

【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26年2月19日

【計算期間】 第12期（自 平成24年11月20日 至 平成25年11月19日）

【ファンド名】 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

【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 多田 正己

【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】 植松 克彦

【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一般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、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

< 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。

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

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（日本を含む）の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

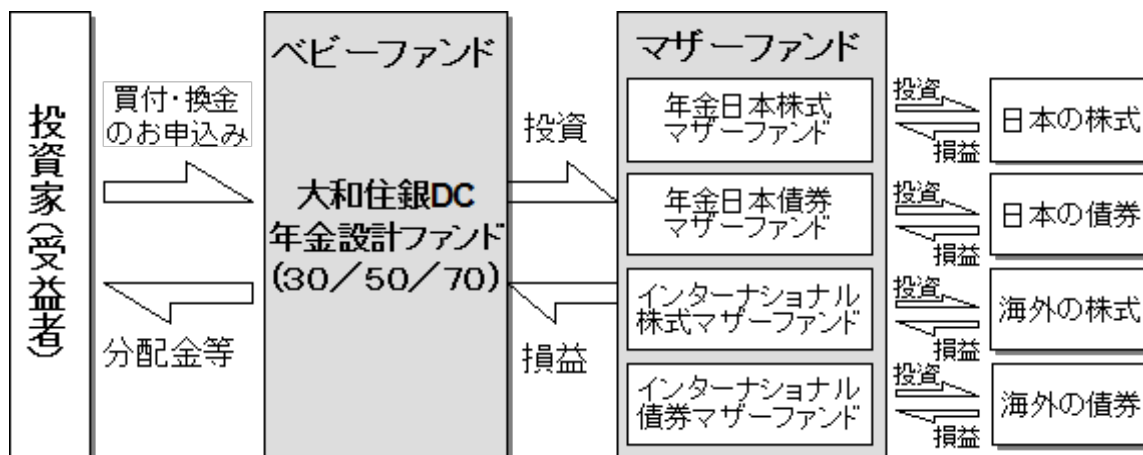
ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

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、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

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、国際株式マザーファンドおよび国際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	国際株式マザーファンド	国際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・インターナショナル・リミテッドが行います。

国際株式マザーファンドおよび国際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・インターナショナル・リミテッドへ委託します。

< T・ロウ・プライス・インターナショナル・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・インターナショナル・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。

二．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ゆる株価指数であり、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25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（2013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、イスラエル、イタリア、オランダ、ニュージーランド、ノルウェー、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、アメリカ

（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・マーケット・インクが開発した債券指数で、平成25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・マーケット・インクに帰属します。また、シティグループ・グローバル・マーケット・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（2013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、スペイン、スウェーデン、スイス、イギリス、ポーランド、ノルウェー、シンガポール、マレーシア、メキシコ、南アフリカ

（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（バリュウ）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) TOPIX（東証株価指数・配当込み）をベンチマークとし、バリュウ・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、バリュウ銘柄に重点をおき、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。

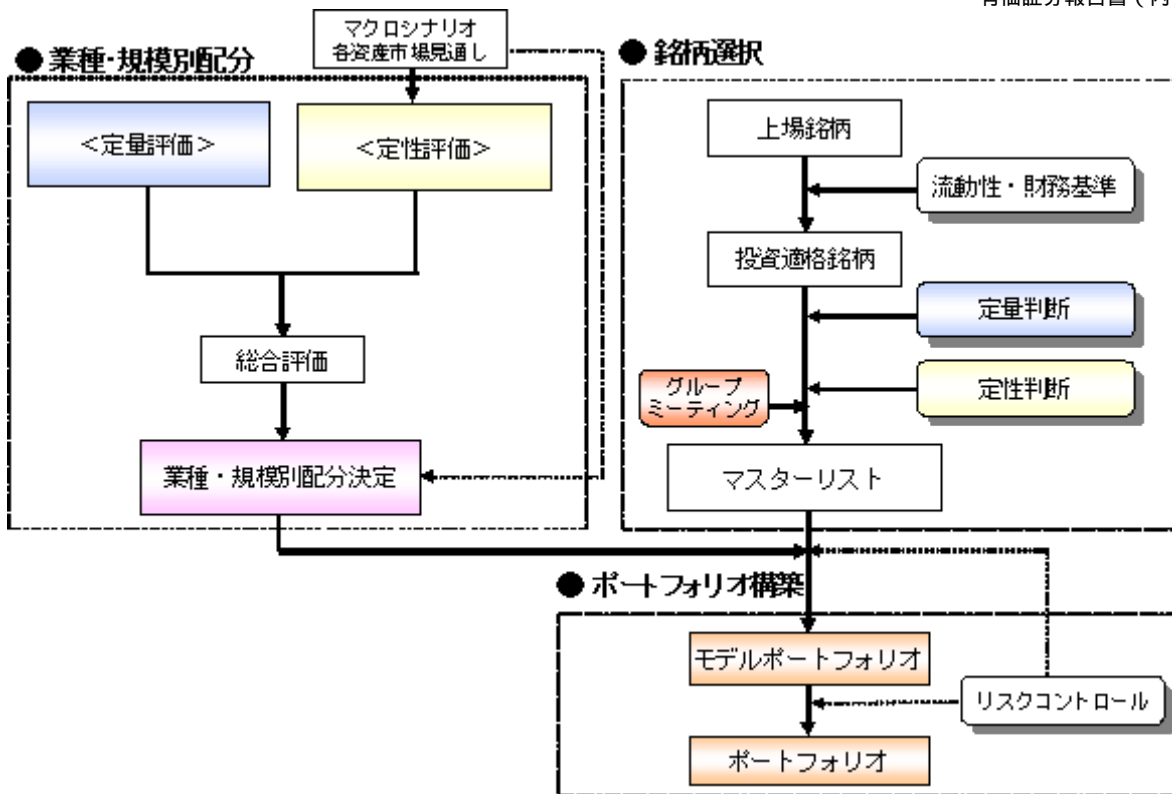
業種規模別配分

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入制限の管理等

< 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調査部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・インターナショナル・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。

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・インターナショナル・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。

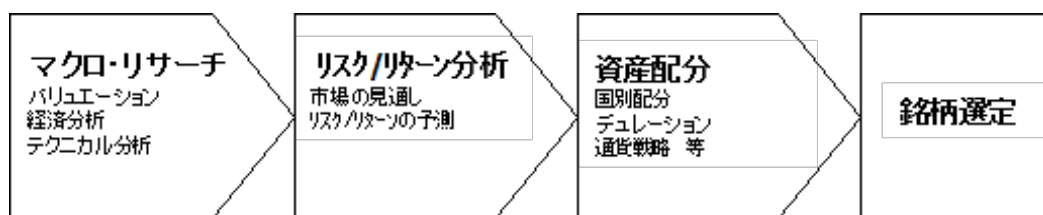
銘柄選択

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>



信託金の限度額

信託金の限度額は、各々につき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】

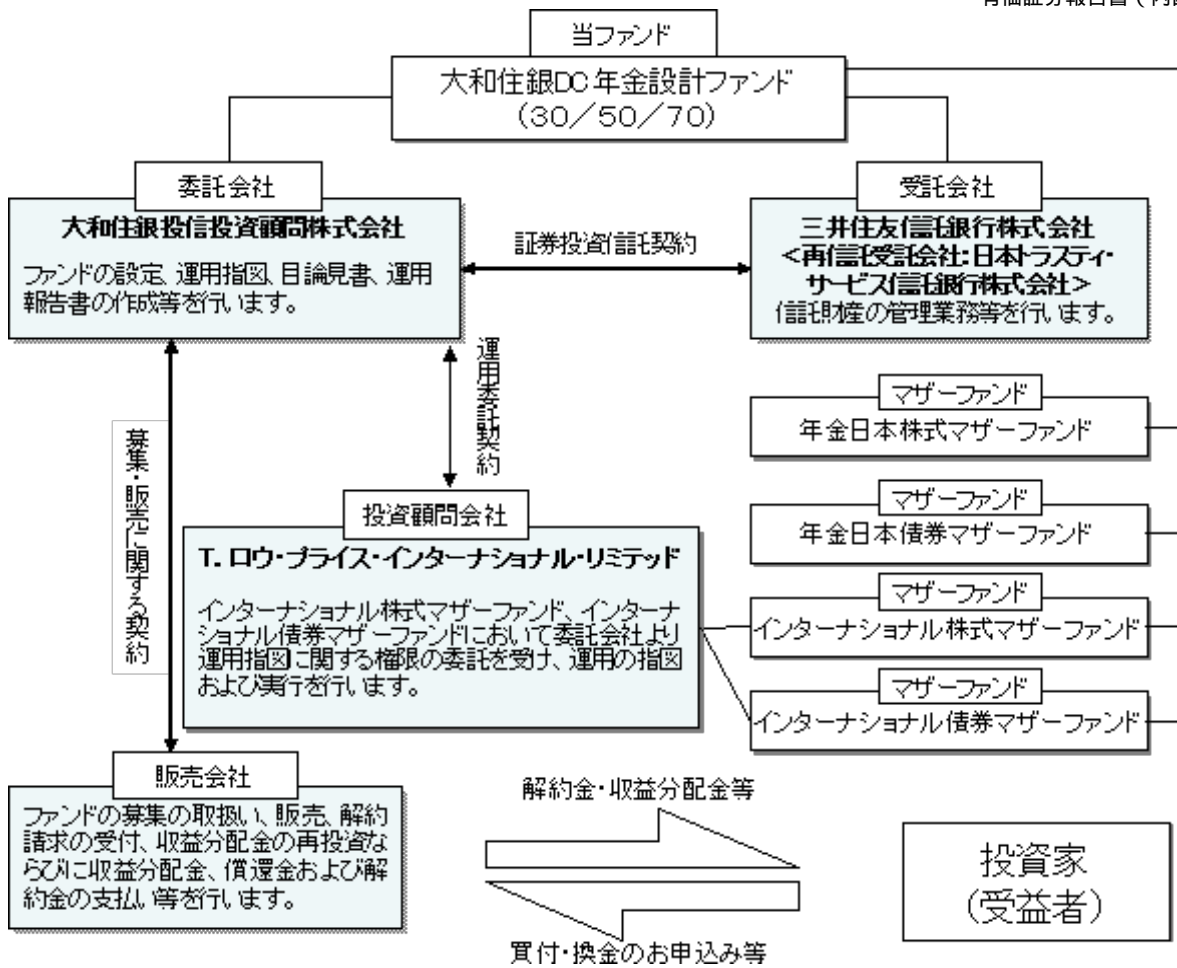
平成13年9月21日 信託契約締結

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。

(3)【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かか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25年12月末現在）

- ・ 資本金の額 20億円
- ・ 会社の沿革
 - 昭和48年6月1日 大和投資顧問株式会社設立
 - 平成11年2月18日 証券投資信託委託業の認可取得
 - 平成11年4月1日 住銀投資顧問株式会社及びエス・ピー・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	東京都千代田区丸の内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】

投資の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せん。）
- 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、三井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。

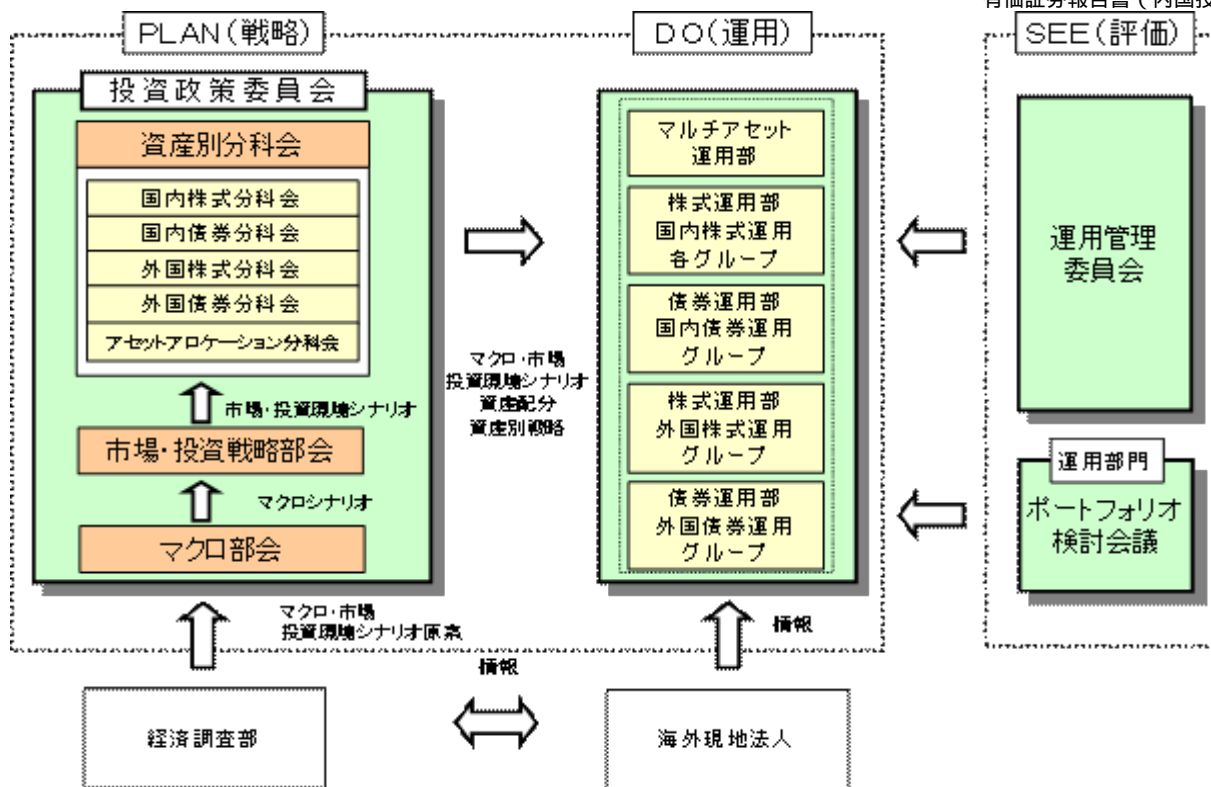
その他の金融商品の運用の指図

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部門の人員数は、平成25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<リスクの管理体制>」に記載しております。
- * 当社では、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等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。

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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、）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。

ニ．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るときは、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。

(八)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るときは、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るときは、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、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。

(ニ)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

外貨建資産への実質投資割合は、取得時において下記のとおりとします。

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以内

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以内

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以内

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。

ヨ．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てを目的として、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。

タ．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．T O P I X（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

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．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るときは、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るときは、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せん。）

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ません。）

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。）

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せん。）

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るときは、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るときは、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。

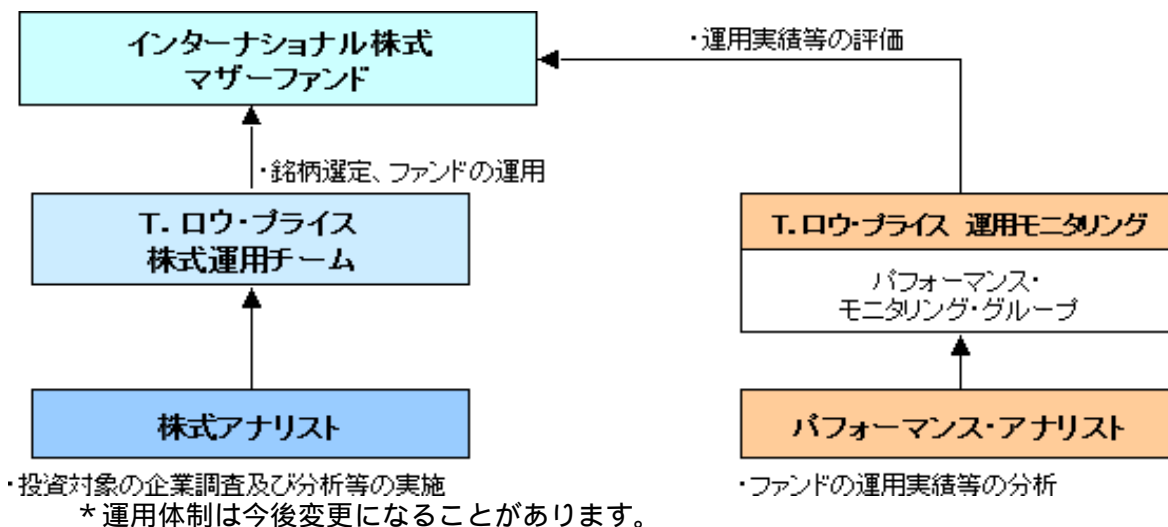
投資態度

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・インターナショナル・リミテッドに委託します。

<運用体制>

T・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドの運用体制は以下の通りです。



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（委託会社から運用の指図に係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。
- 二．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るときは、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。

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るときは、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

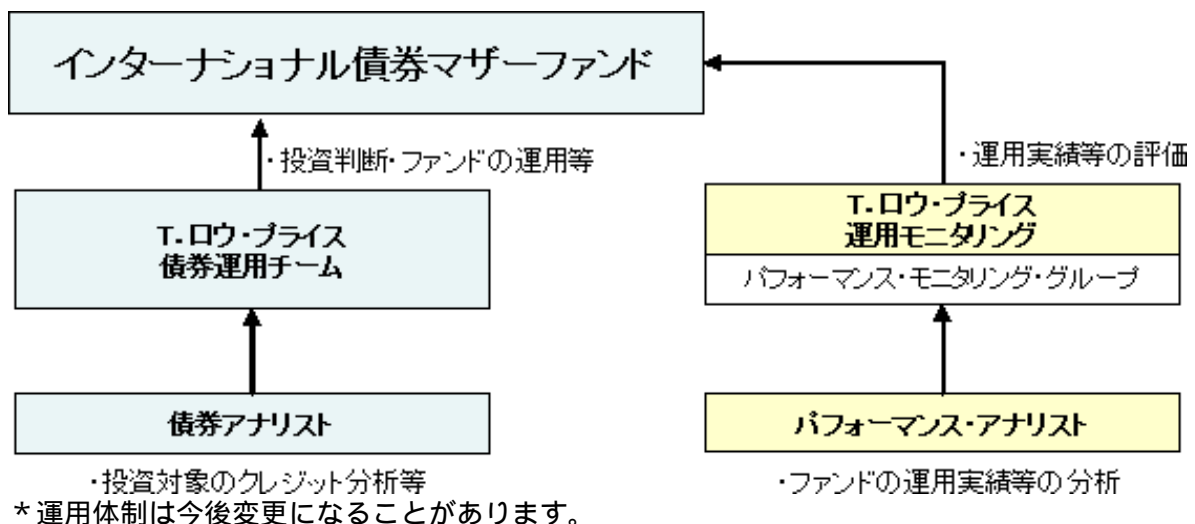
イ．シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円換算）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。

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・インターナショナル・リミテッドに委託します。

<運用体制>

T．ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドの運用体制は以下の通りです。



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せん。）
 - 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(委託会社から運用の指図に係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す。)
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るときは、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るときは、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せん。したがって、投資家の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

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。

投資信託は預貯金と異なります。

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。

<基準価額の変動要因>

基準価額を変動させる要因として主に以下のリスクがあります。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) 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。

(3) 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

デュレーションとは、「投資元本の平均的な回収期間」を表す指標で、単位は「年」で表示されます。また、「金利の変動に対する債券価格の変動性」の指標としても利用され、一般的にこの値が長い（大きい）ほど、金利の変動に対する債券価格の変動が大きくなります。

(4) 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。

(5)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。

(6)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。

(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。

<その他の留意点>

(1)収益分配金に関する留意事項

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

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

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

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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することがあります。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。

(5) クーリング・オフについて

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

(6) 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。

(7) その他

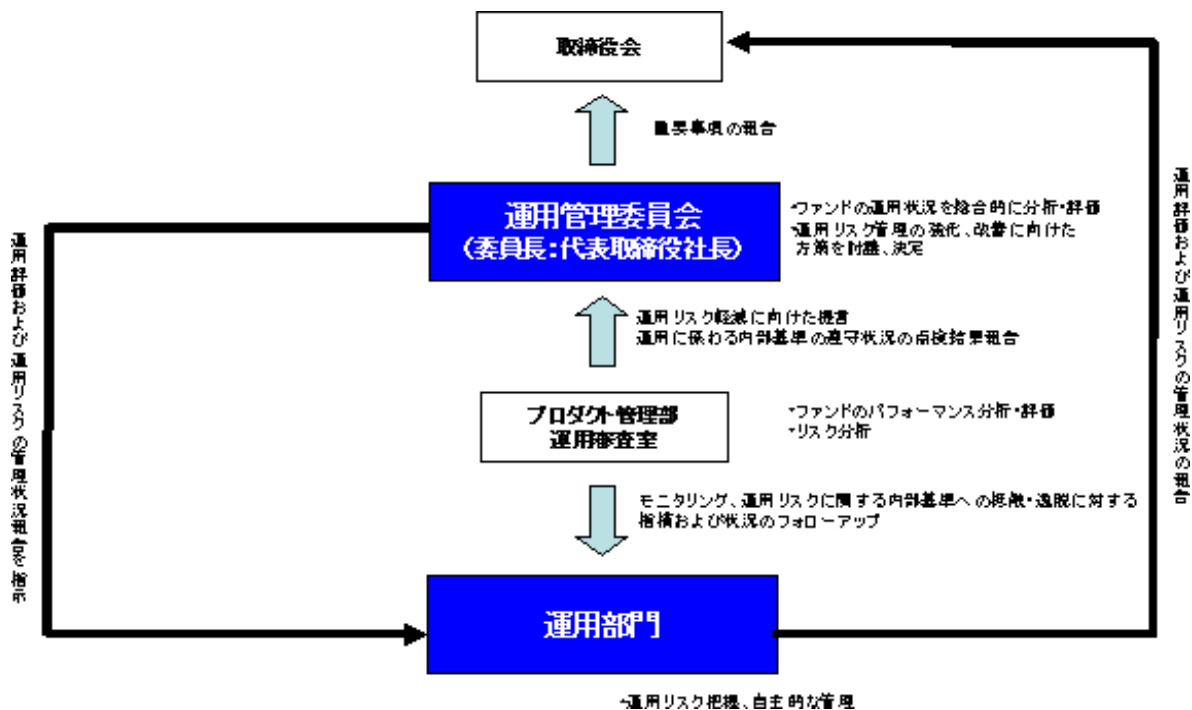
委託会社と投資顧問会社（T・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド）との合意等により、インターナショナル株式マザーファンドおよびインターナショナル債券マザーファンドの運用指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

< リスクの管理体制 >

委託会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 (24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 (18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 (4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。
プロダクト管理部 (12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。
運用審査室 (5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、運用部門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。
トレーディング部 (19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。



* リスクの管理体制は、今後変更になる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(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以下に掲げる率を乗じて得た金額とします。委託会社は販売会社に対して、販売会社の行う業務に対する代行手数料を支払います。委託会社、販売会社および受託会社の間での配分は以下の表のとおりです。

ファンド	委託会社	販売会社	受託会社	合計
年金設計30	年率0.42%（税抜）	年率0.40%（税抜）	年率0.08%（税抜）	年率0.945% ^{*1} （税抜0.90%）
年金設計50	年率0.52%（税抜）	年率0.50%（税抜）	年率0.08%（税抜）	年率1.155% ^{*2} （税抜1.10%）
年金設計70	年率0.62%（税抜）	年率0.60%（税抜）	年率0.08%（税抜）	年率1.365% ^{*3} （税抜1.30%）

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。

*1 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率0.972%となります。

*2 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率1.188%となります。

*3 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率1.404%となります。

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、委託会社が一旦信託財産から收受した後、各販売会社毎の取扱残高に応じて支払います。委託会社は、信託報酬を收受したときは、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、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・インターナショナル・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、

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。

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。

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、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。

* 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率0.00864%となります。

信託財産留保額はありませぬ。

(5)【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取扱われませぬ。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりませぬ。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されませぬ。

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。

個人の受益者に対する課税

・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、配当所得として20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%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、配当控除の適用がござりませぬ。）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20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%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、原則として確定申告不要となります。

所得税については、平成25年1月1日から平成49年12月31日までの間、基準所得税額に対して2.1%の税率で復興特別所得税が付加されませぬ。

< 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）との相殺が可能でせぬ。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せぬ。

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せぬ。

法人の受益者に対する課税

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、15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されませぬ。

所得税については、平成25年1月1日から平成49年12月31日までの間、基準所得税額に対して2.1%の税率で復興特別所得税が付加されませぬ。

< 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ござりませぬ。

（参考）

< 個別元本について >

- ・追加型証券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。
- ・受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照）。

< 収益分配金の課税について >

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区別があります。

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元本払戻金（特別分配金）、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

* 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25年12月末現在)

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	1,564,212,842	57.62%
親投資信託受益証券 （年金日本株式マザーファンド）	日本	717,284,642	26.42%
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）	日本	272,280,414	10.03%
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）	日本	164,704,316	6.07%
純資産総額		2,714,607,389	-

(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	2,027,481,029	39.09%
親投資信託受益証券 （年金日本株式マザーファンド）	日本	1,843,845,358	35.55%
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）	日本	800,795,155	15.44%

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	521,884,946	10.06%
純資産総額		5,186,801,691	-

（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	2,280,163,710	49.94%
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	1,025,594,715	22.46%
親投資信託受益証券 （年金日本債券マザーファンド）	日本	838,480,709	18.36%
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	429,545,895	9.41%
純資産総額		4,566,092,926	-

（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25年12月末現在）

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	85,696,806,300	98.35%
純資産総額		87,133,748,910	-

（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	8,166,263,500	56.77%
地方債証券	日本	109,215,600	0.76%
特殊債券	日本	99,985,400	0.70%
社債券	日本	5,907,347,700	41.06%
純資産総額		14,386,007,276	-

（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。

インター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	27,011,821,522	53.21%
	イギリス	3,926,686,321	7.73%
	スイス	2,187,676,562	4.31%
	スペイン	1,745,125,114	3.44%
	スウェーデン	1,682,905,919	3.31%
	フランス	1,399,273,846	2.76%
	台湾	1,202,836,800	2.37%
	ケイマン諸島	1,148,796,317	2.26%
	メキシコ	1,142,794,235	2.25%
	香港	1,069,204,937	2.11%
	アイルランド	976,148,375	1.92%
	シンガポール	938,947,332	1.85%
	アラブ首長国連邦	862,216,181	1.70%
	インド	782,455,419	1.54%
	韓国	676,821,400	1.33%
	ブラジル	596,034,686	1.17%
	マレーシア	516,561,920	1.02%
	ベルギー	505,214,415	1.00%
ルクセンブルグ	456,116,005	0.90%	

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
投資証券	フランス	395,691,044	0.78%
純資産総額		50,768,517,251	-

(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。

インター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	896,849,800	17.36%
	イギリス	580,504,636	11.23%
	イタリア	552,647,476	10.70%
	フランス	395,226,907	7.65%
	スペイン	251,035,692	4.86%
	ドイツ	236,352,914	4.57%
	ベルギー	181,664,334	3.52%
	カナダ	126,144,377	2.44%
	アイルランド	104,352,017	2.02%
	メキシコ	103,201,648	2.00%
	オランダ	85,887,709	1.66%
	オーストリア	69,693,309	1.35%
	タイ	61,454,651	1.19%
	ロシア	53,491,487	1.04%
	デンマーク	50,065,853	0.97%
	チェコ	46,206,946	0.89%
	ポーランド	44,270,795	0.86%
	韓国	39,679,345	0.77%
	アイスランド	39,085,589	0.76%

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
	スウェーデン	36,544,333	0.71%
	ルーマニア	36,542,825	0.71%
	スロヴェニア	35,570,955	0.69%
	南アフリカ	28,835,116	0.56%
	フィンランド	28,258,459	0.55%
	マレーシア	25,574,534	0.49%
	シンガポール	14,536,274	0.28%
地方債証券	オーストラリア	43,293,280	0.84%
特殊債券	ルクセンブルグ	35,960,969	0.70%
	ドイツ	21,168,370	0.41%
	メキシコ	5,306,386	0.10%

投資資産の種類	国・地域名	時価合計（円）	投資比率
社債券	アメリカ	459,907,549	8.90%
	イギリス	56,558,731	1.09%
	オランダ	53,136,778	1.03%
	インドネシア	30,715,915	0.59%
	ケイマン諸島	24,273,917	0.47%
	コロンビア	18,389,237	0.36%
	フランス	17,983,181	0.35%
	アイルランド	16,216,082	0.31%
	スペイン	15,219,081	0.29%
	ノルウェー	14,376,630	0.28%
	カナダ	10,756,503	0.21%
	ジャージー	8,069,856	0.16%
	ブラジル	7,896,159	0.15%
	イタリア	7,613,747	0.15%
	ベルギー	5,878,989	0.11%
	ドイツ	4,745,093	0.09%
	ルクセンブルグ	4,614,053	0.09%
	オーストリア	2,897,663	0.06%
	オーストラリア	1,643,562	0.03%

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
	メキシコ	958,195	0.02%
純資産総額		5,167,106,887	-

(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25年12月末現在)

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 -	1,396,868,050	1.1228 1,568,425,313	1.1198 1,564,212,842	- -	57.62%
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 -	447,827,085	1.5179 679,799,966	1.6017 717,284,642	- -	26.42%
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 -	119,232,972	2.1597 257,510,109	2.2836 272,280,414	- -	10.03%
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 -	70,740,161	2.0948 148,191,287	2.3283 164,704,316	- -	6.07%

(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 -	1,810,574,236	1.1230 2,033,301,850	1.1198 2,027,481,029	- -	39.09%
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 -	1,151,180,220	1.5179 1,747,405,169	1.6017 1,843,845,358	- -	35.55%
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 -	343,939,851	2.0949 720,548,727	2.3283 800,795,155	- -	15.44%
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 -	228,536,060	2.1620 494,116,992	2.2836 521,884,946	- -	10.06%

(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 -	1,423,589,755	1.5180 2,161,074,813	1.6017 2,280,163,710	- -	49.94%

	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
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 -	440,490,794	2.0949 922,814,414	2.3283 1,025,594,715	- -	22.46%
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 -	748,777,201	1.1228 840,734,920	1.1198 838,480,709	- -	18.36%
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 -	188,100,322	2.1597 406,249,466	2.2836 429,545,895	- -	9.41%

(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	779,300	4,489 3,498,684,150	6,420 5,003,106,000	- -	5.74%
2	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	18,391,500	195 3,597,760,539	228 4,193,262,000	- -	4.81%
3	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	5,140,900	497 2,556,632,749	694 3,567,784,600	- -	4.09%
4	三菱電機 日本	株式 電気機器	2,446,000	857 2,097,461,589	1,320 3,228,720,000	- -	3.71%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	544,400	4,320 2,352,348,335	5,660 3,081,304,000	- -	3.54%
6	ジェイ エフ イー ホール ディングス 日本	株式 鉄鋼	1,147,100	2,170 2,490,324,797	2,502 2,870,044,200	- -	3.29%
7	マツダ 日本	株式 輸送用機器	4,888,000	421 2,059,997,734	544 2,659,072,000	- -	3.05%
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,153,000	613 1,935,489,683	796 2,509,788,000	- -	2.88%
9	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	624,300	3,010 1,879,299,351	3,980 2,484,714,000	- -	2.85%
10	住友不動産 日本	株式 不動産業	445,000	3,014 1,341,480,304	5,230 2,327,350,000	- -	2.67%
11	KDDI 日本	株式 情報・通信業	333,200	3,493 1,164,054,412	6,470 2,155,804,000	- -	2.47%
12	野村ホールディングス 日本	株式 証券、商品先 物取引業	2,405,400	731 1,759,543,909	809 1,945,968,600	- -	2.23%
13	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	546,100	2,979 1,627,027,539	3,420 1,867,662,000	- -	2.14%
14	アイシン精機 日本	株式 輸送用機器	420,900	3,068 1,291,549,013	4,270 1,797,243,000	- -	2.06%
15	りそなホールディングス 日本	株式 銀行業	3,093,100	444 1,374,779,036	536 1,657,901,600	- -	1.90%
16	T & Dホールディングス 日本	株式 保険業	1,101,700	1,122 1,236,163,451	1,469 1,618,397,300	- -	1.86%
17	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	177,100	6,875 1,217,726,504	8,380 1,484,098,000	- -	1.70%
18	三井物産 日本	株式 卸売業	1,007,100	1,432 1,442,955,000	1,465 1,475,401,500	- -	1.69%
19	良品計画 日本	株式 小売業	112,300	5,969 670,336,639	11,370 1,276,851,000	- -	1.47%
20	タダノ 日本	株式 機械	892,000	859 767,077,086	1,410 1,257,720,000	- -	1.44%
21	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	949,100	1,265 1,201,488,675	1,299 1,232,880,900	- -	1.41%
22	セイコーエプソン 日本	株式 電気機器	406,000	1,678 681,634,379	2,825 1,146,950,000	- -	1.32%
23	オリックス 日本	株式 その他金融業	596,000	964 574,966,188	1,847 1,100,812,000	- -	1.26%
24	三菱地所 日本	株式 不動産業	332,000	2,256 749,022,153	3,145 1,044,140,000	- -	1.20%
25	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	209,200	4,807 1,005,763,285	4,825 1,009,390,000	- -	1.16%
26	IHI 日本	株式 機械	2,187,000	330 723,685,229	454 992,898,000	- -	1.14%
27	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	281,000	3,333 936,795,114	3,515 987,715,000	- -	1.13%
28	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	77,100	11,888 916,591,538	12,380 954,498,000	- -	1.10%
29	信越化学工業 日本	株式 化学	154,800	5,539 857,462,429	6,140 950,472,000	- -	1.09%

	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
30	ミネベア 日本	株式 電気機器	1,129,000	332 375,008,653	769 868,201,000	- -	1.00%

(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	317 10年国債 日本	国債証券 -	900,000,000	104.19 937,797,700	104.06 936,567,000	1.1000 2021/09/20	6.51%
2	129 20年国債 日本	国債証券 -	850,000,000	105.84 899,694,500	106.58 905,930,000	1.8000 2031/06/20	6.30%
3	145 20年国債 日本	国債証券 -	850,000,000	100.98 858,392,000	102.54 871,658,000	1.7000 2033/06/20	6.06%
4	312 10年国債 日本	国債証券 -	750,000,000	105.63 792,299,000	105.01 787,642,500	1.2000 2020/12/20	5.48%
5	329 10年国債 日本	国債証券 -	750,000,000	100.75 755,666,000	100.88 756,645,000	0.8000 2023/06/20	5.26%
6	93 20年国債 日本	国債証券 -	600,000,000	112.81 676,907,000	112.90 677,454,000	2.0000 2027/03/20	4.71%
7	314 10年国債 日本	国債証券 -	550,000,000	104.80 576,404,500	104.16 572,924,000	1.1000 2021/03/20	3.98%
8	122 20年国債 日本	国債証券 -	500,000,000	104.82 524,132,500	107.45 537,250,000	1.8000 2030/09/20	3.73%
9	136 20年国債 日本	国債証券 -	500,000,000	98.78 493,910,000	102.45 512,270,000	1.6000 2032/03/20	3.56%
10	316 10年国債 日本	国債証券 -	450,000,000	102.63 461,871,000	104.12 468,549,000	1.1000 2021/06/20	3.26%
11	106 5年国債 日本	国債証券 -	400,000,000	100.17 400,689,500	100.12 400,512,000	0.2000 2017/09/20	2.78%
12	13 30年国債 日本	国債証券 -	300,000,000	103.58 310,744,800	107.10 321,306,000	2.0000 2033/12/20	2.23%
13	120 20年国債 日本	国債証券 -	300,000,000	101.08 303,248,000	104.77 314,325,000	1.6000 2030/06/20	2.18%
14	5 東日本旅客鉄道 日本	社債券 -	200,000,000	110.73 221,468,000	109.70 219,406,200	3.3000 2017/02/25	1.53%
15	2-1 財政マスター特定 日本	社債券 -	200,000,000	107.21 214,437,200	105.87 211,741,400	1.9800 2018/06/20	1.47%
16	4 ほくほくファイナンFR 日本	社債券 -	200,000,000	102.57 205,158,000	103.21 206,438,000	1.5000 2021/12/28	1.43%
17	32 川崎重工業 日本	社債券 -	200,000,000	102.42 204,842,000	102.60 205,205,000	1.0620 2017/06/21	1.43%
18	5 ドン・キホーテ 日本	社債券 -	200,000,000	102.16 204,320,200	102.50 205,019,000	1.5700 2016/03/11	1.43%
19	2 東日本BK劣後FR 日本	社債券 -	200,000,000	101.42 202,848,000	101.91 203,826,000	2.1100 2021/12/13	1.42%
20	150 オリックス 日本	社債券 -	200,000,000	102.26 204,520,000	101.76 203,530,800	1.0300 2016/06/15	1.41%
21	77 三菱商事 日本	社債券 -	200,000,000	100.82 201,654,000	100.93 201,873,400	0.5600 2016/12/26	1.40%
22	486 関西電力 日本	社債券 -	200,000,000	99.38 198,761,000	100.82 201,649,200	0.8210 2017/07/25	1.40%
23	103 三菱地所 日本	社債券 -	200,000,000	100.40 200,804,000	100.73 201,461,200	0.4590 2016/12/22	1.40%
24	417 九州電力 日本	社債券 -	200,000,000	99.41 198,834,000	100.64 201,297,200	0.6410 2017/08/25	1.40%
25	3 森精機製作所 日本	社債券 -	200,000,000	100.00 200,000,000	100.35 200,706,600	0.5150 2017/06/13	1.40%
26	2あいおいニッセ劣FR 日本	社債券 -	200,000,000	100.59 201,184,000	100.33 200,670,000	1.2700 2022/09/27	1.39%
27	12 トヨタ自動車 日本	社債券 -	200,000,000	100.28 200,564,000	100.25 200,509,000	0.3170 2017/09/20	1.39%
28	2 兵庫県公債30年	地方債証券	100,000,000	114.83	109.21	2.3600	0.76%

	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	-		114,839,000	109,215,600	2040/03/19	
29	2 サンケイビル 日本	社債券 -	100,000,000	106.59 106,597,000	106.02 106,028,100	2.0300 2017/09/26	0.74%
30	36 住友化学 日本	社債券 -	100,000,000	105.34 105,344,000	105.10 105,105,800	1.9500 2017/02/27	0.73%

(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	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	28,770	46,450 1,336,381,243	59,027 1,698,232,254	- -	3.35%
2	PROCTER AND GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品・ パーソナル用 品	155,600	8,290 1,289,987,394	8,643 1,344,856,074	- -	2.65%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR MFE 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	3,270,000	372 1,217,687,433	367 1,202,836,800	- -	2.37%
4	VISA INC-CLASS A SHRS アメリカ	株式 ソフトウェ ア・サービス	51,800	19,661 1,018,487,875	23,151 1,199,222,903	- -	2.36%
5	AGILENT TECH アメリカ	株式 医薬品・バイ オテクノロジー ジー・ライフ サイエンス	192,700	5,161 994,696,011	6,025 1,161,045,692	- -	2.29%
6	PRECISION CASTPARTS CORP アメリカ	株式 資本財	38,200	24,640 941,250,814	28,320 1,081,839,310	- -	2.13%
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	461,200	2,062 951,137,607	2,341 1,080,022,386	- -	2.13%
8	STATE STREET CORPORATION アメリカ	株式 各種金融	140,100	7,132 999,285,685	7,689 1,077,264,541	- -	2.12%
9	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 各種金融	651,500	1,439 937,542,999	1,651 1,075,927,036	- -	2.12%
10	AIA GROUP LTD 香港	株式 保険	2,054,200	459 944,065,502	520 1,069,204,937	- -	2.11%
11	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI アイルランド	株式 素材	832,210	904 752,710,520	1,172 976,148,375	- -	1.92%
12	GOOGLE INC-CL A アメリカ	株式 ソフトウェ ア・サービス	8,150	97,063 791,068,539	117,868 960,625,634	- -	1.89%
13	AUTODESK INC アメリカ	株式 ソフトウェ ア・サービス	181,200	3,729 675,875,470	5,221 946,048,932	- -	1.86%
14	LIBERTY GLOBAL PLC-A イギリス	株式 メディア	101,400	8,162 827,679,815	9,311 944,156,339	- -	1.86%
15	AVAGO TECHNOLOGIES LTD シンガポール	株式 半導体・半導 体製造装置	168,800	4,604 777,273,153	5,562 938,947,332	- -	1.85%
16	NESTLE SA (REGD) スイス	株式 食品・飲料・ タバコ	118,343	7,399 875,725,644	7,724 914,125,118	- -	1.80%
17	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 小売	21,700	31,034 673,454,630	41,953 910,394,231	- -	1.79%
18	BOEING CO/THE アメリカ	株式 資本財	62,700	11,101 696,040,891	14,427 904,628,765	- -	1.78%
19	GILEAD SCIENCES INC アメリカ	株式 医薬品・バイ オテクノロジー ジー・ライフ サイエンス	114,500	5,701 652,871,277	7,846 898,399,689	- -	1.77%
20	BARCLAYS PLC イギリス	株式 銀行	1,720,766	470 808,807,316	468 806,403,809	- -	1.59%
21	ECOLAB INC アメリカ	株式 素材	72,400	9,392 680,036,996	11,010 797,130,754	- -	1.57%
22	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV メキシコ	株式 銀行	1,091,400	633 691,041,558	724 790,631,442	- -	1.56%
23	MARTIN MARIETTA MATERIALS アメリカ	株式 素材	74,900	10,246 767,480,497	10,439 781,951,011	- -	1.54%

	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
24	AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS スペイン	株式 ソフトウェア・サービス	173,937	3,590 624,459,276	4,484 779,971,903	- -	1.54%
25	LINKEDIN CORP - A アメリカ	株式 ソフトウェア・サービス	32,000	21,373 683,952,746	22,801 729,636,048	- -	1.44%
26	CREDIT SUISSE GROUP-REG スイス	株式 各種金融	222,737	3,172 706,646,368	3,250 724,006,618	- -	1.43%
27	LEGRAND SA フランス	株式 資本財	123,583	5,657 699,173,405	5,824 719,807,050	- -	1.42%
28	BURBERRY GROUP PLC イギリス	株式 耐久消費財・アパレル	273,975	2,566 703,158,724	2,599 712,184,204	- -	1.40%
29	HEXAGON AB-B SHS スウェーデン	株式 テクノロジー・ハードウェアおよび機器	212,085	3,029 642,544,867	3,273 694,285,273	- -	1.37%
30	ILIAD SA フランス	株式 電気通信サービス	31,012	24,709 766,302,824	21,909 679,466,795	- -	1.34%

(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 N/B アメリカ	国債証券 -	3,625,000	11,263.87 408,315,375	11,054.77 400,735,726	2.6250 2016/04/30	7.76%
2	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	1,329,000	16,655.89 221,356,893	16,582.26 220,378,249	4.2500 2018/10/25	4.27%
3	UK GILT イギリス	国債証券 -	1,242,000	17,087.29 212,224,203	16,882.52 209,680,918	1.2500 2018/07/22	4.06%
4	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券 -	1,802,000	11,325.28 204,081,675	11,178.71 201,440,485	2.8750 2018/03/31	3.90%
5	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	671,000	15,093.90 101,280,089	15,050.38 100,988,103	4.4000 2015/01/31	1.95%
6	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券 -	905,000	11,175.66 101,139,736	11,046.13 99,967,536	2.7500 2019/02/15	1.93%
7	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	650,000	15,190.49 98,738,230	15,222.27 98,944,769	4.5000 2015/07/15	1.91%
8	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券 -	717,000	12,125.00 86,936,271	11,896.63 85,298,865	4.6250 2040/02/15	1.65%
9	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	531,000	15,325.98 81,380,969	15,614.63 82,913,698	4.5000 2018/02/01	1.60%
10	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND ドイツ	国債証券 -	562,000	14,306.94 80,405,015	14,064.04 79,039,949	1.5000 2023/02/15	1.53%
11	FRANCE OAT. フランス	国債証券 -	481,000	16,678.72 80,224,673	16,387.74 78,825,072	3.7500 2021/04/25	1.53%
12	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	464,000	16,215.13 75,238,247	16,769.23 77,809,229	6.0000 2031/05/01	1.51%
13	UK GILT イギリス	国債証券 -	384,000	20,124.88 77,279,551	19,030.19 73,075,949	4.2500 2039/09/07	1.41%
14	UK GILT イギリス	国債証券 -	353,000	20,656.58 72,917,758	19,424.63 68,568,945	4.5000 2019/03/07	1.33%
15	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	415,000	15,564.68 64,593,449	16,189.03 67,184,476	5.5000 2022/09/01	1.30%
16	UK GILT イギリス	国債証券 -	331,000	20,943.81 69,324,038	19,918.10 65,928,940	4.5000 2042/12/07	1.28%
17	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	402,000	15,788.83 63,471,126	15,655.24 62,934,090	4.8500 2020/10/31	1.22%
18	THAILAND GOVERNMENT BOND タイ	国債証券 -	18,764,000	321.60 60,346,013	327.51 61,454,651	3.8750 2019/06/13	1.19%
19	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	国債証券	439,000	14,435.21	13,770.32	2.5000	1.17%

	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
	ドイツ	-		63,370,600	60,451,712	2044/07/04	
20	MEX BONOS DESARR FIX RT メキシコ	国債証券 -	6,709,000	920.04 61,725,712	888.37 59,601,001	8.5000 2038/11/18	1.15%
21	UK GILT イギリス	国債証券 -	312,000	19,228.28 59,992,238	18,672.24 58,257,418	3.7500 2021/09/07	1.13%
22	NETHERLANDS GOVERNMENT オランダ	国債証券 -	283,000	19,393.18 54,882,713	19,358.37 54,784,195	5.5000 2028/01/15	1.06%
23	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	367,000	14,336.74 52,615,843	14,783.49 54,255,430	3.7500 2021/03/01	1.05%
24	US TREASURY N/B アメリカ	国債証券 -	502,000	10,942.85 54,933,129	10,776.44 54,097,747	2.2500 2015/01/31	1.05%
25	UK GILT イギリス	国債証券 -	287,000	19,341.22 55,509,317	18,574.94 53,310,089	4.7500 2015/09/07	1.03%
26	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	357,000	14,333.84 51,171,812	14,824.11 52,922,072	5.0000 2040/09/01	1.02%
27	KINGDOM OF DENMARK デンマーク	国債証券 -	2,340,000	2,195.74 51,380,503	2,139.56 50,065,853	3.0000 2021/11/15	0.97%
28	BUONI POLIENNALI DEL TES イタリア	国債証券 -	303,000	15,228.79 46,143,262	15,663.94 47,461,766	4.5000 2018/08/01	0.92%
29	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO スペイン	国債証券 -	303,000	14,969.16 45,356,554	15,394.15 46,644,294	4.2500 2016/10/31	0.90%
30	CZECH REPUBLIC チェコ	国債証券 -	285,000	16,266.63 46,359,901	16,212.96 46,206,946	3.8750 2022/05/24	0.89%

(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	100.14%
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70

種類別	投資比率
親投資信託受益証券	100.17%
合計	100.17%

(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	98.35%
合計	98.35%

(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	56.77%
社債券	41.06%
地方債証券	0.76%
特殊債券	0.70%
合計	99.28%

（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	96.18%
投資証券	0.78%
合計	96.96%

（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	79.81%
社債券	14.74%
特殊債券	1.21%
地方債証券	0.84%
合計	96.60%

（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	11.63%
銀行業	11.42%
輸送用機器	10.86%
情報・通信業	9.56%
機械	5.78%
小売業	4.81%
鉄鋼	4.14%
不動産業	3.87%
卸売業	3.81%
化学	3.65%
医薬品	3.46%
証券、商品先物取引業	3.04%
保険業	2.99%
ゴム製品	2.85%
陸運業	2.80%
食料品	2.55%
建設業	1.89%
その他金融業	1.84%
サービス業	1.41%
金属製品	0.98%
海運業	0.95%
鉱業	0.92%
繊維製品	0.80%
その他製品	0.74%
精密機器	0.61%
電気・ガス業	0.51%
ガラス・土石製品	0.48%
小計	98.35%
合計	98.35%

（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)	
ソフトウェア・サービス	12.45%
資本財	9.87%
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.44%
小売	7.07%
各種金融	6.93%
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.84%
素材	6.12%
銀行	5.79%
エネルギー	5.69%
半導体・半導体製造装置	4.99%
運輸	3.99%
耐久消費財・アパレル	3.07%
家庭用品・パーソナル用品	2.65%
メディア	2.57%
保険	2.11%
電気通信サービス	2.08%
公益事業	1.82%
食品・飲料・タバコ	1.80%
不動産	1.13%
ヘルスケア機器・サービス	0.79%
小計	96.18%
合計	96.18%

(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25年12月末現在)

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25年12月末現在）

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

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

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	アメリカ	US 10YR NOTE FUT MAR14	売建	7	92,432,316	90,729,266	1.76%
債券先物取引	ドイツ	EURO-BOBL FUTURE MAR14	売建	3	54,741,064	54,058,684	1.05%

(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）
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	-
第8計算期間末 （平成21年11月19日）	1,575	-	1.0609	-
第9計算期間末 （平成22年11月19日）	1,840	-	1.1002	-
第10計算期間末 （平成23年11月21日）	1,935	-	1.0573	-
第11計算期間末 （平成24年11月19日）	2,130	-	1.1122	-
平成25年1月末日	2,325	-	1.2055	-
平成25年2月末日	2,350	-	1.2212	-
平成25年3月末日	2,423	-	1.2555	-
平成25年4月末日	2,521	-	1.3067	-
平成25年5月末日	2,493	-	1.2950	-
平成25年6月末日	2,463	-	1.2875	-
平成25年7月末日	2,500	-	1.2963	-
平成25年8月末日	2,491	-	1.2898	-
平成25年9月末日	2,573	-	1.3229	-
平成25年10月末日	2,620	-	1.3328	-
第12計算期間末 （平成25年11月19日）	2,655	-	1.3476	-
平成25年11月末日	2,692	-	1.3609	-
平成25年12月末日	2,714	-	1.3791	-

(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D C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）
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	-
第8計算期間末 （平成21年11月19日）	2,647	-	1.1149	-
第9計算期間末 （平成22年11月19日）	3,177	-	1.1578	-
第10計算期間末 （平成23年11月21日）	3,254	-	1.0664	-
第11計算期間末 （平成24年11月19日）	3,719	-	1.1378	-
平成25年1月末日	4,267	-	1.2861	-
平成25年2月末日	4,308	-	1.3079	-
平成25年3月末日	4,505	-	1.3578	-
平成25年4月末日	4,747	-	1.4365	-
平成25年5月末日	4,692	-	1.4302	-
平成25年6月末日	4,598	-	1.4139	-
平成25年7月末日	4,659	-	1.4323	-
平成25年8月末日	4,604	-	1.4179	-
平成25年9月末日	4,794	-	1.4757	-
平成25年10月末日	4,890	-	1.4896	-
第12計算期間末 （平成25年11月19日）	4,971	-	1.5159	-
平成25年11月末日	5,067	-	1.5406	-
平成25年12月末日	5,186	-	1.5758	-

（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D C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）
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	-
第8計算期間末 （平成21年11月19日）	2,058	-	1.1968	-
第9計算期間末 （平成22年11月19日）	2,498	-	1.2472	-
第10計算期間末 （平成23年11月21日）	2,487	-	1.1053	-
第11計算期間末 （平成24年11月19日）	2,896	-	1.1983	-
平成25年1月末日	3,463	-	1.4082	-
平成25年2月末日	3,509	-	1.4368	-
平成25年3月末日	3,721	-	1.5040	-
平成25年4月末日	4,014	-	1.6295	-
平成25年5月末日	4,038	-	1.6321	-
平成25年6月末日	3,939	-	1.6097	-
平成25年7月末日	4,026	-	1.6356	-
平成25年8月末日	3,985	-	1.6122	-
平成25年9月末日	4,188	-	1.6957	-
平成25年10月末日	4,246	-	1.7123	-

	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12計算期間末 （平成25年11月19日）	4,337	-	1.7515	-
平成25年11月末日	4,424	-	1.7861	-
平成25年12月末日	4,566	-	1.8476	-

（注）純資産総額は百万円未満切捨てで表記しております。

【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%
第9期（平成21年11月20日～平成22年11月19日）	3.7%
第10期（平成22年11月20日～平成23年11月21日）	3.9%
第11期（平成23年11月22日～平成24年11月19日）	5.2%
第12期（平成24年11月20日～平成25年11月19日）	21.2%

（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%
第9期（平成21年11月20日～平成22年11月19日）	3.8%
第10期（平成22年11月20日～平成23年11月21日）	7.9%
第11期（平成23年11月22日～平成24年11月19日）	6.7%
第12期（平成24年11月20日～平成25年11月19日）	33.2%

（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%
第9期（平成21年11月20日～平成22年11月19日）	4.2%
第10期（平成22年11月20日～平成23年11月21日）	11.4%
第11期（平成23年11月22日～平成24年11月19日）	8.4%
第12期（平成24年11月20日～平成25年11月19日）	46.2%

（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

(4)【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
第9期（平成21年11月20日～平成22年11月19日）	283,532,231	95,707,363
第10期（平成22年11月20日～平成23年11月21日）	272,662,884	115,014,006
第11期（平成23年11月22日～平成24年11月19日）	233,706,227	148,426,124
第12期（平成24年11月20日～平成25年11月19日）	317,138,297	262,519,434

（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

期間	設定総額（円）	解約総額（円）
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
第9期（平成21年11月20日～平成22年11月19日）	482,305,601	113,363,616
第10期（平成22年11月20日～平成23年11月21日）	456,134,340	148,148,120
第11期（平成23年11月22日～平成24年11月19日）	405,650,395	188,431,268
第12期（平成24年11月20日～平成25年11月19日）	381,945,305	371,607,208

（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
第9期（平成21年11月20日～平成22年11月19日）	424,391,294	140,716,214
第10期（平成22年11月20日～平成23年11月21日）	389,926,363	142,778,157
第11期（平成23年11月22日～平成24年11月19日）	349,296,357	182,307,355
第12期（平成24年11月20日～平成25年11月19日）	419,578,520	360,743,160

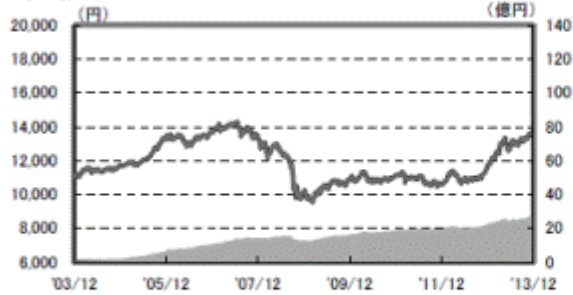
（注）本邦外における設定及び解約の実績はありません。

（参考情報）

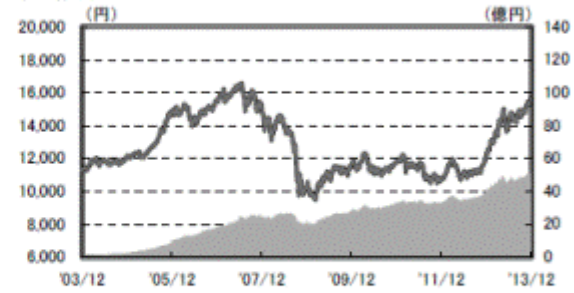
2013年12月30日現在

《基準価額・純資産の推移》（2003年12月30日～2013年12月30日）

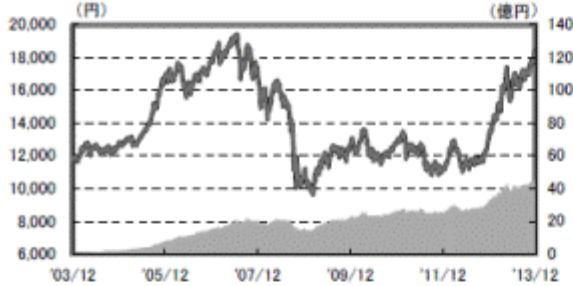
年金設計30



年金設計50



年金設計70



■ 純資産総額: 右目盛
 —— 基準価額(信託報酬控除後): 左目盛
 ——— 基準価額(信託報酬控除後、税引前分配金再投資換算): 左目盛

* 基準価額（信託報酬控除後、税引前分配金再投資換算）は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。

《分配の推移》

	年金設計30	年金設計50	年金設計70
2013年11月	0円	0円	0円
2012年11月	0円	0円	0円
2011年11月	0円	0円	0円
2010年11月	0円	0円	0円
2009年11月	0円	0円	0円
設定来累計	0円	0円	0円

* 分配金は1万円当たり、税引前

《主要な資産の状況》

投資銘柄	年金設計30	年金設計50	年金設計70
	投資比率	投資比率	投資比率
年金日本株式マザーファンド	26.4%	35.5%	49.9%
年金日本債券マザーファンド	57.6%	39.1%	18.4%
インターナショナル株式マザーファンド	6.1%	15.4%	22.5%
インターナショナル債券マザーファンド	10.0%	10.1%	9.4%

■参考情報（上位10銘柄）

年金日本株式マザーファンド

投資銘柄	業種 ^{※1}	投資比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	5.7%
2 みずほフィナンシャルグループ	銀行業	4.8%
3 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4.1%
4 三菱電機	電気機器	3.7%
5 日本電信電話	情報・通信業	3.5%
6 ジェイ・エフ・イーホールディングス	鉄鋼	3.3%
7 マツダ	輸送用機器	3.1%
8 日立製作所	電気機器	2.9%
9 プリヂェストン	ゴム製品	2.9%
10 住友不動産	不動産業	2.7%

年金日本債券マザーファンド

投資銘柄	種別	投資比率
1 317 10年国債	国債証券	6.5%
2 129 20年国債	国債証券	6.3%
3 145 20年国債	国債証券	6.1%
4 312 10年国債	国債証券	5.5%
5 329 10年国債	国債証券	5.3%
6 93 20年国債	国債証券	4.7%
7 314 10年国債	国債証券	4.0%
8 122 20年国債	国債証券	3.7%
9 136 20年国債	国債証券	3.6%
10 316 10年国債	国債証券	3.3%

インターナショナル株式マザーファンド

投資銘柄	業種 ^{※2}	投資比率
1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェア製品	3.3%
2 PROCTER AND GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	2.6%
3 TAIWAN SEMICONDUCTOR MFE	半導体・半導体製造装置	2.4%
4 VISA INC-CLASS A SHRS	ソフトウェア・サービス	2.4%
5 AGILENT TECH	***テクノロジー・ハードウェア製品	2.3%
6 PRECISION CASTPARTS CORP	資本財	2.1%
7 JUNIPER NETWORKS INC	テクノロジー・ハードウェア製品	2.1%
8 STATE STREET CORPORATION	各種金融	2.1%
9 BANK OF AMERICA CORP	各種金融	2.1%
10 AIA GROUP LTD	保険	2.1%

インターナショナル債券マザーファンド

投資銘柄	種別	投資比率
1 US TREASURY N/B 2.625 04/30/16	国債証券	7.8%
2 FRANCE OAT. 4.25 10/25/18	国債証券	4.3%
3 UK GILT 1.25 07/22/18	国債証券	4.1%
4 US TREASURY N/B 2.875 03/31/18	国債証券	3.9%
5 BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 4.4 01/31/15	国債証券	2.0%
6 US TREASURY N/B 2.75 02/15/19	国債証券	1.9%
7 BUNDESPOLIZAMT DEL TES 4.5 07/15/15	国債証券	1.9%
8 US TREASURY N/B 4.625 02/15/40	国債証券	1.7%
9 BUNDESPOLIZAMT DEL TES 4.5 02/01/18	国債証券	1.6%
10 BUNDESPOLIZAMT DEL TES 1.5 02/15/23	国債証券	1.5%

*投資比率は全て純資産総額対比

※1業種は東証33業種分類

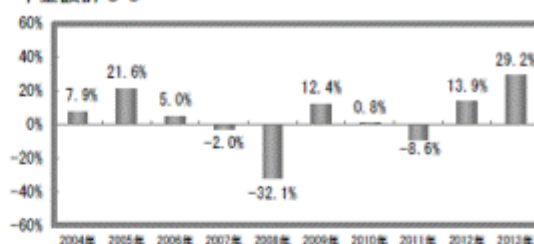
※2業種は世界産業分類基準（GICS）

《年間収益率の推移》

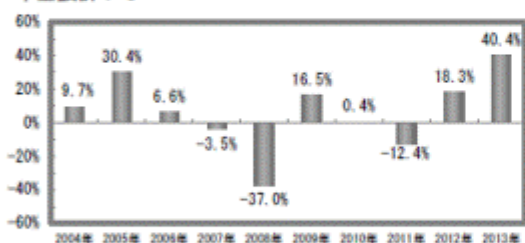
年金設計30



年金設計50



年金設計70



*ファンドの収益率は暦年ベースで表示しております。

*ファンドの年間収益率は、税引前の分配金を再投資したものとして計算しております。

*ファンドには、ベンチマークはありません。

- ・ファンドの運用実績はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

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（当初1口＝1円）とします。申込手数料はありません。また、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) お申込みの方法には、収益の分配がなされた場合に分配金を受取ることができる「分配金受取型」と、分配金を自動的に無手数料で再投資する「分配金自動再投資型」があり、販売会社によってはどちらか一方のみの取扱いの場合があります。
- (5) 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。詳細については、販売会社にお問い合わせください。

* 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。

- (6) 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。

3【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。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（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 の取引所の最終相場で評価します。 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（売気配相場を除く。） ・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．前二．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．前二．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、前二．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ます。）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、

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。受託会社は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。

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。

ロ．運用委託契約

委託会社とT・ロウ・プライス・インターナショナル・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。

4【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ます。)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。

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。

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、償還金を持分に応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、

償還金の支払いは、原則として償還日から起算して5営業日までに開始します。

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3【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12期計算期間（平成24年11月20日から平成25年11月19日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人によ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11期 平成24年11月19日現在	第12期 平成25年11月19日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	2,140,988,438	2,667,567,324
未収入金	-	553,648
流動資産合計	2,140,988,438	2,668,120,972
資産合計	2,140,988,438	2,668,120,972
負債の部		
流動負債		
未払解約金	395,043	553,648
未払受託者報酬	858,537	1,072,825
未払委託者報酬	8,800,441	10,996,876
その他未払費用	170,864	205,011
流動負債合計	10,224,885	12,828,360
負債合計	10,224,885	12,828,360
純資産の部		
元本等		
元本	1,915,757,135	1,970,375,998
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	215,006,418	684,916,614
（分配準備積立金）	35,433,602	297,792,640
元本等合計	2,130,763,553	2,655,292,612
純資産合計	2,130,763,553	2,655,292,612
負債純資産合計	2,140,988,438	2,668,120,972

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	平成23年11月22日 至 平成24年11月19日	自	平成24年11月20日 至 平成25年11月19日
営業収益				
有価証券売買等損益		122,016,525		478,010,098
営業収益合計		122,016,525		478,010,098
営業費用				
受託者報酬		1,710,385		2,051,825
委託者報酬		17,532,218		21,032,072
その他費用		170,864		205,011
営業費用合計		19,413,467		23,288,908
営業利益又は営業損失（ ）		102,603,058		454,721,190
経常利益又は経常損失（ ）		102,603,058		454,721,190
当期純利益又は当期純損失（ ）		102,603,058		454,721,190
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（ ）		5,297,633		37,964,394
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		104,857,597		215,006,418
剰余金増加額又は欠損金減少額		21,642,162		84,750,188
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		21,642,162		84,750,188
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,798,766		31,596,788
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,798,766		31,596,788
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		215,006,418		684,916,614

(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12期	
	自 平成24年11月20日	至 平成25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。	
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。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第11期	第12期
	平成24年11月19日現在	平成25年11月19日現在
1. 元本状況		
期首元本額	1,830,477,032円	1,915,757,135円
期中追加設定元本額	233,706,227円	317,138,297円
期中一部解約元本額	148,426,124円	262,519,434円
2. 受益権の総数	1,915,757,135口	1,970,375,998口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期	第12期
	自 平成23年11月22日 至 平成24年11月19日	自 平成24年11月20日 至 平成25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	1,330,564円	1,556,359円
2. 分配金の計算過程 該当事項はありません。		

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第12期	
	自 平成24年11月20日	至 平成25年11月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資し、また、デリバティブ取引を行っております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会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。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、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・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、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、運用部門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っております。	
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。	

金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期
	平成25年11月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第11期（平成24年11月19日現在）

種類	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	116,104,996
合計	116,104,996

第12期（平成25年11月19日現在）

種類	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	379,324,417
合計	379,324,417

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第11期（平成24年11月19日現在）

該当事項はありません。

第12期（平成25年11月19日現在）

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12期（自平成24年11月20日 至 平成25年11月19日）

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第11期 平成24年11月19日現在	第12期 平成25年11月19日現在
1口当たり純資産額 1.1122円 「1口 = 1円(10,000口 = 11,122円)」	1口当たり純資産額 1.3476円 「1口 = 1円(10,000口 = 13,476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	450,169,620	683,222,432	
	親投資信託 受益証券	年金日本債券マザーファンド	1,404,319,187	1,576,769,583	
	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	71,074,187	148,786,703	
	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	119,881,691	258,788,606	
合計 4銘柄			2,045,444,685	2,667,567,324	

【大和住銀DC年金設計ファンド50】
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 平成24年11月19日現在	第12期 平成25年11月19日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	3,741,246,737	4,999,720,616
未収入金	1,978,181	537,180
流動資産合計	3,743,224,918	5,000,257,796
資産合計	3,743,224,918	5,000,257,796
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,807,274	830,026
未払受託者報酬	1,483,497	2,006,254
未払委託者報酬	18,915,192	25,580,160
その他未払費用	293,936	379,969
流動負債合計	23,499,899	28,796,409
負債合計	23,499,899	28,796,409
純資産の部		
元本等		
元本	3,269,287,378	3,279,625,475
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	450,437,641	1,691,835,912
（分配準備積立金）	88,434,665	772,625,270
元本等合計	3,719,725,019	4,971,461,387
純資産合計	3,719,725,019	4,971,461,387
負債純資産合計	3,743,224,918	5,000,257,796

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	平成23年11月22日 至 平成24年11月19日	自	平成24年11月20日 至 平成25年11月19日
営業収益				
有価証券売買等損益		263,403,134		1,299,937,493
営業収益合計		263,403,134		1,299,937,493
営業費用				
受託者報酬		2,941,219		3,801,529
委託者報酬		37,501,525		48,470,475
その他費用		293,936		379,969
営業費用合計		40,736,680		52,651,973
営業利益又は営業損失（ ）		222,666,454		1,247,285,520
経常利益又は経常損失（ ）		222,666,454		1,247,285,520
当期純利益又は当期純損失（ ）		222,666,454		1,247,285,520
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（ ）		9,276,576		94,908,799
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		202,676,285		450,437,641
剰余金増加額又は欠損金減少額		47,404,156		144,077,733
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		47,404,156		144,077,733
剰余金減少額又は欠損金増加額		13,032,678		55,056,183
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		13,032,678		55,056,183
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		450,437,641		1,691,835,912

(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12期	
	自 平成24年11月20日	至 平成25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。	
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。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第11期	第12期
	平成24年11月19日現在	平成25年11月19日現在
1. 元本状況		
期首元本額	3,052,068,251円	3,269,287,378円
期中追加設定元本額	405,650,395円	381,945,305円
期中一部解約元本額	188,431,268円	371,607,208円
2. 受益権の総数	3,269,287,378口	3,279,625,475口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期	第12期
	自 平成23年11月22日 至 平成24年11月19日	自 平成24年11月20日 至 平成25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	3,981,469円	5,286,990円
2. 分配金の計算過程 該当事項はありません。		

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第12期	
	自 平成24年11月20日	至 平成25年11月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資し、また、デリバティブ取引を行っております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会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。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、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・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、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、運用部門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っております。	
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。	

金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期
	平成25年11月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第11期（平成24年11月19日現在）

種類	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	252,431,860
合計	252,431,860

第12期（平成25年11月19日現在）

種類	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	1,143,545,125
合計	1,143,545,125

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第11期（平成24年11月19日現在）

該当事項はありません。

第12期（平成25年11月19日現在）

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12期（自平成24年11月20日 至 平成25年11月19日）

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第11期 平成24年11月19日現在	第12期 平成25年11月19日現在
1口当たり純資産額 1.1378円 「1口 = 1円(10,000口 = 11,378円)」	1口当たり純資産額 1.5159円 「1口 = 1円(10,000口 = 15,159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	1,270,897,255	1,928,840,763	
	親投資信託 受益証券	年金日本債券マザーファンド	1,583,404,591	1,777,846,674	
	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	392,483,742	821,625,465	
	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	218,375,742	471,407,714	
合計 4銘柄			3,465,161,330	4,999,720,616	

【大和住銀DC年金設計ファンド70】
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 平成24年11月19日現在	第12期 平成25年11月19日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	2,916,648,929	4,368,631,721
未収入金	323,395	4,575,440
流動資産合計	2,916,972,324	4,373,207,161
資産合計	2,916,972,324	4,373,207,161
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,208,506	7,626,385
未払受託者報酬	1,149,223	1,737,521
未払委託者報酬	17,526,329	26,497,815
その他未払費用	228,549	320,461
流動負債合計	20,112,607	36,182,182
負債合計	20,112,607	36,182,182
純資産の部		
元本等		
元本	2,417,391,801	2,476,227,161
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	479,467,916	1,860,797,818
（分配準備積立金）	71,446,552	883,545,367
元本等合計	2,896,859,717	4,337,024,979
純資産合計	2,896,859,717	4,337,024,979
負債純資産合計	2,916,972,324	4,373,207,161

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	平成23年11月22日 至 平成24年11月19日	自	平成24年11月20日 至 平成25年11月19日
営業収益				
有価証券売買等損益		249,085,541		1,411,212,906
営業収益合計		249,085,541		1,411,212,906
営業費用				
受託者報酬		2,287,266		3,206,304
委託者報酬		34,882,020		48,897,445
その他費用		228,549		320,461
営業費用合計		37,397,835		52,424,210
営業利益又は営業損失（ ）		211,687,706		1,358,788,696
経常利益又は経常損失（ ）		211,687,706		1,358,788,696
当期純利益又は当期純損失（ ）		211,687,706		1,358,788,696
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（ ）		11,239,586		127,621,631
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		236,902,622		479,467,916
剰余金増加額又は欠損金減少額		62,204,320		230,233,208
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		62,204,320		230,233,208
剰余金減少額又は欠損金増加額		20,087,146		80,070,371
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		20,087,146		80,070,371
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		479,467,916		1,860,797,818

(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12期	
	自 平成24年11月20日	至 平成25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。	
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。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第11期	第12期
	平成24年11月19日現在	平成25年11月19日現在
1. 元本状況		
期首元本額	2,250,402,799円	2,417,391,801円
期中追加設定元本額	349,296,357円	419,578,520円
期中一部解約元本額	182,307,355円	360,743,160円
2. 受益権の総数	2,417,391,801口	2,476,227,161口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期	第12期
	自 平成23年11月22日 至 平成24年11月19日	自 平成24年11月20日 至 平成25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	3,913,993円	5,512,059円
2. 分配金の計算過程 該当事項はありません。		

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第12期	
	自 平成24年11月20日	至 平成25年11月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資し、また、デリバティブ取引を行っております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会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。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、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・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、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、運用部門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っております。	
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。	

金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期
	平成25年11月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) 金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第11期（平成24年11月19日現在）

種類	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	235,959,927
合計	235,959,927

第12期（平成25年11月19日現在）

種類	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	1,193,599,106
合計	1,193,599,106

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第11期（平成24年11月19日現在）

該当事項はありません。

第12期（平成25年11月19日現在）

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12期（自平成24年11月20日 至 平成25年11月19日）

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第11期 平成24年11月19日現在	第12期 平成25年11月19日現在
1口当たり純資産額 1.1983円 「1口 = 1円(10,000口 = 11,983円)」	1口当たり純資産額 1.7515円 「1口 = 1円(10,000口 = 17,515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	1,436,524,545	2,180,213,301	
	親投資信託 受益証券	年金日本債券マザーファンド	755,733,222	848,537,261	
	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	444,218,631	929,927,282	
	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	189,907,758	409,953,877	
合計 4銘柄			2,826,384,156	4,368,631,721	

[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」、「国際ナショナル株式マザーファンド」及び「国際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。

年金日本株式マザーファンド

(1) 貸借対照表

区 分	平成24年11月19日現在 金 額 (円)	平成25年11月19日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	954,894,867	2,409,464,230
株式	52,497,562,400	82,140,964,400
未収入金	525,385,129	964,926,042
未収配当金	510,349,900	601,247,800
流動資産合計	54,488,192,296	86,116,602,472
資産合計	54,488,192,296	86,116,602,472
負債の部		
流動負債		
未払金	538,891,988	977,815,351
未払解約金	14,408,431	544,962,363
流動負債合計	553,300,419	1,522,777,714
負債合計	553,300,419	1,522,777,714
純資産の部		
元本等		
元本	57,943,881,705	55,739,979,900
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	4,008,989,828	28,853,844,858
元本等合計	53,934,891,877	84,593,824,758
純資産合計	53,934,891,877	84,593,824,758
負債純資産合計	54,488,192,296	86,116,602,472

[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24年11月20日 至 平成25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られ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られた価額で評価しております。
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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年11月19日現在	平成25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	59,645,709,150円	57,943,881,705円
期中追加設定元本額	7,751,034,088円	11,899,960,665円
期中一部解約元本額	9,452,861,533円	14,103,862,470円
元本の内訳		
大和住銀DC日本株式ファンド	10,054,711,833円	10,094,614,747円
大和住銀DC年金設計ファンド30	600,514,915円	450,169,620円
大和住銀DC年金設計ファンド50	1,385,647,116円	1,270,897,255円
大和住銀DC年金設計ファンド70	1,516,970,102円	1,436,524,545円
大和住銀DC国内株式ファンド	2,087,379,067円	2,408,511,582円
大和住銀年金専用日本株式F-1（適格機関投資家限定）	24,456,826,800円	25,937,340,680円
大和住銀日本株式ファンドVA（適格機関投資家限定）	17,131,792,700円	13,041,222,128円
大和住銀年金設計ファンド30VA（適格機関投資家専用）	9,876,880円	7,642,762円
大和住銀年金設計ファンド50VA（適格機関投資家専用）	26,272,319円	25,067,548円
大和住銀年金設計ファンド70VA（適格機関投資家専用）	13,714,303円	13,250,584円
大和住銀バランスファンド60（適格機関投資家限定）	517,172,749円	415,602,262円
大和住銀世界資産バランスVA（適格機関投資家限定）	143,002,921円	69,123,152円
大和住銀ポラリティ調整型日本株F-1（適格機関投資家限定）	-	570,013,035円
合計	57,943,881,705円	55,739,979,900円
2. 受益権の総数	57,943,881,705口	55,739,979,900口
3. 元本の欠損	4,008,989,828円	-

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年11月20日 至 平成25年11月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会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。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、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・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、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、運用部門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っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年11月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成24年11月19日現在）

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額（円）
株 式	1,569,745,453
合計	1,569,745,453

「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24年1月28日から平成24年11月19日まで）を指しております。

（平成25年11月19日現在）

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額（円）
株 式	13,986,249,485
合計	13,986,249,485

「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25年1月29日から平成25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）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（平成24年11月19日現在）

該当事項はありません。

（平成25年11月19日現在）

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24年11月20日 至 平成25年11月19日）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成24年11月19日現在	平成25年11月19日現在
1口当たり純資産額 0.9308円 「1口 = 1円（10,000口 = 9,308円）」	1口当たり純資産額 1.5177円 「1口 = 1円（10,000口 = 15,177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	国際石油開発帝石	601,100	1,160	697,276,000	
	長谷工コーポレーション	215,900	786	169,697,400	
	大東建託	43,100	9,680	417,208,000	
	大和ハウス工業	309,000	1,956	604,404,000	
	三井製糖	158,000	372	58,776,000	
	雪印メグミルク	239,200	1,290	308,568,000	
	不二製油	30,500	1,672	50,996,000	
	日本たばこ産業	519,700	3,700	1,922,890,000	
	東レ	490,000	681	333,690,000	
	オンワードホールディングス	445,000	788	350,660,000	
	東ソー	507,000	442	224,094,000	
	信越化学工業	157,200	5,860	921,192,000	
	日本触媒	269,000	1,264	340,016,000	
	ダイセル	136,000	840	114,240,000	
	日本ゼオン	503,000	1,147	576,941,000	
	宇部興産	1,397,000	210	293,370,000	
	武田薬品工業	196,200	4,800	941,760,000	
	塩野義製薬	213,200	2,280	486,096,000	
	栄研化学	16,600	1,980	32,868,000	
	沢井製薬	96,200	6,870	660,894,000	
	第一三共	321,200	1,944	624,412,800	
	ブリヂストン	634,200	3,675	2,330,685,000	
	太平洋セメント	2,156,000	425	916,300,000	
	新日鐵住金	2,740,000	341	934,340,000	
	ジェイ エフ イー ホールディングス	1,078,000	2,361	2,545,158,000	
	日本発条	946,800	1,155	1,093,554,000	
	東芝機械	705,000	557	392,685,000	
	小松製作所	234,600	2,126	498,759,600	
	クボタ	264,000	1,671	441,144,000	
	荏原製作所	843,000	608	512,544,000	
	タダノ	944,000	1,337	1,262,128,000	
	フジテック	360,000	1,231	443,160,000	
	セガサミーホールディングス	97,200	2,584	251,164,800	
	キッツ	238,100	424	100,954,400	
	I H I	1,812,000	408	739,296,000	
	ミネベア	1,147,000	682	782,254,000	
	日立製作所	2,538,000	695	1,763,910,000	
	三菱電機	2,241,000	1,141	2,556,981,000	
	ジーエス・ユアサ コーポレーション	239,000	608	145,312,000	
	サンケン電気	438,000	596	261,048,000	
	セイコーエプソン	340,600	2,279	776,227,400	
	富士通ゼネラル	443,000	1,179	522,297,000	
	アルプス電気	516,600	1,003	518,149,800	
	日本光電工業	95,000	3,930	373,350,000	
	日本電子	193,000	493	95,149,000	
	新光電気工業	213,100	839	178,790,900	
	K O A	204,500	950	194,275,000	
	リコー	431,000	1,106	476,686,000	
	東京エレクトロン	88,800	5,310	471,528,000	
	トヨタ自動車	821,700	6,300	5,176,710,000	
	アイシン精機	427,600	3,965	1,695,434,000	
	マツダ	2,815,000	452	1,272,380,000	
	本田技研工業	192,200	4,095	787,059,000	
	ショーワ	44,800	1,487	66,617,600	
	オリンパス	163,500	3,280	536,280,000	
	トッパン・フォームズ	394,300	931	367,093,300	
	タカラトミー	588,200	485	285,277,000	
	任天堂	31,300	13,030	407,839,000	

中部電力	537,100	1,419	762,144,900
東京瓦斯	631,000	517	326,227,000
東日本旅客鉄道	179,900	8,420	1,514,758,000
東海旅客鉄道	78,300	12,580	985,014,000
商船三井	1,776,000	433	769,008,000
グリー	374,800	904	338,819,200
マクロミル	306,800	610	187,148,000
ヤフー	787,000	495	389,565,000
日本ユニシス	751,700	847	636,689,900
日本テレビホールディングス	78,100	1,862	145,422,200
日本電信電話	499,000	5,250	2,619,750,000
KDDI	343,800	6,080	2,090,304,000
光通信	25,800	7,470	192,726,000
KADOKAWA	90,300	3,585	323,725,500
東映	849,000	602	511,098,000
コナミ	144,700	2,553	369,419,100
日立ハイテクノロジーズ	235,000	2,262	531,570,000
住友商事	433,400	1,274	552,151,600
三菱商事	1,065,400	2,007	2,138,257,800
アスクル	24,400	2,860	69,784,000
DCMホールディングス	202,600	709	143,643,400
ドトール・日レスホールディングス	110,300	1,722	189,936,600
三越伊勢丹ホールディングス	300,800	1,495	449,696,000
良品計画	127,700	10,460	1,335,742,000
コナカ	144,700	929	134,426,300
チヨダ	213,200	2,176	463,923,200
高島屋	370,000	992	367,040,000
ケースホールディングス	190,300	3,190	607,057,000
アークス	168,700	1,862	314,119,400
新生銀行	1,555,000	241	374,755,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,712,600	658	3,758,890,800
りそなホールディングス	3,142,100	528	1,659,028,800
横浜銀行	1,859,000	556	1,033,604,000
みずほフィナンシャルグループ	16,732,400	219	3,664,395,600
野村ホールディングス	2,024,500	798	1,615,551,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	700,500	874	612,237,000
東京海上ホールディングス	149,600	3,430	513,128,000
T&Dホールディングス	1,119,200	1,309	1,465,032,800
東京センチュリーリース	146,800	3,555	521,874,000
オリックス	605,500	1,762	1,066,891,000
三菱地所	337,000	2,876	969,212,000
住友不動産	452,000	4,950	2,237,400,000
テンブホールディングス	165,400	2,678	442,941,200
ディー・エヌ・エー	234,700	1,893	444,287,100
合計 102銘柄	80,500,300	-	82,140,964,400

[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24年11月19日現在 金額（円）	平成25年11月19日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	126,519,775	160,085,311
国債証券	8,036,713,200	8,457,387,500
地方債証券	-	110,437,300
特殊債券	422,803,145	100,027,300
社債券	4,859,326,500	5,700,142,300
未収利息	44,895,023	40,241,523
前払金	840,000	-
前払費用	2,350,625	9,649,376
差入委託証拠金	2,340,000	-
流動資産合計	13,495,788,268	14,577,970,610
資産合計	13,495,788,268	14,577,970,610
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	368,820	-
未払解約金	855,951	1,584,534
流動負債合計	1,224,771	1,584,534
負債合計	1,224,771	1,584,534
純資産の部		
元本等		
元本	12,343,980,147	12,981,774,091
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,150,583,350	1,594,611,985
元本等合計	13,494,563,497	14,576,386,076
純資産合計	13,494,563,497	14,576,386,076
負債純資産合計	13,495,788,268	14,577,970,610

[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24年11月20日 至 平成25年11月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 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が発表する売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）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。</p> <p>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られ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られた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。
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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年11月19日現在	平成25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	13,244,978,729円	12,343,980,147円
期中追加設定元本額	2,741,206,263円	4,514,159,383円
期中一部解約元本額	3,642,204,845円	3,876,365,439円
元本の内訳		
大和住銀DC日本債券ファンド	175,370,557円	193,063,527円
大和住銀DC年金設計ファンド30	1,131,587,915円	1,404,319,187円
大和住銀DC年金設計ファンド50	1,383,240,648円	1,583,404,591円
大和住銀DC年金設計ファンド70	553,182,615円	755,733,222円
大和住銀年金専用日本債券F-1（適格機関投資家限定）	7,313,130,172円	7,151,987,852円
大和住銀日本債券ファンドVA（適格機関投資家限定）	1,356,704,939円	1,387,115,369円
大和住銀年金設計ファンド30VA（適格機関投資家専用）	19,820,104円	24,729,616円
大和住銀年金設計ファンド50VA（適格機関投資家専用）	26,466,027円	31,479,084円
大和住銀年金設計ファンド70VA（適格機関投資家専用）	4,549,542円	6,364,231円
大和住銀バランスファンド60（適格機関投資家限定）	309,526,521円	403,397,092円
大和住銀世界資産バランスVA（適格機関投資家限定）	70,401,107円	40,180,320円
合計	12,343,980,147円	12,981,774,091円
2. 受益権の総数	12,343,980,147口	12,981,774,091口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年11月20日 至 平成25年11月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会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。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、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・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、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、運用部門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っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年11月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成24年11月19日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	94,182,260
特殊債券	2,269,200
社債券	17,738,800
合計	114,190,260

「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24年1月28日から平成24年11月19日まで）を指しております。

(平成25年11月19日現在)

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	132,238,000
地方債証券	4,401,700
特殊債券	27,300
社債券	8,985,900
合計	136,849,500

「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25年1月29日から平成25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)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(債券関連)

区分	種類	平成24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 売建 長期国債先物	867,351,180	-	867,720,000	368,820
	合計	-	-	867,720,000	368,820

(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。

(平成25年11月19日現在)

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24年11月20日 至 平成25年11月19日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成24年11月19日現在	平成25年11月19日現在
1口当たり純資産額 1.0932円 「1口 = 1円(10,000口 = 10,932円)」	1口当たり純資産額 1.1228円 「1口 = 1円(10,000口 = 11,228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	332 2年国債	200,000,000	200,036,000	
	国債証券	106 5年国債	500,000,000	500,760,000	
	国債証券	110 5年国債	300,000,000	301,545,000	
	国債証券	312 10年国債	750,000,000	793,215,000	
	国債証券	316 10年国債	450,000,000	472,644,000	
	国債証券	317 10年国債	900,000,000	944,955,000	
	国債証券	320 10年国債	400,000,000	416,660,000	
	国債証券	329 10年国債	750,000,000	763,927,500	
	国債証券	13 30年国債	300,000,000	324,396,000	
	国債証券	93 20年国債	600,000,000	683,412,000	
	国債証券	120 20年国債	300,000,000	316,155,000	
	国債証券	122 20年国債	500,000,000	540,490,000	
	国債証券	129 20年国債	850,000,000	910,154,500	
	国債証券	136 20年国債	500,000,000	514,580,000	
	国債証券	145 20年国債	750,000,000	774,457,500	
	地方債証券	2 兵庫県公債30年	100,000,000	110,437,300	
	特殊債券	3 大阪府住宅供給	100,000,000	100,027,300	
	社債券	2 ヒューリック	100,000,000	100,452,300	
	社債券	5 森ビル	100,000,000	102,181,800	
	社債券	9 森ビル	100,000,000	101,402,600	
	社債券	36 住友化学	100,000,000	105,274,400	
	社債券	6 日本ゼオン	100,000,000	100,873,300	
	社債券	3 森精機製作所	200,000,000	200,574,200	
	社債券	31 富士通	100,000,000	100,411,700	
	社債券	10 セイコーエプソン	100,000,000	99,890,500	
	社債券	32 川崎重工業	200,000,000	204,644,800	
	社債券	3-1 住友生命第3	100,000,000	100,858,800	
	社債券	1フコク生命2011基金	100,000,000	101,128,000	
	社債券	1-B 明治安田2012	100,000,000	100,860,000	
	社債券	1 明治安田2013基	100,000,000	100,890,000	
	社債券	12 トヨタ自動車	200,000,000	200,524,200	
	社債券	5 ドン・キホーテ	200,000,000	204,814,800	
	社債券	70 伊藤忠商事	100,000,000	99,571,500	
	社債券	91 丸紅	100,000,000	100,382,600	
	社債券	61 三井物産	100,000,000	105,055,000	
	社債券	77 三菱商事	200,000,000	201,932,800	
	社債券	18 丸井グループ	100,000,000	102,096,300	
	社債券	41 クレディセゾン	100,000,000	101,672,500	
	社債券	4 ほくほくファイナンFR	200,000,000	206,426,000	
	社債券	5 東京センチュリーリース	100,000,000	100,141,400	
	社債券	18 ホンダファイナンス	100,000,000	100,807,900	
	社債券	2 東日本BK劣後FR	200,000,000	203,730,000	
	社債券	62 アコム	100,000,000	101,378,600	
	社債券	64 アコム	100,000,000	100,582,500	
	社債券	150 オリックス	200,000,000	203,598,600	
	社債券	22 三菱UFJリース	100,000,000	99,981,900	
	社債券	2-1 財政マスター特定	200,000,000	212,217,200	
	社債券	2あいおいニッセイ劣FR	200,000,000	200,874,000	
	社債券	3 NECキャピタルソリューシ	100,000,000	100,286,500	
	社債券	103 三菱地所	200,000,000	201,510,400	
	社債券	17 東急不動産	100,000,000	101,588,200	
	社債券	84 住友不動産	100,000,000	99,958,300	
	社債券	5 東日本旅客鉄道	200,000,000	220,104,400	
	社債券	44 阪急阪神HLDG	100,000,000	100,349,100	
	社債券	492 中部電力	100,000,000	104,952,800	
	社債券	486 関西電力	200,000,000	200,565,800	
	社債券	466 東北電力	100,000,000	100,576,700	
	社債券	417 九州電力	200,000,000	200,206,000	
	社債券	22 大阪瓦斯	100,000,000	104,813,900	
	合計	59銘柄	13,850,000,000	14,367,994,400	

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24年11月19日現在 金 額（円）	平成25年11月19日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	621,006,151	155,215,394
コール・ローン	616,011,276	915,035,391
株式	32,121,963,226	45,421,738,759
投資証券	208,488,010	398,318,031
派生商品評価勘定	1,801,282	1,295,320
未収入金	624,543,037	500,774,352
未収配当金	39,251,206	20,798,717
流動資産合計	34,233,064,188	47,413,175,964
資産合計	34,233,064,188	47,413,175,964
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,865,816	2,469,881
未払金	541,309,828	315,265,209
未払解約金	8,326,271	52,876,783
流動負債合計	551,501,915	370,611,873
負債合計	551,501,915	370,611,873
純資産の部		
元本等		
元本	27,297,782,893	22,471,829,897
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,383,779,380	24,570,734,194
元本等合計	33,681,562,273	47,042,564,091
純資産合計	33,681,562,273	47,042,564,091
負債純資産合計	34,233,064,188	47,413,175,964

[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24年11月20日 至 平成25年11月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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られ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られた価額で評価しております。
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。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 外国株式及び外国投資証券についての受取配当金は、原則として、株式及び投資証券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。
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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年11月19日現在	平成25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	29,193,616,585円	27,297,782,893円
期中追加設定元本額	7,803,546,460円	8,594,673,496円
期中一部解約元本額	9,699,380,152円	13,420,626,492円
元本の内訳		
大和住銀グローバルバランスファンド	334,449,333円	245,954,324円
大和住銀DC外国株式ファンド	7,957,288,844円	7,590,302,538円
大和住銀DC年金設計ファンド30	96,362,531円	71,074,187円
大和住銀DC年金設計ファンド50	471,061,290円	392,483,742円
大和住銀DC年金設計ファンド70	497,509,377円	444,218,631円
大和住銀DC海外株式アクティブファンド	1,798,879,251円	1,890,224,437円
大和住銀グローバルバランスファンドVA	285,517,566円	148,788,778円
大和住銀/T・ロウ・ブライズ外国株式ファンドVA	6,234,897,478円	4,990,692,243円
大和住銀グローバルバランスファンドSVA	1,791,941,637円	1,388,051,217円
大和住銀外国株式ファンドMSVA（適格機関投資家限定）	7,447,635,528円	5,060,174,642円
大和住銀年金設計ファンド30VA（適格機関投資家専用）	1,557,403円	1,189,216円
大和住銀年金設計ファンド50VA（適格機関投資家専用）	9,143,215円	7,735,588円
大和住銀年金設計ファンド70VA（適格機関投資家専用）	4,509,371円	4,045,343円
大和住銀バランスファンド60（適格機関投資家限定）	193,413,661円	164,578,330円
大和住銀世界資産バランスVA（適格機関投資家限定）	173,616,408円	72,316,681円
合計	27,297,782,893円	22,471,829,897円
2. 受益権の総数	27,297,782,893口	22,471,829,897口

（金融商品に関する注記）
金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年11月20日 至 平成25年11月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会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。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、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・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、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、運用部門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っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年11月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券
（平成24年11月19日現在）

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額（円）
株 式	50,372,395
投 資 証 券	9,884,323
合計	60,256,718

「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24年7月7日から平成24年11月19日まで）を指しております。

（平成25年11月19日現在）

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額（円）
株 式	4,423,844,577
投 資 証 券	46,193,170
合計	4,470,037,747

「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25年7月9日から平成25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）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
（通貨関連）

区分	種類	平成24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	69,146,420	-	69,904,226	757,806
	香港・ドル	15,256,417	-	15,295,468	39,051
	イギリス・ボンド	38,927,126	-	39,274,958	347,832
	スイス・フラン	27,613,171	-	27,767,208	154,037
	デンマーク・クローネ	22,717,206	-	22,807,952	90,746
	メキシコ・ペソ	15,737,093	-	16,097,998	360,905
	ブラジル・レアル	27,162,541	-	27,053,773	108,768
	ユーロ	11,195,741	-	11,246,015	50,274
	売建				
	アメリカ・ドル	164,709,295	-	165,714,130	1,004,835
	イギリス・ボンド	27,532,234	-	27,675,519	143,285
	ユーロ	35,914,186	-	36,522,483	608,297
	合計	-	-	459,359,730	64,534

区分	種類	平成25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	243,517,461	-	243,951,708	434,247
	イギリス・ボンド	79,295,734	-	78,865,610	430,124
	メキシコ・ペソ	9,255,602	-	9,256,949	1,347
	ユーロ	17,123,169	-	17,070,098	53,071
	売建				
	アメリカ・ドル	142,774,505	-	142,182,270	592,235
	イギリス・ボンド	40,027,570	-	39,995,262	32,308
	スウェーデン・クローネ	18,583,980	-	18,608,628	24,648
	ブラジル・レアル	94,670,565	-	96,396,616	1,726,051
	ユーロ	10,835,346	-	10,836,150	804
	合計	-	-	657,163,291	1,174,561

（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24年11月20日 至 平成25年11月19日）
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成24年11月19日現在	平成25年11月19日現在
1口当たり純資産額 1.2339円 「1口 = 1円（10,000口 = 12,339円）」	1口当たり純資産額 2.0934円 「1口 = 1円（10,000口 = 20,934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	AGILENT TECH	171,700	54.050	9,280,385.000	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	36,500	53.050	1,936,325.000	
	AMAZON.COM INC	27,400	366.180	10,033,332.000	
	APPLE INC	29,370	518.650	15,232,750.500	
	AUTODESK INC	173,500	43.320	7,516,020.000	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	169,700	43.970	7,461,709.000	
	BAIDU INC - SPON ADR	37,000	162.870	6,026,190.000	
	BANK OF AMERICA CORP	677,100	14.920	10,102,332.000	
	BIOGEN IDEC INC	21,200	241.270	5,114,924.000	
	BOEING CO/THE	65,500	138.360	9,062,580.000	
	BRISTOL MYERS-SQUIBB	100,700	51.860	5,222,302.000	
	CABOT OIL & GAS CORP	108,500	32.870	3,566,395.000	
	CHARTER COMMUNICATION-A	26,700	129.540	3,458,718.000	
	CONCHO RESOURCES INC	37,700	107.090	4,037,293.000	
	CONTROLADORA VUELA CIA DE AV	283,800	12.830	3,641,154.000	
	CROWN CASTLE INTL CORP	50,800	76.320	3,877,056.000	
	CTrip.COM INTERNATIONAL-ADR	89,100	51.550	4,593,105.000	
	CUMMINS INC	38,500	132.590	5,104,715.000	
	DP WORLD LTD	294,181	15.400	4,530,387.400	
	ECOLAB INC	70,200	107.070	7,516,314.000	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	155,500	43.310	6,734,705.000	
	FACEBOOK INC-A	103,800	45.840	4,758,192.000	
	FLOWSERVE CORP	119,400	70.600	8,429,640.000	
	GILEAD SCIENCES INC	133,100	68.980	9,181,238.000	
	GOOGLE INC-CL A	7,300	1,031.550	7,530,315.000	
	HOSPIRA INC	154,600	39.000	6,029,400.000	
	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	24,300	73.700	1,790,910.000	
	JUNIPER NETWORKS INC	544,200	19.590	10,660,878.000	
	LIBERTY GLOBAL PLC-A	110,700	79.870	8,841,609.000	
	LINKEDIN CORP - A	27,000	222.070	5,995,890.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	52,400	66.860	3,503,464.000	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	77,200	101.400	7,828,080.000	
	NETFLIX INC	13,900	341.770	4,750,603.000	
	PHARMACYCLICS INC	30,400	122.300	3,717,920.000	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	22,000	186.040	4,092,880.000	
	PRECISION CASTPARTS CORP	39,100	255.870	10,004,517.000	
	PRICELINE.COM INC	5,000	1,127.930	5,639,650.000	
	PROCTER AND GAMBLE CO	163,600	84.570	13,835,652.000	
	RANGE RESOURCES CORP	67,200	73.800	4,959,360.000	
	SINA CORP	28,900	82.660	2,388,874.000	
	STATE STREET CORPORATION	170,600	70.990	12,110,894.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	214,100	28.960	6,200,336.000		
TESLA MOTORS INC	8,400	121.580	1,021,272.000		
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	120,700	36.380	4,391,066.000		
VALERO ENERGY CORP	130,900	42.920	5,618,228.000		
VISA INC-CLASS A SHRS	54,900	199.900	10,974,510.000		
WORKDAY INC-CLASS A	49,800	73.670	3,668,766.000		
小計（アメリカ・ドル）47銘柄	5,138,151	-	301,972,835.900 (30,161,046,849)		
オースト ラリア・ ドル	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	818,828	12.060	9,875,065.680	
	小計（オーストラリア・ドル）1銘柄	818,828	-	9,875,065.680 (924,602,399)	
香港 ・ドル	AIA GROUP LTD	2,071,200	39.300	81,398,160.000	
	SAMSONITE INTERNATIONAL SA	1,968,000	21.750	42,804,000.000	
	小計（香港・ドル）2銘柄	4,039,200	-	124,202,160.000 (1,599,723,821)	
台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MFE	3,015,000	104.000	313,560,000.000	

・ドル	小計(台湾・ドル) 1 銘柄	3,015,000	-	313,560,000.000 (1,062,968,400)	
イギリス ・ ポンド	ARM HOLDINGS PLC	301,563	9.595	2,893,496.980	
	BARCLAYS PLC	1,918,692	2.514	4,823,591.680	
	BG GROUP PLC	211,968	12.585	2,667,617.280	
	BURBERRY GROUP PLC	266,375	14.950	3,982,306.250	
	ROTORK PLC	101,040	28.550	2,884,692.000	
	小計(イギリス・ポンド) 5 銘柄	2,799,638	-	17,251,704.190 (2,776,489,272)	
スイス ・ フラン	CREDIT SUISSE GROUP-REG	251,238	26.430	6,640,220.340	
	NESTLE SA (REGD)	125,134	67.300	8,421,518.200	
	小計(スイス・フラン) 2 銘柄	376,372	-	15,061,738.540 (1,648,808,518)	
スウェー デン・ クローナ	ASSA ABLOY AB-B	98,030	331.600	32,506,748.000	
	HEXAGON AB-B SHS	175,048	201.600	35,289,676.800	
	小計(スウェーデン・クローナ) 2 銘柄	273,078	-	67,796,424.800 (1,024,403,978)	
メキシコ ・ ペソ	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	1,090,600	84.650	92,319,290.000	
	小計(メキシコ・ペソ) 1 銘柄	1,090,600	-	92,319,290.000 (716,397,690)	
インド・ ルピー	HDFC BANK LIMITED	347,079	668.800	232,126,435.200	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,834,111	96.350	176,716,594.850	
	小計(インド・ルピー) 2 銘柄	2,181,190	-	408,843,030.050 (658,237,278)	
ブラジル ・ リアル	AREZZO INDUSTRIA E COMERCIO	234,100	30.740	7,196,234.000	
	RAIA DROGASIL SA	12,000	16.560	198,720.000	
	小計(ブラジル・リアル) 2 銘柄	246,100	-	7,394,954.000 (326,265,370)	
韓国・ ウォン	NAVER CORPORATION	9,628	625,000.000	6,017,500,000.000	
	小計(韓国・ウォン) 1 銘柄	9,628	-	6,017,500,000.000 (570,459,000)	
マレーシ ア・リン ギット	TENAGA NASIONAL	1,169,400	9.450	11,050,830.000	
	小計(マレーシア・リングット) 1 銘柄	1,169,400	-	11,050,830.000 (346,111,995)	
ユーロ	AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	195,886	27.620	5,410,371.320	
	BANCO BILBAO VIZCAYA SA	642,218	8.572	5,505,092.690	
	BRENNTAG AG	29,013	128.450	3,726,719.850	
	D' IETEREN SA/NV	96,218	35.590	3,424,398.620	
	ILIAD SA	24,832	162.950	4,046,374.400	
	LEGRAND SA	112,749	40.955	4,617,635.290	
	小計(ユーロ) 6 銘柄	1,100,916	-	26,730,592.170 (3,606,224,189)	
	合計	22,258,101	-	45,421,738,759 (45,421,738,759)	

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
ユーロ	投資証券	GECINA SA	29,575.000	2,952,472.250	
	小計(ユーロ)1銘柄		29,575.000	2,952,472.250 (398,318,031)	
合計				398,318,031 (398,318,031)	

- (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. 合計欄は邦貨金額を表示しております。()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、内数で表示してあります。
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 47銘柄	64.11%	65.82%
オーストラリア・ドル	外国株式 1銘柄	1.97%	2.02%
香港・ドル	外国株式 2銘柄	3.40%	3.49%
台湾・ドル	外国株式 1銘柄	2.26%	2.32%
イギリス・ポンド	外国株式 5銘柄	5.90%	6.06%
スイス・フラン	外国株式 2銘柄	3.50%	3.60%
スウェーデン・クローナ	外国株式 2銘柄	2.18%	2.24%
メキシコ・ペソ	外国株式 1銘柄	1.52%	1.56%
インド・ルピー	外国株式 2銘柄	1.40%	1.44%
ブラジル・レアル	外国株式 2銘柄	0.69%	0.71%
韓国・ウォン	外国株式 1銘柄	1.21%	1.24%
マレーシア・リンギット	外国株式 1銘柄	0.74%	0.76%
ユーロ	外国株式 6銘柄	7.67%	7.87%
ユーロ	投資証券 1銘柄	0.84%	0.87%

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

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)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24年11月19日現在 金額(円)	平成25年11月19日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	31,876,204	22,196,097
コール・ローン	98,026,788	81,590,688
国債証券	3,375,502,499	4,050,849,785
地方債証券	29,965,200	34,807,203
特殊債券	66,291,713	60,833,648
社債券	759,955,641	712,178,806
派生商品評価勘定	11,022,406	16,290,733
未収入金	161,653,448	-
未収利息	39,059,376	44,261,024
前払費用	8,281,450	7,918,520
差入委託証拠金	11,067,782	14,297,074
流動資産合計	4,592,702,507	5,045,223,578
資産合計	4,592,702,507	5,045,223,578
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,699,527	16,934,961
未払金	133,298,922	2,977,852
未払解約金	230,158	1,434,411
流動負債合計	142,228,607	21,347,224
負債合計	142,228,607	21,347,224
純資産の部		
元本等		
元本	2,608,989,922	2,327,314,161
剰余金		
剰余金又は欠損金()	1,841,483,978	2,696,562,193
元本等合計	4,450,473,900	5,023,876,354
純資産合計	4,450,473,900	5,023,876,354
負債純資産合計	4,592,702,507	5,045,223,578

[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24年11月20日 至 平成25年11月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 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（売気配相場を除く）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。</p> <p>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。</p>
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。
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。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成24年11月19日現在	平成25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	5,055,157,744円	2,608,989,922円
期中追加設定元本額	1,699,652,955円	372,832,418円
期中一部解約元本額	4,145,820,777円	654,508,179円
元本の内訳		
大和住銀DC外国債券ファンド	1,095,204,746円	1,134,645,945円
大和住銀DC年金設計ファンド30	132,533,428円	119,881,691円
大和住銀DC年金設計ファンド50	209,922,149円	218,375,742円
大和住銀DC年金設計ファンド70	167,685,019円	189,907,758円
大和住銀ライフプラン・外国債券	6,473,835円	4,132,807円
大和住銀/T・ロウ・ブライズ外国債券ファンドVA	797,531,413円	526,718,684円
大和住銀年金設計ファンド30VA（適格機関投資家専用）	2,194,021円	2,064,557円
大和住銀年金設計ファンド50VA（適格機関投資家専用）	3,866,395円	4,318,842円
大和住銀年金設計ファンド70VA（適格機関投資家専用）	1,447,876円	1,641,904円
大和住銀バランスファンド60（適格機関投資家限定）	70,568,914円	68,923,637円
大和住銀世界資産バランスVA（適格機関投資家限定）	121,562,126円	56,702,594円
合計	2,608,989,922円	2,327,314,161円
2. 受益権の総数	2,608,989,922口	2,327,314,161口

（金融商品に関する注記）
金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年11月20日 至 平成25年11月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク、為替変動リスク及び流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会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。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、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・決定しております。また、プロダクト管理部運用審査室は、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、運用部門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っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成25年11月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券
（平成24年11月19日現在）

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	53,309,411
地方債証券	1,820,022
特殊債証券	5,167,084
社債証券	39,639,771
合計	99,936,288

「計算期間」とは、「国際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24年2月23日から平成24年11月19日まで）を指しております。

（平成25年11月19日現在）

種類	計算期間 の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	7,508,083
地方債証券	1,119,389
特殊債証券	4,369,908
社債証券	14,604,326
合計	27,601,706

「計算期間」とは、「国際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25年2月23日から平成25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）
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
（平成24年11月19日現在）
該当事項はありません。

（債券関連）

区分	種類	平成25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 売建				
	EURO-BOBL FUTURE DEC13	50,210,804	-	50,753,142	542,338
	US 10YR NOTE FUT DEC13	137,203,908	-	139,583,866	2,379,958
合計		-	-	190,337,008	2,922,296

（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値段等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24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	45,408,000	-	45,563,387	155,387
	カナダ・ドル	14,161,628	-	14,513,338	351,710
	オーストラリア・ドル	1,559,818	-	1,590,300	30,482
	シンガポール・ドル	17,749,414	-	18,047,200	297,786
	イギリス・ポンド	33,704,587	-	34,127,367	422,780
	スイス・フラン	18,479,412	-	19,009,531	530,119
	デンマーク・クローネ	1,531,827	-	1,574,486	42,659
	ノルウェー・クローネ	108,437,726	-	110,280,288	1,842,562
	スウェーデン・クローナ	41,035,045	-	41,712,569	677,524
	メキシコ・ペソ	103,057,614	-	106,575,609	3,517,995
	南アフリカ・ランド	1,566,965	-	1,585,781	18,816
	ポーランド・ズロチ	42,783,305	-	42,732,157	51,148
	ユーロ	148,890,742	-	151,972,453	3,081,711
	売建				
	アメリカ・ドル	205,466,525	-	210,640,832	5,174,307
	オーストラリア・ドル	47,199,794	-	48,324,640	1,124,846
	イギリス・ポンド	45,577,059	-	45,899,897	322,838
	スウェーデン・クローナ	1,054,656	-	1,075,500	20,844
	ポーランド・ズロチ	85,296,129	-	86,465,540	1,169,411
	ユーロ	90,075,073	-	90,858,331	783,258
合計		-	-	1,072,549,206	2,322,879

区分	種類	平成25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	480,546,632	-	485,965,727	5,419,095
	シンガポール・ドル	4,007,539	-	4,053,305	45,766
	スイス・フラン	18,764,147	-	19,160,750	396,603
	ノルウェー・クローネ	162,152,281	-	164,507,280	2,354,999
	メキシコ・ペソ	126,113,634	-	131,768,150	5,654,516
	ロシア・ルーブル	1,895,340	-	1,940,927	45,587
	ポーランド・ズロチ	74,009,800	-	75,612,560	1,602,760
	ユーロ	69,345,449	-	70,116,800	771,351
	売建				
	アメリカ・ドル	6,986,756	-	6,986,700	56
	カナダ・ドル	51,465,675	-	52,424,010	958,335
	オーストラリア・ドル	57,067,697	-	57,660,000	592,303
	イギリス・ポンド	329,936,853	-	335,969,121	6,032,268
	イスラエル・シェケル	19,754,834	-	20,100,100	345,266
	デンマーク・クローネ	3,966,782	-	4,052,160	85,378
	ノルウェー・クローネ	71,366,922	-	72,499,410	1,132,488
	スウェーデン・クローナ	86,799,823	-	87,393,180	593,357
	メキシコ・ペソ	1,281,545	-	1,299,610	18,065
	ロシア・ルーブル	37,790,901	-	38,204,100	413,199
	南アフリカ・ランド	2,627,350	-	2,722,890	95,540
	ポーランド・ズロチ	509,187	-	513,280	4,093
	ユーロ	173,935,051	-	177,677,424	3,742,373
合計	-	-	1,810,627,484	2,278,068	

(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24年11月20日 至 平成25年11月19日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

平成24年11月19日現在	平成25年11月19日現在
1口当たり純資産額 1.7058円 「1口 = 1円(10,000口 = 17,058円)」	1口当たり純資産額 2.1587円 「1口 = 1円(10,000口 = 21,587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
アメリカ ・ドル	国債証券	ICELND 5.875 05/11/22	363,000.000	375,755.820	
	国債証券	ROMANI 4.375 08/22/23	90,000.000	87,075.000	
	国債証券	RUSSIA FL 03/31/30	136,565.000	161,847.270	
	国債証券	SLOVEN 4.75 05/10/18	200,000.000	202,000.000	
	国債証券	T 1 03/31/17	761,000.000	768,130.570	
	国債証券	T 2.25 01/31/15	1,777,000.000	1,821,353.920	
	国債証券	T 2.625 04/30/16	3,625,000.000	3,823,070.000	
	国債証券	T 2.75 02/15/19	326,000.000	348,027.820	
	国債証券	T 2.875 03/31/18	971,000.000	1,044,048.330	
	国債証券	T 4.625 02/15/40	682,000.000	793,779.800	
	国債証券	TURKEY 5.125 03/25/22	200,000.000	202,200.000	
	特殊債券	GAZPRU 8.625 04/28/34	220,000.000	267,377.000	
	特殊債券	PEMEX 4.875 01/24/22	40,000.000	41,100.000	
	特殊債券	PEMEX 5.5 06/27/44	10,000.000	9,057.200	
	社債券	A 3.2 10/01/22	10,000.000	9,376.800	
	社債券	ABBV 2.9 11/06/22	10,000.000	9,450.800	
	社債券	ACT 3.25 10/01/22	20,000.000	18,856.000	
	社債券	AEP 6.375 04/01/36	15,000.000	16,790.700	
	社債券	AET 2.75 11/15/22	25,000.000	23,210.750	
	社債券	AIG 3.375 08/15/20	10,000.000	10,172.300	
	社債券	AIG 4.125 02/15/24	25,000.000	25,506.250	
	社債券	AIG 6.4 12/15/20	10,000.000	11,930.300	
	社債券	AMP 7.3 06/28/19	15,000.000	18,790.650	
	社債券	AMT 4.5 01/15/18	15,000.000	16,128.900	
	社債券	AMT 7.25 05/15/19	30,000.000	35,658.300	
	社債券	APA 3.25 04/15/22	15,000.000	14,714.550	
	社債券	APC 6.375 09/15/17	20,000.000	23,403.800	
	社債券	ARW 3 03/01/18	5,000.000	5,093.500	
	社債券	ARW 4.5 03/01/23	20,000.000	19,695.800	
	社債券	AVP 5 03/15/23	25,000.000	24,626.500	
	社債券	AVT 4.875 12/01/22	10,000.000	10,110.300	
	社債券	BAC 3.75 07/12/16	15,000.000	15,977.700	
	社債券	BAC 5.65 05/01/18	25,000.000	28,649.250	
	社債券	BAC 6.5 08/01/16	55,000.000	62,525.100	
	社債券	BAC 6.875 04/25/18	20,000.000	23,881.400	
	社債券	BAX 3.2 06/15/23	10,000.000	9,715.400	
	社債券	BG 4.1 03/15/16	20,000.000	21,102.200	
	社債券	BHI 3.2 08/15/21	25,000.000	25,327.250	
	社債券	BHP 7.25 08/15/18	10,000.000	10,850.000	
	社債券	BK FL PERPETUAL	20,000.000	18,050.000	
	社債券	BNP 2.7 08/20/18	15,000.000	15,407.550	
	社債券	BNS 2.55 01/12/17	10,000.000	10,419.500	
	社債券	BRK 5.05 03/01/41	40,000.000	40,205.600	
	社債券	BRK 5.4 06/01/41	25,000.000	26,122.500	
	社債券	BSY 3.125 11/26/22	10,000.000	9,457.100	
	社債券	BSY 9.5 11/15/18	15,000.000	19,647.900	
	社債券	BWP 3.375 02/01/23	25,000.000	23,162.000	
	社債券	C 1.3 04/01/16	15,000.000	15,054.300	
	社債券	C 4.587 12/15/15	35,000.000	37,493.050	
	社債券	C 5.5 09/13/25	25,000.000	26,531.000	
社債券	C 5.5 10/15/14	12,000.000	12,512.280		
社債券	CAG 4.95 08/15/20	15,000.000	15,802.800		
社債券	CARGIL 3.25 11/15/21	25,000.000	24,596.500		
社債券	CAT 2.05 08/01/16	35,000.000	36,140.650		
社債券	CCI 3.849 04/15/23	20,000.000	18,858.600		
社債券	CEG 5.15 12/01/20	25,000.000	26,804.000		
社債券	CELG 2.3 08/15/18	10,000.000	10,069.000		
社債券	CMCSA 3.125 07/15/22	15,000.000	14,667.000		
社債券	CMCSA 4.45 01/15/43	20,000.000	18,567.000		
社債券	CMCSA 5.15 04/30/20	20,000.000	22,685.200		
社債券	CMCSA 6.95 08/15/37	25,000.000	31,545.000		
社債券	CNQCEN 5.7 05/15/17	5,000.000	5,696.300		
社債券	COF 2.15 03/23/15	25,000.000	25,448.000		

社債券	COXENT 3.25 12/15/22	5,000.000	4,590.250
社債券	COXENT 8.375 03/01/39	15,000.000	18,531.450
社債券	DE 2 01/13/17	35,000.000	36,008.700
社債券	DELH 6.5 06/15/17	30,000.000	34,020.000
社債券	DG 3.25 04/15/23	25,000.000	22,944.500
社債券	DOW 8.55 05/15/19	20,000.000	25,872.200
社債券	DPM 2.5 12/01/17	15,000.000	15,082.800
社債券	DPM 3.875 03/15/23	5,000.000	4,665.100
社債券	DTV 1.75 01/15/18	5,000.000	4,915.950
社債券	DTV 2.4 03/15/17	15,000.000	15,256.500
社債券	DTV 5.875 10/01/19	20,000.000	22,751.400
社債券	ECOPET 5.875 09/18/23	165,000.000	176,550.000
社債券	EEP 5.5 09/15/40	15,000.000	14,700.600
社債券	ENOGEX 6.25 03/15/20	20,000.000	21,558.800
社債券	ENTERP 3.3 10/15/22	10,000.000	9,499.100
社債券	ENTERP 5.25 10/01/20	20,000.000	22,242.200
社債券	EPD 5.95 02/01/41	45,000.000	49,151.700
社債券	EQT 4.875 11/15/21	30,000.000	31,004.700
社債券	ESRX 3.9 02/15/22	25,000.000	25,292.000
社債券	ETN 4 11/02/32	10,000.000	9,288.700
社債券	ETP 3.6 02/01/23	10,000.000	9,383.100
社債券	ETP 5.2 02/01/22	25,000.000	26,581.000
社債券	EV 3.625 06/15/23	15,000.000	14,739.600
社債券	EXC 6.25 10/01/39	10,000.000	10,069.900
社債券	F 4.75 01/15/43	80,000.000	72,351.200
社債券	FE 4.25 03/15/23	10,000.000	9,330.600
社債券	FIS 3.5 04/15/23	5,000.000	4,607.950
社債券	FISV 3.125 06/15/16	10,000.000	10,463.300
社債券	FISV 3.5 10/01/22	15,000.000	14,236.350
社債券	FITB 3.5 03/15/22	10,000.000	9,926.000
社債券	FITB 3.625 01/25/16	15,000.000	15,831.300
社債券	GCN 2.125 03/15/18	10,000.000	9,833.000
社債券	GE 1.625 07/02/15	15,000.000	15,253.500
社債券	GE 4.125 10/09/42	30,000.000	27,667.500
社債券	GE 5.875 01/14/38	65,000.000	73,763.300
社債券	GMT 4.85 06/01/21	25,000.000	25,870.500
社債券	GS 2.375 01/22/18	5,000.000	5,055.450
社債券	GS 2.9 07/19/18	20,000.000	20,495.600
社債券	GS 3.625 02/07/16	25,000.000	26,400.750
社債券	GS 3.7 08/01/15	55,000.000	57,553.650
社債券	GS 5.75 01/24/22	45,000.000	50,765.850
社債券	GS 6.25 02/01/41	15,000.000	17,218.200
社債券	GTPTOW 4.347 06/15/41	25,000.000	26,450.750
社債券	HOLNVX 6 12/30/19	30,000.000	34,276.500
社債券	HSBC 5.1 04/05/21	35,000.000	38,938.200
社債券	HST 3.75 10/15/23	15,000.000	14,104.950
社債券	HUM 3.15 12/01/22	20,000.000	18,717.400
社債券	HYNMTR 2.875 08/09/18	15,000.000	15,251.550
社債券	IBM 1.25 02/08/18	100,000.000	99,203.000
社債券	IP 4.75 02/15/22	25,000.000	26,580.750
社債券	IPG 3.75 02/15/23	5,000.000	4,735.900
社債券	IPG 4 03/15/22	15,000.000	14,602.050
社債券	IVZ 3.125 11/30/22	10,000.000	9,376.300
社債券	IVZ 4 01/30/24	10,000.000	10,071.000
社債券	JCI 3.75 12/01/21	25,000.000	25,332.250
社債券	JEF 8.5 07/15/19	15,000.000	18,370.950
社債券	JPM 2 08/15/17	65,000.000	65,924.950
社債券	JPM 3.375 05/01/23	20,000.000	18,645.000
社債券	JPM 3.4 06/24/15	25,000.000	25,997.000
社債券	JPM 4.5 01/24/22	35,000.000	37,254.700
社債券	JPM 6 01/15/18	10,000.000	11,617.400
社債券	KEY 5.1 03/24/21	10,000.000	11,079.900
社債券	KRFT 5 06/04/42	10,000.000	9,828.600
社債券	KSU 3 05/15/23	10,000.000	9,336.600
社債券	KSU 4.3 05/15/43	15,000.000	13,295.250
社債券	KTZKZ 6.95 07/10/42	200,000.000	201,670.000
社債券	LIBMUT 4.25 06/15/23	10,000.000	9,888.800

社債券	LIFE 4.4 03/01/15	10,000.000	10,415.900
社債券	LIFE 6 03/01/20	25,000.000	28,488.500
社債券	LUV 5.125 03/01/17	25,000.000	27,528.250
社債券	LYB 4 07/15/23	10,000.000	9,949.500
社債券	MCD 2.625 01/15/22	25,000.000	24,056.750
社債券	MHK 3.85 02/01/23	5,000.000	4,804.650
社債券	MMP 4.25 02/01/21	5,000.000	5,225.700
社債券	MO 4.75 05/05/21	25,000.000	26,758.000
社債券	MO 9.25 08/06/19	20,000.000	26,579.200
社債券	MS 2.125 04/25/18	135,000.000	134,657.100
社債券	MS 3.75 02/25/23	65,000.000	63,831.950
社債券	MTVD 6.85 01/15/40	15,000.000	18,780.000
社債券	MUR 4 06/01/22	10,000.000	9,715.700
社債券	NBL 6 03/01/41	10,000.000	11,057.300
社債券	NBR 2.35 09/15/16	5,000.000	5,070.400
社債券	NBR 4.625 09/15/21	10,000.000	10,078.800
社債券	NI 4.8 02/15/44	15,000.000	13,409.850
社債券	NI 5.25 09/15/17	25,000.000	27,858.000
社債券	NI 6.25 12/15/40	20,000.000	21,668.200
社債券	NTRS 3.95 10/30/25	25,000.000	24,874.000
社債券	NVE 6.5 08/01/18	25,000.000	30,084.000
社債券	NVE 7.125 03/15/19	30,000.000	37,228.500
社債券	NVR 3.95 09/15/22	25,000.000	24,213.500
社債券	NWL 2.05 12/01/17	5,000.000	4,995.100
社債券	NWSA 6.15 02/15/41	20,000.000	22,264.000
社債券	OKS 3.2 09/15/18	5,000.000	5,172.650
社債券	OMC 6.25 07/15/19	30,000.000	35,124.000
社債券	ORCL 2.5 10/15/22	25,000.000	23,186.750
社債券	ORCL 5.75 04/15/18	30,000.000	35,066.400
社債券	ORLY 3.85 06/15/23	10,000.000	9,723.800
社債券	ORLY 4.875 01/14/21	25,000.000	26,580.750
社債券	PERTIJ 4.3 05/20/23	335,000.000	291,450.000
社債券	PETBRA 4.375 05/20/23	25,000.000	23,141.750
社債券	PFG 1.85 11/15/17	5,000.000	4,991.300
社債券	PFG 3.3 09/15/22	5,000.000	4,871.350
社債券	PKG 4.5 11/01/23	5,000.000	5,089.150
社債券	PM 4.375 11/15/41	15,000.000	13,776.000
社債券	PNC 3.3 03/08/22	40,000.000	39,360.800
社債券	PNC 4.375 08/11/20	20,000.000	21,569.400
社債券	PPL 3.4 06/01/23	15,000.000	14,118.150
社債券	PPL 3.5 12/01/22	10,000.000	9,548.600
社債券	PPL 3.9 05/01/16	25,000.000	26,259.500
社債券	PRU 5.375 06/21/20	10,000.000	11,374.900
社債券	PSX 4.3 04/01/22	10,000.000	10,301.900
社債券	PX 2.45 02/15/22	25,000.000	23,472.500
社債券	PXD 3.95 07/15/22	15,000.000	15,264.900
社債券	QVCN 4.375 03/15/23	10,000.000	9,536.000
社債券	RAI 3.25 11/01/22	30,000.000	28,034.700
社債券	RDC 4.875 06/01/22	25,000.000	25,689.250
社債券	RENAUL 3.5 04/03/18	10,000.000	10,329.100
社債券	RENAUL 4.6 04/12/16	25,000.000	26,557.500
社債券	RGA 5 06/01/21	25,000.000	26,773.250
社債券	RIG 2.5 10/15/17	5,000.000	5,069.700
社債券	RIG 5.05 12/15/16	10,000.000	11,030.200
社債券	RSG 3.55 06/01/22	10,000.000	9,781.200
社債券	RSG 5.7 05/15/41	25,000.000	27,068.750
社債券	SBAC 2.933 12/15/17	25,000.000	25,829.250
社債券	SBAC 3.598 04/15/18	25,000.000	24,691.750
社債券	SESGFP 3.6 04/04/23	5,000.000	4,871.450
社債券	SO 4.75 09/01/40	25,000.000	24,207.750
社債券	SRE 3.75 09/15/42	25,000.000	22,192.250
社債券	STI 2.35 11/01/18	25,000.000	25,100.500
社債券	STI 3.6 04/15/16	10,000.000	10,596.800
社債券	STT 3.1 05/15/23	15,000.000	14,075.250
社債券	SWX 3.875 04/01/22	5,000.000	5,130.200
社債券	T 5.55 08/15/41	35,000.000	34,777.400
社債券	TD 2.375 10/19/16	40,000.000	41,674.800

	社債券	TE 5.15 03/15/20	20,000.000	22,149.200	
	社債券	TITIM 5.25 10/01/15	5,000.000	5,255.900	
	社債券	TLMCN 3.75 02/01/21	5,000.000	4,833.150	
	社債券	TOL 4.375 04/15/23	15,000.000	13,950.000	
	社債券	TRICN 4.3 11/23/23	30,000.000	30,097.800	
	社債券	TSN 4.5 06/15/22	20,000.000	20,441.400	
	社債券	TUP 4.75 06/01/21	20,000.000	20,491.000	
	社債券	TWX 6.875 06/15/18	15,000.000	18,091.950	
	社債券	UAL 4.15 04/11/24	24,384.770	24,354.280	
	社債券	UNH 1.4 10/15/17	5,000.000	5,000.850	
	社債券	UNH 4.625 11/15/41	15,000.000	14,386.950	
	社債券	UNM 5.625 09/15/20	30,000.000	33,597.900	
	社債券	UNM 5.75 08/15/42	10,000.000	10,484.900	
	社債券	UNP 4.163 07/15/22	25,000.000	26,246.750	
	社債券	USB 2.95 07/15/22	10,000.000	9,453.600	
	社債券	USB 3.442 02/01/16	20,000.000	20,921.800	
	社債券	UTX 4.5 06/01/42	25,000.000	24,353.750	
	社債券	VALEBZ 4.375 01/11/22	25,000.000	24,450.250	
	社債券	VLO 6.125 06/15/17	30,000.000	34,411.500	
	社債券	VMI 6.625 04/20/20	10,000.000	11,409.000	
	社債券	VOYA 2.9 02/15/18	15,000.000	15,394.050	
	社債券	VRSK 5.8 05/01/21	15,000.000	16,516.950	
	社債券	VTR 3.25 08/15/22	15,000.000	14,214.600	
	社債券	VZ 4.5 09/15/20	35,000.000	37,723.350	
	社債券	VZ 6.4 09/15/33	80,000.000	89,813.600	
	社債券	VZW 8.5 11/15/18	10,000.000	12,862.300	
	社債券	WES 4 07/01/22	25,000.000	24,546.250	
	社債券	WESAU 2.983 05/18/16	15,000.000	15,687.000	
	社債券	WFC 3.5 03/08/22	25,000.000	25,226.750	
	社債券	WFC 4.6 04/01/21	70,000.000	77,086.800	
	社債券	WHR 3.7 03/01/23	5,000.000	4,864.300	
	社債券	WMB 3.7 01/15/23	10,000.000	9,134.700	
	社債券	WPPLN 4.75 11/21/21	25,000.000	25,868.750	
	社債券	WPZ 4.125 11/15/20	15,000.000	15,432.600	
	社債券	XRX 5.2 06/01/15	15,000.000	15,867.600	
	小計(アメリカ・ドル) 232銘柄		14,567,949.770	15,263,860.040 (1,524,554,341)	
カナダ・ドル	国債証券	CAN 2.75 06/01/22	138,000.000	141,414.120	
	国債証券	CAN 3.75 06/01/19	157,000.000	172,196.030	
	国債証券	CAN 4 06/01/17	201,000.000	218,880.960	
	国債証券	CAN 4 06/01/41	44,000.000	51,396.400	
	国債証券	CAN 4.5 06/01/15	400,000.000	420,940.000	
	国債証券	CAN 5 06/01/37	142,000.000	188,044.920	
	国債証券	CAN 5.75 06/01/29	68,000.000	92,358.280	
	小計(カナダ・ドル) 7銘柄		1,150,000.000	1,285,230.710 (123,099,397)	
オーストラリア・ドル	地方債証券	NSWTC 6 03/01/22	338,000.000	371,752.680	
	特殊債券	KFW 6 08/20/20	210,000.000	228,679.500	
	小計(オーストラリア・ドル) 2銘柄		548,000.000	600,432.180 (56,218,465)	
シンガポール・ドル	国債証券	SIGB 3.125 09/01/22	167,000.000	179,977.570	
	小計(シンガポール・ドル) 1銘柄		167,000.000	179,977.570 (14,425,202)	
イギリス・ポンド	国債証券	UKT 1.25 07/22/18	1,681,000.000	1,663,685.700	
	国債証券	UKT 2.25 09/07/23	279,000.000	267,784.200	
	国債証券	UKT 3.75 09/07/21	365,000.000	403,033.000	
	国債証券	UKT 4 09/07/16	61,000.000	66,569.300	
	国債証券	UKT 4.25 06/07/32	233,000.000	262,591.000	
	国債証券	UKT 4.25 09/07/39	384,000.000	434,649.600	
	国債証券	UKT 4.5 03/07/19	353,000.000	404,079.100	
	国債証券	UKT 4.5 12/07/42	331,000.000	392,201.900	
	国債証券	UKT 4.75 09/07/15	287,000.000	309,185.100	
	国債証券	UKT 5 03/07/18	39,000.000	45,056.700	
	小計(イギリス・ポンド) 10銘柄		4,013,000.000	4,248,835.600 (683,807,601)	
イスラエル・シケル	国債証券	ILGOV 4.25 03/31/23	659,000.000	695,034.120	
	小計(イスラエル・シケル) 1銘柄		659,000.000	695,034.120 (19,725,068)	

デンマーク・クローネ	国債証券	DGB 3 11/15/21	2,340,000.000	2,609,334.000
	小計(デンマーク・クローネ) 1銘柄		2,340,000.000	2,609,334.000 (47,202,852)
スウェーデン・クローナ	国債証券	SGB 1.5 11/13/23	5,695,000.000	5,339,347.250
	国債証券	SGB 3.5 06/01/22	720,000.000	798,336.000
	国債証券	SGB 3.75 08/12/17	1,330,000.000	1,449,899.500
	小計(スウェーデン・クローナ) 3銘柄		7,745,000.000	7,587,582.750 (114,648,375)
メキシコ・ペソ	国債証券	MBONO 6.5 06/09/22	255,000.000	263,193.150
	国債証券	MBONO 6.5 06/10/21	2,082,000.000	2,184,226.200
	国債証券	MBONO 7.5 06/03/27	1,553,000.000	1,671,959.800
	国債証券	MBONO 8.5 11/18/38	3,539,000.000	3,919,265.540
	国債証券	MUDI 2.5 12/10/20	282,000.000	1,442,693.520
	小計(メキシコ・ペソ) 5銘柄		7,711,000.000	9,481,338.210 (73,575,185)
韓国・ウォン	国債証券	KORMSB 3.59 04/02/14	395,800,000.000	397,284,250.000
	小計(韓国・ウォン) 1銘柄		395,800,000.000	397,284,250.000 (37,662,547)
ロシア・ルーブル	国債証券	RFLB 7 01/25/23	3,862,000.000	3,754,945.360
	国債証券	RFLB 7.6 04/14/21	3,472,000.000	3,553,626.720
	国債証券	RFLB 7.6 07/20/22	4,045,000.000	4,116,272.900
	小計(ロシア・ルーブル) 3銘柄		11,379,000.000	11,424,844.980 (35,074,274)
マレーシア・リングギット	国債証券	MGS 4.16 07/15/21	567,000.000	574,331.310
	国債証券	MGTB 0 01/17/14	230,000.000	228,870.700
	小計(マレーシア・リングギット) 2銘柄		797,000.000	803,202.010 (25,156,287)
南アフリカ・ランド	国債証券	SAGB 6.75 03/31/21	2,751,000.000	2,635,650.570
	国債証券	SAGB 7.75 02/28/23	255,000.000	254,905.650
	小計(南アフリカ・ランド) 2銘柄		3,006,000.000	2,890,556.220 (28,443,073)
ポーランド・ズロチ	国債証券	POLGB 4.75 04/25/17	236,000.000	247,401.160
	国債証券	POLGB 5.5 04/25/15	512,000.000	531,604.480
	国債証券	POLGB 5.5 10/25/19	209,000.000	227,197.630
	国債証券	POLGB 5.75 09/23/22	236,000.000	261,020.720
	小計(ポーランド・ズロチ) 4銘柄		1,193,000.000	1,267,223.990 (40,918,663)
ユーロ	国債証券	BGB 2.75 03/28/16	224,000.000	236,911.360
	国債証券	BGB 3.25 09/28/16	182,000.000	196,640.080
	国債証券	BGB 3.75 09/28/15	111,000.000	118,379.280
	国債証券	BGB 4 03/28/18	253,000.000	286,479.490
	国債証券	BGB 4 03/28/22	175,000.000	200,532.500
	国債証券	BGB 5 03/28/35	177,000.000	223,140.360
	国債証券	BTPS 3.5 11/01/17	193,000.000	202,105.740
	国債証券	BTPS 3.75 03/01/21	367,000.000	377,386.100
	国債証券	BTPS 4.5 02/01/18	531,000.000	577,090.800
	国債証券	BTPS 4.5 07/15/15	650,000.000	685,847.500
	国債証券	BTPS 4.5 08/01/18	694,000.000	756,043.600
	国債証券	BTPS 5 09/01/40	357,000.000	364,925.400
	国債証券	BTPS 5.25 08/01/17	174,000.000	192,931.200
	国債証券	BTPS 5.5 09/01/22	415,000.000	468,182.250
	国債証券	BTPS 5.75 02/01/33	87,000.000	98,919.000
	国債証券	BTPS 6 05/01/31	494,000.000	574,917.200
	国債証券	CZECH 3.875 05/24/22	285,000.000	319,770.000
	国債証券	DBR 2.5 07/04/44	416,000.000	403,832.000
	国債証券	DBR 3.25 07/04/15	449,000.000	472,002.270
	国債証券	DBR 4 01/04/37	247,000.000	306,304.700
	国債証券	DBR 4.25 07/04/18	39,000.000	45,658.470
	国債証券	FRANCEOAT 5.5 04/25/29	139,000.000	184,986.760
	国債証券	FRTR 3.75 04/25/21	481,000.000	552,798.870
	国債証券	FRTR 4 10/25/38	214,000.000	242,350.720
	国債証券	FRTR 4.25 10/25/18	1,329,000.000	1,540,789.440
	国債証券	FRTR 5.75 10/25/32	176,000.000	245,618.560
	国債証券	IRISH 4.5 04/18/20	123,000.000	133,147.500
	国債証券	IRISH 5 10/18/20	157,000.000	174,654.650
	国債証券	IRISH 5.5 10/18/17	174,000.000	197,385.600
	国債証券	NETHER 1.75 07/15/23	135,000.000	131,800.500
国債証券	NETHER 3.75 01/15/42	73,000.000	87,019.650	

国債証券	NETHER 5.5 01/15/28	283,000.000	385,049.800	
国債証券	OBL 2 02/26/16	209,000.000	217,997.450	
国債証券	RAGB 3.15 06/20/44	221,000.000	232,852.230	
国債証券	RFGB 3.875 09/15/17	175,000.000	196,787.500	
国債証券	ROMANI 4.625 09/18/20	180,000.000	186,372.000	
国債証券	SLOVEN 4 03/22/18	93,000.000	92,860.500	
国債証券	SPGB 4.25 10/31/16	303,000.000	323,204.040	
国債証券	SPGB 4.4 01/31/15	671,000.000	700,926.600	
国債証券	SPGB 4.6 07/30/19	297,000.000	324,220.050	
国債証券	SPGB 4.65 07/30/25	85,000.000	87,728.500	
国債証券	SPGB 5.85 01/31/22	66,000.000	75,628.080	
国債証券	SPGB 6 01/31/29	224,000.000	257,591.040	
特殊債券	GAZPRU 6.605 02/13/18	50,000.000	57,127.500	
社債券	ABIBB 2 12/16/19	16,000.000	16,341.600	
社債券	ABNAV 4.125 03/28/22	50,000.000	56,573.500	
社債券	BAA 4.6 02/15/18	50,000.000	56,337.500	
社債券	BACR 4 10/07/19	100,000.000	115,235.000	
社債券	BNP 2.875 10/24/22	10,000.000	10,196.000	
社債券	C 5 08/02/19	40,000.000	46,572.000	
社債券	C FL 02/10/19	5,000.000	4,981.000	
社債券	CAFP 4 04/09/20	50,000.000	55,175.000	
社債券	DAIGR 4.125 01/19/17	30,000.000	32,911.500	
社債券	DNBNO 1.125 11/12/18	100,000.000	100,035.000	
社債券	GE 2.875 06/18/19	50,000.000	52,930.500	
社債券	GS 6.375 05/02/18	25,000.000	29,980.000	
社債券	HSBC 6 06/10/19	50,000.000	58,987.500	
社債券	ISPIM 4.125 04/14/20	50,000.000	52,794.000	
社債券	JPM FL 11/12/19	50,000.000	51,005.000	
社債券	KPN 4.75 01/17/17	50,000.000	55,126.500	
社債券	LLOYDS 6.5 03/24/20	50,000.000	57,852.500	
社債券	PEMEX 6.375 08/05/16	30,000.000	33,923.100	
社債券	PFGB 4.5 01/26/17	50,000.000	54,682.500	
社債券	RABOBK 4.25 01/16/17	30,000.000	32,997.000	
社債券	RENAUL 4.25 04/27/17	20,000.000	21,793.000	
社債券	REPSM 4.75 02/16/17	50,000.000	54,872.500	
社債券	SANTAN 3.5 03/10/15	50,000.000	51,654.500	
社債券	TELEFO 3.661 09/18/17	50,000.000	53,141.000	
社債券	TOYOTA 2.375 02/01/23	15,000.000	15,125.250	
社債券	VALEBZ 4.375 03/24/18	50,000.000	54,937.500	
社債券	VOTORA 5.25 04/28/17	50,000.000	54,025.000	
社債券	ZURNVX FL 07/24/39	50,000.000	60,807.500	
小計(ユーロ)72銘柄		13,599,000.000	15,077,889.790 (2,034,158,112)	
合計			4,858,669,442 (4,858,669,442)	

- (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. 合計欄は邦貨金額を表示しております。()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、内数で表示してあります。
 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	国債証券 11銘柄	30.35%	31.38%
	特殊債券 3銘柄		
	社債券 218銘柄		
カナダ・ドル	国債証券 7銘柄	2.45%	2.53%
オーストラリア・ドル	地方債証券 1銘柄	1.12%	1.16%
	特殊債券 1銘柄		
シンガポール・ドル	国債証券 1銘柄	0.29%	0.30%
イギリス・ポンド	国債証券 10銘柄	13.61%	14.07%
イスラエル・シケル	国債証券 1銘柄	0.39%	0.41%
デンマーク・クローネ	国債証券 1銘柄	0.94%	0.97%
スウェーデン・クローナ	国債証券 3銘柄	2.28%	2.36%
メキシコ・ペソ	国債証券 5銘柄	1.46%	1.51%
韓国・ウォン	国債証券 1銘柄	0.75%	0.77%
ロシア・ルーブル	国債証券 3銘柄	0.70%	0.72%
マレーシア・リングgit	国債証券 2銘柄	0.50%	0.52%
南アフリカ・ランド	国債証券 2銘柄	0.57%	0.59%
ポーランド・ズロチ	国債証券 4銘柄	0.81%	0.84%
ユーロ	国債証券 43銘柄	40.49%	41.87%
	特殊債券 1銘柄		
	社債券 28銘柄		

組入有価証券時価比率とは、純資産額に対する比率であります。

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)に記載しており、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25年12月末現在)

大和住銀DC年金設計ファンド30

資産総額	2,718,587,696 円
負債総額	3,980,307 円
純資産総額 (-)	2,714,607,389 円
発行済数量	1,968,370,655 口
1単位当り純資産額 (/)	1.3791 円

大和住銀DC年金設計ファンド50

資産総額	5,197,334,478 円
負債総額	10,532,787 円
純資産総額 (-)	5,186,801,691 円
発行済数量	3,291,459,278 口
1単位当り純資産額 (/)	1.5758 円

大和住銀DC年金設計ファンド70

資産総額	4,575,350,427 円
負債総額	9,257,501 円
純資産総額 (-)	4,566,092,926 円
発行済数量	2,471,386,415 口
1単位当り純資産額 (/)	1.8476 円

<参考：マザーファンドの純資産額計算書>

(平成25年12月末現在)

年金日本株式マザーファンド

資産総額	89,545,000,037 円
------	------------------

負債総額	2,411,251,127 円
純資産総額（ - ）	87,133,748,910 円
発行済数量	54,402,423,448 口
1単位当り純資産額（ / ）	1.6017 円

年金日本債券マザーファンド

資産総額	14,492,223,723 円
負債総額	106,216,447 円
純資産総額（ - ）	14,386,007,276 円
発行済数量	12,846,399,868 口
1単位当り純資産額（ / ）	1.1198 円

インターナショナル株式マザーファンド

資産総額	50,844,543,438 円
負債総額	76,026,187 円
純資産総額（ - ）	50,768,517,251 円
発行済数量	21,805,203,619 口
1単位当り純資産額（ / ）	2.3283 円

インターナショナル債券マザーファンド

資産総額	5,257,600,163 円
負債総額	90,493,276 円
純資産総額（ - ）	5,167,106,887 円
発行済数量	2,262,677,745 口

1 単位当り純資産額（ / ）	2.2836 円
-----------------	----------

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

1 名義書換手続など

該当事項はありません。

2 受益者名簿
作成しません。

3 受益者集会
開催しません。

4 受益者に対する特典
ありません。

5 受益権の譲渡
受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

6 受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

7 受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

8 償還金
償還金は、償還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（償還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、当該償還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）に支払います。

9 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

（注）委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在し

ない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

資本金の額：20億円（平成25年12月末現在）

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。

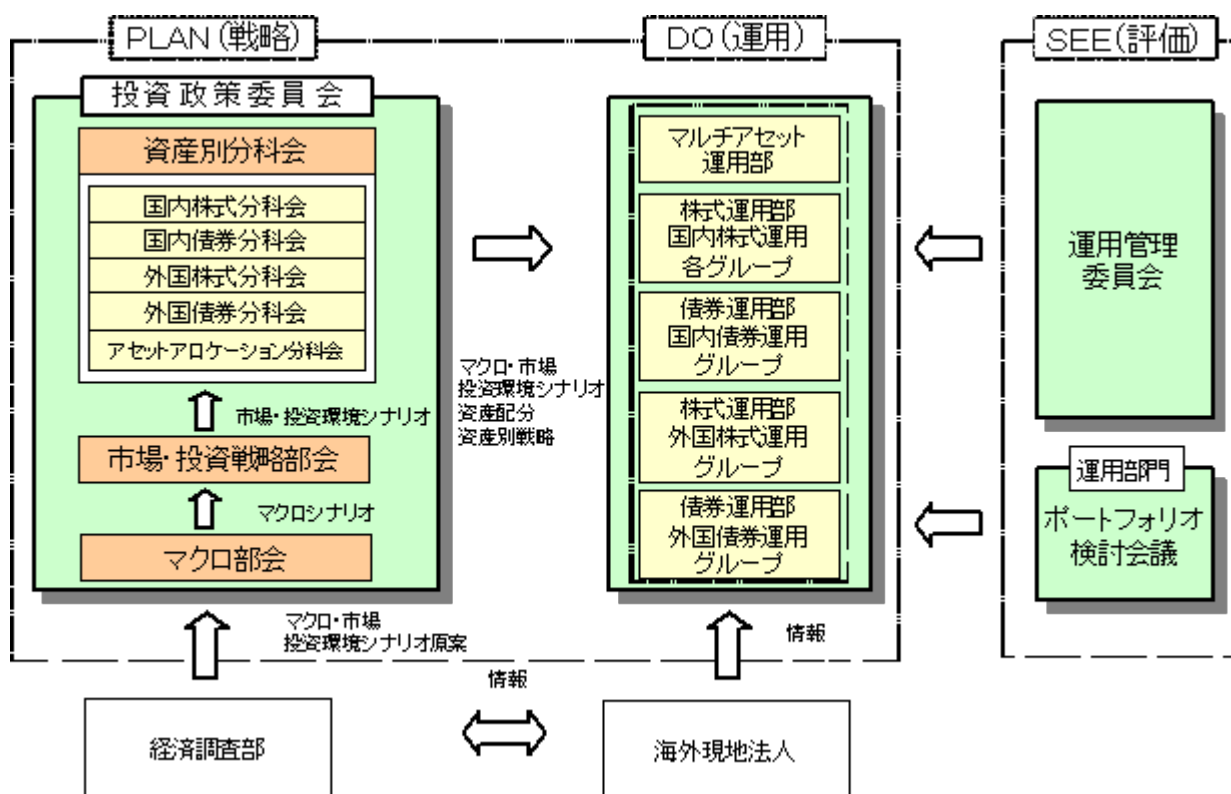
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち、最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。補欠として選任された取締役の任期は、前任取締役の任期の満了する時までとします。

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25年12月末現在、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、182本であり、その純資産総額は、約2,736,082百万円です（なお、親投資信託56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	7	139,029百万円
追加型株式投資信託	174	2,594,516百万円
単位型公社債投資信託	1	2,536百万円
合計	182	2,736,082百万円

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。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号。）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41期事業年度（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表及び、第42期中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第40期 (平成24年3月31日)	第41期 (平成25年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	15,886,867	17,579,316
前払費用	176,593	156,563
未収委託者報酬	2,348,724	2,378,328
未収運用受託報酬	830,844	799,736
未収収益	24,384	21,990
繰延税金資産	485,508	473,110
その他	5,956	3,144
流動資産計	19,758,878	21,412,190
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 225,511	183,873
器具備品	1 60,686	87,233
土地	710	710
リース資産	1 7,309	8,895
有形固定資産計	294,217	280,711
無形固定資産		
ソフトウェア	389,329	261,979
電話加入権	12,706	12,706
無形固定資産計	402,036	274,685
投資その他の資産		
投資有価証券	4,950,199	5,125,836
関係会社株式	1,169,774	1,169,774
従業員長期貸付金	2,534	1,904
長期差入保証金	741,014	509,430
出資金	157,660	132,660
繰延税金資産	543,639	548,043
その他	2,403	1,716
貸倒引当金	70,650	70,650
投資その他の資産計	7,496,574	7,418,714
固定資産計	8,192,828	7,974,112
資産合計	27,951,706	29,386,302

(単位：千円)

	第40期 (平成24年3月31日)	第41期 (平成25年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	2,841	3,396
未払金	222,814	165,892
未払手数料	1,094,446	1,113,859
未払費用	1,010,635	1,127,749
未払法人税等	1,570,446	939,336
賞与引当金	874,000	880,000
役員賞与引当金	79,100	73,000
その他	18,977	20,203
流動負債計	4,873,261	4,323,437
固定負債		
リース債務	4,833	5,944
退職給付引当金	1,139,061	1,268,146
役員退職慰労引当金	144,730	148,470
固定負債計	1,288,624	1,422,561
負債合計	6,161,886	5,745,998

(単位：千円)

	第40期 (平成24年3月31日)	第41期 (平成25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	18,204,076	19,981,120

利益剰余金合計	19,647,807	21,424,851
株主資本合計	21,804,076	23,581,120
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	14,256	59,183
評価・換算差額等合計	14,256	59,183
純資産合計	21,789,820	23,640,304
負債純資産合計	27,951,706	29,386,302

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第40期		第41期	
	（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）		（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）	
営業収益				
運用受託報酬		3,091,311		2,960,778
委託者報酬		27,285,403		27,854,931
その他営業収益		131,340		90,710
営業収益計		30,508,054		30,906,420
営業費用				
支払手数料		12,829,874		13,056,993
広告宣伝費		131,967		175,532
公告費		2,247		1,059
調査費				
調査費		1,103,744		1,114,992
委託調査費		3,541,508		4,000,398
委託計算費		122,453		131,444
営業雑経費				
通信費		29,616		31,982
印刷費		350,466		404,102
協会費		23,131		27,397
諸会費		3,166		4,830
その他		29,989		30,634
営業費用計		18,168,165		18,979,368
一般管理費				
給料				
役員報酬		197,010		201,630
給料・手当		2,831,165		2,883,776
賞与		44,371		55,582
退職金		844		4,450
福利厚生費		544,128		559,967
交際費		19,828		22,159
旅費交通費		151,573		146,403
租税公課		74,062		72,111
不動産賃借料		841,453		726,878
退職給付費用		206,629		213,305
固定資産減価償却費		96,356		79,314
賞与引当金繰入額		874,000		873,819

役員退職慰労引当金繰入額	38,080	38,530
役員賞与引当金繰入額	79,100	67,700
諸経費	255,488	255,296
一般管理費計	6,254,092	6,200,926
営業利益	6,085,796	5,726,125
営業外収益		
受取配当金	149,045	25,045
受取利息	3,732	3,232
投資有価証券売却益	-	33,455
為替差益	-	2,945
その他	11,769	11,668
営業外収益計	164,547	76,346
営業外費用		
投資有価証券売却損	4,016	-
為替差損	2,424	-
その他	957	55
営業外費用計	7,398	55
経常利益	6,242,945	5,802,417
特別利益		
投資有価証券売却益	-	42,767
特別利益計	-	42,767
特別損失		
投資有価証券評価損	50,687	-
投資有価証券売却損	1	111,382
その他	5,375	4,583
特別損失計	56,063	115,965
税引前当期純利益	6,186,881	5,729,219
法人税、住民税及び事業税	2,653,180	2,213,779
法人税等調整額	4,043	32,604
法人税等合計	2,657,223	2,181,175
当期純利益	3,529,657	3,548,044

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第40期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第41期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	1,100,000	1,100,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	1,100,000	1,100,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	16,098,918	18,204,076
当期変動額		
剰余金の配当	1,424,500	1,771,000
当期純利益	3,529,657	3,548,044

当期変動額合計	2,105,157	1,777,044
当期末残高	18,204,076	19,981,120
利益剰余金合計		
当期首残高	17,542,649	19,647,807
当期変動額		
剰余金の配当	1,424,500	1,771,000
当期純利益	3,529,657	3,548,044
当期変動額合計	2,105,157	1,777,044
当期末残高	19,647,807	21,424,851
株主資本合計		
当期首残高	19,698,918	21,804,076
当期変動額		
剰余金の配当	1,424,500	1,771,000
当期純利益	3,529,657	3,548,044
当期変動額合計	2,105,157	1,777,044
当期末残高	21,804,076	23,581,120
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	35,129	14,256
当期変動額		
株主資本以外の項目	20,873	73,440
の当期変動額（純額）		
当期変動額合計	20,873	73,440
当期末残高	14,256	59,183
評価・換算差額等合計		
当期首残高	35,129	14,256
当期変動額		
株主資本以外の項目	20,873	73,440
の当期変動額（純額）		
当期変動額合計	20,873	73,440
当期末残高	14,256	59,183
純資産合計		
当期首残高	19,663,789	21,789,820
当期変動額		
剰余金の配当	1,424,500	1,771,000
当期純利益	3,529,657	3,548,044

株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	20,873	73,440
当期変動額合計	2,126,030	1,850,484
当期末残高	21,789,820	23,640,304

[次へ](#)

重要な会計方針

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(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。</p> <p>(2) その他有価証券</p> <p>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。</p> <p>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。</p>				
<p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産（リース資産を除く） 定率法を採用しております。但し、平成10年4月以降に取得した建物（建物附属設備は除く）については、定額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。</p> <table><tr><td>建物</td><td>15～30年</td></tr><tr><td>器具備品</td><td>4～15年</td></tr></table> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 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。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>	建物	15～30年	器具備品	4～15年
建物	15～30年			
器具備品	4～15年			
<p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>				
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> <p>(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。</p>				

会計方針の変更等

（会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却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、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益がそれぞれ2,523千円増加しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

第40期 （平成24年3月31日）		第41期 （平成25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	315,276千円	建物	354,743千円
器具備品	273,481千円	器具備品	307,425千円
リース資産	3,712千円	リース資産	7,382千円
2.保証債務		2.保証債務	
被保証者	従業員	被保証者	従業員
被保証債務の内容	住宅ローン	被保証債務の内容	住宅ローン
金額	19,359千円	金額	15,346千円

（損益計算書関係）

関係会社に対するものは、次のとおりであります。

	第40期 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	第41期 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
1.投資有価証券売却損	- 千円	111,382千円

（株主資本等変動計算書関係）

第40期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1.発行済株式に関する事項

（単位：千株）

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

2.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23年6月30日 定時株主総会	普通株式	1,424,500	370	平成23年3月31日	平成23年6月30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24年6月29日 定時株主総会	普通 株式	1,771,000	利益 剰余金	460	平成24年3月31日	平成24年6月29日

第41期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1.発行済株式に関する事項

（単位：千株）

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	-	-	3,850
合 計	3,850	-	-	3,850

2. 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24年6月29日 定時株主総会	普通株式	1,771,000	460	平成24年3月31日	平成24年6月29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

平成25年6月24日開催の第41回定時株主総会において、次のとおり付議致します。

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25年6月24日 定時株主総会	普通 株式	3,545,850	利益 剰余金	921	平成25年3月31日	平成25年6月25日

(リース取引関係)

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期末残高相当額

(単位：千円)

	第40期(平成24年3月31日)		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	4,823	3,939	884
合計	4,823	3,939	884

(単位：千円)

	第41期(平成25年3月31日)		
	取得価額相当額	減価償却累計額相当額	期末残高相当額
器具備品	4,823	4,823	-
合計	4,823	4,823	-

(2) 未経過リース料期末残高相当額

(単位：千円)

	第40期(平成24年3月31日)	第41期(平成25年3月31日)
1年内	961	-
1年超	-	-
合計	961	-

(3) 支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額

(単位：千円)

	第40期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第41期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
支払リース料	1,070	981
減価償却費相当額	964	884
支払利息相当額	62	20

(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。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用事業を行っております。余裕資金は安全で流動性の高い金融資産で運用し、銀行からの借入や社債の発行はありません。

安全性の高い金融商品での短期的な運用の他に、自社ファンドの設定に自己資本を投入しております。

その自己設定投信は、事業推進目的で保有しており、設定、解約又は償還に関しては、社内規定に従っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

主たる営業債権は、投資運用業等より発生する未収委託者報酬、未収運用受託報酬であります。

これらの債権は、全て1年以内の債権であり、そのほとんどが信託財産の中から支払われるため、回

収不能となるリスクは極めて軽微であります。

投資有価証券は、その大半が事業推進目的で設定した投資信託であり、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。

未払手数料は、投資信託の販売に係る支払手数料であります。また、未払費用は、投資信託の運用に係る再委託手数料であります。

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、社内規定に従って取引先を選定し、担当部門で取引先の状況を定期的にモニタリングし、財務状況等の悪化等による回収懸念の早期把握や軽減を図っております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

当社は、投資有価証券の一部を除いて、資金決済のほとんどを自国通貨で行っているため、為替の変動リスクは極めて限定的であります。

投資有価証券のうち自己設定投信については、その残高及び損益状況等を定期的に経営会議に報告しております。

また、デリバティブ取引についても行っておりません。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、適時に資金繰計画を作成・更新するとともに、社内規定に従って手元流動性を維持することにより、流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表に含めておりません（注2）を参照ください）。

第40期（平成24年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	15,886,867	15,886,867	-
(2) 未収委託者報酬	2,348,724	2,348,724	-
(3) 未収運用受託報酬	830,844	830,844	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	4,711,863	4,711,863	-
資産計	23,778,298	23,778,298	-
(1) 未払手数料	1,094,446	1,094,446	-
(2) 未払費用（*1）	823,266	823,266	-
負債計	1,917,712	1,917,712	-

（*1）金融商品に該当するものを表示しております。

第41期（平成25年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	17,579,316	17,579,316	-
(2) 未収委託者報酬	2,378,328	2,378,328	-
(3) 未収運用受託報酬	799,736	799,736	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	5,074,700	5,074,700	-
資産計	25,832,081	25,832,081	-
(1) 未払手数料	1,113,859	1,113,859	-
(2) 未払費用（*1）	853,268	853,268	-
負債計	1,967,127	1,967,127	-

（*1）金融商品に該当するものを表示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

（1）現金・預金、（2）未収委託者報酬、及び（3）未収運用受託報酬

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

（4）投資有価証券

投資信託であり、公表されている基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

負債

（1）未払手数料、及び（2）未払費用

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	第40期（平成24年3月31日）	第41期（平成25年3月31日）
(1) その他有価証券 非上場株式	238,335	51,135
(2) 子会社株式 非上場株式	1,169,774	1,169,774
(3) 長期差入保証金	741,014	509,430

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象としておりません。このため、（1）その他有価証券の非上場株式については
2.（4）投資有価証券には含めておりません。

（注3）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第40期（平成24年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	15,886,867	-	-	-
未収委託者報酬	2,348,724	-	-	-
未収運用受託報酬	830,844	-	-	-
投資有価証券				
その他有価証券	-	1,067,561	4,004	-
合計	19,066,435	1,067,561	4,004	-

第41期（平成25年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超

現金・預金	17,579,316	-	-	-
未収委託者報酬	2,378,328	-	-	-
未収運用受託報酬	799,736	-	-	-
投資有価証券				
その他有価証券	-	1,106,722	4,006	-
合計	20,757,380	1,106,722	4,006	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

第40期（平成24年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 1,169,774千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

第41期（平成25年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 1,169,774千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

第40期（平成24年3月31日）

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
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	3,256,023	3,234,000	22,023
小計	3,256,023	3,234,000	22,023
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	1,455,840	1,500,000	44,160
小計	1,455,840	1,500,000	44,160
合計	4,711,863	4,734,000	22,136

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 238,335千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

なお、非上場株式のうち一部を当期において減損処理を行い、投資有価証券評価損50,687千円を計上しております。

第41期（平成25年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
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	3,683,580	3,582,800	100,780
小計	3,683,580	3,582,800	100,780
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	1,391,120	1,400,000	8,880
小計	1,391,120	1,400,000	8,880
合計	5,074,700	4,982,800	91,900

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 51,135千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第40期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	23,383	-	4,016

第41期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	953,041	76,223	111,382

（デリバティブ取引関係）

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。

（退職給付関係）

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

（単位：千円）

区分	第40期（平成24年3月31日）	第41期（平成25年3月31日）
退職給付引当金	1,139,061	1,268,146

（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

(単位：千円)

区分	第40期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第41期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
勤務費用	151,221	156,423
確定拠出年金掛金	55,408	56,882
合計	206,629	213,305

(注) 退職給付費用の算定にあたり簡便法を採用しております。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

	第40期 (平成24年3月31日)	第41期 (平成25年3月31日)
繰延税金資産		
(1) 流動資産		
未払事業税	111,121	78,096
賞与引当金	332,120	334,400
社会保険料	29,079	33,579
未払事業所税	5,098	5,144
その他	8,088	21,890
繰延税金資産合計	485,508	473,110
(2) 固定資産		
退職給付引当金	408,872	454,741
投資有価証券	53,733	2,469
ゴルフ会員権	32,333	32,333
役員退職慰労引当金	54,186	55,431
その他有価証券評価差額金	7,880	-
その他	72,699	70,587
繰延税金資産小計	629,709	615,562
評価性引当額	86,067	34,803
繰延税金資産合計	543,639	580,759
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	32,716
繰延税金負債合計	-	32,716
繰延税金資産の純額	1,029,147	1,021,153

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差異の原因となった主な項目別の内訳

	第40期 (平成24年3月31日)	第41期 (平成25年3月31日)
法定実効税率	40.6%	-
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.7 "	-
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	1.0 "	-
過年度法人税等	0.8 "	-
評価性引当額	0.3 "	-
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.6 "	-
その他	0.1 "	-
税効果会計適用後の法人税等の負担率	42.9%	-

(注) 第41期は、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の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

(セグメント情報等)

セグメント情報

1. 報告セグメントの概要

当社は、「投資・金融サービス業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

第40期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	27,285,403	3,091,311	131,340	30,508,054

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

第41期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	27,854,931	2,960,778	90,710	30,906,420

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者との取引)

第40期（自 平成23年4月1日 至 平成24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	関連当事者 との関係		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	3,883,039	未払 手数料	448,037
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	17,709	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	2,570,671	未払 手数料	193,755

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 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。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

第41期（自平成24年4月1日 至平成25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	関連当事者 との関係		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	5,028,224	未払 手数料	536,727
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	17,709	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	2,621,684	未払 手数料	250,310

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 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。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

(1株当たり情報)

	第40期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第41期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	5,659円69銭	6,140円34銭
1株当たり当期純利益金額	916円79銭	921円57銭

(注) 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株当たりの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。

項目	第40期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	第41期 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
当期純利益(千円)	3,529,657	3,548,044
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)	3,529,657	3,548,044
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)

該当事項はありません。

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

		当中間会計期間 (平成25年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		15,184,871
前払費用		156,053
未収委託者報酬		2,376,045
未収運用受託報酬		1,194,081
未収収益		18,869
繰延税金資産		319,417
流動資産計		19,249,338
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	176,927
器具備品	1	81,959
土地		710
リース資産	1	7,017
有形固定資産計		266,615
無形固定資産		
投資その他の資産		
投資有価証券		5,125,445
関係会社株式		1,169,774
従業員長期貸付金		1,589
長期差入保証金		510,623
出資金		132,660
繰延税金資産		562,442
その他		1,373
貸倒引当金		70,650
投資その他の資産計		7,433,257
固定資産計		7,930,602
資産合計		27,179,940

負債の部

流動負債

リース債務		2,738
未払金	2	166,330
未払手数料		1,086,631
未払費用		971,250
未払法人税等		1,011,574
前受収益		68,511
賞与引当金		540,400
役員賞与引当金		41,100
その他		21,630
流動負債計		<u>3,910,166</u>

固定負債

リース債務		4,630
退職給付引当金		1,310,949
役員退職慰労引当金		96,955
固定負債計		<u>1,412,534</u>
負債合計		<u>5,322,700</u>

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		<u>156,268</u>

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		18,226,859
利益剰余金合計		<u>19,670,591</u>

株主資本合計

21,826,859

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		30,380
評価・換算差額等合計		<u>30,380</u>

純資産合計

21,857,240

負債純資産合計

27,179,940

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

		当中間会計期間
		(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		13,966,220
運用受託報酬		1,706,500
その他営業収益		39,685
営業収益計		15,712,406
営業費用		9,605,765
一般管理費	1	3,217,253
営業利益		2,889,387
営業外収益		
受取配当金		28,747
受取利息		1,486
投資有価証券売却益		541
為替差益		1,505
雑収入		1,022
営業外収益計		33,303
営業外費用		
投資有価証券売却損		794
営業外費用計		794
経常利益		2,921,897
税引前中間純利益		2,921,897
法人税、住民税及び事業税		976,425
法人税等調整額		153,881
法人税等合計		1,130,307
中間純利益		1,791,589

(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25年4月1日 至 平成25年9月30日)

株主資本	
資本金	
当期首残高	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	
当期首残高	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	
当期首残高	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	
当期首残高	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	
当期首残高	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	
当期首残高	19,981,120
当中間期変動額	
剰余金の配当	3,545,850
中間純利益	1,791,589
当中間期変動額合計	1,754,260
当中間期末残高	18,226,859
利益剰余金合計	
当期首残高	21,424,851
当中間期変動額	
剰余金の配当	3,545,850

中間純利益	1,791,589
当中間期変動額合計	1,754,260
当中間期末残高	19,670,591
株主資本合計	
当期首残高	23,581,120
当中間期変動額	
剰余金の配当	3,545,850
中間純利益	1,791,589
当中間期変動額合計	1,754,260
当中間期末残高	21,826,859
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	59,183
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期 変動額（純額）	28,803
当中間期変動額合計	28,803
当中間期末残高	30,380
評価・換算差額等合計	
当期首残高	59,183
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期 変動額（純額）	28,803
当中間期変動額合計	28,803
当中間期末残高	30,380
純資産合計	
当期首残高	23,640,304
当中間期変動額	
剰余金の配当	3,545,850
中間純利益	1,791,589
株主資本以外の項目の当中間期 変動額（純額）	28,803
当中間期変動額合計	1,783,064
当中間期末残高	21,857,240

重要な会計方針

	当中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券</p> <p>(1)子会社株式 ...総平均法による原価法</p> <p>(2)その他有価証券</p> <p>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）</p> <p>時価のないもの...総平均法による原価法</p>
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1)有形固定資産（リース資産を除く）</p> <p>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。</p> <p>建物6年～30年、器具備品3年～16年</p> <p>(2)無形固定資産（リース資産を除く）</p> <p>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。</p> <p>(3)所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産</p> <p>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。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(1)貸倒引当金</p> <p>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。</p> <p>(2)賞与引当金</p> <p>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。</p> <p>(3)役員賞与引当金</p> <p>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の負担額を計上しております。</p> <p>(4)退職給付引当金</p> <p>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。</p> <p>(5)役員退職慰労引当金</p> <p>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の要支給額を計上しております。</p>
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	<p>消費税等の会計処理</p> <p>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。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間（平成25年9月30日）	
1.有形固定資産の減価償却累計額	706,366千円
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「未払金」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	13,317千円

(中間損益計算書関係)

当中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）		
1.減価償却実施額	有形固定資産	36,815千円
	無形固定資産	69,149千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）					
1.発行済株式に関する事項					
株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末	
普通株式（千株）	3,850	-	-	3,850	
2.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25年6月24日 定時株主総会	普通株式	3,545,850	921	平成25年3月31日	平成25年6月25日

（金融商品関係）

当中間会計期間（平成25年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成25年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません。

（（注2）を参照ください。）

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	15,184,871	15,184,871	-
(2) 未収委託者報酬	2,376,045	2,376,045	-
(3) 未収運用受託報酬	1,194,081	1,194,081	-
(4) 投資有価証券 その他有価証券	5,074,310	5,074,310	-
資産計	23,829,307	23,829,307	-
(1) 未払手数料	1,086,631	1,086,631	-
(2) 未払費用 1	765,300	765,300	-
負債計	1,851,931	1,851,931	-

（ 1 ） 金融商品に該当するものを表示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

（1）現金・預金、（2）未収委託者報酬、及び（3）未収運用受託報酬

これらはすべて短期で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（4）投資有価証券

投資信託であり、公表されている基準価額によっております。

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

負債

（1）未払手数料及び（2）未払費用

これらはすべて短期で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額
(1) その他有価証券 非上場株式	51,135
(2) 子会社株式 非上場株式	1,169,774
(3) 長期差入保証金	510,623

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象としておりません。

（有価証券関係）

当中間会計期間（平成25年9月30日）

1.子会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式1,169,774千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2.その他有価証券

（単位：千円）

区 分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 証券投資信託の受益証券	3,717,848	3,624,800	93,048
小計	3,717,848	3,624,800	93,048
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 証券投資信託の受益証券	1,356,461	1,401,000	44,538
小計	1,356,461	1,401,000	44,538
合計	5,074,310	5,025,800	48,509

（デリバティブ取引関係）

当中間会計期間（平成25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。

（セグメント情報等）

セグメント情報

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

当社は、「投資・金融サービス業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

1.サービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	13,966,220	1,706,500	39,685	15,712,406

2.地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3.主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎並びに1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	当中間会計期間 (平成25年9月30日)
(1) 1株当たり純資産額	5,677円21銭
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	21,857,240
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)	21,857,240
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

項目	当中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
(2) 1株当たり中間純利益金額	465円35銭
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	1,791,589
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金額(千円)	1,791,589
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式は存在しないため、記載しておりません。

（重要な後発事象）

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)通常の見積り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25年9月末現在	事業の内容
三井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25年9月末現在）
- ・事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
- ・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・インターナショナル・リミテッド
(T.Rowe Price International Ltd)

資本金の額

平成25年6月末現在：172百万米ドル（約18,127百万円）

（注）米ドルの円貨換算は、平成25年12月末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＝105.39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・インターナショナル・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25年9月末現在	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	1,770,996	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。
株式会社みずほ銀行	1,404,065	
三井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

受託会社の三井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。

三井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25年2月19日
有価証券報告書	平成25年2月19日
有価証券届出書の訂正届出書	平成25年6月28日
半期報告書	平成25年8月19日
有価証券届出書の訂正届出書	平成25年8月19日

独立監査人の監査報告書

平成25年12月27日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ 監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 久野 佳樹 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド30の平成24年11月20日から平成25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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀DC年金設計ファンド30の平成25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。

利害関係

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25年12月27日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ 監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 久野 佳樹 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド50の平成24年11月20日から平成25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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀DC年金設計ファンド50の平成25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。

利害関係

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25年12月27日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ 監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 久野 佳樹 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている大和住銀DC年金設計ファンド70の平成24年11月20日から平成25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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀DC年金設計ファンド70の平成25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。

利害関係

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](#) [次](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年6月14日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 久野 佳樹 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和住銀投信投資顧問株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第41期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和住銀投信投資顧問株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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25年12月9日

大和住銀投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 飯田 浩司 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 久野 佳樹 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和住銀投信投資顧問株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第42期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和住銀投信投資顧問株式会社の平成25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25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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](#)