

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成26年1月24日

【発行者名】 三井住友トラスト・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 鈴木 郁也

【本店の所在の場所】 東京都港区芝3丁目33番1号

【事務連絡者氏名】 ファンド・レポートイング部長 橋詰 廣志

【電話番号】 03-6737-0521

**【届出の対象とした募集内国投資信託
受益証券に係るファンドの名称】** D C 外国債券インデックスファンドL

**【届出の対象とした募集内国投資信託
受益証券の金額】** 上限 10兆円

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DC外国債券インデックスファンドL

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

1口当たりの元本は1円です。

委託会社である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」といいます。）の依頼により、信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ ）とします。

「基準価額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出され、日々の基準価額は、販売会社へお問い合わせください（販売会社の詳細につきましては、下記「（8）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。）。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

ただし、分配金再投資に関する契約（後記「第二部 ファンド情報 第2 管理及び運営 1 申込（販売）手続等 （5）その他 」をご参照ください。）に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、後記「第二部 ファンド情報 第2 管理及び運営 3 資産管理等の概要 （4）計算期間」に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（ 7 ） 【 申込期間 】

平成26年 1 月25日から平成26年7月24日までとします。

（注）お申込みの取扱いは、営業日の午後 3 時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

ただし、後記「第二部 ファンド情報 第 1 ファンドの状況 2 投資方針（4）分配方針 収益分配金の再投資等」に規定する収益分配金の再投資をする場合を除き、ニューヨーク証券取引所又はロンドン証券取引所が休業日の場合は、受益権の取得申込みを受付けないものとし、金融商品取引所等（金融商品取引所（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で 有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第 8 項第 3 号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第 2 条第 8 項第 3 号口に規定する外国金融商品市場で 有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第 8 項第 5 号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付けを中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取消することができます。

なお、継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（ 8 ） 【 申込取扱場所 】

申込取扱場所（以下「販売会社」といいます。）の詳細につきましては、以下の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前 9 時から午後 5 時までとします。）

なお、販売会社が販売会社以外の第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第 1 項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）又は登録金融機関（金融商品取引法第33条の 2 の登録を受けた銀行、協同組織金融機関その他政令で定める金融機関をいいます。以下同じ。）と取次契約を結ぶことにより、当該第一種金融商品取引業者又は当該登録金融機関においても募集等の取次ぎを行う場合があります。

（ 9 ） 【 払込期日 】

申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込金額（申込受付日の翌営業日の基準価額 × 取得口数）を販売会社に支払うものとします。

継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

（ 10 ） 【 払込取扱場所 】

申込みを受付けた販売会社とします。（販売会社の詳細につきましては、上記「（ 8 ） 申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。）

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

申込証拠金

該当事項はありません。

日本以外の地域における発行

該当事項はありません。

振替受益権について

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

当ファンドは、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

信託金限度額

上限：3,000億円

基本的性格

当ファンドは、委託会社である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が投資者のために、利殖の目的をもって設定する証券投資信託で、三井住友信託銀行株式会社がその受託会社となることを引受けたものです。

当ファンドは、委託者が受託者に投資信託財産の運用を指図する委託者指図型の追加型証券投資信託で、その商品分類及び属性区分は以下のとおりです。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

(用語の定義について)

当ファンドが該当する商品分類に係る用語の定義は以下のとおりです。

なお、これ以外の用語の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) にてご確認いただけます。

< 単位型投信・追加型投信 >

- ・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 >

- ・海外...目論見書又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海外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...目論見書又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...目論見書又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。

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	為替ヘッジ	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 (日本を除く)			
	年2回	日本			日経225
	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ()	
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州			TOPIX
	年12回 (毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			
不動産投信	日々	中南米	ファンド ・オブ・ ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (債券 公債))	その他 ()	アフリカ			その他 (シティグループ世界国債 インデックス(除く日本、 ヘッジなし・円ベース))
		中近東 (中東)			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(用語の定義について)

当ファンドが該当する属性区分に係る用語の定義は以下のとおりです。

なお、これ以外の用語の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) にてご確認いただけます。

< 投資対象資産 >

・その他資産（投資信託証券）

…目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投信以外の資産に主として投資する旨の記載があるものをいいます。

- ##### ・債券 公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。

当ファンドでは株式、債券、不動産投信以外の資産である投資信託証券を主要投資対象とし、当該投資信託証券を通じて債券に投資します。

なお、商品分類表の投資対象資産（収益の源泉）が「債券」であるのに対して、属性区分表の投資対象資産では「その他資産（投資信託証券）」と異なる区分になっていますが、これは商品分類表では収益の源泉となる資産（実質基準）を記載するのに対して、属性区分表では組入れている資産そのもの（形式基準）を記載することとなっているためです。

< 決算頻度 >

- ##### ・年1回…目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

< 投資対象地域 >

・グローバル（日本を除く）

…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産（日本を除きます。）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

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

< 為替ヘッジ >

- ##### ・なし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

< インデックスファンドにおける対象インデックス >

・その他（シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））

…「その他」とは、日経225、TOPIX以外の指数をいいます。

なお、当ファンドの対象インデックスは「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」です。

「シティグループ世界国債インデックス」とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インク（以下「CGMI」）が開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、CGMI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、CGMIが有しています。なお、CGMIは、ファンドの設定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。

ファンドの特色

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行い、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に採用されている国の国債等に分散投資を行い、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

（２）【ファンドの沿革】

- 平成15年 1月15日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始
- 平成24年 4月 1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継
当ファンドの名称を中央三井DC外国債券インデックスファンドLからDC外国債券インデックスファンドLに変更
当ファンドの主要投資対象である中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンドに変更

（３）【ファンドの仕組み】

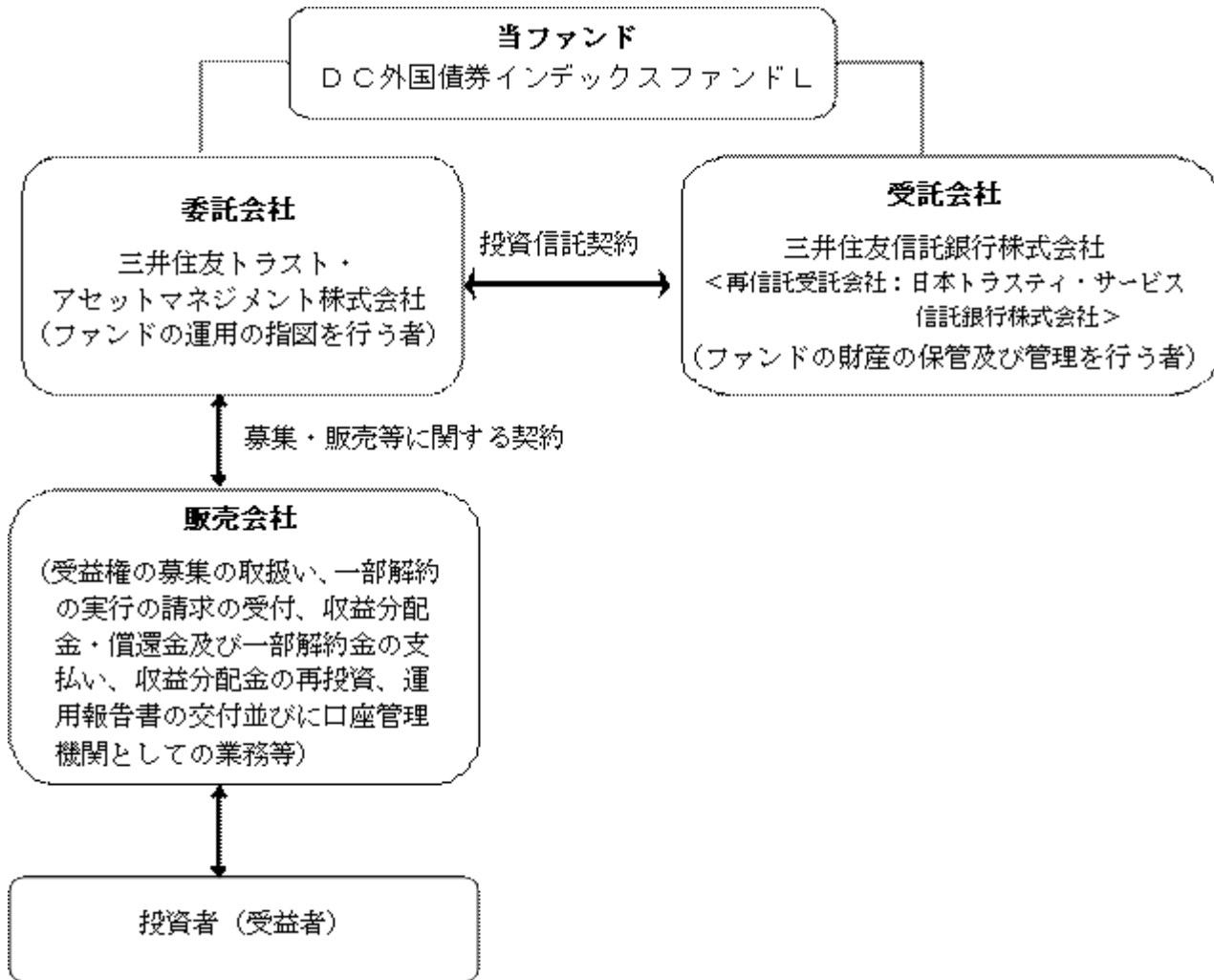
ファミリーファンド方式での運用

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まとめてベビーファンド（DC外国債券インデックスファンドL）とし、その資金をマザーファンド（外国債券マザーファンド）に投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



※マザーファンドの運用にあたっては、年金運用など豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行からの投資助言を受けます。

ファンドの関係法人



委託会社の概況

A．資本金の額：3億円（平成25年11月29日現在）

B．委託会社の沿革

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）

平成24年4月1日：中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

C．大株主の状況（平成25年11月29日現在）

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

運用方針

当ファンドは、日本を除く世界の主要国の公社債に投資する外国債券マザーファンドを主要投資対象とし、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。なお、公社債等に直接投資することもあります。

投資態度

- A．公社債への実質投資は、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に採用されている国の国債等に分散投資を行い、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。
- B．公社債等の実質投資割合は、原則として高位を保ちます。
- C．外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。
- D．運用の効率化を図るため、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、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- E．資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき等、並びに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。
- F．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並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、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及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。
- G．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又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。）を行うことができます。
- H．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- A．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。）
 - 1．有価証券
 - 2．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、後記（5）F．、G．及びH．に定めるものに限りません。）
 - 3．金銭債権（上記1．、2．及び下記4．に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - 4．約束手形（上記1．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- B．次に掲げる特定資産以外の資産
 - 1．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「外国債券マザー

ファンド」(以下、「マザーファンド」といいます。)の受益証券及び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きます。)に投資することを指図します。

1. 国債証券
2. 地方債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。)
5. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
6. 転換社債の転換及び新株予約権(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号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の新株予約権に限ります。)の行使により取得した株券
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記1.から7.までの証券又は証書の性質を有するもの
9. 投資信託又は外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。)
10. 投資証券又は外国投資証券(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。)
11. 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。)
12. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
13. 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。)
14. 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。)
15. 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
16. 外国の者に対する権利で上記15.の有価証券の性質を有するもの

なお、上記6.の証券及び上記8.の証券又は証書のうち上記6.の証券の性質を有するものを以下「株式」といい、上記1.から5.までの証券及び上記8.の証券又は証書のうち上記1.から5.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記9.の証券及び上記10.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用指図できる金融商品

A. 委託会社は、信託金を、上記 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。

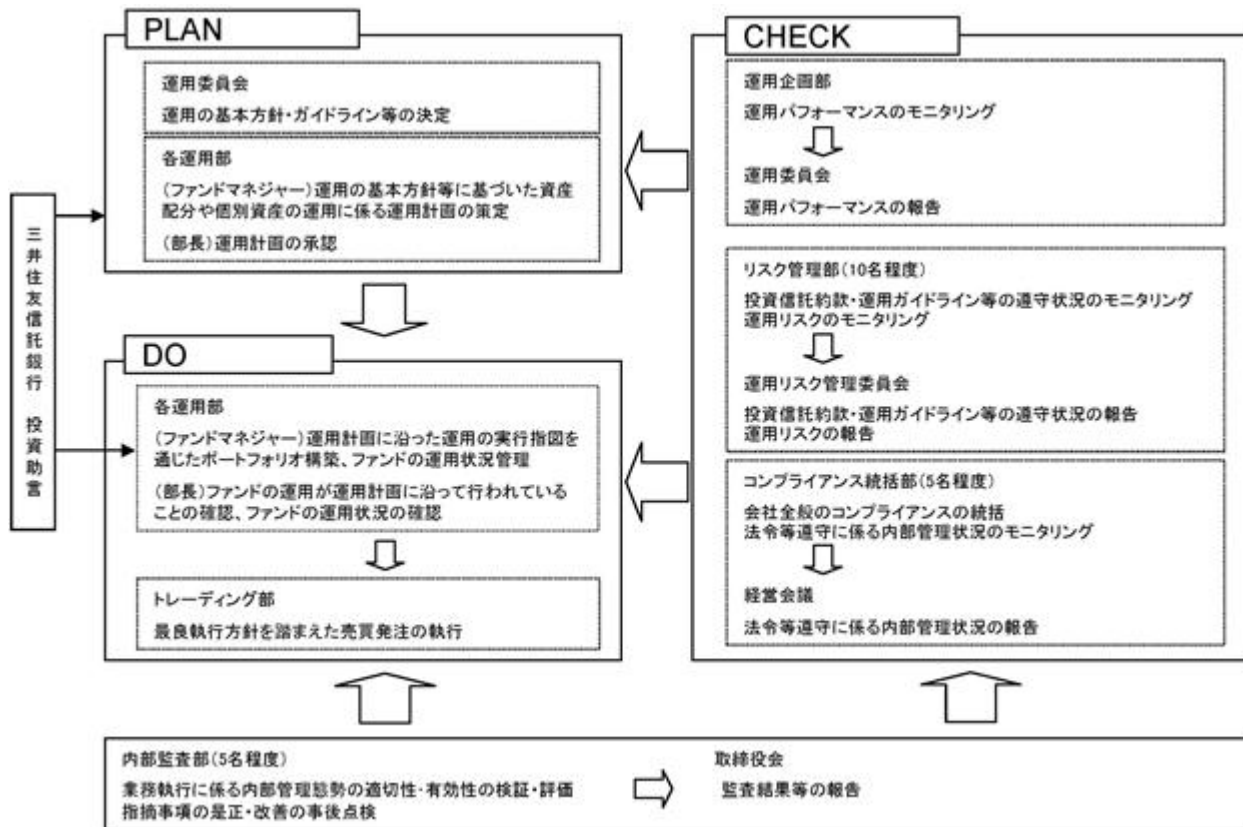
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記A．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】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、平成26年1月24日現在のものであり、今後変更されることがあります。



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

（4）【分配方針】

分配方針

年1回の毎決算時（決算日は10月24日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

- 分配対象額は、経費控除後の利子等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の合計額とします。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は分配を行わないことがあります。
- 収益分配に充てず信託財産に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

分配収益の計算

- 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- イ．配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及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（後記「4 手数料等及び税金（4）その他の手数料等」の記載をご参照ください。）、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）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充てるため、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。
- ロ．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等相当額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配に充てるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- ハ．収益分配金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
- 二．「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。
- B．毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。
- 収益分配金の再投資等
- 収益分配金は、自動的に当ファンドの受益権に再投資されます。
- A．分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。
- B．販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、毎計算期間終了日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（上記A．の収益分配金に係る計算期間終了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、上記A．の収益分配金に係る計算期間終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又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。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。
- C．信託契約の一部解約が行われた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、上記A．及びB．の規定にかかわらず、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日から、当該受益権に係る受益者に支払います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（5）【投資制限】

約款に定める投資制限

- A．外貨建資産への投資制限
- 委託会社は、外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- B．株式への投資制限
- 委託会社は、株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）を行使したものに限り、実質投資割合は取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- C．投資信託証券への投資制限
- 委託会社は、投資信託証券（マザーファンドを除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- D．同一銘柄の株式への投資制限

委託会社は、同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

E．投資する株式の範囲

イ．委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所等（金融商品取引所（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での有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場での有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）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、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

ロ．上記イ．の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

F．先物取引等の運用指図

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。

ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

G．スワップ取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。

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

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

ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

H．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

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

ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

I．有価証券の貸付の指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次のa．及びb．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

- a．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- b．公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．a．及びb．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- Ｊ．公社債の空売りの指図範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有していない公社債又は下記K．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引き渡し又は買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- Ｋ．公社債の借入れ
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れを指図することができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- Ｌ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- Ｍ．外国為替予約取引の指図
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- ロ．上記イ．の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- Ｎ．一部解約の請求及び有価証券売却等の指図
- 委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

O．再投資の指図

委託会社は、上記N．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。

P．資金の借入れ

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

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

Q．受託会社による資金の立替え

イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。

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

ハ．上記イ．及びロ．の立替え金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

関連法令に基づく投資制限

A．発生し得る危険に対応する額として算出した額が運用財産の純資産額を超える場合におけるデリバティブ取引に関する制限

（金融商品取引法第42条の2第7号、金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社等が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用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（新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）を行い、又は継続することを内容とした運用を行わないものとします。

B．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第9条、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第20条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、次のイ．に掲げる数がロ．に掲げる数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

イ．その運用の指図を行う全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当該株式に係る議決権（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定

により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。口．において
同じ。)の総数

口．当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数

（参考）マザーファンドの概要

「外国債券マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

（1）投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

（2）投資態度

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

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、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに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。

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及び金利に係るオプション取引並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及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。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

3．投資制限

株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

当ファンドは、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。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

金利変動リスク

債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及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ます。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

ファンドは、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。

同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴い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ことがあります。

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

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

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

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。

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。

内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料はありません。

(2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はありませんが、下記 の信託財産留保額が控除されます。

一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

なお、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券を一部解約する場合には、下表のA欄の金額にB欄の率を乗じて得た信託財産留保額が控除されます。

マザーファンド名	A 欄	B 欄
外国債券マザーファンド	一部解約を行う日の前営業日の信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額を受益権総口数で除した金額	0.1%

(3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.2415%（税抜 0.23%）（ ）を乗じて得た額とします。その配分は以下のとおりです。

委託会社	年率 0.126%	（税抜 0.12%）
販売会社	年率 0.0735%	（税抜 0.07%）
受託会社	年率 0.042%	（税抜 0.04%）

「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。また、消費税率が8%になった場合は、0.2484%（税込）となります。その配分は以下のとおりです。

委託会社	年率 0.1296%	（税抜 0.12%）
販売会社	年率 0.0756%	（税抜 0.07%）
受託会社	年率 0.0432%	（税抜 0.04%）

なお、マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

上記 の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(4)【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど信託財産中から支弁します。なお、信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、信託財産から収受する信託報酬中より委託会社が支弁します。

なお、マザーファンドにおいては、監査報酬はかかりません。

借入金の利息は、原則として借入金返済時に信託財産中から支弁します。

ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に対する消費税等相当額、先物取引・オプション取引に要する費用、組入資産の保管に要する費用（消費税等相当額を含みます。）等は、取引のつど信託財産中から支弁します。

これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

手数料等の合計額については、ファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、次のとおりとなります。

企業型年金

事業主は、企業型年金の年金資産を管理する資産管理機関と資産管理契約を締結しなければなりません。資産管理契約として信託契約を締結した場合には、当該信託財産について受領する利子等又は配当等には所得税及び地方税を課さないこととされています。従って、当ファンドが資産管理契約としての信託契約の信託財産に組入れられた場合、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。

個人型年金

個人型年金の年金資産は国民年金基金連合会のものとされていますので、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について所得税及び地方税が課されることはありません。

上記は、平成25年11月29日現在のものですので、税法及び確定拠出年金法等が改正された場合等は、上記の内容が変更されることがあります。

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】

以下の記載は、平成25年11月29日現在の状況について記載してあります。

(1)【投資状況】

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	19,170,437,869	100.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		119,487	0.00
合計(純資産総額)		19,170,557,356	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。

(2)【投資資産】

【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(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	9,156,248,684	2.0051	18,359,194,237	2.0937	19,170,437,869	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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第2期計算期間末 (平成16年10月25日)	1,069,021,488	1,069,021,488	11,177	11,177
第3期計算期間末 (平成17年10月24日)	3,415,798,438	3,415,798,438	12,214	12,214
第4期計算期間末 (平成18年10月24日)	5,829,807,764	5,829,807,764	13,091	13,091
第5期計算期間末 (平成19年10月24日)	8,465,796,628	8,465,796,628	14,207	14,207
第6期計算期間末 (平成20年10月24日)	8,884,915,028	8,884,915,028	11,763	11,763
第7期計算期間末 (平成21年10月26日)	11,071,210,461	11,071,210,461	12,966	12,966
第8期計算期間末 (平成22年10月25日)	11,480,222,979	11,480,222,979	11,680	11,680
第9期計算期間末 (平成23年10月24日)	12,375,070,638	12,375,070,638	11,167	11,167
第10期計算期間末 (平成24年10月24日)	14,396,898,451	14,396,898,451	12,102	12,102
第11期計算期間末 (平成25年10月24日)	18,285,032,047	18,285,032,047	15,315	15,315
平成24年11月末日	15,100,381,622		12,589	
12月末日	16,011,201,048		13,419	
平成25年 1月末日	17,004,451,468		14,116	
2月末日	16,999,693,785		14,140	
3月末日	17,160,968,980		14,314	
4月末日	18,281,004,120		15,301	
5月末日	18,590,656,293		15,486	
6月末日	17,750,994,133		14,826	
7月末日	17,887,740,133		14,920	
8月末日	17,839,776,148		14,864	
9月末日	18,059,500,200		15,073	
10月末日	18,564,909,183		15,448	
11月末日	19,170,557,356		15,988	

【分配の推移】

期 間	1万口当たりの分配金(円)
第2期計算期間(平成15年10月25日～平成16年10月25日)	0
第3期計算期間(平成16年10月26日～平成17年10月24日)	0
第4期計算期間(平成17年10月25日～平成18年10月24日)	0
第5期計算期間(平成18年10月25日～平成19年10月24日)	0
第6期計算期間(平成19年10月25日～平成20年10月24日)	0
第7期計算期間(平成20年10月25日～平成21年10月26日)	0
第8期計算期間(平成21年10月27日～平成22年10月25日)	0
第9期計算期間(平成22年10月26日～平成23年10月24日)	0
第10期計算期間(平成23年10月25日～平成24年10月24日)	0

第11期計算期間(平成24年10月25日～平成25年10月24日)	0
-----------------------------------	---

【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第2期計算期間(平成15年10月25日～平成16年10月25日)	9.0
第3期計算期間(平成16年10月26日～平成17年10月24日)	9.3
第4期計算期間(平成17年10月25日～平成18年10月24日)	7.2
第5期計算期間(平成18年10月25日～平成19年10月24日)	8.5
第6期計算期間(平成19年10月25日～平成20年10月24日)	17.2
第7期計算期間(平成20年10月25日～平成21年10月26日)	10.2
第8期計算期間(平成21年10月27日～平成22年10月25日)	9.9
第9期計算期間(平成22年10月26日～平成23年10月24日)	4.4
第10期計算期間(平成23年10月25日～平成24年10月24日)	8.4
第11期計算期間(平成24年10月25日～平成25年10月24日)	26.5

(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。

(4)【設定及び解約の実績】

期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第2期計算期間 (平成15年10月25日～平成16年10月25日)	866,031,398	57,650,502	956,483,529
第3期計算期間 (平成16年10月26日～平成17年10月24日)	2,027,736,568	187,624,984	2,796,595,113
第4期計算期間 (平成17年10月25日～平成18年10月24日)	2,235,582,444	578,815,166	4,453,362,391
第5期計算期間 (平成18年10月25日～平成19年10月24日)	2,273,008,169	767,344,792	5,959,025,768
第6期計算期間 (平成19年10月25日～平成20年10月24日)	2,615,305,363	1,021,354,203	7,552,976,928
第7期計算期間 (平成20年10月25日～平成21年10月26日)	1,772,231,396	786,889,049	8,538,319,275
第8期計算期間 (平成21年10月27日～平成22年10月25日)	1,954,091,439	663,370,955	9,829,039,759
第9期計算期間 (平成22年10月26日～平成23年10月24日)	2,156,562,035	903,519,365	11,082,082,429
第10期計算期間 (平成23年10月25日～平成24年10月24日)	1,780,689,599	966,550,543	11,896,221,485
第11期計算期間 (平成24年10月25日～平成25年10月24日)	2,028,206,123	1,984,791,107	11,939,636,501

(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。

(参考情報)

外国債券マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	141,478,932,792	38.64
	イタリア	36,548,759,859	9.98
	フランス	36,447,942,909	9.95
	ドイツ	32,061,399,339	8.76
	イギリス	28,030,775,476	7.66
	スペイン	19,318,655,072	5.28
	オランダ	10,120,135,732	2.76
	ベルギー	9,898,661,415	2.70
	カナダ	9,033,482,596	2.47
	オーストリア	6,054,850,195	1.65
	オーストラリア	5,162,103,254	1.41
	メキシコ	3,710,005,514	1.01
	デンマーク	3,161,852,901	0.86
	アイルランド	2,963,841,675	0.81
	ポーランド	2,931,934,883	0.80
	フィンランド	2,349,331,403	0.64
	スウェーデン	1,992,719,536	0.54
	マレーシア	1,811,954,199	0.49
	南アフリカ	1,792,976,798	0.49
	スイス	1,410,934,615	0.39
シンガポール	1,300,217,802	0.36	
ノルウェー	1,183,487,188	0.32	
	小計	358,764,955,153	97.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,375,139,372	2.01
合計(純資産総額)		366,140,094,525	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

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(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/20	22,030,000	11,821.50	2,604,278,308	11,362.81	2,503,228,987	3.625	2020/02/15	0.68
アメリカ	国債証券	T 1.25% 09/30/15	21,980,000	10,487.84	2,305,229,000	10,427.83	2,292,038,412	1.250	2015/09/30	0.63
アメリカ	国債証券	T 4.75% 08/15/17	19,000,000	12,079.75	2,295,154,177	11,699.48	2,222,902,080	4.750	2017/08/15	0.61
アメリカ	国債証券	T 0.625% 04/30/18	20,000,000	10,045.35	2,009,070,720	10,011.75	2,002,351,005	0.625	2018/04/30	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	18,900,000	10,626.07	2,008,328,175	10,509.25	1,986,248,662	1.875	2015/06/30	0.54
アメリカ	国債証券	T 0.25% 12/15/15	19,000,000	10,208.39	1,939,594,753	10,233.39	1,944,345,688	0.250	2015/12/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/15/15	18,000,000	10,219.39	1,839,491,207	10,239.59	1,843,127,924	0.250	2015/09/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/15/15	17,500,000	10,261.45	1,795,755,465	10,267.00	1,796,725,860	0.375	2015/04/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 0.375% 02/15/16	17,350,000	10,251.62	1,778,657,367	10,251.80	1,778,687,629	0.375	2016/02/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 3.5% 05/15/20	14,900,000	11,738.69	1,749,065,142	11,274.40	1,679,885,836	3.500	2020/05/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/31/17	16,500,000	10,188.98	1,681,183,294	10,143.78	1,673,723,841	0.625	2017/08/31	0.46
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 10/25/23	10,100,000	16,343.31	1,650,675,057	16,416.32	1,658,048,795	4.250	2023/10/25	0.45
アメリカ	国債証券	T 0.75% 02/28/18	16,300,000	10,241.89	1,669,429,305	10,098.37	1,646,034,623	0.750	2018/02/28	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	15,500,000	10,684.68	1,656,126,404	10,520.45	1,630,670,428	2.375	2015/02/28	0.45
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	15,000,000	11,071.36	1,660,704,289	10,634.47	1,595,171,492	2.625	2020/11/15	0.44
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/20	9,960,000	15,663.38	1,560,072,664	15,782.82	1,571,969,634	3.500	2020/04/25	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.375% 03/15/15	15,300,000	10,263.40	1,570,300,833	10,266.00	1,570,698,716	0.375	2015/03/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 2.25% 01/31/15	14,900,000	10,644.67	1,586,057,121	10,491.44	1,563,225,859	2.250	2015/01/31	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.25% 02/15/15	15,000,000	10,239.39	1,535,909,918	10,249.60	1,537,440,226	0.250	2015/02/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.375% 03/15/16	15,000,000	10,249.78	1,537,467,588	10,248.60	1,537,290,191	0.375	2016/03/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 0.125% 12/31/14	15,000,000	10,219.39	1,532,909,339	10,240.39	1,536,059,953	0.125	2014/12/31	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.375% 02/28/19	15,000,000	10,401.83	1,560,274,683	10,204.79	1,530,718,913	1.375	2019/02/28	0.42
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	14,550,000	10,602.51	1,542,666,427	10,499.45	1,527,670,016	1.750	2015/07/31	0.42

フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/26	9,750,000	15,171.85	1,479,255,706	15,231.96	1,485,116,164	3.500	2026/04/25	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/22	15,100,000	10,140.60	1,531,231,234	9,683.49	1,462,207,131	1.750	2022/05/15	0.40
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 04/25/21	9,000,000	15,869.15	1,428,223,806	16,021.86	1,441,967,589	3.750	2021/04/25	0.39
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/23	15,200,000	9,737.09	1,480,038,235	9,435.44	1,434,187,260	1.750	2023/05/15	0.39
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 04/25/19	8,800,000	16,293.11	1,433,793,838	16,255.94	1,430,523,222	4.250	2019/04/25	0.39
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/31/17	14,000,000	10,217.39	1,430,435,332	10,186.38	1,426,094,476	0.625	2017/05/31	0.39
イタリア	国債証券	BTPS 6.5% 11/01/27	8,310,000	16,248.06	1,350,214,302	16,993.34	1,412,146,592	6.500	2027/11/01	0.39

(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	97.99
合計	97.99

(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。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	US 5YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	34	4,117,057.96	4,113,203.04	421,274,255	0.12
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	18	2,264,134.50	2,258,718.84	231,337,983	0.06
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	11	1,443,622.18	1,438,250	147,305,565	0.04
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	23	2,542,052	2,542,650	354,597,969	0.10
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	25	3,125,850	3,132,000	436,788,720	0.12
	EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	33	4,651,482	4,674,450	651,898,797	0.18

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

（参考情報）交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2003年1月15日
作成基準日：2013年11月29日

基準価額・純資産の推移



基準価額	15,988円
純資産総額	192億円

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

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

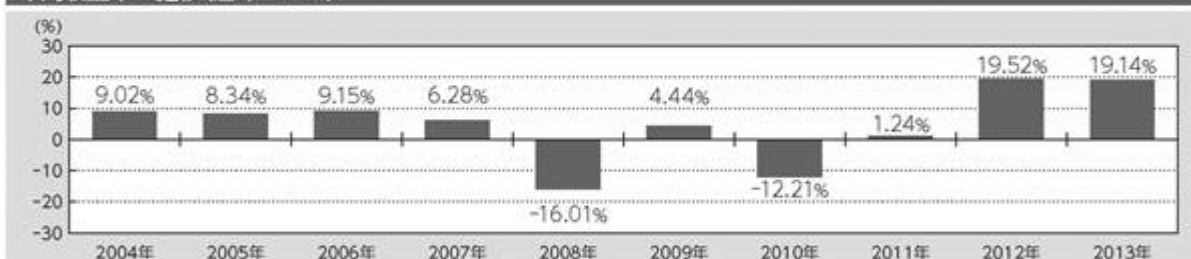
決算期	2009年10月	2010年10月	2011年10月	2012年10月	2013年10月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

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
T 3.625% 02/15/20	アメリカ	国債証券	3.625%	2020/02/15	0.7%
T 1.25% 09/30/15	アメリカ	国債証券	1.250%	2015/09/30	0.6%
T 4.75% 08/15/17	アメリカ	国債証券	4.750%	2017/08/15	0.6%
T 0.625% 04/30/18	アメリカ	国債証券	0.625%	2018/04/30	0.5%
T 1.875% 06/30/15	アメリカ	国債証券	1.875%	2015/06/30	0.5%
T 0.25% 12/15/15	アメリカ	国債証券	0.250%	2015/12/15	0.5%
T 0.25% 09/15/15	アメリカ	国債証券	0.250%	2015/09/15	0.5%
T 0.375% 04/15/15	アメリカ	国債証券	0.375%	2015/04/15	0.5%
T 0.375% 02/15/16	アメリカ	国債証券	0.375%	2016/02/15	0.5%
T 3.5% 05/15/20	アメリカ	国債証券	3.500%	2020/05/15	0.5%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2013年は年初から作成基準日までの収益率です。

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、表紙に記載されている委託会社のホームページでご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

（1）申込みの受け付け

申込期間中において、毎営業日お申込みいただけます。

（注）お申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

ただし、分配金再投資に関する契約（下記（5））をご参照ください。）に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、ニューヨーク証券取引所又はロンドン証券取引所が休業日の場合は、受益権の取得申込みを受け付けないものとし、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受け付けを中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取消することができます。

（2）取得申込者

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、継続募集期間中は、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）第8条（資産管理契約の締結）第1項に規定する事業主による資産管理契約締結の相手方（ ）及び同法第55条（規約の承認）に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）（以下「資産管理機関等」といいます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

- 1．信託会社、信託業務を営む金融機関、厚生年金基金、企業年金基金
- 2．生命保険会社
- 3．農業協同組合連合会
- 4．損害保険会社

（3）募集取扱いの単位

取得申込者は、販売会社において、1円以上1円単位をもって、受益権を購入することができます。

（4）販売価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の販売価額は、原則として、後記「3 資産管理等の概要（4）計算期間」に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

（5）その他

確定拠出年金制度の加入者等は、当ファンドの受益者に該当しておらず、確定拠出年金制度の運営管理機関（記録関連業務を行う事業主を含みます。）に対して資産配分の指図を行い、その指図の通知を受けた資産管理機関等が当ファンドの取得申込み及び後記「2 換金（解約）手続等」に記載する一部解約の実行の請求を行うこととなります。

当ファンドは、収益の分配がなされた場合、自動的に無手数料で再投資がなされる「分配金再投資コース」専用ファンドです。このため受益権の取得申込者は、申込みの際に販売会社との間で、自動けいぞく約款に従い自動的に無手数料で再投資される、分配金再投資に関する契約（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又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。）を締結していただきます。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当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又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うも

のとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

2【換金（解約）手続等】

(1) 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し1口単位の整数倍をもって一部解約の実行を請求することができます。

(注) 一部解約の実行の請求の受け付けは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎての受け付けは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

ただし、ニューヨーク証券取引所又はロンドン証券取引所が休業日の場合は、一部解約の実行の請求を受け付けないものとします。

(2) 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、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) 委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

なお、一部解約の実行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信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

(4) 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出され、日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社のホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

販売会社の詳細につきましては、以下の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(5) 委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、上記(1)による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。

(6) 上記(5)により一部解約の実行の請求の受け付け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一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記(4)の規定に準じて計算された価額とします。

(7) 一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払います。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに従うこととなります。

(8) 解約に係る手数料については、徴収しません。

(9) 当ファンドの規模及び商品性格などにに基づき、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及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会

社までお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、上記（４）に記載の照会先までお問い合わせください。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

基準価額

信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出され、日々の基準価額は、販売会社へお問い合わせください（販売会社の詳細につきましては、前記「2 換金（解約）手続等」に記載の照会先までお問い合わせください。）。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

当ファンドの主たる投資対象としている資産及び基準価額に与える影響が大きいと想定される資産の評価方法

A．親投資信託受益証券（外国債券マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

B．公社債等

計算日（ ）における次のイ．からハ．までに掲げるいずれかの価額で評価します。

イ．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ．金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

ハ．価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

当ファンドの信託期間は、信託契約締結日（平成15年1月15日）から無期限とします。ただし、委託会社は、下記（５）の事項に該当することとなった場合は、この信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年10月25日から翌年10月24日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成15年1月15日から平成15年10月24日までとし、最終計算期間の終了日は、上記（３）に定める信託期間の終了日とします。

上記の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

（５）【その他】

信託の終了

この信託契約を解約し信託を終了させる場合は下記のとおりです。

A．委託会社の所定の手続きを経て信託を終了させる場合

イ．受益権の口数が30億口を下回った場合

委託会社は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合は、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

ロ．受益者に有利な場合又はやむを得ない事情が発生した場合

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

ハ．所定の手続き

a．委託会社は、上記イ．及びロ．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、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

b．上記a．の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

c．上記b．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、上記イ．及びロ．の信託契約の解約をしません。

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

e．上記b．からd．までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b．の一定の期間が一月を下らずにその公告及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。

B．監督官庁の命令

イ．委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

ロ．委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款の変更をしようとするときは、下記 の規定に従います。

C．委託会社の登録取消等に伴う取扱い

イ．委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ．上記イ．の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、下記 D．に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

D．受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い

イ．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、下記 の規定に従い、新受託会社を選任します。

ロ．委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

委託会社の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い

A．委託会社は、事業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

B．委託会社は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

信託約款の変更

A．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更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及びその内容を監督官庁に届け出ます。

B．委託会社は、上記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及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、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

C．上記B．の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

D．上記C．の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記A．の信託約款の変更をしません。

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

反対者の買取請求権

信託契約の解約又は信託約款の変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を経由して受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

信託財産の管理

A．保管業務の委任

受託会社は、委託会社と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

B．有価証券の保管

受託会社は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

C．混蔵寄託

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下C．において同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマース・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

D．信託財産の登記等及び記載等の留保等

イ．信託の登記又は登録をすることができる信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することができます。

ロ．上記イ．ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

ハ．信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して

管理するものとし、ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

二．動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

運用報告書

委託会社は、毎決算時及び償還時に運用報告書を作成し、販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

関係法人との契約の更改等に関する手続き、変更した場合の開示方法

A．委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約の有効期間は、有効期間満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

B．上記A．の契約を変更した場合には、有価証券報告書等においてその内容を開示します。

信託事務処理の再委託

受託会社は、当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基づいて所定の事務を行います。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次のとおりです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は分配金再投資に関する契約に基づき、毎計算期間終了日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間終了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、当該収益分配金に係る計算期間終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に対し、遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。ただし、信託契約の一部解約が行われた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日から当該受益権に係る受益者に支払います。

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了日（償還日）後1ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日）から起算して5営業日までの日）から、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又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販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に対する支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとし、

受益者が、信託終了による償還金について、上記に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3) 一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し1口単位の整数倍をもって一部解約の実行を請求することができます。

一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から当該受益者に支払います。

一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

(4) 投資信託約款等重要事項変更時の反対者の買取請求権

前記「3 資産管理等の概要 (5) その他 反対者の買取請求権」をご参照ください。

(5) 受益権均等分割

受益者は、自己に帰属する受益権の口数に応じて均等に当ファンドの受益権を保有します。

(6) 帳簿閲覧権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧を請求することができます。

(参考)

確定拠出年金制度における当ファンドの受益者は、確定拠出年金法第8条（資産管理契約の締結）第1項に規定する事業主による資産管理契約締結の相手方又は同法第55条（規約の承認）に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）となります。従って確定拠出年金の加入者等は上記の権利を直接には保有していません。また、加入者等が収益分配金、償還金及び一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより拠ることとなります。

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、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11期計算期間(平成24年10月25日から平成25年10月24日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

DC外国債券インデックスファンドL

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第10期 (平成24年10月24日現在)	第11期 (平成25年10月24日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,716,992	28,444,383
親投資信託受益証券	14,394,091,677	18,284,913,077
未収入金	19,624,924	16,220,202
未収利息	21	34
流動資産合計	14,424,433,614	18,329,577,696
資産合計	14,424,433,614	18,329,577,696
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,927,720	22,627,241
未払受託者報酬	2,888,260	3,811,908
未払委託者報酬	13,719,183	18,106,500
流動負債合計	27,535,163	44,545,649
負債合計	27,535,163	44,545,649
純資産の部		
元本等		
元本	11,896,221,485	11,939,636,501
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,500,676,966	6,345,395,546
（分配準備積立金）	2,307,883,986	3,139,827,345
元本等合計	14,396,898,451	18,285,032,047
純資産合計	14,396,898,451	18,285,032,047
負債純資産合計	14,424,433,614	18,329,577,696

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第10期 (自 平成23年10月25日 至 平成24年10月24日)	第11期 (自 平成24年10月25日 至 平成25年10月24日)
営業収益		
受取利息	1,521	12,691
有価証券売買等損益	1,110,936,749	3,893,418,455
営業収益合計	1,110,938,270	3,893,431,146
営業費用		
受託者報酬	5,634,840	7,238,149
委託者報酬	26,765,375	34,381,109
営業費用合計	32,400,215	41,619,258
営業利益又は営業損失()	1,078,538,055	3,851,811,888
経常利益又は経常損失()	1,078,538,055	3,851,811,888
当期純利益又は当期純損失()	1,078,538,055	3,851,811,888
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()	42,080,088	451,286,828
期首剰余金又は期首欠損金()	1,292,988,209	2,500,676,966
剰余金増加額又は欠損金減少額	285,726,828	891,240,621
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	285,726,828	891,240,621
剰余金減少額又は欠損金増加額	114,496,038	447,047,101
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	114,496,038	447,047,101
期末剰余金又は期末欠損金()	2,500,676,966	6,345,395,546

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	第10期 (平成24年10月24日現在)	第11期 (平成25年10月24日現在)
1. 期首元本額	11,082,082,429円	11,896,221,485円
期中追加設定元本額	1,780,689,599円	2,028,206,123円
期中一部解約元本額	966,550,543円	1,984,791,107円
2. 当該計算期間の末日における受益権総数	11,896,221,485口	11,939,636,501口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2102円 (12,102円)	1.5315円 (15,315円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

分配金の計算過程

		第10期 自 平成23年10月25日 至 平成24年10月24日	第11期 自 平成24年10月25日 至 平成25年10月24日
費用控除後の配当等収益額	A	430,658,637円 (444,119,405円)	500,968,069円 (507,086,516円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	682,472,359円
収益調整金額	C	3,714,938,261円	4,091,713,190円
分配準備積立金額	D	1,877,225,349円	1,956,386,917円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,022,822,247円	7,231,540,535円
当ファンドの期末残存口数	F	11,896,221,485口	11,939,636,501口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	5,062.80円	6,056.75円
1万口当たり分配金額	H	- 円	- 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	- 円	- 円

(注)()内は、親投資信託の信託財産に属する配当等収益のうち、当ファンドに帰属すべき金額で、内書であります。

(金融商品に関する注記)

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、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク(為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)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。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第10期 (平成24年10月24日現在)	第11期 (平成25年10月24日現在)
	計算期間(自 平成23年10月25日 至 平成24年10月24日)の損益に含 まれた評価差額(円)	計算期間(自 平成24年10月25日 至 平成25年10月24日)の損益に含 まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,108,148,377	3,671,344,341
合計	1,108,148,377	3,671,344,341

(デリバティブ取引に関する注記)

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)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	9,119,202,572	18,284,913,077	
親投資信託受益証券 小計		9,119,202,572	18,284,913,077	
合計		9,119,202,572	18,284,913,077	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等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。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

< 参考 >

「DC外国債券インデックスファンドL」は、「外国債券マザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、全て同マザーファンドの受益証券であります。

同マザーファンドの平成25年10月24日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

「外国債券マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成25年10月24日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	223,578,527
コール・ローン	998,474,617
国債証券	361,778,780,392
派生商品評価勘定	45,058,007
未収入金	5,911,177,354
未収利息	4,177,722,927
前払費用	84,768,210
差入委託証拠金	169,317,033
流動資産合計	373,388,877,067
資産合計	373,388,877,067
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	30,477,439
未払金	2,911,765
未払解約金	1,754,986,789
流動負債合計	1,788,375,993
負債合計	1,788,375,993
純資産の部	
元本等	
元本	185,327,314,136
剰余金	
剰余金又は欠損金()	186,273,186,938
元本等合計	371,600,501,074
純資産合計	371,600,501,074
負債純資産合計	373,388,877,067

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年10月24日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 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、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等については、「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)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年10月24日現在
1. 計算期間の期首元本額	255,979,056,663円
計算期間中の追加設定元本額	11,636,081,168円
計算期間中の一部解約元本額	82,287,823,695円
計算日の元本額	185,327,314,136円
計算日の元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	4,342,009,589円
DC外国債券インデックスファンド	1,854,219,359円
DC外国債券インデックスファンドL	9,119,202,572円
物価連動債組入世界債券ファンド	54,138,612円
DCバランスファンド30	131,080,151円
DCバランスファンド50	204,797,355円
DCバランスファンド70	43,207,652円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	89,085,776円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	53,930,565円
新生・4分散ファンド	83,434,933円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	411,492,875円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	15,446,078円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	60,574,214円
外国債券インデックスe	1,085,777,572円
インデックスコレクション(外国債券)	1,128,586,750円
インデックスコレクション(バランス株式30)	160,843,001円
インデックスコレクション(バランス株式50)	163,876,421円
インデックスコレクション(バランス株式70)	53,942,829円
私募外国債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	2,732,333,803円
外国債券インデックスファンドF(一般投資家私募)	297,652,886円
外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	8,684,464,326円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	4,545,048,556円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	15,635,530,287円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	51,227,400,366円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	3,348,863,502円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	101,196,754円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	7,372,353,170円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	6,133,591,649円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	1,703,503,294円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	16,561,104,290円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	715,528,299円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	27,211,261,325円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	4,099,295,814円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	333,962,797円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	1,680,507,453円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	1,654,031,083円

VAバランスファンド2(株40 / 100)(適格機関投資家専用)	292,004,637円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	116,963,321円
バランスVA20(適格機関投資家専用)	2,016,094,848円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	5,609,166,520円
バランスVA20L(適格機関投資家専用)	36,817,772円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	680,296,753円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	232,519,984円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	3,206,966,170円
私募外国債券インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	41,845,143円
世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	1,363,030円
2. 計算日における受益権総数	185,327,314,136口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0051円 (20,051円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	平成25年10月24日現在
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、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、市場リスク(為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成25年10月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)国債証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成25年10月24日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,572,734,521
合計	3,572,734,521

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成25年2月8日から平成25年10月24日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

・ヘッジ会計が適用されていないもの

債券関連

区分	種類	平成25年10月24日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買 建	3,115,255,212	-	3,118,745,676	3,490,464
	合計	3,115,255,212	-	3,118,745,676	3,490,464

(注)1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

区分	種類	平成25年10月24日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買 建				
	アメリカドル	1,931,766,240	-	1,919,568,000	12,198,240
	カナダドル	176,227,670	-	173,585,500	2,642,170
	イギリスポンド	366,148,270	-	362,296,000	3,852,270
	ユーロ	2,019,806,295	-	2,008,084,000	11,722,295
	計	4,493,948,475	-	4,463,533,500	30,414,975
	売 建				
	アメリカドル	2,377,288,204	-	2,362,043,040	15,245,164
	カナダドル	138,207,040	-	136,140,500	2,066,540
	オーストラリアドル	83,490,304	-	82,068,591	1,421,713
	イギリスポンド	437,898,725	-	433,290,000	4,608,725
	シンガポールドル	23,831,760	-	23,622,000	209,760
	マレーシアリング ット	30,032,444	-	29,824,724	207,720
	スウェーデンクロー ナ	33,899,800	-	33,660,000	239,800
	ノルウェークローネ	21,630,180	-	21,398,000	232,180
	デンマーククローネ	57,952,000	-	57,632,000	320,000
	メキシコペソ	63,481,720	-	62,333,000	1,148,720
	ポーランドズロチ	50,288,045	-	49,724,000	564,045
	南アフリカランド	31,709,160	-	31,342,500	366,660
	ユーロ	2,546,403,092	-	2,531,529,040	14,874,052
	計	5,896,112,474	-	5,854,607,395	41,505,079
	合計	10,390,060,949	-	10,318,140,895	11,090,104

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年10月24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)

平成25年10月24日現在
該当事項はありません。

[次へ](#)

(3)附属明細表(平成25年10月24日現在)

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 12/31/14	15,000,000.00	14,994,726.60	
		T 0.25% 01/15/15	9,000,000.00	9,008,789.04	
		T 0.25% 01/31/15	10,000,000.00	10,009,570.30	
		T 0.25% 02/15/15	15,000,000.00	15,010,546.95	
		T 0.25% 02/28/15	9,550,000.00	9,555,968.75	
		T 0.25% 04/15/16	5,000,000.00	4,976,855.45	
		T 0.25% 05/15/15	9,090,000.00	9,090,710.20	
		T 0.25% 05/15/16	9,000,000.00	8,952,187.50	
		T 0.25% 07/15/15	10,000,000.00	9,995,507.80	
		T 0.25% 07/31/15	10,000,000.00	9,994,335.90	
		T 0.25% 08/15/15	5,000,000.00	4,996,484.40	
		T 0.25% 09/15/15	18,000,000.00	17,978,906.34	
		T 0.25% 09/30/14	9,000,000.00	9,010,371.06	
		T 0.25% 09/30/15	3,000,000.00	2,996,601.57	
		T 0.25% 10/15/15	5,000,000.00	4,993,066.40	
		T 0.25% 10/31/14	5,000,000.00	5,005,664.05	
		T 0.25% 11/30/14	4,000,000.00	4,004,453.12	
		T 0.25% 12/15/14	6,100,000.00	6,106,552.74	
		T 0.25% 12/15/15	19,000,000.00	18,958,437.50	
		T 0.375% 02/15/16	17,350,000.00	17,341,189.49	
		T 0.375% 03/15/15	15,300,000.00	15,333,169.94	
		T 0.375% 03/15/16	15,000,000.00	14,984,179.65	
		T 0.375% 04/15/15	17,500,000.00	17,536,914.15	
		T 0.375% 06/15/15	6,000,000.00	6,011,484.36	
		T 0.375% 08/31/15	3,800,000.00	3,805,121.10	
		T 0.375% 11/15/14	10,000,000.00	10,024,023.40	
		T 0.375% 11/15/15	6,000,000.00	6,004,101.54	
		T 0.5% 06/15/16	1,050,000.00	1,050,328.12	
		T 0.5% 07/31/17	7,010,000.00	6,905,260.71	
		T 0.5% 10/15/14	5,100,000.00	5,117,929.71	
		T 0.625% 04/30/18	20,000,000.00	19,540,234.40	
		T 0.625% 05/31/17	14,000,000.00	13,891,718.82	
		T 0.625% 07/15/16	7,000,000.00	7,020,507.83	
		T 0.625% 08/15/16	9,050,000.00	9,071,034.19	
T 0.625% 08/31/17	16,500,000.00	16,309,218.75			

T 0.625% 09/30/17	12,000,000.00	11,843,437.56	
T 0.625% 11/30/17	5,000,000.00	4,919,921.90	
T 0.75% 02/28/18	16,300,000.00	16,057,410.19	
T 0.75% 03/31/18	5,000,000.00	4,916,894.55	
T 0.75% 06/30/17	4,000,000.00	3,982,500.00	
T 0.75% 10/31/17	1,600,000.00	1,584,718.75	
T 0.75% 12/31/17	5,000,000.00	4,938,085.95	
T 0.875% 01/31/17	8,000,000.00	8,040,468.72	
T 0.875% 01/31/18	2,000,000.00	1,982,851.56	
T 0.875% 02/28/17	6,000,000.00	6,025,429.68	
T 0.875% 04/30/17	7,000,000.00	7,015,449.21	
T 0.875% 07/31/19	5,000,000.00	4,814,453.15	
T 0.875% 09/15/16	5,000,000.00	5,044,824.20	
T 0.875% 11/30/16	2,000,000.00	2,013,671.88	
T 0.875% 12/31/16	9,500,000.00	9,557,519.55	
T 1% 03/31/17	10,000,000.00	10,075,976.60	
T 1% 05/31/18	1,000,000.00	992,167.97	
T 1% 06/30/19	5,000,000.00	4,858,691.40	
T 1% 08/31/16	4,850,000.00	4,909,677.74	
T 1% 08/31/19	6,000,000.00	5,806,757.82	
T 1% 09/30/16	3,000,000.00	3,036,093.75	
T 1% 09/30/19	5,000,000.00	4,830,273.45	
T 1% 10/31/16	9,000,000.00	9,101,953.17	
T 1% 11/30/19	6,100,000.00	5,870,296.87	
T 1.125% 03/31/20	2,000,000.00	1,923,164.06	
T 1.125% 05/31/19	7,000,000.00	6,861,640.66	
T 1.125% 12/31/19	5,200,000.00	5,030,695.33	
T 1.25% 01/31/19	4,800,000.00	4,768,781.23	
T 1.25% 04/30/19	2,000,000.00	1,977,382.82	
T 1.25% 08/31/15	11,990,000.00	12,200,761.77	
T 1.25% 09/30/15	21,980,000.00	22,377,528.96	
T 1.25% 10/31/15	10,000,000.00	10,185,742.20	
T 1.375% 02/28/19	15,000,000.00	14,972,753.85	
T 1.375% 05/31/20	5,000,000.00	4,867,675.80	
T 1.375% 06/30/18	3,500,000.00	3,526,318.35	
T 1.375% 07/31/18	6,000,000.00	6,041,015.64	
T 1.375% 09/30/18	8,520,000.00	8,558,939.04	
T 1.375% 11/30/15	4,550,000.00	4,647,487.29	
T 1.375% 11/30/18	6,000,000.00	6,016,289.04	
T 1.375% 12/31/18	3,700,000.00	3,704,408.21	
T 1.5% 06/30/16	7,450,000.00	7,648,036.12	
T 1.5% 07/31/16	3,500,000.00	3,592,900.39	

T 1.5% 08/31/18	6,500,000.00	6,577,187.50	
T 1.625% 08/15/22	10,000,000.00	9,428,515.60	
T 1.625% 11/15/22	11,500,000.00	10,778,330.03	
T 1.75% 05/15/22	15,100,000.00	14,466,802.79	
T 1.75% 05/15/23	15,200,000.00	14,257,125.00	
T 1.75% 05/31/16	4,600,000.00	4,750,937.50	
T 1.75% 07/31/15	14,550,000.00	14,924,548.86	
T 1.75% 10/31/18	1,800,000.00	1,840,042.96	
T 1.875% 06/30/15	18,900,000.00	19,407,937.50	
T 1.875% 06/30/20	10,200,000.00	10,238,847.61	
T 1.875% 08/31/17	2,000,000.00	2,071,562.50	
T 1.875% 09/30/17	1,210,000.00	1,252,799.01	
T 1.875% 10/31/17	4,900,000.00	5,069,968.75	
T 11.25% 02/15/15	2,550,000.00	2,918,654.29	
T 2% 01/31/16	3,000,000.00	3,109,746.09	
T 2% 02/15/22	6,000,000.00	5,895,468.78	
T 2% 02/15/23	12,500,000.00	12,050,781.25	
T 2% 04/30/16	6,090,000.00	6,326,463.31	
T 2% 07/31/20	4,000,000.00	4,043,906.24	
T 2% 11/15/21	13,500,000.00	13,333,095.72	
T 2.125% 05/31/15	6,950,000.00	7,156,871.12	
T 2.125% 08/15/21	14,300,000.00	14,322,623.02	
T 2.125% 08/31/20	6,000,000.00	6,102,890.64	
T 2.125% 11/30/14	18,400,000.00	18,796,750.00	
T 2.125% 12/31/15	11,000,000.00	11,423,242.16	
T 2.25% 01/31/15	14,900,000.00	15,291,706.99	
T 2.25% 03/31/16	9,150,000.00	9,558,711.92	
T 2.25% 07/31/18	4,500,000.00	4,714,365.24	
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,098,515.62	
T 2.375% 02/28/15	15,500,000.00	15,951,679.76	
T 2.375% 03/31/16	7,900,000.00	8,274,478.48	
T 2.375% 05/31/18	3,800,000.00	4,002,171.89	
T 2.375% 06/30/18	2,500,000.00	2,634,130.85	
T 2.375% 07/31/17	2,000,000.00	2,108,750.00	
T 2.375% 09/30/14	6,800,000.00	6,941,710.91	
T 2.375% 10/31/14	10,950,000.00	11,198,513.64	
T 2.5% 03/31/15	12,820,000.00	13,237,150.74	
T 2.5% 04/30/15	4,930,000.00	5,099,083.61	
T 2.5% 06/30/17	8,200,000.00	8,686,234.41	
T 2.5% 08/15/23	7,000,000.00	7,002,871.12	
T 2.625% 01/31/18	4,300,000.00	4,577,484.37	
T 2.625% 02/29/16	12,850,000.00	13,522,617.18	

T 2.625% 04/30/16	5,100,000.00	5,378,806.64	
T 2.625% 04/30/18	3,600,000.00	3,833,367.19	
T 2.625% 08/15/20	13,000,000.00	13,673,613.33	
T 2.625% 11/15/20	15,000,000.00	15,728,613.30	
T 2.625% 12/31/14	3,480,000.00	3,581,205.46	
T 2.75% 02/15/19	2,000,000.00	2,139,257.82	
T 2.75% 02/28/18	290,000.00	310,486.91	
T 2.75% 05/31/17	9,900,000.00	10,576,757.86	
T 2.75% 08/15/42	12,150,000.00	10,269,597.71	
T 2.75% 11/15/42	2,900,000.00	2,446,648.45	
T 2.75% 11/30/16	6,400,000.00	6,810,374.97	
T 2.75% 12/31/17	11,000,000.00	11,771,503.92	
T 2.875% 03/31/18	4,800,000.00	5,163,281.23	
T 2.875% 05/15/43	4,300,000.00	3,719,416.02	
T 3% 02/28/17	6,600,000.00	7,089,843.75	
T 3% 05/15/42	13,580,000.00	12,134,472.69	
T 3% 08/31/16	1,030,000.00	1,100,953.32	
T 3% 09/30/16	4,000,000.00	4,280,156.24	
T 3.125% 01/31/17	4,000,000.00	4,310,078.12	
T 3.125% 02/15/42	3,800,000.00	3,487,984.39	
T 3.125% 02/15/43	2,600,000.00	2,372,957.02	
T 3.125% 04/30/17	4,900,000.00	5,292,765.62	
T 3.125% 05/15/19	11,920,000.00	12,989,307.79	
T 3.125% 05/15/21	9,190,000.00	9,908,327.71	
T 3.125% 10/31/16	1,400,000.00	1,504,617.18	
T 3.125% 11/15/41	13,500,000.00	12,411,035.19	
T 3.25% 03/31/17	5,000,000.00	5,420,214.85	
T 3.25% 05/31/16	3,250,000.00	3,484,990.24	
T 3.25% 06/30/16	2,500,000.00	2,683,935.55	
T 3.25% 07/31/16	3,560,000.00	3,827,139.05	
T 3.25% 12/31/16	9,800,000.00	10,591,847.64	
T 3.375% 11/15/19	8,390,000.00	9,265,706.25	
T 3.5% 02/15/18	6,850,000.00	7,546,907.21	
T 3.5% 02/15/39	5,500,000.00	5,493,447.24	
T 3.5% 05/15/20	14,900,000.00	16,547,730.50	
T 3.625% 02/15/20	22,030,000.00	24,645,632.25	
T 3.625% 02/15/21	5,230,000.00	5,831,654.28	
T 3.625% 08/15/19	1,400,000.00	1,563,378.90	
T 3.625% 08/15/43	3,200,000.00	3,220,750.01	
T 3.75% 08/15/41	8,840,000.00	9,154,061.68	
T 3.75% 11/15/18	5,040,000.00	5,644,406.27	
T 3.875% 05/15/18	1,150,000.00	1,289,886.72	

T 3.875% 08/15/40	4,910,000.00	5,210,833.39	
T 4.0% 02/15/15	10,020,000.00	10,517,868.75	
T 4.0% 08/15/18	4,000,000.00	4,527,265.64	
T 4.125% 05/15/15	4,040,000.00	4,283,583.59	
T 4.25% 05/15/39	1,750,000.00	1,976,987.30	
T 4.25% 08/15/15	10,500,000.00	11,251,611.31	
T 4.25% 11/15/14	9,230,000.00	9,630,928.12	
T 4.25% 11/15/17	1,350,000.00	1,525,341.79	
T 4.25% 11/15/40	7,820,000.00	8,826,672.27	
T 4.375% 02/15/38	2,150,000.00	2,475,817.38	
T 4.375% 05/15/40	8,550,000.00	9,846,193.33	
T 4.375% 05/15/41	3,350,000.00	3,856,033.21	
T 4.375% 11/15/39	5,800,000.00	6,680,875.00	
T 4.5% 02/15/16	2,420,000.00	2,650,089.07	
T 4.5% 02/15/36	3,600,000.00	4,225,359.38	
T 4.5% 05/15/17	8,030,000.00	9,066,215.04	
T 4.5% 05/15/38	2,500,000.00	2,933,056.65	
T 4.5% 08/15/39	1,250,000.00	1,467,993.16	
T 4.5% 11/15/15	2,160,000.00	2,345,371.86	
T 4.625% 02/15/17	5,500,000.00	6,199,101.59	
T 4.625% 02/15/40	4,000,000.00	4,785,625.00	
T 4.625% 11/15/16	2,450,000.00	2,745,387.70	
T 4.75% 02/15/41	7,900,000.00	9,633,525.36	
T 4.75% 08/15/17	19,000,000.00	21,748,691.43	
T 4.875% 08/15/16	750,000.00	840,820.31	
T 5.0% 05/15/37	2,250,000.00	2,826,079.11	
T 5.125% 05/15/16	2,000,000.00	2,238,789.06	
T 5.25% 02/15/29	1,600,000.00	2,024,843.74	
T 5.25% 11/15/28	2,350,000.00	2,973,805.66	
T 5.375% 02/15/31	4,000,000.00	5,169,296.88	
T 5.5% 08/15/28	2,250,000.00	2,913,618.17	
T 6.0% 02/15/26	2,440,000.00	3,260,545.30	
T 6.125% 11/15/27	2,300,000.00	3,139,544.91	
T 6.25% 05/15/30	2,520,000.00	3,542,027.35	
T 6.25% 08/15/23	3,600,000.00	4,808,039.07	
T 6.5% 11/15/26	1,150,000.00	1,608,921.87	
T 7.25% 05/15/16	1,670,000.00	1,960,032.03	
T 7.25% 08/15/22	1,000,000.00	1,402,871.09	
T 7.5% 11/15/16	8,250,000.00	9,965,581.06	
T 8.0% 11/15/21	2,600,000.00	3,745,117.19	
T 8.75% 05/15/17	2,700,000.00	3,453,416.01	
T 8.75% 08/15/20	1,800,000.00	2,610,140.63	

アメリカドル小計		1,423,380,000.00	1,467,543,508.40 (143,012,114,893)
カナダドル	CAN 1% 02/01/15	3,850,000.00	3,849,923.00
	CAN 1% 05/01/15	1,000,000.00	999,465.00
	CAN 1% 08/01/16	600,000.00	595,461.00
	CAN 1% 11/01/14	2,100,000.00	2,100,126.00
	CAN 1.25% 02/01/16	2,400,000.00	2,405,820.00
	CAN 1.25% 03/01/18	2,350,000.00	2,310,097.00
	CAN 1.25% 09/01/18	1,050,000.00	1,026,422.25
	CAN 1.5% 03/01/17	2,550,000.00	2,558,963.25
	CAN 1.5% 06/01/23	3,350,000.00	3,086,187.50
	CAN 1.5% 08/01/15	1,400,000.00	1,410,311.00
	CAN 1.5% 09/01/17	3,000,000.00	2,995,050.00
	CAN 2% 06/01/16	1,900,000.00	1,938,123.50
	CAN 2% 12/01/14	8,200,000.00	8,290,200.00
	CAN 2.5% 06/01/15	4,080,000.00	4,174,105.20
	CAN 2.5% 06/01/24	1,500,000.00	1,494,487.50
	CAN 2.75% 06/01/22	3,600,000.00	3,722,760.00
	CAN 2.75% 09/01/16	2,860,000.00	2,975,887.20
	CAN 3% 12/01/15	2,310,000.00	2,399,454.75
	CAN 3.25% 06/01/21	2,900,000.00	3,126,446.50
	CAN 3.5% 06/01/20	3,400,000.00	3,710,879.00
	CAN 3.5% 12/01/45	3,250,000.00	3,557,547.50
	CAN 3.75% 06/01/19	4,600,000.00	5,060,345.00
	CAN 4% 06/01/16	5,050,000.00	5,409,358.00
	CAN 4% 06/01/17	2,400,000.00	2,614,020.00
	CAN 4.0% 06/01/41	3,900,000.00	4,606,446.00
	CAN 4.25% 06/01/18	2,500,000.00	2,783,262.50
	CAN 4.5% 06/01/15	2,200,000.00	2,320,472.00
	CAN 5% 06/01/37	3,550,000.00	4,741,823.75
	CAN 5.75% 06/01/29	3,000,000.00	4,108,170.00
	CAN 5.75% 06/01/33	3,250,000.00	4,598,132.50
CAN 8.0% 06/01/27	1,090,000.00	1,749,193.85	
カナダドル小計		89,190,000.00	96,718,940.75 (9,081,908,536)
オーストラリアドル	ACGB 2.75% 04/21/24	2,350,000.00	2,099,102.25
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,500,000.00	1,383,457.50
	ACGB 3.25% 04/21/29	1,350,000.00	1,174,344.75
	ACGB 4.25% 07/21/17	3,900,000.00	4,052,139.00
	ACGB 4.5% 04/15/20	4,100,000.00	4,309,223.00
	ACGB 4.5% 10/21/14	2,700,000.00	2,751,016.50
	ACGB 4.75% 04/21/27	2,700,000.00	2,831,449.50

	ACGB 4.75% 06/15/16	5,350,000.00	5,601,744.25	
	ACGB 4.75% 10/21/15	2,600,000.00	2,702,050.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	4,100,000.00	4,467,175.50	
	ACGB 5.5% 01/21/18	4,140,000.00	4,508,915.40	
	ACGB 5.5% 04/21/23	4,650,000.00	5,221,415.25	
	ACGB 5.75% 05/15/21	4,300,000.00	4,859,258.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	4,050,000.00	4,607,259.75	
	ACGB 6% 02/15/17	4,600,000.00	5,024,810.00	
	ACGB 6.25% 04/15/15	4,350,000.00	4,580,223.75	
	オーストラリアドル小計	56,740,000.00	60,173,584.40 (5,650,299,575)	
イギリスポンド	UKT 1% 09/07/17	7,050,000.00	7,017,534.75	
	UKT 1.25% 07/22/18	3,100,000.00	3,073,433.00	
	UKT 1.75% 01/22/17	6,300,000.00	6,475,770.00	
	UKT 1.75% 09/07/22	5,050,000.00	4,774,825.50	
	UKT 2% 01/22/16	6,600,000.00	6,811,233.00	
	UKT 2.25% 09/07/23	1,500,000.00	1,454,625.00	
	UKT 2.75% 01/22/15	6,000,000.00	6,175,500.00	
	UKT 3.25% 01/22/44	1,950,000.00	1,875,519.75	
	UKT 3.5% 07/22/68	900,000.00	919,431.00	
	UKT 3.75% 07/22/52	3,720,000.00	3,975,601.20	
	UKT 3.75% 09/07/19	4,650,000.00	5,178,495.75	
	UKT 3.75% 09/07/20	5,250,000.00	5,855,771.25	
	UKT 3.75% 09/07/21	6,450,000.00	7,179,043.50	
	UKT 4% 01/22/60	2,750,000.00	3,137,928.75	
	UKT 4% 03/07/22	4,350,000.00	4,921,350.75	
	UKT 4% 09/07/16	4,000,000.00	4,375,840.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	4,500,000.00	5,164,762.50	
	UKT 4.25% 06/07/32	5,450,000.00	6,242,075.75	
	UKT 4.25% 09/07/39	3,750,000.00	4,321,406.25	
	UKT 4.25% 12/07/27	3,000,000.00	3,435,450.00	
	UKT 4.25% 12/07/40	4,350,000.00	5,016,093.75	
	UKT 4.25% 12/07/46	5,800,000.00	6,751,403.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	3,700,000.00	4,342,357.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	3,950,000.00	4,701,981.25	
	UKT 4.5% 03/07/19	4,500,000.00	5,175,607.50	
	UKT 4.5% 09/07/34	4,780,000.00	5,658,444.50	
	UKT 4.5% 12/07/42	4,700,000.00	5,665,027.50	
	UKT 4.75% 03/07/20	4,370,000.00	5,138,551.90	
	UKT 4.75% 09/07/15	5,090,000.00	5,500,941.15	
	UKT 4.75% 12/07/30	3,880,000.00	4,699,727.60	
	UKT 4.75% 12/07/38	3,950,000.00	4,902,917.75	

	UKT 5% 03/07/18	5,300,000.00	6,144,237.00	
	UKT 5% 03/07/25	4,450,000.00	5,433,872.75	
	UKT 6.0% 12/07/28	2,900,000.00	3,955,165.00	
	UKT 8% 06/07/21	3,700,000.00	5,230,005.50	
	UKT 8% 12/07/15	2,100,000.00	2,435,958.00	
	UKT 8.75% 08/25/17	1,920,000.00	2,472,729.60	
	イギリスポンド小計	155,760,000.00	175,590,618.45 (27,667,813,749)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	1,050,000.00	1,163,972.25	
	SWISS 2.5% 03/12/16	2,050,000.00	2,174,742.50	
	SWISS 3% 01/08/18	1,850,000.00	2,072,157.25	
	SWISS 3% 05/12/19	1,450,000.00	1,658,575.25	
	SWISS 3.75% 06/10/15	1,000,000.00	1,062,165.00	
	SWISS 4% 02/11/23	1,100,000.00	1,393,859.50	
	SWISS 4% 04/08/28	1,500,000.00	2,011,320.00	
	SWISS 4.25% 06/05/17	1,200,000.00	1,381,542.00	
	スイスフラン小計	11,200,000.00	12,918,333.75 (1,410,811,228)	
シンガポールドル	SIGB 0.25% 02/01/15	450,000.00	449,763.75	
	SIGB 0.5% 04/01/18	250,000.00	247,367.50	
	SIGB 1.125% 04/01/16	600,000.00	611,526.00	
	SIGB 1.375% 10/01/14	1,450,000.00	1,464,826.25	
	SIGB 2.25% 06/01/21	920,000.00	948,616.60	
	SIGB 2.375% 04/01/17	1,510,000.00	1,606,496.55	
	SIGB 2.5% 06/01/19	1,050,000.00	1,120,602.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	800,000.00	776,456.00	
	SIGB 2.75% 07/01/23	200,000.00	211,448.00	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,550,000.00	1,617,401.75	
	SIGB 2.875% 09/01/30	800,000.00	815,748.00	
	SIGB 3% 09/01/24	900,000.00	961,758.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,400,000.00	1,531,320.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	1,100,000.00	1,211,419.00	
	SIGB 3.375% 09/01/33	250,000.00	269,580.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,350,000.00	1,488,415.50	
	SIGB 3.75% 09/01/16	1,390,000.00	1,523,620.70	
	SIGB 4% 09/01/18	900,000.00	1,028,880.00	
	シンガポールドル小計	16,870,000.00	17,885,245.60 (1,408,463,091)	
マレーシアリン ギット	MGS 3.172% 07/15/16	950,000.00	951,634.00	
	MGS 3.197% 10/15/15	2,960,000.00	2,974,089.60	
	MGS 3.26% 03/01/18	2,050,000.00	2,043,276.00	
	MGS 3.418% 08/15/22	1,950,000.00	1,909,001.25	

	MGS 3.48% 03/15/23	1,600,000.00	1,578,584.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	4,150,000.00	4,137,923.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	1,680,000.00	1,576,738.80	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,500,000.00	2,515,962.50	
	MGS 3.741% 02/27/15	3,330,000.00	3,364,132.50	
	MGS 3.814% 02/15/17	2,550,000.00	2,588,262.75	
	MGS 3.835% 08/12/15	3,900,000.00	3,959,572.50	
	MGS 3.889% 07/31/20	1,050,000.00	1,072,926.75	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,090,000.00	1,077,116.20	
	MGS 4.127% 04/15/32	450,000.00	443,895.75	
	MGS 4.16% 07/15/21	4,610,000.00	4,738,158.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	9,470,000.00	9,753,768.55	
	MGS 4.262% 09/15/16	5,350,000.00	5,516,411.75	
	MGS 4.378% 11/29/19	4,700,000.00	4,911,805.50	
	MGS 4.392% 04/15/26	2,650,000.00	2,762,346.75	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,900,000.00	2,136,008.50	
マレーシアリングット小計		58,890,000.00	60,011,615.15 (1,852,558,559)	
スウェーデンク ローナ	SGB 1.5% 11/13/23	20,350,000.00	18,816,729.25	
	SGB 3% 07/12/16	11,550,000.00	12,086,439.75	
	SGB 3.5% 03/30/39	10,750,000.00	11,651,602.50	
	SGB 3.5% 06/01/22	15,500,000.00	17,071,545.00	
	SGB 3.75% 08/12/17	15,100,000.00	16,363,115.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	19,150,000.00	21,597,944.50	
	SGB 4.5% 08/12/15	18,550,000.00	19,687,022.25	
	SGB 5% 12/01/20	11,250,000.00	13,457,025.00	
スウェーデンクローナ小計		122,200,000.00	130,731,423.25 (2,001,498,089)	
ノルウェークロー ネ	NGB 2% 05/24/23	7,600,000.00	7,057,398.00	
	NGB 3.75% 05/25/21	14,450,000.00	15,518,216.25	
	NGB 4.25% 05/19/17	15,200,000.00	16,369,260.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	12,850,000.00	14,255,661.50	
	NGB 5% 05/15/15	18,850,000.00	19,797,401.00	
ノルウェークローネ小計		68,950,000.00	72,997,936.75 (1,202,276,018)	
デンマーククロー ネ	DGB 1.5% 11/15/23	9,700,000.00	9,359,821.00	
	DGB 2% 11/15/14	12,970,000.00	13,236,079.55	
	DGB 2.5% 11/15/16	7,550,000.00	8,031,841.00	
	DGB 3% 11/15/21	22,900,000.00	25,466,861.00	
	DGB 4% 11/15/15	21,750,000.00	23,441,823.75	
	DGB 4% 11/15/17	14,600,000.00	16,578,811.00	
	DGB 4% 11/15/19	22,300,000.00	26,077,508.50	

	DGB 4.5% 11/15/39	28,850,000.00	38,976,782.75	
	DGB 7% 11/10/24	7,350,000.00	11,115,111.00	
デンマーククローネ小計		147,970,000.00	172,284,639.55 (3,102,846,358)	
メキシコペソ	MBONO 10% 11/20/36	15,800,000.00	21,382,219.00	
	MBONO 10% 12/05/24	26,300,000.00	35,760,504.50	
	MBONO 4.75% 06/14/18	8,000,000.00	8,054,200.00	
	MBONO 5% 06/15/17	21,250,000.00	21,796,337.50	
	MBONO 6% 06/18/15	27,800,000.00	28,890,733.00	
	MBONO 6.25% 06/16/16	32,550,000.00	34,476,960.00	
	MBONO 6.5% 06/09/22	22,300,000.00	23,751,061.00	
	MBONO 6.5% 06/10/21	30,530,000.00	32,749,073.05	
	MBONO 7.25% 12/15/16	22,500,000.00	24,618,262.50	
	MBONO 7.5% 06/03/27	22,250,000.00	25,123,365.00	
	MBONO 7.75% 05/29/31	22,000,000.00	24,484,240.00	
	MBONO 7.75% 11/13/42	12,750,000.00	13,952,070.00	
	MBONO 7.75% 12/14/17	23,700,000.00	26,693,310.00	
	MBONO 8% 06/11/20	19,500,000.00	22,700,730.00	
	MBONO 8% 12/07/23	13,150,000.00	15,460,520.75	
	MBONO 8% 12/17/15	27,050,000.00	29,477,467.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	28,700,000.00	34,449,471.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	30,150,000.00	35,596,446.75	
	MBONO 8.5% 12/13/18	11,450,000.00	13,422,606.00	
MBONO 9.5% 12/18/14	30,250,000.00	32,299,437.50		
メキシコペソ小計		447,980,000.00	505,139,014.55 (3,798,645,389)	
ポーランドズロチ	POLGB 0% 01/25/16	2,550,000.00	2,386,940.25	
	POLGB 0% 07/25/15	2,500,000.00	2,381,262.50	
	POLGB 2.5% 07/25/18	2,700,000.00	2,587,045.50	
	POLGB 3.75% 04/25/18	6,500,000.00	6,593,080.00	
	POLGB 4% 10/25/23	3,650,000.00	3,594,574.75	
	POLGB 4.75% 04/25/17	4,950,000.00	5,194,678.50	
	POLGB 4.75% 10/25/16	5,540,000.00	5,797,222.20	
	POLGB 5% 04/25/16	7,200,000.00	7,534,440.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	8,450,000.00	9,037,021.50	
	POLGB 5.25% 10/25/20	6,200,000.00	6,716,832.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	7,650,000.00	7,955,235.00	
	POLGB 5.5% 10/25/19	6,350,000.00	6,964,267.25	
	POLGB 5.75% 04/25/29	2,850,000.00	3,244,297.50	
	POLGB 5.75% 09/23/22	6,800,000.00	7,618,380.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	5,500,000.00	6,138,302.50	
	POLGB 6.25% 10/24/15	6,950,000.00	7,399,074.25	

ポーランドズロチ小計		86,340,000.00	91,142,653.70 (2,924,767,757)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	33,150,000.00	40,749,803.25	
	SAGB 6.25% 03/31/36	18,200,000.00	14,037,842.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	15,350,000.00	11,832,087.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	25,800,000.00	25,328,376.00	
	SAGB 7% 02/28/31	17,350,000.00	15,227,574.50	
	SAGB 7.25% 01/15/20	20,850,000.00	21,196,839.75	
	SAGB 7.75% 02/28/23	6,150,000.00	6,319,986.00	
	SAGB 8% 12/21/18	21,650,000.00	22,967,402.50	
	SAGB 8.25% 09/15/17	20,650,000.00	21,962,204.25	
	SAGB 8.75% 02/28/48	8,650,000.00	8,610,037.00	
	SAGB 8.75% 12/21/14	2,150,000.00	2,240,611.75	
南アフリカランド小計		189,950,000.00	190,472,764.00 (1,897,108,729)	
ユーロ	BGB 1.25% 06/22/18	2,300,000.00	2,304,772.50	
	BGB 2.25% 06/22/23	2,300,000.00	2,246,893.00	
	BGB 2.75% 03/28/16	1,740,000.00	1,834,368.90	
	BGB 3% 09/28/19	2,300,000.00	2,482,459.00	
	BGB 3.25% 09/28/16	3,300,000.00	3,549,727.50	
	BGB 3.5% 03/28/15	2,100,000.00	2,196,757.50	
	BGB 3.5% 06/28/17	3,450,000.00	3,770,349.75	
	BGB 3.75% 06/22/45	900,000.00	920,889.00	
	BGB 3.75% 09/28/15	3,700,000.00	3,941,943.00	
	BGB 3.75% 09/28/20	4,950,000.00	5,562,686.25	
	BGB 4% 03/28/18	2,950,000.00	3,319,428.50	
	BGB 4% 03/28/22	4,750,000.00	5,392,105.00	
	BGB 4% 03/28/32	2,000,000.00	2,183,940.00	
	BGB 4.0% 03/28/17	2,850,000.00	3,155,705.25	
	BGB 4.0% 03/28/19	2,550,000.00	2,893,089.75	
	BGB 4.25% 03/28/41	3,250,000.00	3,668,470.00	
	BGB 4.25% 09/28/21	3,100,000.00	3,586,901.50	
	BGB 4.25% 09/28/22	3,500,000.00	4,031,422.50	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,750,000.00	2,044,227.50	
	BGB 5% 03/28/35	4,500,000.00	5,586,705.00	
	BGB 5.5% 03/28/28	4,250,000.00	5,462,992.50	
	BGB 5.5% 09/28/17	1,800,000.00	2,113,857.00	
	BGB 8.0% 03/28/15	1,510,000.00	1,675,367.65	
	BKO 0% 12/12/14	4,000,000.00	3,995,900.00	
	BKO 0.25% 09/11/15	1,500,000.00	1,502,595.00	
	BTNS 1% 07/25/17	3,890,000.00	3,924,990.55	
	BTNS 1.75% 02/25/17	6,000,000.00	6,221,250.00	

BTNS 2% 07/12/15	8,940,000.00	9,204,177.00	
BTNS 2.25% 02/25/16	7,740,000.00	8,074,948.50	
BTNS 2.5% 01/15/15	4,700,000.00	4,831,647.00	
BTNS 2.5% 07/25/16	7,010,000.00	7,398,248.85	
BTPS 2.25% 05/15/16	750,000.00	759,326.25	
BTPS 2.5% 03/01/15	3,200,000.00	3,262,032.00	
BTPS 3% 04/15/15	6,550,000.00	6,727,570.50	
BTPS 3% 06/15/15	8,510,000.00	8,746,322.70	
BTPS 3% 11/01/15	8,200,000.00	8,454,036.00	
BTPS 3.5% 11/01/17	2,900,000.00	3,009,243.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	5,240,000.00	5,366,624.60	
BTPS 3.75% 04/15/16	5,330,000.00	5,593,968.25	
BTPS 3.75% 08/01/15	9,130,000.00	9,504,695.20	
BTPS 3.75% 08/01/16	6,500,000.00	6,829,972.50	
BTPS 3.75% 08/01/21	9,900,000.00	10,120,522.50	
BTPS 4% 02/01/17	7,150,000.00	7,566,058.50	
BTPS 4% 02/01/37	6,250,000.00	5,730,000.00	
BTPS 4% 09/01/20	6,250,000.00	6,531,781.25	
BTPS 4.25% 02/01/15	3,300,000.00	3,436,521.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	5,950,000.00	6,333,775.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	6,200,000.00	6,555,508.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	6,600,000.00	7,020,585.00	
BTPS 4.5% 02/01/18	9,100,000.00	9,801,792.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	5,620,000.00	6,019,469.60	
BTPS 4.5% 03/01/19	6,550,000.00	7,044,001.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	4,600,000.00	4,750,627.00	
BTPS 4.5% 05/01/23	2,050,000.00	2,144,300.00	
BTPS 4.5% 07/15/15	1,410,000.00	1,484,751.15	
BTPS 4.5% 08/01/18	7,650,000.00	8,248,077.00	
BTPS 4.75% 05/01/17	3,160,000.00	3,414,585.40	
BTPS 4.75% 06/01/17	3,600,000.00	3,891,438.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	5,700,000.00	6,117,382.50	
BTPS 4.75% 09/01/21	6,850,000.00	7,407,281.75	
BTPS 4.75% 09/01/28	900,000.00	932,346.00	
BTPS 4.75% 09/01/44	1,500,000.00	1,473,315.00	
BTPS 4.75% 09/15/16	4,400,000.00	4,744,278.00	
BTPS 5% 03/01/22	7,150,000.00	7,811,839.75	
BTPS 5% 03/01/25	4,750,000.00	5,108,696.25	
BTPS 5% 08/01/34	5,400,000.00	5,629,716.00	
BTPS 5% 09/01/40	5,700,000.00	5,858,745.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	4,950,000.00	5,113,647.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	8,100,000.00	8,918,869.50	

BTPS 5.25% 11/01/29	7,350,000.00	7,933,296.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	3,950,000.00	4,428,384.50	
BTPS 5.5% 11/01/22	4,350,000.00	4,874,066.25	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,900,000.00	4,425,369.00	
BTPS 6% 05/01/31	8,450,000.00	9,825,533.25	
BTPS 6% 11/15/14	2,700,000.00	2,845,030.50	
BTPS 6.5% 11/01/27	8,310,000.00	10,087,342.80	
BTPS 7.25% 11/01/26	2,600,000.00	3,350,958.00	
BTPS 9% 11/01/23	3,050,000.00	4,297,892.25	
DBR 1.5% 02/15/23	3,400,000.00	3,352,587.00	
DBR 1.5% 05/15/23	4,050,000.00	3,971,085.75	
DBR 1.5% 09/04/22	4,000,000.00	3,980,240.00	
DBR 1.75% 07/04/22	7,840,000.00	7,987,196.00	
DBR 2% 01/04/22	4,900,000.00	5,121,259.50	
DBR 2% 08/15/23	1,800,000.00	1,837,512.00	
DBR 2.25% 09/04/20	4,200,000.00	4,511,031.00	
DBR 2.25% 09/04/21	3,820,000.00	4,080,829.60	
DBR 2.5% 01/04/21	5,000,000.00	5,446,475.00	
DBR 2.5% 07/04/44	3,050,000.00	2,953,406.50	
DBR 3% 07/04/20	6,720,000.00	7,554,220.80	
DBR 3.25% 01/04/20	4,100,000.00	4,660,654.50	
DBR 3.25% 07/04/15	9,300,000.00	9,786,297.00	
DBR 3.25% 07/04/21	4,250,000.00	4,859,896.25	
DBR 3.25% 07/04/42	4,150,000.00	4,660,885.75	
DBR 3.5% 01/04/16	7,050,000.00	7,563,804.00	
DBR 3.5% 07/04/19	6,060,000.00	6,947,396.10	
DBR 3.75% 01/04/15	6,140,000.00	6,407,489.10	
DBR 3.75% 01/04/17	4,350,000.00	4,826,651.25	
DBR 3.75% 01/04/19	6,450,000.00	7,434,495.75	
DBR 4% 07/04/16	5,600,000.00	6,163,612.00	
DBR 4.0% 01/04/18	5,820,000.00	6,664,802.10	
DBR 4.0% 01/04/37	5,500,000.00	6,794,672.50	
DBR 4.25% 07/04/17	7,010,000.00	7,997,638.90	
DBR 4.25% 07/04/18	5,300,000.00	6,187,644.00	
DBR 4.25% 07/04/39	3,750,000.00	4,870,800.00	
DBR 4.75% 07/04/28	2,950,000.00	3,848,747.00	
DBR 4.75% 07/04/34	5,000,000.00	6,731,900.00	
DBR 4.75% 07/04/40	3,950,000.00	5,536,399.00	
DBR 5.5% 01/04/31	4,530,000.00	6,446,371.20	
DBR 5.625% 01/04/28	3,650,000.00	5,140,842.50	
DBR 6% 06/20/16	900,000.00	1,036,444.50	
DBR 6.25% 01/04/24	2,650,000.00	3,760,297.00	

DBR 6.25% 01/04/30	2,100,000.00	3,178,329.00	
DBR 6.5% 07/04/27	2,300,000.00	3,474,782.50	
FRTR 0.25% 11/25/15	2,100,000.00	2,095,579.50	
FRTR 1% 05/25/18	2,000,000.00	2,001,490.00	
FRTR 1.75% 05/25/23	1,950,000.00	1,865,721.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	7,350,000.00	7,425,374.25	
FRTR 2.5% 10/25/20	7,300,000.00	7,735,043.50	
FRTR 3% 04/25/22	10,800,000.00	11,646,666.00	
FRTR 3% 10/25/15	8,700,000.00	9,164,971.50	
FRTR 3.25% 04/25/16	7,600,000.00	8,135,648.00	
FRTR 3.25% 05/25/45	1,100,000.00	1,071,845.50	
FRTR 3.25% 10/25/21	5,550,000.00	6,125,590.50	
FRTR 3.5% 04/25/15	8,200,000.00	8,597,782.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	9,960,000.00	11,210,876.40	
FRTR 3.5% 04/25/26	9,750,000.00	10,591,376.25	
FRTR 3.75% 04/25/17	8,990,000.00	9,946,760.75	
FRTR 3.75% 04/25/21	9,000,000.00	10,276,785.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	7,150,000.00	8,138,201.50	
FRTR 4% 04/25/18	8,410,000.00	9,545,181.80	
FRTR 4% 04/25/55	3,800,000.00	4,274,107.00	
FRTR 4% 04/25/60	2,050,000.00	2,313,599.25	
FRTR 4% 10/25/14	2,410,000.00	2,501,471.55	
FRTR 4% 10/25/38	6,150,000.00	6,923,178.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	8,800,000.00	10,217,592.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	8,230,000.00	9,344,959.25	
FRTR 4.25% 10/25/18	8,470,000.00	9,779,419.65	
FRTR 4.25% 10/25/23	10,100,000.00	11,814,828.50	
FRTR 4.5% 04/25/41	6,250,000.00	7,595,125.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	5,150,000.00	6,421,689.50	
FRTR 5% 10/25/16	5,410,000.00	6,130,449.70	
FRTR 5.5% 04/25/29	6,000,000.00	7,930,530.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	6,500,000.00	9,016,832.50	
FRTR 6.0% 10/25/25	4,600,000.00	6,213,772.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	4,090,000.00	6,302,628.65	
FRTR 8.5% 10/25/19	2,150,000.00	3,040,239.75	
IRISH 3.9% 03/20/23	1,300,000.00	1,339,383.50	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,750,000.00	1,901,025.00	
IRISH 4.5% 02/18/15	950,000.00	1,001,485.25	
IRISH 4.5% 04/18/20	3,300,000.00	3,558,357.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	2,700,000.00	2,959,537.50	
IRISH 4.6% 04/18/16	2,850,000.00	3,082,075.50	
IRISH 5% 10/18/20	2,200,000.00	2,439,514.00	

IRISH 5.4% 03/13/25	2,850,000.00	3,224,347.50	
IRISH 5.5% 10/18/17	1,200,000.00	1,354,368.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	1,350,000.00	1,565,595.00	
NETHER 0% 04/15/16	2,050,000.00	2,031,980.50	
NETHER 0.75% 04/15/15	3,320,000.00	3,346,908.60	
NETHER 1.25% 01/15/18	3,200,000.00	3,255,520.00	
NETHER 1.25% 01/15/19	850,000.00	856,336.75	
NETHER 1.75% 07/15/23	2,900,000.00	2,809,157.50	
NETHER 2.25% 07/15/22	3,700,000.00	3,802,841.50	
NETHER 2.5% 01/15/17	4,140,000.00	4,396,390.20	
NETHER 2.5% 01/15/33	2,450,000.00	2,363,380.25	
NETHER 2.75% 01/15/15	3,300,000.00	3,404,560.50	
NETHER 3.25% 07/15/15	4,750,000.00	4,996,572.50	
NETHER 3.25% 07/15/21	4,310,000.00	4,797,267.05	
NETHER 3.5% 07/15/20	3,850,000.00	4,354,677.25	
NETHER 3.75% 01/15/23	3,050,000.00	3,506,615.50	
NETHER 3.75% 01/15/42	3,550,000.00	4,209,057.50	
NETHER 4% 01/15/37	3,350,000.00	4,052,813.25	
NETHER 4% 07/15/16	3,800,000.00	4,167,897.00	
NETHER 4% 07/15/19	4,000,000.00	4,617,780.00	
NETHER 4.0% 07/15/18	4,200,000.00	4,789,323.00	
NETHER 4.5% 07/15/17	3,900,000.00	4,444,440.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	3,200,000.00	4,329,760.00	
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	1,025,528.00	
OBL 0.25% 04/13/18	3,750,000.00	3,688,725.00	
OBL 0.5% 02/23/18	3,050,000.00	3,040,133.25	
OBL 0.5% 04/07/17	4,860,000.00	4,879,221.30	
OBL 0.5% 10/13/17	2,800,000.00	2,802,954.00	
OBL 0.75% 02/24/17	3,800,000.00	3,850,046.00	
OBL 1.25% 10/14/16	3,500,000.00	3,601,115.00	
OBL 1.75% 10/09/15	4,980,000.00	5,135,749.50	
OBL 2% 02/26/16	3,150,000.00	3,283,355.25	
OBL 2.25% 04/10/15	8,850,000.00	9,122,226.00	
OBL 2.5% 02/27/15	6,970,000.00	7,192,168.75	
OBL 2.5% 10/10/14	1,200,000.00	1,227,558.00	
OBL 2.75% 04/08/16	2,450,000.00	2,602,096.00	
RAGB 1.15% 10/19/18	800,000.00	804,188.00	
RAGB 1.95% 06/18/19	1,150,000.00	1,196,971.75	
RAGB 3.15% 06/20/44	1,000,000.00	1,043,825.00	
RAGB 3.2% 02/20/17	2,200,000.00	2,390,938.00	
RAGB 3.4% 10/20/14	2,650,000.00	2,735,436.00	
RAGB 3.4% 11/22/22	1,500,000.00	1,676,835.00	

RAGB 3.5% 07/15/15	3,600,000.00	3,803,670.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	3,850,000.00	4,349,402.75	
RAGB 3.65% 04/20/22	2,200,000.00	2,504,964.00	
RAGB 3.8% 01/26/62	800,000.00	969,732.00	
RAGB 3.9% 07/15/20	3,500,000.00	4,037,232.50	
RAGB 4% 09/15/16	2,750,000.00	3,032,205.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,900,000.00	3,522,572.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	1,550,000.00	1,761,714.50	
RAGB 4.35% 03/15/19	3,300,000.00	3,851,974.50	
RAGB 4.65% 01/15/18	3,650,000.00	4,228,616.25	
RAGB 4.85% 03/15/26	2,400,000.00	3,026,100.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	2,400,000.00	3,437,340.00	
RFGB 1.125% 09/15/18	550,000.00	554,262.50	
RFGB 1.5% 04/15/23	1,250,000.00	1,198,618.75	
RFGB 1.625% 09/15/22	1,200,000.00	1,176,210.00	
RFGB 1.75% 04/15/16	1,550,000.00	1,607,350.00	
RFGB 1.875% 04/15/17	1,300,000.00	1,359,520.50	
RFGB 2.625% 07/04/42	650,000.00	631,182.50	
RFGB 2.75% 07/04/28	1,000,000.00	1,024,065.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	1,800,000.00	2,025,225.00	
RFGB 3.5% 04/15/21	1,650,000.00	1,870,110.00	
RFGB 3.875% 09/15/17	1,500,000.00	1,683,472.50	
RFGB 4% 07/04/25	1,450,000.00	1,705,801.75	
RFGB 4.25% 07/04/15	1,450,000.00	1,550,006.50	
RFGB 4.375% 07/04/19	1,100,000.00	1,295,569.00	
SPGB 3% 04/30/15	5,360,000.00	5,498,931.20	
SPGB 3.15% 01/31/16	5,600,000.00	5,785,248.00	
SPGB 3.25% 04/30/16	5,600,000.00	5,807,004.00	
SPGB 3.3% 07/30/16	2,300,000.00	2,386,365.00	
SPGB 3.3% 10/31/14	6,900,000.00	7,072,879.50	
SPGB 3.75% 10/31/15	3,150,000.00	3,286,032.75	
SPGB 3.75% 10/31/18	1,750,000.00	1,822,310.00	
SPGB 3.8% 01/31/17	5,390,000.00	5,677,529.55	
SPGB 4% 04/30/20	4,700,000.00	4,874,252.50	
SPGB 4% 07/30/15	5,250,000.00	5,483,887.50	
SPGB 4.1% 07/30/18	4,500,000.00	4,791,442.50	
SPGB 4.2% 01/31/37	4,050,000.00	3,623,616.00	
SPGB 4.25% 10/31/16	5,000,000.00	5,326,350.00	
SPGB 4.3% 10/31/19	5,100,000.00	5,415,690.00	
SPGB 4.4% 01/31/15	7,420,000.00	7,740,432.70	
SPGB 4.4% 10/31/23	3,000,000.00	3,065,445.00	
SPGB 4.5% 01/31/18	4,800,000.00	5,174,712.00	

	SPGB 4.6% 07/30/19	4,800,000.00	5,187,168.00	
	SPGB 4.65% 07/30/25	4,100,000.00	4,202,500.00	
	SPGB 4.7% 07/30/41	2,800,000.00	2,678,144.00	
	SPGB 4.8% 01/31/24	4,250,000.00	4,470,851.25	
	SPGB 4.85% 10/31/20	4,500,000.00	4,872,262.50	
	SPGB 4.9% 07/30/40	3,400,000.00	3,354,831.00	
	SPGB 5.15% 10/31/28	700,000.00	733,267.50	
	SPGB 5.4% 01/31/23	4,400,000.00	4,850,516.00	
	SPGB 5.5% 04/30/21	7,400,000.00	8,310,385.00	
	SPGB 5.5% 07/30/17	4,850,000.00	5,400,596.25	
	SPGB 5.75% 07/30/32	3,700,000.00	4,138,616.50	
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,960,000.00	3,372,328.00	
	SPGB 5.9% 07/30/26	2,150,000.00	2,435,788.75	
	SPGB 6.0% 01/31/29	5,220,000.00	5,947,198.20	
	ユーロ小計	1,061,130,000.00	1,167,033,934.50 (156,767,668,421)	
	国債証券合計		361,778,780,392 (361,778,780,392)	
	合計		361,778,780,392 (361,778,780,392)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

(2)合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(3)通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 203銘柄	100.0%	39.5%
カナダドル	国債証券 31銘柄	100.0%	2.5%
オーストラリアドル	国債証券 16銘柄	100.0%	1.6%
イギリスポンド	国債証券 37銘柄	100.0%	7.6%
スイスフラン	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 20銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.9%
メキシコペソ	国債証券 20銘柄	100.0%	1.0%
ポーランドズロチ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%
南アフリカランド	国債証券 11銘柄	100.0%	0.5%
ユーロ	国債証券 251銘柄	100.0%	43.3%

(注)組入時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等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。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

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25年11月29日現在）

資産総額	19,205,904,937 円
負債総額	35,347,581 円
純資産総額(-)	19,170,557,356 円
発行済口数	11,990,916,041 口
1口当たり純資産額(/)	1.5988 円
1万口当たり純資産額	15,988 円

(参考情報)

外国債券マザーファンド

資産総額	368,293,774,468 円
負債総額	2,153,679,943 円
純資産総額(-)	366,140,094,525 円
発行済口数	174,876,223,326 口
1口当たり純資産額(/)	2.0937 円
1万口当たり純資産額	20,937 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）投資信託受益証券の名義書換等

委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、該当事項はありません。

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限

該当事項はありません。

（4）振替受益権に関する記載

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取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消された場合又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、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

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

受益権の譲渡

A．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又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。

B．上記A．の申請のある場合には、上記A．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及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又は記録するものとします。ただし、上記A．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

C．上記A．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又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。

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又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、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。

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又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販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

質権口記載又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又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け付け、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（平成25年11月29日現在）

資本金の額 : 3億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間における資本金の額の増減 : 該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

会社取締役3名以上、監査役2名以内をおきます。取締役及び監査役は、株主総会において選任され、又は解任されます。

取締役及び監査役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査役の任期は、選任後4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終結の時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

社長にさしつかえあるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに招集通知を発送します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

運用企画部担当役員を委員長とする運用委員会において、ファンドの運用の基本方針や運用ガイドラインなどを決定します。運用委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部において、ファンドマネジャーが資産配分や個別資産の運用に係る運用計画を月次で策定し、部長が承認します。

[DO（実行）]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の実行指図を通じてポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。

各運用部の部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映させています。

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用リスク管理委員会（委員長はリスク管理部担当役員）及び経営会議（議長は社長）に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - DO - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

さらに、内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価します。この監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

委託会社の機構は平成26年1月24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会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

平成25年11月29日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	343	4,568,647
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	343	4,568,647

3【委託会社等の経理状況】

- (1)委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）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。また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）第38条及び第57条に基づき、同規則並びに、「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、財務諸表及び中間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。
- (2)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、当事業年度（自平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。また、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、第28期事業年度の中間会計期間（自平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)		当事業年度 (平成25年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		4,826,115		8,192,444
前払費用		30,184		81,751
未収委託者報酬		944,716		2,210,605
未収運用受託報酬		26,998		31,051
未収入金		75,514		676
一年以内返還予定保証金		187,128		-
繰延税金資産		69,857		61,743
その他		31,325		19,263
流動資産合計		6,191,840		10,597,535
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	3,525	1	79,281
器具備品	1	14,970	1	103,209
建設仮勘定		62,454		-
有形固定資産合計		80,949		182,491
無形固定資産				
ソフトウェア		60,130		168,561
ソフトウェア仮勘定		12,151		-
その他無形固定資産		928		1,770
無形固定資産合計		73,209		170,332
投資その他の資産				
投資有価証券		43,194		47,112
長期前払費用		357		-
長期貸付金		-		31,838
会員権		-		25,000
その他の投資		165		633
貸倒引当金		-		31,838
投資その他の資産合計		43,717		72,746
固定資産合計		197,876		425,570
資産合計		6,389,717		11,023,105

（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日現在）	当事業年度 （平成25年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	22,794	19,992
未払金	644,600	1,459,757
未払収益分配金	30	-
未払手数料	438,778	942,503
その他未払金	205,791	517,254
未払費用	112,121	82,209
未払法人税等	20,166	204,363
未払消費税等	5,683	11,940
賞与引当金	71,044	92,832
移転関連費用引当金	41,450	-
その他流動負債	-	21,231
流動負債合計	917,862	1,892,326
固定負債		
資産除去債務	-	12,281
退職給付引当金	199,976	268,531
繰延税金負債	308,964	303,555
固定負債合計	508,940	584,368
負債合計	1,426,803	2,476,694
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	-	350,000
資本剰余金合計	-	350,000
利益剰余金		
利益準備金	56,500	59,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計	4,672,773	7,891,412
株主資本合計	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	9,859	4,998
評価・換算差額等合計	9,859	4,998
純資産合計	4,962,913	8,546,410

負債・純資産合計

6,389,717

11,023,105

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	7,821,113	19,128,296
運用受託報酬	98,179	94,659
営業収益合計	7,919,292	19,222,955
営業費用		
支払手数料	3,715,816	9,030,246
広告宣伝費	61,165	73,287
公告費	2,451	2,244
調査費	1,023,870	4,132,154
調査費	86,225	207,030
委託調査費	936,024	3,922,394
図書費	1,620	2,729
営業雑経費	610,455	1,294,879
通信費	10,764	21,905
印刷費	121,287	330,735
協会費	10,136	21,939
諸会費	803	757
情報機器関連費	436,328	874,151
その他営業雑経費	31,135	45,391
営業費用合計	5,413,759	14,532,812
一般管理費		
給料	1,276,685	2,259,238
役員報酬	35,160	78,205
給料・手当	1,048,061	1,967,177
賞与	193,464	213,855
退職給付費用	66,790	64,787
福利費	152,149	190,716
交際費	1,012	879
旅費交通費	25,687	45,160
租税公課	16,148	25,420
不動産賃借料	238,033	129,096
寄付金	2,832	-
減価償却費	55,540	129,966
敷金償却	2,804	-
諸経費	81,858	1 257,947
一般管理費合計	1,919,541	3,103,213
営業利益	585,991	1,586,929

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	2,795	1,919
受取利息	13,889	6,475
投資有価証券売却益	149	924
貸倒引当金戻入	-	3,000
その他	2,125	2,552
営業外収益合計	18,961	14,873
営業外費用		
支払手数料	800	-
投資有価証券売却損	12	14,182
その他	74	361
営業外費用合計	887	14,544
経常利益	604,065	1,587,257
特別利益		
投資有価証券売却益	1,277,804	30,000
特別利益合計	1,277,804	30,000
特別損失		
統合関連損失	123,726	484,725
特別損失合計	123,726	484,725
税引前当期純利益	1,758,142	1,132,532
法人税、住民税及び事業税	241,760	369,828
法人税等調整額	368,903	56,358
法人税等合計	610,664	426,187
当期純利益	1,147,477	706,344

(3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	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
資本剰余金		
その他資本剰余金		
当期首残高	-	-
当期変動額		
自己株式の消却	3,019,410	-
その他利益剰余金より振替	3,019,410	-
合併による増加	-	350,000
当期変動額合計	-	350,000
当期末残高	-	350,000
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	53,500	56,500
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	56,500	59,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	5,100,000	2,100,000
当期変動額		
繰越利益剰余金へ振替	3,000,000	-
当期変動額合計	3,000,000	-
当期末残高	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	1,421,205	2,516,273
当期変動額		
剰余金の配当	33,000	33,000
当期純利益	1,147,477	706,344
別途積立金より振替	3,000,000	-
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,542,294
当期変動額合計	1,095,067	3,215,638
当期末残高	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計		
当期首残高	6,574,705	4,672,773
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344

その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,542,294
当期変動額合計	1,901,932	3,218,638
当期末残高	4,672,773	7,891,412

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
自己株式		
当期首残高	-	-
当期変動額		
自己株式の取得	3,019,410	-
自己株式の消却	3,019,410	-
当期変動額合計	-	-
当期末残高	-	-
株主資本合計		
当期首残高	6,874,705	4,972,773
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,892,294
当期変動額合計	1,901,932	3,568,638
当期末残高	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	8,501	9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,357	14,857
当期末残高	9,859	4,998
評価・換算差額等合計		
当期首残高	8,501	9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,357	14,857
当期末残高	9,859	4,998
純資産合計		
当期首残高	6,866,203	4,962,913
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	3,019,410	-
合併による増加	-	2,892,294
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,357	14,857
当期変動額合計	1,903,289	3,583,496
当期末残高	4,962,913	8,546,410

重要な会計方針

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。）

2．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定率法によっております。

(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更)

当社は、法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。

これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ11,534千円増加しております。

(2)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、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

3．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。

(3)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。

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。

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成24年3月31日)		当事業年度 (平成25年3月31日)	
	建物	84,592	千円	23,594
器具備品	127,549	〃	235,212	〃
計	212,142	〃	258,807	〃

（損益計算書関係）

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)		当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)	
	諸経費		千円	97,199

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	6,000	-	3,000	3,000

(注) 普通株式の減少は、平成24年3月13日付取締役会決議に基づく自己株式の消却による減少であります。

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	-	3,000	3,000	-

(注) (1)普通株式の増加は、平成24年2月21日付株主総会決議に基づく自己株式の取得による増加であります。

(2)普通株式の減少は、平成24年3月13日付取締役会決議に基づく自己株式の消却による減少であります。

3. 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23年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

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

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	配当金の 原資	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成24年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成24年3月31日	平成24年6月29日

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 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24年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成24年3月31日	平成24年6月29日

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

平成25年6月28日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

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25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28日

（リ・ス取引関係）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

当社は、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

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。

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。

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

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）。

前事業年度（平成24年3月31日）

（単位:千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	4,826,115	4,826,115	-
(2)未収委託者報酬	944,716	944,716	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	43,194	43,194	-
(4)未払金	(644,600)	(644,600)	-

(*)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。

当事業年度（平成25年3月31日）

（単位:千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	8,192,444	8,192,444	-
(2)未収委託者報酬	2,210,605	2,210,605	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	47,112	47,112	-
(4)未払金	(1,459,757)	(1,459,757)	-

(*)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

(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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成24年3月31日）

（単位:千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	4,826,115	-	-	-
未収委託者報酬	944,716	-	-	-

当事業年度（平成25年3月31日）

（単位:千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	8,192,444	-	-	-
未収委託者報酬	2,210,605	-	-	-

（有価証券関係）

1．その他有価証券

前事業年度（平成24年3月31日現在）

（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	7,002	7,440	437
小計	7,002	7,440	437
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	51,511	35,754	15,756
小計	51,511	35,754	15,756
合計	58,513	43,194	15,318

当事業年度（平成25年3月31日現在）

（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	37,315	45,159	7,843
小計	37,315	45,159	7,843
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	2,030	1,952	77
小計	2,030	1,952	77
合計	39,345	47,112	7,766

2．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自平成23年4月1日 至 平成24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
1,483,441	1,277,954	12

当事業年度（自平成24年4月1日 至 平成25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
114,040	30,924	14,182

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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．退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
（1）退職給付債務	199,976	268,531
（2）退職給付引当金	199,976	268,531

（注）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。

（注）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

（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
（1）退職給付費用	66,790	64,787

（注）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。

（注）2．金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で12,680千円、当事業年度で13,971千円であります。

4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	4,898 千円	16,142 千円
貸倒引当金繰入限度超過額	- "	11,347 "
賞与引当金損金算入限度超過額	27,004 "	35,285 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	71,271 "	95,704 "
その他有価証券評価差額金	5,459 "	- "
移転関連費用引当金損金算入限度超過額	15,755 "	- "
減価償却超過額	12,745 "	1,067 "
敷金償却超過額	19,348 "	- "
その他	3,334 "	11,680 "
繰延税金資産 小計	159,817 "	171,228 "
評価性引当額	- "	11,347 "
繰延税金資産 合計	159,817 "	159,881 "
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	- "	2,767 "
投資有価証券売却益益金不算入額	398,925 "	398,925 "
繰延税金負債 合計	398,925 "	401,693 "
繰延税金資産(負債)の純額	239,107 "	241,812 "

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

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
法定実効税率	40.69 %	- %
（調整）		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	4.14 "	- "
税率変更による期末繰延税金負債の減額修正	2.30 "	- "
その他	0.49 "	- "
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.73 "	- "

当事業年度は法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

（関連情報）

1．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

(1)営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2)有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	2,429,898千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

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

前事業年度（自平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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	三井住友 トラスト・ホールディングス(株)	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員の兼任	投資有価証券の譲渡	67,316	-	-

(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りません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投資有価証券の譲渡

投資有価証券の譲渡価格については、第三者による鑑定評価額により決定しております。

当事業年度（自平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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	三井住友 トラスト・ホールディングス(株)	東京都千代田区	261,608	持株会社	(直接) 100%	役員の兼任	経営指導料の支払	97,199	-	-

(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りません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

経営指導料

取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

(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

前事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

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)
兄弟会社	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	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	2,721,441	未払手数料	286,815
							投資助言費用の支払	820,269	未払費用	104,322
兄弟会社	すみしん不動産(株)	東京都中央区	300	不動産仲介業務	-	-	投資有価証券の譲渡	185,484	-	-
							自己株式の取得	1,509,705	-	-
兄弟会社	住信カード(株)	東京都中央区	50	クレジットカード業務	-	-	投資有価証券の譲渡	494,720	-	-
							自己株式の取得	1,207,764	-	-
兄弟会社	住信情報サービス(株)	大阪府豊中市	100	コンピュータ関連業務	-	-	投資有価証券の譲渡	729,782	-	-
							自己株式の取得	301,941	-	-

(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

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。

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。

投資有価証券の譲渡及び自己株式の取得

投資有価証券及び自己株式の譲渡価格及び取得価格については、第三者による鑑定評価額により決定しております。

当事業年度（自平成24年4月1日至平成25年3月31日）

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)
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	6,006,973	未払手数料	613,819
							投資助言費用の支払	2,226,006	その他未払金	221,229

(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

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。

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。

3. 平成24年4月1日付で以下の兄弟会社は合併し、商号及び所在地の変更を行っております。

旧商号	新商号	所在地
住友信託銀行(株)	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区
すみしん不動産(株)	三井住友トラスト不動産(株)	東京都中央区
住信カード(株)	三井住友トラスト・カード(株)	東京都港区
住信情報サービス(株)	三井住友トラスト・システム&サービス(株)	東京都府中市

(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

前事業年度（平成24年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（平成25年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（企業結合等関係）

前事業年度（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自平成24年4月1日 至平成25年3月31日）

当社は、平成24年1月24日開催の取締役会における決議に基づき、中央三井アセットマネジメント株式会社と平成24年4月1日を効力発生日として合併する旨の「合併契約書」を平成24年1月31日付で締結いたしました。上記契約に基づき、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社は、平成24年4月1日付で合併いたしました。

1．企業結合の概要

(1)結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 当社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

(2)企業結合日

平成24年4月1日

(3)企業結合の法的形式

当社を吸収合併存続会社、中央三井アセットマネジメント株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

(4)結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5)その他取引の概要に関する事項

旧住友信託銀行グループと旧中央三井トラスト・グループは、平成23年4月1日に経営統合を行い、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（平成23年4月1日付で中央三井トラスト・ホールディングス株式会社が商号変更しております。）が誕生しました。今般、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社のグループ会社として、経営統合の目的に鑑み、統合効果を最大化する一環として、当社及び中央三井アセットマネジメント株式会社が合併し「三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社」として発足しました。

2．実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成20年12月26日）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成20年12月26日）に基づき、共通支配下の取引として処理いたしました。

（ 1株当たり情報）

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	1,654,304円66銭	2,848,803円51銭
1株当たり当期純利益	197,729円22銭	235,448円31銭

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

2 . 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
期中平均株式数	5,803株	3,000株

[次へ](#)

中間貸借対照表

(単位：千円)

第28期中間会計期間末

(平成25年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		9,085,583
未収委託者報酬		2,586,632
未収運用受託報酬		14,364
繰延税金資産		93,174
その他流動資産		145,900
流動資産合計		11,925,655
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	73,320
器具備品	1	96,424
有形固定資産合計		169,745
無形固定資産		183,276
投資その他の資産		
投資有価証券		58,285
長期貸付金		30,338
会員権		25,000
その他の投資		50,103
貸倒引当金		30,338
投資その他の資産合計		133,388
固定資産合計		486,410
資産合計		12,412,066
負債の部		
流動負債		
未払金		1,586,759
未払費用		47,931
未払法人税等		584,513
賞与引当金		97,266
その他流動負債	2	120,862
流動負債合計		2,437,333
固定負債		
退職給付引当金		296,351
繰延税金負債		277,998
資産除去債務		12,386
固定負債合計		586,736
負債合計		3,024,070

(単位：千円)

第28期中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
純資産の部	
株主資本	
資本金	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	350,000
資本剰余金合計	350,000
利益剰余金	
利益準備金	62,500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	6,573,745
利益剰余金合計	8,736,245
株主資本合計	9,386,245
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,751
評価・換算差額等合計	1,751
純資産合計	9,387,996
負債・純資産合計	12,412,066

中間損益計算書

(単位：千円)

第28期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	11,222,467
運用受託報酬	36,913
営業収益合計	11,259,380
営業費用	8,307,878
一般管理費	1 1,553,438
営業利益	1,398,063
営業外収益	2 8,577
営業外費用	9,483
経常利益	1,397,157
税引前中間純利益	1,397,157
法人税、住民税及び事業税	577,514
法人税等調整額	55,190
法人税等合計	522,324
中間純利益	874,833

中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

	第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）
株主資本	
資本金	
当期首残高	300,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	
当期首残高	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	350,000
資本剰余金合計	
当期首残高	350,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	350,000
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	59,500
当中間期変動額	
剰余金の配当に伴う積立	3,000
当中間期変動額合計	3,000
当中間期末残高	62,500
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	2,100,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	2,100,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	5,731,912
当中間期変動額	
剰余金の配当	33,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	841,833
当中間期末残高	6,573,745
利益剰余金合計	
当期首残高	7,891,412
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	844,833
当中間期末残高	8,736,245
株主資本合計	
当期首残高	8,541,412
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	874,833
当中間期変動額合計	844,833
当中間期末残高	9,386,245

（単位：千円）

	第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	4,998
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	3,247
当中間期変動額合計	3,247
当中間期末残高	1,751
評価・換算差額等合計	
当期首残高	4,998
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	3,247
当中間期変動額合計	3,247
当中間期末残高	1,751
純資産合計	
当期首残高	8,546,410
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	874,833
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	3,247
当中間期変動額合計	841,585
当中間期末残高	9,387,996

重要な会計方針

第28期中間会計期間
(自 平成25年4月1日
至 平成25年9月30日)

1. 資産の評価基準及び評価方法

有価証券

其他有価証券

時価のあるもの

 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

 (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。)

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

 定率法によっております。

(2) 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。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

 従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3) 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、当中間会計期間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。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第28期中間会計期間末 （平成25年9月30日）	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 29,556千円
	器具備品 251,697千円
	計 281,253千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 23,080千円
	無形固定資産 33,012千円
2	営業外収益の主要項目
	受取利息 4,063千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成25年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成25年 3月31日	平成25年 6月28日

（リ - ス取引関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第28期中間会計期間末（平成25年9月30日）

平成25年9月30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。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	9,085,583	9,085,583	-
(2)未収委託者報酬	2,586,632	2,586,632	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	58,285	58,285	-
(4)未払金	(1,586,759)	(1,586,759)	-

(*)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。

（有価証券関係）

第28期中間会計期間末（平成25年9月30日）

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	41,540	44,791	3,250
小計	41,540	44,791	3,250
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他	14,024	13,494	529
小計	14,024	13,494	529
合計	55,564	58,285	2,720

（デリバティブ取引関係）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

（関連情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	1,535,927千円

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第28期中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）	
1株当たり純資産額	3,129,332円09銭
1株当たり中間純利益	291,611円01銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期中間会計期間 （自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）
中間純利益	874,833千円
普通株式に係る中間純利益	874,833千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

自己又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、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2) 運用財産相互間の取引

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、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3) 通常の見取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の見取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4) 親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額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。

(5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社は、平成25年4月1日に取締役の役位としての会長を削除しました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

平成26年1月24日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

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) 受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成25年9月末日現在）

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

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成25年9月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
三井住友海上火災保険株式会社	139,595	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2) 販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

(参考) 再信託受託会社

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25年9月末日現在）

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

再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

- (1) 金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2) 目論見書の表紙等に委託会社又は受託会社のロゴ・マーク、ファンドの図案及びキャッチコピーを記載することがあります。
- (3) 目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5) 目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6) 交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載し、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9) 目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10) 有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成25年12月24日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 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DC外国債券インデックスファンドLの平成24年10月25日から平成25年10月24日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC外国債券インデックスファンドLの平成25年10月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友トラスト・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XBR Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年6月7日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	白川芳樹	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊藤浩之	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第27期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

上記は、当社が、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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月9日

三井住友トラスト・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 白川 芳樹 印
業務執行社員
指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 浩之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成25年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。