

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年6月26日提出
【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 平木 秀樹
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目3番1号
【事務連絡者氏名】	投信業務部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0522
【届出の対象とした募集（売出）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（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【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】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。
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」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
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、ファンド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。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

取得申込受付日の基準価額に、1.08%（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。

申込手数料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。

「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。

（６）【申込単位】

販売会社が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。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1口単位です。

（７）【申込期間】

平成29年 6月27日から平成29年12月25日までとします。

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】

下記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】

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとし、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、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」又は「受託者」ということがあります。）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】

取得申込みを受け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、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 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り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。

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、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。

< 申込みコース >

当ファンドは「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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¹）²で³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けを中止すること、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。

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

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法における、当ファンドの商品分類及び属性区分は下記の通りです。

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)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	MRF	特殊型
	内外	不動産投信	ETF	
		その他資産 ()		
		資産複合		

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象 地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル 日本 北米	ファミリー ファンド ファンド・ オブ・ファ ンズ	あり () なし	日経225 TOPIX その他 (NOMUR A-BPI 総 合)	ブル・ベア 型 条件付運用 型 ロング・ ショート型/ 絶対収益追 求型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	欧州 アジア オセアニア 中南米				
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (債券一 般))	その他 ()	アフリカ 中近東 (中東) エマージン グ				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型						

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) でもご覧いただけます。

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2) 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う。

[投資対象地域による区分]

- (1) 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う。
- (2) 海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

- (1) 株式...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株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 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う。
- (3) 不動産投信(リート)...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不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...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上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

[独立した区分]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

[補足分類]

- (1) 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う。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

大型株...目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

中小型株...目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合...以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

資産配分固定型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

資産配分変更型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

[決算頻度による属性区分]

(1)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う。

(2)年2回...目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

(3)年4回...目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

(4)年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

(5)年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

(6)日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含ま

ないかを明確に記載するものとする。

- (2)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う。
- (3)北米...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北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)欧州...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欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5)アジア...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を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...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オセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...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中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...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アフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...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中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...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エマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

- (1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

- (1)為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

- (1)日経225
- (2)TOPIX
- (3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

[特殊型]

- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

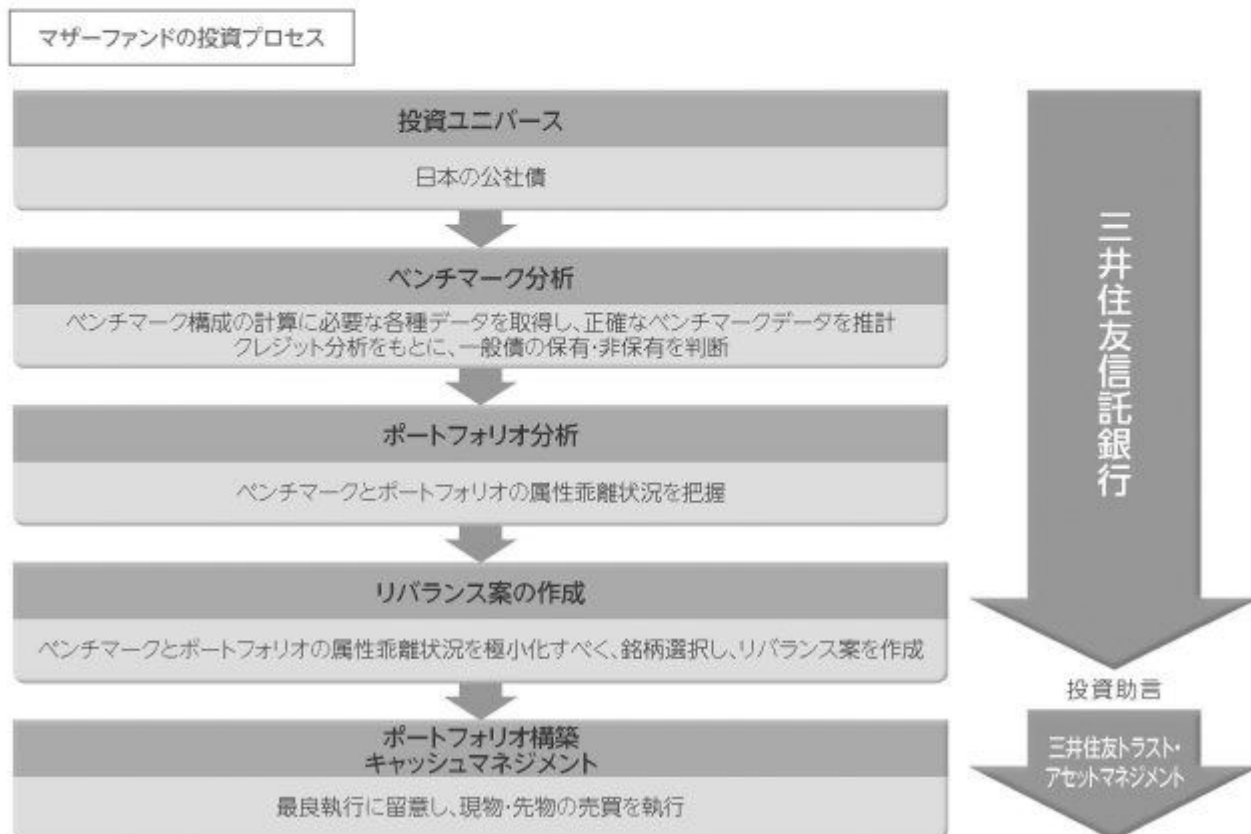
- (3)ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

<ファンドの特色>

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。

NOMURA-BPI総合とは

「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、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。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

ファミリーファンド方式で運用します。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とし、その資金を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。

分配方針

- 年1回、毎決算時に原則として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。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- 収益分配金は、税引後自動的にファンドの受益権に再投資されます。

※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。

主な投資制限

- 外貨建資産への投資は行いません。
- 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す。)を行使したものに限ることとし、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。

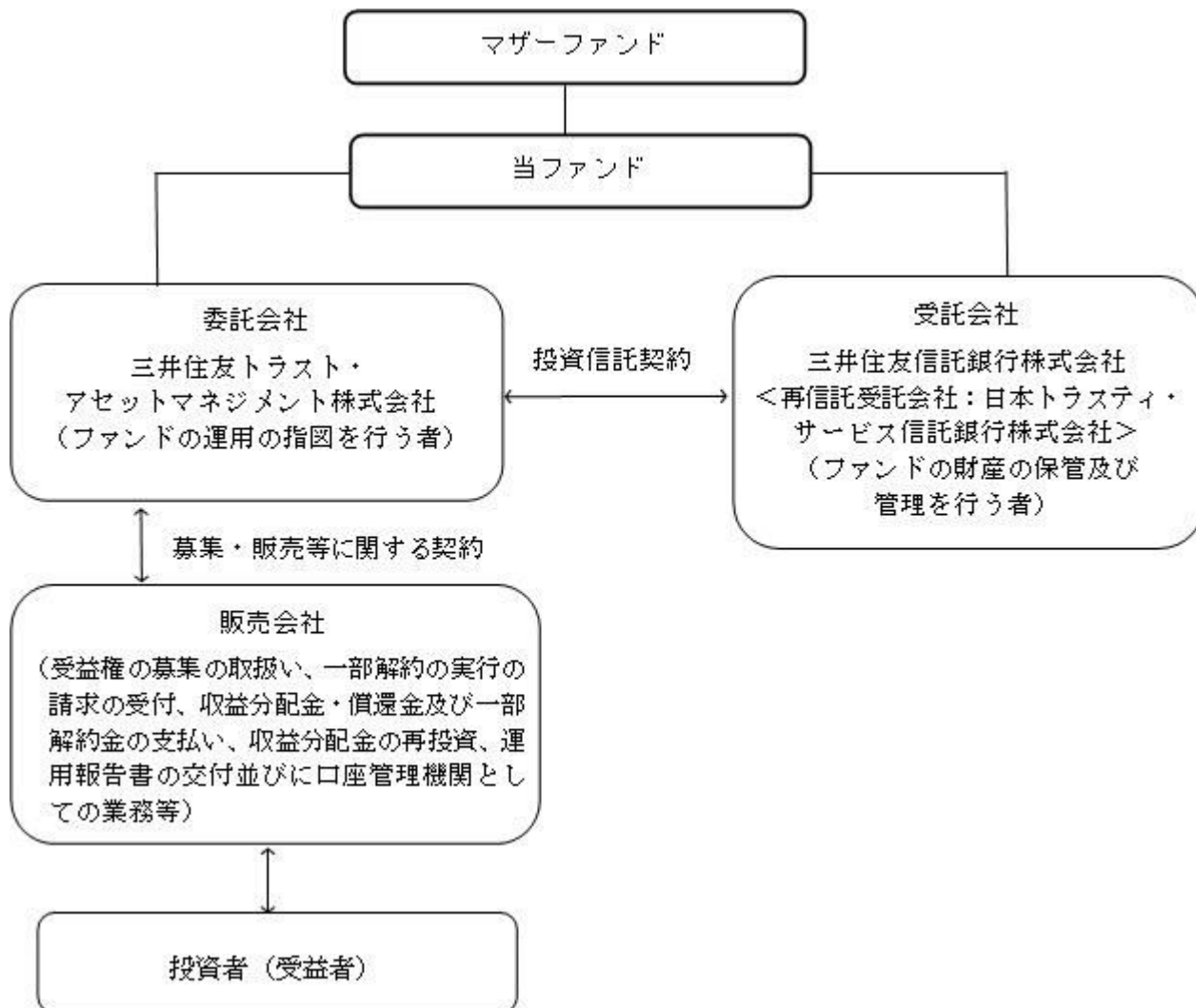
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(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】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（平成29年 4月28日現在）

イ．資本金の額：3億円

ロ．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

ハ．大株主の状況

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 - 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。
- 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、投資信託約款第21条、第22条及び第23条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」という場合があります。）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す。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

上記の規定にかかわらず、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。

(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り、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。

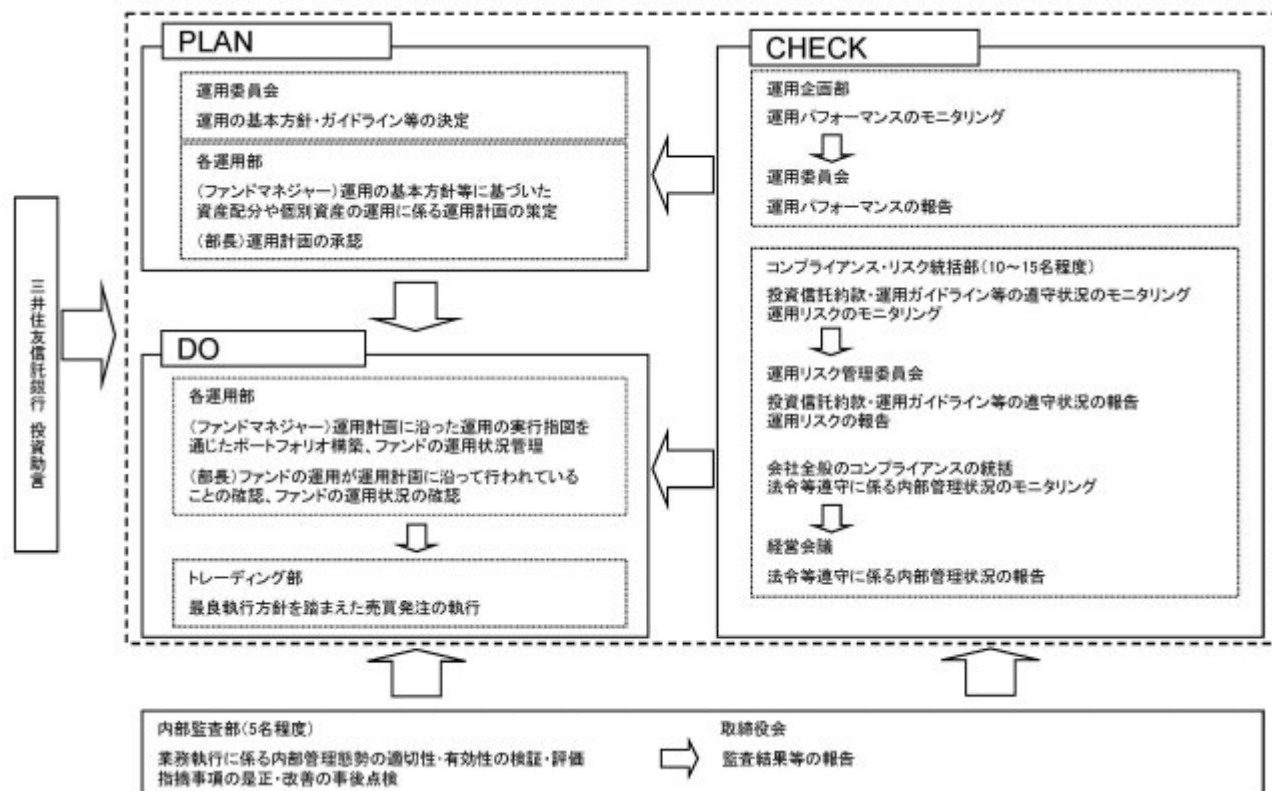
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、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。)について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

(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、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】

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。

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は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、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、

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、

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、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、

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。

二．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たときは、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。

ロ．上記イ．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、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。

ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

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。

ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

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。

ロ. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券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、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

ハ. 上記イ. 及びロ. の立替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っ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。

二. 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。

R．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

S．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、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。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．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、同法施行規則）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う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の総数が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。

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様はに帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの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。

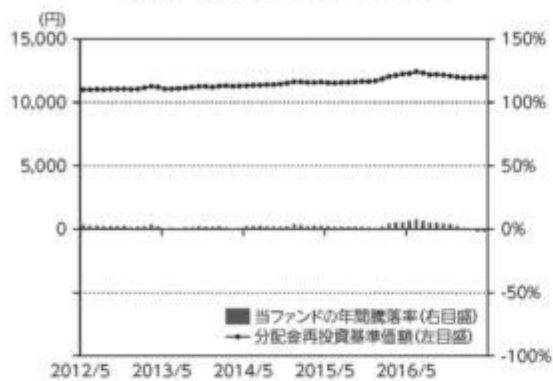
（２）リスクの管理体制

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

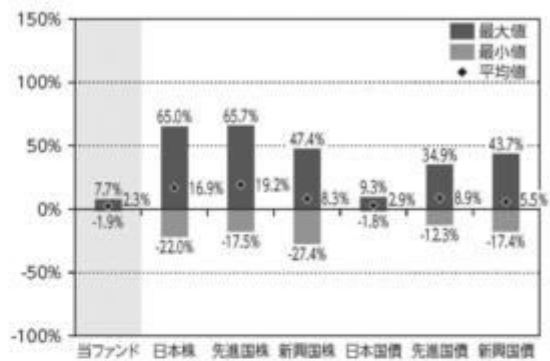
内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び
分配金再投資基準価額の推移

*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

*2012年5月～2017年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

*各資産クラスの指数

日本株…… TOPIX(東証株価指数、配当込み)^{※1}

先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)^{※2}

新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)^{※3}

日本国債… NOMURA-BPI国債^{※4}

先進国債… シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)^{※5}

新興国債… JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・レディパーシファイド(円ベース)^{※6}

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

※1 TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売却に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

※2 MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

※3 MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

※4 NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公算国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに關し一切責任を負いません。

※5 シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定又は売却に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

※6 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

取得申込受付日の基準価額に、1.08%（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。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

「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（以下同じ）。

当ファンドは「分配金再投資コース」専用ファンドです。

上記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、下記に記載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>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時には、解約請求受付日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（ ）として当該基準価額から控除します。また、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられません。

（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、投資信託財産の純資産総額に年率0.3996%（税抜 0.37%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.1404% （税抜 0.13%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.2052% （税抜 0.19%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.054% （税抜 0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

（４）【その他の手数料等】

投資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て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、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。

当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（ ）、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（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）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に投資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。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

	税 率（内 訳）
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。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は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ず（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、上記イ．の表の通りです。

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り、）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

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。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

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49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

（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。）

個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごと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。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．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「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」について）をご参照ください。）

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）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）」（受益者ごと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、

- イ．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、
- ロ．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。

上記は、平成29年 4月28日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

以下は、平成29年 4月28日現在の状況について記載してあります。

【日本債券インデックスファンド（SMA専用）】

（1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	337,346,196	100.00
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,623	0.00
合計（純資産総額）		337,343,573	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】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受 益証券	日本債券マザーファンド	249,387,297	1.3674	341,012,190	1.3527	337,346,196	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

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

【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
第6期計算期間末	(平成25年 9月24日)	311,632,447	311,632,447	11,190	11,190
第7期計算期間末	(平成26年 9月24日)	449,091,816	449,091,816	11,384	11,384
第8期計算期間末	(平成27年 9月24日)	443,435,493	443,435,493	11,618	11,618
第9期計算期間末	(平成28年 9月26日)	368,299,493	368,299,493	12,161	12,161

平成28年 4月末日	463,186,680		12,233
5月末日	455,786,848		12,272
6月末日	461,055,065		12,418
7月末日	378,288,041		12,310
8月末日	369,808,463		12,187
9月末日	369,205,598		12,191
10月末日	367,454,132		12,154
11月末日	364,965,033		12,072
12月末日	342,265,639		12,001
平成29年 1月末日	337,381,965		11,931
2月末日	338,051,774		11,964
3月末日	336,921,191		11,945
4月末日	337,343,573		12,000

【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
第6期計算期間	平成24年 9月25日～平成25年 9月24日	0
第7期計算期間	平成25年 9月25日～平成26年 9月24日	0
第8期計算期間	平成26年 9月25日～平成27年 9月24日	0
第9期計算期間	平成27年 9月25日～平成28年 9月26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
第6期計算期間	平成24年 9月25日～平成25年 9月24日	1.5
第7期計算期間	平成25年 9月25日～平成26年 9月24日	1.7
第8期計算期間	平成26年 9月25日～平成27年 9月24日	2.1
第9期計算期間	平成27年 9月25日～平成28年 9月26日	4.7
第10期中間計算期間	平成28年 9月27日～平成29年 3月26日	1.7

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(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
第6期計算期間	平成24年 9月25日～平成25年 9月24日	82,173,404	6,461,791,049	278,500,828
第7期計算期間	平成25年 9月25日～平成26年 9月24日	130,259,076	14,259,567	394,500,337
第8期計算期間	平成26年 9月25日～平成27年 9月24日	8,438,803	21,272,475	381,666,665
第9期計算期間	平成27年 9月25日～平成28年 9月26日	11,135,266	89,940,191	302,861,740
第10期中間計算期間	平成28年 9月27日～平成29年 3月26日		20,795,110	282,066,630

(注1)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注2)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)

日本債券マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	260,780,631,800	82.17
地方債証券	日本	18,108,656,418	5.71
特殊債券	日本	23,146,656,387	7.29
社債券	日本	11,929,243,000	3.76
	フランス	599,647,000	0.19
	オーストラリア	301,389,000	0.09
	スウェーデン	200,617,000	0.06
	ノルウェー	100,508,000	0.03
	カナダ	100,058,000	0.03
	イギリス	99,917,000	0.03
	スイス	99,724,000	0.03
	小計		13,431,103,000
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,906,561,460	0.60
合計(純資産総額)		317,373,609,065	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。

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	買建	日本	755,100,000	0.24

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	3,820,000,000	101.06	3,860,653,800	101.09	3,861,790,800	0.100	2021/3/20	1.22
日本	国債証券	第116回利付国債(5年)	3,210,000,000	100.85	3,237,285,000	100.68	3,232,116,900	0.200	2018/12/20	1.02
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	3,095,000,000	103.36	3,198,992,000	103.71	3,210,041,150	0.400	2025/6/20	1.01
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	2,970,000,000	103.30	3,068,039,700	103.72	3,080,632,500	0.400	2025/3/20	0.97
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	2,910,000,000	103.37	3,008,096,100	103.78	3,020,259,900	0.400	2025/9/20	0.95
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	2,980,000,000	100.57	2,997,133,600	101.03	3,010,783,400	0.100	2026/9/20	0.95
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	2,870,000,000	101.12	2,902,144,000	101.19	2,904,239,100	0.100	2021/9/20	0.92
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	2,760,000,000	104.63	2,887,870,800	105.10	2,900,898,000	0.600	2024/6/20	0.91
日本	国債証券	第126回利付国債(5年)	2,870,000,000	101.02	2,899,274,000	101.04	2,899,934,100	0.100	2020/12/20	0.91
日本	国債証券	第117回利付国債(5年)	2,830,000,000	100.91	2,855,951,100	100.79	2,852,441,900	0.200	2019/3/20	0.90
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	2,725,000,000	103.98	2,833,519,250	104.42	2,845,581,250	0.500	2024/9/20	0.90
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	2,790,000,000	100.65	2,808,302,400	101.09	2,820,634,200	0.100	2026/6/20	0.89
日本	国債証券	第122回利付国債(5年)	2,770,000,000	100.86	2,793,822,000	100.78	2,791,633,700	0.100	2019/12/20	0.88
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	2,740,000,000	100.97	2,766,660,200	100.97	2,766,605,400	0.100	2020/9/20	0.87
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	2,630,000,000	104.57	2,750,349,000	104.81	2,756,634,500	0.600	2023/12/20	0.87
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	2,710,000,000	100.94	2,735,474,000	100.91	2,734,769,400	0.100	2020/6/20	0.86
日本	国債証券	第373回利付国債(2年)	2,710,000,000	100.74	2,730,054,000	100.57	2,725,582,500	0.100	2019/2/15	0.86
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	2,680,000,000	100.42	2,691,257,100	100.96	2,705,808,400	0.100	2026/12/20	0.85

日本	国債証券	第128回利付国債（5年）	2,490,000,000	101.08	2,516,991,600	101.14	2,518,510,500	0.100	2021/6/20	0.79
日本	国債証券	第325回利付国債（10年）	2,285,000,000	105.14	2,402,563,250	105.13	2,402,220,500	0.800	2022/9/20	0.76
日本	国債証券	第329回利付国債（10年）	2,245,000,000	105.66	2,372,141,000	105.75	2,374,087,500	0.800	2023/6/20	0.75
日本	国債証券	第123回利付国債（5年）	2,320,000,000	100.90	2,340,880,000	100.85	2,339,836,000	0.100	2020/3/20	0.74
日本	国債証券	第333回利付国債（10年）	2,180,000,000	104.58	2,279,844,000	104.96	2,288,128,000	0.600	2024/3/20	0.72
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	2,200,000,000	104.36	2,295,964,000	103.96	2,287,120,000	1.300	2019/12/20	0.72
日本	国債証券	第296回利付国債（10年）	2,150,000,000	102.90	2,212,414,500	102.37	2,201,105,500	1.500	2018/9/20	0.69
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	2,170,000,000	100.73	2,185,841,000	101.15	2,195,106,900	0.100	2026/3/20	0.69
日本	国債証券	第130回利付国債（5年）	2,130,000,000	101.06	2,152,718,600	101.30	2,157,860,400	0.100	2021/12/20	0.68
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	2,037,000,000	105.29	2,144,899,890	105.05	2,139,868,500	1.200	2020/12/20	0.67
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	2,010,000,000	102.53	2,060,913,300	102.94	2,069,214,600	0.300	2025/12/20	0.65
日本	国債証券	第367回利付国債（2年）	1,990,000,000	100.56	2,001,144,000	100.40	1,997,960,000	0.100	2018/8/15	0.63

(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。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	82.17
地方債証券	5.71
特殊債券	7.29
社債券	4.23
合計	99.40

(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。

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	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物	買建	5円		753,661,620	755,100,000	0.24

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

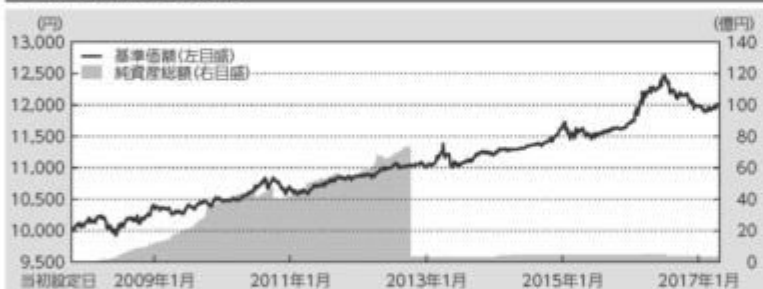
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2007年10月19日
作成基準日：2017年4月28日

基準価額・純資産の推移

基準価額	12,000円
純資産総額	3.37億円

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

分配の推移（1万口当たり、税引前）

設定来分配金合計額：0円

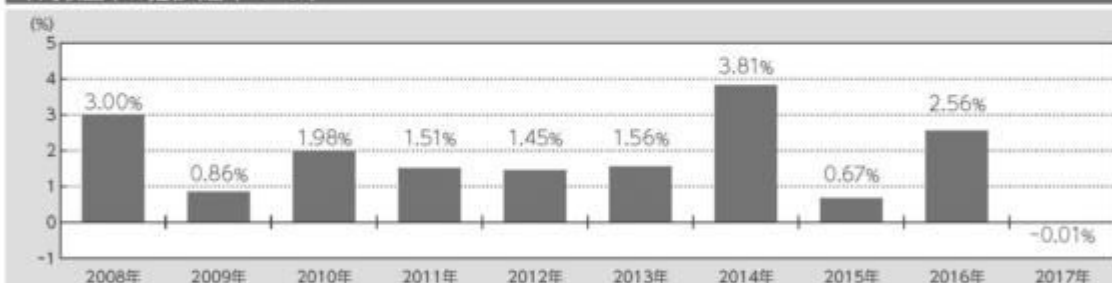
決算期	2012年9月	2013年9月	2014年9月	2015年9月	2016年9月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	利率	償還期限	実質投資比率
第127回利付国債(5年)	日本	国債	0.1%	2021/03/20	1.2%
第116回利付国債(5年)	日本	国債	0.2%	2018/12/20	1.0%
第339回利付国債(10年)	日本	国債	0.4%	2025/06/20	1.0%
第338回利付国債(10年)	日本	国債	0.4%	2025/03/20	1.0%
第340回利付国債(10年)	日本	国債	0.4%	2025/09/20	1.0%
第344回利付国債(10年)	日本	国債	0.1%	2026/09/20	0.9%
第334回利付国債(10年)	日本	国債	0.6%	2024/06/20	0.9%
第129回利付国債(5年)	日本	国債	0.1%	2021/09/20	0.9%
第126回利付国債(5年)	日本	国債	0.1%	2020/12/20	0.9%
第117回利付国債(5年)	日本	国債	0.2%	2019/03/20	0.9%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）

※2017年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

最新の運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページでご確認いただけます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

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るものとし、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。

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

< 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後2時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。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。

< 申込単位 >

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

< 申込手数料 >

前記 第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (1)申込手数料をご覧ください。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、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け付けを中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取り消すことができます。

< その他 >

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、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、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。

< 問い合わせ先 >

上記手続き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）手続等】

< 一部解約手続 >

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

< 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後2時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。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。

< 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の基準価額から、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ます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

< 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

< 受付不可日 >

ありません。

<一部解約受付の中止等>

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け付けを中止することができます。

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け付けたものとして上記<解約価額>の規定に準じて計算された価額とします。

<一部解約の制限>

当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

<その他>

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投資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。

<問い合わせ先>

上記手続き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。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資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。

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

親投資信託受益証券（日本債券マザーファンド）の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

公社債等の評価方法

計算日における次のa. からc. までに掲げるいずれかの価額で評価します。

- a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- b. 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。）
- c. 価格情報会社の提供する価額

< 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記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。

（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）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（平成19年10月19日設定）

ただし、下記「(5)その他 < 投資信託契約の終了（償還）と手続き >」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、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日までとします。

なお、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。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

- ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、

ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

委託会社は上記（1）によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの繰上償還について、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ファンドの繰上償還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、この投資信託契約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。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託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。以下本項において同じ。）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、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

上記からまでの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資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、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記から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。

<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

(1)投資信託約款の変更等

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基いて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続きに従います。

(2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）又はファンドの併合について、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）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変更又はファンドの併合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、この投資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。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託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。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じ

て、議決権を有し、これを行行使うことができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行行使うことができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

上記からまでの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資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。

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る他のファンド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。

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、又は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し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、上記<投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>に従い、新受託会社を選任します。

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

< 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を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手続き >

- ・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

当該契約の有効期間は、契約満了日の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のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

< 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。

< 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。

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

信託の登記又は登録をすることができる投資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あります。

上記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。

投資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投資信託財産については、投資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。

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。

4【受益者の権利等】

(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（決算日）の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は、毎決算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決算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決算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を行います。当該売付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、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します。）に、原則として償還日から起算して5営業日までに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。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3)換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」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9期計算期間(平成27年 9月25日から平成28年 9月26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8期 （平成27年 9月24日現在）	第9期 （平成28年 9月26日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	912,006	880,729
親投資信託受益証券	443,429,039	368,297,564
未収入金	41,308	721,953
未収利息	1	-
流動資産合計	444,382,354	369,900,246
資産合計	444,382,354	369,900,246
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	695,474
未払受託者報酬	119,878	117,386
未払委託者報酬	815,055	776,206
未払利息	-	2
その他未払費用	11,928	11,685
流動負債合計	946,861	1,600,753
負債合計	946,861	1,600,753
純資産の部		
元本等		
元本	381,666,665	302,861,740
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	61,768,828	65,437,753
（分配準備積立金）	26,013,211	35,895,083
元本等合計	443,435,493	368,299,493
純資産合計	443,435,493	368,299,493
負債純資産合計	444,382,354	369,900,246

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期		第9期	
	自	平成26年 9月25日 至 平成27年 9月24日	自	平成27年 9月25日 至 平成28年 9月26日
営業収益				
受取利息		150		20
有価証券売買等損益		11,101,609		23,581,447
営業収益合計		11,101,759		23,581,467
営業費用				
支払利息		-		100
受託者報酬		240,511		235,857
委託者報酬		1,635,346		1,581,754
その他費用		23,928		23,474
営業費用合計		1,899,785		1,841,185
営業利益又は営業損失（ ）		9,201,974		21,740,282
経常利益又は経常損失（ ）		9,201,974		21,740,282
当期純利益又は当期純損失（ ）		9,201,974		21,740,282
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（ ）		376,639		5,912,053
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		54,591,479		61,768,828
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,280,430		2,468,329
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,280,430		2,468,329
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,928,416		14,627,633
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,928,416		14,627,633
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		61,768,828		65,437,753

(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 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、当計算期間末日が休業日のため、第9期計算期間は平成27年 9月25日から平成28年 9月26日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第8期 (平成27年 9月24日現在)	第9期 (平成28年 9月26日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	381,666,665口	302,861,740口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1618円 (11,618円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2161円 (12,161円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自 平成26年 9月25日 至 平成27年 9月24日			第9期 自 平成27年 9月25日 至 平成28年 9月26日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	4,243,665円	費用控除後の配当等収益額	A	3,525,659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	4,581,670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	12,302,570円
収益調整金額	C	35,755,617円	収益調整金額	C	29,542,670円
分配準備積立金額	D	17,187,876円	分配準備積立金額	D	20,066,854円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	61,768,828円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	65,437,753円
当ファンドの期末残存口数	F	381,666,665口	当ファンドの期末残存口数	F	302,861,740口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,618円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,160円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 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

	第9期 自 平成27年 9月25日 至 平成28年 9月26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。
2.金融商品の内容及びそのリスク	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、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第9期 (平成28年 9月26日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（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）

元本の移動

区分	第8期	第9期
	自 平成26年 9月25日 至 平成27年 9月24日	自 平成27年 9月25日 至 平成28年 9月26日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	394,500,337円	381,666,665円
期中追加設定元本額	8,438,803円	11,135,266円
期中一部解約元本額	21,272,475円	89,940,191円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第8期 (平成27年 9月24日現在)	第9期 (平成28年 9月26日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	10,769,623	17,423,846
合計	10,769,623	17,423,846

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	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	269,302,109	368,297,564	
合計		269,302,109	368,297,564	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券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

貸借対照表

	平成28年 9月26日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,598,406,765
国債証券	258,682,630,620
地方債証券	18,111,339,838
特殊債券	24,015,359,364
社債券	14,106,505,000
派生商品評価勘定	2,696,436
未収入金	205,085,000
未収利息	463,281,726
前払費用	4,125,233
差入委託証拠金	860,000
流動資産合計	318,190,289,982
資産合計	318,190,289,982
負債の部	
流動負債	
前受金	2,700,000
未払金	200,000,000
未払解約金	202,468,233
未払利息	6,048
その他未払費用	2,013
流動負債合計	405,176,294
負債合計	405,176,294

項目	平成28年 9月26日現在
	金額（円）
純資産の部	
元本等	
元本	232,369,845,786
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	85,415,267,902
元本等合計	317,785,113,688
純資産合計	317,785,113,688
負債純資産合計	318,190,289,982

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成28年 9月26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、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発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <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又は計算日に知りうる直近の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</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28年 9月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	232,369,845,786口
2. 担保資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>有価証券 105,991,000円</p>
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3676円</p> <p>(1万口当たり純資産額) (13,676円)</p>

（注）担保資産の有価証券は、「国債証券」であります。上記金額には、約定未受渡債券を含んでおります。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	平成28年 9月26日現在
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2．金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。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。
3．金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したコンプライアンス・リスク統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

	平成28年 9月26日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (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。

	平成28年 9月26日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には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>

（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）

元本の移動

区分	平成28年 9月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成27年 9月25日
期首元本額	244,052,309,232円
期中追加設定元本額	33,719,857,512円
期中一部解約元本額	45,402,320,958円
期末元本額	232,369,845,786円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	1,139,054,331円
D C日本債券インデックスファンド	2,925,345,070円
D C日本債券インデックスファンドL	33,288,410,612円
D Cバランスファンド3 0	5,683,352,168円
D Cバランスファンド5 0	3,728,112,496円
D Cバランスファンド7 0	858,592,567円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	60,642,172円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	35,335,141円
日本債券インデックスファンド（SMA専用）	269,302,109円
日本債券インデックスe	1,788,691,093円

区分	平成28年 9月26日現在
インデックスコレクション（国内債券）	12,710,042,334円
インデックスコレクション（バランス株式30）	11,828,093,479円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,642,003,740円
インデックスコレクション（バランス株式70）	617,418,779円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	43,993,231,669円
日本債券パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	5,329,413,325円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	1,190,929,413円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	4,790,780,997円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	320,141,953円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	406,523,250円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	2,154,077,296円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	6,173,882,084円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	1,478,256,076円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	16,428,587,934円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	200,892,483円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	11,256,966,407円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	3,819,684,253円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	323,802,705円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	1,243,538,203円
VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	161,971,241円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,841,583,140円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	512,132,356円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	1,088,447,122円
バランスVA20（適格機関投資家専用）	246,666,089円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	3,342,111,414円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	5,104,740,532円
バランスVA20L（適格機関投資家専用）	324,884,138円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	2,260,347,965円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	37,905,541,947円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	752,467,820円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	225,925,225円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	52,338,349円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	855,835,831円
私募日本債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	4,661,286円
世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	5,087,192円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年 9月26日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	8,344,921,670

地方債証券	124,954,460
特殊債券	313,689,002
社債券	34,857,000
合計	8,818,422,132

(注)当計算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」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

債券関連

(平成28年 9月26日現在)

区分	種類	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	1,667,763,564	-	1,670,460,000	2,696,436
	合計	1,667,763,564	-	1,670,460,000	2,696,436

(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又は計算日に知りうる直近の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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第358回利付国債(2年)	1,330,000,000	1,335,426,400	
	第360回利付国債(2年)	630,000,000	632,954,700	
	第362回利付国債(2年)	2,470,000,000	2,482,646,400	
	第364回利付国債(2年)	2,190,000,000	2,202,329,700	
	第365回利付国債(2年)	610,000,000	613,562,400	
	第366回利付国債(2年)	80,000,000	80,489,600	
	第367回利付国債(2年)	2,960,000,000	2,978,707,200	
	第368回利付国債(2年)	100,000,000	100,651,000	
	第107回利付国債(5年)	1,710,000,000	1,719,576,000	
	第108回利付国債(5年)	880,000,000	883,845,600	
	第109回利付国債(5年)	880,000,000	884,549,600	

第110回利付国債（5年）	370,000,000	373,008,100	
第111回利付国債（5年）	1,230,000,000	1,241,820,300	
第112回利付国債（5年）	660,000,000	667,319,400	
第113回利付国債（5年）	1,930,000,000	1,948,045,500	
第114回利付国債（5年）	790,000,000	798,397,700	
第115回利付国債（5年）	1,830,000,000	1,845,811,200	
第116回利付国債（5年）	3,340,000,000	3,372,130,800	
第117回利付国債（5年）	2,830,000,000	2,859,913,100	
第118回利付国債（5年）	1,550,000,000	1,568,057,500	
第119回利付国債（5年）	660,000,000	665,880,600	
第120回利付国債（5年）	1,490,000,000	1,508,759,100	
第121回利付国債（5年）	450,000,000	454,315,500	
第122回利付国債（5年）	2,770,000,000	2,798,808,000	
第123回利付国債（5年）	2,620,000,000	2,648,872,400	
第124回利付国債（5年）	2,600,000,000	2,630,264,000	
第125回利付国債（5年）	2,740,000,000	2,774,058,200	
第126回利付国債（5年）	3,020,000,000	3,059,260,000	
第127回利付国債（5年）	3,270,000,000	3,315,027,900	
第128回利付国債（5年）	1,930,000,000	1,957,618,300	
第1回利付国債（40年）	230,000,000	356,596,600	
第2回利付国債（40年）	500,000,000	752,180,000	
第3回利付国債（40年）	410,000,000	621,445,200	
第4回利付国債（40年）	645,000,000	984,798,900	
第5回利付国債（40年）	630,000,000	928,714,500	
第6回利付国債（40年）	670,000,000	972,860,100	
第7回利付国債（40年）	570,000,000	793,383,000	
第8回利付国債（40年）	720,000,000	932,090,400	
第9回利付国債（40年）	210,000,000	198,494,100	
第289回利付国債（10年）	2,050,000,000	2,094,280,000	
第290回利付国債（10年）	900,000,000	922,032,000	
第291回利付国債（10年）	820,000,000	838,860,000	
第292回利付国債（10年）	550,000,000	565,906,000	
第293回利付国債（10年）	900,000,000	931,815,000	
第294回利付国債（10年）	900,000,000	930,339,000	
第295回利付国債（10年）	890,000,000	916,913,600	
第296回利付国債（10年）	2,150,000,000	2,224,347,000	
第297回利付国債（10年）	950,000,000	984,665,500	
第298回利付国債（10年）	1,360,000,000	1,406,580,000	
第299回利付国債（10年）	1,140,000,000	1,183,103,400	
第300回利付国債（10年）	550,000,000	573,529,000	
第301回利付国債（10年）	1,500,000,000	1,570,755,000	
第302回利付国債（10年）	870,000,000	908,645,400	

第303回利付国債(10年)	1,640,000,000	1,719,376,000	
第304回利付国債(10年)	740,000,000	773,596,000	
第305回利付国債(10年)	2,200,000,000	2,307,932,000	
第306回利付国債(10年)	1,370,000,000	1,447,185,800	
第307回利付国債(10年)	970,000,000	1,021,254,800	
第308回利付国債(10年)	970,000,000	1,024,805,000	
第309回利付国債(10年)	1,040,000,000	1,090,949,600	
第310回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,467,662,000	
第311回利付国債(10年)	670,000,000	697,001,000	
第312回利付国債(10年)	2,037,000,000	2,159,036,670	代用有価証券 100,000,000円
第313回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,238,543,600	
第314回利付国債(10年)	620,000,000	656,381,600	
第315回利付国債(10年)	1,130,000,000	1,205,190,200	
第316回利付国債(10年)	570,000,000	605,208,900	
第317回利付国債(10年)	740,000,000	788,166,600	
第318回利付国債(10年)	1,050,000,000	1,113,073,500	
第319回利付国債(10年)	740,000,000	790,608,600	
第320回利付国債(10年)	1,270,000,000	1,350,149,700	
第321回利付国債(10年)	1,420,000,000	1,513,464,400	
第322回利付国債(10年)	680,000,000	720,997,200	
第323回利付国債(10年)	690,000,000	733,746,000	
第324回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,269,132,000	
第325回利付国債(10年)	2,285,000,000	2,422,511,300	
第326回利付国債(10年)	560,000,000	591,595,200	
第327回利付国債(10年)	1,180,000,000	1,254,009,600	
第328回利付国債(10年)	1,680,000,000	1,767,561,600	
第329回利付国債(10年)	2,045,000,000	2,183,671,450	
第330回利付国債(10年)	1,880,000,000	2,012,314,400	
第331回利付国債(10年)	970,000,000	1,024,552,800	
第332回利付国債(10年)	2,530,000,000	2,675,475,000	
第333回利付国債(10年)	2,620,000,000	2,773,767,800	
第334回利付国債(10年)	2,590,000,000	2,745,037,400	
第335回利付国債(10年)	2,325,000,000	2,448,015,750	
第336回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,232,829,000	
第337回利付国債(10年)	1,820,000,000	1,887,431,000	
第338回利付国債(10年)	2,970,000,000	3,106,204,200	
第339回利付国債(10年)	3,325,000,000	3,478,980,750	
第340回利付国債(10年)	2,910,000,000	3,045,926,100	
第341回利付国債(10年)	2,980,000,000	3,092,435,400	
第342回利付国債(10年)	3,500,000,000	3,565,240,000	
第343回利付国債(10年)	3,240,000,000	3,297,153,600	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	67,729,500	

第2回利付国債(30年)	100,000,000	131,099,000	
第3回利付国債(30年)	140,000,000	182,183,400	
第4回利付国債(30年)	190,000,000	264,755,500	
第5回利付国債(30年)	180,000,000	234,374,400	
第6回利付国債(30年)	270,000,000	361,567,800	
第7回利付国債(30年)	190,000,000	252,814,000	
第9回利付国債(30年)	180,000,000	214,792,200	
第10回利付国債(30年)	170,000,000	194,554,800	
第11回利付国債(30年)	280,000,000	348,255,600	
第12回利付国債(30年)	370,000,000	485,432,600	
第13回利付国債(30年)	350,000,000	454,160,000	
第14回利付国債(30年)	350,000,000	477,988,000	
第15回利付国債(30年)	500,000,000	693,305,000	
第16回利付国債(30年)	250,000,000	347,075,000	
第17回利付国債(30年)	420,000,000	576,916,200	
第18回利付国債(30年)	540,000,000	733,530,600	
第19回利付国債(30年)	300,000,000	408,189,000	
第20回利付国債(30年)	290,000,000	405,649,100	
第21回利付国債(30年)	360,000,000	490,885,200	
第22回利付国債(30年)	380,000,000	533,322,400	
第23回利付国債(30年)	370,000,000	520,142,300	
第24回利付国債(30年)	335,000,000	471,690,050	
第25回利付国債(30年)	335,000,000	459,700,400	
第26回利付国債(30年)	560,000,000	780,813,600	
第27回利付国債(30年)	490,000,000	696,564,400	
第28回利付国債(30年)	800,000,000	1,142,384,000	
第29回利付国債(30年)	430,000,000	608,032,900	
第30回利付国債(30年)	890,000,000	1,246,391,600	
第31回利付国債(30年)	800,000,000	1,108,864,000	
第32回利付国債(30年)	900,000,000	1,273,779,000	
第33回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,435,780,600	
第34回利付国債(30年)	980,000,000	1,379,369,600	
第35回利付国債(30年)	1,090,000,000	1,489,419,600	
第36回利付国債(30年)	1,145,000,000	1,570,333,150	
第37回利付国債(30年)	1,150,000,000	1,557,767,000	
第38回利付国債(30年)	885,000,000	1,181,598,900	
第39回利付国債(30年)	540,000,000	735,571,800	
第40回利付国債(30年)	720,000,000	964,274,400	
第41回利付国債(30年)	655,000,000	861,953,800	
第42回利付国債(30年)	690,000,000	909,785,700	
第43回利付国債(30年)	695,000,000	917,059,450	
第44回利付国債(30年)	760,000,000	1,004,803,600	
第45回利付国債(30年)	600,000,000	762,564,000	

第46回利付国債（30年）	910,000,000	1,158,475,500	
第47回利付国債（30年）	960,000,000	1,248,768,000	
第48回利付国債（30年）	960,000,000	1,199,942,400	
第49回利付国債（30年）	840,000,000	1,050,193,200	
第50回利付国債（30年）	865,000,000	940,107,950	
第51回利付国債（30年）	965,000,000	915,051,600	
第39回利付国債（20年）	440,000,000	458,480,000	
第40回利付国債（20年）	450,000,000	472,572,000	
第41回利付国債（20年）	520,000,000	542,313,200	
第42回利付国債（20年）	380,000,000	406,706,400	
第43回利付国債（20年）	340,000,000	371,742,400	
第44回利付国債（20年）	370,000,000	405,016,800	
第45回利付国債（20年）	270,000,000	294,607,800	
第46回利付国債（20年）	290,000,000	316,224,700	
第47回利付国債（20年）	470,000,000	515,157,600	
第48回利付国債（20年）	230,000,000	256,438,500	
第49回利付国債（20年）	280,000,000	309,106,000	
第50回利付国債（20年）	590,000,000	645,996,900	
第51回利付国債（20年）	240,000,000	265,077,600	
第52回利付国債（20年）	430,000,000	479,634,900	
第53回利付国債（20年）	350,000,000	392,213,500	
第54回利付国債（20年）	280,000,000	315,249,200	
第55回利付国債（20年）	490,000,000	549,236,100	
第56回利付国債（20年）	410,000,000	461,975,700	
第57回利付国債（20年）	360,000,000	403,556,400	
第58回利付国債（20年）	250,000,000	281,677,500	
第59回利付国債（20年）	440,000,000	492,404,000	
第60回利付国債（20年）	570,000,000	627,307,800	
第61回利付国債（20年）	390,000,000	420,556,500	
第62回利付国債（20年）	250,000,000	266,860,000	
第63回利付国債（20年）	570,000,000	647,280,600	
第64回利付国債（20年）	410,000,000	470,429,900	
第65回利付国債（20年）	370,000,000	426,195,600	
第66回利付国債（20年）	330,000,000	377,704,800	
第67回利付国債（20年）	310,000,000	358,577,000	
第68回利付国債（20年）	230,000,000	271,264,300	
第69回利付国債（20年）	530,000,000	621,075,200	
第70回利付国債（20年）	490,000,000	588,127,400	
第71回利付国債（20年）	400,000,000	473,844,000	
第72回利付国債（20年）	710,000,000	838,992,800	
第73回利付国債（20年）	540,000,000	636,179,400	
第74回利付国債（20年）	310,000,000	367,796,400	

第75回利付国債(20年)	360,000,000	428,785,200	
第76回利付国債(20年)	340,000,000	399,136,200	
第77回利付国債(20年)	290,000,000	342,925,000	
第78回利付国債(20年)	20,000,000	23,562,600	
第79回利付国債(20年)	570,000,000	676,857,900	
第80回利付国債(20年)	250,000,000	299,072,500	
第81回利付国債(20年)	180,000,000	214,534,800	
第82回利付国債(20年)	485,000,000	582,451,050	
第83回利付国債(20年)	270,000,000	325,320,300	
第84回利付国債(20年)	590,000,000	705,392,200	
第85回利付国債(20年)	360,000,000	435,124,800	
第86回利付国債(20年)	240,000,000	294,667,200	
第87回利付国債(20年)	170,000,000	207,099,100	
第88回利付国債(20年)	530,000,000	653,002,400	
第89回利付国債(20年)	320,000,000	391,132,800	
第90回利付国債(20年)	620,000,000	761,031,400	
第91回利付国債(20年)	510,000,000	631,135,200	
第92回利付国債(20年)	790,000,000	965,095,600	
第93回利付国債(20年)	260,000,000	315,785,600	
第94回利付国債(20年)	545,000,000	667,668,600	
第95回利付国債(20年)	400,000,000	500,288,000	
第96回利付国債(20年)	300,000,000	368,760,000	
第97回利付国債(20年)	510,000,000	634,562,400	
第98回利付国債(20年)	370,000,000	456,298,800	
第99回利付国債(20年)	660,000,000	816,987,600	
第100回利付国債(20年)	730,000,000	914,792,200	
第101回利付国債(20年)	360,000,000	459,396,000	
第102回利付国債(20年)	370,000,000	474,125,400	
第103回利付国債(20年)	300,000,000	380,907,000	
第104回利付国債(20年)	360,000,000	448,646,400	
第105回利付国債(20年)	490,000,000	612,519,600	
第106回利付国債(20年)	310,000,000	391,220,000	
第107回利付国債(20年)	430,000,000	539,091,000	
第108回利付国債(20年)	620,000,000	762,172,200	
第109回利付国債(20年)	370,000,000	455,984,300	
第110回利付国債(20年)	565,000,000	710,340,600	
第111回利付国債(20年)	640,000,000	815,545,600	
第112回利付国債(20年)	730,000,000	920,982,600	
第113回利付国債(20年)	755,000,000	955,188,250	
第114回利付国債(20年)	600,000,000	761,124,000	
第115回利付国債(20年)	350,000,000	448,584,500	
第116回利付国債(20年)	400,000,000	514,068,000	
第117回利付国債(20年)	570,000,000	724,931,700	

第118回利付国債（20年）	500,000,000	630,765,000	
第119回利付国債（20年）	390,000,000	481,400,400	
第120回利付国債（20年）	420,000,000	506,671,200	
第121回利付国債（20年）	770,000,000	963,054,400	
第122回利付国債（20年）	450,000,000	556,605,000	
第123回利付国債（20年）	720,000,000	923,292,000	
第124回利付国債（20年）	400,000,000	507,320,000	
第125回利付国債（20年）	300,000,000	389,883,000	
第126回利付国債（20年）	770,000,000	978,731,600	
第127回利付国債（20年）	450,000,000	565,564,500	
第128回利付国債（20年）	640,000,000	806,009,600	
第129回利付国債（20年）	410,000,000	510,409,000	
第130回利付国債（20年）	690,000,000	860,554,200	
第131回利付国債（20年）	360,000,000	443,689,200	
第132回利付国債（20年）	600,000,000	740,652,000	
第133回利付国債（20年）	610,000,000	762,109,600	
第134回利付国債（20年）	490,000,000	613,195,800	
第135回利付国債（20年）	380,000,000	469,782,600	
第136回利付国債（20年）	450,000,000	549,504,000	
第137回利付国債（20年）	370,000,000	458,108,100	
第138回利付国債（20年）	540,000,000	651,996,000	
第139回利付国債（20年）	350,000,000	427,969,500	
第140回利付国債（20年）	1,065,000,000	1,320,514,800	
第141回利付国債（20年）	800,000,000	992,504,000	
第142回利付国債（20年）	480,000,000	603,076,800	
第143回利付国債（20年）	920,000,000	1,128,113,200	
第144回利付国債（20年）	440,000,000	532,496,800	
第145回利付国債（20年）	1,280,000,000	1,592,025,600	
第146回利付国債（20年）	1,220,000,000	1,517,997,200	
第147回利付国債（20年）	1,360,000,000	1,670,120,800	
第148回利付国債（20年）	1,350,000,000	1,636,632,000	
第149回利付国債（20年）	1,140,000,000	1,381,873,800	
第150回利付国債（20年）	1,520,000,000	1,817,600,800	
第151回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,439,082,000	
第152回利付国債（20年）	1,220,000,000	1,415,907,600	
第153回利付国債（20年）	1,440,000,000	1,696,809,600	
第154回利付国債（20年）	1,430,000,000	1,658,113,600	
第155回利付国債（20年）	1,150,000,000	1,290,472,500	
第156回利付国債（20年）	1,630,000,000	1,643,349,700	
第157回利付国債（20年）	1,440,000,000	1,392,422,400	
国債証券合計	230,527,000,000	258,682,630,620	
地方債証券	第3回東京都公募公債（20年）	100,000,000	116,805,000

第7回東京都公募公債(30年)	200,000,000	277,672,000	
第11回東京都公募公債(20年)	200,000,000	243,446,000	
第17回東京都公募公債(20年)	100,000,000	122,868,000	
第18回東京都公募公債(20年)	200,000,000	249,634,000	
第20回東京都公募公債(20年)	100,000,000	123,917,000	
第21回東京都公募公債(20年)	100,000,000	125,492,000	
第657回東京都公募公債	100,000,000	102,677,000	
第696回東京都公募公債	100,000,000	105,648,000	
第703回東京都公募公債	100,000,000	105,205,000	
第714回東京都公募公債	200,000,000	209,090,000	
第722回東京都公募公債	200,000,000	210,626,000	
第740回東京都公募公債	100,000,000	103,725,000	
平成19年度第14回北海道公募公債(10年)	100,000,000	102,425,000	
平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	104,223,000	
平成21年度第6回北海道公募公債	100,000,000	104,675,000	
平成22年度第1回北海道公募公債	100,000,000	105,298,000	
平成22年度第8回北海道公募公債	100,000,000	103,950,000	
平成23年度第4回北海道公募公債	100,000,000	105,784,000	
第16回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	124,934,000	
第21回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	121,005,000	
第168回神奈川県公募公債	100,000,000	104,392,000	
第173回神奈川県公募公債	100,000,000	104,867,000	
第174回神奈川県公募公債	100,000,000	104,381,000	
第175回神奈川県公募公債	100,000,000	104,083,000	
第184回神奈川県公募公債	100,000,000	104,845,000	
第190回神奈川県公募公債	100,000,000	105,071,000	
第196回神奈川県公募公債	100,000,000	104,290,000	
第324回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,118,000	
第331回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,347,000	
第334回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,914,000	
第335回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,066,000	
第339回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,166,000	
第356回大阪府公募公債(10年)	130,000,000	137,269,600	
第363回大阪府公募公債(10年)	114,000,000	119,063,880	
第371回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	207,358,000	
第376回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,596,000	
平成20年度第6回京都府公募公債	100,000,000	103,701,000	
平成21年度第5回京都府公募公債	100,000,000	104,373,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	104,688,000	
第4回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	112,150,000	
平成21年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	104,181,000	
平成21年度第35回兵庫県公募公債	100,000,000	104,856,000	

平成22年度第19回兵庫県公募公債	100,000,000	105,466,000	
平成25年度第14回兵庫県公募公債	100,000,000	105,190,000	
平成26年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	104,655,000	
平成22年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	105,066,000	
平成23年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	106,348,000	
平成23年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	105,529,000	
平成24年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	104,294,000	
平成25年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	103,709,000	
平成27年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	104,175,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,715,000	
平成20年度第10回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,710,000	
平成22年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,107,000	
平成22年度第5回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,747,000	
平成22年度第14回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	124,786,000	
平成23年度第4回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,643,000	
平成23年度第8回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,368,000	
平成24年度第2回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,509,000	
平成25年度第16回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	104,656,000	
平成20年度第6回広島県公募公債	100,000,000	103,701,000	
平成20年度第1回広島県公募公債（20年）	100,000,000	125,123,000	
平成23年度第1回広島県公募公債	272,000,000	287,166,720	
平成24年度第2回広島県公募公債	100,000,000	104,804,000	
平成19年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	102,131,000	
平成19年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	102,347,000	
平成20年度第5回埼玉県公募公債	100,000,000	103,753,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	104,199,000	
平成22年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	104,508,000	
平成23年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	105,308,000	
平成24年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	105,160,000	
平成24年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	104,778,000	
平成19年度第1回福岡県公募公債（30年）	100,000,000	139,723,000	
平成20年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	103,495,000	
平成20年度第1回福岡県公募公債（30年）	200,000,000	268,356,000	
平成21年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	104,229,000	
平成22年度第2回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	116,305,000	

第6回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	125,030,000	
第8回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	125,315,000	
平成21年度第3回千葉県公募公債	100,000,000	104,516,000	
平成22年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	104,494,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	104,187,000	
平成22年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	105,206,000	
平成26年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	103,815,000	
平成20年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	103,691,000	
平成21年度第2回新潟県公募公債	133,900,000	140,466,456	
平成24年度第1回岐阜県公募公債（10年）	139,630,000	146,379,714	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,999,000	
第67回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,119,000	
第70回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,310,000	
第74回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,185,000	
第76回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,968,000	
第77回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,481,000	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,153,000	
第79回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,124,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,732,000	
第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,931,000	
第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,837,000	
第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,164,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,851,000	
第88回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,494,000	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,332,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,674,000	
第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,818,000	
第98回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,523,000	
第99回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,577,000	
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,859,000	
第101回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,184,000	
第102回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,170,000	
第103回共同発行市場公募地方債	177,400,000	186,458,044	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,635,000	
第110回共同発行市場公募地方債	300,000,000	315,195,000	
第111回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,276,000	
第116回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,835,000	
第117回共同発行市場公募地方債	500,000,000	521,960,000	
第118回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,434,000	
第120回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,310,000	
第125回共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,118,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,994,000	

平成24年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	104,772,000	
平成23年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	105,422,000	
平成21年度第3回大阪市公募公債	200,000,000	208,358,000	
平成21年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	104,912,000	
第1回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	114,265,000	
第464回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	103,193,000	
第482回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	104,038,000	
第2回京都市公募公債（20年）	100,000,000	118,871,000	
平成19年度第2回京都市公募公債	100,000,000	102,182,000	
平成21年度第5回京都市公募公債	100,000,000	104,964,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	118,784,000	
平成20年度第6回横浜市公募公債	100,000,000	103,613,000	
平成22年度第4回横浜市公募公債	100,000,000	103,894,000	
平成23年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	105,562,000	
平成25年度第6回横浜市公募公債	100,000,000	105,081,000	
第25回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	120,697,000	
第26回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	121,749,000	
平成23年度第4回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	104,845,000	
平成24年度第7回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	104,399,000	
平成19年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,237,000	
平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	103,260,000	
平成23年度第5回広島市公募公債	151,900,000	160,248,424	
平成23年度第1回千葉市公募公債	100,000,000	106,278,000	
平成27年度第1回三重県公募公債	100,000,000	104,144,000	
平成24年度第1回福井県公募公債	100,000,000	104,772,000	
平成24年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	104,776,000	
平成23年度第2回岡山県公募公債（10年）	100,000,000	105,588,000	
地方債証券合計	16,818,830,000	18,111,339,838	
特殊債券			
第2回政府保証新関西国際空港債券	200,000,000	212,190,000	
第15回政府保証日本政策投資銀行債券	210,000,000	232,236,900	
第17回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	201,238,000	
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	157,875,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	183,594,000	
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,148,000	
第21回道路債券	100,000,000	137,600,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	296,628,000	
第27回道路債券	100,000,000	117,654,000	

第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	123,635,000	
第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,933,000	
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,381,000	
第33回道路債券	100,000,000	141,904,000	
第35回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,441,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	125,663,000	
第38回道路債券	100,000,000	117,567,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	125,469,000	
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	123,859,000	
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	204,086,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,617,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,152,000	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	126,789,000	
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,112,000	
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	102,245,000	
第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,610,000	
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,905,000	
第61回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,599,000	
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	103,080,000	
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	103,554,000	
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	103,246,000	
第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,736,000	
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	104,127,000	
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	122,867,000	
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	104,025,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	248,640,000	
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	103,829,000	

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	104,563,000	
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	104,024,000	
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,968,000	
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	252,002,000	
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	104,934,000	
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	137,600,000	
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	104,664,000	
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	105,179,000	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,428,000	
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,927,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,638,000	
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	105,045,000	
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	123,844,000	
第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	170,000,000	176,543,300	
第123回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,122,000	
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	106,066,000	
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	105,428,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,197,000	
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	131,607,500	
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,994,000	
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,574,000	
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,232,000	
第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,021,000	
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,902,000	
第178回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,097,000	
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,852,000	
	100,000,000	121,835,000	

第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	209,000,000	218,313,040	
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,396,000	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,176,000	
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,269,000	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,650,000	
第2回政府保証公営企業債券（15年）	100,000,000	109,660,000	
第2回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,500,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券（20年）	100,000,000	125,437,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,443,000	
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,108,000	
第4回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	124,150,000	
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,785,000	
第5回公営企業債券（20年）	100,000,000	114,495,000	
第5回地方公共団体金融機構債券（20年）	200,000,000	251,186,000	
第6回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,520,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	125,556,000	
第9回公営企業債券（20年）	100,000,000	118,148,000	
第10回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,641,000	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,127,000	
第11回公営企業債券（20年）	100,000,000	117,211,000	
第12回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	124,919,000	
第13回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,978,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,266,000	
第15回公営企業債券（20年）	100,000,000	118,584,000	
第15回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	373,575,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,050,000	
第17回公営企業債券（20年）	200,000,000	243,726,000	
第17回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	122,442,000	
第20回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,273,000	
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,888,000	
第23回地方公共団体金融機構債券（20年）	300,000,000	360,411,000	
第24回公営企業債券（20年）	100,000,000	123,931,000	
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,385,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,983,000	
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,060,000	

第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	217,000,000	228,370,800	
第43回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,306,000	
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,456,000	
第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,067,000	
第50回政府保証地方公共団体金融機構債券	101,000,000	107,287,250	
第56回政府保証地方公共団体金融機構債券	193,000,000	203,615,000	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	421,000,000	435,886,560	
第885回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,867,000	
第16回国際協力銀行債券	100,000,000	106,173,000	
第19回国際協力銀行債券	100,000,000	105,808,000	
第34回都市再生債券	100,000,000	104,136,000	
第43回都市再生債券	100,000,000	105,093,000	
第38回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	105,652,000	
第18回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	104,466,000	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	17,968,000	18,721,038	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	119,060,000	126,948,915	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	42,876,000	45,993,513	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	21,981,000	23,780,584	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	55,224,000	58,198,364	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	18,776,000	19,757,609	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	19,651,000	21,084,540	
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	124,319,000	
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,963,000	13,291,352	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	78,780,000	84,436,404	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	20,731,000	22,235,448	
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,536,000	54,979,635	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	20,441,000	21,942,187	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,050,000	30,869,764	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	21,132,000	22,683,511	
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,551,000	16,837,497	
第11回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,050,000	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,616,000	17,224,644	
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	26,519,000	28,441,097	
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,751,000	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	96,246,000	100,718,551	
第17回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,282,000	
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,450,000	18,253,398	
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	32,179,000	33,522,795	
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,586,000	39,688,936	
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	128,237,000	

第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,587,000	37,774,537	
第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,997,000	20,898,664	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,207,000	39,519,940	
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,728,000	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,106,000	73,845,973	
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,290,000	23,394,023	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	63,819,000	66,814,663	
第29回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,077,000	
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,691,000	24,872,707	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	76,938,000	80,833,370	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,748,000	28,263,274	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,470,000	50,970,912	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,803,000	53,367,898	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,227,000	24,543,738	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,091,000	54,603,506	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,575,000	25,992,240	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	70,746,000	74,672,403	
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	111,110,000	117,471,047	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	51,848,000	55,247,154	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,247,000	26,977,934	
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,835,000	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,178,000	24,932,111	
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,211,000	70,028,726	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,219,000	70,608,657	
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	126,526,000	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,980,000	211,759,409	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	236,476,000	253,632,333	
第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,564,000	24,242,310	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,932,000	59,914,358	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,952,000	59,661,617	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	68,958,000	74,029,860	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,834,000	64,911,703	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,041,000	25,748,391	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,698,000	69,719,374	
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,956,000	72,155,001	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,849,000	76,149,162	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,816,000	75,106,741	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,608,000	81,066,988	
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,619,000	83,041,318	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,877,000	77,898,863	
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,237,000	76,497,511	
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,674,000	78,070,920	

	第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,746,000	83,436,899
	第85回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	122,086,000
	第88回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	122,407,000
	第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,152,000	100,644,614
	第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,774,000	197,532,715
	第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,821,000	98,332,668
	第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,280,000
	い第758号商工債	100,000,000	100,724,000
	い第770号商工債	100,000,000	100,562,000
	い第771号商工債	100,000,000	100,574,000
	い第773号商工債	200,000,000	201,142,000
	い第786号商工債	100,000,000	100,836,000
	い第749号農林債	100,000,000	100,320,000
	い第751号農林債	100,000,000	100,368,000
	い第765号農林債	100,000,000	100,727,000
	い第766号農林債	300,000,000	302,244,000
	い第769号農林債	100,000,000	100,825,000
	第275回信金中金債（5年）	100,000,000	100,320,000
	第278回信金中金債（5年）	100,000,000	100,393,000
	第280回信金中金債（5年）	100,000,000	100,292,000
	第288回信金中金債（5年）	100,000,000	100,640,000
	第295回信金中金債（5年）	100,000,000	100,687,000
	第299回信金中金債（5年）	200,000,000	201,142,000
	第182号商工債（3年）	100,000,000	100,202,000
	第183号商工債（3年）	200,000,000	200,458,000
	第187号商工債（3年）	200,000,000	200,594,000
	第21回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,004,000
	第5回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,852,000
	第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,862,000
	第20回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	102,108,000
	第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	105,225,000
	第18回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	211,158,000
	第20回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	104,086,000
	第21回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	104,693,000
	特殊債券合計	22,002,988,000	24,015,359,364
社債券	第2回ディー・エヌ・ビー・バンク エイ・エス・エイ円貨社債	100,000,000	100,903,000
	第5回ノルデアバンク・アクツィエボラーク・プブリクト円貨社債	100,000,000	100,932,000
	第7回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,896,000

第11回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	100,000,000	100,461,000	
第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	100,000,000	99,614,000	
第4回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンA B円貨社債	100,000,000	100,439,000	
第9回クレディ・スイス・エイ・ジー円貨社債	100,000,000	99,656,000	
第1回H S B C・ホールディングス・ピーエル シー円貨社債	100,000,000	99,872,000	
第6回ピー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	100,000,000	100,695,000	
第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨 社債	200,000,000	201,490,000	
第11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	100,622,000	
第3回ロイヤルバンク・オブ・カナダ円貨社 債	100,000,000	100,469,000	
第21回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	201,684,000	
第20回株式会社大林組無担保社債	100,000,000	104,119,000	
第20回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	101,488,000	
第5回明治ホールディングス株式会社無担保 社債	100,000,000	100,376,000	
第3回麒麟ホールディングス株式会社無担 保社債	100,000,000	102,398,000	
第21回株式会社ニチレイ無担保社債	100,000,000	101,917,000	
第9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	103,021,000	
第43回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	104,991,000	
第9回宇部興産株式会社無担保社債	100,000,000	100,768,000	
第3回大日本住友製薬株式会社無担保社債	100,000,000	101,505,000	
第1回富士フイルムホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	100,344,000	
第2回富士フイルムホールディングス株式 会社無担保社債	100,000,000	101,161,000	
第5回東海ゴム工業無担保社債	100,000,000	100,303,000	
第14回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	105,064,000	
第67回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	104,996,000	
第23回日新製鋼株式会社無担保社債	100,000,000	101,099,000	
第21回J F Eホールディングス株式会社無 担保社債	100,000,000	102,602,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	100,000,000	101,302,000	
第9回株式会社L I X I Lグループ無担保社 債	100,000,000	100,009,000	
第22回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	103,738,000	
第12回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	100,288,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,915,000	
第2回日本電産株式会社無担保社債	100,000,000	101,279,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,399,000	

第15回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,158,000	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	105,004,000	
第4回株式会社堀場製作所無担保社債	100,000,000	101,582,000	
第12回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	100,201,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	104,265,000	
第32回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,027,000	
第1回明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,032,000	
第5回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,076,000	
第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,470,000	
第10回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	104,626,000	
第18回株式会社ニコン無担保社債	100,000,000	101,241,000	
第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,486,000	
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,825,000	
第69回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	122,275,000	
第39回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,240,000	
第70回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,342,000	
第9回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	116,136,000	
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	104,569,000	
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	105,823,000	
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	106,515,000	
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	106,543,000	
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	112,959,000	
第107回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,400,000	
第1回三井住友FG無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	100,000,000	102,960,000	
第11回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	107,853,000	
第5回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,590,000	
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	104,871,000	
第23回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	105,890,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	106,351,000	
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	116,671,000	
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	106,750,000	
第6回興銀リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,104,000	
	100,000,000	100,394,000	

第21回株式会社ホンダファイナンス無担保社債			
第9回株式会社ジャックス無担保社債	100,000,000	101,749,000	
第50回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	104,578,000	
第167回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,509,000	
第6回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,353,000	
第39回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,658,000	
第14回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	103,945,000	
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	106,213,000	
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,117,000	
第41回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,235,000	
第40回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,305,000	
第47回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	119,629,000	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	120,782,000	
第104回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	104,542,000	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,112,000	
第10回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,381,000	
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	100,000,000	105,227,000	
第9回ジャパンリアルエステイト投資法人無担保投資法人債	100,000,000	100,872,000	
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,355,000	
第31回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,844,000	
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,994,000	
第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,231,000	
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	120,417,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,414,000	
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	124,453,000	
第85回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,057,000	
第7回西日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	105,190,000	
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	114,977,000	
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	124,206,000	
第8回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	122,114,000	
第10回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	124,195,000	
第13回東京地下鉄株式会社社債	100,000,000	118,484,000	
	100,000,000	104,039,000	

第46回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債			
第4回株式会社日立物流無担保社債	100,000,000	100,022,000	
第5回関西高速鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,139,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,815,000	
第18回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	104,547,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	103,324,000	
第457回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,654,000	
第539回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,914,000	
第542回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,028,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,891,000	
第482回中部電力株式会社社債	100,000,000	105,594,000	
第490回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,697,000	
第500回中部電力株式会社社債	100,000,000	104,892,000	
第448回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,515,000	
第463回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,410,000	
第495回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,439,000	
第370回中国電力株式会社社債	100,000,000	104,704,000	
第377回中国電力株式会社社債	100,000,000	106,316,000	
第307回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,242,000	
第479回東北電力株式会社社債	200,000,000	201,342,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	105,074,000	
第371回九州電力株式会社社債	100,000,000	107,213,000	
第431回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,736,000	
第436回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,895,000	
第315回北海道電力株式会社社債	100,000,000	101,070,000	
第316回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,623,000	
第9回沖縄電力株式会社社債	100,000,000	101,271,000	
第33回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,359,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,698,000	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,781,000	
第11回北海道瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	104,726,000	
第21回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	102,353,000	
社債券合計	13,500,000,000	14,106,505,000	
合計		314,915,834,822	

(注)備考欄の代用有価証券の数値は額面を表示しております。代用有価証券の担保差入額面には、約定未受渡券面額を含んでおります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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10期中間計算期間(平成28年 9月27日から平成29年 3月26日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【日本債券インデックスファンド（SMA専用）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 （平成28年 9月26日現在）	第10期中間計算期間 （平成29年 3月26日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	880,729	689,493
親投資信託受益証券	368,297,564	337,128,854
未収入金	721,953	66,487
流動資産合計	369,900,246	337,884,834
資産合計	369,900,246	337,884,834
負債の部		
流動負債		
未払解約金	695,474	38,357
未払受託者報酬	117,386	94,192
未払委託者報酬	776,206	602,772
未払利息	2	3
その他未払費用	11,685	9,348
流動負債合計	1,600,753	744,672
負債合計	1,600,753	744,672
純資産の部		
元本等		
元本	302,861,740	282,066,630
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	65,437,753	55,073,532
（分配準備積立金）	35,895,083	33,453,174
元本等合計	368,299,493	337,140,162
純資産合計	368,299,493	337,140,162
負債純資産合計	369,900,246	337,884,834

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期中間計算期間 自 平成27年 9月25日 至 平成28年 3月24日	第10期中間計算期間 自 平成28年 9月27日 至 平成29年 3月26日
営業収益		
受取利息	20	-
有価証券売買等損益	21,500,653	5,523,088
営業収益合計	21,500,673	5,523,088
営業費用		
支払利息	-	47
受託者報酬	118,471	94,192
委託者報酬	805,548	602,772
その他費用	11,789	9,348
営業費用合計	935,808	706,359
営業利益又は営業損失（ ）	20,564,865	6,229,447
経常利益又は経常損失（ ）	20,564,865	6,229,447
中間純利益又は中間純損失（ ）	20,564,865	6,229,447
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	48,708	335,580
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	61,768,828	65,437,753
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,438	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	15,438	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,568,638	4,470,354
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,568,638	4,470,354
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	80,731,785	55,073,532

(3) 【中間注記表】

(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 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10期中間計算期間は平成28年 9月27日から平成29年 3月26日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第9期 (平成28年 9月26日現在)	第10期中間計算期間 (平成29年 3月26日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	302,861,740口	282,066,630口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.2161円 (12,161円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.1953円 (11,953円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第10期中間計算期間 (平成29年 3月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第10期中間計算期間 (平成29年 3月26日現在)
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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>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>

（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）

元本の移動

区分	第9期 自 平成27年 9月25日 至 平成28年 9月26日	第10期中間計算期間 自 平成28年 9月27日 至 平成29年 3月26日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	381,666,665円	302,861,740円
期中追加設定元本額	11,135,266円	- 円
期中一部解約元本額	89,940,191円	20,795,110円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間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

貸借対照表

	平成29年 3月26日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,312,027,282
国債証券	257,752,804,330
地方債証券	18,280,341,484
特殊債券	23,564,828,388
社債券	13,730,787,000
未収入金	500,307,352
未収利息	416,333,954
前払金	240,000
前払費用	4,570,932
流動資産合計	316,562,240,722
資産合計	316,562,240,722
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	241,296
未払金	850,000
未払解約金	424,686,904
未払利息	3,453
流動負債合計	425,781,653
負債合計	425,781,653
純資産の部	
元本等	
元本	234,722,230,214
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	81,414,228,855
元本等合計	316,136,459,069
純資産合計	316,136,459,069
負債純資産合計	316,562,240,722

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成29年 3月26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、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発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <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又は計算日に知りうる直近の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	派生商品取引等損益

	平成29年 3月26日現在
	約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	平成29年 3月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	234,722,230,214口
2. 担保資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 有価証券 105,184,000円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.3469円 (1万口当たり純資産額) (13,469円)

（注）担保資産の有価証券は、「国債証券」であります。上記金額には、約定未受渡債券を含んでおります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成29年 3月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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。

（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）

元本の移動

区分	平成29年 3月26日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	平成28年 9月27日
期首元本額	232,369,845,786円
期中追加設定元本額	13,372,172,243円
期中一部解約元本額	11,019,787,815円
期末元本額	234,722,230,214円
期末元本額の内訳	
日本債券インデックスファンド	1,069,019,886円
D C日本債券インデックスファンド	2,897,222,552円
D C日本債券インデックスファンドL	33,822,135,685円
D Cバランスファンド30	6,324,860,186円
D Cバランスファンド50	4,270,450,913円
D Cバランスファンド70	994,698,755円
日本債券インデックスファンド（SMA専用）	250,299,840円
日本債券インデックスe	1,609,367,944円
インデックスコレクション（国内債券）	13,554,893,748円
インデックスコレクション（バランス株式30）	14,405,454,894円
インデックスコレクション（バランス株式50）	1,843,763,408円
インデックスコレクション（バランス株式70）	702,547,736円
私募日本債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	44,691,593,087円
日本債券パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	5,304,083,870円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	961,870,557円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	4,148,452,280円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	291,386,709円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	438,371,672円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	2,089,881,205円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	5,976,189,285円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	1,505,402,408円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	16,737,368,770円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	176,525,607円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	8,757,755,702円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	4,007,904,499円

区分	平成29年 3月26日現在
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	315,307,461円
バランスV A 40（適格機関投資家専用）	1,230,377,512円
V Aバランス株式40（適格機関投資家専用）	146,854,661円
バランスファンドV A（適格機関投資家専用）	4,063,816,521円
V Aバランスファンド2（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	512,009,317円
V Aバランス50 - 50（適格機関投資家専用）	1,120,728,947円
バランスV A 20（適格機関投資家専用）	233,225,062円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	3,477,905,752円
バランスファンドV A 2（適格機関投資家専用）	5,069,513,973円
バランスV A 20 L（適格機関投資家専用）	316,500,708円
バランスV A 25 L（適格機関投資家専用）	2,248,754,986円
バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	37,321,627,106円
世界バランスV A 25（適格機関投資家専用）	697,787,948円
国内バランスV A 30（適格機関投資家専用）	225,232,806円
国内バランスV A 25（適格機関投資家専用）	53,816,254円
V Aバランス20 - 80（適格機関投資家専用）	849,311,221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）	6,279,503円
世界バランスV A 20（適格機関投資家専用）	1,679,278円

（デリバティブ取引に関する注記）

債券関連

（平成29年 3月26日現在）

区分	種類	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	601,801,296	-	601,560,000	241,296
	合計	601,801,296	-	601,560,000	241,296

(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又は計算日に知りうる直近の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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【日本債券インデックスファンド（SMA専用）】

【純資産額計算書】

（平成29年 4月28日現在）

資産総額	337,672,580円
負債総額	329,007円
純資産総額（ - ）	337,343,573円
発行済口数	281,129,715口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2000円
（1万口当たり純資産額）	（12,000円）

（参考）

日本債券マザーファンド

純資産額計算書

（平成29年 4月28日現在）

資産総額	321,357,082,744円
負債総額	3,983,473,679円
純資産総額（ - ）	317,373,609,065円
発行済口数	234,618,007,302口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3527円
（1万口当たり純資産額）	（13,527円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

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)振替受益権について

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。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、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29年 4月28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年間に於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

会社に取締役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發します。

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、招集の手續を経ずに取締役会を開催することができます。

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

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

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

また、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したコンプライアンス・リスク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（委員長はコンプライアンス・リスク統括部担当役員）及び経営会議（議長は社長）に報告されます。

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

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

委託会社の機構は平成29年 6月26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29年4月28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	480	9,300,194
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	51	204,618
単位型公社債投資信託	0	0
合計	531	9,504,812

3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

す。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第30期事業年度（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

また、第31期事業年度の間接会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）の間接財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成27年3月31日現在)	当事業年度 (平成28年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	12,314,170	16,534,066
前払費用	125,306	102,445
未収委託者報酬	4,518,944	5,528,610
繰延税金資産	116,728	121,367
その他	8,789	5,566
流動資産合計	17,083,939	22,292,056
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 57,461	1 55,487
器具備品	1 116,879	1 90,924
その他	-	1 3,748
有形固定資産合計	174,341	150,160
無形固定資産		
ソフトウェア	197,641	215,175
その他	7,648	5,886
無形固定資産合計	205,290	221,062
投資その他の資産		
投資有価証券	60,277	63,797
長期前払費用	5,425	8,021
長期貸付金	25,838	22,838
会員権	25,000	25,000
繰延税金資産	114,415	123,235
その他	463	235
貸倒引当金	25,838	22,838
投資その他の資産合計	205,581	220,289
固定資産合計	585,213	591,512
資産合計	17,669,152	22,883,569

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日現在)	当事業年度 (平成28年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	13,868	14,543
未払金	2,578,595	3,057,975
未払手数料	1,896,826	2,223,498
その他未払金	681,769	834,477
未払費用	52,291	64,411
未払法人税等	924,882	1,445,329
未払消費税等	354,256	246,748
賞与引当金	94,769	98,630
その他	56,222	3,100
流動負債合計	4,074,887	4,930,740
固定負債		
資産除去債務	12,707	12,926
退職給付引当金	342,831	389,941
その他	-	3,056
固定負債合計	355,538	405,924
負債合計	4,430,425	5,336,665
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	350,000	350,000
資本剰余金合計	350,000	350,000
利益剰余金		
利益準備金	65,500	68,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	10,419,991	14,729,555
利益剰余金合計	12,585,491	16,898,055
株主資本合計	13,235,491	17,548,055
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	3,235	1,151
評価・換算差額等合計	3,235	1,151
純資産合計	13,238,726	17,546,904
負債・純資産合計	17,669,152	22,883,569

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	28,159,652	32,163,066
運用受託報酬	8,732	-
営業収益合計	28,168,384	32,163,066
営業費用		
支払手数料	12,922,655	14,102,687
広告宣伝費	130,384	126,914
公告費	880	2,765
調査費	5,994,577	6,758,898
調査費	279,702	331,886
委託調査費	5,712,946	6,425,175
図書費	1,928	1,836
営業雑経費	1,299,065	1,399,773
通信費	17,456	17,552
印刷費	330,921	349,902
協会費	23,182	26,659
諸会費	105	105
情報機器関連費	857,009	927,524
その他営業雑経費	70,390	78,029
営業費用合計	20,347,563	22,391,039
一般管理費		
給料	2,185,555	2,123,392
役員報酬	89,055	89,280
給料・手当	1,839,000	1,759,320
賞与	257,499	274,792
退職給付費用	71,270	73,742
福利費	212,286	222,276
交際費	4,491	6,004
旅費交通費	55,788	67,392
租税公課	42,868	73,989
不動産賃借料	130,938	125,339
減価償却費	129,285	126,985
業務委託費	1 45,054	1 209,510
諸経費	167,290	217,580
一般管理費合計	3,044,830	3,246,214
営業利益	4,775,990	6,525,812

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
営業外収益		
受取利息	6,802	8,092

収益分配金		4,617		2,026
投資有価証券売却益		1,846		350
貸倒引当金戻入		3,000		3,000
その他		1,936		5,272
営業外収益合計		18,203		18,742
営業外費用				
長期前払費用償却	1	27,866	1	27,866
支払補償費		7,656		1,893
投資有価証券売却損		117		365
その他		3,283		14
営業外費用合計		38,924		30,139
経常利益		4,755,269		6,514,415
特別損失				
外国税関連費用	2	56,222		-
特別損失合計		56,222		-
税引前当期純利益		4,699,047		6,514,415
法人税、住民税及び事業税		1,667,610		2,183,255
法人税等調整額		30,739		11,403
法人税等合計		1,698,349		2,171,851
当期純利益		3,000,697		4,342,563

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	62,500	2,100,000	7,452,293	9,614,793	10,264,793
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			3,000,697	3,000,697	3,000,697

株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	2,967,697	2,970,697	2,970,697
当期末残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	2,715	2,715	10,267,508
当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			3,000,697
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	520	520	520
当期変動額合計	520	520	2,971,217
当期末残高	3,235	3,235	13,238,726

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当期変動額			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	65,500	2,100,000	10,419,991	12,585,491	13,235,491
当期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
当期純利益			4,342,563	4,342,563	4,342,563
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	3,000	-	4,309,563	4,312,563	4,312,563
当期末残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	3,235	3,235	13,238,726

当期変動額			
剰余金の配当			30,000
当期純利益			4,342,563
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	4,386	4,386	4,386
当期変動額合計	4,386	4,386	4,308,177
当期末残高	1,151	1,151	17,546,904

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。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度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、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計方針の変更

(企業結合に関する会計基準等の適用)

「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成25年9月13日。以下「企業結合会計基準」という。）及び「事業分離等に関する会計基準」（企業会計基準第7号 平成25年9月13日。以下「事業分離等会計基準」という。）等を当事業年度から適用し、取得関連費用を発生した事業年度の費用として計上する方法に変更しております。また、当事業年度期首以後実施される企業結合については、暫定的な会計処理の確定による取得原価の配分額の見直しを企業結合日の属する事業年度の財務諸表に反映させる方法に変更しております。

企業結合会計基準等の適用については、企業結合会計基準第58 - 2項（4）及び事業分離等会計基準第57 - 4項（4）に定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首時点から将来にわたって適用しております。

なお、これによる損益及び1株当たり情報に与える影響はありません。

未適用の会計基準等

- ・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

(1) 概要

繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いについて、監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」の枠組み、すなわち企業を5つに分類し、当該分類に応じて繰延税金資産の計上額を見積もる枠組みを基本的に踏襲した上で、以下の取扱いについて必要な見直しが行われております。

(分類1)から(分類5)に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い

(分類2)及び(分類3)に係る分類の要件

(分類2)に該当する企業におけるスケジューリング不能な将来減算一時差異に関する取扱い

(分類3)に該当する企業における将来の一時差異等加減算前課税所得の合理的な見積可能期間に関する取扱い

(分類4)に係る分類の要件を満たす企業が(分類2)又は(分類3)に該当する場合の取扱い

(2)適用予定日

平成29年3月期の期首より適用予定であります。

(3)当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表作成時において評価中であります。

表示方法の変更

(損益計算書関係)

前事業年度において、「一般管理費」の「諸経費」に含めていた「業務委託費」は、重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「一般管理費」の「諸経費」に表示していた212,345千円は、「業務委託費」45,054千円、「諸経費」167,290千円として組み替えております。

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27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
建 物	45,415	千円	54,302	千円
器具備品	218,270	"	263,257	"
そ の 他	-	"	841	"
計	263,685	"	318,401	"

(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26年4月1日 至平成27年3月31日)		当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	
業務委託費	37,614	千円	39,733	千円
長期前払費用償却	27,866	"	27,866	"

2外国税関連費用

外国税関連費用56,222千円は、中国税務当局等が平成26年10月31日付に発した「通達79号」に基づき、平成22年3月23日から平成26年11月16日までのQFII(Qualified Foreign Institutional Investors)口座を通じて取得した中国A株の譲渡所得に対して税率10%で遡及課税される金額を合理的に計算した当社の負担額であります。中国A株に投資している当社の対象ファンドは「中国A株SRIマザーファンド」であり、ファンドの当時の受益者に負担を求めることが事実上不可能であるため、当社等が負担しております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成26年6月28日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成26年3月31日	平成26年6月30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27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成27年3月31日	平成27年6月30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28年6月30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とおり提案しております。

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

(リ - ス取引関係)

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成27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	12,314,170	12,314,170	-
（2）未収委託者報酬	4,518,944	4,518,944	-
（3）投資有価証券 其他有価証券	60,274	60,274	-
（4）未払金	(2,578,595)	(2,578,595)	-
（5）未払法人税等	(924,882)	(924,882)	-

（*）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28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	16,534,066	16,534,066	-
（2）未収委託者報酬	5,528,610	5,528,610	-
（3）投資有価証券 其他有価証券	63,794	63,794	-
（4）未払金	(3,057,975)	(3,057,975)	-
（5）未払法人税等	(1,445,329)	(1,445,329)	-

（*）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、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 投資有価証券

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

(4) 未払金、並びに(5) 未払法人税等

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

(注2) 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の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	平成27年3月31日	平成28年3月31日
非上場株式	3	3

これについては、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、「投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成27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	12,314,170	-	-	-
未収委託者報酬	4,518,944	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,576	16,038	-

当事業年度(平成28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	16,534,066	-	-	-
未収委託者報酬	5,528,610	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	6,265	17,912	-

(有価証券関係)

1. 其他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日現在)

(単位:千円)

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	58,207	53,306	4,901
小計	58,207	53,306	4,901
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,066	2,186	120
小計	2,066	2,186	120
合計	60,274	55,492	4,781

当事業年度（平成28年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	10,329	9,998	330
小計	10,329	9,998	330
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	53,465	55,455	1,989
小計	53,465	55,455	1,989
合計	63,794	65,453	1,659

（注）非上場株式（貸借対照表計上額3千円）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ことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自平成26年4月1日 至平成27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
34,635	1,846	117

当事業年度（自平成27年4月1日 至平成28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
20,015	350	365

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 退職給付債務に関する事項

（単位：千円）

	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
（1）退職給付債務	342,831	389,941
（2）退職給付引当金	342,831	389,941

（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。

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27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
（1）退職給付費用	71,270	73,742

（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。

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14,089千円、当事業年度で14,434千円であります。

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	64,846	千円	86,931	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	8,356	"	6,993	"
賞与引当金損金算入限度超過額	31,368	"	30,437	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	110,871	"	119,400	"
外国税関連費用損金不算入額	18,609	"	-	"
その他	5,855	"	7,674	"
繰延税金資産 合計	239,908	"	251,436	"
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	1,546	"	-	"
投資有価証券売却益益金不算入額	7,217	"	6,833	"
繰延税金負債 合計	8,763	"	6,833	"
繰延税金資産の純額	231,144	"	244,602	"

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

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

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

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ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33.06%から、平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29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30.86%に、平成30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30.62%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が15,263千円、その他有価証券評価差額金が27千円、それぞれ減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が15,236千円増加しております。

（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

前事業年度（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,363,914千円
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）	3,178,319千円

（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。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	3,979,867千円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

重要性がないため、記載を省略しております。

（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26年4月1日 至 平成27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）
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	8,852,826	未払手数料	1,374,578
							投資助言費用の支払	3,428,200	その他未払金	381,755

（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27年4月1日 至 平成28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)
兄弟会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料等の支払	10,100,152	未払手数料	1,682,049
							投資助言費用の支払	4,834,722	その他未払金	460,620

(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。

(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27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、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（平成28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、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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	4,412,908円85銭	5,848,968円06銭
1株当たり当期純利益金額	1,000,232円56銭	1,447,521円33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金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
当期純利益	3,000,697千円	4,342,563千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	3,000,697千円	4,342,563千円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

(単位：千円)

第31期中間会計期間末

(平成28年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金	18,232,975
未収委託者報酬	5,229,663
繰延税金資産	79,566

その他流動資産		121,642
流動資産合計		23,663,848
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	51,958
器具備品	1	91,200
その他有形固定資産	1	3,289
有形固定資産合計		146,448
無形固定資産		213,226
投資その他の資産		
投資有価証券		64,884
長期貸付金		21,338
会員権		25,000
その他の投資		7,090
繰延税金資産		130,488
貸倒引当金		21,338
投資その他の資産合計		227,463
固定資産合計		587,137
資産合計		24,250,986
負債の部		
流動負債		
未払金		2,832,550
未払費用		127,589
未払法人税等		973,190
賞与引当金		98,952
その他流動負債	2	123,541
流動負債合計		4,155,824
固定負債		
退職給付引当金		412,240
資産除去債務		13,036
その他固定負債		2,561
固定負債合計		427,838
負債合計		4,583,662

(単位：千円)

第31期中間会計期間末
(平成28年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		350,000
資本剰余金合計		350,000
利益剰余金		
利益準備金		71,500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100,000

繰越利益剰余金	16,849,604
利益剰余金合計	19,021,104
株主資本合計	19,671,104
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	3,780
評価・換算差額等合計	3,780
純資産合計	19,667,324
負債・純資産合計	24,250,986

中間損益計算書

(単位：千円)

		第31期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		15,203,419
営業収益合計		15,203,419
営業費用		10,414,275
一般管理費	1	1,675,104
営業利益		3,114,038
営業外収益	2	6,265
営業外費用		4,736
経常利益		3,115,567
税引前中間純利益		3,115,567
法人税、住民税及び事業税		926,810
法人税等調整額		35,707
法人税等合計		962,518
中間純利益		2,153,049

中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300,000	350,000	350,000
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	-	-	-
当中間期末残高	300,000	350,000	350,000

	株主資本	
	利益剰余金	
	利益剰余金	その他利益剰余金

	利益準備金	別途積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	株主資本合計
当期首残高	68,500	2,100,000	14,729,555	16,898,055	17,548,055
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,000		33,000	30,000	30,000
中間純利益			2,153,049	2,153,049	2,153,049
株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純 額）					
当中間期変動額合計	3,000	-	2,120,049	2,123,049	2,123,049
当中間期末残高	71,500	2,100,000	16,849,604	19,021,104	19,671,104

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,151	1,151	17,546,904
当中間期変動額			
剰余金の配当			30,000
中間純利益			2,153,049
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	2,629	2,629	2,629
当中間期変動額合計	2,629	2,629	2,120,419
当中間期末残高	3,780	3,780	19,667,324

重要な会計方針

第31期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
<p>1. 資産の評価基準及び評価方法</p> <p>有価証券</p> <p>その他有価証券</p> <p>時価のあるもの</p> <p>中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)</p> <p>時価のないもの</p> <p>移動平均法による原価法によっております。</p> <p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産</p> <p>定率法によっております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産</p> <p>定額法によっております。 ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p> <p>3. 引当金の計上基準</p>

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計方針の変更

第31期中間会計期間
(自 平成28年4月1日
至 平成28年9月30日)

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第32号 平成28年6月17日)を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ14千円増加しております。

追加情報

第31期中間会計期間
(自 平成28年4月1日
至 平成28年9月30日)

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)を当中間会計期間から適用しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第31期中間会計期間末
(平成28年9月30日)

1 有形固定資産の減価償却累計額

建 物	58,267千円
器具備品	281,219千円
その他有形固定資産	1,300千円
計	340,787千円

- 2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他流動負債」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

第31期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	22,496千円
無形固定資産	41,925千円
2 営業外収益の主要項目	
受取利息	3,038千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

配当金支払額

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

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（金融商品関係）

第31期中間会計期間末（平成28年9月30日）

平成28年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）を参照ください。）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	18,232,975	18,232,975	-
(2)未収委託者報酬	5,229,663	5,229,663	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	64,881	64,881	-
(4)未払金	(2,832,550)	(2,832,550)	-
(5)未払法人税等	(973,190)	(973,190)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、並びに(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、並びに(5)未払法人税等

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

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額3千円）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 その他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第31期中間会計期間末（平成28年9月30日）

その他有価証券

（単位：千円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	7,754	7,496	258
小計	7,754	7,496	258
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	57,127	62,834	5,707
小計	57,127	62,834	5,707
合計	64,881	70,330	5,449

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額3千円）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ことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

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

(関連情報)

第31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

ております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
J-REIT・リサーチ・オープン（毎月決算型）	1,855,519千円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第31期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第31期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）	
1株当たり純資産額	6,555,774円71銭
1株当たり中間純利益	717,683円22銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第31期中間会計期間 （自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）
中間純利益	2,153,049千円
普通株式に係る中間純利益	2,153,049千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社は、平成28年6月30日に社外取締役との責任限定契約に係る規定を追加しました。

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成29年 6月26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28年9月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成28年9月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
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。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成28年9月末日現在）

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

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

第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融

商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。

また、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28年 6 月 3 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 白川 芳樹指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第30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28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成28年11月25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

中島紀子

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）の平成27年9月25日から平成28年9月26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）の平成28年9月26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. XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 白川 芳樹
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹内 知明
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年5月26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

中島紀子

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）の平成28年9月27日から平成29年3月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日本債券インデックスファンド（SMA専用）の平成29年3月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年9月27日から平成29年3月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。