

【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24年12月21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】	日本債券インデックスファンド（SMA専用）
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	継続募集額 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】

日本債券インデックスファンド（SMA専用）

（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1万口当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いただければ、いつでもお知らせいたします（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（4）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】

お申込受付日の基準価額に、1.05%（税抜 1.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

償還乗換えにより当ファンドの受益権をお求めいただく場合には、当該償還金額の範囲内（単位型証券投資信託にあっては、当該償還金額とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数について申込手数料を優遇することがあります（「償還乗換優遇制度」（ ））。

「償還乗換優遇制度」とは、取得申込日の属する月の前3ヶ月以内に償還となった証券投資信託の償還金（信託期間を延長した単位型証券投資信託及び延長前の信託終了日以降、収益分配金の再投資以外の追加信託を行わない追加型証券投資信託にあっては、延長前の信託終了日以降でかつ取得申込日の属する月の前3ヶ月以内における受益権の買取請求による売却代金及び一部解約金を含みます。）をもって、その支払いを行った販売会社で当ファンドの受益権をお求めいただく場合に申込手数料を優遇する制度のことをいいます。なお、この際に、償還金の支払いを受けたことを証する書類をご提示いただくことがあります。

申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額はお申込金額（ ）の中から差引きます。お申込受付日の基準価額に取得口数を乗じて得た額に、申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額を加えた総額をいいます。

収益分配金を再投資する場合のお申込みについては、申込手数料は無手数料とします。

上記 及び の詳細につきましては、販売会社に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。

（6）【申込単位】

販売会社の定める単位とします。

詳細につきましては、販売会社に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。

ただし、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は、1口単位とします。

（7）【申込期間】

平成24年12月22日から平成25年12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2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、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。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、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。）

（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、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

信託金限度額

上限：5,000億円

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
追加型	海外	債券	
	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、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 >

- ・国内...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国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

< 投資対象資産 (収益の源泉) >

- ・債券...目論見書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	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米		日経225
債券 一般	年6回	欧州	ファミリー ファンド	
公債	(隔月)	アジア		
社債	年12回	オセアニア		TOPIX
その他債券 クレジット属性 ()	(毎月)	中南米		
不動産投信	日々	アフリカ	ファンド ・オブ・ ファンズ	その他
その他資産 (投資信託証券 (債券一般))	()	中近東 (中東)		(NOMURA - BPI総合)
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。

(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、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 一般...公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。

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>

- ・日本...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日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

<投資形態>

・ファミリーファンド

...目論見書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。

<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（NOMURA - BPI総合）

...「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「NOMURA - BPI総合」（ ）です。

NOMURA - BPI総合は、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。この指数は野村證券株式会社の知的財産であり、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果に関し、一切責任はありません。

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、「NOMURA - BPI総合」と連動する投資成果を目標とします。

（2）【ファンドの沿革】

平成19年10月19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日本債券インデックスファンド（SMA専用）から日本債券インデックスファンド（SMA専用）に変更
当ファンドの主要投資対象である中央三井日本債券マザーファンドの名称を日本債券マザーファンドに変更

（3）【ファンドの仕組み】

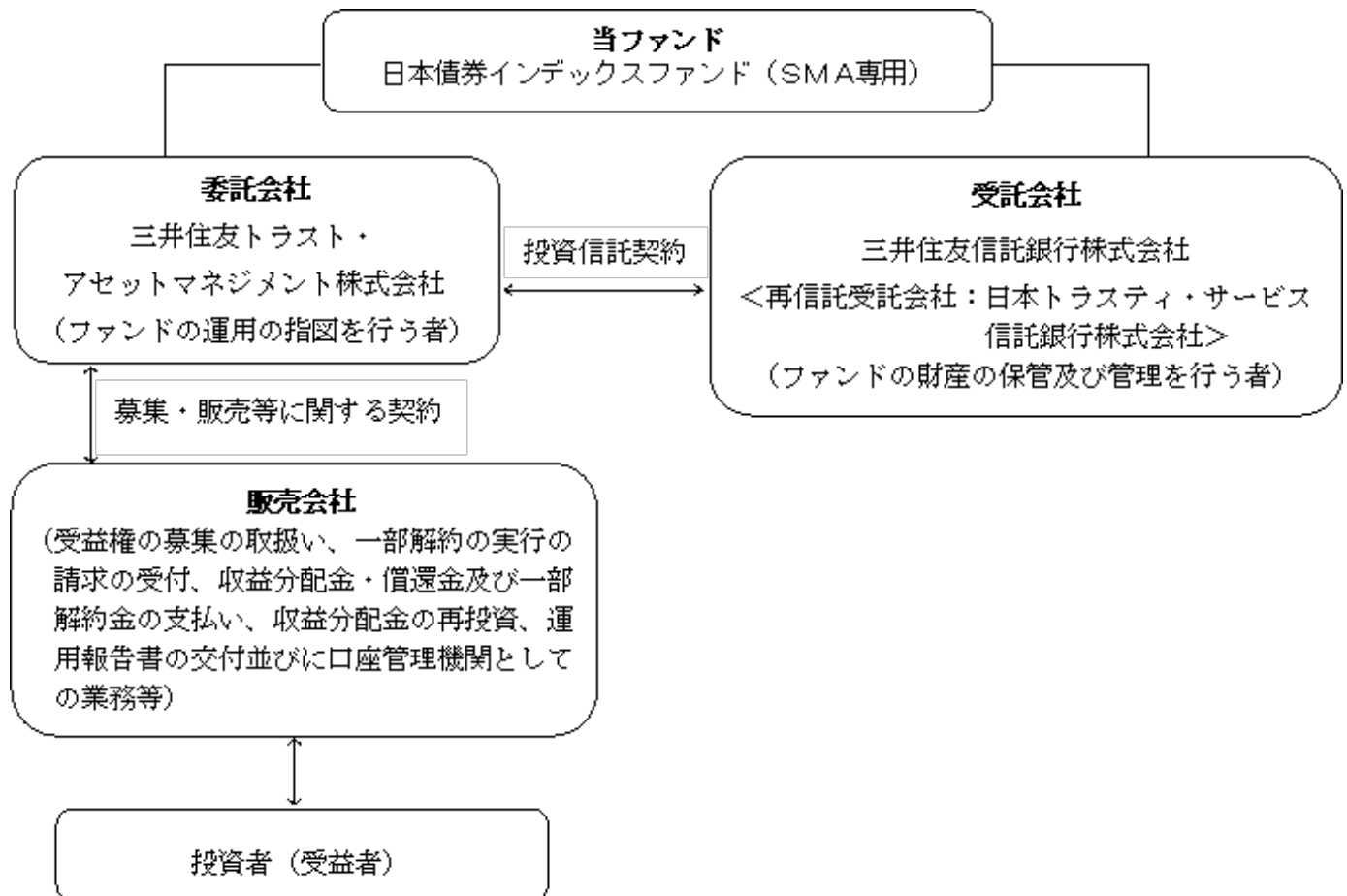
ファミリーファンド方式での運用

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（日本債券インデックスファンド（SMA専用））とし、その資金をマザーファンド（日本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24年10月31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24年10月31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、わが国の公社債に投資する日本債券マザーファンドの受益証券を主要投資対象とし、中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、わが国で発行された公社債に分散投資を行い、「NOMURA - BPI総合」と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 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．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。
- D．資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- E．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。）、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わが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の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。
- F．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。
- G．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

(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）G．、H．及びI．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「日本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（本邦通貨表示のものに限りません。また、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

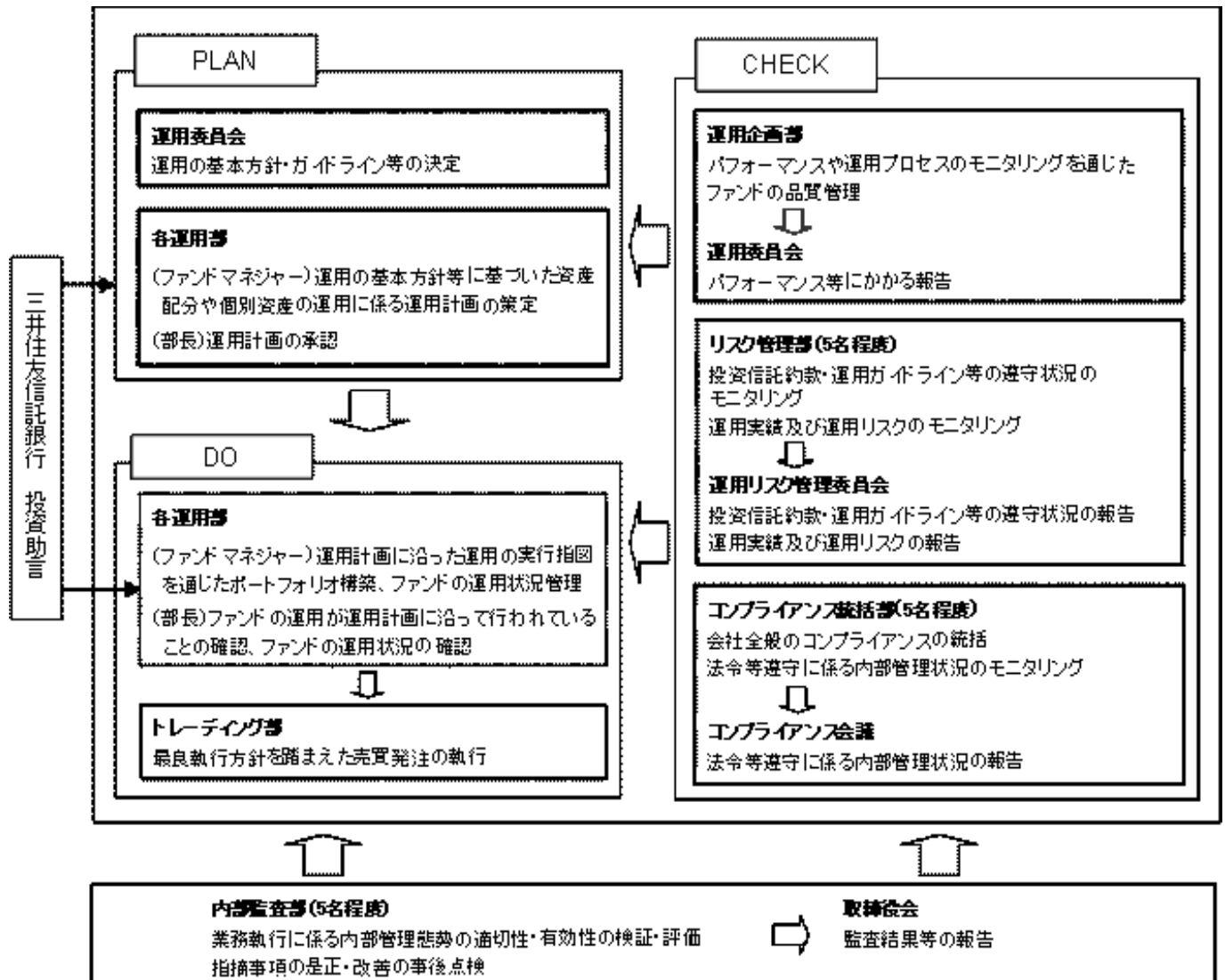
2. 地方債証券
 3. 特別の法律により法人の発行する債券
 4. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
 5. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 6. 転換社債の転換及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「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. の証券又は証書及び上記8. の証券又は証書のうち上記6. の証券又は証書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24年12月21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9月24日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとお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。）等の全額とします。
- 分配金額は、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。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。
- 収益分配にあ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

- A. 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。）、監査費用、当該監査費用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、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 - 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、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- 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（ただし、後記「4 手数料等及び税金（1）申込手数料」に規定する申込手数料及び申込手数料に係る消費税等相当額を除きます。以下本項において同じ。）と原本との差額をいい、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。再投資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。

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. 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、取得時において実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

B. 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。

C. 転換社債等への投資制限

委託会社は、転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債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10%以下とします。

D．外貨建資産への投資制限

委託会社は、外貨建資産への投資は行いません。

E．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。

F．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、わが国の金融商品取引所（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。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当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。

G．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。

ロ．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。

H．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。

I．金利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、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引の指図に当たっては、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可能なものについてはこの限りではありません。

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

ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うに当たり、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。

J．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、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。ただし、当該貸付は、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。

- ．上記イ．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- K．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は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渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ．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□．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。
- L．公社債の借入れの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ．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□．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。
- 二．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。
- M．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
- 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。
- N．再投資の指図
- 委託会社は、上記M．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、有価証券等に係る利子等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。
- O．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。
- ．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等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、当該有価証券等の売却代金、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。
- 二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。
- P．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、借替え、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、信託終了日までは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。

Q．利害関係人等との取引等

イ．受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託会社が当該第三者の代理人となつて行うものを含みます。）及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下イ．及びロ．において同じ。）、信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記G．からO．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

ロ．受託会社は、受託会社が当ファンドの受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託会社又は受託会社の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託会社の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

ハ．委託会社は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託会社、その取締役、執行役及び委託会社の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託会社が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記G．からO．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託会社は、委託会社の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。

ニ．上記イ．からハ．までの場合、委託会社及び受託会社は、受益者に対して信託法第31条第3項及び同法第32条第3項の通知は行いません。

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。□.において同じ。)の総数

□.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

「日本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

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

わが国の公社債に投資を行い、NOMURA - B P I 総合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。

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わが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の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。

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は、行いません。

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

信託財産に生じた利益及び損失は、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。

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。

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、NOMURA - B P I 総合と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、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。

(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コンプライアンス会議に報告します。

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】

お申込受付日の基準価額に、1.05%（税抜 1.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。

なお、マザーファンドにおいては、申込手数料はかかりません。

償還乗換えにより当ファンドの受益権をお求めいただく場合には、当該償還金額の範囲内（単位型証券投資信託にあっては、当該償還金額とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数について申込手数料を優遇することがあります（「償還乗換優遇制度」（ ））。

「償還乗換優遇制度」とは、取得申込日の属する月の前3ヶ月以内に償還となった証券投資信託の償還金（信託期間を延長した単位型証券投資信託及び延長前の信託終了日以降、収益分配金の再投資以外の追加信託を行わない追加型証券投資信託にあっては、延長前の信託終了日以降でかつ取得申込日の属する月の前3ヶ月以内における受益権の買取請求による売却代金及び一部解約金を含みます。）をもって、その支払いを行った販売会社で当ファンドの受益権をお求めいただく場合に申込手数料を優遇する制度のことをいいます。なお、この際に、償還金の支払いを受けたことを証する書類をご提示いただくことがあります。

申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額はお申込金額（ ）の中から差引きます。

お申込受付日の基準価額に取得口数を乗じて得た額に、申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額を加えた総額をいいます。

収益分配金を再投資する場合のお申込みについては、申込手数料は無手数料とします。

上記 及び の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、以下の照会先まで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。）

(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。

受益者の手取額は、当該解約価額から下記「（5）課税上の取扱い」「 個人の受益者に対する課税」もしくは「 法人の受益者に対する課税」に記載の税額を差引いた金額となります。

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
日本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%

税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になることがあります。

(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0.4095%（税抜0.39%）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 0.147%	（税抜 0.14%）
販売会社	年率 0.21%	（税抜 0.2%）
受託会社	年率 0.0525%	（税抜 0.05%）

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信託財産中から支弁するものとします。

上記の信託報酬に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支弁のとき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。

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、受益者の負担とし、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信託財産中から支弁します。

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。

個別元本について

- A. 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- B. 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- C. ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には各販売会社毎に、個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」の両コースで取得する場合はコース別に、個別元本の算出が行われる場合があります。
- D. 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「収益分配金の課税について」をご参照ください。）

一部解約時及び償還時の課税について

一部解約時及び償還時の譲渡益（個人の場合）又は個別元本超過額（法人の場合）が課税対象となります。詳しくは下記 又は をご参照ください。

収益分配金の課税について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

- A．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、
- B．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

個人の受益者に対する課税

- A．収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金の源泉徴収の税率は以下のとおりです。

なお、配当控除の適用はありません。

	税 率（内 訳）
平成24年12月31日まで	10%（所得税7%、住民税3%）
平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7.147%、住民税3%）
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
平成50年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（平成25年1月1日から平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

- B．一部解約時及び償還時の譲渡益が譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は上記Aと同じです。
- C．一部解約時及び償還時の損失の金額については、確定申告により、上場株式等の譲渡所得の金額及び申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得の金額から控除することが可能となります。また、一部解約時及び償還時の差益については、上場株式等の譲渡損との通算が可能となります。

詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めいたします。

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率（所得税のみ）
平成24年12月31日まで	7%
平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	7.147%
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

（平成25年1月1日から平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

上記は、平成24年10月31日現在のものですので、税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

(平成24年10月31日現在)

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	337,120,665	99.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		146,013	0.04
合計(純資産総額)		337,266,678	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

(平成24年10月31日現在)

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	日本債券マザーファンド	276,079,490	1.2199	336,789,370	1.2211	337,120,665	99.96

(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	99.96
合計	99.96

(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1期計算期間末 (平成20年 9月24日)	817,624,539	817,624,539	10,161	10,161
第2期計算期間末 (平成21年 9月24日)	2,755,935,916	2,755,935,916	10,446	10,446
第3期計算期間末 (平成22年 9月24日)	4,667,647,161	4,667,647,161	10,775	10,775
第4期計算期間末 (平成23年 9月26日)	5,397,590,140	5,397,590,140	10,863	10,863
第5期計算期間末 (平成24年 9月24日)	7,342,704,130	7,342,704,130	11,028	11,028

平成23年10月末日	5,429,954,789		10,809
11月末日	5,391,351,467		10,804
12月末日	5,555,886,512		10,867
平成24年 1月末日	5,814,127,456		10,883
2月末日	5,864,258,747		10,892
3月末日	6,113,271,845		10,893
4月末日	6,761,172,958		10,947
5月末日	6,550,488,950		11,001
6月末日	6,683,795,768		10,996
7月末日	6,903,859,187		11,033
8月末日	7,193,897,214		11,016
9月末日	7,379,921,827		11,040
10月末日	337,266,678		11,038

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第1期計算期間(平成19年10月19日～平成20年 9月24日)	1.6
第2期計算期間(平成20年 9月25日～平成21年 9月24日)	2.8
第3期計算期間(平成21年 9月25日～平成22年 9月24日)	3.1
第4期計算期間(平成22年 9月25日～平成23年 9月26日)	0.8
第5期計算期間(平成23年 9月27日～平成24年 9月24日)	1.5

(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1期計算期間 (平成19年10月19日～平成20年 9月24日)	813,601,823	8,898,105	804,703,718
第2期計算期間 (平成20年 9月25日～平成21年 9月24日)	2,260,187,494	426,568,885	2,638,322,327
第3期計算期間 (平成21年 9月25日～平成22年 9月24日)	3,318,834,206	1,625,170,207	4,331,986,326
第4期計算期間 (平成22年 9月25日～平成23年 9月26日)	2,464,511,792	1,827,600,785	4,968,897,333
第5期計算期間 (平成23年 9月27日～平成24年 9月24日)	3,631,618,885	1,942,397,745	6,658,118,473

(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)

日本債券マザーファンド

(1)投資状況

(平成24年10月31日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	260,145,472,000	76.45
地方債証券	日本	22,042,338,217	6.48
特殊債券	日本	34,559,860,971	10.16
社債券	日本	18,834,931,000	5.53
	オーストラリア	1,222,149,000	0.36
	アメリカ	612,222,000	0.18
	フランス	200,486,000	0.06
	イギリス	101,763,000	0.03
	スウェーデン	101,220,000	0.03
	小計		21,072,771,000
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,473,655,307	0.73
合計(純資産総額)		340,294,097,495	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

(平成24年10月31日現在)

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			
日本	国債証券	第87回利付国債(5年)	3,900,000,000	100.92	3,935,880,000	100.86	3,933,579,000	0.5	2014/12/20	1.16
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	3,400,000,000	106.76	3,630,146,000	106.69	3,627,630,000	1.7	2017/03/20	1.07
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	3,200,000,000	102.85	3,291,200,000	105.05	3,361,888,000	1.2	2020/12/20	0.99
日本	国債証券	第313回利付国債(2年)	3,200,000,000	99.98	3,199,360,000	100.00	3,200,192,000	0.1	2014/02/15	0.94
日本	国債証券	第284回利付国債(10年)	2,950,000,000	106.55	3,143,284,000	106.38	3,138,387,000	1.7	2016/12/20	0.92
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	2,900,000,000	104.49	3,030,312,000	106.09	3,076,697,000	1.3	2019/12/20	0.90
日本	国債証券	第88回利付国債(5年)	2,900,000,000	100.93	2,926,981,000	100.96	2,927,840,000	0.5	2015/03/20	0.86
日本	国債証券	第288回利付国債(10年)	2,500,000,000	107.09	2,677,250,000	107.33	2,683,250,000	1.7	2017/09/20	0.79
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	2,600,000,000	100.47	2,612,220,000	102.59	2,667,444,000	1.0	2022/03/20	0.78
日本	国債証券	第103回利付国債(5年)	2,600,000,000	100.04	2,601,062,000	100.58	2,615,236,000	0.3	2017/03/20	0.77
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	2,400,000,000	106.44	2,554,782,000	107.12	2,570,904,000	1.5	2018/09/20	0.76
日本	国債証券	第99回利付国債(5年)	2,400,000,000	100.29	2,407,128,000	101.00	2,424,072,000	0.4	2016/09/20	0.71
日本	国債証券	第92回利付国債(5年)	2,400,000,000	100.18	2,404,392,000	100.58	2,414,136,000	0.3	2015/09/20	0.71
日本	国債証券	第324回利付国債(10年)	2,400,000,000	100.06	2,401,456,000	100.53	2,412,936,000	0.8	2022/06/20	0.71

日本	国債証券	第105回利付国債（5年）	2,400,000,000	100.00	2,400,173,000	100.09	2,402,184,000	0.2	2017/06/20	0.71
日本	国債証券	第320回利付国債（2年）	2,400,000,000	100.00	2,400,062,000	100.00	2,400,216,000	0.1	2014/09/15	0.71
日本	国債証券	第318回利付国債（10年）	2,200,000,000	100.26	2,205,720,000	102.98	2,265,604,000	1.0	2021/09/20	0.67
日本	国債証券	第314回利付国債（2年）	2,200,000,000	99.97	2,199,470,000	100.00	2,200,132,000	0.1	2014/03/15	0.65
日本	国債証券	第270回利付国債（10年）	2,100,000,000	103.50	2,173,636,000	103.16	2,166,381,000	1.3	2015/06/20	0.64
日本	国債証券	第93回利付国債（5年）	2,100,000,000	100.96	2,120,274,000	101.24	2,126,208,000	0.5	2015/12/20	0.62
日本	国債証券	第85回利付国債（5年）	2,100,000,000	101.39	2,129,337,000	101.13	2,123,856,000	0.7	2014/09/20	0.62
日本	国債証券	第82回利付国債（5年）	2,100,000,000	101.63	2,134,356,000	101.10	2,123,247,000	0.9	2014/03/20	0.62
日本	国債証券	第86回利付国債（5年）	2,100,000,000	101.13	2,123,734,000	100.94	2,119,908,000	0.6	2014/09/20	0.62
日本	国債証券	第318回利付国債（2年）	2,100,000,000	100.01	2,100,350,000	100.00	2,100,168,000	0.1	2014/07/15	0.62
日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	1,900,000,000	103.46	1,965,740,000	105.79	2,010,086,000	1.3	2021/03/20	0.59
日本	国債証券	第106回利付国債（5年）	1,970,000,000	100.02	1,970,436,600	100.04	1,970,945,600	0.2	2017/09/20	0.58
日本	国債証券	第320回利付国債（10年）	1,900,000,000	100.35	1,906,650,000	102.79	1,953,105,000	1.0	2021/12/20	0.57
日本	国債証券	第311回利付国債（10年）	1,900,000,000	99.76	1,895,440,000	102.08	1,939,539,000	0.8	2020/09/20	0.57
日本	国債証券	第95回利付国債（5年）	1,900,000,000	101.24	1,923,731,000	101.63	1,931,008,000	0.6	2016/03/20	0.57
日本	国債証券	第98回利付国債（5年）	1,900,000,000	100.00	1,900,090,000	100.63	1,912,008,000	0.3	2016/06/20	0.56

(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	76.45
地方債証券	6.48
特殊債券	10.16
社債券	6.19
合計	99.27

(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	長期国債先物	東京証券取引所	買建	円	7	1,010,572,205	1,009,750,000	1,009,750,000	0.30

(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



第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

（1）取得申込者

当ファンドの受益権取得申込者は、販売会社と投資一任契約を締結されている投資者等に限定するものとします。

（2）申込みの受付

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2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、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

（3）募集取扱いの単位

販売会社の定める単位とします。（ただし収益分配金を再投資する場合は1口単位）

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、後記「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。

（4）販売価額

取得申込受付日の基準価額に、前記「第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金（1）申込手数料」に記載する申込手数料及び当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額とします。

（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

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。このため販売会社は総合約款を取得申込者に交付し、取得申込者は総合約款に基づく取引口座の設定を申込み旨の申込書を提出していただきます。

当ファンドは、収益分配がなされた場合、税金を差引いた後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分配金から税金を差引いた後に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を締結していただきます。

受益権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、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、委託会社に対し販売会社の定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

詳細につきましては、販売会社に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(4)に記載の照会先にお問い合わせください。

(注) 一部解約の実行の請求の受付は、営業日の午後2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付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

(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、

(3) 委託会社は、一部解約の実行の請求を受付けた場合には、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いただければ、いつでもお知らせいたします。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

なお、受益者の手取額は、当該解約価額から税額を差引いた金額となります。

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、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付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付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の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われます。

(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

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いただければ、いつでもお知らせいたします（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（日本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

（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19年10月19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9月25日から翌年9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19年10月19日から平成20年9月24日までとし、最終計算期間の終了日は、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10億口を下回った場合

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10億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。

□．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。

八．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監督官庁に届け出ます。

b．委託会社は、上記イ．及びロ．の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

c．上記b．の書面決議において、受益者（委託会社及び当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下c．において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

d．上記b．の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

e．上記b．からd．までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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．からd．までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

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しを受けたとき、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き継ぐことを命じたときは、当ファンドは、下記 D．に該当する場合には、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。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。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。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

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。

信託約款の変更等

- 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又は当ファンドと他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更又は併合しようとする旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は に定める以外の方法によって変更することができないものとし、
- B．委託会社は、上記A．の事項（上記A．の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款の変更等の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- C．上記B．の書面決議において、受益者（委託会社及び当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下C．において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- D．上記B．の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- E．書面決議の効力は、当ファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。
- F．上記B．からE．までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- G．上記A．からF．までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

反対者の買取請求権

信託契約の解約又は重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約又は重大な約款の変更等に反対した受益者は、販売会社を經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。この買取請求権の内容及び買取請求の手続きに関する事項は、上記 A．八．b．又は B．に規定する書面に付記します。

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．信託業務の委託等

イ．受託会社は、委託会社と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準の全てに適合するもの（受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下、下記八．及び において同じ。）を含みます。）を委託先として選定します。

- 1．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
- 2．委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
- 3．委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること

4．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

ロ．受託会社は、上記イ．に定める委託先の選定に当たっては、当該委託先が上記イ．1．から4．までに掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

ハ．上記イ．及びロ．にかかわらず、受託会社は、次の1．から4．までに掲げる業務を、受託会社及び委託会社が適当と認める者（受託会社の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1．信託財産の保存に係る業務

2．信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用又は改良を目的とする業務

3．委託会社のみ指図により信託財産の処分及びその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務

4．受託会社が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

B．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B．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シャル・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。

C．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ます。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。

ニ．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っ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

A．受託会社は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託会社の利害関係人を含みます。）と信託契約を締結し、これを再委託することができます。

B．上記A．における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

C．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、受託会社の利害関係人である日本トラスティ・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。再投資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。

(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ます。

受益者が、信託終了による償還金については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、委託会社に対し販売会社の定める単位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われます。

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。

(7) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

当ファンドの受益者は、委託会社又は受託会社に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うこ

とはできません。

- 1．他の受益者の氏名又は名称及び住所
- 2．他の受益者が有する受益権の内容

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5期計算期間（平成23年9月27日から平成24年9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】

日本債券インデックスファンド（SMA専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 (平成23年9月26日現在)	第5期 (平成24年9月24日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	-	30,148,843
親投資信託受益証券	5,408,735,435	7,341,658,352
未収入金	316,063,435	-
未収利息	-	59
流動資産合計	5,724,798,870	7,371,807,254
資産合計	5,724,798,870	7,371,807,254
負債の部		
流動負債		
未払解約金	316,063,435	15,092,307
未払受託者報酬	1,410,809	1,773,533
未払委託者報酬	9,593,473	12,059,996
その他未払費用	141,013	177,288
流動負債合計	327,208,730	29,103,124
負債合計	327,208,730	29,103,124
純資産の部		
元本等		
元本	4,968,897,333	6,658,118,473
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	428,692,807	684,585,657
（分配準備積立金）	153,530,482	195,764,079
元本等合計	5,397,590,140	7,342,704,130
純資産合計	5,397,590,140	7,342,704,130
負債純資産合計	5,724,798,870	7,371,807,254

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期 (自 平成22年 9月25日 至 平成23年 9月26日)	第5期 (自 平成23年 9月27日 至 平成24年 9月24日)
営業収益		
受取利息	-	3,020
有価証券売買等損益	81,006,084	122,545,652
営業収益合計	81,006,084	122,548,672
営業費用		
受託者報酬	2,526,692	3,237,909
委託者報酬	17,181,406	22,017,722
その他費用	252,538	323,664
営業費用合計	19,960,636	25,579,295
営業利益又は営業損失（ ）	61,045,448	96,969,377
経常利益又は経常損失（ ）	61,045,448	96,969,377
当期純利益又は当期純損失（ ）	61,045,448	96,969,377
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（ ）	859,120	11,642,660
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	335,660,835	428,692,807
剰余金増加額又は欠損金減少額	170,200,252	338,519,663
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	170,200,252	338,519,663
剰余金減少額又は欠損金増加額	137,354,608	167,953,530
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	137,354,608	167,953,530
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	428,692,807	684,585,657

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 第5期（自 平成23年 9月27日 至 平成24年 9月24日） 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年9月25日から翌年9月24日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第5期計算期間は平成23年 9月27日から平成24年 9月24日までとなっております。

(追加情報)

当該計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）」及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）」を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

	第4期 (平成23年 9月26日現在)	第5期 (平成24年 9月24日現在)
1. 当該計算期間の末日における受益権総数	4,968,897,333口	6,658,118,473口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0863円 (10,863円)	1.1028円 (11,028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4期 自 平成22年 9月25日 至 平成23年 9月26日	第5期 自 平成23年 9月27日 至 平成24年 9月24日
費用控除後の配当等収益額	A	49,002,052円 (65,254,002円)	68,336,504円 (88,819,941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	11,184,276円	16,990,213円
収益調整金額	C	275,162,325円	488,821,578円
分配準備積立金額	D	93,344,154円	110,437,362円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	428,692,807円	684,585,657円
当ファンドの期末残存口数	F	4,968,897,333口	6,658,118,473口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	862.75円	1,028.19円
10,000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

	第4期 自 平成22年 9月25日 至 平成23年 9月26日	第5期 自 平成23年 9月27日 至 平成24年 9月24日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、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。	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、価格変動リスク等に晒されております。	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、価格変動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	委託会社においては、運用セクションから組織的に独立した業務管理室が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。 また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。	委託会社においては、運用セクションから組織的に独立したリスク管理部が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。 また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第4期 (平成23年 9月26日現在)	第5期 (平成24年 9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。	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) 親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) 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>	<p>(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。</p> <p>(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。</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>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>
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	<p>金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。</p>	<p>金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。</p>

(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。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1. 本書における開示対象ファンドの当該計算期間における元本額の変動

	第4期 自 平成22年 9月25日 至 平成23年 9月26日	第5期 自 平成23年 9月27日 至 平成24年 9月24日
期首元本額	4,331,986,326円	4,968,897,333円
期中追加設定元本額	2,464,511,792円	3,631,618,885円
期中一部解約元本額	1,827,600,785円	1,942,397,745円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

	第4期 (平成23年 9月26日現在)	第5期 (平成24年 9月24日現在)
種類	計算期間(自 平成22年9月25日 至 平成23年 9月26日)の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間(自 平成23年 9月27日 至 平成24年 9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	118,188,849	141,007,511
合計	118,188,849	141,007,511

3. デリバティブ取引関係

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、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	日本債券マザーファンド	6,018,246,047	7,341,658,352	
親投資信託受益証券 小計		6,018,246,047	7,341,658,352	
合計		6,018,246,047	7,341,658,352	

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 >

「日本債券インデックスファンド（SMA専用）」は、「日本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24年9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。

「日本債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成24年 9月24日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,540,356,905
国債証券	263,947,154,800
地方債証券	22,209,579,128
特殊債券	34,049,589,018
社債券	21,234,763,000
派生商品評価勘定	1,006,535
未収入金	2,935,650,880
未収利息	652,455,487
前払金	530,000
前払費用	18,989,267
流動資産合計	348,590,075,020
資産合計	348,590,075,020
負債の部	
流動負債	
未払金	2,935,720,000
未払解約金	320,852,222
流動負債合計	3,256,572,222
負債合計	3,256,572,222
純資産の部	
元本等	
元本	283,084,405,765
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	62,249,097,033
元本等合計	345,333,502,798
純資産合計	345,333,502,798
負債純資産合計	348,590,075,020

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成24年 9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、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>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。</p> <p>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公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>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益の計上基準</p> <p>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24年 9月24日現在
1. 担保に供している資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。</p> <p style="text-align: right;">国債証券 104,912,000円</p> <p>なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおりません。</p>
2. 計算日における受益権総数	283,084,405,765口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2199円 (12,199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24年 9月24日現在
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、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。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>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、金利変動リスク、信用リスク及び流動性リスク等に晒されております。</p> <p>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を行っております。当該デリバティブ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。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社においては、運用セクションから組織的に独立したリスク管理部が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。</p> <p>また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。</p>
-------------------	---

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成24年 9月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>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。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「(その他の注記)」の「3. デリバティブ取引関係」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	<p>金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

平成24年 9月24日現在
該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

平成24年 9月24日現在

該当事項はありません。

(その他の注記)

1. 元本の変動

平成24年 9月24日現在

計算期間の期首元本額	294,857,698,998円
計算期間中の追加設定元本額	67,521,202,338円
計算期間中の一部解約元本額	79,294,495,571円
計算日の元本額	283,084,405,765円
計算日の元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	3,852,265,878円
DC日本債券インデックスファンド	2,110,547,173円
DC日本債券インデックスファンドL	23,172,558,843円
DCバランスファンド30	877,123,160円
DCバランスファンド50	867,667,387円
DCバランスファンド70	218,486,170円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	138,741,530円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	91,245,257円
日本債券インデックスファンド(SMA専用)	6,018,246,047円
新生・4分散ファンド	123,819,391円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	33,440,170円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	110,233,837円
日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)	784,639,884円
日本債券インデックスe	639,350,880円
インデックスコレクション(国内債券)	1,986,421,510円
インデックスコレクション(バランス株式30)	979,087,043円
インデックスコレクション(バランス株式50)	783,741,280円
インデックスコレクション(バランス株式70)	297,926,488円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	9,731,241,999円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	30,232,317,168円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	26,764,028,573円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	1,443,471,799円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	6,972,275,095円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	10,537,806,257円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,295,230,979円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	23,326,491,187円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	208,054,222円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	29,006,310,786円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	6,809,360,066円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	626,782,366円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	3,184,992,086円
VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	1,644,011,281円
バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	4,870,805,763円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	964,563,554円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	1,755,398,086円

バランスV A 2 0（適格機関投資家専用）	4,558,561,616円
V A ファンド 2 5（適格機関投資家専用）	4,194,872,426円
バランスファンドV A 2（適格機関投資家専用）	6,490,473,174円
バランスV A 2 0 L（適格機関投資家専用）	599,696,357円
バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	3,813,505,985円
バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	48,220,860,519円
世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	1,238,583,080円
国内バランスV A 3 0（適格機関投資家専用）	304,130,618円
国内バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	136,094,750円
V A バランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	1,242,026,139円
私募日本債券インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	10,014,272円
私募日本債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	8,794,942,551円
世界バランスV A 2 0（適格機関投資家専用）	21,961,083円

2．有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成24年 9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	2,327,496,700
地方債証券	167,243,119
特殊債券	232,823,340
社債券	261,919,000
合計	2,989,482,159

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「日本債券マザーファンド」の期首から計算日までの期間（平成24年1月24日から平成24年9月24日まで）に対応するものです。

3．デリバティブ取引関係

・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24年 9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	1,582,333,465	-	1,583,340,000	1,006,535
	合計	1,582,333,465	-	1,583,340,000	1,006,535

（注）1．時価の算定方法

債券先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段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。

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年 9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24年9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	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	第309回利付国債（2年）	2,200,000,000	2,200,110,000	
	第310回利付国債（2年）	1,200,000,000	1,201,428,000	
	第311回利付国債（2年）	1,300,000,000	1,301,651,000	
	第312回利付国債（2年）	400,000,000	400,024,000	
	第313回利付国債（2年）	3,500,000,000	3,500,210,000	
	第314回利付国債（2年）	2,200,000,000	2,200,154,000	
	第315回利付国債（2年）	600,000,000	600,042,000	
	第316回利付国債（2年）	700,000,000	700,056,000	
	第317回利付国債（2年）	300,000,000	300,024,000	
	第318回利付国債（2年）	2,100,000,000	2,100,168,000	
	第319回利付国債（2年）	200,000,000	200,018,000	
	第320回利付国債（2年）	1,400,000,000	1,400,126,000	
	第78回利付国債（5年）	700,000,000	706,937,000	
	第79回利付国債（5年）	1,700,000,000	1,712,665,000	
	第80回利付国債（5年）	1,300,000,000	1,311,284,000	
	第81回利付国債（5年）	1,700,000,000	1,717,697,000	
	第82回利付国債（5年）	2,100,000,000	2,124,969,000	
	第83回利付国債（5年）	1,200,000,000	1,216,692,000	
	第84回利付国債（5年）	1,800,000,000	1,818,810,000	
	第85回利付国債（5年）	2,100,000,000	2,125,137,000	
	第86回利付国債（5年）	2,100,000,000	2,120,979,000	
	第87回利付国債（5年）	3,900,000,000	3,935,178,000	
	第88回利付国債（5年）	2,900,000,000	2,929,029,000	
	第89回利付国債（5年）	1,200,000,000	1,209,960,000	
	第90回利付国債（5年）	1,300,000,000	1,307,254,000	
	第91回利付国債（5年）	1,000,000,000	1,008,920,000	
	第92回利付国債（5年）	2,400,000,000	2,414,256,000	
	第93回利付国債（5年）	2,100,000,000	2,126,712,000	
	第94回利付国債（5年）	2,000,000,000	2,032,220,000	
	第95回利付国債（5年）	1,900,000,000	1,932,262,000	
	第96回利付国債（5年）	1,300,000,000	1,317,563,000	
	第97回利付国債（5年）	1,600,000,000	1,616,336,000	
	第98回利付国債（5年）	2,000,000,000	2,012,980,000	
	第99回利付国債（5年）	2,400,000,000	2,424,696,000	
	第100回利付国債（5年）	1,400,000,000	1,408,862,000	
	第101回利付国債（5年）	1,800,000,000	1,818,540,000	
	第102回利付国債（5年）	1,900,000,000	1,911,571,000	
	第103回利付国債（5年）	2,600,000,000	2,615,002,000	

第104回利付国債（5年）	2,500,000,000	2,503,325,000	
第105回利付国債（5年）	1,900,000,000	1,901,330,000	
第1回利付国債（40年）	400,000,000	438,664,000	
第2回利付国債（40年）	500,000,000	521,640,000	
第3回利付国債（40年）	600,000,000	623,034,000	
第4回利付国債（40年）	800,000,000	826,696,000	
第5回利付国債（40年）	300,000,000	292,890,000	
第256回利付国債（10年）	1,040,000,000	1,056,712,800	
第257回利付国債（10年）	400,000,000	405,932,000	
第258回利付国債（10年）	480,000,000	488,544,000	
第259回利付国債（10年）	1,180,000,000	1,204,485,000	
第260回利付国債（10年）	860,000,000	882,368,600	
第261回利付国債（10年）	790,000,000	813,281,300	
第262回利付国債（10年）	730,000,000	752,776,000	
第263回利付国債（10年）	750,000,000	772,342,500	
第264回利付国債（10年）	1,330,000,000	1,366,987,300	
第265回利付国債（10年）	730,000,000	752,849,000	
第266回利付国債（10年）	560,000,000	576,279,200	
第267回利付国債（10年）	410,000,000	421,004,400	
第268回利付国債（10年）	1,500,000,000	1,552,125,000	
第269回利付国債（10年）	840,000,000	865,032,000	
第270回利付国債（10年）	2,100,000,000	2,168,922,000	
第271回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,442,140,000	
第272回利付国債（10年）	1,500,000,000	1,558,005,000	
第273回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,458,296,000	
第274回利付国債（10年）	900,000,000	940,446,000	
第275回利付国債（10年）	1,200,000,000	1,250,064,000	
第276回利付国債（10年）	800,000,000	838,528,000	
第277回利付国債（10年）	1,300,000,000	1,367,132,000	
第278回利付国債（10年）	800,000,000	846,856,000	
第279回利付国債（10年）	700,000,000	745,857,000	
第280回利付国債（10年）	1,500,000,000	1,599,180,000	
第281回利付国債（10年）	1,000,000,000	1,069,830,000	
第282回利付国債（10年）	1,600,000,000	1,699,200,000	
第283回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,492,358,000	
第284回利付国債（10年）	2,950,000,000	3,142,310,500	
第285回利付国債（10年）	3,400,000,000	3,632,050,000	
第286回利付国債（10年）	1,400,000,000	1,506,400,000	
第287回利付国債（10年）	1,700,000,000	1,837,173,000	
第288回利付国債（10年）	2,500,000,000	2,685,700,000	
第289回利付国債（10年）	1,600,000,000	1,706,384,000	
第290回利付国債（10年）	1,100,000,000	1,169,322,000	
第291回利付国債（10年）	1,300,000,000	1,374,893,000	
第292回利付国債（10年）	1,200,000,000	1,295,100,000	
第293回利付国債（10年）	1,200,000,000	1,303,992,000	

第294回利付国債(10年)	900,000,000	972,909,000	
第295回利付国債(10年)	800,000,000	855,776,000	
第296回利付国債(10年)	2,400,000,000	2,570,040,000	
第297回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,278,804,000	
第298回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,059,560,000	
第299回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,165,835,000	
第300回利付国債(10年)	900,000,000	965,268,000	
第301回利付国債(10年)	1,700,000,000	1,824,967,000	
第302回利付国債(10年)	1,700,000,000	1,813,798,000	
第303回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,280,220,000	
第304回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,484,084,000	
第305回利付国債(10年)	2,900,000,000	3,073,739,000	
第306回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,493,534,000	
第307回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,377,454,000	
第308回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,376,895,000	
第309回利付国債(10年)	800,000,000	835,104,000	
第310回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,345,253,000	
第311回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,140,131,000	
第312回利付国債(10年)	3,200,000,000	3,357,184,000	(注)
第313回利付国債(10年)	1,900,000,000	2,006,495,000	
第314回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,455,300,000	
第315回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,360,762,000	
第316回利付国債(10年)	1,300,000,000	1,349,439,000	
第317回利付国債(10年)	2,000,000,000	2,073,740,000	
第318回利付国債(10年)	2,200,000,000	2,261,512,000	
第319回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,863,234,000	
第320回利付国債(10年)	1,900,000,000	1,949,419,000	
第321回利付国債(10年)	2,800,000,000	2,865,744,000	
第322回利付国債(10年)	2,100,000,000	2,130,702,000	
第323回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,821,996,000	
第324回利付国債(10年)	2,400,000,000	2,406,504,000	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	59,727,500	
第2回利付国債(30年)	100,000,000	113,122,000	
第3回利付国債(30年)	330,000,000	367,860,900	
第4回利付国債(30年)	190,000,000	229,421,200	
第5回利付国債(30年)	180,000,000	197,209,800	
第6回利付国債(30年)	270,000,000	304,114,500	
第7回利付国債(30年)	390,000,000	432,420,300	
第8回利付国債(30年)	270,000,000	276,123,600	
第9回利付国債(30年)	180,000,000	171,612,000	
第10回利付国債(30年)	170,000,000	152,879,300	
第11回利付国債(30年)	210,000,000	210,321,300	
第12回利付国債(30年)	370,000,000	395,951,800	
第13回利付国債(30年)	350,000,000	368,102,000	
第14回利付国債(30年)	350,000,000	392,560,000	

第15回利付国債(30年)	640,000,000	729,350,400	
第16回利付国債(30年)	250,000,000	284,970,000	
第17回利付国債(30年)	430,000,000	482,455,700	
第18回利付国債(30年)	660,000,000	727,953,600	
第19回利付国債(30年)	370,000,000	407,732,600	
第20回利付国債(30年)	140,000,000	159,430,600	
第21回利付国債(30年)	720,000,000	792,604,800	
第22回利付国債(30年)	300,000,000	341,706,000	
第23回利付国債(30年)	400,000,000	455,648,000	
第24回利付国債(30年)	200,000,000	227,840,000	
第25回利付国債(30年)	500,000,000	549,600,000	
第26回利付国債(30年)	700,000,000	782,670,000	
第27回利付国債(30年)	700,000,000	796,103,000	
第28回利付国債(30年)	600,000,000	682,302,000	
第29回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,228,799,000	
第30回利付国債(30年)	1,000,000,000	1,095,550,000	
第31回利付国債(30年)	1,200,000,000	1,288,344,000	
第32回利付国債(30年)	1,100,000,000	1,202,223,000	
第33回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,437,394,000	
第34回利付国債(30年)	1,400,000,000	1,496,978,000	
第35回利付国債(30年)	1,300,000,000	1,330,511,000	
第36回利付国債(30年)	1,500,000,000	1,532,685,000	
第24回利付国債(20年)	160,000,000	170,884,800	
第25回利付国債(20年)	80,000,000	84,732,800	
第26回利付国債(20年)	50,000,000	54,367,000	
第27回利付国債(20年)	410,000,000	449,876,600	
第28回利付国債(20年)	110,000,000	123,346,300	
第29回利付国債(20年)	100,000,000	112,224,000	
第30回利付国債(20年)	200,000,000	221,470,000	
第31回利付国債(20年)	280,000,000	312,872,000	
第32回利付国債(20年)	80,000,000	89,946,400	
第33回利付国債(20年)	430,000,000	492,539,200	
第34回利付国債(20年)	70,000,000	80,380,300	
第35回利付国債(20年)	270,000,000	307,638,000	
第37回利付国債(20年)	410,000,000	468,900,600	
第39回利付国債(20年)	640,000,000	722,272,000	
第40回利付国債(20年)	450,000,000	503,194,500	
第41回利付国債(20年)	620,000,000	664,751,600	
第42回利付国債(20年)	380,000,000	434,169,000	
第43回利付国債(20年)	340,000,000	397,745,600	
第44回利付国債(20年)	370,000,000	424,730,400	
第45回利付国債(20年)	470,000,000	536,119,600	
第46回利付国債(20年)	290,000,000	326,841,600	
第47回利付国債(20年)	470,000,000	530,949,600	
第48回利付国債(20年)	230,000,000	265,440,700	

第49回利付国債(20年)	280,000,000	314,288,800	
第50回利付国債(20年)	590,000,000	652,451,500	
第51回利付国債(20年)	240,000,000	267,328,800	
第52回利付国債(20年)	430,000,000	483,345,800	
第53回利付国債(20年)	350,000,000	393,687,000	
第54回利付国債(20年)	280,000,000	317,385,600	
第55回利付国債(20年)	490,000,000	546,399,000	
第56回利付国債(20年)	410,000,000	457,309,900	
第57回利付国債(20年)	360,000,000	398,268,000	
第58回利付国債(20年)	250,000,000	276,572,500	
第59回利付国債(20年)	440,000,000	478,130,400	
第60回利付国債(20年)	570,000,000	602,632,500	
第61回利付国債(20年)	390,000,000	396,197,100	
第62回利付国債(20年)	250,000,000	248,280,000	
第63回利付国債(20年)	570,000,000	624,480,600	
第64回利付国債(20年)	410,000,000	453,017,200	
第65回利付国債(20年)	370,000,000	408,576,200	
第66回利付国債(20年)	240,000,000	262,435,200	
第67回利付国債(20年)	760,000,000	838,196,400	
第68回利付国債(20年)	230,000,000	261,243,200	
第69回利付国債(20年)	260,000,000	292,461,000	
第70回利付国債(20年)	400,000,000	463,172,000	
第71回利付国債(20年)	400,000,000	454,212,000	
第72回利付国債(20年)	920,000,000	1,033,822,400	
第73回利付国債(20年)	340,000,000	377,879,400	
第74回利付国債(20年)	310,000,000	348,114,500	
第75回利付国債(20年)	360,000,000	403,934,400	
第76回利付国債(20年)	530,000,000	582,273,900	
第77回利付国債(20年)	410,000,000	455,235,300	
第78回利付国債(20年)	200,000,000	219,460,000	
第79回利付国債(20年)	300,000,000	332,751,000	
第80回利付国債(20年)	250,000,000	280,265,000	
第81回利付国債(20年)	720,000,000	797,695,200	
第82回利付国債(20年)	510,000,000	571,184,700	
第83回利付国債(20年)	530,000,000	592,932,200	
第84回利付国債(20年)	600,000,000	663,906,000	
第85回利付国債(20年)	550,000,000	614,559,000	
第86回利付国債(20年)	270,000,000	308,394,000	
第87回利付国債(20年)	500,000,000	564,560,000	
第88回利付国債(20年)	400,000,000	456,172,000	
第89回利付国債(20年)	800,000,000	902,288,000	
第90回利付国債(20年)	900,000,000	1,013,220,000	
第91回利付国債(20年)	600,000,000	683,118,000	
第92回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,222,573,000	
第93回利付国債(20年)	800,000,000	877,320,000	

第94回利付国債(20年)	800,000,000	887,720,000	
第95回利付国債(20年)	500,000,000	567,430,000	
第96回利付国債(20年)	600,000,000	664,686,000	
第97回利付国債(20年)	700,000,000	783,426,000	
第98回利付国債(20年)	600,000,000	663,102,000	
第99回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,214,972,000	
第100回利付国債(20年)	800,000,000	893,352,000	
第101回利付国債(20年)	500,000,000	572,345,000	
第102回利付国債(20年)	400,000,000	457,164,000	
第103回利付国債(20年)	300,000,000	338,739,000	
第104回利付国債(20年)	600,000,000	660,528,000	
第105回利付国債(20年)	900,000,000	988,740,000	
第106回利付国債(20年)	300,000,000	333,963,000	
第107回利付国債(20年)	700,000,000	767,347,000	
第108回利付国債(20年)	700,000,000	747,278,000	
第109回利付国債(20年)	700,000,000	745,367,000	
第110回利付国債(20年)	700,000,000	766,122,000	
第111回利付国債(20年)	900,000,000	996,246,000	
第112回利付国債(20年)	1,200,000,000	1,310,316,000	
第113回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,199,066,000	
第114回利付国債(20年)	800,000,000	870,488,000	
第115回利付国債(20年)	900,000,000	993,060,000	
第116回利付国債(20年)	600,000,000	660,906,000	
第117回利付国債(20年)	1,200,000,000	1,303,308,000	
第118回利付国債(20年)	800,000,000	855,424,000	
第119回利付国債(20年)	200,000,000	207,676,000	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	201,390,000	
第121回利付国債(20年)	800,000,000	841,152,000	
第122回利付国債(20年)	1,300,000,000	1,346,644,000	
第123回利付国債(20年)	600,000,000	648,288,000	
第124回利付国債(20年)	600,000,000	638,832,000	
第125回利付国債(20年)	900,000,000	985,446,000	
第126回利付国債(20年)	800,000,000	850,488,000	
第127回利付国債(20年)	700,000,000	733,082,000	
第128回利付国債(20年)	800,000,000	836,392,000	
第129回利付国債(20年)	800,000,000	823,648,000	
第130回利付国債(20年)	1,100,000,000	1,130,382,000	
第131回利付国債(20年)	500,000,000	505,805,000	
第132回利付国債(20年)	600,000,000	605,706,000	
第133回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,642,224,000	
第134回利付国債(20年)	500,000,000	512,565,000	
第135回利付国債(20年)	300,000,000	302,655,000	
第136回利付国債(20年)	600,000,000	595,134,000	
第137回利付国債(20年)	500,000,000	503,720,000	
第138回利付国債(20年)	600,000,000	584,424,000	

	第139回利付国債(20年)	600,000,000	594,648,000	
	国債証券 小計	251,350,000,000	263,947,154,800	
地方債証券	第3回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,268,000	
	第11回東京都公募公債(20年)	200,000,000	222,826,000	
	第18回東京都公募公債(20年)	200,000,000	219,740,000	
	第20回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,545,000	
	第21回東京都公募公債(20年)	100,000,000	108,855,000	
	第605回東京都公募公債	100,000,000	101,664,000	
	第608回東京都公募公債	100,000,000	102,126,000	
	第609回東京都公募公債	200,000,000	204,074,000	
	第616回東京都公募公債	100,000,000	102,807,000	
	第617回東京都公募公債	100,000,000	102,785,000	
	第619回東京都公募公債	100,000,000	103,429,000	
	第624回東京都公募公債	100,000,000	103,690,000	
	第628回東京都公募公債	100,000,000	104,600,000	
	第637回東京都公募公債	180,000,000	191,581,200	
	第642回東京都公募公債	100,000,000	106,892,000	
	第646回東京都公募公債	100,000,000	108,248,000	
	第647回東京都公募公債	100,000,000	108,155,000	
	第656回東京都公募公債	100,000,000	106,586,000	
	第657回東京都公募公債	100,000,000	108,205,000	
	第659回東京都公募公債	100,000,000	107,353,000	
	第668回東京都公募公債	100,000,000	107,137,000	
	第681回東京都公募公債	100,000,000	106,298,000	
	第682回東京都公募公債	100,000,000	105,723,000	
	第692回東京都公募公債	100,000,000	105,635,000	
	第700回東京都公募公債	100,000,000	102,532,000	
	平成17年度第1回北海道公募公債	100,000,000	103,054,000	
	平成19年度第14回北海道公募公債(10年)	100,000,000	107,086,000	
	平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	107,922,000	
	平成20年度第15回北海道公募公債(5年)	100,000,000	101,444,000	
	平成21年度第6回北海道公募公債	100,000,000	107,183,000	
	平成22年度第1回北海道公募公債	100,000,000	106,243,000	
	平成22年度第8回北海道公募公債	100,000,000	102,071,000	
	平成23年度第4回北海道公募公債	100,000,000	103,698,000	
	第16回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	106,344,000	
	第126回神奈川県公募公債	100,000,000	102,150,000	
	第127回神奈川県公募公債	100,000,000	103,038,000	
	第130回神奈川県公募公債	100,000,000	102,921,000	
	第134回神奈川県公募公債	100,000,000	103,619,000	
	第135回神奈川県公募公債	100,000,000	104,432,000	
	第143回神奈川県公募公債	150,000,000	159,862,500	
	第144回神奈川県公募公債	100,000,000	106,828,000	
	第162回神奈川県公募公債	100,000,000	107,719,000	
	第168回神奈川県公募公債	100,000,000	106,014,000	

第173回神奈川県公募公債	100,000,000	105,407,000	
第174回神奈川県公募公債	100,000,000	104,444,000	
第175回神奈川県公募公債	100,000,000	103,852,000	
第50回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	101,268,000	
第267回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,458,000	
第275回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,663,000	
第285回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,150,000	
第286回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,255,000	
第293回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,244,000	
第298回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,021,000	
第305回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,921,000	
第309回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,848,000	
第324回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,392,000	
第331回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,948,000	
第334回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,386,000	
第335回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,443,000	
第339回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,514,000	
平成17年度第3回京都府公募公債	100,000,000	104,325,000	
平成20年度第6回京都府公募公債	100,000,000	106,740,000	
平成21年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,972,000	
平成21年度第5回京都府公募公債	100,000,000	105,915,000	
平成22年度第4回京都府公募公債	100,000,000	101,048,000	
平成16年度第10回兵庫県公募公債	100,000,000	102,842,000	
平成17年度第3回兵庫県公募公債	100,000,000	102,933,000	
平成18年度第10回兵庫県公募公債	100,000,000	107,242,000	
平成18年度第3回兵庫県公募公債	110,000,000	117,141,200	
平成18年度第8回兵庫県公募公債	100,000,000	107,255,000	
平成21年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	107,349,000	
平成21年度第35回兵庫県公募公債	100,000,000	106,377,000	
平成17年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	105,353,000	
平成19年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	108,249,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	107,891,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	105,947,000	
平成22年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	106,058,000	
平成23年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	105,793,000	
平成23年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	103,823,000	
平成17年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,223,000	
平成18年度第4回愛知県公募公債(10年)	129,000,000	137,345,010	
平成20年度第10回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,712,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	108,060,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	107,584,000	
平成22年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,360,000	
平成22年度第14回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	106,349,000	
平成22年度第5回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,076,000	
平成23年度第4回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,021,000	

平成16年度第1回広島県公募公債	100,000,000	102,762,000	
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	111,704,000	
平成20年度第6回広島県公募公債	100,000,000	106,706,000	
平成15年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	101,681,000	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	107,978,000	
平成19年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	107,895,000	
平成19年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	107,266,000	
平成20年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	108,177,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	200,000,000	214,164,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	107,382,000	
平成22年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	104,385,000	
平成23年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,960,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	100,000,000	112,102,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	200,000,000	210,306,000	
平成20年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	107,784,000	
平成21年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	106,070,000	
平成22年度第2回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	106,557,000	
第8回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	108,324,000	
平成17年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	104,336,000	
平成18年度第6回千葉県公募公債	175,000,000	186,007,500	
平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	106,935,000	
平成21年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	107,089,000	
平成21年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	107,865,000	
平成22年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	104,380,000	
平成22年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	104,546,000	
平成17年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	103,198,000	
平成20年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	106,850,000	
平成18年度第1回岐阜県公募公債	100,000,000	106,487,000	
第11回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,631,000	
第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,531,000	
第16回共同発行市場公募地方債	127,000,000	130,829,050	
第17回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,155,000	
第18回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,895,000	
第19回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,999,000	
第20回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,908,000	
第22回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,892,000	
第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,775,000	
第24回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,360,000	
第26回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,053,000	
第27回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,150,000	
第34回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,099,000	
第35回共同発行市場公募地方債	160,000,000	167,814,400	
第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,647,000	
第41回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,059,000	
第43回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,504,000	

第48回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,592,000	
第53回共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,112,000	
第54回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,163,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,415,000	
第57回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,118,000	
第63回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,808,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,390,000	
第67回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,724,000	
第74回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,373,000	
第75回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,865,000	
第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	214,468,000	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,200,000	
第79回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,858,000	
第80回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,276,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,399,000	
第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,537,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,091,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,514,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,344,000	
第88回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,380,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,781,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,664,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,985,000	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,023,000	
第97回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,756,000	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,048,000	
第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,919,000	
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,240,000	
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,809,000	
第102回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,535,000	
第103回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,215,000	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,724,000	
平成18年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	107,018,000	
平成16年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	102,907,000	
平成17年度第1回大阪市公募公債	100,000,000	102,960,000	
平成18年度第3回大阪市公募公債	200,000,000	214,106,000	
平成21年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	106,309,000	
第1回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	110,331,000	
第12回す号名古屋市公募公債	100,000,000	105,303,000	
第12回せ号名古屋市公募公債	100,000,000	103,731,000	
第12回ゆ号名古屋市公募公債	100,000,000	101,865,000	
第12回し号名古屋市公募公債	100,000,000	103,353,000	
第455回名古屋市公募公債（10年）	186,700,000	198,656,268	
第463回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	109,350,000	
第464回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	107,359,000	

	第2回京都市公募公債(20年)	100,000,000	110,711,000	
	平成19年度第2回京都市公募公債	100,000,000	107,480,000	
	平成21年度第5回京都市公募公債	100,000,000	106,456,000	
	平成22年度第3回京都市公募公債	100,000,000	100,584,000	
	第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	111,767,000	
	平成17年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	104,307,000	
	平成20年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	108,629,000	
	平成20年度第6回横浜市公募公債	100,000,000	106,887,000	
	平成21年度第6回横浜市公募公債	100,000,000	106,014,000	
	平成22年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	105,918,000	
	平成22年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	104,287,000	
	平成22年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	102,481,000	
	平成23年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	104,120,000	
	平成18年度第4回札幌市公募公債	100,000,000	106,353,000	
	平成23年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,634,000	
	第79回川崎市公募公債	100,000,000	107,906,000	
	平成19年度第3回福岡市公募公債	100,000,000	108,020,000	
	平成19年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	106,359,000	
	平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	107,073,000	
	平成17年度第1回広島市公募公債	100,000,000	104,241,000	
	地方債証券 小計	21,017,700,000	22,209,579,128	
特殊債券	第8回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,193,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	210,000,000	233,291,100	
	第16回政府保証日本政策投資銀行債券	200,000,000	214,046,000	
	第16回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,550,000	
	第19回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,903,000	
	第21回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,056,000	
	第24回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,207,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,618,000	
	第41回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,897,000	
	第47回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,990,000	
	第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,386,000	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,243,000	
	第3回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,475,000	
	第6回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,507,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	170,175,000	
	第14回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	157,000,000	167,192,440	
	第16回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	108,094,240	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,582,000	
	第21回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,704,000	
	第21回道路債券	100,000,000	112,473,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,094,000	

第25回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	133,675,000	
第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,286,000	
第26回道路債券	100,000,000	101,783,000	
第27回道路債券	100,000,000	113,691,000	
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,008,000	
第30回道路債券	100,000,000	102,256,000	
第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,196,000	
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,608,000	
第33回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,791,000	
第33回道路債券	100,000,000	114,582,000	
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,891,000	
第35回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,823,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,643,000	
第38回道路債券	100,000,000	111,873,000	
第38回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,243,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,726,000	
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	216,294,000	
第41回道路債券	100,000,000	103,174,000	
第42回道路債券	100,000,000	111,199,000	
第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,474,000	
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	214,892,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,969,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,382,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,633,000	
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,518,000	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,527,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,550,000	
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,058,000	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,112,000	
第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,874,000	
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	215,694,000	
第59回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,257,000	
第61回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,306,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,953,000	

第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,832,000	
第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	214,932,000	
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,493,000	
第71回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,586,000	
第73回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,944,000	
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,705,000	
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,719,000	
第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,746,000	
第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,045,000	
第86回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,795,000	
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,745,000	
第91回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,019,000	
第93回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,427,000	
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,019,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,714,000	
第100回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,410,000	
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,655,000	
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,391,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,202,000	
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,584,000	
第111回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,967,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,247,000	
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,462,000	
第328回政府保証道路債券	100,000,000	102,279,000	

第329回政府保証道路債券	150,000,000	153,835,500	
第330回政府保証道路債券	100,000,000	103,052,000	
第333回政府保証道路債券	100,000,000	103,047,000	
第334回政府保証道路債券	100,000,000	102,953,000	
第335回政府保証道路債券	100,000,000	102,836,000	
第336回政府保証道路債券	131,000,000	134,873,670	
第343回政府保証道路債券	100,000,000	103,208,000	
第346回政府保証道路債券	115,000,000	119,213,600	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	108,030,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,609,000	
第2回政府保証公営企業債券(15年)	100,000,000	111,841,000	
第2回政府保証地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	214,972,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,046,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	110,051,000	
第3回政府保証地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	212,592,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,090,000	
第3回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,551,000	
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,685,000	
第4回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,222,000	
第4回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	107,036,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,029,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	111,210,000	
第6回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,437,000	
第7回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	107,965,000	
第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,023,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,693,000	
第9回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,339,000	
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,681,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,401,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	110,671,000	
第12回公営企業債券	200,000,000	205,318,000	
第12回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,683,000	
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	105,761,000	
第13回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,589,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	103,390,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,041,000	
第15回公営企業債券(20年)	100,000,000	110,872,000	
第17回公営企業債券	200,000,000	208,170,000	
第17回公営企業債券(20年)	200,000,000	226,978,000	
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	101,857,000	
第19回公営企業債券	200,000,000	212,564,000	
第20回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,548,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,294,000	
第23回公営企業債券	100,000,000	106,961,000	
第24回公営企業債券	100,000,000	107,087,000	

第24回公営企業債券(20年)	100,000,000	110,822,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,448,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,553,000	
第833回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,585,000	
第838回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,156,000	
第839回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,272,000	
第841回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,043,000	
第843回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,741,000	
第847回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,965,000	
第848回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,821,000	
第850回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,256,000	
第851回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,094,000	
第852回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,205,000	
第855回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,446,000	
第857回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,616,000	
第859回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,500,000	
第860回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,931,000	
第862回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,859,000	
第864回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,473,000	
第871回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,913,000	
第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,767,000	
第876回政府保証公営企業債券	200,000,000	215,806,000	
第877回政府保証公営企業債券	200,000,000	216,006,000	
第879回政府保証公営企業債券	200,000,000	214,438,000	
第884回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,103,000	
第885回政府保証公営企業債券	100,000,000	107,817,000	
第886回政府保証公営企業債券	100,000,000	108,455,000	
第5回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,911,000	
第9回首都高速道路債券	100,000,000	102,374,000	
第187回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	203,352,000	
第189回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	101,623,000	
第190回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	101,853,000	
第197回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	103,391,000	
第6回阪神高速道路債券	100,000,000	103,075,000	
第144回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	103,369,000	
第148回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	103,468,000	
第1回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,363,000	
第4回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,948,000	
第7回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,885,000	
第178回政府保証中小企業債券	100,000,000	101,669,000	
第184回政府保証中小企業債券	100,000,000	102,836,000	
第187回政府保証中小企業債券	100,000,000	104,333,000	
第191回政府保証中小企業債券	200,000,000	214,408,000	
第12回国際協力銀行債券	100,000,000	102,050,000	
第15回国際協力銀行債券	100,000,000	102,638,000	

第16回国際協力銀行債券	100,000,000	110,413,000	
第19回国際協力銀行債券	100,000,000	107,738,000	
第21回国際協力銀行債券	100,000,000	104,031,000	
第25回国際協力銀行債券	100,000,000	106,248,000	
第27回国際協力銀行債券	100,000,000	106,590,000	
第29回国際協力銀行債券	100,000,000	107,195,000	
第16回都市再生債券	100,000,000	106,782,000	
第24回都市再生債券	100,000,000	108,459,000	
第34回都市再生債券	100,000,000	105,334,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	104,225,000	
第49回都市再生債券	100,000,000	105,372,000	
第2回本州四国連絡橋債券	100,000,000	101,981,000	
第27回政府保証本州四国連絡橋債券	100,000,000	103,681,000	
第323回東京交通債券	100,000,000	112,719,000	
第324回東京交通債券	100,000,000	113,443,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	106,658,000	
第174回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,359,000	
第177回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,282,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	31,898,000	33,185,403	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	283,455,000	301,746,351	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	79,700,000	84,734,649	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	41,345,000	44,288,350	
第2回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	213,258,000	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	98,532,000	103,937,465	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	34,256,000	35,984,557	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	35,683,000	38,285,361	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	113,018,000	
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,489,000	25,579,740	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	144,976,000	155,509,956	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	37,015,000	39,622,336	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	119,408,000	126,144,999	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	37,098,000	39,668,149	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	61,108,000	63,017,013	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	38,236,000	40,807,753	
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,811,000	33,999,665	
第11回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,710,000	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,602,000	38,134,891	
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	61,111,000	64,999,492	
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,980,000	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	193,140,000	203,291,438	
第17回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,306,000	
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,116,000	42,179,165	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	64,600,000	67,572,246	
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	83,556,000	88,793,290	
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	217,334,000	

第23回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,117,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,851,000	76,333,450	
第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券	44,848,000	46,813,239	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,980,000	74,066,585	
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,304,000	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	138,146,000	147,144,830	
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,249,000	51,513,469	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	158,892,000	166,409,180	
第29回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,193,000	
第30回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,131,000	
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	55,853,000	58,135,712	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	173,928,000	180,935,559	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	59,922,000	62,759,905	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,587,000	85,797,705	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,324,000	89,882,861	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	56,191,000	59,054,493	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,464,000	90,768,177	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	56,808,000	59,687,597	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	168,075,000	176,194,703	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,480,000	183,748,729	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	113,206,000	119,257,992	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	57,531,000	61,142,796	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,360,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	54,586,000	58,800,585	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,669,000	93,881,889	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,052,000	95,458,844	
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,655,000	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,461,000	97,203,324	
第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,238,000	55,740,035	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,070,000	98,587,241	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,561,000	98,397,339	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	164,655,000	175,937,160	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,040,000	98,723,750	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	55,781,000	59,190,892	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,030,000	98,623,770	
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,290,000	98,763,690	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,816,000	98,841,390	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,280,000	99,537,868	
第67回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,857,000	
第12回政府保証国民生活債券	100,000,000	101,871,000	
第15回政府保証国民生活債券	100,000,000	103,373,000	
第19回政府保証国民生活債券	125,000,000	132,930,000	
第20回政府保証国民生活債券	100,000,000	102,492,000	
第11回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	106,635,000	
い第705号商工債	100,000,000	101,715,000	

い第707号商工債	200,000,000	203,646,000	
い第710号商工債	200,000,000	202,756,000	
い第713号商工債	100,000,000	101,248,000	
い第714号商工債	100,000,000	101,527,000	
い第715号商工債	100,000,000	101,122,000	
い第716号商工債	100,000,000	101,165,000	
い第717号商工債	100,000,000	101,207,000	
い第726号商工債	100,000,000	100,773,000	
い第733号商工債	100,000,000	101,210,000	
い第704号農林債	100,000,000	101,431,000	
い第708号農林債	100,000,000	101,531,000	
い第717号農林債	100,000,000	101,255,000	
い第718号農林債	100,000,000	101,157,000	
い第720号農林債	100,000,000	101,101,000	
い第721号農林債	100,000,000	100,998,000	
い第724号農林債	100,000,000	100,775,000	
い第725号農林債	100,000,000	100,491,000	
い第728号農林債	100,000,000	101,012,000	
い第729号農林債	100,000,000	101,698,000	
い第730号農林債	100,000,000	101,561,000	
い第732号農林債	100,000,000	101,255,000	
第228回信金中金債（5年）	100,000,000	101,465,000	
第230回信金中金債（5年）	200,000,000	202,810,000	
第231回信金中金債（5年）	100,000,000	101,636,000	
第234回信金中金債（5年）	100,000,000	101,581,000	
第237回信金中金債（5年）	100,000,000	101,532,000	
第238回信金中金債（5年）	100,000,000	101,288,000	
第243回信金中金債（5年）	100,000,000	101,195,000	
第246回信金中金債（5年）	100,000,000	101,182,000	
第248回信金中金債（5年）	100,000,000	100,973,000	
第251回信金中金債（5年）	100,000,000	100,430,000	
第259回信金中金債（5年）	100,000,000	101,191,000	
第265回信金中金債（5年）	100,000,000	101,012,000	
第5回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	107,122,000	
第5回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	108,190,000	
第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	107,538,000	
第8回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	107,057,000	
第10回政府保証中日本高速道路債券	172,000,000	183,441,440	
第14回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,896,000	
第20回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	106,037,000	
第3回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	106,673,000	
第20回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	106,376,000	
特殊債券 小計	32,293,999,000	34,049,589,018	
社債券	第1回フランス電力円貨社債	100,000,000	100,495,000
	第1回ジーディーエフ・スエズ円貨社債	100,000,000	99,971,000

第1回スウェーデン輸出信用銀行円貨債券	100,000,000	101,258,000	
第9回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	200,000,000	203,824,000	
第14回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	100,000,000	103,653,000	
第17回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	100,049,000	
第22回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	101,976,000	
第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債	100,000,000	101,550,000	
第4回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	101,806,000	
第6回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	101,657,000	
第8回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	100,000,000	102,744,000	
第2回ウエストパック・バンキング・コーポ・円貨社債	100,000,000	101,914,000	
第5回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	200,000,000	203,336,000	
第7回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	101,606,000	
第1回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	101,872,000	
第5回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	101,648,000	
第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	101,389,000	
第3回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債	100,000,000	102,187,000	
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債	100,000,000	101,755,000	
第1回エイチエスピーシー・バンク・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	101,627,000	
第3回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	106,811,000	
第8回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,796,000	
第5回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	101,485,000	
第5回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	102,142,000	
第23回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,281,000	
第43回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	104,536,000	
第37回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	108,377,000	
第7回エーザイ株式会社無担保社債	100,000,000	104,168,000	
第2回第一三共株式会社無担保社債	100,000,000	107,940,000	
第26回新日本石油株式会社無担保社債	100,000,000	106,944,000	
第52回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	102,094,000	
第56回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	101,916,000	
第62回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	101,554,000	
第67回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	102,668,000	
第13回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,188,000	
第15回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	104,175,000	

第50回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	101,137,000	
第42回三菱電機株式会社無担保社債	100,000,000	101,590,000	
第7回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,415,000	
第17回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	102,858,000	
第25回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	101,609,000	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	105,018,000	
第3回松下電工株式会社無担保社債	100,000,000	103,191,000	
第22回三菱重工株式会社無担保社債	100,000,000	107,990,000	
第9回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	101,501,000	
第10回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	108,218,000	
第5回アイシン精機株式会社無担保社債	100,000,000	102,584,000	
第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,825,000	
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,940,000	
第58回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	106,751,000	
第39回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,844,000	
第46回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,258,000	
第53回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,683,000	
第70回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	108,070,000	
第75回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,689,000	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,797,000	
第16回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	300,000,000	304,899,000	
第17回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,269,000	
第18回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,160,000	
第19回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	202,078,000	
第21回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,833,000	
第23回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,482,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	102,333,000	
第28回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	104,103,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	104,423,000	
第35回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,163,000	
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	224,730,000	
第83回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	213,042,000	
第87回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	107,226,000	
第106回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	303,813,000	
第107回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	107,009,000	
第109回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,179,000	
第116回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,809,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,163,000	
第23回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	208,828,000	

第24回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	200,000,000	208,126,000	
第45回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	202,680,000	
第47回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,257,000	
第48回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,136,000	
第50回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,789,000	
第51回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,391,000	
第52回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,102,000	
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	106,702,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	105,656,000	
第37回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,047,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	106,620,000	
第25回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	102,049,000	
第22回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,320,000	
第23回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,291,000	
第2回大和証券キャピタル・マーケット株式会社無担保社債	100,000,000	99,528,000	
第5回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	100,000,000	100,937,000	
第40回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,321,000	
第48回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	113,471,000	
第70回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	102,132,000	
第79回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	106,501,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	111,357,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	228,964,000	
第13回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	114,413,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	115,143,000	
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,365,000	
第33回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,845,000	
第37回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,802,000	
第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,071,000	
第50回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,561,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,762,000	
第7回西日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	111,917,000	
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	111,888,000	
第5回東海旅客鉄道株式会社普通社債	100,000,000	114,312,000	
第10回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,375,000	
第20回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	214,186,000	
第25回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,479,000	
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,805,000	
第3回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	106,453,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	110,724,000	
第27回日本郵船株式会社無担保社債	100,000,000	105,867,000	
第48回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,728,000	
第50回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	104,000,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	213,402,000	
第52回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	106,543,000	

第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	106,148,000	
第59回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	107,684,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	108,729,000	
第16回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	101,279,000	
第457回東京電力株式会社社債	100,000,000	85,852,000	
第511回東京電力株式会社社債	100,000,000	96,644,000	
第513回東京電力株式会社社債	100,000,000	96,735,000	
第514回東京電力株式会社社債	100,000,000	95,540,000	
第515回東京電力株式会社社債	100,000,000	94,670,000	
第516回東京電力株式会社社債	100,000,000	93,946,000	
第518回東京電力株式会社社債	100,000,000	92,876,000	
第519回東京電力株式会社社債	100,000,000	92,383,000	
第521回東京電力株式会社社債	100,000,000	92,240,000	
第522回東京電力株式会社社債	100,000,000	92,182,000	
第539回東京電力株式会社社債	100,000,000	85,726,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	85,114,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	86,515,000	
第405回中部電力株式会社社債	100,000,000	109,383,000	
第406回中部電力株式会社社債	200,000,000	217,724,000	
第426回中部電力株式会社社債	100,000,000	112,064,000	
第466回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,251,000	
第478回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,241,000	
第480回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,174,000	
第484回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,854,000	
第433回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,531,000	
第435回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,167,000	
第443回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,313,000	
第448回関西電力株式会社社債	100,000,000	106,582,000	
第454回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,483,000	
第463回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,686,000	
第298回中国電力株式会社社債	100,000,000	109,557,000	
第306回中国電力株式会社社債	100,000,000	112,275,000	
第311回中国電力株式会社社債	100,000,000	111,293,000	
第350回中国電力株式会社社債	100,000,000	102,257,000	
第354回中国電力株式会社社債	100,000,000	106,682,000	
第277回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,262,000	
第283回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,003,000	
第288回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,181,000	
第383回東北電力株式会社社債	100,000,000	110,863,000	
第414回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,648,000	
第416回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,945,000	
第420回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,106,000	
第435回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,748,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	96,491,000	

第257回四国電力株式会社社債	100,000,000	102,190,000	
第371回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,589,000	
第376回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,249,000	
第384回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,729,000	
第387回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,896,000	
第391回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,123,000	
第399回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,693,000	
第405回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,732,000	
第257回北海道電力株式会社社債	100,000,000	111,617,000	
第282回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,200,000	
第284回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,142,000	
第285回北海道電力株式会社社債	100,000,000	104,128,000	
第9回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	102,110,000	
第14回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,064,000	
第16回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,313,000	
第17回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,567,000	
第19回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,994,000	
第21回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,997,000	
第29回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,332,000	
第30回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,993,000	
第30回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,812,000	
第7回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	113,747,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	113,421,000	
第25回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,527,000	
第21回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	106,497,000	
第24回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,154,000	
社債券 小計	20,500,000,000	21,234,763,000	
合計	325,161,699,000	341,441,085,946	

(注) 代用有価証券で額面100,000,000円 担保差入

なお、代用有価証券の担保差入券面額には、約定未受渡券面額を含んでおります。

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（デリバティブ取引関係）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24年10月31日現在)

資産総額	338,834,973 円
負債総額	1,568,295 円
純資産総額（ - ）	337,266,678 円
発行済口数	305,548,246 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1038 円
1万口当たり純資産額	11,038 円

(参考情報)

日本債券マザーファンド

資産総額	343,979,781,780 円
負債総額	3,685,684,285 円
純資産総額（ - ）	340,294,097,495 円
発行済口数	278,683,068,196 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2211 円
1万口当たり純資産額	12,211 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り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合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り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載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付、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り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（平成24年10月31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、会長1名及び副社長、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）]

運用部門において各運用部から独立した運用企画部は、ファンド品質の維持・向上の観点から、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）にパフォーマンス等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）及びコンプライアンス会議（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24年12月21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24年10月31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	300	3,662,013
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	623
単位型公社債投資信託	0	0
合計	305	3,662,636

3【委託会社等の経理状況】

- (イ) 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（旧社名 住信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。
- なお、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (ロ) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24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。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)		当事業年度 (平成24年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金	2	6,223,302		4,826,115
前払費用		34,720		30,184
未収委託者報酬		953,916		944,716
未収運用受託報酬		42,516		26,998
未収入金		-		75,514
一年以内返還予定保証金		-		187,128
繰延税金資産		50,152		69,857
その他		34		31,325
流動資産合計		7,304,641		6,191,840
固定資産				
有形固定資産				
建物		38,802		3,525
器具備品		27,919		14,970
建設仮勘定		-		62,454
有形固定資産合計	1	66,721	1	80,949
無形固定資産				
ソフトウェア		91,774		60,130
ソフトウェア仮勘定		-		12,151
その他無形固定資産		1,415		928
無形固定資産合計		93,189		73,209
投資その他の資産				
投資有価証券		239,090		43,194
敷金・保証金		228,451		-
長期前払費用		409		357
繰延税金資産		80,017		-
その他の投資		195		165
投資その他の資産合計		548,164		43,717
固定資産合計		708,076		197,876
資産合計		8,012,717		6,389,717

(単位：千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	18,485	22,794
未払金	495,343	644,600
未払収益分配金	130	30
未払手数料	2 452,781	438,778
その他未払金	42,432	205,791
未払費用	2 135,706	112,121
未払法人税等	220,711	20,166
未払消費税等	25,316	5,683
賞与引当金	79,835	71,044
移転関連費用引当金	-	41,450
流動負債合計	975,399	917,862
固定負債		
退職給付引当金	171,115	199,976
繰延税金負債	-	308,964
固定負債合計	171,115	508,940
負債合計	1,146,514	1,426,803
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
利益剰余金		
利益準備金	53,500	56,500
その他利益剰余金		
別途積立金	5,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	1,421,205	2,516,273
利益剰余金合計	6,574,705	4,672,773
株主資本合計	6,874,705	4,972,773
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	8,501	9,859
評価・換算差額等合計	8,501	9,859
純資産合計	6,866,203	4,962,913
負債・純資産合計	8,012,717	6,389,717

(2)【損益計算書】

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	8,619,288	7,821,113
運用受託報酬	126,038	98,179
営業収益合計	8,745,326	7,919,292
営業費用		
支払手数料	1 4,301,606	3,715,816
広告宣伝費	67,247	61,165
公告費	2,744	2,451
調査費	898,998	1,023,870
調査費	87,937	86,225
委託調査費	809,173	936,024
図書費	1,887	1,620
営業雑経費	640,623	610,455
通信費	11,303	10,764
印刷費	152,354	121,287
協会費	10,102	10,136
諸会費	594	803
情報機器関連費	433,365	436,328
その他営業雑経費	32,903	31,135
営業費用合計	5,911,221	5,413,759
一般管理費		
給料	1,315,974	1,276,685
役員報酬	38,295	35,160
給料・手当	1,062,048	1,048,061
賞与	215,631	193,464
退職給付費用	63,772	66,790
福利費	156,648	152,149
交際費	1,350	1,012
旅費交通費	31,880	25,687
租税公課	17,981	16,148
不動産賃借料	238,033	238,033
寄付金	7,972	2,832
減価償却費	57,385	55,540
敷金償却	2,804	2,804
諸経費	91,394	81,858

	1,985,197	1,919,541
一般管理費合計		
営業利益	848,907	585,991
(単位：千円)		
	前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	1,280	2,795
受取利息	1 14,783	13,889
投資有価証券売却益	756	149
その他	1,877	2,125
営業外収益合計	18,697	18,961
営業外費用		
支払手数料	-	800
投資有価証券売却損	480	12
その他	242	74
営業外費用合計	722	887
経常利益	866,883	604,065
特別利益		
投資有価証券売却益	-	1,277,804
特別利益合計	-	1,277,804
特別損失		
資産除去債務会計基準の適用に伴う 影響額	6,776	-
統合関連損失	-	123,726
特別損失合計	6,776	123,726
税引前当期純利益	860,106	1,758,142
法人税、住民税及び事業税	377,534	241,760
法人税等調整額	29,183	368,903
法人税等合計	348,350	610,664
当期純利益	511,755	1,147,477

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24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
当期変動額合計	-	-
当期末残高	-	-
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	50,500	53,500
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	53,500	56,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	5,100,000	5,100,000
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	5,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	942,449	1,421,205
当期変動額		
剰余金の配当	33,000	33,000
当期純利益	511,755	1,147,477
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
当期変動額合計	478,755	1,095,067
当期末残高	1,421,205	2,516,273
利益剰余金合計		
当期首残高	6,092,949	6,574,705
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	511,755	1,147,477
その他資本剰余金へ振替	-	3,019,410

当期変動額合計	481,755	1,901,932
当期末残高	6,574,705	4,672,773

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24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	6,392,949	6,874,705
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	511,755	1,147,477
その他資本剰余金へ振替	-	3,019,410
当期変動額合計	481,755	1,901,932
当期末残高	6,874,705	4,972,773
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	6,299	8,501
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	2,202	1,357
当期変動額合計	2,202	1,357
当期末残高	8,501	9,859
評価・換算差額等合計		
当期首残高	6,299	8,501
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	2,202	1,357
当期変動額合計	2,202	1,357
当期末残高	8,501	9,859
純資産合計		
当期首残高	6,386,650	6,866,203
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	511,755	1,147,477
その他資本剰余金へ振替	-	3,019,410

株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	2,202	1,357
当期変動額合計	479,553	1,903,289
当期末残高	6,866,203	4,962,913

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。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

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。

ただし、平成19年3月31日以前に取得したものについては、償却可能限度額まで償却が終了した翌年から5年間で均等償却する方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、原則として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)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2)退職給付引当金

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。

(3)移転関連費用引当金

本店事務所の移転に伴い発生する損失に備えるため、合理的な見積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。

会計上の見積りの変更

1. 耐用年数の変更

当社が保有する建物附属設備は、従来、耐用年数を8～18年として減価償却を行ってまいりましたが、当事業年度において、平成24年5月に本店事務所を移転することを決定したため、当該建物附属設備の耐用年数を使用見込期間までに見直し、将来にわたって変更しております。また、当社が保有するソフトウェアの一部は、従来、利用可能期間を5年として償却を行ってまいりましたが、平成24年4月1日の中央三井アセットマネジメント株式会社との合併に伴い、翌事業年度以降の利用見込がなくなったことから、利用可能期間を当事業年度末までとしております。

この変更により、従来の方法に比べて、当事業年度の特別損失が33,532千円増加し、税引前当期純利益が同額減少しております。

2. 資産除去債務の見積りの変更

当社は賃借した本店事務所の原状回復義務に係る資産除去債務について、敷金のうち回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、10年（定期貸室賃貸借契約期間）で償却を行ってまいりましたが、当事業年度において、平成24

年5月に本店事務所を移転することを決定しました。これに伴い、敷金のうち回収が最終的に見込めないと認められる金額を新たに見積り、また、当該敷金の償却期間を使用見込期間までに見直し、将来にわたって変更しております。

この変更により、従来の方法に比べて、当事業年度の特別損失が38,519千円増加し、税引前当期純利益が同額減少しております。

追加情報

会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

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23年3月31日)		当事業年度 (平成24年3月31日)	
建 物	49,316	千円	84,592	千円
器具備品	113,320	"	127,549	"
計	162,636	"	212,142	"

2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 (平成23年3月31日)		当事業年度 (平成24年3月31日)	
預金	3,477,508	千円		
未払手数料	333,570	"		
未払費用	123,687	"		

（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22年4月1日 至 平成23年3月31日)		当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	
支払手数料	3,761,890	千円		
受取利息	6,579	"		

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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	-	-	6,000
---------	-------	---	---	-------

2. 自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

3. 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22年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成22年3月31日	平成22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23年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	5,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

当事業年度（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

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

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

平成24年6月29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。

(1) 配当金の総額 30,000千円

(2) 配当金の原資 利益剰余金

(3) 1株当たり配当額 10,000円

(4) 基準日 平成24年3月31日

(5) 効力発生日 平成24年6月29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、投資有価証券は非上場株式と投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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23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	6,223,302	6,223,302	-
(2)未収委託者報酬	953,916	953,916	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	39,590	39,590	-
(4)未払金	(495,343)	(495,343)	-

(*)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。

(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、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

(注2) 前事業年度（平成23年3月31日）において保有する非上場株式（貸借対照表計上額199,500千円）は、市場価格がな

く、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、

「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成23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	6,223,302	-	-	-
未収委託者報酬	953,916	-	-	-

当事業年度（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	-	-	-
---------	---------	---	---	---

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度(平成23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	3,000	3,075	75
小計	3,000	3,075	75
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	50,925	36,515	14,409
小計	50,925	36,515	14,409
計	53,925	39,590	14,334

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

当事業年度(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
計	58,513	43,194	15,318

2. 売却したその他有価証券

前事業年度(自平成22年4月1日至平成23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
7,639	756	480

当事業年度(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

（デリバティブ取引関係）

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2．退職給付債務及びその他に関する事項（単位：千円）

	前事業年度 （平成23年3月31日）	当事業年度 （平成24年3月31日）
(1) 退職給付債務	171,115	199,976
(2) 退職給付引当金	171,115	199,976

（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23年3月31日）	当事業年度 （平成24年3月31日）
(1) 退職給付費用	63,772	66,790

（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13,307千円、当事業年度で12,680千円です。

4．退職給付債務等の計算基礎

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

（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23年3月31日）	当事業年度 （平成24年3月31日）
繰延税金資産		
未払事業税	17,667 千円	4,898 千円
賞与引当金損金算入限度超過額	32,484 "	27,004 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	69,626 "	71,271 "
有価証券評価差額	5,832 "	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 "
敷金償却超過額		19,348 "
その他	4,558 "	3,334 "

			有価証券届出書（内国投資信託受益証券）	
繰延税金資産 合計	130,169	"	159,817	"
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額			398,925	"
繰延税金負債 合計			398,925	"
繰延税金資産(負債)の純額	130,169	"	239,107	"

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23年3月31日)	当事業年度 (平成24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 "

前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。

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以降に開始する事業年度から、法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.69%から平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.01%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については35.64%となります。

この税率変更により、繰延税金資産は4,925千円減少（繰延税金負債は44,685千円減少）し、その他有価証券評価差額金が773千円、法人税等調整額が40,534千円、それぞれ減少しております。

（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

営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

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22年4月1日 至 平成23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	住友信託銀行(株)	大阪市中央区	342,037	信託業務及び銀行業務	直接30%, 間接70%	営業上の取引 役員の兼任	投信販売 代行手数料	3,761,890	未払手数料	333,570
							投資助言費用 の支払	692,451	未払費用	123,687

(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。

当事業年度（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	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。

(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22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（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	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。

(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23年3月31日）

住友信託銀行株式会社（非上場）

当事業年度（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）

（1株当たり情報）

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
1株当たり純資産額	1,144,367円30銭	1,654,304円66銭
1株当たり当期純利益	85,292円63銭	197,729円22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22年4月1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
当期純利益	511,755千円	1,147,477千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	511,755千円	1,147,477千円
期中平均株式数	6,000株	5,803株

（重要な後発事象）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24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 住信アセットマネジメント株式会社

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」として発足するものです。

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す。

[次へ](#)

<参考> 中央三井アセットマネジメント株式会社の経理状況

(1) 委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」といいます。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52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については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2) 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月11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 木村 充男

印

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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている中央三井アセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第26期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、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、中央三井アセットマネジメント株式会社の平成24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。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社と住信アセットマネジメント株式会社は、平成24年4月1日付で合併し、会社名を三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に変更している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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](#)

(1) 貸借対照表

科目	第25期 平成23年3月31日		第26期 平成24年3月31日	
	金額(千円)		金額(千円)	
(資産の部)				
流動資産				
1. 現金・預金		2,336,337		2,641,578
2. 前払費用		56,149		40,865
3. 未収委託者報酬		967,198		970,835
4. 未収収益		53		58
5. 繰延税金資産		43,658		61,881
6. その他		6,108		4,232
流動資産 計		3,409,505		3,719,451
固定資産				
1. 有形固定資産 1				
(1) 建物		7,448		2,300
(2) 器具備品		23,068		17,749
(3) 建設仮勘定		-		62,454
有形固定資産 計		30,517		82,504
2. 無形固定資産				
(1) ソフトウェア		78,445		47,468
(2) ソフトウェア仮勘定		-		11,446
(3) 電話加入権		1,847		1,847
(4) 電話施設利用権		37		17
無形固定資産 計		80,330		60,779
3. 投資その他の資産				
(1) 投資有価証券		69,135		62,728
(2) 長期貸付金		37,588		34,838
(3) 長期差入保証金		90,141		-
(4) 長期前払費用		2,216		2,023
(5) 会員権		25,000		25,000
(6) 貸倒引当金		37,588		34,838
投資その他の資産 計		186,494		89,751
固定資産 計		297,342		233,034
資産合計		3,706,847		3,952,486

科目	第25期 平成23年3月31日		第26期 平成24年3月31日	
	金額（千円）		金額（千円）	
（負債の部）				
流動負債				
1. 預り金		3,682		15,109
2. 未払金				
(1) 未払手数料	298,465		342,664	
(2) その他未払金	109,112	407,578	150,014	492,679
3. 未払費用		365,151		332,531
4. 未払法人税等		82,266		91,057
5. 賞与引当金		50,180		49,936
6. 役員賞与引当金		-		7,068
7. 資産除去債務		16,345		20,000
8. 移転関連費用引当金		-		29,277
流動負債計		925,203		1,037,661
固定負債				
1. 退職給付引当金		18,693		20,003
2. 繰延税金負債		1,600		901
3. その他		20,700		-
固定負債計		40,993		20,904
負債合計		966,197		1,058,565
（純資産の部）				
株主資本				
1. 資本金		300,000		300,000
2. 資本剰余金				
(1) 資本準備金		50,000		50,000
資本剰余金計		50,000		50,000
3. 利益剰余金				
(1) 利益準備金		25,401		25,401
(2) その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		2,364,106		2,516,892
利益剰余金計		2,389,507		2,542,294
株主資本計		2,739,507		2,892,294
評価・換算差額等				
1. その他有価証券評価差額金		1,142		1,627
評価・換算差額等計		1,142		1,627
純資産合計		2,740,649		2,893,921
負債・純資産合計		3,706,847		3,952,486

(2) 損益計算書

科目	第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)		第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)	
	金額(千円)		金額(千円)	
営業収益				
1. 委託者報酬		9,561,211		10,971,754
営業収益 計		9,561,211		10,971,754
営業費用				
1. 支払手数料		3,634,705		4,769,780
2. 広告宣伝費		83,750		98,743
3. 調査費				
(1) 調査費	232,183		229,530	
(2) 委託調査費	3,098,589	3,330,773	3,343,750	3,573,280
4. 営業雑経費				
(1) 通信費	14,141		12,330	
(2) 印刷費	206,247		187,155	
(3) 協会費	12,069		12,334	
(4) 諸会費	507	232,966	620	212,440
営業費用 計		7,282,194		8,654,245
一般管理費				
1. 給料				
(1) 役員報酬	62,111		118,031	
(2) 給料・手当	633,310		639,241	
(3) 賞与	158,866	854,287	161,905	919,177
2. 福利厚生費		232,228		249,419
3. 交際費		770		990
4. 旅費交通費		21,590		21,102
5. 租税公課		11,095		10,660
6. 不動産賃借料		116,174		117,946
7. 退職給付費用		7,250		7,090
8. 役員退職慰労引当金繰入		8,250		-
9. 賞与引当金繰入		50,180		49,936
10. 役員賞与引当金繰入		-		7,068
11. 減価償却費		53,926		53,782
12. 諸経費		540,822		555,222
一般管理費 計		1,896,577		1,992,396
営業利益		382,439		325,113

科目	第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)		第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)	
	金額(千円)		金額(千円)	
営業外収益				
1. 受取配当金		63,400		-
2. 受取利息		787		712
3. 貸倒引当金戻入		-		2,750
4. 雑収入		4,513		37
営業外収益 計		68,700		3,499
営業外費用				
1. 雑損失		573		1,714
営業外費用 計		573		1,714
経常利益		450,566		326,897
特別利益				
1. 投資有価証券売却益		67,194		153
2. 投資有価証券償還益		584		-
3. 貸倒引当金戻入		2,400		-
特別利益 計		70,179		153
特別損失				
1. 投資有価証券売却損		344		2
2. 固定資産除却損		980		-
3. 資産除去債務会計基準の適用に伴う 影響額		12,305		-
4. 減損損失 2		17,622		-
5. 統合関連費用 1		51,394		53,349
特別損失 計		82,648		53,352
税引前当期純利益		438,098		273,699
法人税、住民税及び事業税	173,405		139,942	
法人税等調整額	12,604	160,801	19,029	120,912
当期純利益		277,297		152,786

(3) 株主資本等変動計算書

		第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)
株主資本		(単位：千円)	(単位：千円)
資本金	当期首残高	300,000	300,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	300,000	300,000
資本剰余金			
資本準備金	当期首残高	50,000	50,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	50,000	50,000
資本剰余金合計	当期首残高	50,000	50,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	50,000	50,000
利益剰余金			
利益準備金	当期首残高	25,401	25,401
	当期変動額	-	-
	当期末残高	25,401	25,401
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金	当期首残高	2,086,808	2,364,106
	当期変動額 当期純利益	277,297	152,786
	当期末残高	2,364,106	2,516,892
利益剰余金合計	当期首残高	2,112,210	2,389,507
	当期変動額	277,297	152,786
	当期末残高	2,389,507	2,542,294
株主資本合計	当期首残高	2,462,210	2,739,507
	当期変動額	277,297	152,786
	当期末残高	2,739,507	2,892,294
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金	当期首残高	103	1,142
	当期変動額 (純額)	1,245	484
	当期末残高	1,142	1,627
評価・換算差額等合計	当期首残高	103	1,142
	当期変動額	1,245	484
	当期末残高	1,142	1,627
純資産合計	当期首残高	2,462,107	2,740,649
	当期変動額	278,542	153,271
	当期末残高	2,740,649	2,893,921

重要な会計方針

項目	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券</p> <p>(1) 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額について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）を採用しております。</p> <p>(2) 時価のないもの 移動平均法に基づく原価法を採用しております。</p>
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>定率法を採用しております。</p> <p>なお、耐用年数は、建物については主として10年～15年、器具備品については主として5年～20年であります。</p>
(1) 有形固定資産	<p>定額法を採用しております。</p> <p>なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（5年）を耐用年数としております。</p>
(2) 無形固定資産	<p>定額法を採用しております。</p> <p>なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（5年）を耐用年数としております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>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。</p> <p>(1) 貸倒引当金</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当期負担分を計上しております。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当期負担分を計上しております。</p> <p>(4) 退職給付引当金 従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による期末退職給付債務相当額を計上しております。</p> <p>(5) 移転関連費用引当金 移転関連費用引当金は、当社グループの東京地区拠点ビルの統廃合に伴うオフィス移転で発生する損失に備えるため、合理的な見積額を計上しております。</p> <p>4. その他財務諸表作成の基本となる重要な事項 消費税等の会計処理は税抜方式を採用しております。</p>

追加情報

第26期
(平成23年4月1日から
平成24年3月31日まで)

1．会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

2．役員賞与引当金

役員賞与制度新設に伴い、「役員賞与に関する会計基準」（企業会計基準第4号 平成17年11月29日）を適用し、当事業年度より役員賞与引当金を計上しております。

注記事項

1. 貸借対照表関係

項目	期別	第25期 (平成23年3月31日)		第26期 (平成24年3月31日)	
1. 有形固定資産の減価 償却累計額	建物	33,765千円		建物	41,266千円
	器具備品	142,605千円		器具備品	149,241千円

2. 損益計算書関係

第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)														
<p>1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。</p> <p>統合関連費用 51,394千円</p> <p>2 当事業年度において、以下の資産グループについて減損損失を計上しました。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>用途</th> <th>場所</th> <th>種類</th> <th>金額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>処分予定資産</td> <td>本社事務所 (東京都港区)</td> <td>建物 器具備品</td> <td>17,622千円</td> </tr> </tbody> </table> <p>(経緯)</p> <p>上記の資産グループについては、当社グループの経営統合に伴い、将来の使用見込みがなく除却される可能性が高い資産について、除去予定時の帳簿価額を減損損失として特別損失に計上しました。</p> <p>(減損損失の金額)</p> <table> <tr> <td>建物</td> <td>15,615千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>2,007千円</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>17,622千円</td> </tr> </table> <p>(グルーピングの方法)</p> <p>当社は、基本的に全ての資産が一体となってキャッシュ・フローを生成しておりますが、将来使用見込みがなく処分される可能性が高いものについては、処分予定資産としてグルーピングしております。</p>	用途	場所	種類	金額	処分予定資産	本社事務所 (東京都港区)	建物 器具備品	17,622千円	建物	15,615千円	器具備品	2,007千円	合計	17,622千円	<p>1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。</p> <p>統合関連費用 12,011千円</p>
用途	場所	種類	金額												
処分予定資産	本社事務所 (東京都港区)	建物 器具備品	17,622千円												
建物	15,615千円														
器具備品	2,007千円														
合計	17,622千円														

3. 株主資本等変動計算書関係

期別	第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)				
項目	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
1. 発行済株式に関する事項	普通株式(株)	5,050	-	-	5,050
2. 自己株式に関する事項	該当事項はありません。				
3. 新株予約権等に関する事項	該当事項はありません。				
4. 配当に関する事項	(1) 配当金支払額 該当事項はありません。 (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの 該当事項はありません。				

期別	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)				
項目	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
1. 発行済株式に関する事項	普通株式(株)	5,050	-	-	5,050
2. 自己株式に関する事項	該当事項はありません。				
3. 新株予約権等に関する事項	該当事項はありません。				
4. 配当に関する事項	配当金支払額 該当事項はありません。				

4．リース取引関係

第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)
当社はリース取引を全く行っていないため、該当事項はありません。	当社はリース取引を全く行っていないため、該当事項はありません。

5．金融商品関係

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

1．金融商品の状況に関する事項

当社は、投資信託委託業務を中心とする投資運用業を行っており、事業を行うために主に現金・預金や未収委託者報酬などの資産を有し、未払金などの負債を負っております。資金運用については短期的な預金等に限定し、資金調達は自己資本で賄っております。

投資運用業に伴う未収委託者報酬・未払金は運用資産額変動の影響を受けますが、定期的なモニタリング及び資金繰計画の作成により管理しております。

投資有価証券については、定期的な時価の把握及び社内での報告体制を敷いております。

2．金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、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金融商品は次表には含めておりません。

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
	千円	千円	千円
(1) 現金・預金	2,336,337	2,336,337	-
(2) 未収委託者報酬	967,198	967,198	-
(3) 投資有価証券			
その他有価証券	59,135	59,135	-
(4) 未払金	(407,578)	(407,578)	-

（*）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・預金

満期のない預金については、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。満期のある預金については、預入期間が短期間（1年以内）であり、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。

(2) 未収委託者報酬及び (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。

(3) 投資有価証券

投資信託受益証券については、証券投資信託委託会社の公表する基準価額等によっております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次のとおりです。

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

1．金融商品の状況に関する事項

当社は、投資信託委託業務を中心とする投資運用業を行っており、事業を行うために主に現金・預金や未収委託者報酬などの資産を有し、未払金などの負債を負っております。資金運用については短期的な預金等に限定し、資金調達は自己資本で賄っております。

投資運用業に伴う未収委託者報酬・未払金は運用資産額変動の影響を受けますが、定期的なモニタリング及び資金繰計画の作成により管理しております。

投資有価証券については、定期的な時価の把握及び社内での報告体制を敷いております。

2．金融商品の時価等に関する事項

平成24年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、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金融商品は次表には含めておりません。

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
	千円	千円	千円
(1) 現金・預金	2,641,578	2,641,578	-
(2) 未収委託者報酬	970,835	970,835	-
(3) 投資有価証券			
その他有価証券	52,728	52,728	-
(4) 未払金	(492,679)	(492,679)	-

（*）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・預金

満期のない預金については、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。満期のある預金については、預入期間が短期間（1年以内）であり、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。

(2) 未収委託者報酬及び (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。

(3) 投資有価証券

投資信託受益証券については、証券投資信託委託会社の公表する基準価額等によっております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次のとおりです。

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

6．有価証券関係

第25期 (平成23年3月31日)				第26期 (平成24年3月31日)			
1．その他有価証券 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの				1．その他有価証券 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額	区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円		千円	千円	千円
その他	58,149	56,200	1,949	その他	52,728	50,200	2,528
計	58,149	56,200	1,949	計	52,728	50,200	2,528
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの				貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額	区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円		千円	千円	千円
その他	986	1,000	13	その他	986	1,000	13
計	986	1,000	13	計	986	1,000	13
2．当事業年度中に売却したその他有価証券				2．当事業年度中に売却したその他有価証券			
区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額	区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
	千円	千円	千円		千円	千円	千円
その他	128,650	67,194	344	その他	7,151	153	2
計	128,650	67,194	344	計	7,151	153	2
3．時価評価されていない有価証券				3．時価評価されていない有価証券			
内容	貸借対照表計上額（千円）			内容	貸借対照表計上額（千円）		
その他有価証券 非上場株式	10,000			その他有価証券 非上場株式	10,000		
4．その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額 該当事項はありません。				4．その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額 該当事項はありません。			

7. デリバティブ関係

第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)
当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、 該当事項はありません。	当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、 該当事項はありません。

8. 退職給付関係

第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)																
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成23年3月31日現在）</p> <table> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>18,693千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>18,693千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 （平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）</p> <table> <tr> <td>勤務費用</td> <td>7,250千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>7,250千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	18,693千円	退職給付引当金	18,693千円	勤務費用	7,250千円	退職給付費用	7,250千円	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成24年3月31日現在）</p> <table> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>20,003千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>20,003千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 （平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）</p> <table> <tr> <td>勤務費用</td> <td>7,090千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>7,090千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	20,003千円	退職給付引当金	20,003千円	勤務費用	7,090千円	退職給付費用	7,090千円
退職給付債務	18,693千円																
退職給付引当金	18,693千円																
勤務費用	7,250千円																
退職給付費用	7,250千円																
退職給付債務	20,003千円																
退職給付引当金	20,003千円																
勤務費用	7,090千円																
退職給付費用	7,090千円																

9. 税効果会計関係

第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)																																																																																										
<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>貸倒引当金繰入超過額</td><td style="text-align: right;">15,294千円</td></tr> <tr><td>賞与引当金繰入超過額</td><td style="text-align: right;">20,418千円</td></tr> <tr><td>資産除去債務</td><td style="text-align: right;">6,650千円</td></tr> <tr><td>移転による除却予定資産減損</td><td style="text-align: right;">7,170千円</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">6,824千円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">19,740千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td style="text-align: right;">76,099千円</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">32,440千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;">43,658千円</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;">793千円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">806千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;">1,600千円</td></tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>法定実効税率</td><td style="text-align: right;">40.7%</td></tr> <tr><td>(調整)</td><td></td></tr> <tr><td>受取配当金等永久に益金に 算入されない項目</td><td style="text-align: right;">2.9%</td></tr> <tr><td>評価性引当額の減少</td><td style="text-align: right;">1.6%</td></tr> <tr><td>住民税均等割</td><td style="text-align: right;">0.1%</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">0.4%</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td style="text-align: right;">36.7%</td></tr> </table>	貸倒引当金繰入超過額	15,294千円	賞与引当金繰入超過額	20,418千円	資産除去債務	6,650千円	移転による除却予定資産減損	7,170千円	未払事業税	6,824千円	その他	19,740千円	<hr/>		繰延税金資産小計	76,099千円	評価性引当額	32,440千円	<hr/>		繰延税金資産合計	43,658千円	その他有価証券評価差額金	793千円	その他	806千円	<hr/>		繰延税金負債合計	1,600千円	法定実効税率	40.7%	(調整)		受取配当金等永久に益金に 算入されない項目	2.9%	評価性引当額の減少	1.6%	住民税均等割	0.1%	その他	0.4%	<hr/>		税効果会計適用後の法人税等の負担率	36.7%	<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>貸倒引当金繰入超過額</td><td style="text-align: right;">12,629千円</td></tr> <tr><td>賞与引当金繰入超過額</td><td style="text-align: right;">18,980千円</td></tr> <tr><td>資産除去債務</td><td style="text-align: right;">7,602千円</td></tr> <tr><td>移転による除却予定資産減損</td><td style="text-align: right;">6,698千円</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">7,012千円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">28,721千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td style="text-align: right;">81,645千円</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">19,763千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;">61,881千円</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;">901千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;">901千円</td></tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>法定実効税率</td><td style="text-align: right;">40.7%</td></tr> <tr><td>(調整)</td><td></td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入 されない項目</td><td style="text-align: right;">5.4%</td></tr> <tr><td>評価性引当額の減少</td><td style="text-align: right;">3.7%</td></tr> <tr><td>住民税均等割</td><td style="text-align: right;">0.2%</td></tr> <tr><td>税率変更による期末繰延 税金資産の減額修正</td><td style="text-align: right;">1.6%</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td style="text-align: right;">44.2%</td></tr> </table>	貸倒引当金繰入超過額	12,629千円	賞与引当金繰入超過額	18,980千円	資産除去債務	7,602千円	移転による除却予定資産減損	6,698千円	未払事業税	7,012千円	その他	28,721千円	<hr/>		繰延税金資産小計	81,645千円	評価性引当額	19,763千円	<hr/>		繰延税金資産合計	61,881千円	その他有価証券評価差額金	901千円	<hr/>		繰延税金負債合計	901千円	法定実効税率	40.7%	(調整)		交際費等永久に損金に算入 されない項目	5.4%	評価性引当額の減少	3.7%	住民税均等割	0.2%	税率変更による期末繰延 税金資産の減額修正	1.6%	<hr/>		税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.2%
貸倒引当金繰入超過額	15,294千円																																																																																										
賞与引当金繰入超過額	20,418千円																																																																																										
資産除去債務	6,650千円																																																																																										
移転による除却予定資産減損	7,170千円																																																																																										
未払事業税	6,824千円																																																																																										
その他	19,740千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金資産小計	76,099千円																																																																																										
評価性引当額	32,440千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金資産合計	43,658千円																																																																																										
その他有価証券評価差額金	793千円																																																																																										
その他	806千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金負債合計	1,600千円																																																																																										
法定実効税率	40.7%																																																																																										
(調整)																																																																																											
受取配当金等永久に益金に 算入されない項目	2.9%																																																																																										
評価性引当額の減少	1.6%																																																																																										
住民税均等割	0.1%																																																																																										
その他	0.4%																																																																																										
<hr/>																																																																																											
税効果会計適用後の法人税等の負担率	36.7%																																																																																										
貸倒引当金繰入超過額	12,629千円																																																																																										
賞与引当金繰入超過額	18,980千円																																																																																										
資産除去債務	7,602千円																																																																																										
移転による除却予定資産減損	6,698千円																																																																																										
未払事業税	7,012千円																																																																																										
その他	28,721千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金資産小計	81,645千円																																																																																										
評価性引当額	19,763千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金資産合計	61,881千円																																																																																										
その他有価証券評価差額金	901千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金負債合計	901千円																																																																																										
法定実効税率	40.7%																																																																																										
(調整)																																																																																											
交際費等永久に損金に算入 されない項目	5.4%																																																																																										
評価性引当額の減少	3.7%																																																																																										
住民税均等割	0.2%																																																																																										
税率変更による期末繰延 税金資産の減額修正	1.6%																																																																																										
<hr/>																																																																																											
税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.2%																																																																																										

第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)
	<p>3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の修正</p> <p>「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以降開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については35.6%となります。</p> <p>この税率変更により、繰延税金資産は4,363千円減少（繰延税金負債は127千円減少）し、その他有価証券評価差額金が127千円、法人税等調整額が4,363千円、それぞれ増加しております。</p>

10. 資産除去債務関係

第25期
平成23年3月31日

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

事業用に賃借している事務所等の不動産賃貸借契約に基づく原状回復義務であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

物件の耐用年数等を参考に使用期間を見積り、対応する期間の割引率を使用して、金額を算定しております。

3. 当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

期首残高	5,776千円
時の経過による調整額	79千円
見積りの変更による増加額	10,489千円
期末残高	<u>16,345千円</u>

当社グループの経営統合に伴い、当事業年度末において見積りの見直しを行ったもの

第26期
平成24年3月31日

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

事業用に賃借している事務所等の不動産賃貸借契約に基づく原状回復義務であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

物件の耐用年数等を参考に使用期間を見積り、対応する期間の割引率を使用して、金額を算定しております。

3. 当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

期首残高	16,345千円
時の経過による調整額	80千円
見積りの変更による増加額	3,574千円
期末残高	<u>20,000千円</u>

当社グループの経営統合に伴い、平成24年5月にオフィス移転することを決定したことから、当事業年度末において見積りの見直しを行ったもの

11. セグメント情報等

第25期
(平成22年4月1日から
平成23年3月31日まで)

(セグメント情報)

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

当社は、投資信託委託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

投資信託委託業の区分の外部顧客へ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

本邦の外部顧客へ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
中央三井高金利ソブリンオープン	1,336,886千円
中央三井VAバランスファンド（株25/100）	1,150,446千円

(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)

当事業年度において、17,622千円の減損損失を計上しておりますが、当社は投資信託委託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。

第26期
(平成23年4月1日から
平成24年3月31日まで)

(セグメント情報)

第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

当社は、投資信託委託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

投資信託委託業の区分の外部顧客へ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

本邦の外部顧客へ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）	2,529,799千円

(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。

12. 関連当事者との取引関係

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	中央三井トラスト・ホールディングス株式会社	東京都港区	261,608	グループの業務執行管理	(被所有)直接100%	持株会社経営指導	統合関連費用の支払 統合関連費用	51,394	未払金	15,680

(2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	中央三井信託銀行株式会社 (注)親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	399,697	銀行業務・信託業務	該当なし	投資信託販売	投資信託に係る営業費用の支払 (注1)支払代 hands 手数料	3,100,880	未払手数料	243,621
同一の親会社を持つ会社	中央三井アセット信託銀行株式会社 (注)親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	11,000	信託業務	該当なし	投資信託委託投資顧問	支払投資顧問料 (注1)調査費(支払投資顧問料) 建物の賃借 (注2)	2,425,966 -	未払費用 前払費用 長期差入保証金	201,863 11,088 72,681

上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高（長期差入保証金を除く）には消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

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

中央三井トラスト・ホールディングス株式会社（東京、大阪、名古屋証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

1．関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高
親会社	三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都港区	261,608	グループの業務執行管理	(被所有)直接100%	持株会社経営指導	統合関連費用の支払(注2) 統合関連費用	12,011	-	-

(2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	中央三井信託銀行株式会社 (注)親会社三井住友トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	399,697	銀行業務・信託業務	該当なし	投資信託販売	投資信託に係る営業費用の支払(注1) 支払代行手数料	2,678,471	未払手数料	194,559
同一の親会社を持つ会社	中央三井アセット信託銀行株式会社 (注)親会社三井住友トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	11,000	信託業務	該当なし	投資信託委託 投資顧問	支払投資顧問料(注1) 調査費(支払投資顧問料)	1,850,089	未払費用 前払費用	157,857 176

上記の金額のうち、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。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

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

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

13. 1株当たり情報

項目	第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)
1. 1株当たり純資産額	542,702円95銭	573,053円68銭
2. 1株当たり当期純利益	54,910円36銭 (注) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため、記載していません。	30,254円79銭 (注) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

1株当たり当期純損益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

項目	第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)
当期純利益(千円)	277,297	152,786
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益 (千円)	277,297	152,786
普通株式の期中平均株式数 (株)	5,050	5,050

14. 重要な後発事象

第26期
(平成23年4月1日から
平成24年3月31日まで)

(企業結合)

当社は、平成24年1月31日開催の取締役会における決議に基づき、住信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、当社及び住信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

結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 住信アセットマネジメント株式会社

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

企業結合日

平成24年4月1日

企業結合の法的形式

住信アセットマネジメント株式会社を吸収合併存続会社、当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。

結合後の企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

その他取引の概要に関する事項

旧中央三井トラスト・グループと旧住友信託銀行グループは、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、当社及び住信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」として発足するものです。

(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す。

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) 通常の実行条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の実行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24年4月1日に中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、商号を三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に変更しました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

平成24年12月21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24年4月1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24年3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。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

資本金の額は平成24年4月1日現在です。

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、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24年3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みます。）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24年11月22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

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山田信之 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、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本債券インデックスファンド（SMA専用）（旧ファンド名：中央三井日本債券インデックスファンド（SMA専用））の平成23年9月27日から平成24年9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、日本債券インデックスファンド（SMA専用）（旧ファンド名：中央三井日本債券インデックスファンド（SMA専用））の平成24年9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24年6月11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	羽 太 典 明 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	石 井 勝 也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（旧社名：住信アセットマネジメント株式会社）の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第26期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、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24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。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は平成24年4月1日に中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、会社名を三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に変更している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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。