

**【表紙】**

**【提出書類】** 有価証券届出書

**【提出先】** 関東財務局長

**【提出日】** 平成23年9月15日

**【発行者名】** 三井住友アセットマネジメント株式会社

**【代表者の役職氏名】** 代表取締役社長 前田 良治

**【本店の所在の場所】** 東京都港区愛宕二丁目5番1号

**【事務連絡者氏名】** 隠地 保夫

**【電話番号】** 03-5405-0735

**【届出の対象とした募集内国投資信託受益証 三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンド  
券に係るファンドの名称】**

**【届出の対象とした募集内国投資信託受益証 1,000億円を上限とします。  
券の金額】**

**【縦覧に供する場所】** 該当ありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンド

以下「当ファンド」といいます。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

1,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「日債イン」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="http://www.smam-jp.com">http://www.smam-jp.com</a>

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

**(5) 【申込手数料】**

無手数料です。

**(6) 【申込単位】**

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社または前記「(4) 発行(売出) 価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

**(7) 【申込期間】**

平成23年9月16日から平成24年9月20日まで

申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

**(8) 【申込取扱場所】**

販売会社において申込みを取り扱います。

販売会社の詳細につきましては、前記「(4) 発行(売出) 価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

**(9) 【払込期日】**

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の基準価額×申込口数）を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を經由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

**(10) 【払込取扱場所】**

販売会社において払込みを取り扱います。（販売会社は前記「(4) 発行(売出) 価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。）

**(11) 【振替機関に関する事項】**

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**(12) 【その他】**

イ 申込証拠金

ありません。

□ わが国以外の地域における募集

ありません。

ハ クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用

ありません。

ニ 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則に従って取り扱われるものとし、ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および当該振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

（参考：投資信託振替制度）

- ・ ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われます。
- ・ 受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます（原則として受益証券を保有することはできません。）。
- ・ ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。
- ・ 振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を組み入れることにより、実質的にわが国の公社債に投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目指して運用を行います。なお、公社債その他の有価証券または金融商品に直接投資を行う場合があります。

ロ NOMURA - B P I（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

NOMURA-BPI（総合）とは、

日本の債券市場の動向を的確に表すために野村證券株式会社によって開発された市場指数です。年金運用において、わが国の債券市場のベンチマークに多く利用されています。

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他の一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、金1,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

##### (イ) 当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	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。
投資対象地域	国内	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	債券	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

##### (ロ) 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（債券一般））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「債券」となります。

決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	日本	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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。
対象インデックス	その他の指数（NOMURA-BPI（総合））	目論見書または信託約款において、NOMURA-BPI（総合）に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。







## 《商品分類表》

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単 位 型  追 加 型	国 内	株 式 債 券	インデックス型
	海 外	不 動 産 投 信	特 殊 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。

## 《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株 式 一 般 大 型 株 中 小 型 株	年 1 回	グ ロ ー バ ル	ファミリーファンド	日 経 2 2 5
	年 2 回	日 本		
債 券 一 般 公 債 社 債 そ の 他 債 券 ク レ ジ ッ ト 属 性 ( )	年 4 回	北 米	ファンド・オブ・ファンズ	T O P I X
	年 6 回 (隔月)	欧 州		
不 動 産 投 信	年 12 回 (毎月)	ア ジ ア	ファンド・オブ・ファンズ	そ の 他 (NOMURA-BPI (総合))
	日 々	オ セ ア ニ ア		
そ の 他 資 産 (投資信託証券(債券 一般))	そ の 他 ( )	中 南 米	ファンド・オブ・ファンズ	そ の 他 (NOMURA-BPI (総合))
		ア フ リ カ		
資 産 複 合 ( ) 資 産 配 分 固 定 型 資 産 配 分 変 更 型		中 近 東 (中 東)	ファンド・オブ・ファンズ	そ の 他 (NOMURA-BPI (総合))
		エ マ ー ジ ン グ		

(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。

商品分類、属性区分は、社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

## (2)【ファンドの沿革】

平成14年1月4日

信託契約締結、設定、運用開始。

(設定時の委託会社はさくら投信投資顧問株式会社)

平成14年12月1日

三井住友アセットマネジメント株式会社が、合併によりファンドの委託会社としての業務を承継。「DC年金日本債券インデックス・ファンド」から「三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンド」に名称を変更。

### （3）【ファンドの仕組み】

#### イ 当ファンドの関係法人とその役割

##### （イ）委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

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

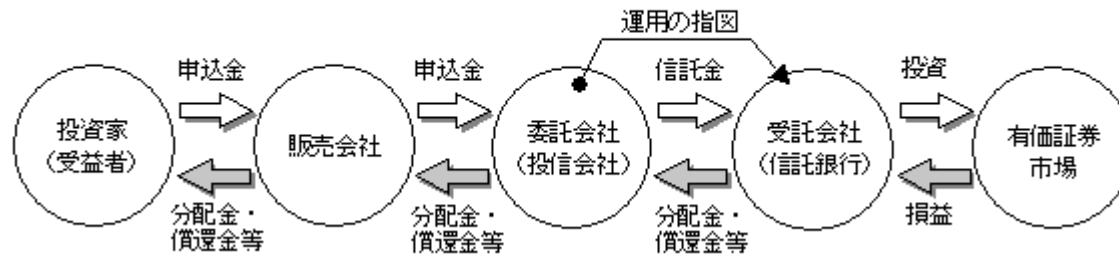
##### （ロ）受託会社 「中央三井アセット信託銀行株式会社」

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

##### （ハ）販売会社

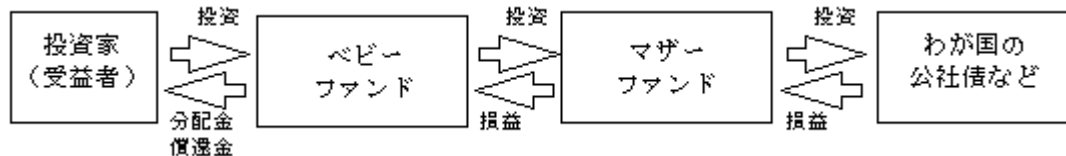
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

#### 運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。



#### ロ 委託会社の概況

##### （イ）資本金の額

2,000百万円（平成23年7月29日現在）

## (口) 会社の沿革

昭和60年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

昭和62年2月20日 証券投資顧問業の登録

昭和62年6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可

平成11年1月1日 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合

平成11年2月5日 三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号  
変更

平成12年1月27日 証券投資信託委託業の認可取得

平成14年12月1日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友  
海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三  
井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更

## (八) 大株主の状況

(平成23年7月29日現在)

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

**2【投資方針】****(1)【投資方針】**

## イ 基本方針

マザーファンド受益証券を組み入れることにより、実質的にわが国の公社債に投資し、信託財産の中長期的な成長を図ることを目指して運用を行います。なお、公社債その他の有価証券または金融商品に直接投資を行う場合があります。

## ロ 投資態度

- (イ) 主としてマザーファンド受益証券に投資を行い、NOMURA - B P I（総合）に連動する投資成果を目指します。
- (ロ) マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、ファンド設定当初や解約・償還への対応などの事情により変更することもあります。
- (ハ) 「ファミリーファンド方式」により運用を行います。
- (ニ) 運用の効率化を図るため、有価証券先物取引等を利用することもあります。

**〈ファンドの特色〉**

1. マザーファンドを主要投資対象とし、NOMURA - B P I（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

公社債その他の有価証券または金融商品に直接投資を行う場合があります。

**※NOMURA-BPI(総合)とは**

日本の債券市場の動向を的確に表すために野村証券株式会社によって開発された市場指数です。

年金運用において、わが国の債券市場のベンチマークに多く利用されています。

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他の一切の権利は野村証券株式会社に帰属しております。また、野村証券株式会社は、ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

2. マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます、ただし、解約・償還への対応などの事情により変更することもあります、
3. 「ファミリーファンド方式」により運用を行います、

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

**（２）【投資対象】****イ 投資対象とする資産の種類**

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、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。）とします。

- １．有価証券
- ２．デリバティブ取引にかかる権利
- ３．金銭債権
- ４．約束手形

**ロ 投資対象とする有価証券**

委託会社は、信託金を、主としてマザーファンドの受益証券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書
- 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．特定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本邦通貨表示の証券または証書で、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．投資証券もしくは投資法人債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ます。）

価証券にかかるものに限ります。）

- 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．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
- 21．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、第1号の証券または証書、第12号および第17号の証券または証書のうち第1号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、第2号から第6号までの証券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（ただし、投資法人債券を除きます。以下同じ。）を以下「投資信託証券」といいます。



## 八 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記口に掲げる有価証券のほか、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

### （3）【運用体制】

#### イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

##### （イ）計画（Plan）

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

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

##### （ロ）実行（Do）

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

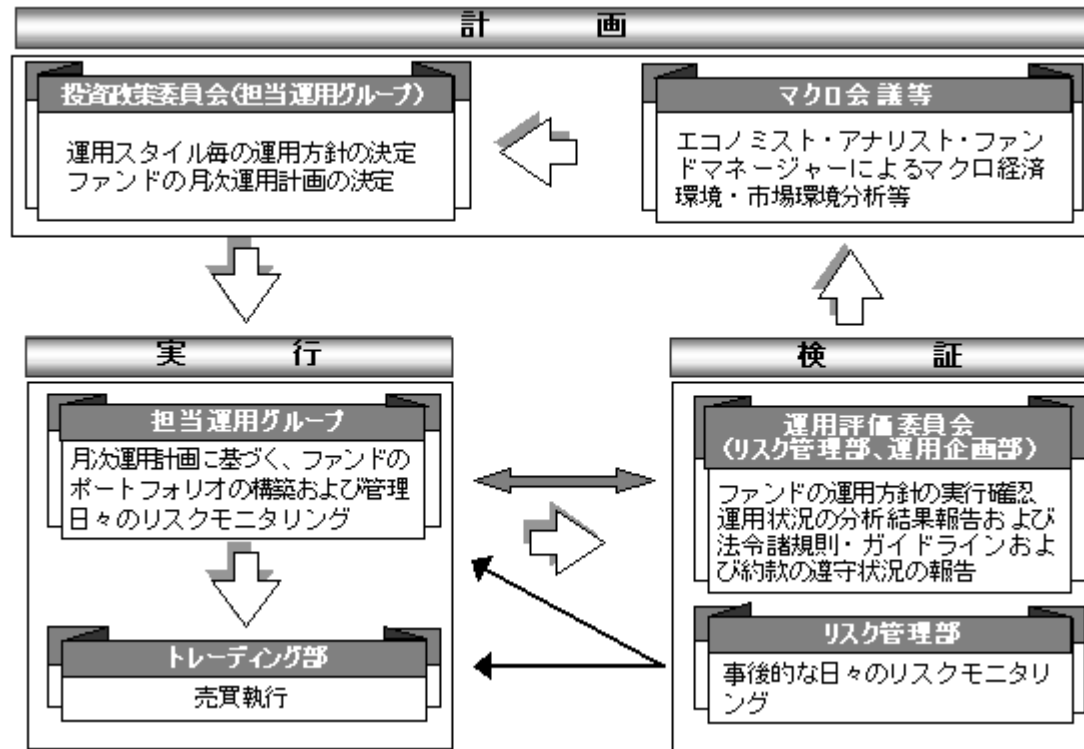
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

##### （ハ）検証（Check）

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

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

## 〔ファンドの運用体制〕



リスク管理部は8名程度、運用企画部は10名程度で構成されています。

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

□ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

毎年1回（原則として6月20日、休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として次の通り収益分配を行う方針とします。

イ 分配対象額は、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

ロ 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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。

#### （５）【投資制限】

##### ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式への投資は、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の行使による取得に限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ロ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ハ 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は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ニ 外貨建資産への投資は行いません。
- ホ マザーファンド受益証券以外の投資信託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%以下とします。

## ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

### イ 投資する株式の範囲

- (イ) 委託会社が投資することを指図する株式は、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の行使による取得に限り、わが国の取引所に上場し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については、この限りではありません。
- (ロ) 上記(イ)にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録す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。

### ロ 先物取引等の運用指図および目的

- (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。以下同じ。）、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。以下同じ。）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。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるわが国の有価証券にかか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るものとします（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わが国の金利にかか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。

### ハ 有価証券の貸付けの指図および範囲

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付けの指図をすることができます。ただし、当該貸付けは、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を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ)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、有価証券の貸付け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。

### ニ 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の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り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代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入

額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

- (八) 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。
- (二) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

### 法令に基づく投資制限

#### イ 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

#### ロ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

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かか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額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（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かか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。

**（参考情報：国内債券（NOMURA - BPI）マザーファンドの投資方針等）****（１）投資方針等**

## イ 基本方針

わが国の公社債を中心に投資し、安定した利子等収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

## ロ 投資態度

（イ）主としてわが国の公社債および短期金融資産に投資し、安定した利子等収益および売買益の確保を目指すとともに、NOMURA - BPIの動きに連動する投資成果を目指します。

（ロ）有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

**（２）投資対象**

## イ 投資対象とする資産の種類

前記「２ 投資方針（２）投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

## ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券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の新株引受権証券を除きます。）
- 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。）
- ５の２．投資法人債券（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。）
- ６．コマーシャル・ペーパー
- ７．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- ８．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、有価証券にかかるものに限りません。）
- ９．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せん。）

## ハ 投資対象とする金融商品

前記「２ 投資方針（２）投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投

資対象とする金融商品の各号のうち、第1号から第4号に掲げるものに投資します。

### （3）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資は行いません。

（ロ）外貨建資産への投資は行いません。

ロ 法令に基づく投資制限

ベビーファンドにつき上述した法令に基づく制限は、当マザーファンドについても課されます。

### 3【投資リスク】

#### イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、主にわが国の債券を投資対象としています（マザーファンドを通じて間接的に投資する場合を含みます。）。当ファンドの基準価額は、組み入れた債券の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化等の影響により上下します。基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

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

当ファンドが有するリスク等（当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドへの投資を通じて間接的に受ける実質的なリスク等を含みます。）のうち主要なものは、以下の通りです。

#### （イ）債券市場リスク

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

#### （ロ）信用リスク

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

#### （ハ）市場流動性リスク

大口の解約請求があった場合、解約資金を手当てするために保有資産を大量に売却しなければならないことがあります。その際、市場動向や取引量等の状況によっては、取引ができなかったり、通常よりも著しく不利な価格での取引を余儀なくされたりすることがあり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

#### （ニ）収益分配金に関する留意事項

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

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

受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないしすべてが、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。

#### （ホ）インデックスに連動しない要因・留意点



当ファンドは、NOMURA - B P I（総合）に連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、有価証券売買時のコストおよび信託報酬その他のファンド運営にかかる費用、追加設定・解約に伴う組入有価証券の売買のタイミング差、インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差の影響等から、上記インデックスに連動しないことがあります。

（ハ）ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

ロ 投資リスクの管理体制

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

無手数料です。

##### (2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

##### (3)【信託報酬等】

純資産総額に年0.168%（税抜き0.16%）の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各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。

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

委託会社	販売会社	受託会社
年0.0630% (0.06%)	年0.0735% (0.07%)	年0.0315% (0.03%)

( )内は税抜き。

##### (4)【その他の手数料等】

イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0021%（税抜き0.002%）の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各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。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。

ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。

ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ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（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）等は、信託財産中から支弁するものとします。

上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法を具体的に記載することはできません。

上記（１）～（４）にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあったりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

## （５）【課税上の取扱い】

### イ 個別元本について

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

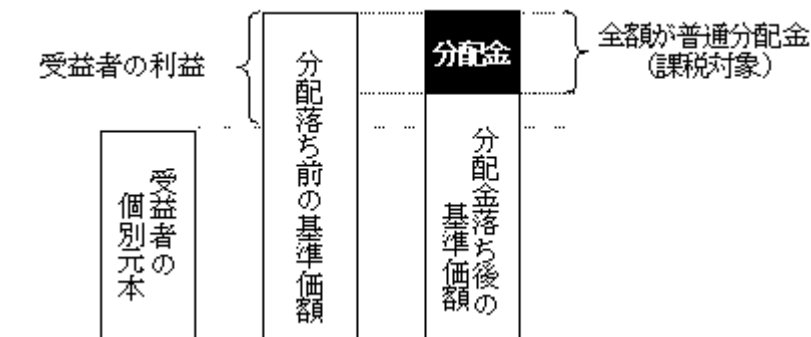
### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

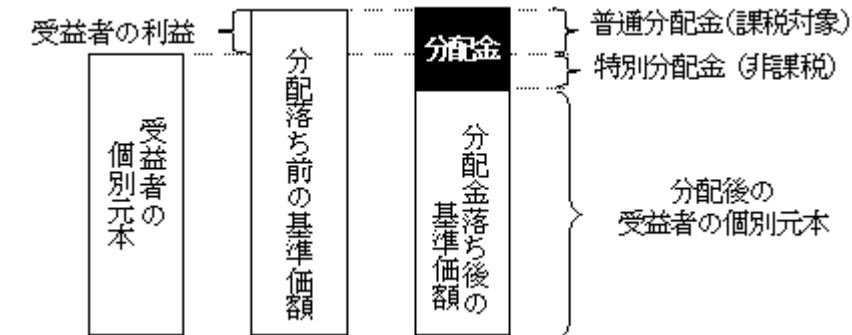
### ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・ 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、平成25年12月31日までは10%（所得税7%および地方税3%）、平成26年1月1日以降は20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

#### ・ 一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、平成25年12月31日までは10%（所得税7%および地方税3%）、平成26年1月1日以降は20%（所得税15%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

なお、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、上場株式等にかかる譲渡益との通算が可能です。

### (ロ) 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、平成25年12月31日までは7%（所得税のみ）、平成26年1月1日以降は15%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

当ファンドは、受取配当にかかる益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への投資は行いません。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

上記にかかわらず、確定拠出年金制度における受益者が支払いを受ける収益分配金、一部解約金、償還金はいずれも課税されません。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成23年7月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

平成23年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国内債券(NOMURA - BPI)マザーファンド受益証券	日本	19,530,657,584	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,410,976	0.02
合計(純資産総額)		19,527,246,608	100.00

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

### (2)【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ 主要投資銘柄

平成23年7月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量(口)	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	国内債券(NOMURA - BPI)マザーファンド	16,079,909,093	1.2100 19,457,234,462	1.2146 19,530,657,584	100.02

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

##### ロ 種類別の投資比率

平成23年7月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.02
合計	100.02

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

年月日	純資産総額 (円)	1万口当たりの 純資産額(円)
第1期(平成14年6月20日)(分配落)	1,530,304	10,088
第1期(平成14年6月20日)(分配付)	1,530,304	10,088
第2期(平成15年6月20日)(分配落)	433,303,041	10,450
第2期(平成15年6月20日)(分配付)	433,303,041	10,450
第3期(平成16年6月21日)(分配落)	1,957,629,825	10,039
第3期(平成16年6月21日)(分配付)	1,957,629,825	10,039
第4期(平成17年6月20日)(分配落)	4,272,433,992	10,424
第4期(平成17年6月20日)(分配付)	4,272,433,992	10,424
第5期(平成18年6月20日)(分配落)	5,602,798,014	10,189
第5期(平成18年6月20日)(分配付)	5,602,798,014	10,189
第6期(平成19年6月20日)(分配落)	8,161,980,557	10,306
第6期(平成19年6月20日)(分配付)	8,161,980,557	10,306
第7期(平成20年6月20日)(分配落)	10,479,608,829	10,504
第7期(平成20年6月20日)(分配付)	10,479,608,829	10,504
第8期(平成21年6月22日)(分配落)	13,202,228,067	10,880
第8期(平成21年6月22日)(分配付)	13,202,228,067	10,880
第9期(平成22年6月21日)(分配落)	15,866,374,412	11,240
第9期(平成22年6月21日)(分配付)	15,866,374,412	11,240
第10期(平成23年6月20日)(分配落)	18,787,548,365	11,379
第10期(平成23年6月20日)(分配付)	18,787,548,365	11,379
平成22年7月末日	16,507,832,360	11,360
平成22年8月末日	16,982,788,798	11,434
平成22年9月末日	17,136,382,296	11,443
平成22年10月末日	17,246,180,696	11,404
平成22年11月末日	17,230,665,147	11,276
平成22年12月末日	17,822,640,029	11,344
平成23年1月末日	17,892,487,287	11,282
平成23年2月末日	17,749,125,486	11,264

平成23年3月末日	18,238,728,133	11,261
平成23年4月末日	18,367,109,868	11,300
平成23年5月末日	18,743,072,836	11,346
平成23年6月末日	19,338,465,182	11,380
平成23年7月末日	19,527,246,608	11,420

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

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

### 【分配の推移】

計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期（平成14年1月4日～平成14年6月20日）	0
第2期（平成14年6月21日～平成15年6月20日）	0
第3期（平成15年6月21日～平成16年6月21日）	0
第4期（平成16年6月22日～平成17年6月20日）	0
第5期（平成17年6月21日～平成18年6月20日）	0
第6期（平成18年6月21日～平成19年6月20日）	0
第7期（平成19年6月21日～平成20年6月20日）	0
第8期（平成20年6月21日～平成21年6月22日）	0
第9期（平成21年6月23日～平成22年6月21日）	0
第10期（平成22年6月22日～平成23年6月20日）	0

### 【収益率の推移】

計算期間	収益率（％）
第1期	0.9
第2期	3.6
第3期	3.9
第4期	3.8
第5期	2.3
第6期	1.1
第7期	1.9



第8期	3.6
第9期	3.3
第10期	1.2

（注1）収益率は、計算期間末の分配基準価額から前期末分配基準価額を控除した額を前期末分配基準価額で除したものをいいます。

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

#### （4）【設定及び解約の実績】

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,517,016	0
第2期	413,262,089	122,269
第3期	1,605,787,672	70,469,296
第4期	2,337,432,387	188,933,085
第5期	2,490,370,858	1,090,146,276
第6期	3,358,813,837	937,995,200
第7期	3,291,645,811	1,234,256,139
第8期	3,388,629,786	1,231,281,526
第9期	3,032,158,464	1,050,563,427
第10期	3,855,988,734	1,461,698,204

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 【参考情報：国内債券（NOMURA - BPI）マザーファンドの投資状況・投資資産】

## （１）投資状況

平成23年7月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	119,181,060,990	72.33
地方債証券	日本	11,564,641,230	7.02
特殊債券	日本	18,514,987,172	11.24
	韓国	100,488,000	0.06
	小計	18,615,475,172	11.30
社債券	日本	12,516,787,310	7.60
	アメリカ	914,016,000	0.55
	オーストラリア	100,051,000	0.06
	イギリス	303,298,000	0.18
	オランダ	200,086,000	0.12
	小計	14,034,238,310	8.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,388,964,598	0.84
合計(純資産総額)		164,784,380,300	100.00

## （２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成23年7月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	額面金額 (円)	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (円)	利率(%) / 償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第260回利付国債(10年)	3,956,000,000	104.05 4,116,375,200	104.00 4,114,556,480	1.6 2014/6/20	2.50
日本	国債証券	第250回利付国債(10年)	4,019,000,000	100.66 4,045,733,350	100.65 4,045,324,450	0.5 2013/6/20	2.45
日本	国債証券	第253回利付国債(10年)	3,857,000,000	103.18 3,979,806,880	103.05 3,974,947,060	1.6 2013/9/20	2.41

日本	国債証券	第272回利付国債（10年）	3,500,000,000	104.41 3,654,420,000	104.48 3,657,115,000	1.4 2015/9/20	2.22
日本	国債証券	第263回利付国債（10年）	3,355,000,000	104.30 3,499,392,500	104.30 3,499,533,400	1.6 2014/9/20	2.12
日本	国債証券	第274回利付国債（10年）	3,218,000,000	105.03 3,380,029,700	105.09 3,382,021,460	1.5 2015/12/20	2.05
日本	国債証券	第258回利付国債（10年）	3,180,000,000	102.94 3,273,523,800	102.90 3,272,251,800	1.3 2014/3/20	1.99
日本	国債証券	第256回利付国債（10年）	3,105,000,000	102.98 3,197,808,450	102.90 3,195,169,200	1.4 2013/12/20	1.94
日本	国債証券	第268回利付国債（10年）	3,010,000,000	104.41 3,142,981,800	104.45 3,144,095,500	1.5 2015/3/20	1.91
日本	国債証券	第265回利付国債（10年）	2,995,000,000	104.22 3,121,389,000	104.24 3,122,077,850	1.5 2014/12/20	1.89
日本	国債証券	第247回利付国債（10年）	3,010,000,000	101.12 3,043,922,700	101.06 3,041,996,300	0.8 2013/3/20	1.85
日本	国債証券	第270回利付国債（10年）	2,833,000,000	103.86 2,942,377,800	103.91 2,943,883,620	1.3 2015/6/20	1.79
日本	国債証券	第277回利付国債（10年）	2,714,000,000	105.70 2,868,806,560	105.71 2,869,132,240	1.6 2016/3/20	1.74
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	2,140,000,000	101.33 2,168,633,200	101.71 2,176,701,000	1.2 2020/12/20	1.32
日本	国債証券	第244回利付国債（10年）	2,134,000,000	101.27 2,161,101,800	101.18 2,159,287,900	1 2012/12/20	1.31
日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	2,050,000,000	101.98 2,090,636,100	102.36 2,098,462,000	1.3 2021/3/20	1.27
日本	国債証券	第303回利付国債（10年）	1,960,000,000	104.31 2,044,613,200	104.70 2,052,120,000	1.4 2019/9/20	1.25
日本	国債証券	第310回利付国債（10年）	2,020,000,000	99.87 2,017,434,600	100.29 2,025,918,600	1 2020/9/20	1.23
日本	国債証券	第306回利付国債（10年）	1,800,000,000	103.84 1,869,120,000	104.29 1,877,310,000	1.4 2020/3/20	1.14

日本	国債証券	第280回利付国債（10年）	1,713,000,000	107.38 1,839,474,100	107.38 1,839,487,920	1.9 2016/6/20	1.12
日本	国債証券	第293回利付国債（10年）	1,621,000,000	107.79 1,747,421,790	108.03 1,751,247,350	1.8 2018/6/20	1.06
日本	国債証券	第308回利付国債（10年）	1,660,000,000	102.77 1,705,982,000	103.16 1,712,472,600	1.3 2020/6/20	1.04
日本	国債証券	第297回利付国債（10年）	1,564,000,000	104.83 1,639,603,760	105.20 1,645,453,120	1.4 2018/12/20	1.00
日本	国債証券	第315回利付国債（10年）	1,580,000,000	100.94 1,594,871,600	101.11 1,597,632,800	1.2 2021/6/20	0.97
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	1,520,000,000	103.27 1,569,825,600	103.68 1,575,966,400	1.3 2019/12/20	0.96
日本	国債証券	第286回利付国債（10年）	1,425,000,000	107.53 1,532,302,500	107.67 1,534,297,500	1.8 2017/6/20	0.93
日本	国債証券	第282回利付国債（10年）	1,416,000,000	106.56 1,508,889,600	106.61 1,509,696,720	1.7 2016/9/20	0.92
日本	国債証券	第296回利付国債（10年）	1,416,000,000	105.66 1,496,145,600	105.97 1,500,577,680	1.5 2018/9/20	0.91
日本	国債証券	第284回利付国債（10年）	1,400,000,000	106.70 1,493,800,000	106.79 1,495,074,000	1.7 2016/12/20	0.91
日本	国債証券	第289回利付国債（10年）	1,388,000,000	105.78 1,468,351,320	105.98 1,471,085,680	1.5 2017/12/20	0.89

## □ 種類別の投資比率

平成23年 7月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	72.33
地方債証券	7.02
特殊債券	11.30
社債券	8.52
合計	99.16

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

### 〔参考情報〕

基準日2011年7月29日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。  
※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

#### 基準価額・純資産の推移



基準価額	11,420円
純資産総額	195億円

#### 分配の推移

決算期	分配金
2011年6月	0円
2010年6月	0円
2009年6月	0円
2008年6月	0円
2007年6月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

※基準価額は、1万円当たり、信託報酬控除後です。

#### 年間収益率の推移（暦年ベース）



2002年のファンドの収益率は、ファンドの設定日（2002年1月4日）から年末までの騰落率を表示しています。  
2011年の収益率は、年初から2011年7月29日までの騰落率を表示しています。  
ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### イ 申込方法

（イ）ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。お申込みの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

（ロ）原則として午後3時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。

なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

（ハ）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あらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

#### ロ 申込価額

取得申込受付日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

#### ハ 申込手数料

無手数料です。

#### ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

#### ホ 照会先

申込単位の詳細についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="http://www.smam-jp.com">http://www.smam-jp.com</a>

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

#### ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

#### ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の基準価額×申込口数）を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

## 2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求（一部解約の実行請求）により換金することができます。お買付けの販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。

解約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かかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従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。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の基準価額となります。

一部解約価額は、委託会社の営業日において日々算出されますので、委託会社（電話：0120-88-2976）にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせします。

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

## 3【資産管理等の概要】

### (1)【資産の評価】

#### イ 基準価額の算出方法

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を除きます。）を法令および社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「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（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

#### ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝

刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「日債イン」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

## （２）【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、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るため、原則として受益証券は発行されません。したがって、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】

平成14年1月4日から下記「（５）その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

## （４）【計算期間】

毎年6月21日から翌年6月20日までとすることを原則としますが、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、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、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】

### イ 信託の終了

#### （イ）信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンド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に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、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当ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドのすべ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。
- c. 上記b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、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記cの一定の期間内に異議を述べ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、信託契約の解約をしません。



- e. 委託会社は、当ファンド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、すべ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。
- f. 上記c～eまでの取扱いは、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、上記cの一定の期間が一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。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

(ハ) 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、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 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。また、受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないとき、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、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（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の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決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。  
ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(ロ) 償還金

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（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の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）に支払われます。

#### 八 信託約款の変更

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の変更事項のうち、その内容が重大なものについては、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、これらの事項を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に交付します。ただし、当ファンドのすべ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。
- (ハ) 上記(ロ)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、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (ニ) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べ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、(イ)の信託約款の変更をしません。
- (ホ) 委託会社は、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、すべ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。

#### 二 反対者の買取請求権

当ファンドの信託契約の解約または重大な信託約款の変更が行われる場合において、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間内に委託会社に異議を述べた受益者は、自己に帰属する受益権を、受託会社に信託財産をもって買い取るよう請求をすることができます。

#### ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの）は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

#### へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。

#### ト 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。

#### チ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は毎決算後、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「運用報告書」を作成します。  
運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。

## 4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が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通りです。

### イ 分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、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（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の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決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を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（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の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）に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

### ハ 一部解約実行請求権

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

### ニ 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または重大な信託約款の変更を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に関する異議のある受益者は、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間中に異議を申し立てることができます。異議を申し立てた受益者の受益権の口数が、受益権の総口数の過半数となる場合は、当該解約または信託約款変更は行われません。

当該解約または信託約款変更が行われる場合において、前述の異議を申し立てた受益者は、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い取るべき旨の請求ができます。

#### ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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。

### 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）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（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、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期（平成21年6月23日から平成22年6月21日まで）および第10期（平成22年6月22日から平成23年6月20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り監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (平成22年6月21日現在)	第10期 (平成23年6月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	9,118,026	5,223,627
親投資信託受益証券	15,878,957,203	18,802,744,749
未収入金	2,339,528	9,078,796
未収利息	12	7
流動資産合計	15,890,414,769	18,817,047,179
資産合計	15,890,414,769	18,817,047,179
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	11,383,296	14,223,941
未払受託者報酬	2,343,918	2,828,705
未払委託者報酬	10,156,939	12,257,648
その他未払費用	156,204	188,520
流動負債合計	24,040,357	29,498,814
負債合計	24,040,357	29,498,814
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	14,115,850,702	16,510,141,232
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,750,523,710	2,277,407,133
元本等合計	15,866,374,412	18,787,548,365
純資産合計	15,866,374,412	18,787,548,365
負債純資産合計	15,890,414,769	18,817,047,179

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期	第10期
	自 平成21年 6月23日 至 平成22年 6月21日	自 平成22年 6月22日 至 平成23年 6月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	4,061	4,219
有価証券売買等損益	492,474,987	236,882,001
営業収益合計	492,479,048	236,886,220
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	4,530,504	5,487,148
委託者報酬	19,632,085	23,777,499
その他費用	301,916	365,691
営業費用合計	24,464,505	29,630,338
営業利益	468,014,543	207,255,882
経常利益	468,014,543	207,255,882
当期純利益	468,014,543	207,255,882
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	18,926,239	8,668,252
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,067,972,402	1,750,523,710
剰余金増加額又は欠損金減少額	327,694,121	511,476,191
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	327,694,121	511,476,191
剰余金減少額又は欠損金増加額	94,231,117	183,180,398
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	94,231,117	183,180,398
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,750,523,710	2,277,407,133

**（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9期	第10期
	自平成21年6月23日 至平成22年6月21日	自平成22年6月22日 至平成23年6月20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（売買目的有価証券） 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、親投資信託受益証券の基準価額に 基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同 左
2. その他財務諸表作成のための基本 となる重要な事項	計算期間の取扱い 当計算期間は前期末および当期末が休日のため、平成 21年6月23日から平成22年6月21日までとなっております。	計算期間の取扱い 当計算期間は前期末が休日のため、平成22年6月22日 から平成23年6月20日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第9期	第10期
	(平成22年6月21日現在)	(平成23年6月20日現在)
1. 受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 14,115,850,702口	当計算期間の末日における受益権の総数 16,510,141,232口
2. 1単位当たり純資産額	1.1240円 (1万口 = 11,240円)	1.1379円 (1万口 = 11,379円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第9期	第10期
	自平成21年6月23日 至平成22年6月21日	自平成22年6月22日 至平成23年6月20日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（ 212,558,094円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価 証券売買等損益（236,530,210円）、収益調整金（ 881,431,114円）、および分配準備積立金（420,004,292 円）より、分配対象収益は1,750,523,710円（1万口当 たり1,240.11円）であります。分配を行っておりませ ん。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（ 257,538,213円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価 証券売買等損益（0円）、収益調整金（1,228,896,926 円）、および分配準備積立金（790,971,994円）より、分 配対象収益は2,277,407,133円（1万口当たり1,379.39 円）であります。分配を行っておりません。



## （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9期 自平成21年6月23日 至平成22年6月21日	第10期 自平成22年6月22日 至平成23年6月20日
	<p>（追加情報） 当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。</p>	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>（1）金融商品の内容 1）有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2）デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的としております。 3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 （2）金融商品にかかるリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>	<p>（1）金融商品の内容 1）有価証券 同左 2）デリバティブ取引 同左 3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 （2）金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 同左</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>	同 左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評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よった場合、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かかる市場リスクを示すものではありません。</p>	同 左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第9期 (平成22年6月21日現在)	第10期 (平成23年6月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同 左

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

## 第9期（自平成21年6月23日至平成22年6月21日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	500,398,990円
合 計	500,398,990円

## 第10期（自平成22年6月22日至平成23年6月20日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	251,739,226円
合 計	251,739,226円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 第9期（平成22年6月21日現在）

第9期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

## 第10期（平成23年6月20日現在）

第10期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

## 第9期（自平成21年6月23日至平成22年6月21日）

該当事項はありません。

## 第10期（自平成22年6月22日至平成23年6月20日）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

項 目	第9期 (平成22年6月21日現在)	第10期 (平成23年6月20日現在)
期首元本額	12,134,255,665円	14,115,850,702円
期中追加設定元本額	3,032,158,464円	3,855,988,734円
期中一部解約元本額	1,050,563,427円	1,461,698,204円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

種類	銘柄名	元本額	評価額	
			単価	金額
親投資信託 受益証券	国内債券(NOMURA - BPI) マザーファンド	15,539,458,471円	1.2100円	18,802,744,749円

## （参考情報）

三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンドは、「国内債券（NOMURA - BPI）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」はすべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外です。

「国内債券（NOMURA - BPI）マザーファンド」の状況

## （1）貸借対照表

対象年月日	(平成22年6月21日現在)	(平成23年6月20日現在)
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,078,923,096	1,093,288,220
国債証券	126,619,036,800	118,752,125,580
地方債証券	11,823,524,160	11,672,816,235
特殊債券	19,031,454,325	18,597,365,315
社債券	14,671,741,770	14,357,858,840
未収入金	-	104,078,000
未収利息	425,813,470	412,965,522
前払費用	15,905,154	13,802,474
流動資産合計	173,666,398,775	165,004,300,186
資産合計	173,666,398,775	165,004,300,186
負債の部		
流動負債		
未払金	430,760,200	316,550,700
未払解約金	24,232,182	137,580,612
流動負債合計	454,992,382	454,131,312
負債合計	454,992,382	454,131,312
純資産の部		

元本等		
元本		
元本	145,176,769,466	135,996,949,897
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	28,034,636,927	28,553,218,977
元本等合計	173,211,406,393	164,550,168,874
純資産合計	173,211,406,393	164,550,168,874
負債純資産合計	173,666,398,775	165,004,300,186

（注）「国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド」は、毎年6月20日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成22年6月21日ならびに平成23年6月20日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成21年6月23日 至平成22年6月21日	自平成22年6月22日 至平成23年6月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券（売買目的有価証券） 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、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成22年6月21日現在)	(平成23年6月20日現在)
1. 受益権総数	平成22年6月21日現在における受益権の総数 145,176,769,466口	平成23年6月20日現在における受益権の総数 135,996,949,897口
2. 1単位当たり純資産額	1.1931円 (1万口 = 11,931円)	1.2100円 (1万口 = 12,100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21年6月23日 至平成22年6月21日	自平成22年6月22日 至平成23年6月20日
	(追加情報) 当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。	
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、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券を組み入れております。	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 同左



	<p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、および価格変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>	<p>2) デリバティブ取引 同 左</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 同 左</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>	同 左

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委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評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よった場合、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かかる市場リスクを示すものではありません。	同 左
----------------------------	--	-----

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成22年6月21日現在)	(平成23年6月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同 左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券） 「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。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券） 同 左</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同 左</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 同 左</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

(平成22年6月21日現在)

平成22年6月21日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

(平成23年6月20日現在)

平成23年6月20日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

(自平成21年6月23日 至 平成22年6月21日)

該当事項はありません。

(自平成22年6月22日 至 平成23年6月20日)

該当事項はありません。

## （その他の注記）

(平成22年 6月21日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	145,855,334,842円
期中追加設定元本額	22,824,134,923円
期中一部解約元本額	23,502,700,299円
平成22年 6月21日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンド	13,308,991,035円
S M A M・国内債券インデックス・ファンド	77,404,838,028円
国内債券インデックスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	1,037,048,391円
S M A M・年金国内債券パッシブファンド < 適格機関投資家限定 >	53,425,892,012円
合 計	145,176,769,466円

(平成23年 6月20日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	145,176,769,466円
期中追加設定元本額	12,821,307,320円
期中一部解約元本額	22,001,126,889円
平成23年 6月20日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンド	15,539,458,471円
S M A M・国内債券インデックス・ファンド	71,718,798,452円
国内債券インデックスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	834,811,452円
S M A M・年金国内債券パッシブファンド < 適格機関投資家限定 >	47,903,881,522円
合 計	135,996,949,897円

## （3）附属明細表

有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第1回利付国債(40年)	165,000,000	173,644,350	
	第2回利付国債(40年)	250,000,000	250,000,000	
	第3回利付国債(40年)	330,000,000	329,310,300	
	第4回利付国債(40年)	90,000,000	89,713,800	
	第243回利付国債(10年)	506,000,000	512,061,880	
	第244回利付国債(10年)	3,548,000,000	3,593,166,040	
	第247回利付国債(10年)	3,010,000,000	3,043,922,700	
	第250回利付国債(10年)	3,919,000,000	3,945,061,350	
	第253回利付国債(10年)	3,857,000,000	3,979,806,880	
	第256回利付国債(10年)	3,105,000,000	3,197,808,450	
	第258回利付国債(10年)	3,180,000,000	3,273,523,800	
	第260回利付国債(10年)	3,766,000,000	3,918,711,300	
	第263回利付国債(10年)	2,955,000,000	3,082,360,500	
	第265回利付国債(10年)	2,995,000,000	3,121,389,000	
	第268回利付国債(10年)	3,010,000,000	3,142,981,800	
	第270回利付国債(10年)	2,883,000,000	2,994,341,460	
	第272回利付国債(10年)	3,500,000,000	3,654,420,000	
	第274回利付国債(10年)	3,068,000,000	3,222,627,200	
	第277回利付国債(10年)	2,714,000,000	2,868,806,560	
	第280回利付国債(10年)	1,093,000,000	1,173,805,490	
	第282回利付国債(10年)	1,506,000,000	1,604,899,020	
	第284回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,493,800,000	
	第285回利付国債(10年)	1,284,000,000	1,371,491,760	
	第286回利付国債(10年)	1,515,000,000	1,629,094,650	
	第288回利付国債(10年)	1,033,000,000	1,105,371,980	
	第289回利付国債(10年)	1,388,000,000	1,468,351,320	

第290回利付国債(10年)	1,242,000,000	1,305,515,880
第293回利付国債(10年)	1,621,000,000	1,747,421,790
第296回利付国債(10年)	1,616,000,000	1,707,481,760
第297回利付国債(10年)	1,564,000,000	1,639,603,760
第300回利付国債(10年)	1,110,000,000	1,170,039,900
第301回利付国債(10年)	1,648,000,000	1,734,651,840
第303回利付国債(10年)	1,960,000,000	2,044,613,200
第305回利付国債(10年)	1,520,000,000	1,569,825,600
第306回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,869,120,000
第308回利付国債(10年)	1,810,000,000	1,860,155,100
第309回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,010,330,000
第310回利付国債(10年)	2,020,000,000	2,017,434,600
第312回利付国債(10年)	2,140,000,000	2,168,633,200
第313回利付国債(10年)	2,030,000,000	2,070,254,900
第2回利付国債(30年)	150,000,000	162,573,000
第4回利付国債(30年)	160,000,000	186,388,800
第5回利付国債(30年)	110,000,000	115,349,300
第7回利付国債(30年)	180,000,000	191,489,400
第10回利付国債(30年)	210,000,000	178,388,700
第11回利付国債(30年)	210,000,000	200,529,000
第12回利付国債(30年)	210,000,000	215,052,600
第14回利付国債(30年)	250,000,000	269,420,000
第15回利付国債(30年)	130,000,000	142,366,900
第16回利付国債(30年)	270,000,000	295,641,900
第18回利付国債(30年)	240,000,000	253,629,600
第19回利付国債(30年)	150,000,000	158,451,000
第21回利付国債(30年)	212,000,000	223,742,680
第22回利付国債(30年)	209,000,000	228,754,680
第23回利付国債(30年)	111,000,000	121,461,750
第24回利付国債(30年)	200,000,000	218,978,000
第25回利付国債(30年)	315,000,000	332,076,150

第26回利付国債(30年)	299,000,000	321,505,730
第27回利付国債(30年)	421,000,000	461,192,870
第28回利付国債(30年)	411,000,000	450,332,700
第29回利付国債(30年)	580,000,000	622,554,600
第30回利付国債(30年)	410,000,000	431,557,800
第31回利付国債(30年)	650,000,000	671,638,500
第32回利付国債(30年)	630,000,000	664,486,200
第33回利付国債(30年)	640,000,000	632,992,000
第34回利付国債(30年)	300,000,000	309,744,000
第23回利付国債(20年)	10,000,000	11,190,100
第25回利付国債(20年)	50,000,000	55,313,000
第28回利付国債(20年)	350,000,000	410,987,500
第30回利付国債(20年)	450,000,000	513,400,500
第32回利付国債(20年)	150,000,000	173,359,500
第33回利付国債(20年)	230,000,000	270,231,600
第35回利付国債(20年)	315,000,000	365,025,150
第37回利付国債(20年)	230,000,000	265,965,100
第39回利付国債(20年)	223,000,000	252,134,950
第40回利付国債(20年)	492,000,000	547,399,200
第42回利付国債(20年)	400,000,000	454,464,000
第43回利付国債(20年)	710,000,000	825,623,500
第46回利付国債(20年)	289,000,000	319,605,100
第48回利付国債(20年)	368,000,000	416,590,720
第50回利付国債(20年)	223,000,000	239,863,260
第52回利付国債(20年)	330,000,000	360,884,700
第54回利付国債(20年)	315,000,000	347,432,400
第56回利付国債(20年)	290,000,000	313,594,400
第58回利付国債(20年)	270,000,000	288,721,800
第59回利付国債(20年)	320,000,000	334,976,000
第61回利付国債(20年)	210,000,000	203,374,500
第63回利付国債(20年)	216,000,000	227,558,160

第64回利付国債（20年）	330,000,000	350,727,300	
第65回利付国債（20年）	380,000,000	403,202,800	
第70回利付国債（20年）	390,000,000	435,021,600	
第72回利付国債（20年）	530,000,000	571,128,000	
第74回利付国債（20年）	418,000,000	449,421,060	
第75回利付国債（20年）	490,000,000	525,887,600	
第78回利付国債（20年）	560,000,000	585,900,000	
第82回利付国債（20年）	583,000,000	623,320,280	
第84回利付国債（20年）	604,000,000	636,537,480	
第85回利付国債（20年）	632,000,000	673,301,200	
第88回利付国債（20年）	589,000,000	641,956,990	
第90回利付国債（20年）	498,000,000	535,270,320	
第92回利付国債（20年）	685,000,000	725,716,400	
第93回利付国債（20年）	657,000,000	685,303,560	
第95回利付国債（20年）	686,000,000	742,889,980	
第97回利付国債（20年）	570,000,000	608,207,100	
第99回利付国債（20年）	674,000,000	707,814,580	
第100回利付国債（20年）	633,000,000	673,366,410	
第102回利付国債（20年）	720,000,000	785,923,200	
第105回利付国債（20年）	707,000,000	739,288,690	
第107回利付国債（20年）	763,000,000	796,098,940	
第109回利付国債（20年）	780,000,000	788,892,000	
第111回利付国債（20年）	853,000,000	900,588,870	
第113回利付国債（20年）	970,000,000	1,007,888,200	
第114回利付国債（20年）	913,000,000	947,054,900	
第116回利付国債（20年）	880,000,000	926,076,800	
第118回利付国債（20年）	280,000,000	285,499,200	
第119回利付国債（20年）	700,000,000	691,194,000	
第121回利付国債（20年）	740,000,000	741,561,400	
第122回利付国債（20年）	400,000,000	394,360,000	
第124回利付国債（20年）	1,060,000,000	1,078,136,600	

	第125回利付国債（20年）	170,000,000	178,472,800	
	第126回利付国債（20年）	140,000,000	142,315,600	
	第127回利付国債（20年）	360,000,000	360,255,600	
	国債証券 小計	113,595,000,000	118,752,125,580	
地方債証券	第1回東京都公募公債（20年）	200,000,000	202,668,000	
	第7回東京都公募公債（20年）	100,000,000	106,440,000	
	第8回東京都公募公債（30年）	100,000,000	100,435,000	
	第575回東京都公募公債	26,000,000	26,027,040	
	第586回東京都公募公債	41,000,000	41,503,890	
	第597回東京都公募公債	200,000,000	201,438,000	
	第598回東京都公募公債	100,000,000	100,541,000	
	第599回東京都公募公債	100,000,000	101,814,000	
	第603回東京都公募公債	100,000,000	103,010,000	
	第629回東京都公募公債	100,000,000	104,545,000	
	第656回東京都公募公債	300,000,000	316,275,000	
	第660回東京都公募公債	200,000,000	211,748,000	
	第668回東京都公募公債	200,000,000	210,490,000	
	第681回東京都公募公債	200,000,000	206,682,000	
	平成13年度第4回北海道公募公債	130,000,000	131,101,100	
	平成16年度第11回北海道公募公債	100,000,000	103,137,000	
	平成18年度第8回北海道公募公債（5年）	100,000,000	100,563,000	
	平成19年度第9回北海道公募公債	200,000,000	212,204,000	
	第7回神奈川県公募公債（20年）	200,000,000	211,726,000	
	第24回神奈川県公募公債（5年）	100,000,000	100,873,000	
	第120回神奈川県公募公債	100,000,000	100,705,000	
	第147回神奈川県公募公債	200,000,000	216,302,000	
	第31回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	101,438,000	
	第44回大阪府公募公債（5年）	200,000,000	204,662,000	
	第263回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,543,000	
	第273回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,415,000	



第297回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,525,000	
第311回大阪府公募公債（10年）	250,000,000	265,157,500	
平成14年度第2回京都府公募公債	100,000,000	101,174,000	
平成15年度第3回京都府公募公債	100,000,000	103,069,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	100,000,000	103,924,000	
平成16年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	103,725,000	
平成16年度第13回兵庫県公募公債	100,000,000	103,246,000	
平成17年度第4回兵庫県公募公債	200,000,000	206,886,000	
平成19年度第18回兵庫県公募公債	100,000,000	105,536,000	
平成13年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	100,405,000	
平成14年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	101,284,000	
平成15年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	102,669,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	107,237,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	106,548,000	
平成14年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	101,029,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	209,756,000	
平成16年度第2回広島県公募公債	100,000,000	104,154,000	
平成14年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	101,263,000	
平成17年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	208,186,000	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	107,857,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	146,000,000	153,698,580	
平成17年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	104,785,000	
平成21年度第13回福岡県公募公債	200,000,000	200,922,000	
平成17年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,556,000	
平成18年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	107,150,000	
第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,864,000	
第4回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,793,000	
第14回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,462,000	
第17回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,286,000	
第20回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,836,000	
第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,399,000	

	第30回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,709,000	
	第31回共同発行市場公募地方債	100,500,000	105,128,025	
	第36回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,720,000	
	第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,446,000	
	第40回共同発行市場公募地方債	200,000,000	216,212,000	
	第47回共同発行市場公募地方債	300,000,000	320,748,000	
	第51回共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,394,000	
	第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,475,000	
	第75回共同発行市場公募地方債	300,000,000	317,304,000	
	平成14年度第3回大阪市公募公債	125,000,000	126,395,000	
	平成17年度第10回大阪市公募公債	192,500,000	201,070,100	
	平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	106,804,000	
	平成21年度第4回大阪市公募公債	200,000,000	209,918,000	
	第12回こ号名古屋市公募公債	100,000,000	101,107,000	
	第12回あ号名古屋市公募公債	100,000,000	101,011,000	
	第464回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	105,915,000	
	平成21年度第1回京都市公募公債	100,000,000	104,795,000	
	平成15年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	102,704,000	
	第16回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	106,691,000	
	平成17年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	314,451,000	
	平成14年度第7回札幌市公募公債	100,000,000	100,844,000	
	平成16年度第2回札幌市公募公債	100,000,000	103,722,000	
	平成15年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	103,017,000	
	平成16年度第6回福岡市公募公債	100,000,000	103,321,000	
	平成18年度第4回福岡市公募公債	100,000,000	106,676,000	
	平成16年度第1回広島市公募公債	100,000,000	103,571,000	
	地方債証券 小計	11,211,000,000	11,672,816,235	
特殊債券	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	500,000,000	522,130,000	
	第7回政府保証日本政策投資銀行債券	103,000,000	105,846,920	
	第7回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,850,000	

第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,564,000	
第16回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,575,000	
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,888,000	
第39回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,384,000	
第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,016,000	
第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,424,000	
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	214,288,000	
第10回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	323,307,000	
第14回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	190,000,000	203,632,500	
第16回道路債券	200,000,000	202,398,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	195,234,000	
第27回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	214,154,000	
第27回道路債券	100,000,000	109,433,000	
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	319,650,000	
第32回道路債券	100,000,000	109,366,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,684,000	
第42回道路債券	100,000,000	106,332,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	317,715,000	
第52回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,128,000	
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	320,397,000	
第79回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,147,000	
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,863,000	
第313回政府保証道路債券	200,000,000	202,798,000	
第314回政府保証道路債券	100,000,000	101,219,000	
第323回政府保証道路債券	100,000,000	103,107,000	
第326回政府保証道路債券	100,000,000	103,100,000	
第327回政府保証道路債券	150,000,000	155,190,000	
第328回政府保証道路債券	100,000,000	103,554,000	
第331回政府保証道路債券	200,000,000	209,484,000	
第337回政府保証道路債券	100,000,000	103,498,000	
第1回公営企業債券（5年）	100,000,000	101,345,000	

第2回公営企業債券	200,000,000	202,524,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	733,306,000	
第4回公営企業債券(20年)	200,000,000	213,562,000	
第9回公営企業債券	100,000,000	103,391,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	110,851,000	
第19回公営企業債券	100,000,000	107,188,000	
第22回公営企業債券(20年)	200,000,000	213,306,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	107,526,000	
第804回政府保証公営企業債券	3,000,000	3,002,430	
第809回政府保証公営企業債券	20,000,000	20,126,800	
第813回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,008,000	
第820回政府保証公営企業債券	3,000,000	3,045,060	
第823回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,987,000	
第824回政府保証公営企業債券	200,000,000	202,054,000	
第828回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,572,000	
第831回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,091,000	
第840回政府保証公営企業債券	200,000,000	207,792,000	
第851回政府保証公営企業債券	400,000,000	414,628,000	
第858回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,832,000	
第860回政府保証公営企業債券	300,000,000	316,278,000	
第861回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,483,000	
第863回政府保証公営企業債券	400,000,000	430,336,000	
第875回政府保証公営企業債券	300,000,000	319,878,000	
第876回政府保証公営企業債券	101,000,000	108,921,430	
第882回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,107,000	
第7回首都高速道路債券	100,000,000	102,794,000	
第193回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	207,666,000	
第195回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	207,544,000	
第4回阪神高速道路債券	100,000,000	101,111,000	
第136回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	102,748,000	
第12回中小企業債券	100,000,000	105,348,000	

第176回政府保証中小企業債券	100,000,000	103,058,000	
第184回政府保証中小企業債券	100,000,000	103,696,000	
第12回国際協力銀行債券	100,000,000	103,402,000	
第29回国際協力銀行債券	100,000,000	106,628,000	
第12回都市再生債券	100,000,000	100,620,000	
第341回東京交通債券	100,000,000	104,299,000	
第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	104,656,000	
第6回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	105,099,000	
第140回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,661,000	
第143回政府保証預金保険機構債券	200,000,000	201,656,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	50,674,000	52,533,229	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	39,358,000	39,971,984	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	55,597,000	57,807,536	
第2回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,943,000	26,909,376	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	40,678,000	41,501,322	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	40,696,000	42,013,736	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	45,086,000	46,258,686	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	48,589,000	51,093,762	
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,894,000	37,091,064	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	49,582,000	52,101,757	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	50,545,000	52,812,954	
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	38,088,000	38,761,776	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	50,622,000	53,000,221	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,319,000	40,761,702	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	52,159,000	54,483,726	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	45,867,000	46,858,644	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	74,616,000	76,997,742	
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,922,000	50,503,648	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,250,000	90,733,355	
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	63,032,000	63,983,783	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	67,870,000	68,888,050	

第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,580,000	92,375,295	
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	68,845,000	70,305,202	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	67,382,000	69,201,987	
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,795,000	95,890,830	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	66,546,000	68,455,870	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	66,790,000	70,543,598	
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	66,036,000	69,430,910	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,820,000	97,833,694	
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	65,459,000	68,887,742	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,444,000	99,954,130	
第48回貸付債権担保住宅金融公庫債券	69,658,000	73,400,027	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,935,000	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,493,000	73,855,516	
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	58,377,000	60,709,161	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	75,151,000	77,355,930	
第12回政府保証国民生活債券	137,000,000	141,218,230	
第5回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,430,000	
い第681号商工債	100,000,000	100,816,000	
い第697号商工債	100,000,000	102,418,000	
い第698号商工債	200,000,000	205,004,000	
い第707号商工債	100,000,000	102,789,000	
い第681号農林債	400,000,000	403,096,000	
い第688号農林債	400,000,000	405,344,000	
い第698号農林債	100,000,000	102,438,000	
い第704号農林債	100,000,000	102,399,000	
い第707号農林債	200,000,000	205,406,000	
い第709号農林債	100,000,000	102,223,000	
い第712号農林債	100,000,000	101,531,000	
第589回あおぞら債	200,000,000	200,866,000	
第243回信金中金債（5年）	100,000,000	100,944,000	
第219回信金中金債（5年）	200,000,000	203,060,000	

	第223回信金中金債(5年)	200,000,000	204,796,000	
	第225回信金中金債(5年)	200,000,000	204,254,000	
	第230回信金中金債(5年)	100,000,000	102,323,000	
	第236回信金中金債(5年)	200,000,000	203,120,000	
	第237回信金中金債(5年)	100,000,000	101,887,000	
	第2回韓国中小企業銀行	100,000,000	100,545,000	
	第16回政府保証東日本高速道路債券	200,000,000	206,932,000	
	第1回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	206,416,000	
	第5回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	207,424,000	
	特殊債券 小計	17,915,763,000	18,597,365,315	
社債券	第11回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク	100,000,000	100,336,000	
	第12回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	100,000,000	102,874,000	
	第2回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	102,520,000	
	第3回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	102,988,000	
	第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	103,873,000	
	第7回シティグループ・インク円貨社債(2002)	200,000,000	201,934,000	
	第11回シティグループ・インク円貨社債(2003)	100,000,000	99,946,000	
	第15回シティグループ・インク円貨債券	100,000,000	100,422,000	
	第6回ザ・ベアー・スターンズ・カンパニーズ・インク	100,000,000	100,419,000	
	第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	100,000,000	101,889,000	
	第4回パークレイズ・バンク・ピーエルシー円貨社債(2010)	100,000,000	100,441,000	
	第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債(2011)	100,000,000	99,907,000	
	第10回コペラティブ・セントラル・ライフイゼン・ボレンソーンバンク・ピー・エー	200,000,000	199,898,000	
	第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債(2010)	100,000,000	101,107,000	
	H S B C 銀行 P L C 第1回円貨社債	100,000,000	102,191,000	
	H S B C 銀行 P L C 第2回円貨社債	100,000,000	100,540,000	
	第1回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,344,000	
	第4回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	101,526,000	
	第1回株式会社三越伊勢丹ホールディングス無担保社債	100,000,000	99,990,000	
	第23回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,820,000	

第33回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	105,909,000	
第38回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,895,000	
第4回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,001,000	
第8回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,650,000	
第30回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	114,784,000	
第46回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	106,444,000	
第11回ジェイエフイーホールディングス株式会社	100,000,000	102,016,000	
第50回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	100,268,000	
第45回日本電気株式会社無担保社債	100,000,000	99,980,000	
第10回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,562,000	
第25回シャープ株式会社無担保社債	100,000,000	102,555,000	
第12回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,305,000	
第20回三洋電機株式会社無担保社債	100,000,000	104,918,000	
第20回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,340,000	
第22回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	107,076,000	
第1回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	114,217,000	
第3回凸版印刷株式会社無担保社債	100,000,000	102,576,000	
第49回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	109,101,000	
第54回丸紅株式会社無担保社債	200,000,000	201,222,000	
第53回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	104,146,000	
第18回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,194,000	
第33回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,280,000	
第64回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,979,000	
第38回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	99,632,000	
第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	106,619,000	
第4回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	300,000,000	302,076,000	
第14回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	102,759,000	
第15回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	204,878,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	98,354,000	
第57回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	107,821,000	
第72回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	102,773,000	



第92回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,611,000	
第104回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	308,211,000	
第6回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,685,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	109,097,000	
第2回株式会社ふくおかフィナンシャルグループ無担保社債	100,000,000	101,853,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,828,000	
第4回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	103,182,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	104,188,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	106,836,000	
第42回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	202,578,000	
第47回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,588,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	105,052,000	
第16回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	99,632,000	
第10回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	202,370,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	106,326,000	
第41回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,103,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	103,434,000	
第118回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,178,000	
第10回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,263,000	
第15回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	104,227,000	
第22回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,852,000	
第27回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	106,572,000	
第62回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,140,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,726,000	
第66回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,880,000	
第59回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,555,000	
第68回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,543,000	
第29回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	107,438,000	
第22回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	115,758,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	115,608,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	109,996,000	

第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	103,113,000	
第32回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,784,000	
第35回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,499,000	
第10回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,764,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	108,325,000	
第13回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,252,000	
第19回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,234,000	
第40回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,386,000	
第46回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,216,000	
第48回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	207,694,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	105,027,000	
第2回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,009,000	
第16回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	102,323,000	
第425回東京電力株式会社社債	100,000,000	86,306,000	
第457回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	73,559,000	
第489回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,592,000	
第506回東京電力株式会社社債（一般担保付）	110,000,000	92,350,500	
第528回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	146,372,000	
第536回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	73,903,000	
第541回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	170,450,000	
第547回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	72,531,000	
第406回中部電力株式会社社債	100,000,000	111,537,000	
第469回中部電力株式会社社債	300,000,000	306,903,000	
第433回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,789,000	
第448回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,373,000	
第466回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,769,000	
第470回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,201,000	
第306回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	113,815,000	
第337回中国電力株式会社社債（一般担保付）	43,000,000	43,437,740	
第279回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	270,000,000	278,337,600	
第383回東北電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	221,146,000	

	第253回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	90,712,000	
	第343回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	111,143,000	
	第388回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,668,000	
	第292回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,714,000	
	第10回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,916,000	
	第12回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,921,000	
	第20回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,001,000	
	第24回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,564,000	
	第19回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	106,078,000	
	第20回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,539,000	
	社債券 小計	14,123,000,000	14,357,858,840	
	合計		163,380,165,970	

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

平成23年7月29日現在

資産総額	19,539,549,423 円
負債総額	12,302,815 円
純資産総額( - )	19,527,246,608 円
発行済口数	17,098,448,436 口
1口当たり純資産額( / )	1.1420 円
( 1万口当たり純資産額	11,420 円)

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンド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等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券は発行されません。

### イ 名義書換

該当事項はありません。

### ロ 受益者名簿

作成しません。

### ハ 受益者に対する特典

ありません。

### ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

#### (イ) 受益権の譲渡

- a . 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かかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b . 上記 a の申請のある場合には、上記 a の振替機関等は、当該譲渡にかか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 a 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。）に社振法の規定に従い、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。
- c . 上記 a 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かか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得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。

#### (ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、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。

### ホ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議の上、社振法に定めるところに従い、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。

### ヘ 償還金

償還金は、原則として、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に支払い

ます。

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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け、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従って取り扱われます。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### イ 資本金の額および株式数

	平成23年7月29日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

##### ロ 最近5年間における資本金の額の増減

該当ありません。

##### ハ 会社の機構

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

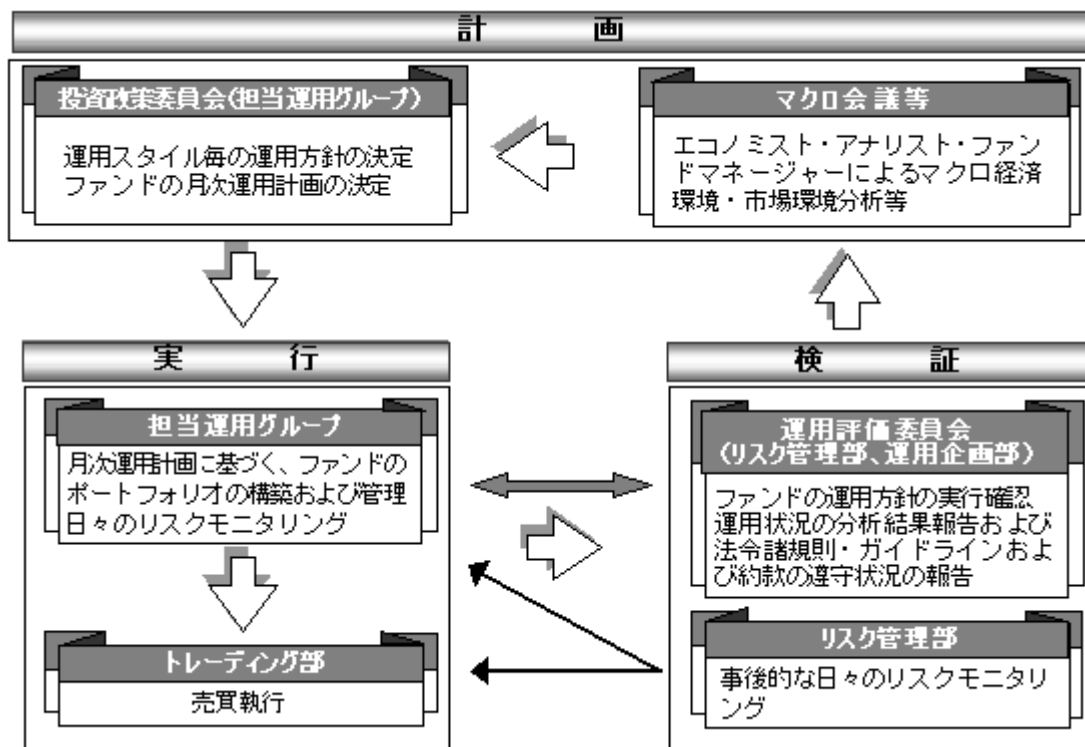
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名のほか、取締役副社長、専務取締役、常務取締役を若干名選定することができます。

##### ニ 投資信託の運用の流れ



## 2【事業の内容及び営業の概況】

「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23年7月29日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成23年7月29日現在、単位：百万円）

		本数	純資産総額
株式投資信託	単位型	54 ( 1 )	84,660 ( 189 )
	追加型	285 ( 131 )	4,845,660 ( 3,090,742 )
	計	339 ( 132 )	4,930,320 ( 3,090,931 )
公社債投資信託	単位型	0 ( 0 )	0 ( 0 )
	追加型	0 ( 0 )	0 ( 0 )
	計	0 ( 0 )	0 ( 0 )
合計		339 ( 132 )	4,930,320 ( 3,090,931 )

( )内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

### 3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、第25期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しており、第26期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）については、改正後の「財務諸表等規則」並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、第25期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、あずさ監査法人の監査を受けており、第26期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。  
なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年7月1日付をもって、名称を有限責任 あずさ監査法人に変更しております。



## （１）【貸借対照表】

（単位：千円）

		第 25 期 （平成22年 3月31日現在）	第 26 期 （平成23年 3月31日現在）
（資産の部）			
流動資産			
現金及び預金	2	15,484,883	17,127,600
有価証券		2,999,185	3,999,722
前払費用		248,594	264,910
未収入金		6,524	607,623
未収委託者報酬		3,405,895	3,712,698
未収運用受託報酬		456,672	326,523
未収投資助言報酬	2	426,716	412,606
未収収益		7,020	27,051
繰延税金資産		244,770	241,975
その他の流動資産		1,392	1,299
流動資産計		23,281,654	26,722,012
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	173,574	148,698
器具備品		150,631	232,209
有形固定資産合計		324,206	380,907
無形固定資産			
電話加入権	1	150	138
商標権		6,160	4,216
無形固定資産合計		6,310	4,354
投資その他の資産			
投資有価証券		6,923,150	4,980,828
関係会社株式		236,178	234,921
長期差入保証金		681,764	681,432
長期前払費用		7,822	10,561
会員権		20,113	20,113
繰延税金資産		524,820	606,449
投資その他の資産合計		8,393,850	6,534,307
固定資産計		8,724,367	6,919,569
資産合計		32,006,022	33,641,581

	第 25 期 (平成22年 3月31日現在)	第 26 期 (平成23年 3月31日現在)
( 負 債 の 部 )		
流動負債		
預り金	46,362	47,190
未払金		
未払収益分配金	943	681
未払償還金	18,453	21,638
未払手数料	2 1,523,402	1,971,626
その他未払金	71,728	64,551
未払費用	869,497	824,240
未払消費税等	74,053	126,666
未払法人税等	1,264,485	1,004,164
賞与引当金	293,651	327,914
流動負債計	4,162,578	4,388,674
固定負債		
退職給付引当金	1,137,766	1,310,821
固定負債計	1,137,766	1,310,821
負債合計	5,300,344	5,699,496
( 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	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	14,172,932	15,381,398
利益剰余金合計	15,994,137	17,202,602
株主資本計	26,623,121	27,831,586
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	82,556	110,498
評価・換算差額等計	82,556	110,498
純資産合計	26,705,677	27,942,085
負債・純資産合計	32,006,022	33,641,581

## （２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第 25 期 （自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日）	第 26 期 （自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日）
営業収益		
委託者報酬	21,113,167	27,350,519
運用受託報酬	2,492,177	2,113,027
投資助言報酬	1,893,038	1,828,087
その他営業収益		
情報提供コンサルタント業務報酬	5,000	5,000
投資法人運用受託報酬	43,853	35,635
サービス支援手数料	-	234,885
その他	12,348	26,930
営業収益計	25,559,586	31,594,086
営業費用		
支払手数料	9,706,627	14,161,927
広告宣伝費	420,508	482,728
公告費	2,339	4,634
調査費		
調査費	579,477	537,254
委託調査費	1,556,961	2,115,042
営業雑経費		
通信費	31,515	34,433
印刷費	278,539	266,803
協会費	19,271	23,235
諸会費	12,955	11,346
情報機器関連費	2,005,507	2,066,205
販売促進費	13,183	27,670
その他	66,833	79,571
営業費用計	14,693,722	19,810,852
一般管理費		
給料		
役員報酬	155,835	155,867
給料・手当	4,192,414	4,342,937
賞与	719,290	983,434
賞与引当金繰入額	293,651	327,914
交際費	19,087	21,460
寄付金	23	31
事務委託費	195,150	220,738
旅費交通費	197,842	219,278
租税公課	86,095	87,674
不動産賃借料	714,209	677,468
退職給付費用	197,352	199,545
固定資産減価償却費	97,916	100,356
諸経費	280,916	250,817
一般管理費計	7,149,786	7,587,526

営業利益

3,716,077

4,195,707

営業外収益			
受取配当金		1,710	34,115
有価証券利息		4,645	3,603
受取利息	1	16,592	7,877
為替差益		-	4,753
時効成立分配金・償還金		3,492	3,076
原稿・講演料		3,255	3,485
還付加算金		37,708	1,645
雑収入		6,291	7,033
営業外収益計		73,696	65,590
営業外費用			
為替差損		5,113	-
時効成立後支払分配金・償還金		-	659
営業外費用計		5,113	659
経常利益		3,784,660	4,260,638
特別利益			
投資有価証券償還益		2,459	7
投資有価証券売却益		31,117	71,400
特別利益計		33,577	71,407
特別損失			
固定資産除却損	2	5,302	17,318
投資有価証券償還損		-	2,679
投資有価証券評価損		51,557	-
投資有価証券売却損		2,724	20,822
関係会社株式評価損		-	1,256
特別損失計		59,583	42,077
税引前当期純利益		3,758,653	4,289,968
法人税、住民税及び事業税		1,817,726	1,852,053
法人税等調整額		722,069	93,549
法人税等合計		1,095,656	1,758,503
当期純利益		2,662,997	2,531,465

## (3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第 25 期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	第 26 期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,000	2,000,000
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	284,245	284,245
当期末残高	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		
前期末残高	60,000	60,000
当期末残高	60,000	60,000
別途積立金		
前期末残高	1,476,959	1,476,959
当期末残高	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金		
前期末残高	12,356,655	14,172,932
当期変動額		
剰余金の配当	846,720	1,323,000
当期純利益	2,662,997	2,531,465
当期変動額合計	1,816,277	1,208,465
当期末残高	14,172,932	15,381,398
利益剰余金合計		
前期末残高	14,177,860	15,994,137
当期変動額		
剰余金の配当	846,720	1,323,000
当期純利益	2,662,997	2,531,465
当期変動額合計	1,816,277	1,208,465
当期末残高	15,994,137	17,202,602
株主資本合計		
前期末残高	24,806,844	26,623,121
当期変動額		
剰余金の配当	846,720	1,323,000
当期純利益	2,662,997	2,531,465

当期変動額合計

1,816,277

1,208,465

当期末残高

26,623,121

27,831,586

評価・換算差額等		
其他有価証券評価差額金		
前期末残高	5,805	82,556
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	88,361	27,941
当期変動額合計	88,361	27,941
当期末残高	82,556	110,498
評価・換算差額合計		
前期末残高	5,805	82,556
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	88,361	27,941
当期変動額合計	88,361	27,941
当期末残高	82,556	110,498
純資産合計		
前期末残高	24,801,038	26,705,677
当期変動額		
剰余金の配当	846,720	1,323,000
当期純利益	2,662,997	2,531,465
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	88,361	27,941
当期変動額合計	1,904,639	1,236,407
当期末残高	26,705,677	27,942,085



## 重要な会計方針

項目	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
1 有価証券の評価基準及び 評価方法	満期保有目的の債券 償却原価法 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法によ り処理し、売却原価は移動平均法 により算定) 時価のないもの 移動平均法による原価法	満期保有目的の債券 同左 子会社株式及び関連会社株式 同左 その他有価証券 時価のあるもの 同左 時価のないもの 同左
2 固定資産の減価償却の方 法	有形固定資産 定率法によっております。但し、建物(建 物附属設備を除く)については、定額法に よっております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであ ります。  建物 3～50年 器具備品 3～20年  無形固定資産 定額法によっております。	有形固定資産 同左    無形固定資産 同左
3 引当金の計上基準 (1) 賞与引当金  (2) 退職給付引当金	従業員賞与の支給に充てるため、将来の 支給見込額のうち当事業年度の負担額を 計上しております。  従業員の退職金支給に備えるため、当事 業年度末における退職給付債務に基づき 計上しております。 過去勤務債務については、その発生時に おいて一時に費用処理しております。 数理計算上の差異については、その発生 時において一時に費用処理してしま す。 (会計方針の変更) 当事業年度より、「退職給付に係る会計 基準」の一部改正(その3)(企業会計 基準第19号 平成20年7月31日)を適用 しております。この変更が当事業年度の 損益に与える影響はありません。また、本 会計基準の適用に伴い発生する退職給付 債務の差額はありませぬ。	同左  従業員の退職金支給に備えるため、当事 業年度末における退職給付債務に基づき 計上しております。 過去勤務債務については、その発生時に おいて一時に費用処理しております。 数理計算上の差異については、その発生 時において一時に費用処理してしま す。
4 その他財務諸表作成のた めの基本となる重要な事項	消費税等の会計処理は税抜方式によっ ております。	同左

## 会計方針の変更

## （会計処理の変更）

第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
-	<p>資産除去債務に関する会計基準            企業会計基準第18号「資産除去債務に関する会計基準」（平成20年3月31日 企業会計基準委員会）及び企業会計基準適用指針第21号「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（同前）が平成22年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当事業年度から同会計基準及び適用指針を適用しております。            これによる損益の影響はありません。</p>

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

第25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額            建 物 172,855千円            器具備品 863,358千円            無形固定資産の減価償却累計額            電話加入権 83千円            商標権 13,282千円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額            建 物 191,415千円            器具備品 774,482千円            無形固定資産の減価償却累計額            電話加入権 95千円            商標権 15,226千円</p>
<p>2 関係会社に対する債権債務            現金及び預金 10,591,647千円            未収投資助言報酬 295,911千円            未払手数料 441,536千円</p>	<p>2 関係会社に対する債権債務            現金及び預金 11,201,422千円            未収投資助言報酬 293,061千円            未払手数料 469,104千円</p>
<p>3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。            当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。            当座貸越極度額の総額 10,000,000千円            借入実行残高 - 千円            差引額 10,000,000千円</p>	<p>3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。            当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。            当座貸越極度額の総額 10,000,000千円            借入実行残高 - 千円            差引額 10,000,000千円</p>
<p>4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額102,815千円の支払保証を行っております。</p>	<p>4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額74,617千円の支払保証を行っております。</p>

## （損益計算書関係）

第25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）
1 関係会社との取引に係るもの 受取利息 5,916千円	1 関係会社との取引に係るもの 受取利息 3,867千円
2 固定資産除却損は、器具備品5,302千円であります。	2 固定資産除却損は、建物9,847千円、器具備品7,471千円あります。

## （株主資本等変動計算書関係）

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成21年6月30日 定時株主総会	普通株式	846,720	48,000	平成21年 3月31日	平成21年 7月1日

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

平成22年6月24日開催の第25回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成22年6月24日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,323,000	75,000	平成22年 3月31日	平成22年 6月25日

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成22年6月24日 定時株主総会	普通株式	1,323,000	75,000	平成22年 3月31日	平成22年 6月25日

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

平成23年6月24日開催の第26回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成23年6月24日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,252,440	71,000	平成23年 3月31日	平成23年 6月27日

## （リース取引関係）

第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
1.オペレーティング・リース取引 (借主側) 未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円) 1年以内 667,234 1年超 1,608,004 合計 2,275,239	1.オペレーティング・リース取引 (借主側) 未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円) 1年以内 672,700 1年超 958,593 合計 1,631,293

## （金融商品関係）

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

満期保有目的の債券は、余資運用規則に基づき、短期の国債のみを対象としているため、信用リスクは僅少であります。

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

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

## 市場リスクの管理

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません（（注2）参照）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	15,484,883	15,484,883	-
(2)未収委託者報酬	3,405,895	3,405,895	-
(3)未収運用受託報酬	456,672	456,672	-
(4)未収投資助言報酬	426,716	426,716	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	2,999,185	2,999,100	85
その他有価証券	6,874,409	6,874,409	-
(6)長期差入保証金	681,764	681,764	-
資産計	30,329,527	30,329,442	85
(1)未払金			
未払手数料	1,523,402	1,523,402	-
負債計	1,523,402	1,523,402	-

## （注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

## (1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収投資助言報酬

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券については業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

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

## (6) 長期差入保証金

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

負債

## (1) 未払金

## 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

	貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	48,443
合計	48,741
子会社株式	
非上場株式	236,178
合計	236,178

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(5) その他有価証券」には含めておりません。また、上記の表中にある「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、51,557千円です。

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	15,484,883	-	-	-
未収委託者報酬	3,405,895	-	-	-
未収運用受託報酬	456,672	-	-	-
未収投資助言報酬	426,716	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	3,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち				
満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	2,289	679,475	-	-
合計	22,776,457	679,475	-	-

(追加情報)

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

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### (1) 金融商品に対する取組方針

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

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスクの管理

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

満期保有目的の債券は、余資運用規則に基づき、短期の国債のみを対象としているため、信用リスクは僅少であります。

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

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

#### 市場リスクの管理

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

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

### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません（（注2）参照）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	17,127,600	17,127,600	-
(2)未収委託者報酬	3,712,698	3,712,698	-
(3)未収運用受託報酬	326,523	326,523	-
(4)未収投資助言報酬	412,606	412,606	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	3,999,722	3,999,600	122
その他有価証券	4,932,087	4,932,087	-
(6)長期差入保証金	681,432	681,432	-
資産計	31,192,671	31,192,549	122
(1)未払金			
未払手数料	1,971,626	1,971,626	-
負債計	1,971,626	1,971,626	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収投資助言報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券については業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

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

(6) 長期差入保証金

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

負債

(1) 未払金

未払手数料

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



(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

	貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	48,443
合計	48,741
子会社株式	
非上場株式	234,921
合計	234,921

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(5) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。また、上記の表中にある「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、1,256千円です。

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	17,127,600	-	-	-
未収委託者報酬	3,712,698	-	-	-
未収運用受託報酬	326,523	-	-	-
未収投資助言報酬	412,606	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	4,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち				
満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	13,841	667,590	-	-
合計	25,593,271	667,590	-	-

## （有価証券関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

## 1．満期保有目的の債券

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの	2,999,185	2,999,100	85
小計	2,999,185	2,999,100	85
合計	2,999,185	2,999,100	85

## 2．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式236,178千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 3．その他有価証券

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	2,484,337	2,253,148	231,189
小計	2,484,337	2,253,148	231,189
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	4,390,071	4,483,035	92,963
小計	4,390,071	4,483,035	92,963
合計	6,874,409	6,736,184	138,225

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

## 4．当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,539,393	31,117	2,724

第26期(平成23年3月31日現在)

## 1. 満期保有目的の債券

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの	3,999,722	3,999,600	122
小計	3,999,722	3,999,600	122
合計	3,999,722	3,999,600	122

## 2. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式234,921千円）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。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、1,256千円です。

## 3. その他有価証券

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	3,047,395	2,801,036	246,358
小計	3,047,395	2,801,036	246,358
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	1,884,692	1,950,168	65,476
小計	1,884,692	1,950,168	65,476
合計	4,932,087	4,751,205	180,882

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

## 4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
4,845,387	71,400	20,822

(デリバティブ取引関係)

第25期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(退職給付関係)

第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	第26期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)																												
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p> <p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,137,766</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;"><u>1,137,766</u></td> </tr> </table> <p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>勤務費用</td> <td style="text-align: right;">154,625</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">14,583</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">12,466</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;"><u>15,677</u></td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;"><u>197,352</u></td> </tr> </table> <p>(注) その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p> <p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 退職給付見込額の期間配分方法 勤務期間を基準とする方法 割引率 1.5% 過去勤務債務の額の処理年数 1年(発生時において費用処理する方法) 数理計算上の差異の処理年数 1年(発生時において費用処理する方法)</p>	退職給付債務	1,137,766	退職給付引当金	<u>1,137,766</u>	勤務費用	154,625	利息費用	14,583	数理計算上の差異の費用処理額	12,466	その他	<u>15,677</u>	退職給付費用	<u>197,352</u>	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p> <p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,310,821</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;"><u>1,310,821</u></td> </tr> </table> <p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>勤務費用</td> <td style="text-align: right;">160,751</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">17,066</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">6,439</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;"><u>15,287</u></td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;"><u>199,545</u></td> </tr> </table> <p>(注) その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p> <p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 退職給付見込額の期間配分方法 勤務期間を基準とする方法 割引率 1.5% 過去勤務債務の額の処理年数 1年(発生時において費用処理する方法) 数理計算上の差異の処理年数 1年(発生時において費用処理する方法)</p>	退職給付債務	1,310,821	退職給付引当金	<u>1,310,821</u>	勤務費用	160,751	利息費用	17,066	数理計算上の差異の費用処理額	6,439	その他	<u>15,287</u>	退職給付費用	<u>199,545</u>
退職給付債務	1,137,766																												
退職給付引当金	<u>1,137,766</u>																												
勤務費用	154,625																												
利息費用	14,583																												
数理計算上の差異の費用処理額	12,466																												
その他	<u>15,677</u>																												
退職給付費用	<u>197,352</u>																												
退職給付債務	1,310,821																												
退職給付引当金	<u>1,310,821</u>																												
勤務費用	160,751																												
利息費用	17,066																												
数理計算上の差異の費用処理額	6,439																												
その他	<u>15,287</u>																												
退職給付費用	<u>199,545</u>																												

## (税効果会計関係)

第25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)																																																																																
<p>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</p> <p style="text-align: center;">(単位：千円)</p> <p>(1) 流動の部</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>賞与引当金</td><td style="text-align: right;">119,486</td></tr> <tr><td>未払社会保険料</td><td style="text-align: right;">12,746</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">100,639</td></tr> <tr><td>未払事業所税</td><td style="text-align: right;">6,089</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>5,807</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;">244,770</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;"><u>-</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;"><u>244,770</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>244,770</u></td></tr> </table> <p>(2) 固定の部</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>退職給付引当金</td><td style="text-align: right;">462,957</td></tr> <tr><td>ソフトウェア償却</td><td style="text-align: right;">111,245</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td style="text-align: right;">73,440</td></tr> <tr><td>特定外国子会社留保金額</td><td style="text-align: right;">213,896</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>8,735</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;">870,274</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;"><u>289,785</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;">580,489</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;"><u>55,668</u></td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;"><u>55,668</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>524,820</u></td></tr> </table>	賞与引当金	119,486	未払社会保険料	12,746	未払事業税	100,639	未払事業所税	6,089	その他	<u>5,807</u>	繰延税金資産計	244,770	評価性引当額	<u>-</u>	繰延税金資産合計	<u>244,770</u>	繰延税金資産の純額	<u>244,770</u>	退職給付引当金	462,957	ソフトウェア償却	111,245	投資有価証券評価損	73,440	特定外国子会社留保金額	213,896	その他	<u>8,735</u>	繰延税金資産計	870,274	評価性引当額	<u>289,785</u>	繰延税金資産合計	580,489	その他有価証券評価差額金	<u>55,668</u>	繰延税金負債合計	<u>55,668</u>	繰延税金資産の純額	<u>524,820</u>	<p>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</p> <p style="text-align: center;">(単位：千円)</p> <p>(1) 流動の部</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>賞与引当金</td><td style="text-align: right;">133,428</td></tr> <tr><td>未払社会保険料</td><td style="text-align: right;">14,807</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">83,126</td></tr> <tr><td>未払事業所税</td><td style="text-align: right;">6,378</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>4,235</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;">241,975</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;"><u>-</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;"><u>241,975</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>241,975</u></td></tr> </table> <p>(2) 固定の部</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>退職給付引当金</td><td style="text-align: right;">533,373</td></tr> <tr><td>ソフトウェア償却</td><td style="text-align: right;">141,119</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td style="text-align: right;">71,023</td></tr> <tr><td>特定外国子会社留保金額</td><td style="text-align: right;">247,489</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>4,925</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;">997,931</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;"><u>321,097</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;">676,833</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;"><u>70,383</u></td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;"><u>70,383</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>606,449</u></td></tr> </table>	賞与引当金	133,428	未払社会保険料	14,807	未払事業税	83,126	未払事業所税	6,378	その他	<u>4,235</u>	繰延税金資産計	241,975	評価性引当額	<u>-</u>	繰延税金資産合計	<u>241,975</u>	繰延税金資産の純額	<u>241,975</u>	退職給付引当金	533,373	ソフトウェア償却	141,119	投資有価証券評価損	71,023	特定外国子会社留保金額	247,489	その他	<u>4,925</u>	繰延税金資産計	997,931	評価性引当額	<u>321,097</u>	繰延税金資産合計	676,833	その他有価証券評価差額金	<u>70,383</u>	繰延税金負債合計	<u>70,383</u>	繰延税金資産の純額	<u>606,449</u>
賞与引当金	119,486																																																																																
未払社会保険料	12,746																																																																																
未払事業税	100,639																																																																																
未払事業所税	6,089																																																																																
その他	<u>5,807</u>																																																																																
繰延税金資産計	244,770																																																																																
評価性引当額	<u>-</u>																																																																																
繰延税金資産合計	<u>244,770</u>																																																																																
繰延税金資産の純額	<u>244,770</u>																																																																																
退職給付引当金	462,957																																																																																
ソフトウェア償却	111,245																																																																																
投資有価証券評価損	73,440																																																																																
特定外国子会社留保金額	213,896																																																																																
その他	<u>8,735</u>																																																																																
繰延税金資産計	870,274																																																																																
評価性引当額	<u>289,785</u>																																																																																
繰延税金資産合計	580,489																																																																																
その他有価証券評価差額金	<u>55,668</u>																																																																																
繰延税金負債合計	<u>55,668</u>																																																																																
繰延税金資産の純額	<u>524,820</u>																																																																																
賞与引当金	133,428																																																																																
未払社会保険料	14,807																																																																																
未払事業税	83,126																																																																																
未払事業所税	6,378																																																																																
その他	<u>4,235</u>																																																																																
繰延税金資産計	241,975																																																																																
評価性引当額	<u>-</u>																																																																																
繰延税金資産合計	<u>241,975</u>																																																																																
繰延税金資産の純額	<u>241,975</u>																																																																																
退職給付引当金	533,373																																																																																
ソフトウェア償却	141,119																																																																																
投資有価証券評価損	71,023																																																																																
特定外国子会社留保金額	247,489																																																																																
その他	<u>4,925</u>																																																																																
繰延税金資産計	997,931																																																																																
評価性引当額	<u>321,097</u>																																																																																
繰延税金資産合計	676,833																																																																																
その他有価証券評価差額金	<u>70,383</u>																																																																																
繰延税金負債合計	<u>70,383</u>																																																																																
繰延税金資産の純額	<u>606,449</u>																																																																																
<p>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</p> <p style="text-align: center;">(%)</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>法定実効税率</td><td style="text-align: right;">40.7</td></tr> <tr><td>(調整)</td><td></td></tr> <tr><td>評価性引当額の増減</td><td style="text-align: right;">11.6</td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td style="text-align: right;">0.2</td></tr> <tr><td>住民税均等割等</td><td style="text-align: right;">0.1</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>0.2</u></td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td style="text-align: right;"><u>29.1</u></td></tr> </table>	法定実効税率	40.7	(調整)		評価性引当額の増減	11.6	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	住民税均等割等	0.1	その他	<u>0.2</u>	税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>29.1</u>	<p>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</p> <p style="text-align: center;">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、記載を省略しております。</p>																																																																		
法定実効税率	40.7																																																																																
(調整)																																																																																	
評価性引当額の増減	11.6																																																																																
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2																																																																																
住民税均等割等	0.1																																																																																
その他	<u>0.2</u>																																																																																
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>29.1</u>																																																																																

## （資産除去債務関係）

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	27,350,519	2,113,027	1,828,087	302,451	31,594,086

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## （追加情報）

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

## (関連当事者情報)

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府 大阪市 中央区	199,000,000	生命保険業	(被所有)% 直接 40	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,125,661	未収投資助言報酬	295,911
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有)% 直接 27.5	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,495,661	未払手数料	347,340

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投資助言契約の受託については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

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

## 2. その他の関係会社の子会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	日興コーディアル証券(株)	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託	委託販売手数料	1,019,546	未払手数料	238,828

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府 大阪市 中央区	210,000,000	生命保険業	(被所有)% 直接 40	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,130,782	未収投資助言報酬	293,061
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有)% 直接 27.5	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,558,604	未払手数料	374,320

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投資助言契約の受託については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

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

2. その他の関係会社の子会社等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	日興コーディアル証券(株)	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託	委託販売手数料	2,174,385	未払手数料	110,182

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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



## （ 1株当たり情報）

第25期 （自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）	第26期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）
1株当たり純資産額 1,513,927円30銭 1株当たり当期純利益 150,963円55銭	1株当たり純資産額 1,584,018円42銭 1株当たり当期純利益 143,507円12銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
（1株当たり純資産額の算定上の基礎） 貸借対照表の純資産の部の合計額 26,705,677千円 普通株式に係る純資産額 26,705,677千円 普通株式の発行済株式数 17,640株 1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 17,640株	（1株当たり純資産額の算定上の基礎） 貸借対照表の純資産の部の合計額 27,942,085千円 普通株式に係る純資産額 27,942,085千円 普通株式の発行済株式数 17,640株 1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 17,640株
（1株当たり当期純利益の算定上の基礎） 損益計算書上の当期純利益 2,662,997千円 普通株式に係る当期純利益 2,662,997千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 17,640株	（1株当たり当期純利益の算定上の基礎） 損益計算書上の当期純利益 2,531,465千円 普通株式に係る当期純利益 2,531,465千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 17,640株

## （重要な後発事象）

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

該当事項はありません。

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

該当事項はありません。

#### 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。

- イ 自己またはその取締役も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、もしくは取引の公正を害し、また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。)
- ロ 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、もしくは取引の公正を害し、また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。)
- ハ 通常の取引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。以下同じ。）または子法人等（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または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等また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、運用財産の額も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。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等また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、もしくは取引の公正を害し、また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】

- イ 定款の変更、その他の重要事項  
平成23年6月24日に開催された定時株主総会において、監査体制の見直しにより監査役の員数を1名減員し4名以内とする定款の変更が決議されました。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実  
該当ありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

（イ）名称 中央三井アセット信託銀行株式会社

（ロ）資本金の額 11,000百万円（平成23年3月末現在）

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

#### 【参考情報：再信託受託会社の概要】

・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

・ 資本金の額 51,000百万円（平成23年3月末現在）

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

ロ 販売会社

（イ）名称	（ロ）資本金の額	（ハ）事業の内容
株式会社みずほコーポレート銀行	1,404,065百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	
三井住友海上火災保険株式会社	139,595百万円	保険業法に基づき、損害保険業を営んでいます。
住友生命保険相互会社	439,000百万円	
三井生命保険株式会社	167,280百万円	

資本金の額は、平成23年3月末現在。

住友生命保険相互会社の資本金の額は、平成23年3月末現在の基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。

### 2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、一部解約の実行の請求の受付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

### 3【資本関係】

販売会社である住友生命保険相互会社は、委託会社株式を7,056株（持株比率40.0%）保有しています。

販売会社である三井住友海上火災保険株式会社は、委託会社株式を4,851株（持株比率27.5%）保有しています。

販売会社である株式会社三井住友銀行は、委託会社株式を4,851株（持株比率27.5%）保有しています。

販売会社である三井生命保険株式会社は、委託会社株式を882株（持株比率5.0%）保有しています。

### 第3【その他】

- 1．目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案およびキャッチコピーを採用すること、ファンドの形態、申込みにかかる事項、委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該目論見書の使用開始日などを記載することがあります。
- 2．目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。
- 3．目論見書に当ファンドの信託約款を掲載すること、および投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- 4．目論見書は、電子媒体等として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。
- 5．有価証券届出書の表紙記載情報を抜粋して、目論見書に記載することがあります。
- 6．目論見書の冒頭または巻末に届出書記載内容に関連する用語集を掲載することがあります。
- 7．評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

平成23年8月22日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンドの平成22年6月22日から平成23年6月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンドの平成23年6月20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。

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

以上

- 
- (注) 1. 上記は、当社が、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いません。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成22年8月10日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンドの平成21年6月23日から平成22年6月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンドの平成22年6月21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。

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

以上

- 
- (注) 1. 上記は、当社が、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いません。

[委託会社の監査報告書\(前期\)へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成23年 6月17日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 辰巳 幸久 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第26期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成23年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

---

上記は、当社が、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。

## 独立監査人の監査報告書

平成22年 6月18日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員      公認会計士      鈴木 敏夫 印  
業務執行社員指 定 社 員      公認会計士      辰巳 幸久 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

---

上記は、当社が、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。