

【表紙】	
【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成22年12月15日提出
【計算期間】	第8期（自 平成21年10月1日 至 平成22年9月30日）
【ファンド名】	すみしん DC日本債券インデックス・オープンS （以下「本ファンド」または「当ファンド」ということがあります。）
【発行者名】	住信アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 平 田 誠 一
【本店の所在の場所】	東京都中央区八重洲2丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投信業務部長 橋 詰 廣 志
【連絡場所】	東京都中央区八重洲2丁目3番1号
【電話番号】	03-6259-3801
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

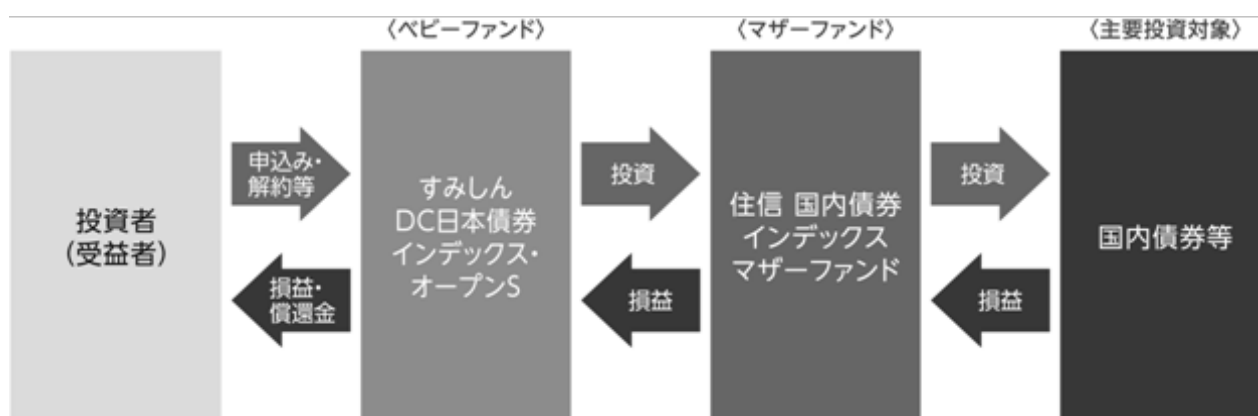
わが国の公社債を中心に投資を行い、ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス（総合）（以下「NOMURA-BPI 総合」ということがあります。）に連動する投資成果を目指します。

なお、信託金の限度額は、3,000億円とします。ただし、委託者は、受託者と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

ファンドの特色

1. わが国の公社債を主要投資対象とし、ファミリーファンド方式で運用を行います。

ファンドのしくみ



※マザーファンドの運用にあたっては、企業年金の運用等で国内外から定評のある住友信託銀行からモデルポートフォリオの提示等の投資助言を受けます。

? ファミリーファンド方式とは

ファミリーファンド方式とは、投資者の皆様からお預かりした資金を、ベビーファンドごとにまとめ、そ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、実質的な運用をマザーファンドで行うしくみです。

〈マザーファンドの概要〉

マザーファンド	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
住信 国内債券インデックス マザーファンド	わが国の公社債	この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI 総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. NOMURA-BPI 総合に連動する投資成果を目指します。

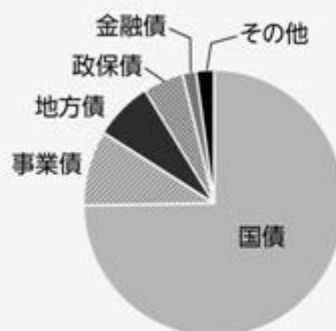
?

NOMURA-BPI総合とは

インデックスの概要
(2010年10月29日現在)

構成国	1ヶ国(日本)
構成銘柄数	6,650銘柄
時価総額	約672兆円

公社債種別構成比



国債	74.8%
事業債	9.3%
地方債	7.1%
政保債	4.9%
金融債	1.7%
その他	2.3%

(出所)野村證券株式会社のデータをもとに住信アセットマネジメント作成

※公社債種別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。

※「ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス(総合) (NOMURA-BPI 総合)」とは、野村證券株式会社(野村證券株)が、国内で発行された公募利付債券の流通市場全体の動向を的確に表すために開発した経過利子込時価総額加重型の投資収益指数です。NOMURA-BPI 総合は、野村證券株の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、野村證券株が有しています。なお、野村證券株は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

3. 毎決算時に分配を行います。

分配方針

- ・ 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益等の全額とします。
- ・ 原則として、毎年 9 月 30 日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、収益の分配を行います。
- ・ 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。市況動向の影響を受けて変動するため、あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。

!

主な投資制限

- ・ 外貨建資産への投資は行いません。

資金動向および市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用ができない場合があります。

【ファンドの商品分類】

本ファンドは、社団法人投資信託協会が定める分類方法において、以下のように分類・区分されます。

本ファンドの商品分類・属性区分に該当しない定義につきましては、社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

①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
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
		不動産投信	
		その他資産	
		()	
	内外	資産複合	特殊型

（注）本ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

[分類における定義]

分類項目	該当分類	分類の定義
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	目論見書または投資信託約款において、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	目論見書または投資信託約款において、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	目論見書または投資信託約款において、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。

②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225
	年2回	日本		
	年4回	北米		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
		オセアニア	ファンド・オブ・ファンズ	TOPIX
		中南米		
不動産投信	日々	アフリカ		
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))	その他 ()	中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				その他 (NOMURA-BPI 総合)

(注) 本ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

【区分における定義】

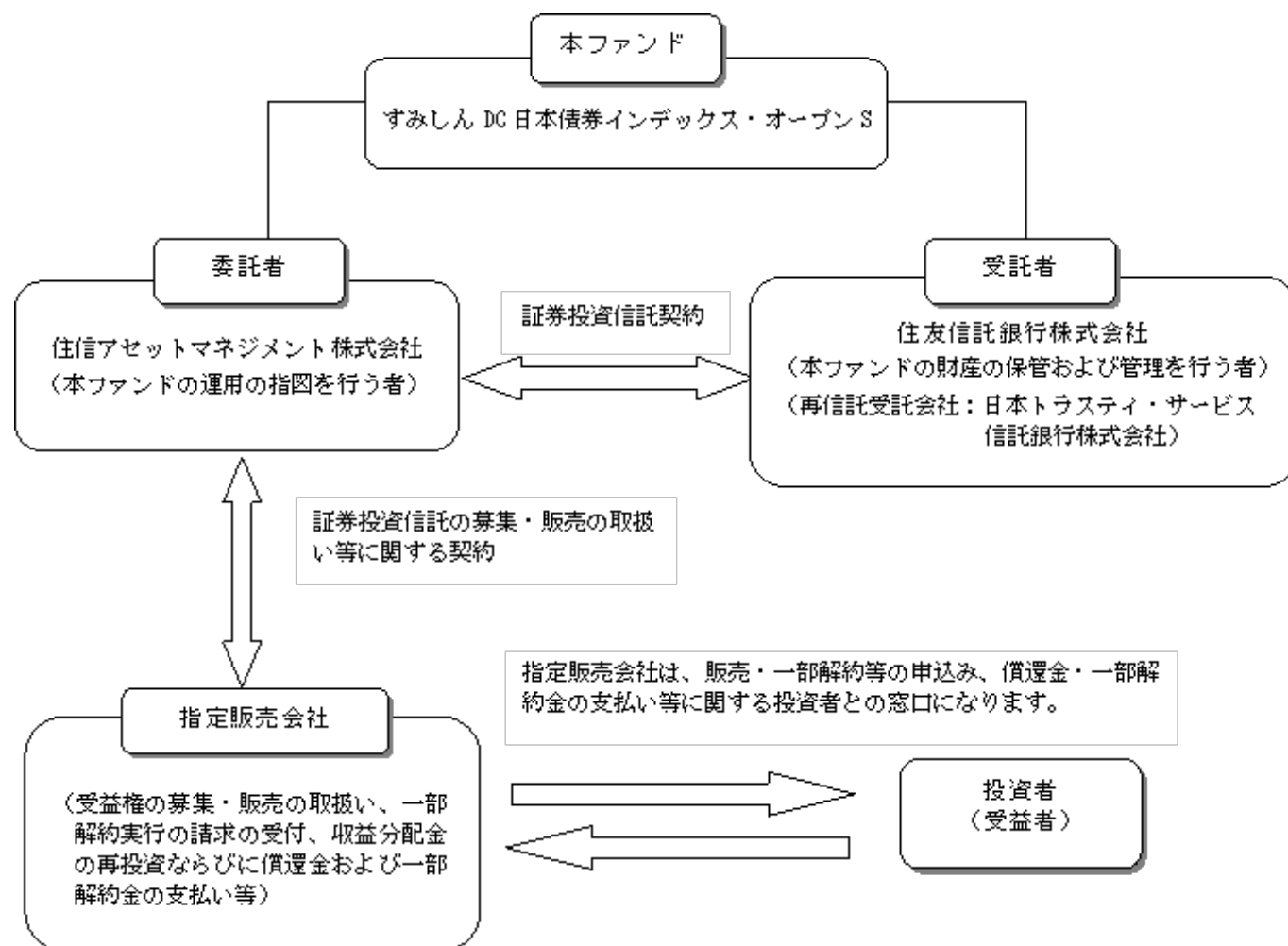
区分項目	該当区分	定義
投資対象資産	その他資産 (投資信託証券(債券 一般))	目論見書または投資信託約款において、組入れている資産が主として投資信託証券であり(投資形態がファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズのものをいいます。)、実質的に主として債券 一般(公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。)に投資する旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	日本	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資する旨の記載があるものをいいます。
対象インデックス	その他 (NOMURA-BPI 総合)	目論見書または投資信託約款において、日経225またはTOPIXにあてはまらない指数(本ファンドにおいては、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。

(2) 【ファンドの沿革】

平成12年5月30日	本ファンドの主要投資対象である「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の投資信託契約締結、設定、運用開始
平成15年2月3日	本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

(イ) 本ファンドの関係法人図



(ロ) 委託会社が関係法人と締結している契約等の概要

①受託者との投資信託契約

受託者とは、受益者の利殖に資する目的で、投資信託約款の通り投資信託契約を締結しております。

②指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約

委託者は、指定販売会社に対し、次の業務を委託し、指定販売会社はこれを引き受けます。

- 1) 受益権の募集・販売の取扱い
- 2) 追加設定の申込受付事務
- 3) 受益者に対する収益分配金の再投資事務
- 4) 受益者に対する一部解約等の事務
- 5) 受益者に対する一部解約金および償還金の支払事務
- 6) 受益者に対する運用報告書の交付
- 7) その他前記の業務に付随する業務

指定販売会社によって引き受ける業務が異なる場合があります。

(ハ) 委託会社等の概況

①資本金

平成22年10月29日現在 3億円

②会社の沿革

昭和61年11月 1日	住信キャピタルマネジメント株式会社設立
昭和62年 2月20日	投資顧問業の登録
昭和62年 9月 9日	投資一任契約に係る業務の認可
平成 2年10月 1日	住信投資顧問株式会社に商号変更
平成11年 2月15日	住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
平成11年 3月25日	証券投資信託委託業の認可
平成19年 9月30日	金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録 (登録番号：関東財務局長（金商）第347号）

③大株主の状況（平成22年10月29日現在）

名 称	住 所	持株数	持株比率
住友信託銀行株式会社	大阪府大阪市中央区北浜4-5-33	1,800株	30.0%
すみしん不動産株式会社	東京都中央区八重洲2-3-1	1,500株	25.0%
住信保証株式会社	東京都中央区日本橋本町4-11-5	1,200株	20.0%
住信カード株式会社	東京都中央区日本橋本町4-11-5	1,200株	20.0%
住信情報サービス株式会社	大阪府豊中市新千里西町1-1-3	300株	5.0%
合計		6,000株	100.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

(イ) 基本方針

本ファンドは、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

(ロ) 運用方法

①投資対象

住信 国内債券インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。なお、債券等に直接投資することもあります。

②投資態度

- 1)主として、マザーファンド受益証券に投資し、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 2)運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の実質組入総額と債券先物取引等の買建玉の実質時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 3)ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- 4)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、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけ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、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

5)投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引および金利先渡し取引を行うことができます。

（参考）「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1.基本方針

この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2.運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

- ①NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ③ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ④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、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけ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、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- ⑤投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引および金利先渡し取引を行うことができます。

3.運用制限

- ①同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ③外貨建資産への投資は、行いません。

(2)【投資対象】

（イ）本ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。）

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

（ロ）委託者は、信託金を主として住信アセットマネジメント株式会社を委託者とし、住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに次に掲げる有価証券（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くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）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. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（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係る優先出資証券（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. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券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、有価証券に係るものに限ります。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第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号までの証券および第12号ならびに第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、および第14号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

(ハ) 委託者は、信託金を、前記（ロ）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

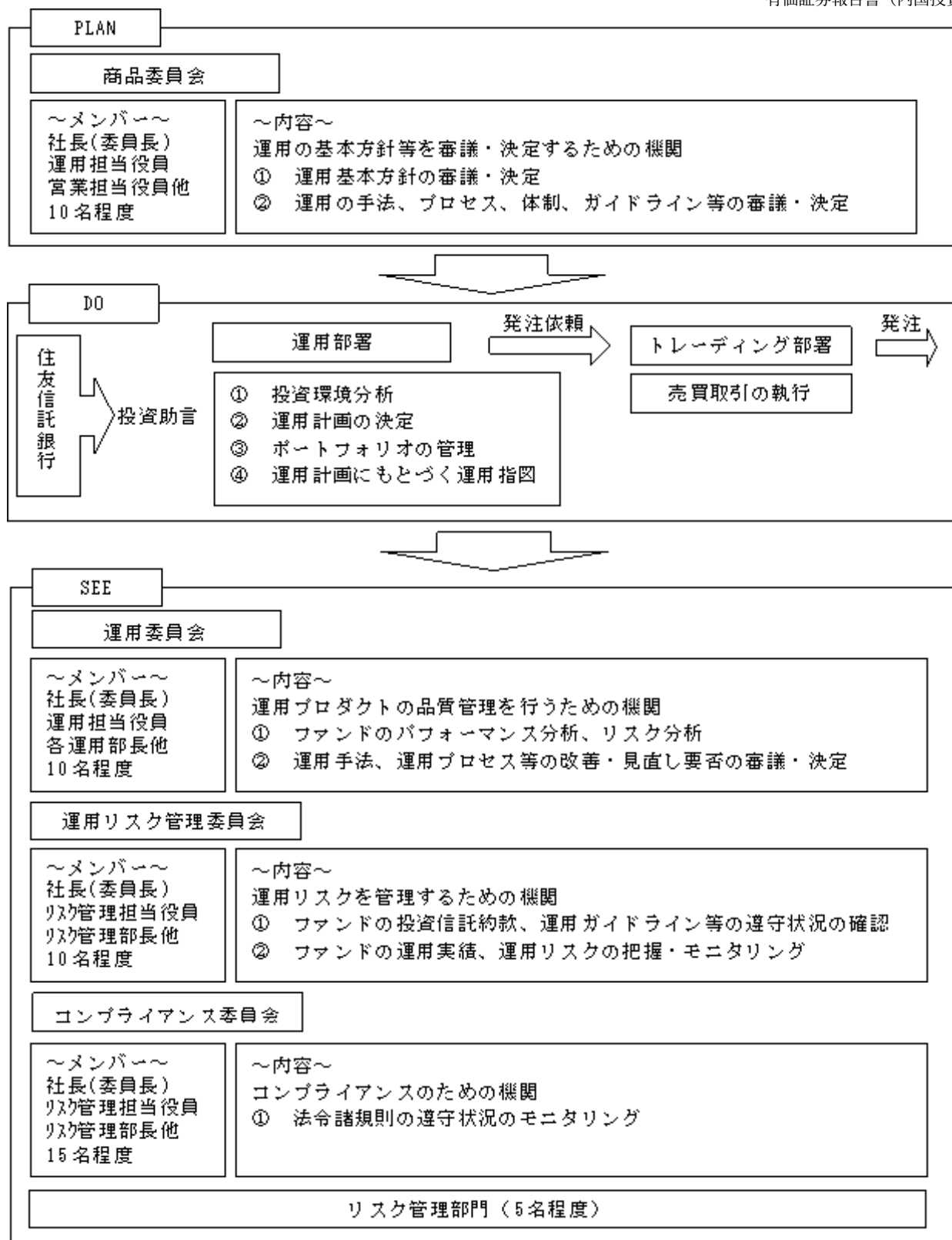
5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

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

（二）前記（ロ）の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前記（ハ）第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（3）【運用体制】

実質的な運用を行うマザーファンドの運用体制は、以下の通りであり、そのベビーファンドである本ファンドも同様の運用体制となっております。記載された体制、会議・部署の名称、人員等は、本書提出日現在のものであり、今後変更されることがあります。



(4) 【分配方針】

(イ) 分配方針

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

①分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

②分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

③留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

（ロ）収益の分配

①投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1)配当金、利子、貸付有価証券に係る品賃料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2)売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

②毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

（5）【投資制限】

（イ）投資信託約款にもとづく投資制限

①株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

③同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

④同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑥マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑦外貨建資産への投資は、行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

⑧委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）

⑨委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けるとの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第22条）

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求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り取得可能な株券
 6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- ⑩委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。（投資信託約款第23条）
- ⑪委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第24条）
- ⑫委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。また、金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。（投資信託約款第25条）
- ⑬委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。（投資信託約款第26条）
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資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。
- ⑭委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売付けの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をす

ることができるものとし、売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第27条）

⑮委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入の指図をすることができ、この指図は、当該借入に係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第28条）

⑯委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。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。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資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投資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間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資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、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資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。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第36条）

※前記①から⑥における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記①から⑥に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。前記⑩、⑫における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

（ロ）法律等で規制される取引等

委託者は、「金融商品取引法」および「投資信託及び投資法人に関する法律」等関係法令を遵守し、受益者のため忠実に、また受益者に対し善良な管理者の注意をもって、投資信託財産の運用の指図その他の業務を遂行しなければなりません。関係法令に定める運用上の禁止行為または規制事項のうち、後記される利害関係人との取引制限を除く主なものは、以下の通りです。

＜同一の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）

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、投資信託財産として有する同一の法人の発行する株式に係る議決権の総数が、当該法人の総発行株式の数に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合には、かかる株式を取得することを受託会社に指図してはならない。

＜デリバティブ取引に係る投資制限＞（金融商品取引業等に関する内閣府令）

投資信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託者が定めた合理的な方法により算出した額が当該投資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係る取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図してはならない。

3【投資リスク】

（イ）本ファンドのもつ主なリスク

投資信託商品はリスク商品であり、投資元本は保証されていません。また、収益や利回り等も未確定の商品です。したがって、以下に記載する本ファンドのリスク要因を充分にご理解頂いたうえ、本ファンドの受益権への取得申込みを行ってください。なお、本ファンドは、預貯金や保険契約とは異なり、預金保険・貯金保険・保険契約者保護機構による保護の対象ではなく、また、第一種金融商品取引業を行う者以外でご購入頂いた場合は、投資者保護基金の保護の対象ではありません。

①本ファンドは値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割り込むことがあります。本ファンドの運用による損益は、すべて本ファンドの受益者に帰属します。

②基準価額の変動要因

1)債券価格変動リスク

債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）局面では値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等およびそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動し、基準価額の変動要因となります。

2)インデックスと乖離するリスク

本ファンドは、NOMURA－BPI 総合の値動きに連動することをめざしますが、本ファンドへの入出金、組入比率、本ファンドの銘柄ごとの組入比率と指数の構成銘柄比率に差異が生ずること、売買コストや信託報酬等の影響などから、前記インデックスと連動しないことがあります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

③その他の留意点

1)本ファンドは、ファミリーファンド方式で運用するため、マザーファンドに対し、同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドによる追加設定および一部解約等があり、マザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与える場合があります。

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

（ロ）リスクの管理体制

委託者におけるリスクマネジメント体制

- ・委託者では、運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行っています（運用を再委託しているファンドも含みます。）。
- ・モニタリング結果は、原則月1回（必要に応じ随時）開催される運用リスクの管理に関する委員会に報告され、委員会は適切な運用リスク管理に必要な措置を講じることとしています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬総額	配分		
	委託者	指定販売会社	受託者
純資産総額に対して 年率0.1680% (税抜※0.16%)	純資産総額に対して 年率0.0525% (税抜※0.05%)	純資産総額に対して 年率0.0840% (税抜※0.08%)	純資産総額に対して 年率0.0315% (税抜※0.03%)

※「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。以下同じ。

信託報酬は信託期間を通じて毎日計算し、投資信託財産の費用として計上します。

上記により日々計算された信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、投資信託財産中から支弁するものとします。マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

(4) 【その他の手数料等】

- (イ) 投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に関する諸費用（消費税等を含みます。）ならびに受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。投資信託約款の定めにもとづいて、資金の借入れを行う場合の利息も同様です。負担の水準・計算方法は、個別の費用・税金等により異なり、実費での負担（運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。）となります。（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）
- (ロ) 証券取引に伴う売買委託手数料等の手数料（消費税等を含みます。）または税金、先物・オプション取引に要する費用（消費税等を含みます。）、組入資産の保管に要する費用（消費税等を含みます。）等は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。負担の水準・計算方法は、個別の費用・税金等により異なり、実費での負担（運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。）となります。（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）
- (ハ) 投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）は、毎計算期末または信託終了のとき、投資信託財産中から支弁します。

(5) 【課税上の取扱い】

- ・本ファンドは、課税上は、株式投資信託として取り扱われます。なお、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。
- ・本ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）にもとづく確定拠出年金制度専用ファンドです。税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合は、下記の内容が変更されることがあります。受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会である場合は、所得税および地方税はかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。
- ・税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】

（平成22年10月29日現在）

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
住信 国内債券インデックス マザーファンド	日本	32,429,604,945	100.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,559	0.00
合計(純資産総額)		32,429,608,504	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、本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。

(参考情報)

住信 国内債券インデックス マザーファンドの投資状況

（平成22年10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	119,556,410,500	74.11
	ポーランド	99,512,000	0.06
	小計	119,655,922,500	74.17

地方債証券	日本	10,263,403,876	6.36
特殊債券	日本	16,817,375,284	10.42
社債券	日本	12,173,158,350	7.55
	アメリカ	809,030,000	0.50
	オーストラリア	305,556,000	0.19
	オランダ	103,354,000	0.06
	イギリス	100,681,000	0.06
	小計	13,491,779,350	8.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,092,022,006	0.68
合計(純資産総額)		161,320,503,016	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザー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。

(2)【投資資産】(平成22年10月29日現在)

①【投資有価証券の主要銘柄】

a. 投資有価証券の主要銘柄

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	住信 国内債券インデックス マザーファンド	26,772,562,491	1.2149	32,527,971,141	1.2113	32,429,604,945	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

(注)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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)

住信 国内債券インデックス マザーファンドの投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債 証券	第288回利付国債 (10年)	1,970,000,000	106.50	2,098,050,000	108.26	2,132,820,500	1.7	2017/09/20	1.32
日本	国債 証券	第89回利付国債 (5年)	1,900,000,000	100.51	1,909,813,000	100.52	1,909,956,000	0.4	2015/06/20	1.18
日本	国債 証券	第305回利付国債 (10年)	1,820,000,000	100.93	1,836,961,400	104.20	1,896,585,600	1.3	2019/12/20	1.18
日本	国債 証券	第87回利付国債 (5年)	1,840,000,000	100.46	1,848,629,600	101.00	1,858,400,000	0.5	2014/12/20	1.15
日本	国債 証券	第296回利付国債 (10年)	1,730,000,000	104.24	1,803,518,000	106.88	1,849,179,700	1.5	2018/09/20	1.15
日本	国債 証券	第88回利付国債 (5年)	1,700,000,000	100.42	1,707,250,000	100.97	1,716,524,000	0.5	2015/03/20	1.06
日本	国債 証券	第306回利付国債 (10年)	1,580,000,000	101.26	1,599,908,000	104.86	1,656,867,000	1.4	2020/03/20	1.03
日本	国債 証券	第84回利付国債 (5年)	1,610,000,000	101.55	1,635,050,000	101.78	1,638,658,000	0.7	2014/06/20	1.02
日本	国債 証券	第63回利付国債 (5年)	1,590,000,000	101.87	1,619,733,000	101.47	1,613,516,100	1.2	2012/03/20	1.00
日本	国債 証券	第289回利付国債 (10年)	1,500,000,000	104.87	1,573,050,000	106.99	1,604,865,000	1.5	2017/12/20	0.99
日本	国債 証券	第85回利付国債 (5年)	1,570,000,000	101.48	1,593,236,000	101.80	1,598,338,500	0.7	2014/09/20	0.99
日本	国債 証券	第284回利付国債 (10年)	1,440,000,000	106.66	1,535,904,000	107.87	1,553,328,000	1.7	2016/12/20	0.96
日本	国債 証券	第61回利付国債 (5年)	1,530,000,000	101.63	1,554,939,000	101.22	1,548,666,000	1.2	2011/12/20	0.96
日本	国債 証券	第285回利付国債 (10年)	1,430,000,000	106.80	1,527,317,400	108.01	1,544,557,300	1.7	2017/03/20	0.96
日本	国債 証券	第235回利付国債 (10年)	1,490,000,000	101.93	1,518,876,200	101.44	1,511,530,500	1.4	2011/12/20	0.94
日本	国債 証券	第69回利付国債 (5年)	1,410,000,000	101.80	1,435,380,000	101.61	1,432,701,000	0.9	2012/12/20	0.89
日本	国債 証券	第309回利付国債 (10年)	1,400,000,000	100.99	1,413,910,000	101.90	1,426,684,000	1.1	2020/06/20	0.88
日本	国債 証券	第273回利付国債 (10年)	1,280,000,000	105.53	1,350,900,000	105.81	1,354,470,400	1.5	2015/09/20	0.84
日本	国債 証券	第300回利付国債 (10年)	1,250,000,000	104.04	1,300,521,500	106.62	1,332,775,000	1.5	2019/03/20	0.83
日本	国債 証券	第81回利付国債 (5年)	1,290,000,000	101.95	1,315,155,000	102.06	1,316,586,900	0.8	2014/03/20	0.82
日本	国債 証券	第269回利付国債 (10年)	1,250,000,000	104.13	1,301,625,000	104.47	1,305,912,500	1.3	2015/03/20	0.81
日本	国債 証券	第256回利付国債 (10年)	1,240,000,000	104.00	1,289,686,800	103.84	1,287,616,000	1.4	2013/12/20	0.80
日本	国債 証券	第70回利付国債 (5年)	1,200,000,000	101.65	1,219,878,000	101.54	1,218,576,000	0.8	2013/03/20	0.76
日本	国債 証券	第237回利付国債 (10年)	1,190,000,000	102.41	1,218,679,000	101.89	1,212,502,900	1.5	2012/03/20	0.75

日本	国債証券	第303回利付国債 (10年)	1,140,000,000	102.01	1,162,914,000	105.36	1,201,161,000	1.4	2019/09/20	0.74
日本	国債証券	第240回利付国債 (10年)	1,170,000,000	102.30	1,196,985,500	101.90	1,192,288,500	1.3	2012/06/20	0.74
日本	国債証券	第286回利付国債 (10年)	1,090,000,000	107.46	1,171,404,200	108.82	1,186,181,600	1.8	2017/06/20	0.74
日本	国債証券	第298回利付国債 (10年)	1,060,000,000	102.20	1,083,320,000	105.21	1,115,321,400	1.3	2018/12/20	0.69
日本	国債証券	第264回利付国債 (10年)	1,060,000,000	104.91	1,112,141,000	104.87	1,111,717,400	1.5	2014/09/20	0.69
日本	国債証券	第66回利付国債 (5年)	1,070,000,000	102.11	1,092,577,000	101.80	1,089,324,200	1.1	2012/09/20	0.68

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	74.17
地方債証券	6.36
特殊債券	10.42
社債券	8.36
合計	99.32

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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】

① 【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
第1期計算期間末 (平成15年 9月30日)	(分配付)	121,506,065	(分配付)	0.9801
	(分配落)	121,506,065	(分配落)	0.9801
第2期計算期間末 (平成16年 9月30日)	(分配付)	842,262,242	(分配付)	0.9922
	(分配落)	842,262,242	(分配落)	0.9922
第3期計算期間末 (平成17年 9月30日)	(分配付)	6,495,884,019	(分配付)	1.0006
	(分配落)	6,495,884,019	(分配落)	1.0006
第4期計算期間末 (平成18年10月 2日)	(分配付)	9,991,683,450	(分配付)	0.9970
	(分配落)	9,991,683,450	(分配落)	0.9970

第5期計算期間末 (平成19年10月 1日)	(分配付) (分配落)	14,417,377,540 14,417,377,540	(分配付) (分配落)	1.0147 1.0147
第6期計算期間末 (平成20年 9月30日)	(分配付) (分配落)	19,245,698,957 19,245,698,957	(分配付) (分配落)	1.0357 1.0357
第7期計算期間末 (平成21年 9月30日)	(分配付) (分配落)	25,756,568,373 25,756,568,373	(分配付) (分配落)	1.0677 1.0677
第8期計算期間末 (平成22年 9月30日)	(分配付) (分配落)	32,161,591,454 32,161,591,454	(分配付) (分配落)	1.1067 1.1067
平成21年10月末日		25,837,127,404		1.0631
11月末日		26,331,038,194		1.0720
12月末日		27,152,633,817		1.0732
平成22年 1月末日		27,443,595,533		1.0728
2月末日		27,478,692,799		1.0740
3月末日		28,324,142,917		1.0718
4月末日		28,990,170,216		1.0807
5月末日		29,440,327,152		1.0835
6月末日		30,413,364,188		1.0956
7月末日		31,010,905,054		1.0989
8月末日		31,808,341,098		1.1058
9月末日		32,161,591,454		1.1067
10月末日		32,429,608,504		1.1030

②【分配の推移】

期 間	1口当たりの分配金(円)
第1期計算期間（平成15年 2月 3日～平成15年 9月30日）	0.0000
第2期計算期間（平成15年10月 1日～平成16年 9月30日）	0.0000
第3期計算期間（平成16年10月 1日～平成17年 9月30日）	0.0000
第4期計算期間（平成17年10月 1日～平成18年10月 2日）	0.0000
第5期計算期間（平成18年10月 3日～平成19年10月 1日）	0.0000
第6期計算期間（平成19年10月 2日～平成20年 9月30日）	0.0000
第7期計算期間（平成20年10月 1日～平成21年 9月30日）	0.0000
第8期計算期間（平成21年10月 1日～平成22年 9月30日）	0.0000

③【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第1期計算期間（平成15年 2月 3日～平成15年 9月30日）	△2.0
第2期計算期間（平成15年10月 1日～平成16年 9月30日）	1.2
第3期計算期間（平成16年10月 1日～平成17年 9月30日）	0.8
第4期計算期間（平成17年10月 1日～平成18年10月 2日）	△0.4
第5期計算期間（平成18年10月 3日～平成19年10月 1日）	1.8

第6期計算期間（平成19年10月 2日～平成20年 9月30日）	2.1
第7期計算期間（平成20年10月 1日～平成21年 9月30日）	3.1
第8期計算期間（平成21年10月 1日～平成22年 9月30日）	3.7

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額（分配付）から前計算期間末の基準価額（分配落）を控除した額を前計算期間末の基準価額（分配落）で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

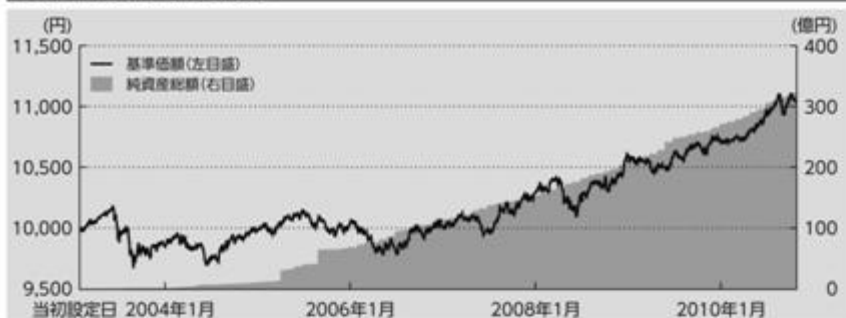
(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（参考情報）

当初設定日：2003年2月3日

作成基準日：2010年10月29日

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	11,030円
純資産総額	324億円

〈基準価額の騰落率〉

1ヶ月	-0.33%
3ヶ月	0.37%
6ヶ月	2.06%
1年	3.75%
3年	8.23%
5年	10.55%
設定来	10.30%

※上記は作成基準日からの期間です。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

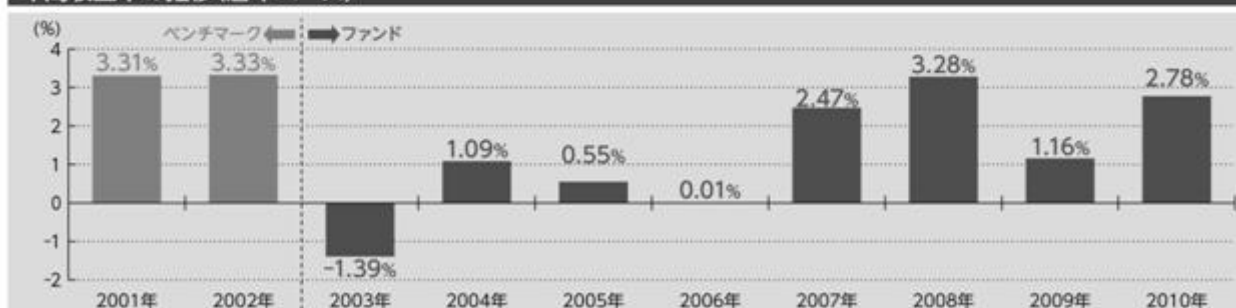
決算期	2006年10月	2007年10月	2008年9月	2009年9月	2010年9月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

※分配金額は株価、金利、為替などの変動の影響を受けて変動し、分配対象額が少額の場合、分配を行わないことがあります。

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	利率	償還期限	実質投資比率
第288回利付国債(10年)	日本	国債証券	1.7%	2017/09/20	1.3%
第89回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.4%	2015/06/20	1.2%
第305回利付国債(10年)	日本	国債証券	1.3%	2019/12/20	1.2%
第87回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.5%	2014/12/20	1.2%
第296回利付国債(10年)	日本	国債証券	1.5%	2018/09/20	1.1%
第88回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.5%	2015/03/20	1.1%
第306回利付国債(10年)	日本	国債証券	1.4%	2020/03/20	1.0%
第84回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.7%	2014/06/20	1.0%
第63回利付国債(5年)	日本	国債証券	1.2%	2012/03/20	1.0%
第289回利付国債(10年)	日本	国債証券	1.5%	2017/12/20	1.0%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2003年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2010年は年初から作成基準日までの収益率です。

※2001年～2002年は、ファンドのベンチマークである「NOMURA-BPI 総合」の年間収益率です。

※ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

最新の運用の内容等は、委託者のホームページでご確認いただけます。

(4)【設定及び解約の実績】

期 間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	受益権総口数 (口)
第1期計算期間 (平成15年 2月 3日～平成15年 9月30日)	132,284,731	8,311,715	123,973,016
第2期計算期間 (平成15年10月 1日～平成16年 9月30日)	775,251,636	50,356,810	848,867,842

第3期計算期間 (平成16年10月 1日～平成17年 9月30日)	5,843,859,806	200,808,599	6,491,919,049
第4期計算期間 (平成17年10月 1日～平成18年10月 2日)	4,808,957,575	1,279,488,417	10,021,388,207
第5期計算期間 (平成18年10月 3日～平成19年10月 1日)	5,767,288,169	1,580,566,991	14,208,109,385
第6期計算期間 (平成19年10月 2日～平成20年 9月30日)	6,633,500,730	2,260,029,788	18,581,580,327
第7期計算期間 (平成20年10月 1日～平成21年 9月30日)	8,324,897,088	2,783,102,747	24,123,374,668
第8期計算期間 (平成21年10月 1日～平成22年 9月30日)	7,549,000,376	2,610,357,633	29,062,017,411

(注)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

（イ）申込手続

- ①本ファンドの受益権の取得申込者は、指定販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行います。
- ②取得申込みは、申込期間における毎営業日に、指定販売会社の営業所等で受け付けます。
- ③取得申込みの受付は、原則として、指定販売会社の営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付になります。
- ④本ファンドの受益権の販売価額は、取得申込受付日の基準価額とします。
- ⑤申込代金の払込みについては、指定販売会社が指定する期日までに申込みの指定販売会社に支払うものとします。
- ⑥本ファンドは、収益の分配がなされた場合、分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資コース」専用ファンドです。このため申込みの際、受益権の取得申込者は、指定販売会社との間で別に定める「自動けいぞく投資約款」にしたがって、「分配金自動けいぞく投資に関する契約」を締結します。指定販売会社によっては、「自動けいぞく投資約款」、「分配金自動けいぞく投資に関する契約」について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。なお、指定販売会社によっては、定時定額で購入する「自動購入サービス」を利用することもできます。当該サービスを利用する場合には指定販売会社との間で「自動購入サービス」に関する取り決め（指定販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。）を行うものとします。
- ⑦取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

- (ロ) 申込単位
1円以上1円単位
- (ハ) 申込手数料
ありません。

2【換金（解約）手続等】

(イ) 受益権の買取請求

本ファンドにおいては、指定販売会社による受益権の買取は行っておりません。ご換金は解約請求制のみとなります。

(ロ) 受益権のご解約の請求

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

- ①受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもってご解約の請求をすることができます。ご解約の請求の受付は、原則として、指定販売会社の営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付になります。
- ②受益者が前記①のご解約の請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ③委託者は、前記①のご解約の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。
- ④ご解約の価額は、解約請求受付日の基準価額（解約価額）とします。信託財産留保金[※]の控除はありません。

※「信託財産留保金」（以下「信託財産留保額」ということがあります。）とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から頂く一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

- ⑤確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度専用ファンドである本ファンドに係る期中収益分配金、ご解約による収益の分配、償還による収益の分配のいずれも非課税であるため、ご解約のお受取金額は、ご解約価額となります。
- ⑥解約代金は、原則として、解約請求受付日より起算して4営業日目から指定販売会社の営業所等において支払います。
- ⑦委託者は、取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、前記①によるご解約の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けたご解約の請求の受付を取り消すことができます。
- ⑧前記⑦により、ご解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日のご解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がそのご解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権のご解約の価額は、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ご解約の請求を受け付けたものとして、前記④の規定に準じて計算された価額とします。
- ⑨解約価額に関する投資者の皆様による照会方法等につきましては、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、以下の通りです。

＜お問い合わせ先＞

住信アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.sumishinam.co.jp/>

フリーダイヤル：0120-417434

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時とします。）

（ハ）換金制限

本ファンドの規模および商品性格などにもとづき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間および金額の制限を行う場合があります。詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「（ロ）受益権のご解約の請求⑨」に記載されている先と同じです。

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、投資信託財産に属する有価証券（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）、金融商品等のすべての資産を時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した純資産総額を、本ファンドの基準価額計算日における受益権総口数で除した1口当たり純資産価額をいいます。なお、投資信託財産に属する有価証券等の資産の時価評価は、原則として、法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって評価します。

[主要な投資対象の評価方法]

- ・本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

- ・マザーファンドの主要な投資対象である公社債の評価方法

原則として、次のいずれかから入手した価額で評価します。

1. 日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）
2. 価格情報会社の提供する価額
3. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

（ロ）基準価額の算出頻度

基準価額は、委託者の営業日において日々算出されます。

（ハ）基準価額に関する投資者による照会方法等

基準価額は、委託者および指定販売会社で入手できます。投資者の皆様による照会方法等につきましては、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「2換金（解約）手続等（ロ）受益権のご解約の請求⑨」に記載されている先と同じです。

なお、基準価額は、翌日の日本経済新聞に掲載されます。ただし、表示は1万口当たりに換算した価額で行われます。

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

平成15年2月3日から投資信託約款第4条の規定による信託終了の日までとします。（原則無期限）

（4）【計算期間】

原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとします。（第1計算期間は平成15年2月3日から平成15年9月30日までとします。）なお、当該計算期間終了の該当日が休業日のとき、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されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、投資信託約款第4条に定める信託期間の終了日とします。

（5）【その他】

（イ）信託の終了

- ①(a)委託者は、投資信託約款に定める信託終了前にこの投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、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)委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、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。
- (c)委託者は、前記(a)および(b)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この投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係る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。
- (d)前記(c)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者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。
- (e)前記(d)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二分の一を超えるときは、前記(a)および(b)の投資信託契約の解約をしません。
- (f)委託者は、この投資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この投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係る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。
- (g)前記(d)から(f)までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記(d)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。
- ②委託者は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。
- ③委託者が、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この投資信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、後記「(ロ) 投資信託約款の変更①(d)」に該当する場合を除き、この信託はその委託者と受託者との間において存続します。
- ④受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者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、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

(ロ) 投資信託約款の変更

- ①(a)委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資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その内容を監督官庁に届け出ます。
- (b)委託者は、前記(a)の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る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)前記(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者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)前記(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二分の一を超えるときは、前記(a)の投資信託約款の変更をしません。
- (e)委託者は、当該投資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この投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る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。
- ②委託者は、監督官庁の命令にもとづいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、前記①に記載さ

れている手続きにしたがいます。

(ハ) 指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約の更改等に関する手続

指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約の有効期間は、契約締結の日から1年間とします。ただし、契約満了日の3ヶ月前までに別段の意思表示のないときは、同一条件にて自動的に1年間更新され、以後も同様とします。期間の途中において必要あるときは、契約の一部を変更することができます。

(ニ) 運用報告書

委託者は、原則として計算期間の末日ごとおよび償還時に、期間中の運用経過のほか投資信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、当該投資信託財産に係る知れている受益者に対して交付します。

(ホ) 信託事務処理の再信託

受託者は、本ファンドに係る信託事務の処理の一部について日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類にもとづいて所定の事務を行います。

(ヘ) 公告

委託者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。

4 【受益者の権利等】

本ファンドの受益者が有する主な権利は、以下の通りです。なお、本ファンドの受益権の1口当たり投資信託財産持分は、すべて均等かつ同一であり、取得申込日の前後等により受益者間で1口当たり持分の差異が生じることはありません。

(イ) 収益分配金請求権

本ファンドの収益分配金は、自動的に本ファンドの受益権に再投資されます。受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、受益者に対して遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

※分配金は、無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

(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、原則として、償還日から起算して5営業日目までに受益者に支払います。償還金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行われます。

受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属するものとします。

(ハ) 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、解約の請求をすることにより換金する権利を有します。

(ニ) 反対者の買取請求権

投資信託契約の解約、または投資信託約款の変更のうち、その内容が重大な変更を行う場合において、一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

(ホ) 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は、委託者に対し、当該受益者に係る投資信託財産に関する書類の閲覧または謄写の請求をすることができます。

なお、受益者には、議決権、受益者集会の権利はありません。

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）（以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。

財務諸表等規則は、平成20年8月7日付内閣府令第50号附則第2条第1項第1号により改正されておりますが、第7期計算期間（平成20年10月1日から平成21年9月30日まで）については、改正前の財務諸表等規則に基づき、第8期計算期間（平成21年10月1日から平成22年9月30日まで）については、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

投資信託財産計算規則は、平成21年6月24日付内閣府令第35号附則第16条第2項により改正されておりますが、第7期計算期間（平成20年10月1日から平成21年9月30日まで）については、改正前の投資信託財産計算規則に基づき、第8期計算期間（平成21年10月1日から平成22年9月30日まで）については、改正後の投資信託財産計算規則に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間（平成20年10月1日から平成21年9月30日まで）の財務諸表については、あずさ監査法人により監査を受け、第8期計算期間（平成21年10月1日から平成22年9月30日まで）の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

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

1 【財務諸表】

すみしん DC日本債券インデックス・オープンS

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 (平成21年 9 月30日現在)	第8期 (平成22年 9 月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	55,088,942	38,058,679
親投資信託受益証券	25,756,324,402	32,161,178,759
未収利息	119	99
流動資産合計	25,811,413,463	32,199,237,537
資産合計	25,811,413,463	32,199,237,537
負債の部		
流動負債		
未払解約金	33,370,191	10,786,208
未払受託者報酬	3,806,074	4,756,193
未払委託者報酬	16,492,938	20,610,126
その他未払費用	1,175,887	1,493,556
流動負債合計	54,845,090	37,646,083
負債合計	54,845,090	37,646,083
純資産の部		
元本等		
元本	24,123,374,668	29,062,017,411
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,633,193,705	3,099,574,043
（分配準備積立金）	—	1,992,295,603
元本等合計	25,756,568,373	32,161,591,454
純資産合計	25,756,568,373	32,161,591,454
負債純資産合計	25,811,413,463	32,199,237,537

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期 (自 平成20年10月1日 至 平成21年9月30日)	第8期 (自 平成21年10月1日 至 平成22年9月30日)
営業収益		
受取利息	37,220	21,672
有価証券売買等損益	716,393,785	1,102,951,722
営業収益合計	716,431,005	1,102,973,394
営業費用		
受託者報酬	7,056,054	8,962,020
委託者報酬	30,576,131	38,835,345
その他費用	1,175,887	1,493,556
営業費用合計	38,808,072	49,290,921
営業利益又は営業損失（△）	677,622,933	1,053,682,473
経常利益又は経常損失（△）	677,622,933	1,053,682,473
当期純利益又は当期純損失（△）	677,622,933	1,053,682,473
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	34,208,572	30,409,816
期首剰余金又は期首欠損金（△）	664,118,630	1,633,193,705
剰余金増加額又は欠損金減少額	431,336,404	622,188,132
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	431,336,404	622,188,132
剰余金減少額又は欠損金増加額	105,675,690	179,080,451
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	105,675,690	179,080,451
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,633,193,705	3,099,574,043

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第 7 期 (自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)	第 8 期 (自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)
資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法により親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

	第 7 期 (平成21年9月30日現在)	第 8 期 (平成22年9月30日現在)
1.期首元本額	18,581,580,327円	24,123,374,668円
期中追加設定元本額	8,324,897,088円	7,549,000,376円
期中一部解約元本額	2,783,102,747円	2,610,357,633円
期末元本額	24,123,374,668円	
2.計算期間末日における受益権の総数	24,123,374,668口	29,062,017,411口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	第 7 期 (自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)	第 8 期 (自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)
分配金の 計算過程	計算期間末における経費控除後の配当等収益（33,339円）、経費控除後繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（643,381,022円）、収益調整金（562,861,780円）及び分配準備積立金（426,917,564円）により、分配対象収益は1,633,193,705円（1万口当たり677円01銭）ですが、分配は見送りとさせていただきます。	計算期間末における経費控除後の配当等収益（21,672円）、経費控除後繰越欠損補填後の有価証券売買等損益（1,023,250,985円）、収益調整金（1,107,278,440円）及び分配準備積立金（969,022,946円）により、分配対象収益は3,099,574,043円（1万口当たり1,066円53銭）ですが、分配は見送りとさせていただきます。

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）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。

I 金融商品の状況に関する事項

項目	第 8 期 (自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、金融商品に対する取組方針は投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。 なお、当ファンドには、以下のリスクがあります。 ・価格変動リスク
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行っております（運用を再委託しているファンドも含まれます。）。 モニタリング結果は、原則月1回（必要に応じ随時）開催される運用リスクの管理に関する委員会に報告され、委員会は適切な運用リスク管理に必要な措置を講じることとしております。
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価に関する事項

項目	第 8 期 (平成22年9月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	a. 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。 b. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 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。

(有価証券に関する注記)

第7期（平成21年9月30日現在）

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

種 類	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	25,756,324,402	721,834,128
合 計	25,756,324,402	721,834,128

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、決算日現在の評価換え額です。

第8期（平成22年9月30日現在）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	1,123,512,856
合 計	1,123,512,856

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、決算日現在の評価換え額です。

（デリバティブ取引に関する注記）

Ⅰ取引の状況に関する事項

第 7 期 (自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)
該当事項はありません。

Ⅱ取引の時価等に関する事項

第 7 期 (平成21年9月30日現在)
該当事項はありません。

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第 8 期 (平成22年9月30日現在)
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第 7 期 (自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)	第 8 期 (自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)
当計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左

（1口当たり情報）

第 7 期 (平成21年9月30日現在)	第 8 期 (平成22年9月30日現在)
1口当たり純資産額 = 1.0677円	1口当たり純資産額 = 1.1067円

(4)【附属明細表】（平成22年9月30日現在）

1) 有価証券明細表

①株式

該当事項はありません。

②株式以外の有価証券

種類	銘柄	総口数（口）	評価額（円）
親投資信託 受益証券	住信 国内債券インデックス マザーファンド	26,465,749,473	32,161,178,759

合計	26,465,749,473	32,161,178,759
----	----------------	----------------

2) 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3) デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「すみしん DC日本債券インデックス・オープンS」は、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」を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、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の受益証券です。

「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の状況は次の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成21年 9月30日現在)	(平成22年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,516,863,604	1,087,290,386
国債証券	108,800,534,100	121,949,865,900
地方債証券	9,399,449,167	10,476,574,653
特殊債券	17,099,060,533	17,007,527,750
社債券	11,992,401,950	13,942,323,080
未収利息	326,311,671	349,903,899
前払費用	21,919,519	10,169,870
流動資産合計	149,156,540,544	164,823,655,538
資産合計	149,156,540,544	164,823,655,538
負債の部		
流動負債		
未払金	1,096,944,200	1,103,171,000
未払解約金	45,310,000	24,209,941
流動負債合計	1,142,254,200	1,127,380,941
負債合計	1,142,254,200	1,127,380,941
純資産の部		
元本等		
元本	126,462,206,194	134,702,024,810
剰余金		

剰余金又は欠損金（△）	21,552,080,150	28,994,249,787
元本等合計	148,014,286,344	163,696,274,597
純資産合計	148,014,286,344	163,696,274,597
負債純資産合計	149,156,540,544	164,823,655,538

（注）「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年5月30日から翌年5月29日までであり、「すみしん DC日本債券インデックス・オープンS」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成21年9月30日および平成22年9月30日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

（2）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	（自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）	（自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日）
資産の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、原則として時価評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価格、価格情報会社の提供する価格又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、社債券 同左

（貸借対照表に関する注記）

	（平成21年9月30日現在）	（平成22年9月30日現在）
1.期首元本額	127,492,516,880円	126,462,206,194円
期中追加設定元本額	40,774,691,779円	25,524,327,066円
期中一部解約元本額	41,805,002,465円	17,284,508,450円
期末元本額	126,462,206,194円	134,702,024,810円
元本額の内訳		
住信 エマージング株式オープン	10,940,920円	10,940,920円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	216,744,457円	321,804,503円
SBI資産設計オープン（分配型）	21,599,438円	17,932,042円
STAM 国内債券インデックス・オープン	780,018,621円	1,368,832,717円
世界経済インデックスファンド	9,337,842円	26,291,324円
住信 国内バランス30	619,613,638円	509,962,775円
住信 国内バランス60	122,264,966円	90,350,753円
すみしん マイセクション25	333,331,263円	263,079,910円
すみしん マイセクション50	248,587,925円	231,498,803円
すみしん マイセクション75	58,131,929円	52,694,764円
すみしん DC マイセクション25	5,914,528,106円	6,200,339,300円
すみしん DC マイセクション50	8,202,929,398円	8,657,412,418円
すみしん DC マイセクション75	2,179,362,191円	2,353,586,626円
すみしん DC日本債券インデックス・オープン	309,672,023円	326,887,806円
すみしん DC日本債券インデックス・オープンS	22,006,428,915円	26,465,749,473円

すみしん DC日本債券インデックス・オープンP	5,643,683,930円	6,895,990,906円
すみしん DC マイセクションS25	253,520,919円	524,846,940円
すみしん DC マイセクションS50	553,094,423円	980,677,778円
すみしん DC マイセクションS75	131,235,601円	200,461,384円
すみしん DC ターゲット・イヤー ファンド2015	35,397,616円	34,637,670円
すみしん DC ターゲット・イヤー ファンド2025	28,842,450円	95,773,695円
すみしん DC ターゲット・イヤー ファンド2035	11,198,954円	41,662,199円
すみしん DC ターゲット・イヤー ファンド2045	1,459,618円	8,180,675円
STAM 日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	2,617,946,979円	6,800,155,651円
住信 国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	101,710,539円	86,189,049円
すみしん マイセクション50VA1 （適格機関投資家専用）	691,094,269円	617,595,311円
すみしん マイセクション75VA1 （適格機関投資家専用）	84,645,260円	79,905,729円
住信 国内バランス 30VA2（適格機関投資家専用）	15,465,393円	15,015,202円
住信 国内バランス 60VA2（適格機関投資家専用）	15,762,955円	15,590,336円
すみしん マイセクション50VA2 （適格機関投資家専用）	5,480,030円	3,436,291円
すみしん バランス30VA1（適格機関投資家専用）	2,419,864,847円	2,177,633,990円
すみしん バランス50VA1（適格機関投資家専用）	3,761,762,486円	3,277,162,918円
すみしん バランス25VA2（適格機関投資家専用）	12,223,314,037円	10,410,377,425円
すみしん バランス50VA2（適格機関投資家専用）	1,034,400,132円	884,783,973円
すみしん バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	18,979,705,905円	16,955,722,368円
すみしん バランスB（37.5）VA1 （適格機関投資家専用）	2,103,728,946円	1,844,028,210円
すみしん バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	7,201,189,442円	6,583,436,435円
すみしん 世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	4,197,871,532円	3,793,665,867円
すみしん 世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	6,009,197,451円	5,421,120,590円
すみしん バランス D（35）VA1 （適格機関投資家専用）	3,222,409,359円	2,926,880,800円
すみしん グローバルバランスファンドVA35 （適格機関投資家専用）	2,487,378,787円	2,140,226,545円
すみしん バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,134,111,821円	3,471,788,084円
すみしん バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	—	2,560,975,682円
すみしん 国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	—	320,593,626円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,920,041,596円	2,137,156,435円
住信 日本債券ファンド・シリーズ1	7,543,199,285円	6,498,988,912円
2.計算期間末日における受益権の総数	126,462,206,194口	134,702,024,810口

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）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。

I 金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、金融商品に対する取組方針は投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドは、わが国の公社債を中心に投資を行い、ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス(総合)と連動する投資成果を目標として運用を行っております。 なお、当ファンドには、以下のリスクがあります。 ・価格変動リスク
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行っております（運用を再委託しているファンドも含まれます。）。 モニタリング結果は、原則月1回（必要に応じ随時）開催される運用リスクの管理に関する委員会に報告され、委員会は適切な運用リスク管理に必要な措置を講じることとしております。
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価に関する事項

項目	(平成22年9月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	a.国債証券、地方債証券、特殊債券、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。 b.コールローン等の金銭債権及び金銭債務 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。

(有価証券に関する注記)

(平成21年9月30日現在)

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

種 類	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	108,800,534,100	1,178,210,500
地方債証券	9,399,449,167	156,691,545
特殊債券	17,099,060,533	238,709,947
社債券	11,992,401,950	241,916,690
合 計	147,291,445,750	1,815,528,682

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当親投資信託の計算期間開始日から本報告書における開示対象

ファンドの計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

（平成22年9月30日現在）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	2,163,525,200
地方債証券	158,851,075
特殊債券	230,565,771
社債券	156,980,140
合 計	2,709,922,186

（注）当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当親投資信託の計算期間開始日から本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

（自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）
該当事項はありません。

II 取引の時価等に関する事項

（平成21年9月30日現在）
該当事項はありません。

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（平成22年9月30日現在）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）	（自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日）
本報告書における開示対象ファンドの計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左

（1口当たり情報）

（平成21年9月30日現在）	（平成22年9月30日現在）
1口当たり純資産額 = 1.1704円	1口当たり純資産額 = 1.2152円

(3) 附属明細表（平成22年9月30日現在）

1) 有価証券明細表

① 株式

該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	第100回利付国債（20年）	300,000,000	327,462,000	
	第101回利付国債（20年）	160,000,000	179,545,600	
	第102回利付国債（20年）	140,000,000	156,969,400	
	第103回利付国債（20年）	280,000,000	309,604,400	
	第104回利付国債（20年）	270,000,000	290,228,400	
	第105回利付国債（20年）	450,000,000	483,408,000	
	第106回利付国債（20年）	400,000,000	435,912,000	
	第107回利付国債（20年）	190,000,000	203,968,800	
	第108回利付国債（20年）	490,000,000	510,364,400	
	第109回利付国債（20年）	200,000,000	208,102,000	
	第110回利付国債（30年）	120,000,000	105,138,000	
	第110回利付国債（20年）	520,000,000	557,440,000	
	第111回利付国債（20年）	200,000,000	217,432,000	
	第112回利付国債（20年）	530,000,000	567,741,300	
	第113回利付国債（20年）	960,000,000	1,026,835,200	
	第114回利付国債（20年）	380,000,000	406,125,000	
	第115回利付国債（20年）	650,000,000	705,224,000	
	第116回利付国債（20年）	180,000,000	195,154,200	
	第117回利付国債（20年）	600,000,000	640,704,000	
	第118回利付国債（20年）	800,000,000	840,384,000	
	第119回利付国債（20年）	180,000,000	183,061,800	
	第11回利付国債（30年）	40,000,000	39,386,800	
	第121回利付国債（20年）	100,000,000	103,442,000	
	第12回利付国債（30年）	120,000,000	127,086,000	
	第13回利付国債（30年）	90,000,000	93,636,000	
	第14回利付国債（30年）	240,000,000	267,945,600	
	第15回利付国債（30年）	170,000,000	193,305,300	
	第16回利付国債（30年）	170,000,000	193,317,200	
	第17回利付国債（30年）	120,000,000	134,060,400	
	第18回利付国債（20年）	80,000,000	87,179,200	
	第18回利付国債（30年）	140,000,000	153,713,000	
	第19回利付国債（30年）	240,000,000	263,676,000	
	第1回利付国債（30年）	40,000,000	47,395,600	
	第1回利付国債（40年）	150,000,000	172,644,000	
	第20回利付国債（20年）	110,000,000	121,720,500	
	第20回利付国債（30年）	190,000,000	216,256,100	
	第21回利付国債（30年）	130,000,000	142,880,400	
	第22回利付国債（20年）	120,000,000	135,164,400	

第22回利付国債（30年）	220,000,000	250,822,000	
第235回利付国債（10年）	1,490,000,000	1,513,095,000	
第236回利付国債（10年）	440,000,000	447,352,400	
第237回利付国債（10年）	1,190,000,000	1,213,752,400	
第238回利付国債（10年）	410,000,000	417,589,100	
第239回利付国債（10年）	550,000,000	561,891,000	
第23回利付国債（20年）	40,000,000	46,310,800	
第23回利付国債（30年）	120,000,000	136,683,600	
第240回利付国債（10年）	1,170,000,000	1,193,306,400	
第241回利付国債（10年）	630,000,000	644,401,800	
第242回利付国債（10年）	360,000,000	367,524,000	
第243回利付国債（10年）	420,000,000	427,959,000	
第244回利付国債（10年）	320,000,000	326,092,800	
第245回利付国債（10年）	470,000,000	477,914,800	
第246回利付国債（10年）	350,000,000	355,124,000	
第247回利付国債（10年）	400,000,000	406,456,000	
第248回利付国債（10年）	190,000,000	192,601,100	
第249回利付国債（10年）	400,000,000	404,500,000	
第24回利付国債（20年）	20,000,000	23,123,600	
第24回利付国債（30年）	150,000,000	170,995,500	
第250回利付国債（10年）	290,000,000	292,775,300	
第251回利付国債（10年）	560,000,000	571,396,000	
第252回利付国債（10年）	440,000,000	450,142,000	
第253回利付国債（10年）	780,000,000	813,430,800	
第254回利付国債（10年）	550,000,000	570,333,500	
第255回利付国債（10年）	240,000,000	249,580,800	
第256回利付国債（10年）	1,240,000,000	1,289,488,400	
第257回利付国債（10年）	460,000,000	476,886,600	
第258回利付国債（10年）	310,000,000	322,083,800	
第259回利付国債（10年）	640,000,000	669,350,400	
第25回利付国債（20年）	60,000,000	68,145,600	
第25回利付国債（30年）	210,000,000	230,958,000	
第260回利付国債（10年）	290,000,000	305,106,100	
第261回利付国債（10年）	410,000,000	434,374,500	
第262回利付国債（10年）	480,000,000	510,302,400	
第263回利付国債（10年）	810,000,000	854,533,800	
第264回利付国債（10年）	1,060,000,000	1,114,123,600	
第265回利付国債（10年）	550,000,000	579,474,500	
第266回利付国債（10年）	940,000,000	986,454,800	
第267回利付国債（10年）	370,000,000	386,738,800	
第268回利付国債（10年）	520,000,000	549,120,000	
第269回利付国債（10年）	1,350,000,000	1,413,693,000	
第26回利付国債（20年）	20,000,000	23,387,000	
第26回利付国債（30年）	430,000,000	481,845,100	
第270回利付国債（10年）	940,000,000	986,370,200	

第271回利付国債（10年）	230,000,000	240,276,400	
第272回利付国債（10年）	130,000,000	137,321,600	
第273回利付国債（10年）	1,280,000,000	1,358,361,600	
第274回利付国債（10年）	430,000,000	457,279,200	
第275回利付国債（10年）	230,000,000	243,409,000	
第276回利付国債（10年）	430,000,000	459,489,400	
第277回利付国債（10年）	370,000,000	396,240,400	
第278回利付国債（10年）	230,000,000	248,781,800	
第279回利付国債（10年）	340,000,000	371,419,400	
第27回利付国債（20年）	50,000,000	59,463,000	
第27回利付国債（30年）	400,000,000	457,464,000	
第280回利付国債（10年）	730,000,000	795,305,800	
第281回利付国債（10年）	390,000,000	427,077,300	
第282回利付国債（10年）	900,000,000	972,333,000	
第283回利付国債（10年）	450,000,000	488,799,000	
第284回利付国債（10年）	1,740,000,000	1,883,289,000	
第285回利付国債（10年）	1,430,000,000	1,549,891,200	
第285回利付国債（2年）	450,000,000	450,414,000	
第286回利付国債（10年）	1,090,000,000	1,190,051,100	
第286回利付国債（2年）	950,000,000	951,947,500	
第287回利付国債（10年）	500,000,000	549,165,000	
第288回利付国債（10年）	1,970,000,000	2,139,045,700	
第288回利付国債（2年）	560,000,000	560,571,200	
第289回利付国債（10年）	1,700,000,000	1,823,335,000	
第289回利付国債（2年）	960,000,000	961,036,800	
第28回利付国債（20年）	20,000,000	24,217,400	
第28回利付国債（30年）	300,000,000	343,317,000	
第290回利付国債（10年）	710,000,000	756,192,600	
第290回利付国債（2年）	250,000,000	250,287,500	
第291回利付国債（10年）	270,000,000	285,624,900	
第291回利付国債（2年）	600,000,000	600,684,000	
第292回利付国債（10年）	420,000,000	456,712,200	
第292回利付国債（2年）	800,000,000	800,960,000	
第293回利付国債（10年）	410,000,000	448,884,400	
第293回利付国債（2年）	300,000,000	300,354,000	
第294回利付国債（10年）	500,000,000	543,715,000	
第294回利付国債（2年）	700,000,000	700,861,000	
第295回利付国債（10年）	600,000,000	643,326,000	
第295回利付国債（2年）	600,000,000	600,834,000	
第296回利付国債（10年）	1,730,000,000	1,851,774,700	
第297回利付国債（10年）	640,000,000	678,988,800	
第298回利付国債（10年）	1,060,000,000	1,115,862,000	
第299回利付国債（10年）	420,000,000	441,168,000	
第29回利付国債（20年）	60,000,000	71,667,600	
第29回利付国債（30年）	610,000,000	685,719,300	

第2回利付国債（30年）	60,000,000	67,149,600	
第2回利付国債（40年）	300,000,000	328,764,000	
第300回利付国債（10年）	1,050,000,000	1,120,171,500	
第301回利付国債（10年）	970,000,000	1,032,826,900	
第302回利付国債（10年）	370,000,000	390,771,800	
第303回利付国債（10年）	1,240,000,000	1,306,563,200	
第304回利付国債（10年）	190,000,000	198,605,100	
第305回利付国債（10年）	1,820,000,000	1,896,403,600	
第306回利付国債（10年）	1,700,000,000	1,782,603,000	
第308回利付国債（10年）	600,000,000	621,978,000	
第309回利付国債（10年）	1,600,000,000	1,628,560,000	
第30回利付国債（20年）	80,000,000	93,572,000	
第30回利付国債（30年）	310,000,000	341,737,800	
第31回利付国債（20年）	80,000,000	93,922,400	
第31回利付国債（30年）	430,000,000	464,954,700	
第32回利付国債（20年）	50,000,000	59,239,500	
第32回利付国債（30年）	450,000,000	497,619,000	
第33回利付国債（20年）	340,000,000	409,424,600	
第34回利付国債（20年）	50,000,000	59,960,500	
第35回利付国債（20年）	10,000,000	11,865,800	
第36回利付国債（20年）	70,000,000	82,266,100	
第37回利付国債（20年）	70,000,000	82,740,000	
第38回利付国債（20年）	20,000,000	23,203,800	
第39回利付国債（20年）	500,000,000	576,290,000	
第3回利付国債（30年）	120,000,000	132,247,200	
第3回利付国債（40年）	220,000,000	241,135,400	
第40回利付国債（20年）	100,000,000	113,085,000	
第41回利付国債（20年）	330,000,000	351,634,800	
第42回利付国債（20年）	80,000,000	92,428,000	
第43回利付国債（20年）	140,000,000	165,475,800	
第44回利付国債（20年）	170,000,000	195,229,700	
第45回利付国債（20年）	290,000,000	330,347,700	
第46回利付国債（20年）	170,000,000	190,333,700	
第47回利付国債（20年）	90,000,000	100,695,600	
第48回利付国債（20年）	130,000,000	149,171,100	
第49回利付国債（20年）	140,000,000	155,170,400	
第4回利付国債（30年）	110,000,000	132,374,000	
第50回利付国債（20年）	220,000,000	239,316,000	
第51回利付国債（20年）	100,000,000	109,726,000	
第52回利付国債（20年）	110,000,000	121,832,700	
第53回利付国債（20年）	80,000,000	88,645,600	
第54回利付国債（20年）	200,000,000	223,736,000	
第55回利付国債（20年）	140,000,000	153,522,600	
第56回利付国債（20年）	150,000,000	164,427,000	
第57回利付国債（20年）	240,000,000	260,316,000	

第58回利付国債（20年）	200,000,000	216,680,000	
第59回利付国債（20年）	200,000,000	211,888,000	
第5回利付国債（30年）	50,000,000	54,147,500	
第60回利付国債（20年）	270,000,000	276,779,700	
第61回利付国債（20年）	220,000,000	214,766,200	
第61回利付国債（5年）	1,730,000,000	1,752,645,700	
第62回利付国債（20年）	220,000,000	208,799,800	
第62回利付国債（5年）	320,000,000	324,572,800	
第63回利付国債（20年）	80,000,000	85,432,800	
第63回利付国債（5年）	1,790,000,000	1,817,941,900	
第64回利付国債（20年）	470,000,000	506,895,000	
第64回利付国債（5年）	900,000,000	920,997,000	
第65回利付国債（20年）	250,000,000	269,337,500	
第65回利付国債（5年）	280,000,000	286,053,600	
第66回利付国債（20年）	130,000,000	138,418,800	
第66回利付国債（5年）	1,070,000,000	1,090,276,500	
第67回利付国債（20年）	150,000,000	161,415,000	
第67回利付国債（5年）	470,000,000	480,744,200	
第68回利付国債（20年）	140,000,000	155,856,400	
第68回利付国債（5年）	260,000,000	265,522,400	
第69回利付国債（20年）	120,000,000	132,128,400	
第69回利付国債（5年）	1,410,000,000	1,433,744,400	
第6回利付国債（30年）	70,000,000	78,224,300	
第70回利付国債（20年）	230,000,000	261,717,000	
第70回利付国債（5年）	1,000,000,000	1,016,140,000	
第71回利付国債（20年）	290,000,000	322,613,400	
第71回利付国債（5年）	820,000,000	843,263,400	
第72回利付国債（20年）	490,000,000	538,539,400	
第72回利付国債（5年）	630,000,000	653,013,900	
第73回利付国債（20年）	220,000,000	238,612,000	
第73回利付国債（5年）	470,000,000	484,635,800	
第74回利付国債（20年）	190,000,000	208,602,900	
第74回利付国債（5年）	380,000,000	388,759,000	
第75回利付国債（20年）	240,000,000	262,881,600	
第75回利付国債（5年）	440,000,000	452,311,200	
第76回利付国債（20年）	240,000,000	256,584,000	
第76回利付国債（5年）	720,000,000	742,269,600	
第77回利付国債（20年）	120,000,000	129,825,600	
第77回利付国債（5年）	470,000,000	481,839,300	
第78回利付国債（20年）	170,000,000	181,361,100	
第78回利付国債（5年）	390,000,000	399,336,600	
第79回利付国債（20年）	180,000,000	194,475,600	
第79回利付国債（5年）	170,000,000	172,985,200	
第7回利付国債（30年）	190,000,000	209,180,500	
第80回利付国債（20年）	190,000,000	207,867,600	

	第80回利付国債（5年）	680,000,000	694,110,000	
	第81回利付国債（20年）	70,000,000	75,521,600	
	第81回利付国債（5年）	1,490,000,000	1,522,496,900	
	第82回利付国債（20年）	540,000,000	590,036,400	
	第82回利付国債（5年）	390,000,000	399,843,600	
	第83回利付国債（20年）	220,000,000	239,910,000	
	第83回利付国債（5年）	220,000,000	225,790,400	
	第84回利付国債（20年）	380,000,000	409,100,400	
	第84回利付国債（5年）	1,910,000,000	1,945,850,700	
	第85回利付国債（20年）	120,000,000	130,671,600	
	第85回利付国債（5年）	1,770,000,000	1,804,745,100	
	第86回利付国債（20年）	170,000,000	189,799,900	
	第86回利付国債（5年）	80,000,000	81,256,800	
	第87回利付国債（20年）	230,000,000	253,699,200	
	第87回利付国債（5年）	1,840,000,000	1,861,472,800	
	第88回利付国債（20年）	420,000,000	468,367,200	
	第88回利付国債（5年）	1,700,000,000	1,719,856,000	
	第89回利付国債（20年）	280,000,000	308,243,600	
	第89回利付国債（5年）	1,700,000,000	1,711,849,000	
	第8回利付国債（30年）	50,000,000	50,439,000	
	第90回利付国債（20年）	480,000,000	528,024,000	
	第91回利付国債（20年）	290,000,000	323,202,100	
	第92回利付国債（20年）	710,000,000	769,554,800	
	第93回利付国債（20年）	150,000,000	160,108,500	
	第94回利付国債（20年）	440,000,000	476,097,600	
	第95回利付国債（20年）	430,000,000	477,226,900	
	第96回利付国債（20年）	220,000,000	237,633,000	
	第97回利付国債（20年）	510,000,000	557,511,600	
	第98回利付国債（20年）	230,000,000	247,986,000	
	第99回利付国債（20年）	640,000,000	689,222,400	
	第9回ポーランド共和国円貨債券（2009）	100,000,000	98,642,000	
	第9回利付国債（30年）	70,000,000	65,349,900	
	小計	115,740,000,000	121,949,865,900	
地方債証券	第113回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	108,739,000	
	第116回神奈川県公募公債	14,000,000	14,272,860	
	第11回東京都公募公債（30年）	100,000,000	104,335,000	
	第124回神奈川県公募公債	10,000,000	10,383,600	
	第12回す号名古屋市公募公債	100,000,000	107,171,000	
	第144回神奈川県公募公債	100,000,000	108,516,000	
	第14回共同発行市場公募地方債	100,200,000	104,682,948	
	第150回神奈川県公募公債	100,000,000	107,817,000	
	第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,934,000	
	第167回神奈川県公募公債	140,000,000	148,003,800	
	第17回東京都公募公債（20年）	100,000,000	105,867,000	
	第19回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,285,000	

第19回東京都公募公債（20年）	100,000,000	106,172,000	
第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,211,000	
第21回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,601,000	
第247回大阪府公募公債（10年）	20,000,000	20,229,400	
第248回大阪府公募公債（10年）	16,550,000	16,847,900	
第252回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,159,000	
第262回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,542,000	
第271回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,919,000	
第284回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,912,000	
第28回1号宮城県公募公債	116,000,000	117,534,680	
第291回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	108,528,000	
第29回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,160,000	
第307回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	108,313,000	
第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,455,000	
第35回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,574,000	
第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,967,000	
第3回共同発行市場公募地方債	20,000,000	20,146,600	
第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	111,008,000	
第40回共同発行市場公募地方債	120,000,000	131,670,000	
第41回共同発行市場公募地方債	100,000,000	109,224,000	
第458回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	107,910,000	
第47回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	102,984,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	113,200,000	
第52回共同発行市場公募地方債	100,000,000	109,298,000	
第55回共同発行市場公募地方債	158,400,000	172,703,520	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,161,000	
第587回東京都公募公債	10,000,000	10,198,500	
第588回東京都公募公債	117,000,000	119,430,090	
第591回東京都公募公債	108,000,000	110,064,960	
第593回東京都公募公債	143,000,000	144,947,660	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	108,999,000	
第5回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	110,482,000	
第602回東京都公募公債	20,000,000	20,719,200	
第608回東京都公募公債	100,000,000	104,627,000	
第611回東京都公募公債	40,000,000	42,321,200	
第618回東京都公募公債	100,000,000	104,858,000	
第622回東京都公募公債	100,000,000	104,509,000	
第623回東京都公募公債	100,000,000	104,648,000	
第633回東京都公募公債	129,000,000	140,201,070	
第639回東京都公募公債	50,000,000	54,186,500	
第674回東京都公募公債	100,000,000	104,592,000	
第67回共同発行市場公募地方債	165,700,000	176,162,298	
第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	107,087,000	
第75回共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,890,000	
第75回川崎市公募公債	22,000,000	22,466,620	

第77回共同発行市場公募地方債	110,000,000	116,565,900	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,594,000	
第81回川崎市公募公債	100,000,000	106,483,000	
第82回川崎市公募公債	100,000,000	105,629,000	
第9回東京都公募公債（30年）	100,000,000	108,167,000	
第9回名古屋市長公募公債（20年）	100,000,000	105,366,000	
平成13年度第2回京都府公募公債	10,000,000	10,147,200	
平成13年度第2回福岡市公募公債	18,000,000	18,221,580	
平成13年度第5回横浜市公募公債	10,000,000	10,147,200	
平成14年度第1回愛知県公募公債	20,000,000	20,372,400	
平成14年度第1回広島市公募公債	10,000,000	10,168,700	
平成14年度第1回仙台市公募公債	20,000,000	20,424,200	
平成14年度第1回千葉市公募公債	100,100,000	102,214,112	
平成14年度第2回愛知県公募公債	120,000,000	122,655,600	
平成14年度第2回埼玉県公募公債	20,040,000	20,433,986	
平成14年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	101,392,000	
平成14年度第8回札幌市公募公債	28,300,000	28,572,812	
平成15年度第1回愛知県公募公債	100,000,000	103,574,000	
平成15年度第5回札幌市公募公債	72,580,000	75,449,087	
平成15年度第5回北海道公募公債	50,000,000	51,616,500	
平成15年度第6回福岡市公募公債	124,600,000	128,954,770	
平成15年度第6回兵庫県公募公債	10,000,000	10,378,700	
平成16年度第1回広島県公募公債	100,000,000	104,302,000	
平成16年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	104,883,000	
平成16年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	104,801,000	
平成16年度第4回静岡県公募公債	150,000,000	157,927,500	
平成16年度第4回兵庫県公募公債	200,000,000	209,244,000	
平成16年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	104,302,000	
平成17年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	105,404,000	
平成17年度第13回神戸市公募公債	100,000,000	106,315,000	
平成17年度第13回兵庫県公募公債	200,000,000	213,588,000	
平成17年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	104,363,000	
平成17年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	106,278,000	
平成17年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	104,630,000	
平成17年度第6回札幌市公募公債	100,000,000	105,877,000	
平成18年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	108,652,000	
平成18年度第1回北海道公募公債	100,000,000	107,184,000	
平成18年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	108,987,000	
平成18年度第4回札幌市公募公債	100,000,000	108,072,000	
平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	108,435,000	
平成19年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	109,467,000	
平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	108,020,000	
平成19年度第8回北海道公募公債（5年）	100,000,000	102,258,000	
平成19年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	108,459,000	
平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	107,078,000	

	平成２０年度第６回愛知県公募公債（１０年）	100,000,000	107,926,000	
	平成２１年度第１２回千葉県公募公債	100,000,000	104,499,000	
	平成２１年度第１回横浜市公募公債	200,000,000	213,044,000	
	平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	100,000,000	108,385,000	
	平成２１年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	105,839,000	
	小計	9,893,470,000	10,476,574,653	
特殊債券	い第６８２号農林債	100,000,000	101,503,000	
	い第６８５号農林債	210,000,000	214,544,400	
	い第６８９号農林債	100,000,000	102,417,000	
	い第６９０号農林債	100,000,000	102,090,000	
	い第６９４号農林債	100,000,000	102,022,000	
	い第６９５号農林債	100,000,000	102,088,000	
	い第７０４号商工債	100,000,000	103,508,000	
	い第７０５号商工債	100,000,000	103,748,000	
	い第７０７号農林債	200,000,000	206,934,000	
	い第７１０号農林債	100,000,000	102,312,000	
	い第７１５号農林債	100,000,000	101,209,000	
	い第７１８号商工債	100,000,000	101,260,000	
	第１０８号商工債（３年）	100,000,000	101,117,000	
	第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	81,451,000	85,675,048	
	第１０回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,124,000	
	第１１９号商工債（３年）	100,000,000	100,401,000	
	第１１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,382,000	
	第１１回日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,451,000	
	第１２回政府保証国民生活債券	179,000,000	186,296,040	
	第１２回都市再生債券	100,000,000	101,486,000	
	第１３４回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	100,826,000	
	第１３５回政府保証阪神高速道路債券	20,000,000	20,733,800	
	第１３回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	115,977,780	
	第１３回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,445,000	
	第１４５回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	105,019,000	
	第１４回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,206,000	
	第１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	84,349,000	87,977,693	
	第１５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	84,831,000	88,298,891	
	第１７１回政府保証中小企業債券	12,000,000	12,215,640	
	第１７６回政府保証中小企業債券	20,000,000	20,825,000	
	第１７回公営企業債券	100,000,000	105,973,000	
	第１８２回政府保証中小企業債券	10,000,000	10,490,900	
	第１９０回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	104,060,000	
	第１９３回政府保証首都高速道路債券	104,000,000	109,112,640	
	第１回公営企業債券（５年）	200,000,000	204,002,000	
	第１回政府保証新東京国際空港債券	11,000,000	11,221,210	
	第１回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	217,002,540	
	第１回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,084,000	
	第１回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	106,524,000	

第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	106,104,000	
第1回政府保証農林漁業金融公庫債券	12,000,000	12,278,760	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	64,947,000	68,165,773	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,887,000	83,365,414	
第1回中日本高速道路株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,271,000	
第1回日本鉄道建設債券	100,000,000	101,572,000	
第200回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	104,885,000	
第203回信金中金債（5年）	100,000,000	101,306,000	
第205回信金中金債（5年）	100,000,000	101,485,000	
第212回信金中金債（5年）	100,000,000	102,477,000	
第214回信金中金債（5年）	100,000,000	102,099,000	
第21回道路債券	100,000,000	112,535,000	
第222回信金中金債（5年）	200,000,000	205,766,000	
第224回信金中金債（5年）	100,000,000	103,200,000	
第226回信金中金債（5年）	100,000,000	103,082,000	
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,731,000	
第233回信金中金債（5年）	100,000,000	103,577,000	
第237回信金中金債（5年）	100,000,000	102,465,000	
第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,952,000	
第24回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,795,000	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,242,000	96,440,722	
第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	106,938,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	109,154,000	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,311,000	97,789,928	
第2回政府保証成田国際空港債券	147,000,000	156,940,140	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,181,000	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	66,415,000	70,430,450	
第30回公営企業債券	100,000,000	109,987,000	
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,087,000	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,749,000	98,331,451	
第30回中小企業債券	40,000,000	40,839,600	
第313回政府保証道路債券	100,000,000	102,221,000	
第315回政府保証道路債券	225,000,000	227,929,500	
第316回政府保証道路債券	120,000,000	121,300,800	
第319回政府保証道路債券	30,000,000	30,608,400	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,345,000	99,338,048	
第322回東京交通債券	10,000,000	11,537,300	
第323回政府保証道路債券	100,000,000	104,161,000	
第327回政府保証道路債券	100,000,000	104,529,000	
第328回政府保証道路債券	114,000,000	119,271,360	
第331回政府保証道路債券	102,000,000	108,145,500	
第333回政府保証道路債券	48,000,000	50,604,960	
第344回東京交通債券	100,000,000	103,947,000	
第346回政府保証道路債券	143,000,000	150,637,630	
第346回東京交通債券	20,000,000	19,477,400	

第347回政府保証道路債券	181,000,000	189,874,430	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,425,000	101,435,987	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,436,000	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	215,000,000	235,480,900	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	74,163,000	77,283,779	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,399,000	102,391,047	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,158,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,876,000	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	74,546,000	77,108,146	
第3回公営企業債券	40,000,000	40,840,400	
第3回公営企業債券（20年）	10,000,000	9,673,100	
第3回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	111,290,470	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	73,954,000	79,110,072	
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	108,265,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,659,000	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	72,620,000	77,085,403	
第47回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,876,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,393,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,213,000	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	77,777,000	82,590,618	
第4回国際協力銀行債券	120,000,000	122,238,000	
第4回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	102,140,000	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	70,678,000	73,958,165	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,880,000	84,201,244	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	78,787,000	82,738,955	
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	30,000,000	31,854,000	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	117,842,040	
第5回公営企業債券	100,000,000	101,302,000	
第5回新東京国際空港債券	100,000,000	104,508,000	
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	84,918,400	
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,723,000	
第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	106,776,000	
第5回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,627,000	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	54,035,000	55,776,548	
第5回東日本高速道路株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,635,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	109,197,000	
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,120,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	196,082,730	
第6回公営企業債券	10,000,000	10,098,200	
第6回国際協力銀行債券	100,000,000	101,845,000	
第6回阪神高速道路債券	100,000,000	104,879,000	
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	108,358,000	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	116,404,000	123,829,411	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	73,025,000	76,018,294	
第6回都市基盤整備債券	100,000,000	101,589,000	

	第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	109,882,000	
	第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	106,588,000	
	第7回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	106,385,000	
	第808回政府保証公営企業債券	110,000,000	111,433,300	
	第810回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,634,000	
	第814回政府保証公営企業債券	122,000,000	124,348,500	
	第815回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,016,000	
	第818回政府保証公営企業債券	101,000,000	103,143,220	
	第821回政府保証公営企業債券	110,000,000	112,174,700	
	第827回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,082,000	
	第836回政府保証公営企業債券	10,000,000	10,370,500	
	第839回政府保証公営企業債券	28,000,000	29,292,760	
	第840回政府保証公営企業債券	13,000,000	13,654,290	
	第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,908,000	
	第855回政府保証公営企業債券	140,000,000	146,850,200	
	第859回政府保証公営企業債券	131,000,000	139,086,630	
	第862回政府保証公営企業債券	200,000,000	215,952,000	
	第866回政府保証公営企業債券	100,000,000	109,415,000	
	第867回政府保証公営企業債券	100,000,000	108,360,000	
	第872回政府保証公営企業債券	200,000,000	217,382,000	
	第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	108,124,000	
	第875回政府保証公営企業債券	312,000,000	337,465,440	
	第876回政府保証公営企業債券	122,000,000	133,621,720	
	第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,670,000	
	第8回公営企業債券（20年）	40,000,000	44,206,800	
	第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	106,833,000	
	第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	60,265,000	63,562,700	
	第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	76,907,000	80,885,399	
	第8回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	106,233,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,437,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,998,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	108,302,000	
	第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	60,545,000	63,981,534	
	第9回都市再生債券	100,000,000	101,451,000	
	小計	16,176,937,000	17,007,527,750	
社債券	第103回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	202,350,000	
	第10回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	101,963,000	
	第11回シティグループ・インク円貸社債（2003）	200,000,000	198,170,000	
	第11回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貸社債	100,000,000	100,485,000	
	第12回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	102,439,000	
	第133回オリックス株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,927,000	
	第138回オリックス株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,106,000	
	第13回積水ハウス株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,234,000	
	第13回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	204,364,000	
	第14回トヨタファイナンス株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,480,000	

第14回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク円貨社債	100,000,000	101,014,000	
第14回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,703,000	
第15回シェイ・エイ・エフ・イー・ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,662,000	
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	105,249,000	
第16回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	206,178,000	
第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,591,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,835,000	
第17回電源開発株式会社無担保社債間限定同順位特約付	200,000,000	218,226,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	111,704,000	
第18回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	100,000,000	103,766,000	
第18回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,683,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,314,000	
第1回A号日本生命2009基金特定目的会社特定社債（一般担保付）	100,000,000	102,868,000	
第1回みずほ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	106,089,000	
第1回ラポバンク円貨社債	100,000,000	103,438,000	
第1回株式会社ジェイテクト無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,686,000	
第1回大和ハウス工業株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,194,000	
第20回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	200,000,000	204,564,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	109,352,000	
第20回三菱重工業株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,208,000	
第20回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,466,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,980,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	100,988,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	111,692,000	
第248回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	119,620,000	
第24回シャープ株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	101,731,000	
第24回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	101,034,000	
第24回三井不動産株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,863,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,315,000	
第257回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,580,000	
第261回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	31,000,000	35,720,990	
第26回日本郵船株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,236,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,621,000	
第285回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	107,108,000	
第286回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,877,000	
第28回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	104,660,000	
第2回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債（2008）	100,000,000	103,988,000	
第2回三菱信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	105,372,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,542,000	
第30回東京瓦斯株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,015,000	
第316回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	110,588,000	
第346回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	109,972,000	
第362回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	107,104,000	
第376回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	116,876,000	
第380回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	118,633,000	

第382回東北電力株式会社社債（一般担保付）	20,000,000	23,360,000	
第387回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,975,000	
第38回三菱電機株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,990,000	
第39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	102,663,000	
第3回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	107,188,000	
第3回株式会社サンケイビル無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,114,000	
第3回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	108,773,000	
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	101,293,000	
第3回松下電工株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	105,654,000	
第405回中部電力株式会社社債（一般担保付）	50,000,000	58,566,000	
第408回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	107,031,000	
第408回中部電力株式会社社債（一般担保付）	50,000,000	58,551,500	
第40回日立キャピタル株式会社無担保社債間同順位特約付	100,000,000	101,204,000	
第425回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	117,804,000	
第431回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,020,000	
第451回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	108,237,000	
第455回東京電力株式会社社債（一般担保付）	120,000,000	132,798,000	
第459回東京電力株式会社社債（一般担保付）	10,000,000	11,554,600	
第462回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,602,000	
第463回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,440,000	
第464回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,248,000	
第46回株式会社三井住友銀行無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,307,000	
第46回日本電信電話株式会社電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	101,982,000	
第473回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	107,104,000	
第474回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	107,102,000	
第47回株式会社三井住友銀行無担保社債間限定同順位特約付	200,000,000	204,294,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,201,000	
第489回東京電力株式会社社債（一般担保付）	20,000,000	20,260,600	
第498回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,873,000	
第4回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	104,215,000	
第4回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債（2010）	100,000,000	100,671,000	
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	100,238,000	
第4回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債	100,000,000	102,903,000	
第4回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,497,000	
第4回電源開発株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,328,000	
第501回東京電力株式会社社債（一般担保付）	30,000,000	30,474,300	
第505回東京電力株式会社社債（一般担保付）	30,000,000	30,397,500	
第510回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,702,000	
第518回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,806,000	
第51回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	102,315,000	
第51回日産自動車株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,052,000	
第521回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	108,717,000	
第528回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	108,990,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,551,000	
第536回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	107,641,000	

第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,198,000	
第53回三井物産株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,181,000	
第542回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	107,136,000	
第544回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	110,005,000	
第54回日本電信電話株式会社電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	108,682,000	
第55回新日本製鐵株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,871,000	
第5回アフラック・インコーポレーテッド円貨社債（2007）	100,000,000	100,114,000	
第5回日本たばこ産業株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,839,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	109,367,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,943,000	
第6回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	106,177,000	
第70回住友不動産株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,370,000	
第75回丸紅株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	102,064,000	
第7回KDDI株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,782,000	
第7回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,405,000	
第7回エーザイ株式会社無担保社債	100,000,000	106,388,000	
第7回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,626,000	
第7回ジャパンリアルエステイト投資法人無担保投資法人債	100,000,000	101,635,000	
第7回トヨタ自動車株式会社無担保社債（社債間限定同等特約付）	200,000,000	206,504,000	
第7回パナソニック株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,603,000	
第7回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債	100,000,000	101,709,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,105,000	
第8回旭化成株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,874,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	105,825,000	
第8回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	102,690,000	
第8回三菱UFJリース無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,858,000	
第8回昭和シェル石油株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,108,000	
第9回株式会社日興コーディアルグループ無担保社債	100,000,000	99,974,000	
第9回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	102,685,000	
第9回三菱UFJリース株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,872,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債間限定同順位特約付	19,000,000	21,177,590	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	116,444,000	
小計	13,300,000,000	13,942,323,080	
合計	155,110,407,000	163,376,291,383	

2) 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3) デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】（平成22年10月29日現在）

I 資産総額	32,456,095,504 円
II 負債総額	26,487,000 円

Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	32,429,608,504 円
Ⅳ 発行済口数	29,402,597,911 口
Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1030 円

(参考情報)

住信 国内債券インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	161,349,300,768 円
Ⅱ 負債総額	28,797,752 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	161,320,503,016 円
Ⅳ 発行済口数	133,179,979,470 口
Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2113 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（イ）名義書換

該当事項はありません。

（ロ）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（ハ）譲渡制限

該当事項はありません。

（ニ）振替受益権の取扱い

本ファンドの受益権は、社振法の適用を受けています。

①受益証券の不発行

委託者は、本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がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

②受益権の譲渡

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

2) 前記1)の申請のある場合には、前記1)の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記1)の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

3) 委託者は、前記1)に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めた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。

③受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

④受益権の再分割

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

⑤償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係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指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については、原則として取得申込者としてします。）に支払います。

⑥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係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、投資信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（イ）資本金の額

平成22年10月29日現在の資本金の額	3億円
発行可能株式総数	24,000株
発行済株式総数	6,000株
最近5年間にける資本金の額の増減	なし

（ロ）会社の機構

①経営体制

経営の意思決定機関として、取締役会をおきます。3名以上の取締役が、株主総会で選任されます。取締役の選任は、議決権を行使することができる株主の議決権の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選任します。取締役の選任については、累積投票にはよりません。

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ときまでとします。増員により、または補欠として選任された取締役の任期は、他の在任取締役の任期の満了するときまでとします。

取締役会は、その決議により、取締役の中から代表取締役若干名を選定します。また、取締役会の決議により、取締役社長1名を置き、必要に応じ取締役会長1名、取締役副社長、専務取締役および常務取締役各若干名を置くことができます。

取締役会は、取締役社長が招集し、その議長となります。取締役社長に事故があるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順序により、他の取締役がこれに代わります。取締役会招集の通知は、会日の3日前までに発します。ただし、緊急の場合は、この期間を短縮することができます。

取締役会の決議は、取締役の過半数が出席し、その取締役の過半数をもって行います。

②運用体制

〔PLAN(計画)〕

ファンドの運用基本方針、運用手法、運用プロセス等は、社長を委員長とし、運用担当役員、営業担当役員、投資企画部長、営業企画部長等10名程度で構成される商品委員会において決定されます。

〔DO(実行)〕

ファンドの運用計画は、商品委員会において決定された運用基本方針、運用手法、運用プロセス、運用ガイドライン等に則り、各運用部において、ファンドマネジャーによって起案され、各運用部長が決定します。ファンドマネジャーは、運用計画に沿って運用の指図を行います。

売買の執行は、運用部署から独立したトレーディング部署が行います。

〔SEE(検証)〕

毎月開催される運用委員会において、ファンドのパフォーマンス分析、リスク分析を通じて、運用プロダクトのクオリティーコントロールを行います。

また、ファンドの投資信託約款、運用ガイドライン等の遵守状況の確認、ファンドの運用実績、運用リスクの把握・モニタリングを行う機関として、運用リスク管理委員会を毎月開催します。運用リスク管理委員会は、社長を委員長とし、リスク管理担当役員、運用担当役員、営業担当役員、リスク管理部長、各運用部長等10名程度で構成されます。

また、法令諸規則等遵守状況は、コンプライアンス委員会に報告されます。コンプライアンス委員会は、原則として毎月開催され、社長を委員長とし、リスク管理担当役員、運用担当役員、営業担当役員、リスク管理部長、各運用部長、各営業部長等15名程度で構成されます。

なお、ファンドの運用実績、運用リスクの把握・モニタリング、法令諸規則や投資信託約款等の遵守状況の

確認は、運用部署から独立したリスク管理部が行います。（5名程度）

会社の機構は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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者は、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等の関連する業務を行っています。

平成22年10月29日現在、委託者が運用の指図を行っている証券投資信託は次のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
追加型株式投資信託	156	1,393,935
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	156	1,393,935

3【委託会社等の経理状況】

（イ）委託者の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）第2条に基づき、同規則及び「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）により作成しております。

なお、前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）は、改正前の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき、当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）は、改正後の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。

また、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

（ロ）委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）及び当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）の財務諸表について、あずさ監査法人による監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 (平成21年3月31日現在)		当事業年度 (平成22年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金	※2	4,620,293	※2	5,642,056
有価証券		324,008		—
前払金		—		6,819
前払費用		33,583		35,081
未収委託者報酬		762,027		942,664
未収運用受託報酬		37,916		48,083

未収還付法人税等	108,554	—
未収消費税等	13,438	—
繰延税金資産	26,084	44,119
その他	4,235	129
流動資産合計	5,930,144	6,718,954
固定資産		
有形固定資産		
建物	63,983	49,765
器具備品	40,445	26,485
有形固定資産合計	※1 104,428	※1 76,250
無形固定資産		
ソフトウェア	83,031	95,682
その他無形固定資産	146	126
無形固定資産合計	83,178	95,808
投資その他の資産		
投資有価証券	294,353	245,516
敷金・保証金	238,033	238,033
長期前払費用	225	449
繰延税金資産	55,356	55,356
その他の投資	255	225
投資その他の資産合計	588,223	539,579
固定資産合計	775,830	711,639
資産合計	6,705,974	7,430,593

(単位：千円)

	前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	17,703	16,838
未払金	465,995	520,453
未払収益分配金	130	130
未払手数料	※2 361,950	※2 454,590
その他未払金	103,914	65,733
未払費用	※2 85,253	※2 126,959
未払法人税等	—	174,433
未払消費税等	—	11,758

賞与引当金	79,979	70,599
流動負債合計	648,932	921,042
固定負債		
退職給付引当金	91,962	122,901
固定負債合計	91,962	122,901
負債合計	740,894	1,043,943
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
利益剰余金		
利益準備金	47,500	50,500
その他利益剰余金		
別途積立金	4,100,000	5,100,000
繰越利益剰余金	1,542,542	942,449
利益剰余金合計	5,690,042	6,092,949
株主資本合計	5,990,042	6,392,949
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△ 24,962	△ 6,299
評価・換算差額等合計	△ 24,962	△ 6,299
純資産合計	5,965,080	6,386,650
負債・純資産合計	6,705,974	7,430,593

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	9,373,528	8,637,673
運用受託報酬	99,489	108,227
営業収益合計	9,473,018	8,745,901
営業費用		
支払手数料	※1 4,753,041	※1 4,414,750
広告宣伝費	227,750	123,104
公告費	2,934	2,520
受益証券発行費	—	95
調査費	881,688	835,300

調査費	80,845	85,751
委託調査費	798,694	747,629
図書費	2,148	1,918
営業雑経費	650,350	650,397
通信費	10,965	10,735
印刷費	177,337	164,695
協会費	10,450	9,726
諸会費	586	594
情報機器関連費	400,645	429,265
その他営業雑経費	50,366	35,380
営業費用合計	6,515,764	6,026,169
一般管理費		
給料	1,346,925	1,313,847
役員報酬	39,900	34,470
給料・手当	1,127,586	1,098,871
賞与	179,439	180,505
退職給付費用	65,654	52,327
役員退職慰労金	—	1,980
福利費	149,509	148,136
交際費	1,777	1,771
旅費交通費	54,749	43,688
租税公課	16,216	17,962
不動産賃借料	238,033	238,033
寄付金	3,960	3,745
減価償却費	60,600	58,878
諸経費	158,896	101,459
一般管理費合計	2,096,324	1,981,829
営業利益	860,928	737,901

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	2,532	1,046
有価証券利息	1,544	257
受取利息	※1 12,425	※1 6,564

投資有価証券売却益	291	1,179
その他	5,943	3,344
営業外収益合計	22,737	12,393
営業外費用		
支払保証料 ※1	64	—
投資有価証券売却損	2,275	12,836
投資有価証券評価損	637	—
固定資産除却損 ※2	24	※2 1,136
その他	1,759	820
営業外費用合計	4,762	14,794
経常利益	878,903	735,501
税引前当期純利益	878,903	735,501
法人税、住民税及び事業税	328,438	333,431
法人税等調整額	29,609	△ 30,837
法人税等合計	358,047	302,594
当期純利益	520,856	432,906

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	300,000	300,000
当期変動額		
当期変動額合計	—	—
当期末残高	300,000	300,000
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	44,500	47,500
当期変動額		
剰余金の配当に伴う積立	3,000	3,000
当期変動額合計	3,000	3,000
当期末残高	47,500	50,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	3,100,000	4,100,000

当期変動額		
別途積立金の積立	1,000,000	1,000,000
当期変動額合計	1,000,000	1,000,000
当期末残高	4,100,000	5,100,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	2,054,686	1,542,542
当期変動額		
剰余金の配当	△ 33,000	△ 33,000
当期純利益	520,856	432,906
別途積立金の積立	△ 1,000,000	△ 1,000,000
当期変動額合計	△ 512,143	△ 600,093
当期末残高	1,542,542	942,449
利益剰余金合計		
前期末残高	5,199,186	5,690,042
当期変動額		
剰余金の配当	△ 30,000	△ 30,000
当期純利益	520,856	432,906
当期変動額合計	490,856	402,906
当期末残高	5,690,042	6,092,949
株主資本合計		
前期末残高	5,499,186	5,990,042
当期変動額		
剰余金の配当	△ 30,000	△ 30,000
当期純利益	520,856	432,906
当期変動額合計	490,856	402,906
当期末残高	5,990,042	6,392,949

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）	当事業年度 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	△ 2,238	△ 24,962
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 22,724	18,662
当期変動額合計	△ 22,724	18,662

当期末残高	△ 24,962	△ 6,299
評価・換算差額等合計		
前期末残高	△ 2,238	△ 24,962
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 22,724	18,662
当期変動額合計	△ 22,724	18,662
当期末残高	△ 24,962	△ 6,299
純資産合計		
前期末残高	5,496,948	5,965,080
当期変動額		
剰余金の配当	△ 30,000	△ 30,000
当期純利益	520,856	432,906
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 22,724	18,662
当期変動額合計	468,132	421,569
当期末残高	5,965,080	6,386,650

重要な会計方針

項目	期別 前事業年度 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)
1 有価証券の評価基準 及び評価方法	その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時 価法によっております。（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し ております。） 時価のないもの 移動平均法による原価法によって おります。	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。 無形固定資産 定額法によっております。 ただし、ソフトウェア（自社利用分）に ついては、社内における利用可能期間（5 年）に基づく定額法によっております。	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 従業員の賞与の支給に備えるため、支 給見込額に基づき計上しております。 （２）退職給付引当金	（１）賞与引当金 同 左 （２）退職給付引当金

	従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当期末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。	同 左
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。	同 左

会計方針の変更

前事業年度 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)
リース取引に関する会計基準 所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、当事業年度より「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準第13号（平成5年6月17日（企業会計審議会第一部会）、平成19年3月30日改正））及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第16号（平成6年1月18日（日本公認会計士協会 会計制度委員会）、平成19年3月30日改正））が適用されたことに伴い、通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっております。これによる損益に与える影響はありません。	—

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)												
※1 有形固定資産の減価償却累計額 <table> <tr> <td>建 物</td><td>24,134千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>93,840千円</td></tr> <tr> <td>計</td><td>117,974千円</td></tr> </table>	建 物	24,134千円	器具備品	93,840千円	計	117,974千円	※1 有形固定資産の減価償却累計額 <table> <tr> <td>建 物</td><td>38,352千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>96,447千円</td></tr> <tr> <td>計</td><td>134,799千円</td></tr> </table>	建 物	38,352千円	器具備品	96,447千円	計	134,799千円
建 物	24,134千円												
器具備品	93,840千円												
計	117,974千円												
建 物	38,352千円												
器具備品	96,447千円												
計	134,799千円												
※2 関係会社に対するものは次のとおりであります。 <table> <tr> <td>預金</td><td>2,832,577千円</td></tr> <tr> <td>未払手数料</td><td>305,246千円</td></tr> <tr> <td>未払費用</td><td>80,084千円</td></tr> </table>	預金	2,832,577千円	未払手数料	305,246千円	未払費用	80,084千円	※2 関係会社に対するものは次のとおりであります。 <table> <tr> <td>預金</td><td>3,498,856千円</td></tr> <tr> <td>未払手数料</td><td>353,462千円</td></tr> <tr> <td>未払費用</td><td>119,557千円</td></tr> </table>	預金	3,498,856千円	未払手数料	353,462千円	未払費用	119,557千円
預金	2,832,577千円												
未払手数料	305,246千円												
未払費用	80,084千円												
預金	3,498,856千円												
未払手数料	353,462千円												
未払費用	119,557千円												

（損益計算書関係）

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

※1 関係会社に対するものは次のとおりであります。	※1 関係会社に対するものは次のとおりであります。
支払手数料 4,504,556千円	支払手数料 4,065,257千円
受取利息 5,343千円	受取利息 1,030千円
支払保証料 64千円	
※2 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。	※2 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。
器具備品 24千円	器具備品 1,136千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

株式の種類	前期末	当期増加	当期減少	当期末
普通株式（株）	6,000	—	—	6,000

2. 自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

3. 当期中に行った剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成20年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成20年3月31日	平成20年6月30日

4. 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成21年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	5,000	平成21年3月31日	平成21年6月29日

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

株式の種類	前期末	当期増加	当期減少	当期末
普通株式（株）	6,000	—	—	6,000

2. 自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

3. 当期中に行った剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成21年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成21年3月31日	平成21年6月29日

4. 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	配当金の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成22年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	5,000	平成22年3月31日	平成22年6月29日

（リース取引関係）

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (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。	同左

（金融商品関係）

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

（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。

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、資金運用については短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用し、必要な資金については内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクはきわめて低いものと考えております。また、投資有価証券は非上場株式と投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

未払金については、全て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

①信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

売上債権の管理については、社内規程を定め、随時確認を行うなどの管理を行っております。なお、未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスクはきわめて低いものと考えております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）を定めており、

投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価に関する事項

平成22年3月31日（当社の決算日）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、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注2）を参照ください）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	5,642,056	5,642,056	—
(2)未収委託者報酬	942,664	942,664	—
(3)投資有価証券 其他有価証券	46,016	46,016	—
(4)未払金	(520,453)	(520,453)	—

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券取引に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(4)未払金

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

（注2）非上場株式（貸借対照表計上額199,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

（注3）金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	5,642,056	—	—	—
未収委託者報酬	942,664	—	—	—

（有価証券関係）

前事業年度（平成21年3月31日現在）

1. その他有価証券で時価のあるもの

（単位:千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,000	4,157	157
小計	4,000	4,157	157
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	133,578	90,695	△ 42,883
小計	133,578	90,695	△ 42,883
計	137,578	94,853	△ 42,725

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

（単位:千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
16,166	291	2,275

3. 時価評価されていない主な有価証券

（単位:千円）

区分	貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	199,500
MMF	324,008
計	523,508

4. その他有価証券のうち満期があるもの

該当事項はありません。

当事業年度（平成22年3月31日現在）

1. その他有価証券

（単位:千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	5,362	6,387	1,025
小計	5,362	6,387	1,025
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

その他	51,275	39,628	△ 11,646
小計	51,275	39,628	△ 11,646
計	56,637	46,016	△ 10,621

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 199,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
74,035	1,179	12,836

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

当事業年度（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。

（退職給付関係）

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
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、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。 2. 退職給付債務及びその他のに関する事項 退職給付債務 91,962千円 退職給付引当金 91,962千円 (1) 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。 (2) 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。 3. 退職給付費用に関する事項 退職給付費用 65,654千円 (1) 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。 (2) 金額には確定拠出年金への掛金支払額12,624千円を含んでおります。 4. 退職給付債務等の計算基礎	1. 採用している退職給付制度の概要 同左 2. 退職給付債務及びその他のに関する事項 退職給付債務 122,901千円 退職給付引当金 122,901千円 (1) 同左 (2) 同左 3. 退職給付費用に関する事項 退職給付費用 52,327千円 (1) 同左 (2) 金額には確定拠出年金への掛金支払額13,326千円を含んでおります。 4. 退職給付債務等の計算基礎

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。	同左
--	----

(税効果会計関係)

前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
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 (繰延税金資産) 賞与引当金損金算入限度超過額 32,543千円 退職給付引当金損金算入限度超過額 37,419千円 有価証券評価差額 17,125千円 その他 811千円 繰延税金資産 合計 87,900千円 (繰延税金負債) 未収還付事業税 6,459千円 繰延税金負債 合計 6,459千円 差引 繰延税金資産の純額 81,441千円 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 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。	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 (繰延税金資産) 未払事業税 15,392千円 賞与引当金損金算入限度超過額 28,726千円 退職給付引当金損金算入限度超過額 50,008千円 有価証券評価差額 4,321千円 その他 1,025千円 繰延税金資産 合計 99,475千円 (繰延税金負債) — 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 同左

(持分法損益等)

前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
該当事項はありません。	同左

(関連当事者情報)

前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

(追加情報)

当事業年度から平成18年10月17日公表の、「関連当事者の開示に関する会計基準」（企業会計基準委員会 企業会計基準第11号）及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 企業会計基準第13号）を適用しております。

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社	住友信託銀行(株)	大阪市中央区	287,537	信託業務及び銀行業務	直接30%, 間接70%	営業上の取引 役員の兼任	投信販売 代行手数料	4,504,556	未払 手数料	305,246
							投資助言 費用の支払	604,558	その他 未払金	223
									未払費用	80,084

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、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 投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

② 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

該当事項はありません。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所及び大阪証券取引所に上場）

当事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社	住友信託銀行(株)	大阪市中央区	342,037	信託業務及び銀行業務	直接30%, 間接70%	営業上の取引 役員の兼任	投信販売 代行手数料	4,065,257	未払 手数料	353,462
							投資助言 費用の支払	609,879	未払費用	119,557

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、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 投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

② 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

該当事項はありません。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所及び大阪証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)		当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	
1株当たり純資産額	994,180円05銭	1株当たり純資産額	1,064,441円67銭
1株当たり当期純利益	86,809円36銭	1株当たり当期純利益	72,151円14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。		同左	

（注）1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
当期純利益	520,856千円	432,906千円
普通株主に帰属しない金額	—	—
普通株式に係る当期純利益	520,856千円	432,906千円
期中平均株式数	6,000株	6,000株

（重要な後発事象）

前事業年度 (自 平成20年4月1日	当事業年度 (自 平成21年4月1日
-----------------------	-----------------------

至 平成21年3月31日)	至 平成22年3月31日)
該当事項はありません。	同左

4【利害関係人との取引制限】

委託者は、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、委託者の親法人等（委託者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（ニ）および（ホ）において同じ。）または子法人等（委託者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) 委託者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) 前記（ハ）および（ニ）に掲げるもののほか、委託者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) 委託者の定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会において株主の決議が必要です。

(ロ) 訴訟事件その他の重要事項

本書提出日現在、委託者および本ファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

①住友信託銀行株式会社（受託者および指定販売会社）

1)資本金の額

平成22年3月末日現在 342,037百万円

2)事業の内容

銀行法にもとづき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）にもとづき信託業務を営んでいます。

②三井住友海上火災保険株式会社（指定販売会社）

1)資本金の額

平成22年3月末日現在 139,595百万円

2)事業の内容

保険業法にもとづき損害保険業を営んでいます。

③株式会社東邦銀行（指定販売会社）

1)資本金の額

平成22年3月末日現在 23,519百万円

2)事業の内容

銀行法にもとづき銀行業を営んでいます。

④株式会社みずほコーポレート銀行（指定販売会社）

1)資本金の額

平成22年3月末日現在 1,404,065百万円

2)事業の内容

銀行法にもとづき銀行業を営んでいます。

⑤第一生命保険株式会社（指定販売会社）

1)資本金の額

平成22年4月1日現在 210,200百万円

2)事業の内容

保険業法にもとづき生命保険業を営んでいます。

⑥株式会社千葉銀行（指定販売会社）

1)資本金の額

平成22年3月末日現在 145,069百万円

2)事業の内容

銀行法にもとづき銀行業を営んでいます。

⑦株式会社SBI証券（指定販売会社）

1)資本金の額

平成22年3月末日現在 47,937百万円

2)事業の内容

金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

（イ）受託者は、以下の業務を行います。

- ①投資信託財産の保管・管理
- ②投資信託財産の計算
- ③投資信託財産に関する報告書の作成
- ④その他前記の業務に付随する業務

（ロ）指定販売会社は、以下の業務を行います。

- ①受益権の募集・販売の取扱い
- ②追加設定の申込受付事務
- ③受益者に対する収益分配金の再投資事務
- ④受益者に対する一部解約等の事務
- ⑤受益者に対する一部解約金および償還金の支払事務
- ⑥受益者に対する運用報告書の交付
- ⑦その他前記の業務に付随する業務

指定販売会社によって引き受ける業務が異なる場合があります。

3【資本関係】

受託者および指定販売会社である住友信託銀行株式会社は、委託者である住信アセットマネジメント株式

会社の株式を1,800株保有しております。（発行済株式総数に対する比率は30%です。）

その他の前記関係法人と委託者との間に資本関係はありません。

＜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

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成22年3月末日現在）

業務の概要：銀行法にもと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もとづき信託業務を営んでいます。

第3【参考情報】

本ファンドについては、当該計算期間において次の書類を提出しています。

提出年月日	書類名
平成21年12月15日	有価証券報告書
平成21年12月15日	有価証券届出書
平成22年4月1日	有価証券届出書の訂正届出書
平成22年6月21日	半期報告書
平成22年6月21日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成22年11月12日

住信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 石井 勝也 ⑩

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている すみしん DC日本債券インデックス・オープンSの平成21年10月1日から平成22年9月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、すみしん DC日本債券インデックス・オープンSの平成22年9月30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。

住信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

-
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おりません。

[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6月29日

住信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
業務執行社員 公認会計士 壁 谷 恵 嗣 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている住信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24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、住信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、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21年10月23日

住信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
業務執行社員 公認会計士 壁 谷 恵 嗣 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」に掲げられているすみしん DC日本債券インデックス・オープンSの平成20年10月1日から平成21年9月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、すみしん DC日本債券インデックス・オープンSの平成21年9月30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。

住信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

-
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. 前計算期間の財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[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21年 6月29日

住信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
業務執行社員 公認会計士 白 川 芳 樹 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている住信アセットマネジメント株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第23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、住信アセットマネジメント株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

※上記は、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。