ファンド30	783,888,904円	981,326,689円
大和住銀DC年金設計ファンド50	881,866,958円	1,033,271,701円
大和住銀DC年金設計ファンド70	337,814,175円	408,505,207円
大和住銀ライフプラン・バランス30	4,623,436円	4,613,137円
大和住銀ライフプラン・バランス50	5,749,419円	7,099,002円
大和住銀ライフプラン・バランス70	1,661,405円	1,695,124円
大和住銀年金専用日本債券F-1（適格機関投資家限定）	13,360,450,850円	10,576,640,641円
大和住銀日本債券ファンドVA（適格機関投資家限定）	1,259,720,207円	1,384,265,094円
大和住銀年金設計ファンド30VA（適格機関投資家専用）	19,254,126円	18,282,663円
大和住銀年金設計ファンド50VA（適格機関投資家専用）	23,747,734円	27,885,896円
大和住銀年金設計ファンド70VA（適格機関投資家専用）	2,657,989円	3,366,239円
大和住銀バランスファンド60（適格機関投資家限定）	379,566,402円	394,287,408円
大和住銀世界資産バランスVA（適格機関投資家限定）	42,244,108円	56,658,175円
合計	17,194,100,882円	15,010,290,694円
2. 受益権の総数	17,194,100,882口	15,010,290,694口
3. 元本の欠損	522,437,664円	134,751,994円

（有価証券に関する注記）
 売買目的有価証券
 （平成20年11月19日現在）

種類	貸借対照表計上額（円）	計算期間 の損益に 含まれた評価差額（円）
国 債 証 券	10,681,189,140	173,081,940
社 債 券	5,662,754,500	372,354,700
合計	16,343,943,640	545,436,640

「計算期間」とは、「年金日本債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成20年1月29日から平成20年11月19日まで）を指しております。

（平成21年11月19日現在）

種類	貸借対照表計上額（円）	計算期間 の損益に 含まれた評価差額（円）
国 債 証 券	9,648,278,720	61,262,310
特 殊 債 券	392,856,420	2,288,420
社 債 券	4,592,903,900	79,792,746
合計	14,634,039,040	143,343,476

「計算期間」とは、「年金日本債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成21年1月28日から平成21年11月19日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
 取引の状況に関する事項

項目	自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日	自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日
1．取引の内容	当ファンドは債券先物取引を行っております。	同左
2．取引に対する取組方針	債券先物取引につきましては、投資信託約款上の投資制限を遵守しております。	同左
3．取引の利用目的	デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しております。	同左
4．取引に係るリスクの内容	債券先物取引は、相場変動によるリスク（価格変動リスク）を有しております。また、債券先物取引は、相手方の契約不履行によるリスク（信用リスク）を有しております。	同左
5．取引に係るリスク管理体制	価格変動リスクについては、運用者および管理者が日々のポジションや評価損益等を含め、投資信託財産全体を総合的に管理しております。また、運用から独立したリスク管理組織が事後的にチェックを行う、ダブル・チェック体制をとっております。信用リスクについては、ブローカー選定委員会等を通じて、取引の相手方に対するチェックを行っております。	同左
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。	同左

取引の時価等に関する事項

（債券関連）

区分	種類	平成20年11月19日現在			
		契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引 買建 長期国債先物	274,802,940	-	277,660,000	2,857,060
合計		-	-	277,660,000	2,857,060

区分	種類	平成21年11月19日現在			
		契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引 買建 長期国債先物	276,252,940	-	278,500,000	2,247,060
合計		-	-	278,500,000	2,247,060

評価損益は、「年金日本債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応するものです。

（注）時価の算定方法

- 1）先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 2）期末の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段等を用いております。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日）

該当事項はありません。

（自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成20年11月19日現在	平成21年11月19日現在
1口当たり純資産額 0.9696円 「1口＝1円（10,000口＝9,696円）」	1口当たり純資産額 0.9910円 「1口＝1円（10,000口＝9,910円）」

（3）附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
円	国債証券	70 5年国債	540,000,000	547,594,560	
	国債証券	37 15年国債FR	250,000,000	242,375,000	
	国債証券	264 10年国債	530,000,000	553,194,920	
	国債証券	264 10年国債	200,000,000	208,752,800	
	国債証券	264 10年国債	500,000,000	521,882,000	

国債証券	264 10年国債	200,000,000	208,752,800	
国債証券	264 10年国債	200,000,000	208,752,800	
国債証券	264 10年国債	150,000,000	156,564,600	
国債証券	264 10年国債	250,000,000	260,941,000	
国債証券	289 10年国債	310,000,000	321,113,810	
国債証券	289 10年国債	300,000,000	310,755,300	
国債証券	289 10年国債	250,000,000	258,962,750	
国債証券	289 10年国債	100,000,000	103,585,100	
国債証券	289 10年国債	150,000,000	155,377,650	
国債証券	289 10年国債	100,000,000	103,585,100	
国債証券	289 10年国債	400,000,000	414,340,400	
国債証券	289 10年国債	120,000,000	124,302,120	
国債証券	289 10年国債	250,000,000	258,962,750	
国債証券	289 10年国債	180,000,000	186,453,180	
国債証券	289 10年国債	100,000,000	103,585,100	
国債証券	301 10年国債	200,000,000	204,104,400	
国債証券	301 10年国債	50,000,000	51,026,100	
国債証券	301 10年国債	300,000,000	306,156,600	
国債証券	301 10年国債	100,000,000	102,052,200	
国債証券	301 10年国債	300,000,000	306,156,600	
国債証券	301 10年国債	250,000,000	255,130,500	
国債証券	301 10年国債	100,000,000	102,052,200	
国債証券	301 10年国債	120,000,000	122,462,640	
国債証券	13 30年国債	490,000,000	476,070,280	
国債証券	13 30年国債	290,000,000	281,755,880	
国債証券	13 30年国債	300,000,000	291,471,600	
国債証券	13 30年国債	80,000,000	77,725,760	
国債証券	69 20年国債	300,000,000	313,828,500	
国債証券	105 20年国債	320,000,000	323,934,720	
国債証券	105 20年国債	300,000,000	303,688,800	
国債証券	105 20年国債	100,000,000	101,229,600	
国債証券	12 物価連動国債	220,000,000	209,160,600	
国債証券	12 物価連動国債	600,000,000	570,438,000	
特殊債券	S14 住宅機構RMBS	190,568,000	192,588,020	
特殊債券	5 中小企業銀行	200,000,000	200,268,400	
社債券	1 テレフオニカヨーロッパFR	200,000,000	189,548,000	
社債券	62 新日本製鐵	100,000,000	101,612,600	
社債券	24 富士通	200,000,000	203,847,200	
社債券	20 三洋電機	100,000,000	102,486,700	
社債券	1 日東電工	100,000,000	101,353,000	
社債券	48 日産自動車	100,000,000	99,914,500	
社債券	49 日産自動車	100,000,000	99,842,800	
社債券	50 伊藤忠商事	200,000,000	203,933,200	
社債券	70 丸紅	100,000,000	101,814,500	
社債券	2 荘内銀行劣後FR	100,000,000	97,067,000	
社債券	2 荘内銀行劣後FR	300,000,000	291,201,000	
社債券	39 トヨタファイナンス	200,000,000	203,292,800	
社債券	15 ポケットカード	300,000,000	282,579,600	
社債券	1 東日本BK劣後FR	300,000,000	297,870,000	
社債券	1 トマト銀行劣後FR	100,000,000	87,130,000	
社債券	51 アコム	400,000,000	354,361,600	
社債券	38 プロミス	200,000,000	162,200,200	
社債券	39 プロミス	300,000,000	217,187,400	
社債券	1-A 日本生命2009	200,000,000	202,366,000	
社債券	52 住友不動産	100,000,000	99,113,800	
社債券	1 イー・アクセス	200,000,000	197,777,400	
社債券	1-A ビア・スリー・ファンディング	30,435,000	29,217,600	
社債券	HNDA FL 06/25/12	200,000,000	197,224,000	
社債券	JWBSF FR 1911	100,000,000	95,709,000	
社債券	JWBSF FR 1911	200,000,000	191,418,000	
社債券	JWBSF FR 1911	200,000,000	191,418,000	
社債券	JWBSF FR 1911	200,000,000	191,418,000	
合計（日本）34銘柄		14,721,003,000	14,634,039,040	

デリバティブ取引の契約額等及び時価の状況表

注記表中の(デリバティブ取引等関係に関する注記) 取引の時価等に関する事項で記載しており、ここでは省略しております。

[前へ](#) [次へ](#)

インターナショナル株式マザーファンド

(1) 貸借対照表

区 分	平成20年11月19日現在 金 額（円）	平成21年11月19日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	2,590,811,587	467,504,892
コール・ローン	401,321,716	514,224,088
株式	23,410,009,191	36,668,326,512
派生商品評価勘定	30,143	2,181,188
未収入金	268,013,017	849,396,052
未収配当金	14,375,330	21,156,214
流動資産合計	26,684,560,984	38,522,788,946
資産合計	26,684,560,984	38,522,788,946
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	904,394	2,055,369
未払金	333,617,652	326,053,463
未払解約金	-	30,594,804
流動負債合計	334,522,046	358,703,636
負債合計	334,522,046	358,703,636
純資産の部		
元本等		
元本	30,900,102,278	30,615,119,570
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,550,063,340	7,548,965,740
元本等合計	26,350,038,938	38,164,085,310
純資産合計	26,350,038,938	38,164,085,310
負債純資産合計	26,684,560,984	38,522,788,946

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成19年11月20日	自 平成20年11月20日
	至 平成20年11月19日	至 平成21年11月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等の提示する気配相場に基づいて評価しております。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	株式 同左 同左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。	同左
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 外国株式についての受取配当金は、原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 (2)有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。	(1)受取配当金 同左 (2)有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益 同左
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条及び第61条に基づいております。	外貨建資産等の会計処理 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成20年11月19日現在	平成21年11月19日現在
1. 元本状況		
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	23,859,489,196円	30,900,102,278円
期中追加設定元本額	13,119,153,805円	9,184,163,789円
期中一部解約元本額	6,078,540,723円	9,469,146,497円
元本の内訳		
大和住銀グローバルバランスファンド	606,333,150円	522,189,821円
大和住銀DC外国株式ファンド	3,833,676,188円	5,256,853,204円
大和住銀DC年金設計ファンド30	70,884,481円	68,872,980円
大和住銀DC年金設計ファンド50	306,817,548円	360,693,517円
大和住銀DC年金設計ファンド70	309,538,083円	376,386,215円
大和住銀ライフプラン・バランス30	354,239円	352,809円
大和住銀ライフプラン・バランス50	1,949,203円	2,297,379円
大和住銀ライフプラン・バランス70	1,764,064円	1,794,472円
大和住銀DC海外株式アクティブファンド	761,808,463円	1,026,262,984円
大和住銀グローバルバランスファンドVA	637,344,511円	570,845,258円
大和住銀/T・ロウ・ブライズ外国株式ファンドVA	6,321,098,605円	7,169,141,517円
大和住銀グローバルバランスファンドSVA	3,525,204,343円	3,239,691,031円
大和住銀外国株式ファンドMSVA（適格機関投資家限定）	13,112,008,879円	11,129,868,431円
大和住銀年金設計ファンド30VA（適格機関投資家専用）	1,577,099円	1,505,849円
大和住銀年金設計ファンド50VA（適格機関投資家専用）	8,243,482円	9,794,647円
大和住銀年金設計ファンド70VA（適格機関投資家専用）	2,876,810円	3,547,992円
大和住銀バランスファンド60（適格機関投資家限定）	241,484,029円	222,554,648円
大和住銀世界資産バランスVA（適格機関投資家限定）	117,433,687円	138,442,295円
T・ロウ・ブライズ外国株式オープン（FOFs用）（適格機関投資家専用）	1,039,705,414円	514,024,521円

合計	30,900,102,278円	30,615,119,570円
２．受益権の総数	30,900,102,278口	30,615,119,570口
３．元本の欠損	4,550,063,340円	-

（有価証券に関する注記）
 売買目的有価証券
 （平成20年11月19日現在）

種類	貸借対照表計上額（円）	計算期間 の損益に 含まれた評価差額（円）
株 式	23,410,009,191	10,647,520,671
合計	23,410,009,191	10,647,520,671

「計算期間」とは、「インターナショナル株式マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成20年7月8日から平成20年11月19日まで）を指しております。

（平成21年11月19日現在）

種類	貸借対照表計上額（円）	計算期間 の損益に 含まれた評価差額（円）
株 式	36,668,326,512	5,484,871,319
合計	36,668,326,512	5,484,871,319

「計算期間」とは、「インターナショナル株式マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成21年7月7日から平成21年11月19日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
 取引の状況に関する事項

項目	自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日	自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日
１．取引の内容	当ファンドは為替予約取引を行っております。	同左
２．取引に対する取組方針	為替予約取引につきましては、投資信託約款上の投資制限を遵守しております。	同左
３．取引の利用目的	デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しております。	同左
４．取引に係るリスクの内容	為替予約取引は、相場変動によるリスク（価格変動リスク）を有しております。また、為替予約取引は、相手方の契約不履行によるリスク（信用リスク）を有しております。	同左
５．取引に係るリスク管理体制	価格変動リスクについては、運用者および管理者が日々のポジションや評価損益等を含め、投資信託財産全体を総合的に管理しております。また、運用から独立したリスク管理組織が事後的にチェックを行う、ダブル・チェック体制をとっております。信用リスクについては、ブローカー選定委員会等を通じて、取引の相手方に対するチェックを行っております。	同左

6．取引の時価等に関する 事項についての補足説 明	該当事項はありません。	同左
---------------------------------	-------------	----

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

区分	種類	平成20年11月19日現在			
		契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	15,255,906	-	15,284,474	28,568
	イギリス・ポンド	42,088,613	-	41,809,680	278,933
	スイス・フラン	4,320,807	-	4,294,080	26,727
	ユーロ	69,398,557	-	68,830,689	567,868
	売建				
	アメリカ・ドル	131,007,977	-	131,030,398	22,421
	ユーロ	955,906	-	962,776	6,870
合計		-	-	262,212,097	874,251

区分	種類	平成21年11月19日現在			
		契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	420,439,552	-	419,789,482	650,070
	イギリス・ポンド	131,360,593	-	131,077,377	283,216
	ユーロ	16,978,550	-	17,015,574	37,024
	売建				
	アメリカ・ドル	148,339,143	-	148,460,102	120,959
	オーストラリア・ドル	140,734,458	-	139,700,693	1,033,765
	イギリス・ポンド	114,197,221	-	113,617,643	579,578
	スイス・フラン	19,160,182	-	19,249,572	89,390
	メキシコ・ペソ	20,758,512	-	20,776,700	18,188
	ユーロ	83,089,179	-	83,451,904	362,725
合計		-	-	1,093,139,047	125,819

評価損益は、「インターナショナル株式マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応するものです。

（注）時価の算定方法

A．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きましては、以下のように評価しております。

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には、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。

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

- ・計算期間末日に当該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、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

B．計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨につきましては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成19年11月20日 至 平成21年11月19日）

該当事項はありません。

（自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成20年11月19日現在	平成21年11月19日現在
1口当たり純資産額 0.8527円 「1口 = 1円（10,000口 = 8,527円）」	1口当たり純資産額 1.2466円 「1口 = 1円（10,000口 = 12,466円）」

（3）附属明細表

有価証券明細表

<株式>

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	

アメリカ・ドル	ACCENTURE PLC-CL A	172,700	40.000	6,908,000.000	
	AMAZON.COM INC	69,600	131.290	9,137,784.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV-ADR SERIES L	220,600	48.070	10,604,242.000	
	AON CORP	76,800	40.040	3,075,072.000	
	APPLE INC	66,700	205.960	13,737,532.000	
	AUTODESK INC	123,700	24.200	2,993,540.000	
	BAIDU INC - SPON ADR	7,300	435.120	3,176,376.000	
	BAKER HUGHES INC	103,300	42.210	4,360,293.000	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	58,500	55.680	3,257,280.000	
	BED BATH & BEYOND INC	125,300	37.390	4,684,967.000	
	CELGENE CORP	84,800	55.270	4,686,896.000	
	CEPHALON INC	67,800	60.230	4,083,594.000	
	EDWARDS LIFESCIENCES	31,000	81.800	2,535,800.000	
	ELAN CORP PLC -SPONS ADR	310,508	6.690	2,077,298.520	
	EOG RESOURCES INC	51,200	88.740	4,543,488.000	
	FIFTH THIRD BANCORP	486,100	10.160	4,938,776.000	
	GILEAD SCIENCES INC	202,200	46.780	9,458,916.000	
	GOLDMAN SACHS	32,300	176.900	5,713,870.000	
	GOOGLE INC-CL A	24,000	576.650	13,839,600.000	
	JANUS CAPITAL GROUP INC	147,100	13.800	2,029,980.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	431,100	43.380	18,701,118.000	
	JUNIPER NETWORKS INC	463,700	25.600	11,870,720.000	
	KEYCORP	218,000	5.940	1,294,920.000	
	LOWE'S COS INC	333,000	21.590	7,189,470.000	
	MASTERCARD INC-CLASS A	34,800	227.280	7,909,344.000	
	MICROSOFT CORP	174,800	30.110	5,263,228.000	
	MURPHY OIL CORP	107,200	59.660	6,395,552.000	
	NIKE INC	115,900	64.420	7,466,278.000	
	NORTHERN TRUST CORP	123,300	48.680	6,002,244.000	
	OAQ GAZPROM	182,167	25.700	4,681,691.900	
	PETROLEO BRASILEIRO S.A. -ADR	136,700	44.940	6,143,298.000	
	PRAXAIR INC	55,300	83.880	4,638,564.000	
	QUALCOMM INC	152,300	45.490	6,928,127.000	
	RED HAT INC	104,300	28.360	2,957,948.000	
	SCHLUMBERGER LTD	70,800	66.710	4,723,068.000	
	SMITH INTERNATIONAL INC	135,500	27.580	3,737,090.000	
	TAM SA-SPONSORED ADR	171,400	16.450	2,819,530.000	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	214,900	21.260	4,568,774.000	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	88,300	53.060	4,685,198.000	
	VALE SA-SP PREF ADR	188,000	25.030	4,705,640.000	
	WAL-MART STORES INC	240,500	54.150	13,023,075.000	
	WELLPOINT INC	178,400	52.410	9,349,944.000	
	YUM! BRANDS INC	191,300	35.910	6,869,583.000	
	小計（アメリカ・ドル）43銘柄	6,573,175	-	267,767,709.420	
				(23,908,978,774)	
オーストラリア・ドル	RIO TINTO LTD	35,270	72.600	2,560,602.000	
	小計（オーストラリア・ドル）1銘柄	35,270	-	2,560,602.000	
				(211,812,997)	
香港・ドル	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	5,623,000	7.340	41,272,820.000	
	HUTCHISON TELECOMMUNICATIONS	1,974,000	1.610	3,178,140.000	
	HUTCHISON TELECOMMUNICATIONS HK HLDGS	10,150,000	1.310	13,296,500.000	
	小計（香港・ドル）3銘柄	17,747,000	-	57,747,460.000	
				(665,250,739)	

イギリス・ ポンド	RIO TINTO	139,518	33.100	4,618,045.800	
	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	2,086,031	4.853	10,123,508.440	
	STANDARD CHARTERD PLC	268,500	16.385	4,399,372.500	
	TESCO PLC	820,993	4.233	3,475,263.360	
	VODAFONE GROUP PLC	2,533,673	1.351	3,422,992.220	
	WPP PLC	927,462	5.810	5,388,554.220	
	小計（イギリス・ポンド）6 銘柄	6,776,177	-	31,427,736.540 (4,691,218,234)	
エジプト・ ポンド	ORASCOM TELECOM HOLDING	229,600	31.050	7,129,080.000	
	小計（エジプト・ポンド）1 銘柄	229,600	-	7,129,080.000 (116,631,748)	
スイス・フ ラン	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	63,763	162.100	10,335,982.300	
	小計（スイス・フラン）1 銘柄	63,763	-	10,335,982.300 (912,563,877)	
メキシコ・ ペソ	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	838,100	49.650	41,611,665.000	
	小計（メキシコ・ペソ）1 銘柄	838,100	-	41,611,665.000 (285,872,138)	
インド・ル ピー	BAJAJ FINSERV LTD	218,375	334.600	73,068,275.000	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	40,413	1,181.950	47,766,145.350	
	GMR INFRASTRUCTURE LTD	3,200,000	67.650	216,480,000.000	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	73,387	2,100.050	154,116,369.350	
	UNITED SPIRITS LIMITED	59,732	1,168.400	69,790,868.800	
	小計（インド・ルピー）5 銘柄	3,591,907	-	561,221,658.500 (1,099,994,451)	
ブラジル・ レアル	BM&FBOVESPA SA	275,265	11.900	3,275,653.500	
	小計（ブラジル・レアル）1 銘柄	275,265	-	3,275,653.500 (169,482,313)	
ユーロ	DANONE	89,848	42.515	3,819,887.720	
	E.ON AG	284,035	27.310	7,756,995.850	
	IBERDROLA RENOVABLES	1,659,200	3.275	5,433,880.000	
	INTESA SANPAOLO SPA	3,680,865	3.082	11,344,425.930	
	PERNOD-RICARD SA	109,418	56.330	6,163,515.940	
	小計（ユーロ）5 銘柄	5,823,366	-	34,518,705.440 (4,606,521,241)	
合計		41,953,623	-	36,668,326,512 (36,668,326,512)	

（注）1. 各種通貨ごとの小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

2. ファンド合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入有価証券	
		時価比率	有価証券の合計 金額に対する比率
アメリカ・ドル	外国株式 43銘柄	62.65%	65.20%
オーストラリア・ドル	外国株式 1 銘柄	0.56%	0.58%
香港・ドル	外国株式 3 銘柄	1.74%	1.82%
イギリス・ポンド	外国株式 6 銘柄	12.29%	12.79%
エジプト・ポンド	外国株式 1 銘柄	0.31%	0.32%
スイス・フラン	外国株式 1 銘柄	2.39%	2.49%
メキシコ・ペソ	外国株式 1 銘柄	0.75%	0.78%
インド・ルピー	外国株式 5 銘柄	2.88%	3.00%

ブラジル・リアル	外国株式	1 銘柄	0.44%	0.46%
ユーロ	外国株式	5 銘柄	12.07%	12.56%

為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表中の(デリバティブ取引等関係に関する注記) 取引の時価等に関する事項で記載しており、ここでは省略しております。

[前へ](#) [次へ](#)

インターナショナル債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

区 分	平成20年11月19日現在 金 額（円）	平成21年11月19日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	5,685,298	7,306,698
コール・ローン	134,026,324	227,163,501
国債証券	3,557,373,474	4,926,310,756
地方債証券	5,112,458	24,602,480
特殊債券	286,215,675	405,966,955
社債券	187,397,670	373,329,162
派生商品評価勘定	13,565,557	4,702,376
未収入金	122,678,304	72,962,202
未収利息	62,446,293	77,394,744
前払費用	18,128,133	21,190,499
差入委託証拠金	20,364,825	9,797,289
流動資産合計	4,412,994,011	6,150,726,662
資産合計	4,412,994,011	6,150,726,662
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,450,625	5,712,797
未払金	97,785,470	75,652,092
未払解約金	-	111,403
流動負債合計	104,236,095	81,476,292
負債合計	104,236,095	81,476,292
純資産の部		
元本等		
元本	2,832,212,162	3,528,399,365
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,476,545,754	2,540,851,005
元本等合計	4,308,757,916	6,069,250,370
純資産合計	4,308,757,916	6,069,250,370
負債純資産合計	4,412,994,011	6,150,726,662

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成19年11月20日	自 平成20年11月20日
	至 平成20年11月19日	至 平成21年11月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価 評価にあたっては、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 は採用しない）又は価格情報会社の提供する価 額のいずれかから入手した価額で評価しており ます。 また、適正な評価額を入手できなかった場合又は 入手した評価額が時価と認定できない事由が 認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義 務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた 価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理 的事由をもって時価と認めた価額で評価しており ます。	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 同左 同左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しており ます。	同左
3. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益、派生商品取引等損益及び 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。	有価証券売買等損益、派生商品取引等損益及び 為替予約取引による為替差損益 同左
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条及 び第61条に基づいております。	外貨建資産等の会計処理 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成20年11月19日現在	平成21年11月19日現在
1. 元本状況		
開示対象ファンドの計算期間の期首における当該親投資信託の元本額	2,188,735,460円	2,832,212,162円
期中追加設定元本額	1,040,648,975円	1,140,263,382円
期中一部解約元本額	397,172,273円	444,076,179円
元本の内訳		
大和住銀DC外国債券ファンド	621,942,622円	745,877,486円
大和住銀DC年金設計ファンド30	85,413,544円	90,767,553円
大和住銀DC年金設計ファンド50	131,271,655円	153,264,943円
大和住銀DC年金設計ファンド70	100,485,271円	121,013,865円
大和住銀ライフプラン・外国債券	158,792,274円	909,982,461円
大和住銀ライフプラン・バランス30	455,349円	454,091円
大和住銀ライフプラン・バランス50	844,617円	984,908円
大和住銀ライフプラン・バランス70	528,687円	538,314円
大和住銀ノット・ロウ・プライス外国債券ファンドVA	1,303,162,557円	1,196,976,666円
大和住銀年金設計ファンド30VA（適格機関投資家専用）	1,926,272円	1,835,318円
大和住銀年金設計ファンド50VA（適格機関投資家専用）	3,512,555円	4,131,769円
大和住銀年金設計ファンド70VA（適格機関投資家専用）	863,793円	1,071,476円
大和住銀バランスファンド60（適格機関投資家限定）	78,808,093円	72,897,642円
大和住銀世界資産バランスVA（適格機関投資家限定）	75,360,239円	94,621,764円
大和住銀FoF用外国債券ファンド（ヘッジなし）（適格機関投資家限定）	268,844,634円	133,981,109円
合計	2,832,212,162円	3,528,399,365円
2. 受益権の総数	2,832,212,162口	3,528,399,365口

（有価証券に関する注記）
 売買目的有価証券
 （平成20年11月19日現在）

種類	貸借対照表計上額（円）	計算期間 の損益に 含まれた評価差額（円）
国 債 証 券	3,557,373,474	19,766,937
地 方 債 証 券	5,112,458	387,368
特 殊 債 券	286,215,675	11,699,221
社 債 券	187,397,670	11,146,924
合 計	4,036,099,277	42,225,714

「計算期間」とは、「インターナショナル債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成20年2月23日から平成20年11月19日まで）を指しております。

（平成21年11月19日現在）

種類	貸借対照表計上額（円）	計算期間 の損益に 含まれた評価差額（円）
国 債 証 券	4,926,310,756	39,086,690
地 方 債 証 券	24,602,480	448,538
特 殊 債 券	405,966,955	16,527,020
社 債 券	373,329,162	33,285,321
合 計	5,730,209,353	88,450,493

「計算期間」とは、「インターナショナル債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成21年2月24日から平成21年11月19日まで）を指しております。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
 取引の状況に関する事項

項目	自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日	自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日
1．取引の内容	当ファンドは債券先物取引及び為替予約取引を行っております。	同左
2．取引に対する取組方針	債券先物取引及び為替予約取引につきましては、投資信託約款上の投資制限を遵守しております。	同左
3．取引の利用目的	デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しております。	同左
4．取引に係るリスクの内容	債券先物取引及び為替予約取引は、相場変動によるリスク（価格変動リスク）を有しております。また、債券先物取引及び為替予約取引は、相手方の契約不履行によるリスク（信用リスク）を有しております。	同左
5．取引に係るリスク管理体制	価格変動リスクについては、運用者および管理者が日々のポジションや評価損益等を含め、投資信託財産全体を総合的に管理しております。また、運用から独立したリスク管理組織が事後的にチェックを行う、ダブル・チェック体制をとっております。信用リスクについては、ブローカー選定委員会等を通じて、取引の相手方に対するチェックを行っております。	同左

6．取引の時価等に関する 事項についての補足説 明	該当事項はありません。	同左
---------------------------------	-------------	----

取引の時価等に関する事項

（債券関連）

区分	種類	平成20年11月19日現在			
		契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引 買建				
	EURO-SCHATZ FUT Dec08	114,595,553	-	116,983,748	2,388,195
	EURO-BOBL FUTURE Dec08	217,367,339	-	222,262,476	4,895,137
	EURO-BUND FUTURE Dec08	55,977,776	-	57,926,377	1,948,601
	売建				
	US 10YR NOTE FUT Dec08	156,631,258	-	160,134,209	3,502,951
合計		-	-	557,306,810	5,728,982

区分	種類	平成21年11月19日現在			
		契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引 買建				
	US 2YR NOTE(CBT) Dec09	270,936,553	-	272,903,723	1,967,170
	売建				
	EURO-BUND FUTURE Dec09	48,578,469	-	48,938,784	360,315
	US 5YR NOTE(CBT) Dec09	10,248,121	-	10,474,833	226,712
	US 10YR NOTE FUT Dec09	85,040,358	-	85,316,595	276,237
合計		-	-	417,633,935	1,103,906

評価損益は、「インターナショナル債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応するものです。

（注）時価の算定方法

１）先物取引の残高表示は、契約額によっております。

外国先物においては、契約額等には、手数料相当額を含んでおりません。

２）期末の評価においては、取引所の発表する計算日に知りうる直近の日の清算価格又は最終相場で評価しております。

３）契約額等及び時価の邦貨換算は計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

（通貨関連）

区分	種類	平成20年11月19日現在			
		契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	324,887,862	-	325,104,751	216,889
	カナダ・ドル	10,605,213	-	10,561,119	44,094
	イギリス・ポンド	24,430,566	-	24,770,089	339,523
	スイス・フラン	33,585,955	-	33,276,103	309,852
	ノルウェー・クローネ	12,144,047	-	11,857,856	286,191
	ポーランド・ズロチ	15,686,697	-	15,388,106	298,591
	ユーロ	32,630,064	-	32,705,957	75,893
	売建				
	カナダ・ドル	7,129,000	-	6,856,791	272,209
	オーストラリア・ドル	5,365,994	-	5,255,782	110,212
	デンマーク・クローネ	1,026,824	-	1,022,125	4,699
	スウェーデン・クローナ	4,850,207	-	4,766,385	83,822
	メキシコ・ペソ	96,888,189	-	95,554,243	1,333,946
	ポーランド・ズロチ	20,179,000	-	20,316,534	137,534
	ハンガリー・フォリント	35,207,756	-	35,229,300	21,544
	ユーロ	122,164,084	-	122,117,521	46,563
	合計	-	-	744,782,662	1,385,950

区分	種類	平成21年11月19日現在			
		契約額等 （円）	うち 1年超 （円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	516,799,515	-	514,364,505	2,435,010
	カナダ・ドル	19,119,393	-	18,942,194	177,199
	オーストラリア・ドル	7,967,607	-	7,906,306	61,301
	シンガポール・ドル	83,812,579	-	83,553,057	259,522
	イギリス・ポンド	131,844,923	-	131,325,851	519,072
	イスラエル・シケル	30,289,000	-	30,180,802	108,198
	スイス・フラン	38,212,896	-	38,124,795	88,101
	デンマーク・クローネ	18,134,999	-	18,122,849	12,150
	ノルウェー・クローネ	79,285,533	-	79,228,193	57,340
	スウェーデン・クローナ	64,161,439	-	64,482,122	320,683
	ポーランド・ズロチ	3,448,211	-	3,454,398	6,187
	ユーロ	222,830,023	-	222,736,460	93,563
	売建				
	アメリカ・ドル	54,722,724	-	54,746,219	23,495
	カナダ・ドル	76,347,582	-	75,639,996	707,586
	イギリス・ポンド	2,477,000	-	2,468,091	8,909
	メキシコ・ペソ	161,329,480	-	161,481,122	151,642
	ユーロ	722,969,470	-	722,140,569	828,901
	合計	-	-	2,228,897,529	2,114,327

評価損益は、「インターナショナル債券マザーファンド」の計算期間の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応するものです。

（注）時価の算定方法

A．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きましては、以下のように評価しております。

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には、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合には、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算期間末日に当該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、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

B．計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨につきましては、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

（関連当事者との取引に関する注記）
（自 平成19年11月20日 至 平成20年11月19日）
該当事項はありません。

（自 平成20年11月20日 至 平成21年11月19日）
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成20年11月19日現在	平成21年11月19日現在
1口当たり純資産額 1.5213円 「1口＝1円（10,000口＝15,213円）」	1口当たり純資産額 1.7201円 「1口＝1円（10,000口＝17,201円）」

[前へ](#) [次へ](#)

(3) 附属明細表

有価証券明細表

< 株式以外の有価証券 >

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
アメリカ・ドル	国債証券	BRAZIL 6 01/17/17	97,000.000	106,234.400	
	国債証券	BRAZIL 6 01/17/17	255,000.000	279,276.000	
	国債証券	BRAZIL 6 01/17/17	106,000.000	116,091.200	
	国債証券	KOREA 5.75 04/16/14	107,000.000	117,127.550	
	国債証券	SOAF 6.5 06/02/14	231,000.000	254,966.250	
	国債証券	SOAF 6.5 06/02/14	65,000.000	71,743.750	
	国債証券	T 1.125 01/15/12	460,000.000	462,263.200	
	国債証券	T 1.125 01/15/12	1,580,000.000	1,587,773.600	
	国債証券	T 1.125 01/15/12	217,000.000	218,067.640	
	国債証券	T 1.125 01/15/12	1,126,000.000	1,131,539.920	
	国債証券	T 1.125 01/15/12	227,000.000	228,116.840	
	国債証券	T 2 11/30/13	262,000.000	264,557.120	
	国債証券	T 2 11/30/13	168,000.000	169,639.680	
	国債証券	T 2 11/30/13	80,000.000	80,780.800	
	国債証券	T 2.375 03/31/16	179,000.000	175,489.810	
	国債証券	T 2.375 03/31/16	46,000.000	45,097.940	
	国債証券	T 2.375 03/31/16	238,000.000	233,332.820	
	国債証券	T 2.375 03/31/16	243,000.000	238,234.770	
	国債証券	T 2.375 03/31/16	459,000.000	449,999.010	
	国債証券	T 2.375 03/31/16	206,000.000	201,960.340	
	国債証券	T 2.375 03/31/16	215,000.000	210,783.850	
	国債証券	T 2.375 03/31/16	94,000.000	92,156.660	
	国債証券	T 4.75 05/15/14	90,000.000	100,835.100	
	国債証券	T 4.75 05/15/14	29,000.000	32,491.310	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	9,000.000	10,411.830	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	205,000.000	237,158.350	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	90,000.000	104,118.300	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	56,000.000	64,784.720	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	14,000.000	16,196.180	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	24,000.000	27,764.880	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	46,000.000	53,216.020	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	147,000.000	170,059.890	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	340,000.000	393,335.800	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	35,000.000	40,490.450	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	15,000.000	17,353.050	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	60,000.000	69,412.200	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	43,000.000	49,745.410	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	241,000.000	278,805.670	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	96,000.000	111,059.520	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	25,000.000	28,921.750	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	75,000.000	86,765.250	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	60,000.000	69,412.200	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	40,000.000	46,274.800	
	国債証券	T 5.375 02/15/31	85,000.000	98,333.950	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	12,000.000	13,605.840	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	20,000.000	22,676.400	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	40,000.000	45,352.800	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	55,000.000	62,360.100	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	140,000.000	158,734.800	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	15,000.000	17,007.300	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	30,000.000	34,014.600	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	10,000.000	11,338.200	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	40,000.000	45,352.800	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	10,000.000	11,338.200	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	25,000.000	28,345.500	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	45,000.000	51,021.900	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	35,000.000	39,683.700	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	85,000.000	96,374.700	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	90,000.000	102,043.800	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	80,000.000	90,705.600	

	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	30,000.000	34,014.600	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	30,000.000	34,014.600	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	20,000.000	22,676.400	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	16,000.000	18,141.120	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	10,000.000	11,338.200	
	国債証券	T-BOND 5.25 02/15/29	12,000.000	13,605.840	
	国債証券	T-NOTE 4 11/15/12	113,000.000	122,348.490	
	国債証券	T-NOTE 4 11/15/12	110,000.000	119,100.300	
	国債証券	T-NOTE 4 11/15/12	330,000.000	357,300.900	
	国債証券	T-NOTE 4 11/15/12	320,000.000	346,473.600	
	特殊債券	BNG 5.25 01/31/17	237,000.000	261,932.400	
	特殊債券	BNG 5.25 01/31/17	500,000.000	552,600.000	
	特殊債券	EIB 4.625 05/15/14	500,000.000	548,050.000	
	特殊債券	KFW 4.75 05/15/14	670,000.000	736,832.500	
	特殊債券	SEK 4.5 09/27/10	700,000.000	723,625.000	
	特殊債券	SEK 4.5 09/27/10	155,000.000	160,231.250	
	社債券	KZOLKZ 11.75 01/23/15	100,000.000	120,510.000	
	社債券	PEMEX 5.75 03/01/18	400,000.000	412,000.000	
	社債券	PEMEX 5.75 03/01/18	84,000.000	86,520.000	
	小計（アメリカ・ドル）16銘柄		13,555,000.000	14,353,451.220 (1,281,619,660)	
カナダ・ドル	国債証券	CAN 3.75 06/01/19	865,000.000	887,706.250	
	国債証券	CAN 4 06/01/17	18,000.000	19,053.360	
	国債証券	CAN 4.25 06/01/18	188,000.000	201,470.200	
	国債証券	CAN 4.25 06/01/18	34,000.000	36,436.100	
	国債証券	CAN 4.5 06/01/15	70,000.000	76,281.800	
	国債証券	CAN 4.5 06/01/15	90,000.000	98,076.600	
	国債証券	CAN 4.5 06/01/15	88,000.000	95,897.120	
	国債証券	CAN 5 06/01/14	50,000.000	55,343.500	
	国債証券	CAN 5 06/01/14	35,000.000	38,740.450	
	国債証券	CAN 5 06/01/14	40,000.000	44,274.800	
	国債証券	CAN 5 06/01/14	25,000.000	27,671.750	
	国債証券	CAN 5 06/01/14	98,000.000	108,473.260	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	74,000.000	90,823.160	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	20,000.000	24,546.800	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	20,000.000	24,546.800	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	15,000.000	18,410.100	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	30,000.000	36,820.200	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	25,000.000	30,683.500	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	20,000.000	24,546.800	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	35,000.000	42,956.900	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	20,000.000	24,546.800	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	45,000.000	55,230.300	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	24,000.000	29,456.160	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	18,000.000	22,092.120	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	42,000.000	51,548.280	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	20,000.000	24,546.800	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	12,000.000	14,728.080	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	17,000.000	20,864.780	
	国債証券	CAN 6 06/01/11	85,000.000	91,537.350	
	国債証券	CAN 6 06/01/11	164,000.000	176,613.240	
	国債証券	CAN 6 06/01/11	330,000.000	355,380.300	
	国債証券	CAN 6 06/01/11	50,000.000	53,845.500	
	小計（カナダ・ドル）7銘柄		2,667,000.000	2,903,149.160 (245,287,073)	

オーストラ リア・ドル	地方債証券	QTC 6 09/14/17	80,000.000	80,112.800	
	地方債証券	QTC 6 09/14/17	78,000.000	78,109.980	
	地方債証券	QTC 6 09/14/17	50,000.000	50,070.500	
	地方債証券	QTC 6 09/14/17	31,000.000	31,043.710	
	地方債証券	QTC 6 09/14/17	58,000.000	58,081.780	
	特殊債券	IFC 7.5 02/28/13	60,000.000	63,435.000	
	特殊債券	IFC 7.5 02/28/13	60,000.000	63,435.000	
小計（オーストラリア・ドル）2 銘柄			417,000.000	424,288.770 (35,097,167)	
イギリス・ ポンド	国債証券	UKT 4.25 03/07/11	50,000.000	52,268.000	
	国債証券	UKT 4.25 03/07/11	70,000.000	73,175.200	
	国債証券	UKT 4.25 03/07/11	100,000.000	104,536.000	
	国債証券	UKT 4.25 03/07/11	174,000.000	181,892.640	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	14,000.000	14,168.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	5,000.000	5,060.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	20,000.000	20,240.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	20,000.000	20,240.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	75,000.000	75,900.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	10,000.000	10,120.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	130,000.000	131,560.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	165,000.000	166,980.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	15,000.000	15,180.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	35,000.000	35,420.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	20,000.000	20,240.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	10,000.000	10,120.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	94,000.000	95,128.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	11,000.000	11,132.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	15,000.000	15,180.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	35,000.000	35,420.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	122,000.000	123,464.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	115,000.000	116,380.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	26,000.000	26,312.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	13,000.000	13,156.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	9,000.000	9,108.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	28,000.000	28,336.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	40,000.000	40,480.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	15,000.000	15,180.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	10,000.000	10,120.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	20,000.000	20,240.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	35,000.000	35,420.000	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	88,000.000	89,056.000	
	国債証券	UKT 4.5 03/07/13	229,000.000	246,472.700	
	国債証券	UKT 4.5 03/07/13	36,000.000	38,746.800	
	特殊債券	EIB 8.75 08/25/17	110,000.000	145,150.500	
	特殊債券	EIB 8.75 08/25/17	108,000.000	142,511.400	
	特殊債券	KFW 5.5 12/07/15	140,000.000	155,134.000	
	特殊債券	KFW 5.5 12/07/15	161,000.000	178,404.100	
小計（イギリス・ポンド）5 銘柄			2,373,000.000	2,527,631.340 (377,299,530)	
デンマーク ・クローネ	国債証券	DGB 5 11/15/13	515,000.000	562,998.000	
	国債証券	DGB 5 11/15/13	265,000.000	289,698.000	
	国債証券	DGB 5 11/15/13	305,000.000	333,426.000	
	国債証券	DGB 5 11/15/13	135,000.000	147,582.000	
	国債証券	DGB 5 11/15/13	325,000.000	355,290.000	
	国債証券	DGB 5 11/15/13	535,000.000	584,862.000	
小計（デンマーク・クローネ）1 銘柄			2,080,000.000	2,273,856.000 (40,792,977)	

スウェーデン・クローナ	国債証券	SGB 3.75 08/12/17	670,000.000	699,212.000	
	国債証券	SGB 3.75 08/12/17	660,000.000	688,776.000	
	国債証券	SGB 5.25 3/15/11	600,000.000	636,690.000	
	国債証券	SGB 5.25 3/15/11	325,000.000	344,873.750	
	国債証券	SGB 5.25 3/15/11	650,000.000	689,747.500	
	小計（スウェーデン・クローナ）2 銘柄		2,905,000.000	3,059,299.250 (39,985,042)	
メキシコ・ペソ	国債証券	MBONO 8 12/17/15	3,345,000.000	3,406,380.750	
	国債証券	MBONO 8 12/17/15	540,000.000	549,909.000	
	国債証券	MBONO 8 12/17/15	1,430,000.000	1,456,240.500	
	国債証券	MBONO 8 12/17/15	300,000.000	305,505.000	
	国債証券	MBONO 8 12/17/15	425,000.000	432,798.750	
	国債証券	MBONO 8 12/17/15	1,760,000.000	1,792,296.000	
	国債証券	MBONO 8 12/19/13	3,205,000.000	3,309,162.500	
	国債証券	MBONO 8 12/19/13	3,645,000.000	3,763,462.500	
	国債証券	MBONO 8 12/19/13	1,200,000.000	1,239,000.000	
	国債証券	MBONO 8 12/19/13	2,155,000.000	2,225,037.500	
	国債証券	MBONO 9 12/20/12	1,570,000.000	1,674,357.900	
	国債証券	MBONO 9 12/20/12	540,000.000	575,893.800	
	国債証券	MBONO 9 12/20/12	1,840,000.000	1,962,304.800	
	小計（メキシコ・ペソ）3 銘柄		21,955,000.000	22,692,349.000 (155,896,438)	
マレーシア・リングギット	国債証券	MGS 3.7 05/15/13	380,000.000	385,593.600	
	国債証券	MGS 3.718 06/15/12	454,000.000	463,879.040	
	国債証券	MGTB 0 02/25/10	1,120,000.000	1,113,011.200	
	国債証券	MGTB 0 07/02/10	1,110,000.000	1,094,238.000	
	国債証券	MGTB 0 07/02/10	1,010,000.000	995,658.000	
	国債証券	MGTB 0 07/30/10	1,990,000.000	1,958,279.400	
	国債証券	MGTB 0 07/30/10	780,000.000	767,566.800	
	小計（マレーシア・リングギット）5 銘柄		6,844,000.000	6,778,226.040 (179,487,426)	
ポーランド・ズロチ	国債証券	POLGB 5.75 04/25/14	1,031,000.000	1,035,124.000	
	国債証券	POLGB 5.75 04/25/14	158,000.000	158,632.000	
	国債証券	POLGB 6.25 10/24/15	180,000.000	183,600.000	
	国債証券	POLGB 6.25 10/24/15	229,000.000	233,580.000	
	小計（ポーランド・ズロチ）2 銘柄		1,598,000.000	1,610,936.000 (52,532,623)	
ユーロ	国債証券	BELGIAN 5 09/28/12	240,000.000	261,432.000	
	国債証券	BELGIAN 5 09/28/12	150,000.000	163,395.000	
	国債証券	BGB 5 03/28/35	38,000.000	41,537.040	
	国債証券	BGB 5 03/28/35	315,000.000	344,320.200	
	国債証券	BTPS 4 02/01/37	170,000.000	151,300.000	
	国債証券	BTPS 4 02/01/37	40,000.000	35,600.000	
	国債証券	BTPS 4 02/01/37	15,000.000	13,350.000	
	国債証券	BTPS 4 02/01/37	347,000.000	308,830.000	
	国債証券	BTPS 4 02/01/37	45,000.000	40,050.000	
	国債証券	BTPS 4 02/01/37	55,000.000	48,950.000	
	国債証券	BTPS 4 02/01/37	40,000.000	35,600.000	
	国債証券	BTPS 4 02/01/37	20,000.000	17,800.000	
	国債証券	BTPS 4 02/01/37	70,000.000	62,300.000	
	国債証券	BTPS 4 02/01/37	40,000.000	35,600.000	
	国債証券	BTPS 4.25 08/01/14	55,000.000	58,745.500	
	国債証券	BTPS 4.25 08/01/14	130,000.000	138,853.000	
	国債証券	BTPS 4.25 08/01/14	69,000.000	73,698.900	
	国債証券	BTPS 4.25 08/01/14	85,000.000	90,788.500	
	国債証券	BTPS 4.25 08/01/14	105,000.000	112,150.500	
	国債証券	BTPS 5 02/01/12	800,000.000	857,040.000	
	国債証券	BTPS 5 02/01/12	110,000.000	117,843.000	
	国債証券	BTPS 5 02/01/12	230,000.000	246,399.000	
	国債証券	BTPS 5 02/01/12	156,000.000	167,122.800	

国債証券	BTPS 5.25 08/01/17	165,000.000	185,674.500	
国債証券	BTPS 5.25 08/01/17	175,000.000	196,927.500	
国債証券	BTPS 5.25 08/01/17	320,000.000	360,096.000	
国債証券	BTPS 5.25 08/01/17	120,000.000	135,036.000	
国債証券	BTPS 5.25 08/01/17	60,000.000	67,518.000	
国債証券	BTPS 5.25 08/01/17	60,000.000	67,518.000	
国債証券	BTPS 5.25 08/01/17	144,000.000	162,043.200	
国債証券	BTPS 5.25 08/01/17	224,000.000	252,067.200	
国債証券	BTPS 5.25 08/01/17	474,000.000	533,392.200	
国債証券	BTPS 5.5 11/01/10	65,000.000	67,828.150	
国債証券	BTPS 5.5 11/01/10	345,000.000	360,010.950	
国債証券	BTPS 5.5 11/01/10	115,000.000	120,003.650	
国債証券	BTPS 6 05/01/31	42,000.000	49,098.000	
国債証券	BTPS 6 05/01/31	50,000.000	58,450.000	
国債証券	BTPS 6 05/01/31	75,000.000	87,675.000	
国債証券	BTPS 6 05/01/31	25,000.000	29,225.000	
国債証券	BTPS 6 05/01/31	49,000.000	57,281.000	
国債証券	BTPS 6 05/01/31	19,000.000	22,211.000	
国債証券	BTPS 6 05/01/31	50,000.000	58,450.000	
国債証券	BTPS 6 05/01/31	25,000.000	29,225.000	
国債証券	BTPS 6 05/01/31	60,000.000	70,140.000	
国債証券	BTPS 6 05/01/31	40,000.000	46,760.000	
国債証券	BTPS 6 05/01/31	20,000.000	23,380.000	
国債証券	BTPS 6 05/01/31	30,000.000	35,070.000	
国債証券	BTPS 6 05/01/31	20,000.000	23,380.000	
国債証券	BTPS 6 05/01/31	55,000.000	64,295.000	
国債証券	DBR 3.5 01/04/16	91,000.000	95,195.100	
国債証券	DBR 3.5 01/04/16	45,000.000	47,074.500	
国債証券	DBR 3.5 01/04/16	38,000.000	39,751.800	
国債証券	DBR 3.5 01/04/16	239,000.000	250,017.900	
国債証券	DBR 3.5 01/04/16	100,000.000	104,610.000	
国債証券	DBR 3.5 01/04/16	38,000.000	39,751.800	
国債証券	DBR 3.75 01/04/17	104,000.000	109,824.000	
国債証券	DBR 3.75 01/04/17	55,000.000	58,080.000	
国債証券	DBR 3.75 01/04/17	78,000.000	82,368.000	
国債証券	DBR 3.75 01/04/19	294,000.000	307,141.800	
国債証券	DBR 3.75 01/04/19	255,000.000	266,398.500	
国債証券	DBR 3.75 01/04/19	57,000.000	59,547.900	
国債証券	DBR 3.75 01/04/19	82,000.000	85,665.400	
国債証券	DBR 3.75 01/04/19	153,000.000	159,839.100	
国債証券	DBR 4 01/04/18	83,000.000	88,494.600	
国債証券	DBR 4 01/04/18	60,000.000	63,972.000	
国債証券	DBR 4 01/04/18	81,000.000	86,362.200	
国債証券	DBR 4 01/04/37	28,000.000	27,862.800	
国債証券	DBR 4 01/04/37	145,000.000	144,289.500	
国債証券	DBR 4 01/04/37	46,000.000	45,774.600	
国債証券	DBR 4 01/04/37	78,000.000	77,617.800	
国債証券	DBR 4 01/04/37	140,000.000	139,314.000	
国債証券	DBR 4 01/04/37	87,000.000	86,573.700	
国債証券	DBR 4 01/04/37	17,000.000	16,916.700	
国債証券	DBR 4 01/04/37	140,000.000	139,314.000	
国債証券	DBR 4 01/04/37	22,000.000	21,892.200	
国債証券	DBR 4 01/04/37	98,000.000	97,519.800	
国債証券	DBR 4 01/04/37	120,000.000	119,412.000	
国債証券	DBR 4 01/04/37	90,000.000	89,559.000	
国債証券	DBR 4 01/04/37	50,000.000	49,755.000	
国債証券	DBR 4 01/04/37	55,000.000	54,730.500	
国債証券	DBR 4.25 01/04/14	56,000.000	60,505.200	
国債証券	DBR 4.25 01/04/14	102,000.000	110,205.900	
国債証券	DBR 4.25 07/04/14	415,000.000	449,611.000	
国債証券	DEUTSCH 4.5 01/04/13	113,000.000	122,096.500	
国債証券	DEUTSCH 4.5 01/04/13	211,000.000	227,985.500	
国債証券	DEUTSCH 4.75 07/04/34	1,000.000	1,106.300	
国債証券	DEUTSCH 4.75 07/04/34	15,000.000	16,594.500	

国債証券	DEUTSCH 4.75 07/04/34	99,000.000	109,523.700	
国債証券	DEUTSCH 4.75 07/04/34	95,000.000	105,098.500	
国債証券	DEUTSCH 4.75 07/04/34	55,000.000	60,846.500	
国債証券	DEUTSCH 4.75 07/04/34	144,000.000	159,307.200	
国債証券	DEUTSCH 4.75 07/04/34	14,000.000	15,488.200	
国債証券	FRANCEOAT 5.5 04/25/10	450,000.000	459,225.000	
国債証券	FRANCEOAT 5.5 04/25/29	35,000.000	41,464.500	
国債証券	FRANCEOAT 5.5 04/25/29	85,000.000	100,699.500	
国債証券	FRANCEOAT 5.5 04/25/29	50,000.000	59,235.000	
国債証券	FRANCEOAT 5.5 04/25/29	45,000.000	53,311.500	
国債証券	FRANCEOAT 5.5 04/25/29	40,000.000	47,388.000	
国債証券	FRANCEOAT 5.5 04/25/29	25,000.000	29,617.500	
国債証券	FRANCEOAT 5.5 04/25/29	43,000.000	50,942.100	
国債証券	FRANCEOAT 5.5 04/25/29	18,000.000	21,324.600	
国債証券	FRANCEOAT 5.5 04/25/29	66,000.000	78,190.200	
国債証券	FRTR 4 04/25/13	501,000.000	533,615.100	
国債証券	FRTR 4 10/25/14	68,000.000	72,515.200	
国債証券	FRTR 4 10/25/14	513,000.000	547,063.200	
国債証券	FRTR 4 10/25/14	201,000.000	214,346.400	
国債証券	FRTR 4 10/25/14	106,000.000	113,038.400	
国債証券	FRTR 4 10/25/14	92,000.000	98,108.800	
国債証券	FRTR 4.25 04/25/19	85,000.000	90,397.500	
国債証券	FRTR 4.25 04/25/19	134,000.000	142,509.000	
国債証券	FRTR 4.25 04/25/19	69,000.000	73,381.500	
国債証券	FRTR 4.25 10/25/17	165,000.000	177,101.100	
国債証券	FRTR 4.25 10/25/17	137,000.000	147,047.580	
国債証券	FRTR 4.25 10/25/17	170,000.000	182,467.800	
国債証券	FRTR 4.25 10/25/17	270,000.000	289,801.800	
国債証券	FRTR 4.75 10/25/12	130,000.000	140,881.000	
国債証券	FRTR 4.75 10/25/12	65,000.000	70,440.500	
国債証券	FRTR 4.75 10/25/12	105,000.000	113,788.500	
国債証券	FRTR 4.75 10/25/12	237,000.000	256,836.900	
国債証券	FRTR 5 10/25/16	115,000.000	129,225.500	
国債証券	FRTR 5 10/25/16	44,000.000	49,442.800	
国債証券	FRTR 5 10/25/16	50,000.000	56,185.000	
国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	28,000.000	34,648.320	
国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	65,000.000	80,433.600	
国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	110,000.000	136,118.400	
国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	296,000.000	366,282.240	
国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	30,000.000	37,123.200	
国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	16,000.000	19,799.040	
国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	70,000.000	86,620.800	
国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	110,000.000	136,118.400	
国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	30,000.000	37,123.200	
国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	60,000.000	74,246.400	
国債証券	GGB 4.6 05/20/13	615,000.000	645,645.450	
国債証券	GGB 5.25 05/18/12	165,000.000	175,954.350	
国債証券	GGB 6.5 10/22/19	65,000.000	73,788.000	
国債証券	GGB 6.5 10/22/19	172,000.000	195,254.400	
国債証券	GGB 6.5 10/22/19	97,000.000	110,114.400	
国債証券	GREECE 6.5 01/11/14	100,000.000	111,837.000	
国債証券	GREECE 6.5 01/11/14	120,000.000	134,204.400	
国債証券	GREECE 6.5 01/11/14	135,000.000	150,979.950	
国債証券	NETHER 4.5 07/15/17	420,000.000	456,414.000	
国債証券	NETHER 5 07/15/12	50,000.000	54,300.000	
国債証券	NETHER 5 07/15/12	65,000.000	70,590.000	
国債証券	NETHER 5 07/15/12	405,000.000	439,830.000	
国債証券	NETHER 5.5 01/15/28	10,000.000	11,764.000	
国債証券	NETHER 5.5 01/15/28	85,000.000	99,994.000	
国債証券	NETHER 5.5 01/15/28	50,000.000	58,820.000	
国債証券	NETHER 5.5 01/15/28	40,000.000	47,056.000	
国債証券	PGB 4.45 06/15/18	113,000.000	120,029.730	
国債証券	PGB 5.45 09/23/13	385,000.000	427,376.950	
国債証券	RAGB 4.65 01/15/18	233,000.000	253,163.820	

国債証券	RAGB 5.25 01/04/11	205,000.000	214,809.250	
国債証券	RAGB 5.25 01/04/11	205,000.000	214,809.250	
国債証券	RAGB 5.25 01/04/11	118,000.000	123,646.300	
国債証券	RAGB 6.25 07/15/27	16,000.000	19,950.080	
国債証券	RAGB 6.25 07/15/27	45,000.000	56,109.600	
国債証券	RFGB 3.875 09/15/17	175,000.000	182,840.000	
国債証券	SPGB 4.1 07/30/18	145,000.000	150,618.750	
国債証券	SPGB 4.4 01/31/15	100,000.000	107,802.000	
国債証券	SPGB 4.4 01/31/15	490,000.000	528,229.800	
国債証券	SPGB 5.4 07/30/11	140,000.000	149,640.400	
国債証券	SPGB 6 01/31/29	75,000.000	89,781.000	
国債証券	SPGB 6 01/31/29	80,000.000	95,766.400	
国債証券	SPGB 6 01/31/29	15,000.000	17,956.200	
国債証券	SPGB 6 01/31/29	65,000.000	77,810.200	
国債証券	SPGB 6 01/31/29	25,000.000	29,927.000	
国債証券	SPGB 6 01/31/29	13,000.000	15,562.040	
特殊債券	GAZPRU 5.364 10/31/14	50,000.000	50,825.000	
特殊債券	GAZPRU 6.605 02/13/18	50,000.000	52,787.500	
特殊債券	GAZPRU 6.605 02/13/18	160,000.000	168,920.000	
社債券	ABIBB 8.625 01/30/17	50,000.000	62,895.000	
社債券	ANZ 5.125 09/10/19	50,000.000	50,876.000	
社債券	BAC FL 03/28/18	50,000.000	43,997.500	
社債券	BACR 5.75 03/08/11	5,000.000	5,215.250	
社債券	BERTEL 4.75 09/26/16	14,000.000	14,119.000	
社債券	BMW 6.375 07/23/12	20,000.000	21,882.000	
社債券	BNP 5.431 09/07/17	50,000.000	55,150.000	
社債券	C 3.5 08/05/15	55,000.000	51,416.750	
社債券	C FL 02/10/19	10,000.000	8,636.500	
社債券	COFP 6 02/27/12	20,000.000	21,342.000	
社債券	CS 6.375 06/07/13	30,000.000	33,013.500	
社債券	CS 6.375 06/07/13	20,000.000	22,009.000	
社債券	DAIGR 8 06/17/10	50,000.000	51,772.500	
社債券	DB 4.5 03/07/11	50,000.000	51,862.500	
社債券	DT 6 01/20/17	16,000.000	17,901.600	
社債券	DT 8.125 05/29/12	13,000.000	14,725.750	
社債券	EOAGR 5.125 10/02/12	9,000.000	9,697.500	
社債券	EOANGR 5.5 01/19/16	8,000.000	8,848.800	
社債券	EWE 5.25 07/16/21	4,000.000	4,200.800	
社債券	FNCIM 8.125 12/03/13	50,000.000	58,657.500	
社債券	GE 5.25 05/18/15	20,000.000	21,324.000	
社債券	GE 5.25 05/18/15	15,000.000	15,993.000	
社債券	GE 6 01/15/19	50,000.000	54,400.000	
社債券	GS 6.375 05/02/18	22,000.000	24,374.900	
社債券	GSZFP 5.625 01/18/16	7,000.000	7,803.250	
社債券	GSZFP 6.25 01/24/14	25,000.000	28,263.750	
社債券	HBOS FL 10/30/19	5,000.000	4,208.250	
社債券	HEIANA 7.125 04/07/14	11,000.000	12,485.000	
社債券	HSBC FL 06/29/20	45,000.000	44,379.000	
社債券	IBESM 7.5 11/25/15	50,000.000	60,570.000	
社債券	IBM 6.625 01/30/14	50,000.000	57,180.000	
社債券	IMPTOB 4.375 11/22/13	50,000.000	51,307.500	
社債券	INTNED FL 03/15/19	20,000.000	19,532.000	
社債券	ISPIM FL 06/26/18	50,000.000	50,787.500	
社債券	JPM 4.375 01/30/14	50,000.000	52,267.500	
社債券	KPN 6.25 09/16/13	50,000.000	55,472.500	
社債券	LINGR 4.75 04/24/17	15,000.000	15,769.500	
社債券	MANAG 7.25 05/20/16	3,000.000	3,463.800	
社債券	MER 4.625 10/02/13	12,000.000	12,176.880	
社債券	MICH 8.625 04/24/14	4,000.000	4,724.600	
社債券	MONTE FL PERPETUAL	5,000.000	4,650.000	
社債券	MRKGR 4.75 11/26/10	15,000.000	15,515.250	
社債券	MRKGR 4.875 09/27/13	3,000.000	3,207.450	
社債券	MS 6.5 12/28/18	50,000.000	54,298.000	
社債券	MTNA 9.375 06/03/16	50,000.000	60,350.000	

社債券	NBHSS FL 09/10/18	50,000.000	53,244.500	
社債券	NGGLN 5 07/02/18	5,000.000	5,237.000	
社債券	OTE 4.625 05/20/16	50,000.000	51,207.500	
社債券	PEMEX 6.25 08/05/13	15,000.000	16,034.250	
社債券	PM 5.625 09/06/11	50,000.000	53,140.000	
社債券	PRTP 8.625 04/03/14	5,000.000	5,914.500	
社債券	RENAUL 8.125 05/15/12	5,000.000	5,503.500	
社債券	ROSW 4.625 03/04/13	11,000.000	11,711.150	
社債券	RY 5.75 07/25/11	50,000.000	53,340.000	
社債券	SANFP 3.125 10/10/14	3,000.000	3,048.450	
社債券	SANFP 4.5 05/18/16	5,000.000	5,318.250	
社債券	SANTAN FL 05/30/18	50,000.000	50,507.500	
社債券	SOCGEN 5.25 03/28/13	50,000.000	54,192.500	
社債券	STANLN 5.875 09/26/17	50,000.000	53,040.000	
社債券	TD 5.375 05/14/15	50,000.000	55,130.000	
社債券	TITIM 6.875 01/24/13	15,000.000	16,657.500	
社債券	TITIM 6.875 01/24/13	15,000.000	16,657.500	
社債券	TITIM FL 04/20/11	10,000.000	10,755.000	
社債券	TITIM FL 04/20/11	10,000.000	10,755.000	
社債券	TKA 6.375 01/29/16	15,000.000	16,896.000	
社債券	TOYOTA 5.25 02/03/12	14,000.000	14,876.400	
社債券	TSCOLN 5.875 09/12/16	50,000.000	56,380.000	
社債券	UBS 6 04/18/18	50,000.000	54,772.500	
社債券	UCGIM 4.875 02/12/13	50,000.000	53,217.500	
社債券	VATFAL 4.125 03/18/13	50,000.000	52,360.000	
社債券	VIEFP 4.875 05/28/13	8,000.000	8,496.000	
社債券	VIEFP 5.375 05/28/18	17,000.000	18,383.800	
社債券	VINCI 7.375 03/20/19	50,000.000	61,552.500	
社債券	VZW 8.75 12/18/15	50,000.000	63,737.500	
社債券	WSTP 4.875 09/28/12	50,000.000	53,260.000	
社債券	ZURNVX FL 07/24/39	50,000.000	55,285.000	
小計（ユーロ）117銘柄		23,071,000.000	24,894,802.670	
			(3,322,211,417)	
合計			5,730,209,353	
			(5,730,209,353)	

（注）1. 各種通貨ごとの小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

2. ファンド合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入有価証券	有価証券の合計
		時価比率	金額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 10銘柄	21.12%	22.37%
	特殊債券 4 銘柄		
	社債券 2 銘柄		
カナダ・ドル	国債証券 7 銘柄	4.04%	4.28%
オーストラリア・ドル	地方債証券 1 銘柄	0.58%	0.61%
	特殊債券 1 銘柄		
イギリス・ポンド	国債証券 3 銘柄	6.21%	6.58%
	特殊債券 2 銘柄		
デンマーク・クローネ	国債証券 1 銘柄	0.67%	0.71%
スウェーデン・クローナ	国債証券 2 銘柄	0.66%	0.70%
メキシコ・ペソ	国債証券 3 銘柄	2.57%	2.72%
マレーシア・リングgit	国債証券 5 銘柄	2.96%	3.13%
ポーランド・ズロチ	国債証券 2 銘柄	0.86%	0.92%
ユーロ	国債証券 43銘柄	54.74%	57.98%
	特殊債券 2 銘柄		
	社債券 72銘柄		

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等並びに時価の状況表

注記表中の(デリバティブ取引等関係に関する注記) 取引の時価等に関する事項で記載しており、ここでは省略しております。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

（平成21年12月末日現在）

大和住銀DC年金設計ファンド30

資産総額	1,638,789,354 円
負債総額	2,256,172 円
純資産総額（ - ）	1,636,533,182 円
発行済数量	1,498,914,514 口
1単位当り純資産額（ / ）	1.0918 円

大和住銀DC年金設計ファンド50

資産総額	2,817,155,994 円
負債総額	4,863,650 円
純資産総額（ - ）	2,812,292,344 円
発行済数量	2,418,734,633 口
1単位当り純資産額（ / ）	1.1627 円

大和住銀DC年金設計ファンド70

資産総額	2,220,553,766 円
負債総額	3,466,356 円
純資産総額（ - ）	2,217,087,410 円
発行済数量	1,753,466,200 口
1単位当り純資産額（ / ）	1.2644 円

<参考：マザーファンドの純資産額計算書>
（平成21年12月末日現在）

年金日本株式マザーファンド

資産総額	62,543,620,881 円
負債総額	1,270,087,538 円
純資産総額（ - ）	61,273,533,343 円
発行済数量	63,089,666,695 口
1単位当り純資産額（ / ）	0.9712 円

年金日本債券マザーファンド

資産総額	15,809,072,965 円
負債総額	819,506,919 円
純資産総額（ - ）	14,989,566,046 円
発行済数量	15,001,062,705 口
1単位当り純資産額（ / ）	0.9992 円

インターナショナル株式マザーファンド

資産総額	40,414,119,470 円
負債総額	224,643,301 円
純資産総額（ - ）	40,189,476,169 円
発行済数量	31,066,027,887 口
1単位当り純資産額（ / ）	1.2937 円

インターナショナル債券マザーファンド

資産総額	6,230,397,563 円
負債総額	37,100,876 円
純資産総額（ - ）	6,193,296,687 円
発行済数量	3,612,142,376 口
1単位当り純資産額（ / ）	1.7146 円

第5【設定及び解約の実績】

大和住銀DC年金設計ファンド30

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
第1期（平成13年9月21日～平成14年11月19日）	16,738,625	0
第2期（平成14年11月20日～平成15年11月19日）	27,202,678	139,706
第3期（平成15年11月20日～平成16年11月19日）	138,771,682	16,070,889
第4期（平成16年11月20日～平成17年11月21日）	318,229,837	39,653,644
第5期（平成17年11月22日～平成18年11月20日）	378,693,981	72,849,363
第6期（平成18年11月21日～平成19年11月19日）	406,366,967	101,760,367
第7期（平成19年11月20日～平成20年11月19日）	373,468,531	143,235,212
第8期（平成20年11月20日～平成21年11月19日）	305,461,538	106,221,372

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

大和住銀DC年金設計ファンド50

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
第1期（平成13年9月21日～平成14年11月19日）	13,684,442	0
第2期（平成14年11月20日～平成15年11月19日）	21,946,632	390,070
第3期（平成15年11月20日～平成16年11月19日）	171,327,426	18,988,801
第4期（平成16年11月20日～平成17年11月21日）	367,282,251	29,943,825
第5期（平成17年11月22日～平成18年11月20日）	649,435,356	54,733,529
第6期（平成18年11月21日～平成19年11月19日）	632,725,984	123,531,924
第7期（平成19年11月20日～平成20年11月19日）	557,795,727	180,063,326
第8期（平成20年11月20日～平成21年11月19日）	545,720,178	177,126,475

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

大和住銀DC年金設計ファンド70

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
第1期（平成13年9月21日～平成14年11月19日）	12,222,369	2,784
第2期（平成14年11月20日～平成15年11月19日）	22,194,148	3,216,831
第3期（平成15年11月20日～平成16年11月19日）	138,932,306	11,772,009
第4期（平成16年11月20日～平成17年11月21日）	282,173,673	28,769,672
第5期（平成17年11月22日～平成18年11月20日）	498,588,224	86,787,396
第6期（平成18年11月21日～平成19年11月19日）	481,419,162	147,601,892
第7期（平成19年11月20日～平成20年11月19日）	453,744,672	213,353,608
第8期（平成20年11月20日～平成21年11月19日）	475,417,177	153,608,026

（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

第三部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

資本金の額：20億円（本書提出日現在）

会社が発行する株式総数：12,800,000株

発行済株式総数：3,850,000株

最近5年間ににおける主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構

会社は、8名以内で構成される取締役により運営されます。取締役は、株主総会の決議によって選任されます。取締役の選任は、議決権を行使することができる総株主の議決権の3分の2以上を有する株主が出席し、議決権を行使することができる総株主の議決権の3分の2以上をもってこれを行います。

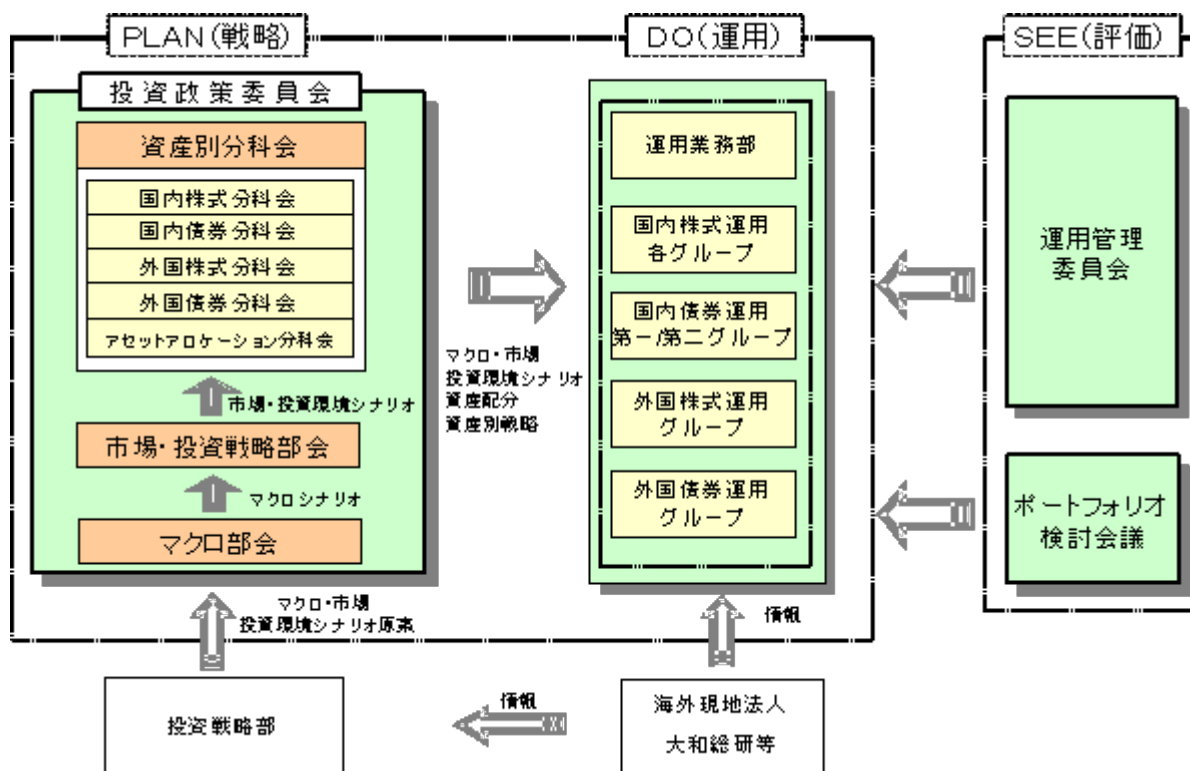
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち、最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。補欠として選任された取締役の任期は、前任取締役の任期の満了する時までとします。

取締役会は、取締役会の決議によって取締役の中から取締役社長、取締役副社長各1名、専務取締役および常務取締役若干名を選定することができます。また代表取締役は2名とし、取締役社長および取締役副社長がこれに就任します。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、代表取締役が招集し、招集通知は3日前までにこれを発します。ただし、緊急の必要があるときは、この期間を短縮することができます。

取締役会は、法令または定款に定める事項の他、業務執行に関する重要事項を決定します。その決議は、取締役の6名以上が出席し、その出席取締役の過半数をもって行います。

< 投信運用の意思決定プロセス >



2【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、株式会社住友銀行（現株式会社三井住友フィナンシャルグループ）および大和証券株式会社（現株式会社大和証券グループ本社）の戦略的提携により平成11年4月1日付で、大和投資顧問株式会社と住銀投資顧問株式会社およびエス・ピー・アイ・エム投信株式会社の三社が合併して設立された会社です。

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

平成21年12月末日現在、委託会社が運用の指図を行っている投資信託の総ファンド数は、137本であり、その純資産総額は、約2,014,689百万円です（なお、親投資信託48本は、ファンド数及び純資産総額からは除いております。）。

種類	ファンド数	純資産総額
単位型株式投資信託	4	19,404百万円
追加型株式投資信託	132	1,988,064百万円
追加型公社債投資信託	1	7,220百万円
合計	137	2,014,689百万円

3【委託会社等の経理状況】

1．委託会社の財務諸表は、「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条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号。）に基づいて作成しております。なお、第36期事業年度（自平成19年4月1日至平成20年3月31日）については、改正前の財務諸表等規則に基づき、第37期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）については、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

また、委託会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．財務諸表及び中間財務諸表の記載金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期事業年度（自平成19年4月1日至平成20年3月31日）及び、第37期事業年度（自平成20年4月1日至平成21年3月31日）の財務諸表についての監査、並びに第38期中間会計期間（自平成21年4月1日至平成21年9月30日）の中間財務諸表についての中間監査を、あずさ監査法人により受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

		第36期 (平成20年3月31日)	第37期 (平成21年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金・預金		9,891,855	8,926,038
前払費用		113,371	164,321
未収還付法人税等		-	304,359
未収収益		3,633,754	2,200,246
繰延税金資産		515,272	302,927
その他		15,104	96,171
流動資産計		14,169,358	11,994,065
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	488,532	397,192
器具備品	1	158,303	98,818
土地		710	710
建設仮勘定		-	3,911
有形固定資産計		647,545	500,632
無形固定資産			
ソフトウェア		316,333	445,887
電話加入権		12,706	12,706
無形固定資産計		329,039	458,593
投資その他の資産			
投資有価証券		4,173,446	3,812,850
関係会社株式		1,169,774	1,169,774
従業員長期貸付金		42,615	9,100
長期差入保証金		771,418	742,547
出資金		189,040	161,517
繰延税金資産		383,481	557,369
その他		1,730	1,323
貸倒引当金		70,350	70,350
投資その他の資産計		6,661,158	6,384,132

（単位：千円）

	第36期 （平成20年3月31日）	第37期 （平成21年3月31日）
固定資産計	7,637,744	7,343,357
資産合計	21,807,102	19,337,423

（単位：千円）

	第36期 （平成20年3月31日）	第37期 （平成21年3月31日）
負債の部		
流動負債		
未払金	53,603	73,433
未払費用	1,911,249	1,102,827
未払法人税等	1,674,618	-
前受収益	8,913	8,983
賞与引当金	876,200	604,600
役員賞与引当金	67,900	48,800
その他	18,892	18,721
流動負債計	4,611,378	1,857,365
固定負債		
退職給付引当金	701,833	751,197
役員退職慰労引当金	127,560	133,802
固定負債計	829,393	885,000
負債合計	5,440,771	2,742,365

（単位：千円）

	第36期 （平成20年3月31日）	第37期 （平成21年3月31日）
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	156,268	156,268
資本剰余金合計	156,268	156,268
利益剰余金		
利益準備金	343,731	343,731
その他利益剰余金		
別途積立金	1,100,000	1,100,000
繰越利益剰余金	12,806,951	13,220,524
利益剰余金合計	14,250,683	14,664,255
株主資本合計	16,406,951	16,820,524
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	40,620	225,466
評価・換算差額等合計	40,620	225,466
純資産合計	16,366,330	16,595,057
負債純資産合計	21,807,102	19,337,423

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第36期 （自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）	第37期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）
営業収益		
運用受託報酬	5,376,238	4,061,953
委託者報酬	20,900,527	15,381,937
その他営業収益	22,800	23,815
営業収益計	26,299,565	19,467,706
営業費用		
支払手数料	12,922,865	7,587,789
広告宣伝費	223,060	139,283
公告費	1,202	1,590
調査費		
調査費	820,589	1,208,212
委託調査費	5,980	1,691,482
委託計算費	117,931	112,690
営業雑経費		
通信費	52,015	27,023
印刷費	333,993	288,628
協会費	18,355	21,841
諸会費	13,550	8,534
その他	5,387	4,503
営業費用計	14,514,934	11,091,578
一般管理費		
給料		
役員報酬	275,374	205,830
給料・手当	2,474,696	2,704,289
賞与	31,325	40,459
退職金	4,113	5,076
福利厚生費	486,478	457,355
交際費	17,337	11,634
旅費交通費	155,950	144,711
租税公課	70,637	57,374
器具・備品費	98,812	-

不動産賃借料	532,824	838,846
--------	---------	---------

	(単位：千円)	
	第36期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第37期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
退職給付費用	186,719	171,337
固定資産減価償却費	75,468	168,629
賞与引当金繰入額	876,200	604,600
役員退職慰労引当金繰入額	40,330	39,220
役員賞与引当金繰入額	67,900	48,800
海外委託費	367,657	-
諸経費	229,675	282,477
一般管理費計	5,991,500	5,780,642
営業利益	5,793,131	2,595,485
営業外収益		
受取配当金	5,463	354,591
受取利息	21,451	22,205
投資有価証券売却益	41,942	2,288
為替差益	-	9,761
その他	36,449	4,989
営業外収益計	105,306	393,834
営業外費用		
投資有価証券売却損	121,459	677
為替差損	23,822	-
その他	280	4,113
営業外費用計	145,562	4,790
経常利益	5,752,875	2,984,529
特別利益		
投資有価証券売却益	28,500	-
賞与引当金戻入益	-	100,063

特別利益計	28,500	100,063
特別損失		
本社移転損失	284,487	-
その他	10,560	221
特別損失計	295,048	221
税引前当期純利益	5,486,327	3,084,371
法人税、住民税及び事業税	2,493,000	966,000
(単位：千円)		
	第36期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第37期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
法人税等調整額	126,191	164,798
法人税等合計	2,366,808	1,130,798
当期純利益	3,119,518	1,953,572

（３）【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	第36期 （自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）	第37期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,000	2,000,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	156,268	156,268
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	156,268	156,268
資本剰余金合計		
前期末残高	156,268	156,268
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	156,268	156,268
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	343,731	343,731
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	343,731	343,731
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	1,100,000	1,100,000
当期末変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	1,100,000	1,100,000

（単位：千円）

	第36期 （自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）	第37期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）
繰越利益剰余金		
前期末残高	10,457,433	12,806,951
当期変動額		
剰余金の配当	770,000	1,540,000
当期純利益	3,119,518	1,953,572
当期変動額合計	2,349,518	413,572
当期末残高	12,806,951	13,220,524
利益剰余金合計		
前期末残高	11,901,164	14,250,683
当期変動額		
剰余金の配当	770,000	1,540,000
当期純利益	3,119,518	1,953,572
当期変動額合計	2,349,518	413,572
当期末残高	14,250,683	14,664,255
株主資本合計		
前期末残高	14,057,433	16,406,951
当期変動額		
剰余金の配当	770,000	1,540,000
当期純利益	3,119,518	1,953,572
当期変動額合計	2,349,518	413,572
当期末残高	16,406,951	16,820,524
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	14,348	40,620
当期変動額		
株主資本以外の項目	54,969	184,845
の当期変動額（純額）		
当期変動額合計	54,969	184,845
当期末残高	40,620	225,466
評価・換算差額等合計		
前期末残高	14,348	40,620

当期変動額		
株主資本以外の項目	54,969	184,845
の当期変動額（純額）		
当期変動額合計	54,969	184,845
当期末残高	40,620	225,466
純資産合計		
前期末残高	14,071,782	16,366,330
当期変動額		
剰余金の配当	770,000	1,540,000
当期純利益	3,119,518	1,953,572
株主資本以外の項目の当期 変動額（純額）	54,969	184,845
当期変動額合計	2,294,548	228,726
当期末残高	16,366,330	16,595,057

[次へ](#)

重要な会計方針

	第36期 （自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）	第37期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）
1.有価証券の評価基準 及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法を採用して おります。 (2) 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、総平均 法により算定）を採用しておりま す。 時価のないもの 総平均法による原価法を採用し て おります。	(1) 子会社株式及び関連会社株式 同左 (2) その他有価証券 同左

2.固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 15～30年 器具備品 4～15年 (会計方針の変更) 法人税法の改正（（所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号）及び（法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日政令第83号）に伴い、平成19年4月1日以降に取得したものについては、改正後の法人税法に基づく方法に変更しております。これにより、従来の方法に比べて営業利益、経常利益、及び税引前当期純利益がそれぞれ12,326千円減少しております。 (追加情報) 平成19年度の法人税法改正に伴い、平成19年3月31日以前に取得した資産については、改正前の法人税法に基づく減価償却の方法の適用により取得価額の5%に到達した事業年度の翌事業年度より、取得価額の5%相当額と備忘価額との差額を5年間にわたり均等償却し、減価償却費に含めております。当該変更に伴う損益に与える影響は軽微であります。	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおり であります。 建物 15～30年 器具備品 4～15年
-----------------------	---	--

3.引当金の計上基準	(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、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。 (1) 貸倒引当金 債権の貸倒による損失に備えるため 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金 従業員賞与の支払に備えるため、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。 (3) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、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。 (4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。 (5) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。	(2)無形固定資産 同左 (1) 貸倒引当金 同左 (2) 賞与引当金 同左 (3) 役員賞与引当金 同左 (4) 退職給付引当金 同左 (5) 役員退職慰労引当金 同左
4.その他財務諸表作成のための重要な事項	(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。	(1) 消費税等の会計処理 同左

会計方針の変更

第36期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第37期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
-	(リース取引に関する会計基準等) 所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、当事業年度より「リース取引に関する会計基準」(企業会計基準第13号(平成5年6月17日(企業会計審議会第一部会)、平成19年3月30日改正))及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第16号(平成6年1月18日(日本公認会計士協会 会計制度委員会)、平成19年3月30日改正))が適用されたことに伴い、通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理を適用しております。なお、リース取引開始日が適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、引き続き通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理を適用しております。当該変更に伴う損益に与える影響はありません。

表示方法の変更

第36期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第37期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
(損益計算書) (1) 金融商品取引法の施行に伴う、投資運用業等統一経理基準の改正により、前事業年度において「投資顧問料」と表示しておりました投資運用業に係る収益は、当事業年度より「運用受託報酬」と表示することといたしました。 (2) 前事業年度において、一般管理費の「諸経費」に含めて表示しておりました「海外委託費」は、一般管理費総額の100分の5を超えたため、当事業年度より区分掲記することといたしました。なお、前事業年度の一般管理費の「諸経費」に含まれる「海外委託費」は、263,400千円であります。	(損益計算書) 投資運用業等統一経理基準の一部改正（平成20年3月19日）により、以下の表示方法の変更を行っております。 (1) 前事業年度まで助言手数料を営業費用の「支払手数料」に含めて表示しておりましたが、当事業年度より「委託調査費」として区分掲記することといたしました。なお、前事業年度の「支払手数料」に含まれる助言手数料は、2,333,171千円であり、当事業年度の「調査費」に含まれる助言手数料は、1,651,234千円であります。 (2) 前事業年度まで「海外委託費」は、一般管理費に表示しておりましたが、当事業年度より営業費用の「調査費」と「委託調査費」に表示することといたしました。当事業年度の「調査費」、「委託調査費」に含まれる海外委託費の合計額は、360,564千円であります。 (3) 前事業年度まで「器具・備品費」は、一般管理費の内訳として区分掲記しておりましたが、当事業年度より「諸経費」の中に含めることといたしました。なお、当事業年度の「器具・備品費」は、84,833千円であります。 (4) 前事業年度まで「情報提供料」を一般管理費の「諸経費」に含めて表示しておりましたが、当事業年度より営業費用の「調査費」に含めて表示することといたしました。なお、前事業年度及び当事業年度の「情報提供料」はいずれも40,000千円であります。

注記事項

(貸借対照表関係)

第36期 (平成20年3月31日)	第37期 (平成21年3月31日)
----------------------	----------------------

1.有形固定資産の減価償却累計額	1.有形固定資産の減価償却累計額
建物 35,799千円	建物 132,619千円
器具備品 116,068千円	器具備品 184,596千円
	2.保証債務
	被保証者 従業員
	被保証債務の内容 住宅ローン
	金額 31,092千円

（損益計算書関係）

第36期 （自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）	第37期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）
該当事項はありません。	同左

（株主資本等変動計算書関係）

第36期（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

1.発行済株式に関する事項

（単位：千株）

	前事業年度末 株 式 数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株 式 数
発行済株式				
普通株式	3,850	-	-	3,850
合 計	3,850	-	-	3,850

2.自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3.新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4.配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成19年6月22 日 定時株主総会	普通株式	770,000	200	平成19年3月31 日	平成19年6月25 日

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

決議	株式の 種類	配当金 の総額 （千円）	配当の 原資	1株当た り配当額 （円）	基準日	効力発生日
----	-----------	--------------------	-----------	---------------------	-----	-------

平成20年6月20日 定時株主総会	普通 株式	1,540,000	利益 剰余金	400	平成20年3月31日	平成20年6月23日
----------------------	----------	-----------	-----------	-----	------------	------------

第37期（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

（単位：千株）

	前事業年度末 株 式 数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株 式 数
発行済株式				
普通株式	3,850	-	-	3,850
合 計	3,850	-	-	3,850

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成20年6月20日 定時株主総会	普通株式	1,540,000	400	平成20年3月31日	平成20年6月23日

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

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	配当の 原資	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成21年6月24日 定時株主総会	普通 株式	962,500	利益 剰余金	250	平成21年3月31日	平成21年6月25日

（リース取引関係）

第36期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第37期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)																								
1. ファイナンス・リース取引 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引（借主側） (1) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額	1. ファイナンス・リース取引 リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引（通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっているもの） (借主側) (1) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額																								
<table><tr><th></th><th>取得価額 相当額 (千円)</th><th>減価償却 累計額相当 額 (千円)</th><th>期末残高 相当額 (千円)</th></tr><tr><td>器具備品</td><td>4,823</td><td>80</td><td>4,743</td></tr><tr><td>合 計</td><td>4,823</td><td>80</td><td>4,743</td></tr></table>		取得価額 相当額 (千円)	減価償却 累計額相当 額 (千円)	期末残高 相当額 (千円)	器具備品	4,823	80	4,743	合 計	4,823	80	4,743	<table><tr><th></th><th>取得価額 相当額 (千円)</th><th>減価償却累 計額相当額 (千円)</th><th>期末残高 相当額 (千円)</th></tr><tr><td>器具備品</td><td>4,823</td><td>1,045</td><td>3,778</td></tr><tr><td>合 計</td><td>4,823</td><td>1,045</td><td>3,778</td></tr></table>		取得価額 相当額 (千円)	減価償却累 計額相当額 (千円)	期末残高 相当額 (千円)	器具備品	4,823	1,045	3,778	合 計	4,823	1,045	3,778
	取得価額 相当額 (千円)	減価償却 累計額相当 額 (千円)	期末残高 相当額 (千円)																						
器具備品	4,823	80	4,743																						
合 計	4,823	80	4,743																						
	取得価額 相当額 (千円)	減価償却累 計額相当額 (千円)	期末残高 相当額 (千円)																						
器具備品	4,823	1,045	3,778																						
合 計	4,823	1,045	3,778																						
(2) 未経過リース料期末残高相当額 1年以内 889千円 1年超 3,861千円 合計 4,751千円	(2) 未経過リース料期末残高相当額 1年以内 926千円 1年超 2,934千円 合計 3,861千円																								
(3) 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 支払リース料 89千円 減価償却費相当額 80千円 支払利息相当額 16千円	(3) 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 支払リース料 1,070千円 減価償却費相当額 964千円 支払利息相当額 181千円																								
(4) 減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法 減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。 支払利息相当額の算定方法 リース料総額とリース物件の取得価額相当額の差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。	(4) 減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法 同左																								
2. オペレーティング・リース取引 未経過リース料 1年以内 2,104千円 1年超 3,714千円 合計 5,818千円	2. オペレーティング・リース取引 未経過リース料 1年以内 2,104千円 1年超 1,609千円 合計 3,714千円																								

（有価証券関係）

第36期（平成20年3月31日現在）

1. その他有価証券で時価のあるもの

	種類	取得原価（千円）	貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	35,000	41,194	6,194
	小計	35,000	41,194	6,194
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	3,850,000	3,775,420	74,580
	小計	3,850,000	3,775,420	74,580
合計		3,885,000	3,816,614	80,774

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
3,864,983	70,442	121,459

3. 時価評価されていない有価証券

(1) 子会社株式及び関連会社株式

区分	貸借対照表計上額（千円）
子会社株式	1,169,774
関連会社株式	-
合計	1,169,774

(2) その他有価証券

区分	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	356,832
合計	356,832

第37期（平成21年3月31日現在）

1. その他有価証券で時価のあるもの

	種類	取得原価（千円）	貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	-	-	-
	小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券	-	-	-
	(3) その他	3,901,000	3,521,426	379,573
	小計	3,901,000	3,521,426	379,573
合計		3,901,000	3,521,426	379,573

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
77,769	2,288	677

3.時価評価されていない有価証券

(1) 子会社株式及び関連会社株式

区分	貸借対照表計上額（千円）
子会社株式	1,169,774
関連会社株式	-
合計	1,169,774

(2) その他有価証券

区分	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	291,423
合計	291,423

(デリバティブ取引関係)

第36期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第37期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
当社は、デリバティブ取引を全く利用しておりませんので、該当事項はありません。	同左

(退職給付関係)

第36期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第37期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
1.採用している退職給付制度の概要 退職金規程に基づく退職一時金制度のほか、確定拠出年金制度を採用しております。 2.退職給付債務に関する事項 退職給付債務（退職給付引当金） 701,833千円 (注)退職給付債務の算定にあたり簡便法を採用しております。 3.退職給付費用に関する事項 勤務費用 148,413千円 確定拠出年金掛金 38,306千円 合 計 186,719千円 (注)退職給付債務の算定にあたり簡便法を採用しております。 4.退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については記載しておりません。	1.採用している退職給付制度の概要 同左 2.退職給付債務に関する事項 退職給付債務（退職給付引当金） 751,197千円 (注)退職給付債務の算定にあたり簡便法を採用しております。 3.退職給付費用に関する事項 勤務費用 128,898千円 確定拠出年金掛金 42,439千円 合 計 171,337千円 (注)退職給付債務の算定にあたり簡便法を採用しております。 4.退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 同左

（税効果会計関係）

第36期 （自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）	第37期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別 内訳	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別 内訳
流動資産 (千円)	流動資産 (千円)
未払事業税 118,450	未払事業税 14,717
賞与引当金 355,737	賞与引当金 245,467
社会保険料 26,640	社会保険料 22,200
未払事業所税 5,253	未払事業所税 5,229
その他 9,190	その他 15,313
（繰延税金資産の小計） 515,272	（繰延税金資産の小計） 302,927
繰延税金資産の純額 515,272	繰延税金資産の純額 302,927
固定資産	固定資産
退職給付引当金 284,944	退職給付引当金 304,986
投資有価証券 40,700	投資有価証券 40,700
ゴルフ会員権 37,190	ゴルフ会員権 37,190
役員退職慰労引当金 51,789	役員退職慰労引当金 54,323
その他有価証券評価差額金 27,764	その他有価証券評価差額金 154,106
その他 18,983	その他 43,952
（繰延税金資産の小計） 461,372	（繰延税金資産の小計） 635,260
評価性引当額 77,890	評価性引当額 77,890
（繰延税金資産の合計） 383,481	（繰延税金資産の合計） 557,369
繰延税金資産の純額 383,481	繰延税金資産の純額 557,369
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	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	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
法定実効税率 40.6%	法定実効税率 40.6%
（調整）	（調整）
交際費等永久に損金に算入されない項 目 0.7	交際費等永久に損金に算入されない項 0.9
評価性引当額の減少 0.2	受取配当金等永久に益金に算入されない項 0.3
過年度法人税等 1.5	目 0.6
特定外国子会社等課税所得 3.6	過年度法人税等 1.6
外国税額控除 0.4	特定外国子会社等課税所得 1.7
その他 0.3	外国税額控除 0.7
税効果会計適用後の法人税等の負担率 43.1	その他 0.7
	税効果会計適用後の法人税等の負担率 36.6

(関連当事者との取引)

第36期（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	3,447,678	未払費用	486,012
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	6,650	銀行業	-	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	4,942,630	未払費用	341,444

取引条件 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。

第37期（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	2,078,153	未払費用	242,242
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	6,650	銀行業	-	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	3,549,060	未払費用	193,011

取引条件 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。

(追加情報)

当事業年度より平成18年10月17日公表の、「関連当事者の開示に関する会計基準」（企業会計基準委員会 企業会

計基準第11号）及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会企業会計基準適用指針第13号）を適用しております。

なお、これによる開示対象の追加はございません。

（１株当たり情報）

第36期 （自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）	第37期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）
1株当たり純資産額 4,251円00銭 1株当たり当期純利益 810円26銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益に 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。	1株当たり純資産額 4,310円40銭 1株当たり当期純利益 507円42銭 同左

（注）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。

	第36期 （自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）	第37期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）
損益計算書上の当期純利益（千円）	3,119,518	1,953,572
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（千円）	3,119,518	1,953,572
普通株式の期中平均株式数（千株）	3,850	3,850

（重要な後発事象）

第36期 （自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）	第37期 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）
該当事項はありません。	同左

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

		当中間会計期間末 (平成21年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		8,325,881
前払費用		141,850
未収収益		3,248,527
繰延税金資産		215,502
その他		13,191
流動資産計		11,944,953
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	359,613
器具備品	1	80,778
土地		710
有形固定資産計		441,101
無形固定資産		416,102
投資その他の資産		
投資有価証券		4,326,862
関係会社株式		1,169,774
長期貸付金		7,092
長期差入保証金		742,150
会員権		161,517
繰延税金資産		540,064
その他		1,119
貸倒引当金		70,350
投資その他の資産計		6,878,229
固定資産計		7,735,434
資産合計		19,680,388

負債の部

流動負債

未払金		25,746
未払費用		1,521,043
未払法人税等		381,573
前受収益		99,056
賞与引当金		369,000
役員賞与引当金		23,500
その他	2	88,102
流動負債計		2,508,022

固定負債

退職給付引当金		785,612
役員退職慰労引当金		153,622
固定負債計		939,234
負債合計		3,447,257

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		156,268
資本剰余金合計		156,268
利益剰余金		
利益準備金		343,731
その他利益剰余金		
別途積立金		1,100,000
繰越利益剰余金		12,787,310
利益剰余金合計		14,231,041
株主資本合計		16,387,310

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		154,179
評価・換算差額等合計		154,179

純資産合計		16,233,130
-------	--	------------

負債純資産合計		19,680,388
---------	--	------------

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

		当中間会計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		7,477,809
運用受託報酬		1,733,941
その他営業収益		10,204
営業収益計		9,221,955
営業費用		5,407,052
一般管理費	1	2,870,648
営業利益		944,253
営業外収益		
受取配当金		2,114
受取利息		8,188
還付加算金		10,117
雑収入		1,606
営業外収益計		22,027
営業外費用		
為替差損		13,862
営業外費用計		13,862
經常利益		952,418
税引前中間純利益		952,418
法人税、住民税及び事業税		367,126
法人税等調整額		56,005
法人税等合計		423,132
中間純利益		529,286

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位:千円)

当中間会計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日)	
株主資本	
資本金	
前期末残高	2,000,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	2,000,000
資本剰余金	
資本準備金	
前期末残高	156,268
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	156,268
資本剰余金合計	
前期末残高	156,268
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	156,268
利益剰余金	
利益準備金	
前期末残高	343,731
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	343,731
その他利益剰余金	
別途積立金	
前期末残高	1,100,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	1,100,000
繰越利益剰余金	
前期末残高	13,220,524
当中間期変動額	
剰余金の配当	962,500
中間純利益	529,286
当中間期変動額合計	433,213
当中間期末残高	12,787,310
利益剰余金合計	
前期末残高	14,664,255
当中間期変動額	
剰余金の配当	962,500
中間純利益	529,286
当中間期変動額合計	433,213
当中間期末残高	14,231,041

株主資本合計	
前期末残高	16,820,524
当中間期変動額	
剰余金の配当	962,500
中間純利益	529,286
当中間期変動額合計	433,213
当中間期末残高	16,387,310
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	225,466
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期	71,287
変動額（純額）	
当中間期変動額合計	71,287
当中間期末残高	154,179
評価・換算差額等合計	
前期末残高	225,466
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期	71,287
変動額（純額）	
当中間期変動額合計	71,287
当中間期末残高	154,179
純資産合計	
前期末残高	16,595,057
当中間期変動額	
剰余金の配当	962,500
中間純利益	529,286
株主資本以外の項目の当中間期	71,287
変動額（純額）	
当中間期変動額合計	361,926
当中間期末残高	16,233,130

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

	当中間会計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日)
1. 資産の評価基準及び評価方法	有価証券 (1) 子会社株式及び関連会社株式...総平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの...中間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、売却原価は総平均法により算定） 時価のないもの...総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 定率法を採用しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物15年～30年、器具備品4年～15年 (2) 無形固定資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、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) 貸倒引当金 債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金 従業員賞与の支払に備えるため、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。 (3) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、当事業年度における支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。 (4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当中間会計期間末の要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。 (5) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。
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 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間末（平成21年9月30日）	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	376,559千円
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. 保証債務

被保証者	従業員
被保証債務の内容	住宅ローン
金額	29,138千円

（中間損益計算書関係）

当中間会計期間（自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日）		
1. 減価償却実施額	有形固定資産	59,343千円
	無形固定資産	68,774千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

（中間決算までの期間が経過しているため、当該期間中に発行済株式数等が変動しているため）

当中間会計期間（自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日）					
1. 発行済株式に関する事項					
株式の種類	前事業年度末 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（千株）	3,850	-	-	3,850	
2. 自己株式に関する事項 該当事項はありません。					
3. 新株予約権等に関する事項 該当事項はありません。					
4. 配当に関する事項 配当金支払額					
決議	株式の 種類	配当金の 総額（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成21年6月24日 定時株主総会	普通株式	962,500	250	平成21年3月31日	平成21年6月25日

（リース取引関係）

当中間会計期間（自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日）

1. ファイナンス・リース取引

リース取引開始日が平成20年3月31日以前の所有権移転外ファイナンス・リース取引

（借主側）

（1）リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額

	器具備品	合 計
取得価額相当額	4,823千円	4,823千円
減価償却累計額相当額	1,527千円	1,527千円
中間期末残高相当額	3,296千円	3,296千円

（2）未経過リース料中間会計期間末残高相当額

1 年内	946千円
1 年超	2,456千円
合 計	3,403千円

（3）支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

支払リース料	535千円
減価償却費相当額	482千円
支払利息相当額	76千円

（4）減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法

減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

支払利息相当額の算定方法

リース料総額とリース物件の取得価額相当額の差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。

2. オペレーティング・リース取引

（借主側）

未経過リース料

1年以内	2,104千円
1年超	556千円
合 計	2,661千円

（有価証券関係）

当中間会計期間末（平成21年9月30日）

1．その他有価証券で時価のあるもの

区 分	取得原価(千円)	中間貸借対照表計上額 (千円)	差額(千円)
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	4,295,000	4,035,438	259,561
合 計	4,295,000	4,035,438	259,561

2．時価評価されていない主な有価証券の内容及び中間貸借対照表計上額

（1）子会社株式及び関連会社株式

区 分	中間貸借対照表計上額(千円)
子会社株式	1,169,774
関連会社株式	-

合 計	1,169,774
-----	-----------

(2) その他有価証券

区 分	中間貸借対照表計上額(千円)
非上場株式（店頭売買株式を除く）	291,423
合 計	291,423

(デリバティブ取引関係)

当中間会計期間（自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日）
デリバティブ取引を利用しておりませんので、該当事項はありません。

(1株当たり情報)

当中間会計期間（自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日）
1株当たり純資産額 4,216円39銭
1株当たり中間純利益 137円47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株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

(注)算定上の基礎

1.1株当たり純資産額

項目	当中間会計期間末 (平成21年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(千円)	16,233,130
純資産の部の合計額から控除する金額(千円)	-
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	16,233,130
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間期末の普通株式の 数(千株)	3,850

2.1株当たり中間純利益

項目	当中間会計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日)
中間損益計算書上の中間純利益(千円)	529,286
普通株式に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益(千円)	529,286
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850

(重要な後発事象)

当中間会計期間（自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日）
該当事項はありません。

[前へ](#)

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1)自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2)運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3)通常の利用の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)および(5)において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。
- (4)委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5)上記(3)および(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

- (1)定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

当社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

- (2)訴訟事件その他重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えると予想される訴訟事件等は発生していません。

委託会社の営業年度は、毎年4月1日より翌年3月31日までとし、営業年度末に決算を行います。

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】

(1)受託会社

名称	資本金の額（百万円） 平成21年9月末日現在	事業の内容
住友信託銀行株式会社	342,037	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（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

<参考：再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）の概要>

- ・資本金：51,000百万円（平成21年9月末日現在）
- ・資本構成：住友信託銀行株式会社33.3%、株式会社りそな銀行33.3%、中央三井トラスト・ホールディングス株式会社33.3%
- ・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。
- ・再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2)投資顧問会社

名称

T・ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービスーズ・リミテッド
(T.Rowe Price Global Investment Services Limited)

資本金の額

平成21年6月末日現在：4,700万米ドル（約4,328百万円）

（注）米ドルの円貨換算は、平成21年12月末日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝92.10円）によります。

事業の内容

同社（所在地：英国ロンドン）は、米国T・ロウ・プライス・グループの運用会社です。同グループの代表的な会社であるT・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクは、1937年に設立された会社で、グローバルに資産運用業務を行っております。T・ロウ・プライス・アソシエイツ・インクおよびT・ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービスーズ・リミテッドの親会社であるT・ロウ・プライス・グループ・インクは、米国の上場会社であり、また、S & P 500インデックスの採用銘柄です。T・ロウ・プライス・グローバル・インベストメント・サービスーズ・リミテッドは、T・ロウ・プライス・グループの運用技術および調査能力を活用することができます。

(3) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 平成21年9月末日現在	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三井住友銀行	1,262,959	銀行法に基づき、監督官庁の免許を受け銀行業を営んでいます。
株式会社みずほコーポレート銀行	1,404,065	
住友信託銀行株式会社	342,037	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（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの受託会社として、信託財産に属する有価証券の保管・管理・計算等およびその信託事務処理の一部の委託等を行います。

(2) 投資顧問会社

委託会社より、運用指図に関する権限の委託を受けて運用の指図および実行を行います。

(3) 販売会社

日本におけるファンドの募集・販売業務、解約金・償還金、収益分配金の支払い等に関する事務等を行います。

3【資本関係】

(1) 受託会社

受託会社の住友信託銀行株式会社は、ファンドの受益権の発行会社である大和住銀投信投資顧問株式会社の2.1%の株式を保有しています。

(2) 販売会社

大和証券株式会社の親会社である株式会社大和証券グループ本社はファンドの受益権の発行会社である大和住銀投信投資顧問株式会社の44.0%の株式を保有しています。

株式会社三井住友銀行の親会社である株式会社三井住友フィナンシャルグループはファンドの受益権の発行会社である大和住銀投信投資顧問株式会社の44.0%の株式を保有しています。

住友信託銀行株式会社はファンドの受益権の発行会社である大和住銀投信投資顧問株式会社の2.1%の株式を保有しています。

第3【参考情報】

当計算期間において、本ファンドに係る金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は、以下のとおり関東財務局長宛に提出しております。

書類名	提出年月日
有価証券届出書	平成21年 2 月19日
有価証券報告書	平成21年 2 月19日
半期報告書	平成21年 8 月19日
有価証券届出書の訂正届出書	平成21年 8 月19日

独立監査人の監査報告書

平成22年1月8日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド30の平成20年11月20日から平成21年11月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀DC年金設計ファンド30の平成21年11月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況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。

大和住銀投信投資顧問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、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．財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年1月8日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド50の平成20年11月20日から平成21年11月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀DC年金設計ファンド50の平成21年11月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況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。

大和住銀投信投資顧問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、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．財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年1月8日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド70の平成20年11月20日から平成21年11月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀DC年金設計ファンド70の平成21年11月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況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。

大和住銀投信投資顧問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、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．財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年 6 月25日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和住銀投信投資顧問株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第37期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀投信投資顧問株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

上記は、当社が、独立監査人の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。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成21年12月11日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和住銀投信投資顧問株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（平成21年4月1日から平成21年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和住銀投信投資顧問株式会社の平成21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21年4月1日から平成21年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以 上

上記は、当社が、独立監査人の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。

[前へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年12月26日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド30の平成19年11月20日から平成20年11月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀DC年金設計ファンド30の平成20年11月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況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。

大和住銀投信投資顧問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、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．財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年12月26日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド50の平成19年11月20日から平成20年11月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀DC年金設計ファンド50の平成20年11月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況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。

大和住銀投信投資顧問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、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．財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年12月26日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド70の平成19年11月20日から平成20年11月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀DC年金設計ファンド70の平成20年11月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況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。

大和住銀投信投資顧問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、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．財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年6月25日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 飯田 浩司 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 久野 佳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和住銀投信投資顧問株式会社の平成19年4月1日から平成20年3月31日までの第36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について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀投信投資顧問株式会社の平成20年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

上記は、当社が、独立監査人の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。

[前へ](#)