【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成25年９月12日
【発行者名】	レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 田島 廣久
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目５番１号
【事務連絡者氏名】	藤田 剛志
【電話番号】	03-5219-5700
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ＬＭ・ユーロ・アルファ ポートフォリオＡ（為替ヘッジなし） ＬＭ・ユーロ・アルファ ポートフォリオＢ（為替ヘッジあり）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	各ファンド 5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

Ⅰ【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、平成25年３月14日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また記載事項の一部に訂正すべき事項がありこれを訂正するため、本訂正届出書を提出いたします。

Ⅱ【訂正の内容】

下線部＿＿は訂正箇所を表します。

第一部【証券情報】

(6)【申込単位】

（訂正前）

申込単位は、新規でお申込みする場合は50万円以上１円単位、追加でお申込みする場合は１万円以上１円単位とします。
また、自動けいぞく投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合は、１口単位で取得することができます。「ポートフォリオＡ」と「ポートフォリオＢ」の相互間でスイッチングを行う場合の申込単位は、１万円以上１円単位とします。ただし、受益者が保有する「ポートフォリオＡ」または「ポートフォリオＢ」の受益権のすべてを一部解約または買取請求した場合の手取金をもって取得申込を行う場合は、１円以上１円単位でお申込みいただけます。

（訂正後）

申込単位は販売会社毎に定められておりますので、販売会社にお問合せください。
販売会社につきましては、下記の照会先までお問合せください。

レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社
ホームページのアドレス　http://www.leggmason.co.jp
電話番号：03(5219)5940（受付時間：営業日の午前９時から午後５時まで）

※ポートフォリオＡとポートフォリオＢとの間でスイッチングを行う場合の申込単位は、販売会社にお問合せください。

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】

(3)【ファンドの仕組み】

（訂正前）

（前略）

②委託会社の概況（平成25年１月末現在）

■資本金の額

1,000百万円

（以下略）

（訂正後）

（前略）

②委託会社の概況（平成25年７月末現在）

■資本金の額

1,000百万円

（以下略）

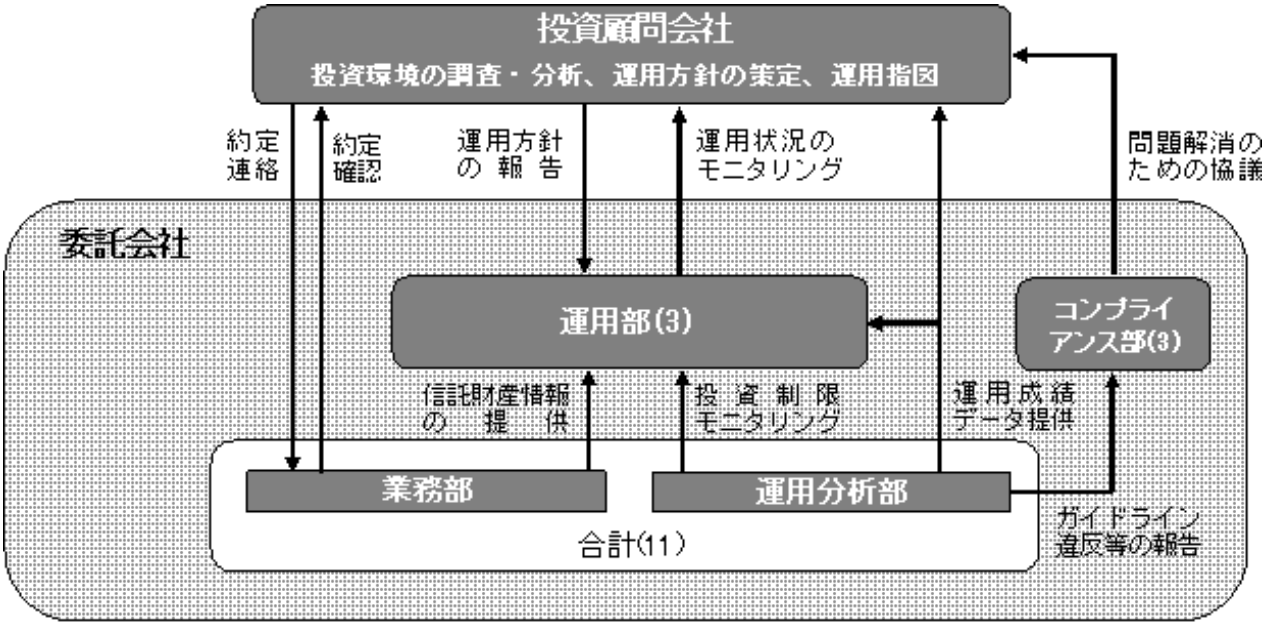
2【投資方針】

(3)【運用体制】

（訂正前）

（前略）

■当ファンドの運用体制



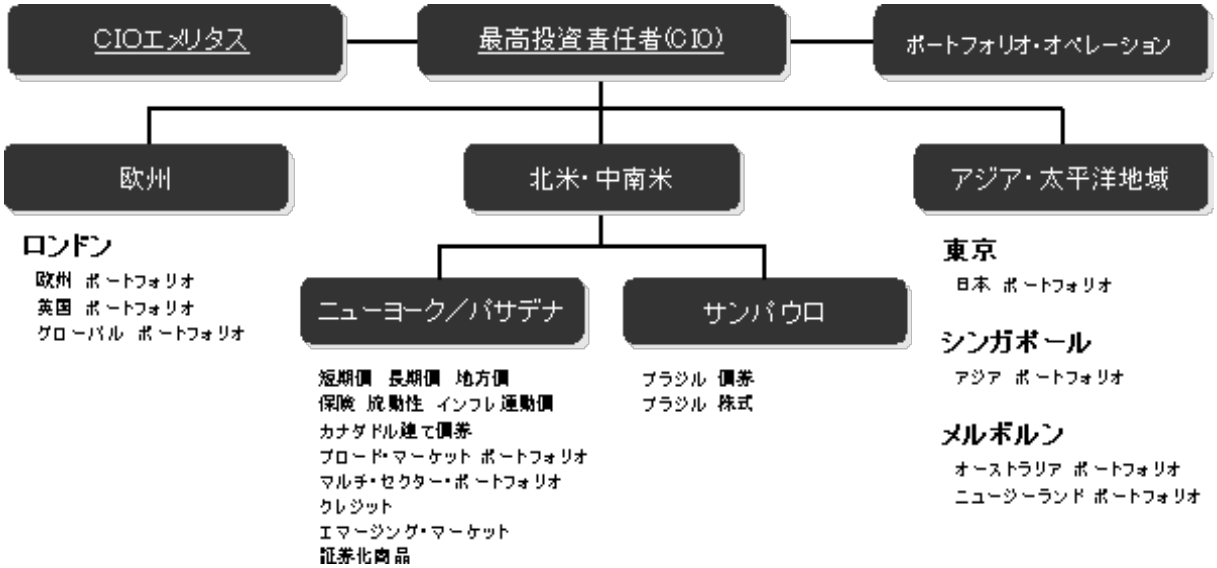
（注）括弧内は平成25年1月末現在の各部署に属する人数（業務部及び運用分析部は、上記業務に従事する人数の合計）を示します。

（中略）

（参考）投資顧問会社の運用体制

（中略）

①ウエスタン・アセットの運用体制



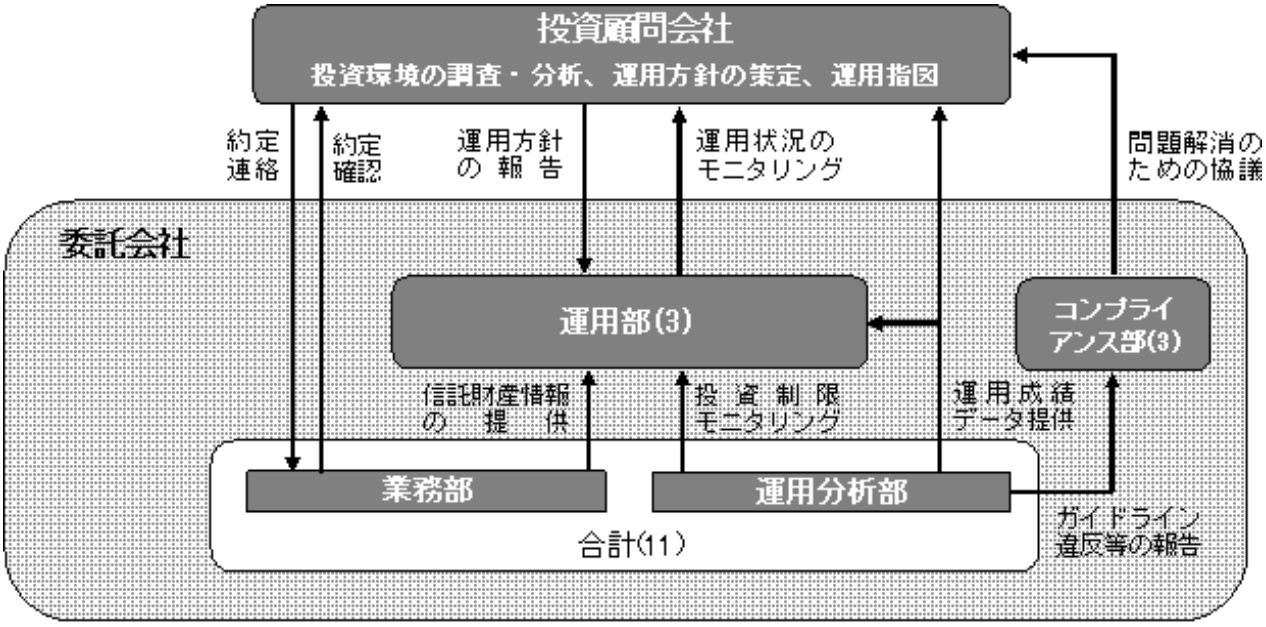
上記は、投資顧問会社２社を含めたウエスタン・アセットのグループ全体の運用体制を示したものです。

（以下略）

（訂正後）

（前略）

■当ファンドの運用体制



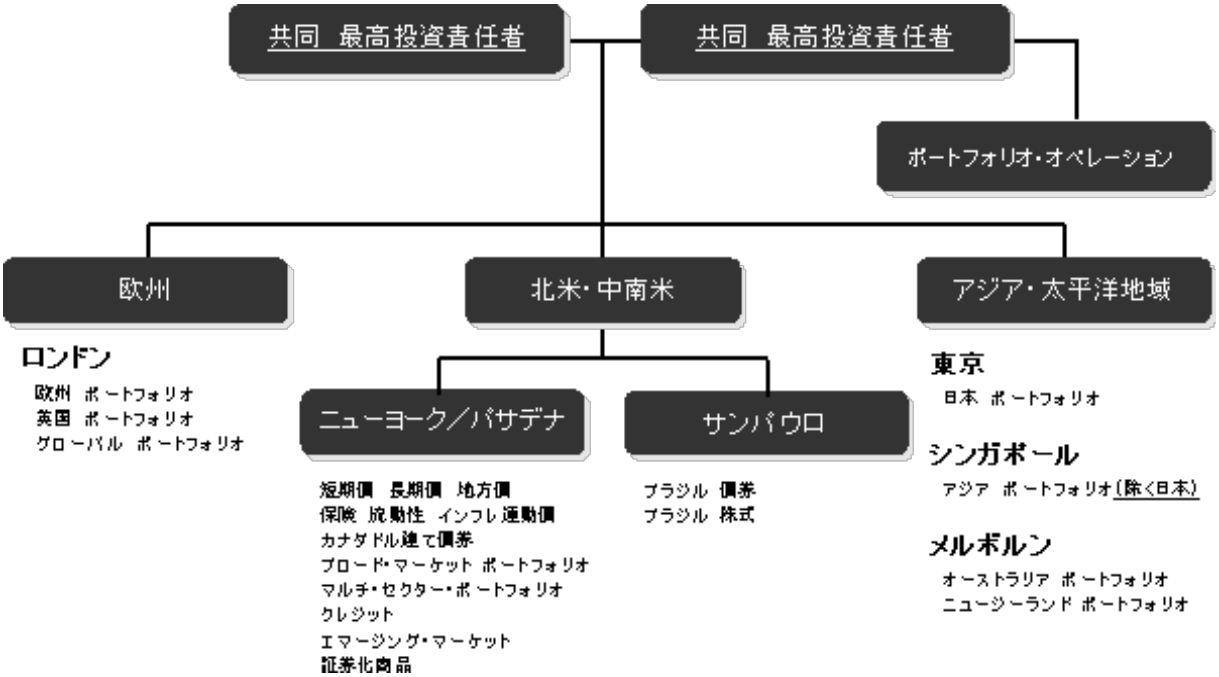
（注）括弧内は平成25年7月末現在の各部署に属する人数（業務部及び運用分析部は、上記業務に従事する人数の合計）を示します。

（中略）

（参考）投資顧問会社の運用体制

（中略）

①ウエスタン・アセットの運用体制



上記は、投資顧問会社２社を含めたウエスタン・アセットのグループ全体の運用体制を示したものです。

（以下略）

４【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

（訂正前）

（前略）

①個人の受益者に対する課税

（中略）

期間	税率
平成25年12月31日まで	10.147%（所得税７%、復興特別所得税0.147%、地方税３%）
平成26年１月１日から 平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税５%）
平成50年１月１日以降	20%（所得税15%、地方税５%）

②法人の受益者に対する課税

（中略）

（注）上記は、平成25年１月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。
買取請求時における課税上の取扱いについては、販売会社へお問合せください。

（訂正後）

（前略）

①個人の受益者に対する課税

（中略）

期間	税率
平成25年12月31日まで	10.147%（所得税７%、復興特別所得税0.147%、地方税３%）
平成26年１月１日から 平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税５%）
平成50年１月１日以降	20%（所得税15%、地方税５%）

c.少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合
公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です（平成26年１月１日以降）。
少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」は、平成26年１月１日以降の非課税制度です。ＮＩＳＡをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が５年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

（中略）

（注）上記は、平成25年７月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。
買取請求時における課税上の取扱いについては、販売会社へお問合せください。

５【運用状況】

原届出書の第二部 ファンド情報 第１ ファンドの状況 ５ 運用状況につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

（更新・訂正後）

(1)【投資状況】

LM・ユーロ・アルファ ポートフォリオA （為替ヘッジなし）

平成25年7月末現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	26,897,520	5.76
	カナダ	4,234,343	0.91
	イタリア	148,110,601	31.74
	フランス	104,766,133	22.45
	スペイン	19,800,294	4.24
	ベルギー	41,016,989	8.79
	メキシコ	17,653,904	3.78
	ポーランド	6,139,464	1.32
	小計	368,619,248	78.99
特殊債券	アメリカ	18,974,648	4.07
社債券	アメリカ	35,590,711	7.62
	オーストラリア	4,600,108	0.98
	イギリス	3,059,362	0.66
	アイルランド	1,946,888	0.42
	小計	45,197,069	9.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		33,881,159	7.26
合計(純資産総額)		466,672,124	100.00

（注1）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。
（注2）その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しております。評価においては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

種類	資産の名称	取引所	買建／売建	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物	US 10YR 1309	CBOT	売建	49,597,831	△10.63
	EB 5YR 1309	EUX	買建	376,346,493	80.64
	EB 10YR 1309	EUX	売建	185,256,225	△39.70
	UK 10YR 1309	LIFFE	買建	33,804,135	7.24
債券オプション	FVU3 C 0823	CBOT	売建	245,966	△0.05
	TYU3 C 0823	CBOT	売建	101,145	△0.02
	TYU3 C 0823	CBOT	売建	32,182	△0.01
	TYU3 P 0823	CBOT	売建	105,743	△0.02
	TYU3 P 0823	CBOT	売建	47,507	△0.01
	USU3 C 0823	CBOT	売建	21,455	△0.00
	USU3 C 0823	CBOT	売建	13,792	△0.00
	USU3 C 0823	CBOT	売建	18,390	△0.00

LM・ユーロ・アルファ ポートフォリオB （為替ヘッジあり）

平成25年7月末現在

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	42,801,767	3.18
	カナダ	14,820,202	1.10
	ドイツ	11,236,007	0.83
	イタリア	423,924,047	31.51
	フランス	286,575,057	21.29
	イギリス	3,844,595	0.29
	スペイン	79,201,178	5.88
	ベルギー	104,489,192	7.76
	メキシコ	50,720,224	3.77
	ポーランド	16,883,527	1.25
	小計	1,034,495,796	76.86
特殊債券	アメリカ	88,308,782	6.56
社債券	アメリカ	86,611,173	6.44

	フランス	14,681,344	1.09
	オーストラリア	13,552,839	1.01
	イギリス	9,457,626	0.70
	アイルランド	5,840,664	0.43
	チャネル諸島	9,765,652	0.73
	小計	139,909,298	10.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		83,206,160	6.18
合計(純資産総額)		1,345,920,036	100.00

（注1）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。
（注2）その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しております。評価においては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

種類	資産の名称	取引所	買建／売建	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物	US 5YR 1309	CBOT	売建	190,434,576	△14.15
	US 2YR 1309	CBOT	買建	108,025,925	8.03
	US 10YR 1309	CBOT	売建	61,997,289	△4.61
	US 20YR 1309	CBOT	買建	13,133,525	0.98
	EB 5YR 1309	EUX	買建	1,014,499,242	75.38
	EB 10YR 1309	EUX	売建	481,666,185	△35.79
	UK 10YR 1309	LIFFE	買建	67,608,270	5.02
債券オプション	FVU3 C 0823	CBOT	売建	491,933	△0.04
	TYU3 C 0823	CBOT	売建	303,437	△0.02
	TYU3 C 0823	CBOT	売建	96,548	△0.01
	TYU3 P 0823	CBOT	売建	387,727	△0.03
	TYU3 P 0823	CBOT	売建	142,523	△0.01
	USU3 C 0823	CBOT	買建	55,170	0.00
	USU3 C 0823	CBOT	売建	85,820	△0.01
	USU3 C 0823	CBOT	売建	27,585	△0.00
	USU3 C 0823	CBOT	売建	36,780	△0.00

(2)【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

ＬＭ・ユーロ・アルファ ポートフォリオＡ （為替ヘッジなし）

a．上位30銘柄

平成25年7月末現在

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量 (券面総額)	帳簿価額単価(円) 帳簿価額金額(円)	評価額単価(円) 評価額金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T.	630,000.00	14,894.36 93,834,508	14,810.74 93,307,688	4.250000	2017/10/25	19.99
2	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	630,000.00	13,511.67 85,123,551	13,519.86 85,175,168	3.750000	2016/4/15	18.25
3	ベルギー	国債証券	BELGIUM GOVT	210,000.00	13,992.46 29,384,186	13,943.96 29,282,318	3.750000	2015/9/28	6.27
4	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	200,000.00	14,049.95 28,099,903	14,123.29 28,246,599	5.500000	2022/11/1	6.05
5	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	190,000.00	13,176.79 25,035,912	13,158.32 25,000,825	3.500000	2018/6/1	5.36
6	スペイン	国債証券	SPAIN GOVT	140,000.00	14,083.76 19,717,270	14,143.06 19,800,294	5.500000	2017/7/30	4.24
7	アメリカ	特殊債券	FNMA 30YR AUG FWD	200,000.00	9,380.43 18,760,865	9,487.32 18,974,648	3.000000	2043/8/1	4.07
8	ベルギー	国債証券	BELGIUM GOVT	80,000.00	14,784.47 11,827,579	14,668.33 11,734,671	4.000000	2018/3/28	2.51
9	アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	70,000.00	16,709.86 11,696,905	16,643.79 11,650,659	7.375000	2019/9/4	2.50
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	130,000.00	9,445.10 12,278,635	8,916.08 11,590,910	3.125000	2042/2/15	2.48
11	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T.	80,000.00	14,530.61 11,624,493	14,323.05 11,458,445	3.250000	2021/10/25	2.46
12	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	75,000.00	13,201.37 9,901,031	12,917.34 9,688,009	5.000000	2040/9/1	2.08
13	メキシコ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	1,197,000.00	837.27 10,022,143	795.82 9,525,997	6.500000	2022/6/9	2.04
14	メキシコ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	930,000.00	901.65 8,385,368	873.96 8,127,907	8.000000	2020/6/11	1.74

15	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP	50,000.00	15,045.74 7,522,872	14,984.49 7,492,245	5.125000	2019/10/23	1.61
16	アメリカ	国債証券	US T STRIP PRINC	200,000.00	3,819.75 7,639,510	3,542.75 7,085,514	－	2040/5/15	1.52
17	ポーランド	国債証券	POLAND GOVT	200,000.00	3,060.21 6,120,436	3,069.73 6,139,464	4.000000	2023/10/25	1.32
18	アメリカ	社債券	WACHOVIA CAP TRUST FRN	60,000.00	9,677.65 5,806,591	9,510.91 5,706,549	5.569750	2049/12/31	1.22
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	60,000.00	8,706.51 5,223,908	8,195.04 4,917,026	2.750000	2042/11/15	1.05
20	オーストラリア	社債券	RIO TINTO FIN USA LTD	40,000.00	11,786.86 4,714,744	11,500.27 4,600,108	6.500000	2018/7/15	0.99
21	カナダ	国債証券	CANADIAN GOVT	40,000.00	10,741.51 4,296,604	10,585.85 4,234,343	4.250000	2018/6/1	0.91
22	アメリカ	国債証券	US T STRIP PRINC	100,000.00	3,572.64 3,572,642	3,304.07 3,304,070	－	2041/11/15	0.71
23	アメリカ	社債券	JP MORGAN CHASE & CO	30,000.00	10,561.84 3,168,552	10,364.80 3,109,440	4.500000	2022/1/24	0.67
24	イギリス	社債券	DIGNITY FINANCE PLC	17,046.36	17,949.84 3,059,795	17,947.30 3,059,362	6.310000	2023/12/31	0.66
25	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP INC	20,000.00	11,162.19 2,232,438	11,159.34 2,231,869	6.250000	2041/2/1	0.48
26	アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	20,000.00	11,031.44 2,206,289	10,718.67 2,143,734	5.875000	2037/5/29	0.46
27	アイルランド	社債券	XL GROUP PLC FRN	20,000.00	9,624.10 1,924,820	9,734.44 1,946,888	6.500000	2049/12/31	0.42
28	アメリカ	社債券	SAFEWAY INC	10,000.00	11,366.58 1,136,658	11,301.85 1,130,185	6.350000	2017/8/15	0.24
29	アメリカ	社債券	AT&T INC	10,000.00	10,427.96 1,042,796	10,153.83 1,015,383	3.875000	2021/8/15	0.22
30	アメリカ	社債券	KRAFT FOODS INC	5,000.00	11,285.56 564,278	11,150.12 557,506	5.375000	2020/2/10	0.12

（注1）変動利付債券は平成25年7月末現在の利率です。
（注2）平成25年7月末現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
（注3）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価額の比率をいいます。

b．種類別及び業種別投資比率

平成25年7月末現在

種類	投資比率（%）
国債証券	78.99
特殊債券	4.07
社債券	9.68
合計	92.74

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する各種類の評価額の比率をいいます。

LM・ユーロ・アルファ ポートフォリオB （為替ヘッジあり）

a．上位30銘柄

平成25年7月末現在

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量 (券面総額)	帳簿価額単価(円) 帳簿価額金額(円)	評価額単価(円) 評価額金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	1,910,000.00	13,511.67 258,072,988	13,519.86 258,229,477	3.750000	2016/4/15	19.19
2	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T.	1,030,000.00	13,804.28 142,184,159	13,774.89 141,881,428	3.000000	2015/10/25	10.54
3	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T.	700,000.00	14,530.61 101,714,315	14,323.05 100,261,397	3.250000	2021/10/25	7.45
4	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	570,000.00	14,056.71 80,123,284	14,123.29 80,502,809	5.500000	2022/11/1	5.98
5	スペイン	国債証券	SPAIN GOVT	560,000.00	14,083.76 78,869,082	14,143.06 79,201,178	5.500000	2017/7/30	5.88
6	ベルギー	国債証券	BELGIUM GOVT	560,000.00	13,992.46 78,357,830	13,943.96 78,086,181	3.750000	2015/9/28	5.80
7	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	510,000.00	13,176.79 67,201,659	13,158.32 67,107,477	3.500000	2018/6/1	4.99
8	アメリカ	特殊債券	FNMA 15YR AUG FWD	600,000.00	9,770.07 58,620,423	9,781.94 58,691,687	2.500000	2028/8/1	4.36
9	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T.	300,000.00	14,894.36 44,683,099	14,810.74 44,432,232	4.250000	2017/10/25	3.30
10	アメリカ	特殊債券	FNMA 30YR AUG FWD	300,000.00	9,804.93 29,414,805	9,872.36 29,617,095	3.500000	2043/8/1	2.20
11	メキシコ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	3,518,000.00	837.27 29,455,222	795.82 27,997,043	6.500000	2022/6/9	2.08
12	ベルギー	国債証券	BELGIUM GOVT	180,000.00	14,784.47 26,612,053	14,668.33 26,403,011	4.000000	2018/3/28	1.96
13	メキシコ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	2,600,000.00	901.65 23,442,965	873.96 22,723,181	8.000000	2020/6/11	1.69

14	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI	140,000.00	13,201.37 18,481,925	12,917.34 18,084,284	5.000000	2040/9/1	1.34
15	ポーランド	国債証券	POLAND GOVT	550,000.00	3,060.21 16,831,199	3,069.73 16,883,527	4.000000	2023/10/25	1.25
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	200,000.00	8,706.51 17,413,031	8,195.04 16,390,087	2.750000	2042/11/15	1.22
17	アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	90,000.00	16,709.86 15,038,877	16,643.79 14,979,419	7.375000	2019/9/4	1.11
18	カナダ	国債証券	CANADIAN GOVT	140,000.00	10,741.51 15,038,115	10,585.85 14,820,202	4.250000	2018/6/1	1.10
19	フランス	社債券	VIVENDI SA	100,000.00	14,845.33 14,845,337	14,681.34 14,681,344	4.750000	2021/7/13	1.09
20	ドイツ	国債証券	BUNDES REPUBLIC DE	80,000.00	14,051.12 11,240,897	14,045.00 11,236,007	3.500000	2016/1/4	0.83
21	アメリカ	国債証券	US T STRIP PRINC	340,000.00	3,572.64 12,146,984	3,304.07 11,233,838	－	2041/11/15	0.83
22	アメリカ	国債証券	US T STRIP PRINC	290,000.00	3,819.75 11,077,289	3,542.75 10,273,996	－	2040/5/15	0.76
23	オーストラリア	社債券	WESTPAC BANKING	100,000.00	10,151.28 10,151,283	10,102.75 10,102,758	7.250000	2020/2/11	0.75
24	チャネル諸島	社債券	HSBC CAPITAL FDG FRN	60,000.00	16,108.38 9,665,029	16,276.08 9,765,652	8.208000	2049/6/30	0.73
25	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP	63,000.00	15,543.44 9,792,370	15,475.42 9,749,520	6.375000	2018/5/2	0.72
26	イギリス	社債券	BARCLAYS BANK PLC	70,000.00	13,582.42 9,507,695	13,510.89 9,457,626	5.250000	2014/5/27	0.70
27	アメリカ	社債券	CITIGROUP INC	80,000.00	11,031.44 8,825,159	10,718.67 8,574,938	5.875000	2037/5/29	0.64
28	アメリカ	社債券	WACHOVIA CAP TRUST FRN	90,000.00	9,677.65 8,709,886	9,510.91 8,559,824	5.569750	2049/12/31	0.64
29	アメリカ	社債券	JP MORGAN CHASE & CO	80,000.00	10,561.84 8,449,474	10,364.80 8,291,840	4.500000	2022/1/24	0.62
30	アメリカ	社債券	GOLDMAN SACHS GROUP	50,000.00	15,045.74 7,522,872	14,984.49 7,492,245	5.125000	2019/10/23	0.56

（注1）変動利付債券は平成25年7月末現在の利率です。
（注2）平成25年7月末現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。
（注3）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価額の比率をいいます。

b．種類別及び業種別投資比率

平成25年7月末現在

種類	投資比率（%）
国債証券	76.86
特殊債券	6.56
社債券	10.40
合計	93.82

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する各種類の評価額の比率をいいます。

②【投資不動産物件】

LM・ユーロ・アルファ ポートフォリオA （為替ヘッジなし）

該当事項はありません。

LM・ユーロ・アルファ ポートフォリオB （為替ヘッジあり）

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

LM・ユーロ・アルファ ポートフォリオA （為替ヘッジなし）

平成25年7月末現在

種類	国名	取引所	銘柄名	売買区分	数量	通貨	帳簿価額	評価額金額	評価額金額(円)	投資比率(%)
債券先物	アメリカ	CBOT	US 10YR 1309	売建	4	ドル	517,250.00	505,687.52	49,597,831	△10.63
	ドイツ	EUX	EB 5YR 1309	買建	23	ユーロ	2,901,909.20	2,893,860.00	376,346,493	80.64
	ドイツ	EUX	EB 10YR 1309	売建	10	ユーロ	1,436,107.70	1,424,500.00	185,256,225	△39.70
	イギリス	LIFFE	UK 10YR 1309	買建	2	ポンド	230,620.00	226,160.00	33,804,135	7.24
債券オプション	アメリカ	CBOT	FVU3 C 0823	売建	3	ドル	1,349.63	2,507.82	245,966	△0.05
	アメリカ	CBOT	TYU3 C 0823	売建	2	ドル	1,024.75	1,031.26	101,145	△0.02
	アメリカ	CBOT	TYU3 C 0823	売建	1	ドル	371.75	328.13	32,182	△0.01
	アメリカ	CBOT	TYU3 P 0823	売建	3	ドル	2,271.51	1,078.14	105,743	△0.02
	アメリカ	CBOT	TYU3 P 0823	売建	1	ドル	434.25	484.38	47,507	△0.01
	アメリカ	CBOT	USU3 C 0823	売建	1	ドル	559.25	218.75	21,455	△0.00
	アメリカ	CBOT	USU3 C 0823	売建	1	ドル	231.13	140.63	13,792	△0.00
	アメリカ	CBOT	USU3 C 0823	売建	2	ドル	1,587.25	187.50	18,390	△0.00

（注1）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。
（注2）評価においては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
（注3）評価額は、平成25年7月末現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

ＬＭ・ユーロ・アルファ ポートフォリオＢ （為替ヘッジあり）

平成25年7月末現在

種類	国名	取引所	銘柄名	売買区分	数量	通貨	帳簿価額	評価額金額	評価額金額(円)	投資比率(%)
債券先物	アメリカ	CBOT	US 5YR 1309	売建	16	ドル	1,960,000.00	1,941,624.96	190,434,576	△14.15
	アメリカ	CBOT	US 2YR 1309	買建	5	ドル	1,101,796.90	1,101,406.25	108,025,925	8.03
	アメリカ	CBOT	US 10YR 1309	売建	5	ドル	630,483.77	632,109.40	61,997,289	△4.61
	アメリカ	CBOT	US 20YR 1309	買建	1	ドル	134,065.75	133,906.25	13,133,525	0.98
	ドイツ	EUX	EB 5YR 1309	買建	62	ユーロ	7,823,846.10	7,800,840.00	1,014,499,242	75.38
	ドイツ	EUX	EB 10YR 1309	売建	26	ユーロ	3,732,220.80	3,703,700.00	481,666,185	△35.79
	イギリス	LIFFE	UK 10YR 1309	買建	4	ポンド	461,240.00	452,320.00	67,608,270	5.02
債券オプション	アメリカ	CBOT	FVU3 C 0823	売建	6	ドル	2,699.26	5,015.64	491,933	△0.04
	アメリカ	CBOT	TYU3 C 0823	売建	6	ドル	3,074.25	3,093.78	303,437	△0.02
	アメリカ	CBOT	TYU3 C 0823	売建	3	ドル	1,115.25	984.39	96,548	△0.01
	アメリカ	CBOT	TYU3 P 0823	売建	11	ドル	8,401.77	3,953.18	387,727	△0.03
	アメリカ	CBOT	TYU3 P 0823	売建	3	ドル	1,302.75	1,453.14	142,523	△0.01
	アメリカ	CBOT	USU3 C 0823	買建	1	ドル	768.88	562.50	55,170	0.00
	アメリカ	CBOT	USU3 C 0823	売建	4	ドル	2,049.50	875.00	85,820	△0.01
	アメリカ	CBOT	USU3 C 0823	売建	2	ドル	462.26	281.26	27,585	△0.00
	アメリカ	CBOT	USU3 C 0823	売建	4	ドル	3,174.50	375.00	36,780	△0.00

（注1）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。
（注2）評価においては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
（注3）評価額は、平成25年7月末現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

ＬＭ・ユーロ・アルファ ポートフォリオＡ （為替ヘッジなし）

期間末	純資産総額(円)（分配落）	純資産総額(円)（分配付）	基準価額(円)（分配落）	基準価額(円)（分配付）
第 1特定期間 （平成11年 6月18日）	17,394,820,943	17,527,756,118	9,160	9,230
第 2特定期間 （平成11年12月20日）	8,484,524,329	8,608,982,976	7,213	7,293
第 3特定期間 （平成12年 6月19日）	6,691,469,556	6,691,469,556	7,002	7,002
第 4特定期間 （平成12年12月18日）	5,447,226,362	5,447,226,362	6,615	6,615
第 5特定期間 （平成13年 6月18日）	4,717,185,545	4,717,185,545	7,388	7,388
第 6特定期間 （平成13年12月18日）	4,985,247,092	4,985,247,092	8,344	8,344
第 7特定期間 （平成14年 6月18日）	4,801,276,733	4,895,376,490	8,348	8,508
第 8特定期間 （平成14年12月18日）	3,826,359,324	3,903,380,224	8,945	9,105
第 9特定期間 （平成15年 6月18日）	2,586,803,665	2,635,403,048	10,375	10,535
第10特定期間 （平成15年12月18日）	2,075,245,144	2,109,621,762	9,801	9,961
第11特定期間 （平成16年 6月18日）	1,849,901,312	1,880,812,544	9,688	9,848
第12特定期間 （平成16年12月20日）	1,796,952,605	1,825,570,915	10,287	10,447
第13特定期間 （平成17年 6月20日）	1,579,637,763	1,605,875,991	9,884	10,044
第14特定期間 （平成17年12月19日）	1,389,956,065	1,412,420,318	10,183	10,343
第15特定期間 （平成18年 6月19日）	1,289,310,930	1,309,924,636	10,330	10,490
第16特定期間 （平成18年12月18日）	1,300,892,494	1,320,117,868	10,986	11,146
第17特定期間 （平成19年 6月18日）	1,248,111,780	1,265,880,208	11,308	11,468
第18特定期間 （平成19年12月18日）	1,146,895,802	1,163,652,969	11,184	11,344
第19特定期間 （平成20年 6月18日）	1,100,550,196	1,116,681,095	10,948	11,108
第20特定期間 （平成20年12月18日）	765,788,814	780,955,655	8,263	8,423
第21特定期間 （平成21年 6月18日）	767,998,939	782,075,125	8,784	8,944
第22特定期間 （平成21年12月18日）	730,883,387	744,279,075	8,904	9,064
第23特定期間 （平成22年 6月18日）	613,737,515	626,237,806	7,940	8,100
第24特定期間 （平成22年12月20日）	538,557,437	549,948,676	7,630	7,790

第25特定期間　(平成23年 6月20日)	528,393,531	539,282,305	7,792	7,952
第26特定期間　(平成23年12月19日)	416,795,642	427,102,099	6,671	6,831
第27特定期間　(平成24年 6月18日)	409,270,555	418,816,041	6,953	7,113
第28特定期間　(平成24年12月18日)	444,047,668	453,055,526	8,021	8,181
第29特定期間　(平成25年 6月18日)	467,159,992	475,463,267	9,225	9,385
平成24年 7月末	392,242,766	－	6,790	－
8月末	404,622,344	－	7,056	－
9月末	409,958,890	－	7,181	－
10月末	419,635,045	－	7,449	－
11月末	434,716,553	－	7,782	－
12月末	465,771,131	－	8,373	－
平成25年 1月末	495,679,473	－	9,011	－
2月末	487,715,676	－	8,944	－
3月末	472,648,519	－	8,869	－
4月末	500,025,918	－	9,579	－
5月末	503,241,665	－	9,810	－
6月末	472,584,489	－	9,267	－
7月末	466,672,124	－	9,424	－

（注1）分配付純資産総額は、各特定期間末の純資産総額に、各特定期間中に支払われた分配金の総額を加算しております。
（注2）基準価額は1万口当たりの純資産額です。

ＬＭ・ユーロ・アルファ ポートフォリオＢ （為替ヘッジあり）

期間末	純資産総額(円)（分配落）	純資産総額(円)（分配付）	基準価額(円)（分配落）	基準価額(円)（分配付）
第 1特定期間　(平成11年 6月18日)	23,434,421,758	23,505,411,980	9,903	9,933
第 2特定期間　(平成11年12月20日)	21,078,674,229	21,224,694,976	9,258	9,318
第 3特定期間　(平成12年 6月19日)	17,165,606,151	17,284,619,285	8,965	9,025
第 4特定期間　(平成12年12月18日)	14,849,277,440	14,955,386,466	8,652	8,712
第 5特定期間　(平成13年 6月18日)	14,656,015,080	14,756,440,312	8,795	8,855
第 6特定期間　(平成13年12月18日)	12,621,135,180	12,709,670,078	8,916	8,976
第 7特定期間　(平成14年 6月18日)	6,400,127,696	6,450,857,585	8,736	8,796
第 8特定期間　(平成14年12月18日)	6,025,610,414	6,067,445,281	8,771	8,831
第 9特定期間　(平成15年 6月18日)	5,501,045,403	5,538,910,831	9,055	9,115
第10特定期間　(平成15年12月18日)	5,126,897,360	5,161,631,916	8,913	8,973
第11特定期間　(平成16年 6月18日)	4,784,251,410	4,817,672,066	8,892	8,952
第12特定期間　(平成16年12月20日)	4,426,698,409	4,457,583,235	8,941	9,001
第13特定期間　(平成17年 6月20日)	3,501,082,397	3,525,849,716	8,926	8,986
第14特定期間　(平成17年12月19日)	3,096,011,867	3,117,659,229	8,763	8,823
第15特定期間　(平成18年 6月19日)	2,594,786,877	2,613,917,314	8,452	8,512
第16特定期間　(平成18年12月18日)	2,503,753,522	2,521,752,173	8,420	8,480
第17特定期間　(平成19年 6月18日)	2,315,948,362	2,333,445,124	8,017	8,077
第18特定期間　(平成19年12月18日)	2,226,461,216	2,243,246,741	7,965	8,025
第19特定期間　(平成20年 6月18日)	1,915,063,755	1,930,415,102	7,494	7,554
第20特定期間　(平成20年12月18日)	1,586,927,553	1,600,401,346	7,331	7,391
第21特定期間　(平成21年 6月18日)	1,574,808,615	1,587,620,346	7,398	7,458
第22特定期間　(平成21年12月18日)	1,628,145,916	1,640,544,773	7,905	7,965
第23特定期間　(平成22年 6月18日)	1,512,789,574	1,524,074,970	8,079	8,139
第24特定期間　(平成22年12月20日)	1,472,917,378	1,484,053,648	7,965	8,025
第25特定期間　(平成23年 6月20日)	1,428,516,376	1,439,515,848	7,838	7,898
第26特定期間　(平成23年12月19日)	1,289,359,132	1,299,842,720	7,673	7,733
第27特定期間　(平成24年 6月18日)	1,334,932,451	1,344,916,841	8,054	8,114
第28特定期間　(平成24年12月18日)	1,396,211,916	1,406,066,089	8,527	8,587

第29特定期間　（平成25年 6月18日）	1,352,401,341	1,361,815,006	8,662	8,722
平成24年 7月末	1,363,248,691	－	8,244	－
8月末	1,375,354,216	－	8,345	－
9月末	1,380,477,382	－	8,364	－
10月末	1,376,966,859	－	8,407	－
11月末	1,392,928,287	－	8,504	－
12月末	1,403,296,503	－	8,566	－
平成25年 1月末	1,402,740,066	－	8,562	－
2月末	1,414,551,232	－	8,641	－
3月末	1,372,409,096	－	8,690	－
4月末	1,386,464,688	－	8,833	－
5月末	1,373,079,803	－	8,795	－
6月末	1,340,180,812	－	8,585	－
7月末	1,345,920,036	－	8,637	－

（注1）分配付純資産総額は、各特定期間末の純資産総額に、各特定期間中に支払われた分配金の総額を加算しております。
（注2）基準価額は1万口当たりの純資産額です。

②【分配の推移】

LM・ユーロ・アルファ ポートフォリオA （為替ヘッジなし）

期間	分配金（円）
第 1特定期間　（自 平成11年 2月19日 至 平成11年 6月18日）	70
第 2特定期間　（自 平成11年 6月19日 至 平成11年12月20日）	80
第 3特定期間　（自 平成11年12月21日 至 平成12年 6月19日）	0
第 4特定期間　（自 平成12年 6月20日 至 平成12年12月18日）	0
第 5特定期間　（自 平成12年12月19日 至 平成13年 6月18日）	0
第 6特定期間　（自 平成13年 6月19日 至 平成13年12月18日）	0
第 7特定期間　（自 平成13年12月19日 至 平成14年 6月18日）	160
第 8特定期間　（自 平成14年 6月19日 至 平成14年12月18日）	160
第 9特定期間　（自 平成14年12月19日 至 平成15年 6月18日）	160
第10特定期間　（自 平成15年 6月19日 至 平成15年12月18日）	160
第11特定期間　（自 平成15年12月19日 至 平成16年 6月18日）	160
第12特定期間　（自 平成16年 6月19日 至 平成16年12月20日）	160
第13特定期間　（自 平成16年12月21日 至 平成17年 6月20日）	160
第14特定期間　（自 平成17年 6月21日 至 平成17年12月19日）	160
第15特定期間　（自 平成17年12月20日 至 平成18年 6月19日）	160
第16特定期間　（自 平成18年 6月20日 至 平成18年12月18日）	160
第17特定期間　（自 平成18年12月19日 至 平成19年 6月18日）	160
第18特定期間　（自 平成19年 6月19日 至 平成19年12月18日）	160
第19特定期間　（自 平成19年12月19日 至 平成20年 6月18日）	160
第20特定期間　（自 平成20年 6月19日 至 平成20年12月18日）	160
第21特定期間　（自 平成20年12月19日 至 平成21年 6月18日）	160
第22特定期間　（自 平成21年 6月19日 至 平成21年12月18日）	160
第23特定期間　（自 平成21年12月19日 至 平成22年 6月18日）	160
第24特定期間　（自 平成22年 6月19日 至 平成22年12月20日）	160
第25特定期間　（自 平成22年12月21日 至 平成23年 6月20日）	160
第26特定期間　（自 平成23年 6月21日 至 平成23年12月19日）	160
第27特定期間　（自 平成23年12月20日 至 平成24年 6月18日）	160
第28特定期間　（自 平成24年 6月19日 至 平成24年12月18日）	160
第29特定期間　（自 平成24年12月19日 至 平成25年 6月18日）	160

（注）分配金は、各特定期間中の各計算期間末に支払われた分配金（1万口当たり）の合計金額を記載しております。

LM・ユーロ・アルファ ポートフォリオB （為替ヘッジあり）

期間	分配金（円）

第 1特定期間　（自 平成11年 2月19日 至 平成11年 6月18日）	30
第 2特定期間　（自 平成11年 6月19日 至 平成11年12月20日）	60
第 3特定期間　（自 平成11年12月21日 至 平成12年 6月19日）	60
第 4特定期間　（自 平成12年 6月20日 至 平成12年12月18日）	60
第 5特定期間　（自 平成12年12月19日 至 平成13年 6月18日）	60
第 6特定期間　（自 平成13年 6月19日 至 平成13年12月18日）	60
第 7特定期間　（自 平成13年12月19日 至 平成14年 6月18日）	60
第 8特定期間　（自 平成14年 6月19日 至 平成14年12月18日）	60
第 9特定期間　（自 平成14年12月19日 至 平成15年 6月18日）	60
第10特定期間　（自 平成15年 6月19日 至 平成15年12月18日）	60
第11特定期間　（自 平成15年12月19日 至 平成16年 6月18日）	60
第12特定期間　（自 平成16年 6月19日 至 平成16年12月20日）	60
第13特定期間　（自 平成16年12月21日 至 平成17年 6月20日）	60
第14特定期間　（自 平成17年 6月21日 至 平成17年12月19日）	60
第15特定期間　（自 平成17年12月20日 至 平成18年 6月19日）	60
第16特定期間　（自 平成18年 6月20日 至 平成18年12月18日）	60
第17特定期間　（自 平成18年12月19日 至 平成19年 6月18日）	60
第18特定期間　（自 平成19年 6月19日 至 平成19年12月18日）	60
第19特定期間　（自 平成19年12月19日 至 平成20年 6月18日）	60
第20特定期間　（自 平成20年 6月19日 至 平成20年12月18日）	60
第21特定期間　（自 平成20年12月19日 至 平成21年 6月18日）	60
第22特定期間　（自 平成21年 6月19日 至 平成21年12月18日）	60
第23特定期間　（自 平成21年12月19日 至 平成22年 6月18日）	60
第24特定期間　（自 平成22年 6月19日 至 平成22年12月20日）	60
第25特定期間　（自 平成22年12月21日 至 平成23年 6月20日）	60
第26特定期間　（自 平成23年 6月21日 至 平成23年12月19日）	60
第27特定期間　（自 平成23年12月20日 至 平成24年 6月18日）	60
第28特定期間　（自 平成24年 6月19日 至 平成24年12月18日）	60
第29特定期間　（自 平成24年12月19日 至 平成25年 6月18日）	60

（注）分配金は、各特定期間中の各計算期間末に支払われた分配金（1万口当たり）の合計金額を記載しております。

③【収益率の推移】

LM・ユーロ・アルファ ポートフォリオA （為替ヘッジなし）

期間	収益率（%）
第 1特定期間　（自 平成11年 2月19日 至 平成11年 6月18日）	△7.70
第 2特定期間　（自 平成11年 6月19日 至 平成11年12月20日）	△20.38
第 3特定期間　（自 平成11年12月21日 至 平成12年 6月19日）	△2.93
第 4特定期間　（自 平成12年 6月20日 至 平成12年12月18日）	△5.53
第 5特定期間　（自 平成12年12月19日 至 平成13年 6月18日）	11.69
第 6特定期間　（自 平成13年 6月19日 至 平成13年12月18日）	12.94
第 7特定期間　（自 平成13年12月19日 至 平成14年 6月18日）	1.97
第 8特定期間　（自 平成14年 6月19日 至 平成14年12月18日）	9.07
第 9特定期間　（自 平成14年12月19日 至 平成15年 6月18日）	17.78
第10特定期間　（自 平成15年 6月19日 至 平成15年12月18日）	△3.99
第11特定期間　（自 平成15年12月19日 至 平成16年 6月18日）	0.48
第12特定期間　（自 平成16年 6月19日 至 平成16年12月20日）	7.83
第13特定期間　（自 平成16年12月21日 至 平成17年 6月20日）	△2.36
第14特定期間　（自 平成17年 6月21日 至 平成17年12月19日）	4.64
第15特定期間　（自 平成17年12月20日 至 平成18年 6月19日）	3.01
第16特定期間　（自 平成18年 6月20日 至 平成18年12月18日）	7.90
第17特定期間　（自 平成18年12月19日 至 平成19年 6月18日）	4.39
第18特定期間　（自 平成19年 6月19日 至 平成19年12月18日）	0.32
第19特定期間　（自 平成19年12月19日 至 平成20年 6月18日）	△0.68
第20特定期間　（自 平成20年 6月19日 至 平成20年12月18日）	△23.06

第21特定期間　（自 平成20年12月19日 至 平成21年 6月18日）	8.24
第22特定期間　（自 平成21年 6月19日 至 平成21年12月18日）	3.19
第23特定期間　（自 平成21年12月19日 至 平成22年 6月18日）	△9.03
第24特定期間　（自 平成22年 6月19日 至 平成22年12月20日）	△1.89
第25特定期間　（自 平成22年12月21日 至 平成23年 6月20日）	4.22
第26特定期間　（自 平成23年 6月21日 至 平成23年12月19日）	△12.33
第27特定期間　（自 平成23年12月20日 至 平成24年 6月18日）	6.63
第28特定期間　（自 平成24年 6月19日 至 平成24年12月18日）	17.66
第29特定期間　（自 平成24年12月19日 至 平成25年 6月18日）	17.01

（注）収益率は、特定期間末の基準価額（分配付きの額。）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落ちの額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。

LM・ユーロ・アルファ ポートフォリオB （為替ヘッジあり）

期間	収益率（%）
第 1特定期間　（自 平成11年 2月19日 至 平成11年 6月18日）	△0.67
第 2特定期間　（自 平成11年 6月19日 至 平成11年12月20日）	△5.91
第 3特定期間　（自 平成11年12月21日 至 平成12年 6月19日）	△2.52
第 4特定期間　（自 平成12年 6月20日 至 平成12年12月18日）	△2.82
第 5特定期間　（自 平成12年12月19日 至 平成13年 6月18日）	2.35
第 6特定期間　（自 平成13年 6月19日 至 平成13年12月18日）	2.06
第 7特定期間　（自 平成13年12月19日 至 平成14年 6月18日）	△1.35
第 8特定期間　（自 平成14年 6月19日 至 平成14年12月18日）	1.09
第 9特定期間　（自 平成14年12月19日 至 平成15年 6月18日）	3.92
第10特定期間　（自 平成15年 6月19日 至 平成15年12月18日）	△0.91
第11特定期間　（自 平成15年12月19日 至 平成16年 6月18日）	0.44
第12特定期間　（自 平成16年 6月19日 至 平成16年12月20日）	1.23
第13特定期間　（自 平成16年12月21日 至 平成17年 6月20日）	0.50
第14特定期間　（自 平成17年 6月21日 至 平成17年12月19日）	△1.15
第15特定期間　（自 平成17年12月20日 至 平成18年 6月19日）	△2.86
第16特定期間　（自 平成18年 6月20日 至 平成18年12月18日）	0.33
第17特定期間　（自 平成18年12月19日 至 平成19年 6月18日）	△4.07
第18特定期間　（自 平成19年 6月19日 至 平成19年12月18日）	0.10
第19特定期間　（自 平成19年12月19日 至 平成20年 6月18日）	△5.16
第20特定期間　（自 平成20年 6月19日 至 平成20年12月18日）	△1.37
第21特定期間　（自 平成20年12月19日 至 平成21年 6月18日）	1.73
第22特定期間　（自 平成21年 6月19日 至 平成21年12月18日）	7.66
第23特定期間　（自 平成21年12月19日 至 平成22年 6月18日）	2.96
第24特定期間　（自 平成22年 6月19日 至 平成22年12月20日）	△0.67
第25特定期間　（自 平成22年12月21日 至 平成23年 6月20日）	△0.84
第26特定期間　（自 平成23年 6月21日 至 平成23年12月19日）	△1.34
第27特定期間　（自 平成23年12月20日 至 平成24年 6月18日）	5.75
第28特定期間　（自 平成24年 6月19日 至 平成24年12月18日）	6.62
第29特定期間　（自 平成24年12月19日 至 平成25年 6月18日）	2.29

（注）収益率は、特定期間末の基準価額（分配付きの額。）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落ちの額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。

(4)【設定及び解約の実績】

LM・ユーロ・アルファ ポートフォリオA （為替ヘッジなし）

期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第 1特定期間	18,990,739,341	0
第 2特定期間	417,830,270	7,645,112,915
第 3特定期間	557,706,605	2,764,455,431

第 4特定期間	430,379,886	1,752,615,727
第 5特定期間	214,547,336	2,063,753,094
第 6特定期間	90,119,794	500,970,924
第 7特定期間	322,593,496	545,520,274
第 8特定期間	133,708,804	1,607,317,896
第 9特定期間	136,001,200	1,920,477,708
第10特定期間	58,172,536	434,217,119
第11特定期間	28,476,031	236,299,050
第12特定期間	25,622,723	188,395,140
第13特定期間	27,113,620	175,625,065
第14特定期間	28,712,159	261,997,701
第15特定期間	24,023,108	140,868,299
第16特定期間	21,397,413	85,355,162
第17特定期間	24,433,554	104,851,482
第18特定期間	16,028,569	94,284,088
第19特定期間	13,125,347	33,384,942
第20特定期間	15,162,655	93,617,849
第21特定期間	17,751,175	70,180,118
第22特定期間	14,042,674	67,529,464
第23特定期間	14,918,532	62,837,830
第24特定期間	13,383,388	80,514,050
第25特定期間	15,137,113	42,804,144
第26特定期間	13,417,469	66,757,495
第27特定期間	12,059,973	48,276,156
第28特定期間	11,659,255	46,662,856
第29特定期間	9,714,369	56,867,005

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

ＬＭ・ユーロ・アルファ ポートフォリオＢ （為替ヘッジあり）

期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第 1特定期間	23,663,407,377	0
第 2特定期間	5,559,251,421	6,453,740,516
第 3特定期間	104,436,525	3,725,481,384
第 4特定期間	70,209,798	2,054,909,247
第 5特定期間	111,118,977	611,146,807
第 6特定期間	70,025,998	2,577,673,086
第 7特定期間	46,487,581	6,876,025,069
第 8特定期間	45,803,959	502,171,612
第 9特定期間	56,066,369	850,179,411
第10特定期間	47,874,611	370,956,545
第11特定期間	141,884,006	513,820,913
第12特定期間	29,225,016	458,449,755
第13特定期間	26,523,172	1,055,426,505
第14特定期間	22,278,489	411,697,014
第15特定期間	18,705,096	481,576,984
第16特定期間	17,432,274	113,941,128
第17特定期間	17,651,348	102,295,285
第18特定期間	18,185,299	111,660,998
第19特定期間	16,320,482	256,129,617
第20特定期間	15,062,874	406,031,674
第21特定期間	13,227,090	49,241,833
第22特定期間	12,091,857	81,006,908
第23特定期間	10,528,725	197,696,471
第24特定期間	9,574,384	32,814,945

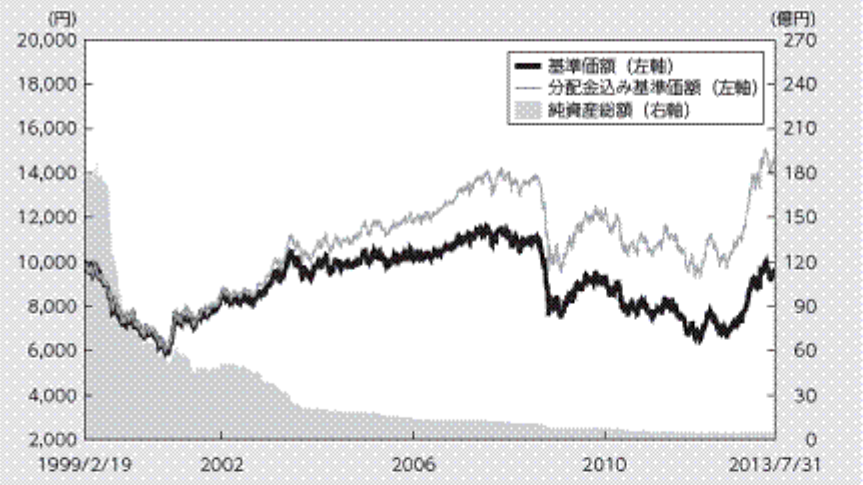
第25特定期間	9,695,809	36,464,442
第26特定期間	9,720,076	151,819,990
第27特定期間	8,043,121	31,081,298
第28特定期間	7,634,163	27,678,563
第29特定期間	7,087,138	83,219,866

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

＜参考情報＞

LM・ユーロ・アルファ　ポートフォリオA（為替ヘッジなし）

基準価額・純資産の推移



※分配金込み基準価額は、税引前分配金を再投資（複利運用）したと仮定して、委託会社が算出したものです。

基準価額・純資産総額

基準価額	純資産総額
9,424円	5億円

分配の推移

2012年６月	80円
2012年９月	80円
2012年12月	80円
2013年３月	80円
2013年６月	80円
直近1年間累計	320円
設定来累計	3,830円

※1万口当たり、税引前
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、また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

■種類別組入比率

資産	比率(%)
国債証券	78.99
特殊債券	4.07
社債券	9.68
現金・預金・その他の資産	7.26

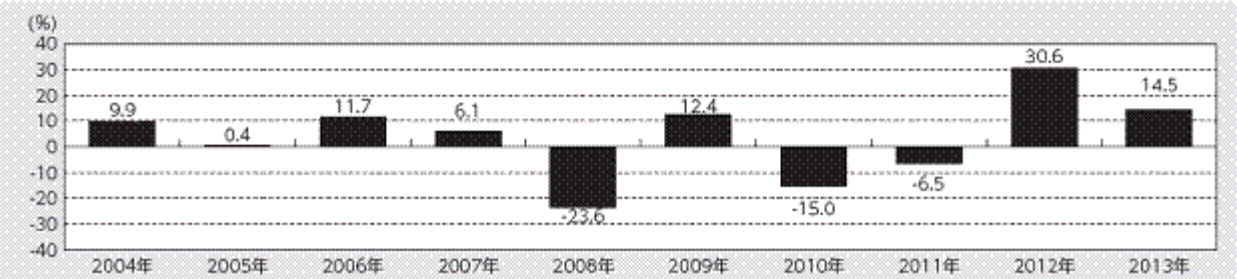
その他投資資産	比率(%)
先物	37.55
オプション	△0.11

■組入上位銘柄

銘柄	国	種類	利率(%)	償還日	比率(%)
FRANCE O.A.T.	フランス	国債証券	4.250	2017年10月25日	19.99
BUONI POLIENNALI	イタリア	国債証券	3.750	2016年４月15日	18.25
BELGIUM GOVT	ベルギー	国債証券	3.750	2015年９月28日	6.27
BUONI POLIENNALI	イタリア	国債証券	5.500	2022年11月１日	6.05
BUONI POLIENNALI	イタリア	国債証券	3.500	2018年６月１日	5.36
SPAIN GOVT	スペイン	国債証券	5.500	2017年７月30日	4.24
FNMA 30YR AUG FWD	アメリカ	特殊債券	3.000	2043年８月１日	4.07
BELGIUM GOVT	ベルギー	国債証券	4.000	2018年３月28日	2.51
CITIGROUP INC	アメリカ	社債券	7.375	2019年９月４日	2.50
US TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	3.125	2042年２月15日	2.48

※上記比率はファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

年間収益率の推移

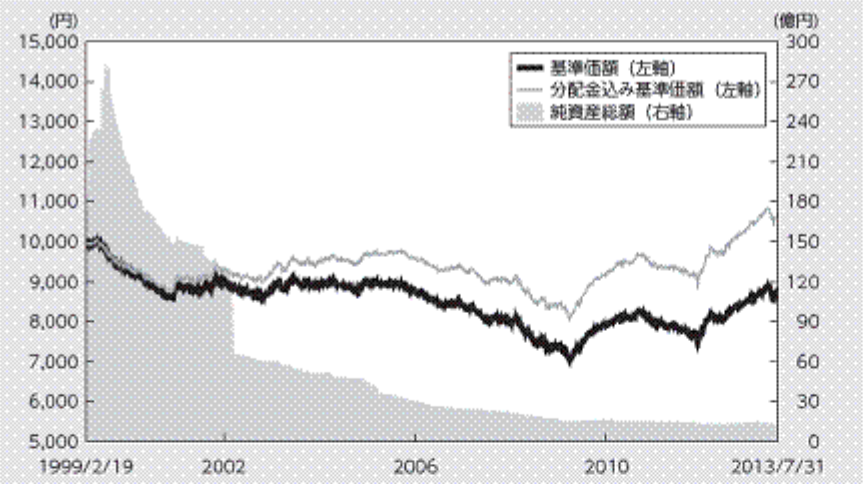


※年間収益率は、税引前分配金を再投資（複利運用）したと仮定して、委託会社が暦年ベースで算出したものです。
※2013年は年初から基準日までの収益率を表示しています。

ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
ファンドの運用状況は、委託会社のホームページで確認することができます。

LM・ユーロ・アルファ　ポートフォリオB(為替ヘッジあり)

基準価額・純資産の推移



※分配金込み基準価額は、税引前分配金を再投資(複利運用)したと仮定して、委託会社が算出したものです。

基準価額・純資産総額

基準価額	純資産総額
8,637円	13億円

分配の推移

2012年 6 月	30円
2012年 9 月	30円
2012年12月	30円
2013年 3 月	30円
2013年 6 月	30円
直近1年間累計	120円
設定来累計	1,710円

※1万口当たり、税引前
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、また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

■種類別組入比率

資産	比率(%)
国債証券	76.86
特殊債券	6.56
社債券	10.40
現金・預金・その他の資産	6.18

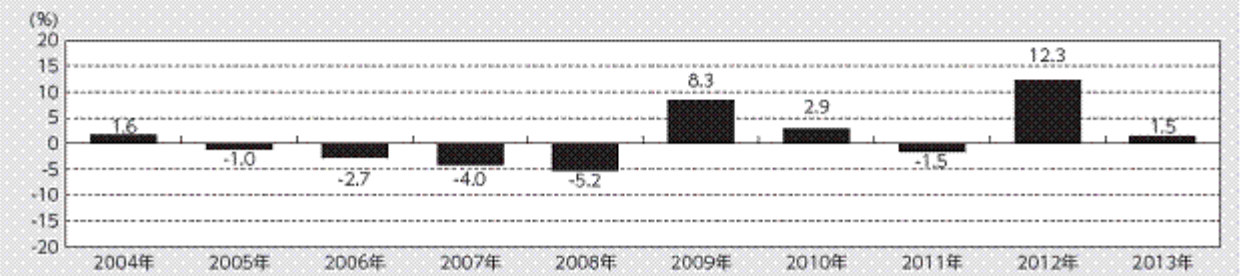
その他投資資産	比率(%)
先物	34.86
オプション	△0.12

■組入上位銘柄

銘柄	国	種類	利率(%)	償還日	比率(%)
BUONI POLIENNALI	イタリア	国債証券	3.750	2016年 4 月15日	19.19
FRANCE O.A.T.	フランス	国債証券	3.000	2015年10月25日	10.54
FRANCE O.A.T.	フランス	国債証券	3.250	2021年10月25日	7.45
BUONI POLIENNALI	イタリア	国債証券	5.500	2022年11月 1 日	5.98
SPAIN GOVT	スペイン	国債証券	5.500	2017年 7 月30日	5.88
BELGIUM GOVT	ベルギー	国債証券	3.750	2015年 9 月28日	5.80
BUONI POLIENNALI	イタリア	国債証券	3.500	2018年 6 月 1 日	4.99
FNMA 15YR AUG FWD	アメリカ	特殊債券	2.500	2028年 8 月 1 日	4.36
FRANCE O.A.T.	フランス	国債証券	4.250	2017年10月25日	3.30
FNMA 30YR AUG FWD	アメリカ	特殊債券	3.500	2043年 8 月 1 日	2.20

※上記比率はファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

年間収益率の推移



※年間収益率は、税引前分配金を再投資(複利運用)したと仮定して、委託会社が暦年ベースで算出したものです。
※2013年は年初から基準日までの収益率を表示しています。

ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
ファンドの運用状況は、委託会社のホームページで確認することができます。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

（訂正前）

（前略）

(5)申込単位は、新規でお申込みいただく場合は、50万円以上１円単位です。受益権をすでに保有する受益者が追加でお申込みいただく場合は、１万円以上１円単位です。ただし、自動けいぞく投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合に限り、１口単位で取得することができます。

(6)上記(5)にかかわらず、「ポートフォリオＡ」と「ポートフォリオＢ」の間でスイッチングを行う際の申込単位は、１万円以上１円単位です。ただし、保有する受益権をすべて一部解約請求または買取請求した場合の手取代金をもってスイッチングを行う場合には、１円以上１円単位で取得することができます。ただし、スイッチングの受付日が、ロンドンの銀行の休業日の場合には、販売会社の営業日であってもスイッチングのお申込みは受付けません。

（以下略）

（訂正後）

（前略）

(5)申込単位は、販売会社毎に定められておりますので、販売会社にお問合せください。なお、販売会社は、上記(1)の照会先までお問合せください。

(6)「ポートフォリオＡ」と「ポートフォリオＢ」の間でスイッチングを行うことができます。ただし、スイッチングの受付日が、ロンドンの銀行の休業日の場合には、販売会社の営業日であってもスイッチングのお申込みは受付けません。

(注)スイッチングを行う場合の申込単位は、販売会社にお問合せください。

（以下略）

第３【ファンドの経理状況】

原届出書の第二部 ファンド情報 第３ ファンドの経理状況につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

（更新・訂正後）

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)(以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）(以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。
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)当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。

(3)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、当特定期間（平成24年12月19日から平成25年6月18日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ＬＭ・ユーロ・アルファ ポートフォリオＡ （為替ヘッジなし）】

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 平成24年12月18日現在	当期 平成25年6月18日現在
資産の部		
流動資産		
預金	3,526,639	1,124,337
コール・ローン	2,682,893	1,349,888
国債証券	351,729,651	383,330,702
特殊債券	8,765,725	18,986,745
社債券	42,528,369	44,462,854
コール・オプション（買）	6,554	1,482
派生商品評価勘定	16,452,643	6,056,080
未収入金	9,122,262	―
未収利息	3,113,534	4,897,102
前払費用	1,969,163	2,727,049
その他未収収益	122,938	―
差入委託証拠金	29,059,649	33,374,115
流動資産合計	469,080,020	496,310,354
資産合計	469,080,020	496,310,354
負債の部		
流動負債		
コール・オプション（売）	―	2,964
プット・オプション（売）	129,736	371,912
派生商品評価勘定	9,614,360	3,984,829
未払金	8,781,124	18,964,519
未払収益分配金	4,428,656	4,051,435
未払解約金	582,947	―
未払受託者報酬	55,506	65,860
未払委託者報酬	1,387,565	1,646,459
その他未払費用	52,458	62,384
流動負債合計	25,032,352	29,150,362
負債合計	25,032,352	29,150,362
純資産の部		
元本等		
元本	553,582,047	506,429,411
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△109,534,379	△39,269,419
（分配準備積立金）	74,049,396	66,327,576
純資産合計	444,047,668	467,159,992
負債純資産合計	469,080,020	496,310,354

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 平成24年 6月19日 至 平成24年12月18日	当期 自 平成24年12月19日 至 平成25年 6月18日
営業収益		
受取利息	7,417,607	8,884,030
有価証券売買等損益	19,616,249	△3,313,138
派生商品取引等損益	4,989,855	4,077,145
為替差損益	39,409,664	69,975,614
その他収益	634,822	144,393
営業収益合計	72,068,197	79,768,044
営業費用		
受託者報酬	108,882	128,792
委託者報酬	2,721,878	3,219,717
その他費用	211,721	248,296
営業費用合計	3,042,481	3,596,805
営業利益	69,025,716	76,171,239
経常利益	69,025,716	76,171,239
当期純利益	69,025,716	76,171,239
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	212,266	4,448,144
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△179,315,093	△109,534,379
剰余金増加額又は欠損金減少額	13,322,973	8,215,948
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	13,322,973	8,215,948
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,347,851	1,370,808
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,347,851	1,370,808
分配金	9,007,858	8,303,275
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△109,534,379	△39,269,419

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	当期 自 平成24年12月19日 至 平成25年6月18日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券・特殊債券・社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1)先物取引・オプション取引 個別法に基づき、法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。 (2)為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における特定期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（未適用の会計基準等に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

項目	前期 平成24年12月18日現在	当期 平成25年6月18日現在
1.特定期間の末日における受益権の総数	553,582,047口	506,429,411口
2.元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	109,534,379円	39,269,419円
3.特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額		
一口当たり純資産額	0.8021円	0.9225円
(一万口当たり純資産額)	(8,021円)	(9,225円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	前期 自 平成24年 6月19日 至 平成24年12月18日	当期 自 平成24年12月19日 至 平成25年 6月18日
1.信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	委託者報酬のうち、販売会社へ支払う手数料を除いた額の100分の50相当額を支払っております。	同左
2.分配金の計算過程		
	平成24年6月19日から 平成24年9月18日まで の計算期間	平成24年12月19日から 平成25年 3月18日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	3,913,675円	4,231,936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	－円	－円
収益調整金額	33,944,152円	32,843,117円
分配準備積立金額	78,759,046円	70,469,012円
当ファンドの分配対象収益額	116,616,873円	107,544,065円
当ファンドの期末残存口数	572,400,300口	531,480,029口
1万口当たり収益分配対象額	2,037.32円	2,023.47円
1万口当たり分配金額	80.00円	80.00円
収益分配金金額	4,579,202円	4,251,840円
	平成24年 9月19日から 平成24年12月18日まで の計算期間	平成25年3月19日から 平成25年6月18日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	3,682,844円	3,853,996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	－円	－円
収益調整金額	33,559,084円	31,900,989円
分配準備積立金額	74,795,208円	66,525,015円
当ファンドの分配対象収益額	112,037,136円	102,280,000円
当ファンドの期末残存口数	553,582,047口	506,429,411口
1万口当たり収益分配対象額	2,023.84円	2,019.61円
1万口当たり分配金額	80.00円	80.00円
収益分配金金額	4,428,656円	4,051,435円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	前期 自　平成24年 6月19日 至　平成24年12月18日	当期 自　平成24年12月19日 至　平成25年　6月18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。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は（その他の注記）の2　有価証券関係に記載しております。これらは、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクに晒されております。 また、当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、債券先物取引、債券先物オプション取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引、債券先物オプション取引は金利変動リスク、為替予約取引は為替変動リスクを有しております。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用リスク管理に関する委員会において、パフォーマンスの分析、運用計画のレビュー及び運用リスクの管理を行っております。 ①市場リスクの管理 市場リスクに関しては、パフォーマンス実績等の状況を分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。 ②信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体等に関する格付情報に基づき、信用度に応じた組入制限等の管理をしております。 ③流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性について、組入比率等の状況を把握することにより管理をしております。	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には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計算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。	同左

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

項目	前期 自 平成24年 6月19日 至 平成24年12月18日	当期 自 平成24年12月19日 至 平成25年 6月18日
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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。	同左
2.時価の算定方法	①国債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 ②派生商品評価勘定、コール・オプション(買)、プット・オプション(売) デリバティブ取引については、（その他の注記）の3 デリバティブ取引関係に記載しております。 ③コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	①国債証券、特殊債券、社債券 同左 ②派生商品評価勘定、コール・オプション(買)、コール・オプション(売)、プット・オプション(売) デリバティブ取引については、（その他の注記）の3 デリバティブ取引関係に記載しております。 ③コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）
該当事項はありません。

（その他の注記）
1 元本の移動

項目	前期 自 平成24年 6月19日 至 平成24年12月18日	当期 自 平成24年12月19日 至 平成25年 6月18日
期首元本額	588,585,648円	553,582,047円
期中追加設定元本額	11,659,255円	9,714,369円
期中解約元本額	46,662,856円	56,867,005円

2 有価証券関係
売買目的有価証券

種類	前期 平成24年12月18日現在	当期 平成25年6月18日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	5,402,223	△3,039,561
特殊債券	△15,399	22,226
社債券	958,762	△926,723
合計	6,345,586	△3,944,058

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

債券関連

区分	種類	前期 平成24年12月18日現在			
		契約額等（円）	うち1年超(円)	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引				
	売建	255,936,092	―	254,381,003	1,555,089
	買建	288,918,709	―	289,102,977	184,268
	債券先物オプション取引				
	売建				
	プット	12,328,890 (96,702)	―	129,736	△33,034
	買建				
	コール	62,986,370 (543,898)	―	6,554	△537,344
合計		620,170,061	―	543,620,270	1,168,979

区分	種類	当期 平成25年6月18日現在			
		契約額等（円）	うち1年超(円)	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引				
	売建	275,918,606	―	275,647,552	271,054
	買建	338,267,911	―	338,323,953	56,042
	債券先物オプション取引				
	売建				
	コール	27,500,700 (120,884)	―	2,964	117,920
	プット	39,923,430 (234,669)	―	371,912	△137,243
	買建				
	コール	13,940,010 (98,101)	―	1,482	△96,619
合計		695,550,657	―	614,347,863	211,154

（注）時価の算定方法

A 外国先物取引について

1)外国先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。

2)特定期間末日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

B 外国オプション取引について

1)外国オプション取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。

2)特定期間末日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

3)契約額等のうち、( )内はオプション料であります。

通貨関連

区分	種類	前期 平成24年12月18日現在			
		契約額等（円）	うち1年超(円)	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	73,646,707	―	77,682,484	△4,035,777
	メキシコペソ	11,766,720	―	12,782,712	△1,015,992
	ユーロ	33,363,530	―	34,118,980	△755,450
	英ポンド	15,735,317	―	16,976,249	△1,240,932
	ポーランドズロチ	11,288,980	―	12,737,671	△1,448,691
	オーストラリアドル	6,630,710	―	7,044,800	△414,090
	買建				
	米ドル	13,319,710	―	13,755,215	435,505
	カナダドル	12,744,812	―	13,779,094	1,034,282
	メキシコペソ	4,907,428	―	5,456,024	548,596
	ユーロ	129,265,575	―	139,660,664	10,395,089
	英ポンド	7,052,400	―	7,332,660	280,260
	ポーランドズロチ	11,953,784	―	13,269,910	1,316,126
合計		331,675,673	―	354,596,463	5,098,926

区分	種類	当期 平成25年6月18日現在			
		契約額等（円）	うち1年超(円)	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	57,381,324	―	54,330,577	3,050,747
	メキシコペソ	6,030,569	―	5,430,754	599,815
	英ポンド	15,516,427	―	15,047,702	468,725
	オーストラリアドル	11,033,000	―	9,930,800	1,102,200
	買建				
	米ドル	1,896,800	―	1,896,000	△800
	カナダドル	5,095,189	―	4,819,816	△275,373
	メキシコペソ	675,666	―	597,942	△77,724
	ユーロ	114,989,509	―	111,976,605	△3,012,904
	ポーランドズロチ	619,790	―	590,672	△29,118
	オーストラリアドル	774,967	―	693,554	△81,413
合計		214,013,241	―	205,314,422	1,744,155

（注）時価の算定方法
為替予約取引について
1.特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
①特定期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
②特定期間末日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
2.特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、特定期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※ 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

次表の通りです。

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US T STRIP PRINC	200,000.00	77,890.60	
		US T STRIP PRINC	100,000.00	36,425.80	
		US TREASURY BOND	160,000.00	154,093.75	
		US TREASURY BOND	60,000.00	53,261.71	
	計		520,000.00	321,671.86	
	(邦貨換算額)			(30,504,142)	
	特殊債券	FNMA 30YR JUL FWD	200,000.00	200,218.76	
	計		200,000.00	200,218.76	
	(邦貨換算額)			(18,986,745)	
	社債券	AT&T INC	10,000.00	10,632.10	
		CITIGROUP INC	20,000.00	22,494.80	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC	20,000.00	22,761.40	
		JP MORGAN CHASE & CO	30,000.00	32,305.80	
		KRAFT FOODS INC	5,000.00	5,737.40	
		KRAFT FOODS INC	5,000.00	5,753.25	
		RIO TINTO FIN USA LTD	40,000.00	48,070.40	
		SAFEWAY INC	10,000.00	11,589.10	
		WACHOVIA CAP TRUST FRN	60,000.00	59,202.60	*
		XL GROUP PLC FRN	20,000.00	19,625.00	
	計		220,000.00	238,171.85	
	(邦貨換算額)			(22,585,836)	
米ドル計				760,062.47	
(邦貨換算額)				(72,076,723)	
カナダドル	国債証券	CANADIAN GOVT	40,000.00	45,132.40	
	計		40,000.00	45,132.40	
	(邦貨換算額)			(4,202,277)	
カナダドル計				45,132.40	
(邦貨換算額)				(4,202,277)	
メキシコペソ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	930,000.00	1,090,425.00	
		MEXICAN BONOS DESARR FIX	1,197,000.00	1,303,269.66	
	計		2,127,000.00	2,393,694.66	
	(邦貨換算額)			(17,737,277)	
メキシコペソ計				2,393,694.66	
(邦貨換算額)				(17,737,277)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM GOVT	210,000.00	225,945.30	
		BELGIUM GOVT	80,000.00	90,946.40	
		BUNDES REPUBLIC DE	90,000.00	103,945.50	
		BUNDES REPUBLIC DE	20,000.00	23,276.00	
		BUONI POLIENNALI	630,000.00	654,544.80	
		BUONI POLIENNALI	190,000.00	192,509.90	
		BUONI POLIENNALI	140,000.00	154,029.40	
		BUONI POLIENNALI	135,000.00	137,046.60	
		FRANCE O.A.T.	630,000.00	721,526.40	
		FRANCE O.A.T.	80,000.00	89,384.80	
		SPAIN GOVT	140,000.00	151,613.00	
	計		2,345,000.00	2,544,768.10	
	(邦貨換算額)			(322,498,461)	

	社債券	CITIGROUP INC	70,000.00	89,941.60	
		GOLDMAN SACHS GROUP	50,000.00	57,846.00	
	計		120,000.00	147,787.60	
	(邦貨換算額)			(18,729,122)	
ユーロ計				2,692,555.70	
(邦貨換算額)				(341,227,583)	
英ポンド	社債券	DIGNITY FINANCE PLC	17,584.09	21,116.90	
	計		17,584.09	21,116.90	
	(邦貨換算額)			(3,147,896)	
英ポンド計				21,116.90	
(邦貨換算額)				(3,147,896)	
トルコリラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	170,000.00	165,945.50	
	計		170,000.00	165,945.50	
	(邦貨換算額)			(8,388,545)	
トルコリラ計				165,945.50	
(邦貨換算額)				(8,388,545)	
合計				446,780,301	
(外貨建証券の邦貨換算額)				(446,780,301)	

（注）備考欄の*の銘柄はハイブリッド優先証券であることを示しています。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券　4銘柄	42.4%	16.1%
	特殊債券　1銘柄	26.3%	
	社債券　10銘柄	31.3%	
カナダドル	国債証券　1銘柄	100.0%	0.9%
メキシコペソ	国債証券　2銘柄	100.0%	4.0%
ユーロ	国債証券　11銘柄	94.5%	76.4%
	社債券　2銘柄	5.5%	
英ポンド	社債券　1銘柄	100.0%	0.7%
トルコリラ	国債証券　1銘柄	100.0%	1.9%

第2 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

債券関連

「(3)注記表（その他の注記）3 デリバティブ取引関係」の「取引の時価等に関する事項 債券関連」において使用した表が、附属明細表別紙様式第1号の「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」に求められている項目（記載上の注意を含む）を満たしているため、当該表の添付を省略しております。

通貨関連

「(3)注記表（その他の注記）3 デリバティブ取引関係」の「取引の時価等に関する事項 通貨関連」において使用した表が、附属明細表別紙様式第1号の「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」に求められている項目（記載上の注意を含む）を満たしているため、当該表の添付を省略しております。

【LM・ユーロ・アルファ ポートフォリオB （為替ヘッジあり）】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 平成24年12月18日現在	当期 平成25年6月18日現在
資産の部		
流動資産		
預金	34,498,520	10,708,250
コール・ローン	9,591,172	45,759,314
国債証券	1,190,343,570	1,025,511,154
特殊債券	96,753,213	87,302,868
社債券	134,727,089	137,691,894
コール・オプション（買）	23,595	205,302
派生商品評価勘定	23,288,236	44,126,376
未収入金	171,256,889	58,951,625
未収利息	11,514,518	16,262,216
前払費用	5,882,833	3,213,715
その他未収収益	400,652	―
差入委託証拠金	68,758,023	88,597,855
流動資産合計	1,747,038,310	1,518,330,569
資産合計	1,747,038,310	1,518,330,569
負債の部		
流動負債		
売付債券	17,499,998	―
コール・オプション（売）	―	28,157
プット・オプション（売）	259,473	743,825
派生商品評価勘定	138,287,844	8,124,099
未払金	184,470,101	147,430,119
未払収益分配金	4,912,043	4,683,645
未払解約金	512,000	―
未払受託者報酬	181,257	182,513
未払委託者報酬	4,531,300	4,562,852
その他未払費用	172,378	174,018
流動負債合計	350,826,394	165,929,228
負債合計	350,826,394	165,929,228
純資産の部		
元本等		
元本	1,637,347,897	1,561,215,169
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△241,135,981	△208,813,828
（分配準備積立金）	343,204,140	335,231,650
純資産合計	1,396,211,916	1,352,401,341
負債純資産合計	1,747,038,310	1,518,330,569

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 自 平成24年 6月19日 至 平成24年12月18日	当期 自 平成24年12月19日 至 平成25年 6月18日
営業収益		
受取利息	23,760,454	25,715,204
有価証券売買等損益	57,955,374	△5,393,261
派生商品取引等損益	15,720,931	12,818,765
為替差損益	△1,250,754	8,528,935
その他収益	1,696,886	441,350
営業収益合計	97,882,891	42,110,993
営業費用		
受託者報酬	361,887	364,671
委託者報酬	9,047,036	9,116,743
その他費用	561,195	669,256
営業費用合計	9,970,118	10,150,670
営業利益	87,912,773	31,960,323
経常利益	87,912,773	31,960,323
当期純利益	87,912,773	31,960,323
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	391,651	1,139,906
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△322,459,846	△241,135,981
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,051,964	11,884,348
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,051,964	11,884,348
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,395,048	968,947
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,395,048	968,947
分配金	9,854,173	9,413,665
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△241,135,981	△208,813,828

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	当期 自 平成24年12月19日 至 平成25年6月18日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券・特殊債券・社債券・売付債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1)先物取引・オプション取引 個別法に基づき、法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。 (2)為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における特定期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産計算規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（未適用の会計基準等に関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

項目	前期 平成24年12月18日現在	当期 平成25年6月18日現在
1.特定期間の末日における受益権の総数	1,637,347,897口	1,561,215,169口
2.元本の欠損 貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	241,135,981円	208,813,828円
3.特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額		
一口当たり純資産額	0.8527円	0.8662円
(一万口当たり純資産額)	(8,527円)	(8,662円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	前期 自 平成24年 6月19日 至 平成24年12月18日	当期 自 平成24年12月19日 至 平成25年 6月18日
1.信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	委託者報酬のうち、販売会社へ支払う手数料を除いた額の100分の50相当額を支払っております。	同左
2.分配金の計算過程		
	平成24年6月19日から 平成24年9月18日まで の計算期間	平成24年12月19日から 平成25年 3月18日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	11,415,546円	11,659,010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	－円	－円
収益調整金額	35,043,346円	34,952,286円
分配準備積立金額	333,087,693円	329,810,366円
当ファンドの分配対象収益額	379,546,585円	376,421,662円
当ファンドの期末残存口数	1,647,376,877口	1,576,673,514口
1万口当たり収益分配対象額	2,303.93円	2,387.43円
1万口当たり分配金額	30.00円	30.00円
収益分配金金額	4,942,130円	4,730,020円
	平成24年 9月19日から 平成24年12月18日まで の計算期間	平成25年3月19日から 平成25年6月18日まで の計算期間
費用控除後の配当等収益額	11,387,246円	7,264,222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	－円	－円
収益調整金額	35,594,886円	35,397,233円
分配準備積立金額	336,728,937円	332,651,073円
当ファンドの分配対象収益額	383,711,069円	375,312,528円
当ファンドの期末残存口数	1,637,347,897口	1,561,215,169口
1万口当たり収益分配対象額	2,343.48円	2,403.95円
1万口当たり分配金額	30.00円	30.00円
収益分配金金額	4,912,043円	4,683,645円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	前期 自　平成24年 6月19日 至　平成24年12月18日	当期 自　平成24年12月19日 至　平成25年　6月18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。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は（その他の注記）の2 有価証券関係に記載しております。これらは、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクに晒されております。 また、当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減を目的として、為替予約取引を、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、債券先物取引、債券先物オプション取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引、債券先物オプション取引は金利変動リスク、為替予約取引は為替変動リスクを有しております。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	委託会社では、運用リスク管理に関する委員会において、パフォーマンスの分析、運用計画のレビュー及び運用リスクの管理を行っております。 ①市場リスクの管理 市場リスクに関しては、パフォーマンス実績等の状況を分析・把握し、投資方針に従っているかを管理しております。 ②信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体等に関する格付情報に基づき、信用度に応じた組入制限等の管理をしております。 ③流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、市場流動性について、組入比率等の状況を把握することにより管理をしております。	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には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計算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。	同左

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

項目	前期 自 平成24年 6月19日 至 平成24年12月18日	当期 自 平成24年12月19日 至 平成25年 6月18日
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべ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。	同左
2.時価の算定方法	①国債証券、特殊債券、社債券、売付債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 ②派生商品評価勘定、コール・オプション(買)、プット・オプション(売) デリバティブ取引については、（その他の注記）の3 デリバティブ取引関係に記載しております。 ③コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	①国債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 ②派生商品評価勘定、コール・オプション(買)、コール・オプション(売)、プット・オプション(売) デリバティブ取引については、（その他の注記）の3 デリバティブ取引関係に記載しております。 ③コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）
該当事項はありません。

（その他の注記）
1 元本の移動

項目	前期 自 平成24年 6月19日 至 平成24年12月18日	当期 自 平成24年12月19日 至 平成25年 6月18日
期首元本額	1,657,392,297円	1,637,347,897円
期中追加設定元本額	7,634,163円	7,087,138円
期中解約元本額	27,678,563円	83,219,866円

2 有価証券関係
売買目的有価証券

種類	前期 平成24年12月18日現在	当期 平成25年6月18日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）	当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	16,829,074	△4,516,517
特殊債券	△85,513	268,191
社債券	2,759,732	△2,496,742
売付債券	△7,862	―
合計	19,495,431	△6,745,068

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

債券関連

区分	種類	前期 平成24年12月18日現在			
		契約額等（円）	うち1年超(円)	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引				
	売建	862,869,508	―	857,356,350	5,513,158
	買建	942,008,439	―	942,500,000	491,561
	債券先物オプション取引				
	売建				
	プット	24,657,780 (193,404)	―	259,473	△66,069
	買建				
	コール	226,784,480 (2,041,380)	―	23,595	△2,017,785
合計		2,056,320,207	―	1,800,139,418	3,920,865

区分	種類	当期 平成25年6月18日現在			
		契約額等（円）	うち1年超(円)	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引				
	売建	708,026,655	―	708,069,051	△42,396
	買建	1,065,804,048	―	1,066,314,228	510,180
	債券先物オプション取引				
	売建				
	コール	206,824,230 (973,316)	―	28,157	945,159
	プット	79,846,860 (466,374)	―	743,825	△277,451
	買建				
	コール	55,127,550 (215,048)	―	205,302	△9,746
合計		2,115,629,343	―	1,775,360,563	1,125,746

（注）時価の算定方法

A 外国先物取引について

1)外国先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。

2)特定期間末日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

B 外国オプション取引について

1)外国オプション取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。

2)特定期間末日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

3)契約額等のうち、( )内はオプション料であります。

通貨関連

区分	種類	前期 平成24年12月18日現在			
		契約額等（円）	うち1年超(円)	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	317,187,094	－	330,792,065	△13,604,971
	メキシコペソ	38,345,110	－	41,656,000	△3,310,890
	ユーロ	1,175,622,156	－	1,285,851,652	△110,229,496
	英ポンド	30,591,826	－	33,004,386	△2,412,560
	デンマーククローネ	2,022,900	－	2,220,000	△197,100
	ポーランドズロチ	38,438,743	－	43,371,506	△4,932,763
	オーストラリアドル	23,508,971	－	25,432,432	△1,923,461
	買建				
	米ドル	127,330,973	－	130,099,051	2,768,078
	カナダドル	40,042,690	－	43,292,281	3,249,591
	メキシコペソ	13,671,226	－	15,199,520	1,528,294
	ユーロ	84,276,324	－	88,059,950	3,783,626
	ポーランドズロチ	38,849,025	－	43,126,350	4,277,325
合計		1,929,887,038	－	2,082,105,193	△121,004,327

区分	種類	当期 平成25年6月18日現在			
		契約額等（円）	うち1年超(円)	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	84,580,570	－	79,211,376	5,369,194
	メキシコペソ	17,368,823	－	15,641,279	1,727,544
	ユーロ	1,225,295,195	－	1,195,393,842	29,901,353
	英ポンド	50,081,989	－	48,569,096	1,512,893
	デンマーククローネ	2,615,775	－	2,548,500	67,275
	オーストラリアドル	36,439,792	－	32,799,446	3,640,346
	買建				
	米ドル	57,882,299	－	56,743,776	△1,138,523
	カナダドル	12,629,368	－	11,946,804	△682,564
	ユーロ	107,226,329	－	103,158,220	△4,068,109
	オーストラリアドル	8,216,320	－	7,421,404	△794,916
合計		1,602,336,460	－	1,553,433,743	35,534,493

（注）時価の算定方法
為替予約取引について
1.特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
①特定期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
②特定期間末日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
2.特定期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、特定期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

※ 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

次表の通りです。

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US T STRIP PRINC	290,000.00	112,941.37	
		US T STRIP PRINC	340,000.00	123,847.72	
		US TREASURY BOND	55,000.00	52,969.72	
		US TREASURY BOND	200,000.00	177,539.06	
		US TREASURY NOTE	10,000.00	9,979.68	
		US TREASURY NOTE	20,000.00	19,253.12	
	計		915,000.00	496,530.67	
	(邦貨換算額)			(47,086,003)	
	特殊債券	FNMA 15YR JUL FWD	600,000.00	610,875.00	
		FNMA 30YR JUL FWD	300,000.00	309,750.00	
	計		900,000.00	920,625.00	
	(邦貨換算額)			(87,302,868)	
	社債券	AT&T INC	30,000.00	31,896.30	
		CITIGROUP INC	30,000.00	33,352.80	
		CITIGROUP INC	80,000.00	89,979.20	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC	50,000.00	56,903.50	
		JP MORGAN CHASE & CO	80,000.00	86,148.80	
		KRAFT FOODS INC	15,000.00	17,212.20	
		KRAFT FOODS INC	15,000.00	17,259.75	
		RIO TINTO FIN USA LTD	30,000.00	36,052.80	
		SAFEWAY INC	10,000.00	11,589.10	
		SLM CORP	50,000.00	54,853.50	
		WACHOVIA CAP TRUST FRN	90,000.00	88,803.90	*
		XL GROUP PLC FRN	60,000.00	58,875.00	
	計		540,000.00	582,926.85	
	(邦貨換算額)			(55,278,953)	
米ドル計				2,000,082.52	
(邦貨換算額)				(189,667,824)	
カナダドル	国債証券	CANADIAN GOVT	140,000.00	157,963.40	
	計		140,000.00	157,963.40	
	(邦貨換算額)			(14,707,972)	
カナダドル計				157,963.40	
(邦貨換算額)				(14,707,972)	
メキシコペソ	国債証券	MEXICAN BONOS DESARR FIX	2,600,000.00	3,048,500.00	
		MEXICAN BONOS DESARR FIX	3,518,000.00	3,830,328.04	
	計		6,118,000.00	6,878,828.04	
	(邦貨換算額)			(50,972,115)	
メキシコペソ計				6,878,828.04	
(邦貨換算額)				(50,972,115)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM GOVT	560,000.00	602,520.80	
		BELGIUM GOVT	180,000.00	204,629.40	
		BUONI POLIENNALI	90,000.00	92,855.70	
		BUONI POLIENNALI	1,910,000.00	1,984,413.60	
		BUONI POLIENNALI	510,000.00	516,737.10	
		BUONI POLIENNALI	410,000.00	451,086.10	
		BUONI POLIENNALI	310,000.00	314,699.60	
		FRANCE O.A.T.	1,030,000.00	1,093,303.80	

		FRANCE O.A.T.	300,000.00	343,584.00	
		FRANCE O.A.T.	700,000.00	782,117.00	
		SPAIN GOVT	560,000.00	606,452.00	
	計		6,560,000.00	6,992,399.10	
	(邦貨換算額)			(886,146,737)	
	社債券	BARCLAYS BANK PLC	70,000.00	73,108.00	
		CITIGROUP INC	90,000.00	115,639.20	
		GOLDMAN SACHS GROUP	63,000.00	75,296.97	
		GOLDMAN SACHS GROUP	50,000.00	57,846.00	
		JP MORGAN CHASE & CO	50,000.00	56,155.00	
		VIVENDI SA	100,000.00	114,151.00	
	計		423,000.00	492,196.17	
	(邦貨換算額)			(62,376,020)	
ユーロ計				7,484,595.27	
(邦貨換算額)				(948,522,757)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY	12,000.00	14,493.72	
		UK TREASURY	10,000.00	11,667.90	
	計		22,000.00	26,161.62	
	(邦貨換算額)			(3,899,912)	
	社債券	HSBC CAPITAL FDG FRN	60,000.00	64,662.00	
	計		60,000.00	64,662.00	
	(邦貨換算額)			(9,639,164)	
英ポンド計				90,823.62	
(邦貨換算額)				(13,539,076)	
トルコリラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	460,000.00	449,029.00	
	計		460,000.00	449,029.00	
	(邦貨換算額)			(22,698,415)	
トルコリラ計				449,029.00	
(邦貨換算額)				(22,698,415)	
オーストラリアドル	社債券	WESTPAC BANKING	100,000.00	114,639.00	
	計		100,000.00	114,639.00	
	(邦貨換算額)			(10,397,757)	
オーストラリアドル計				114,639.00	
(邦貨換算額)				(10,397,757)	
合計				1,250,505,916	
(外貨建証券の邦貨換算額)				(1,250,505,916)	

（注）備考欄の*の銘柄はハイブリッド優先証券であることを示しています。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券　6銘柄	24.8%	15.2%
	特殊債券　2銘柄	46.1%	
	社債券　12銘柄	29.1%	
カナダドル	国債証券　1銘柄	100.0%	1.2%
メキシコペソ	国債証券　2銘柄	100.0%	4.1%
ユーロ	国債証券　11銘柄	93.4%	75.8%
	社債券　6銘柄	6.6%	
英ポンド	国債証券　2銘柄	28.8%	1.1%
	社債券　1銘柄	71.2%	
トルコリラ	国債証券　1銘柄	100.0%	1.8%
オーストラリアドル	社債券　1銘柄	100.0%	0.8%

第2 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

債券関連

「(3)注記表（その他の注記）3 デリバティブ取引関係」の「取引の時価等に関する事項 債券関連」において使用した表が、附属明細表別紙様式第1号の「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」に求められている項目（記載上の注意を含む）を満たしているため、当該表の添付を省略しております。

通貨関連

「(3)注記表（その他の注記）3 デリバティブ取引関係」の「取引の時価等に関する事項 通貨関連」において使用した表が、附属明細表別紙様式第1号の「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」に求められている項目（記載上の注意を含む）を満たしているため、当該表の添付を省略しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

LM・ユーロ・アルファ ポートフォリオA （為替ヘッジなし）

平成25年7月末現在

Ⅰ 資産総額	489,999,029円
Ⅱ 負債総額	23,326,905円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	466,672,124円
Ⅳ 発行済口数	495,188,748口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	0.9424円
（1万口当たり純資産額）	(9,424円)

LM・ユーロ・アルファ ポートフォリオB （為替ヘッジあり）

平成25年7月末現在

Ⅰ 資産総額	1,447,684,338円
Ⅱ 負債総額	101,764,302円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	1,345,920,036円
Ⅳ 発行済口数	1,558,252,745口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	0.8637円
（1万口当たり純資産額）	(8,637円)

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】

（訂正前）

(1)資本金の額（平成25年１月末現在）

①資本金の額　　1,000百万円

②委託会社が発行する株式総数　　100,000株

③発行済株式総数　　78,270株

④主な資本金の額の増減

平成20年３月30日に、資本金の額を3,913百万円から1,000百万円に減資しました。

（以下略）

（訂正後）

(1)資本金の額（平成25年７月末現在）

①資本金の額：　　1,000百万円

②委託会社が発行する株式総数：　　100,000株

③発行済株式総数：　　78,270株

④最近５年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

（以下略）

２【事業の内容及び営業の概況】

（訂正前）

（前略）

(2)平成25年１月末現在、委託会社が運用の指図を行っている投資信託（親投資信託を除きます。）は以下の通りです。

種　類	ファンド数	純資産総額の合計額（百万円）
追加型株式投資信託	43	1,476,665
合　計	43	1,476,665

（訂正後）

（前略）

(2)平成25年７月末現在、委託会社が運用の指図を行っている投資信託（親投資信託を除きます。）は以下の通りです。

種　類	ファンド数	純資産総額の合計額（百万円）
追加型株式投資信託	51	1,270,029
合　計	51	1,270,029

３【委託会社等の経理状況】

原届出書の第三部 委託会社等の情報 第１ 委託会社等の概況 ３ 委託会社等の経理状況につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

（更新・訂正後）

１． 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）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）に従って作成しております。
財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

２． 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期事業年度（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

（単位：千円）

		第14期事業年度 (平成24年3月31日)	第15期事業年度 (平成25年3月31日)
資 産 の 部			
流動資産			
現金及び預金		1,912,467	2,032,268
関係会社貸付金	※2	400,000	-
前払費用		46,764	63,269
未収入金		-	840
未収委託者報酬		594,342	556,977
未収運用受託報酬		1,272,104	1,629,769
その他未収収益		19,830	28,098
未収利息		235	58
立替金		67	-
繰延税金資産		214,942	258,745
流動資産計		4,460,756	4,570,026
固定資産			
有形固定資産	※1		※1
建物		258,118	266,002
器具備品		53,573	60,304
建設仮勘定		1,592	1,120
有形固定資産計		313,284	327,428
無形固定資産			
ソフトウェア		14,924	27,768
無形固定資産計		14,924	27,768
投資その他の資産			
投資有価証券		160,710	161,770
長期差入保証金		77,476	115,537
保険積立金		291,522	354,242
前払年金費用		39,960	-
投資その他の資産計		569,670	631,550
固定資産計		897,879	986,746
資産合計		5,358,635	5,556,772

（単位：千円）

	第14期事業年度 (平成24年3月31日)		第15期事業年度 (平成25年3月31日)	
負 債 の 部				
流動負債				
預り金		23,055		26,039
未払金		856,579		907,785
未払手数料		260,408		231,605
未払消費税等		123,864		85,231
その他未払金		472,305		590,948
未払費用	※2	1,012,629	※2	1,179,396
未払法人税等		629,961		270,170
前受金		17,136		20,044
流動負債計		2,539,361		2,403,436
固定負債				
退職給付引当金		150,425		161,047
役員退職慰労引当金		405,749		482,938
固定負債計		556,174		643,985
負債合計		3,095,536		3,047,421
純 資 産 の 部				
株主資本				
資本金		1,000,000		1,000,000
資本剰余金				
資本準備金		226,405		226,405
資本剰余金計		226,405		226,405
利益剰余金				
利益準備金		23,594		23,594
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		1,013,099		1,259,350
利益剰余金計		1,036,693		1,282,944
株主資本合計		2,263,099		2,509,350
純資産合計		2,263,099		2,509,350
負債純資産合計		5,358,635		5,556,772

（2）【損益計算書】

（単位：千円）

	第14期事業年度 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）		第15期事業年度 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）	
営業収益				
委託者報酬		10,249,870		10,223,443
運用受託報酬		2,143,793		2,546,566
その他営業収益		173,155		266,965
営業収益計		12,566,819		13,036,975
営業費用				
支払手数料		4,715,756		4,402,847
広告宣伝費		31,594		43,566
公告費		665		665
調査費		4,417,472		4,850,395
調査費	88,217		93,771	
委託調査費	4,328,431		4,755,711	
図書費	824		913	
委託計算費		148,330		155,472
営業雑経費		112,924		117,813
通信費	36,167		38,502	
印刷費	66,316		65,565	
協会費	10,099		13,407	
諸会費	341		337	
営業費用計		9,426,743		9,570,761
一般管理費				
給料		1,325,444		1,516,399
役員報酬	108,887		118,588	
給料・手当	810,010		882,301	
賞与	406,547		515,509	
交際費		8,983		7,591
寄付金		-		120
旅費交通費		29,376		42,660
租税公課		19,914		20,188
不動産賃借料		186,593		242,308
退職給付費用		91,953		128,612
役員退職慰労引当金繰入額		67,548		77,189
固定資産減価償却費		55,354		52,874
諸経費	※1	228,850	※1	235,601
一般管理費計		2,014,018		2,323,544
営業利益		1,126,057		1,142,669

（単位：千円）

		第14期事業年度 （自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日）		第15期事業年度 （自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）
営業外収益				
受取利息	※1	6,692	※1	3,281
受取配当金		834		1,000
為替差益		-		18,184
営業外収益計		7,527		22,466
営業外費用				
為替差損		3,081		-
営業外費用計		3,081		-
経常利益		1,130,502		1,165,136
税引前当期純利益		1,130,502		1,165,136
法人税、住民税及び事業税		620,800		562,687
法人税等調整額		△214,942		△43,802
法人税等合計		405,857		518,885
当期純利益		724,645		646,251

(3) 【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	第14期事業年度 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	第15期事業年度 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	1,000,000	1,000,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	1,000,000	1,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	226,405	226,405
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	226,405	226,405
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	-	23,594
当期変動額		
剰余金の配当	23,594	-
当期変動額合計	23,594	-
当期末残高	23,594	23,594
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
当期首残高	912,047	1,013,099
当期変動額		
剰余金の配当	△623,594	△400,000
当期純利益	724,645	646,251
当期変動額合計	101,051	246,251
当期末残高	1,013,099	1,259,350
利益剰余金合計		
当期首残高	912,047	1,036,693
当期変動額		
剰余金の配当	△600,000	△400,000
当期純利益	724,645	646,251
当期変動額合計	124,645	246,251
当期末残高	1,036,693	1,282,944
株主資本合計		
当期首残高	2,138,453	2,263,099
当期変動額		
剰余金の配当	△600,000	△400,000
当期純利益	724,645	646,251
当期変動額合計	124,645	246,251
当期末残高	2,263,099	2,509,350
純資産合計		
当期首残高	2,138,453	2,263,099
当期変動額		
剰余金の配当	△600,000	△400,000
当期純利益	724,645	646,251
当期変動額合計	124,645	246,251
当期末残高	2,263,099	2,509,350

重要な会計方針

項　目	第15期事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)満期保有目的の債券 償却原価法（定額法） (2)その他有価証券 時価のあるもの 期末日の市場価額等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの 移動平均法による原価法
2.固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産 定額法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物　12年～18年 器具備品　4年～8年 (2)無形固定資産 定額法によっております。 ただしソフトウエア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
3.引当金の計上基準	(1)退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び退職給付年金について当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当事業年度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。 なお、退職給付債務は、簡便法（直近の年金財政計算上の責任準備金に合理的な調整を加えた額をもって退職給付債務とする方法）により計算しております。 (2)役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支出に充てるため、内規に基づく期末要支給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	(1)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。ただし、固定資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は、発生会計期間の費用として処理しております。

会計上の見積りの変更

第14期事業年度　（自 平成23年4月1日　至 平成24年3月31日）

本社オフィス賃貸借契約に係る資産除去債務は、従来、使用見込期間を60ケ月として償却を行っておりましたが、当事業年度において、オフィス賃貸借契約の延長に伴い、使用見込期間を95ケ月に見直し、将来にわたり変更しております。

この変更により、従来の方法と比べて当事業年度の一般管理費が9,411千円減少し、営業利益、経常利益、及び税引前当期純利益が同額増加しております。

第15期事業年度　（自 平成24年4月1日　至 平成25年3月31日）

該当事項はありません。

注記事項

（貸借対照表関係）

第14期事業年度	第15期事業年度

(平成24年3月31日)	(平成25年3月31日)
※1 固定資産の減価償却累計額 建物 97,400千円 器具備品 139,289千円 ※2 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。 未払費用 2,813千円	※1 固定資産の減価償却累計額 建物 119,641千円 器具備品 162,046千円 ※2 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。 未払費用 2,575千円

（損益計算書関係）

第14期事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第15期事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
※1 関係会社との取引 諸経費 29,893千円 受取利息 647千円	※1 関係会社との取引 諸経費 39,195千円 受取利息 564千円

（株主資本等変動計算書関係）

第14期事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1． 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数（株）	当事業年度増加株式数（株）	当事業年度減少株式数（株）	当事業年度末株式数（株）
普通株式	78,270	―	―	78,270

2． 配当に関する事項

（1）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23年12月16日取締役会	普通株式	600,000	7,665.7	平成23年9月30日	平成23年12月22日

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

次の通り決議する予定であります。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成24年6月27日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	400,000	5,110.5	平成24年3月31日	平成24年6月28日

第15期事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1． 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数（株）	当事業年度増加株式数（株）	当事業年度減少株式数（株）	当事業年度末株式数（株）
普通株式	78,270	―	―	78,270

2． 配当に関する事項

（1）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24年6月27日定時株主総会	普通株式	400,000	5,110.5	平成24年3月31日	平成24年6月28日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成25年6月24日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	600,000	7,665.7	平成25年3月31日	平成25年6月27日

（リース取引関係）

第14期事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	第15期事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
オペレーティング・リース取引 （借主側） オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料 1年以内 178,581千円 1年超 443,119千円 合計 621,701千円	オペレーティング・リース取引 （借主側） オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料 1年以内 196,942千円 1年超 246,177千円 合計 443,119千円

（金融商品関係）

第14期事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は公募及び私募投資信託の設定、運用等の投資信託委託業務及び年金基金等に対して投資一任業務を行っております。

資金運用については、安全性の高い金融資産で運用し、デリバティブ取引は行っておらず、投機的な取引は行わない方針であります。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されております。

なお、その一部には外貨建てのものがあり、為替の変動リスクに晒されております。また、貸付金は親会社に対し貸付を行ったものであり、貸付先の信用リスクに晒されております。

営業債務であるその他未払金、未払手数料、未払費用は、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。また、その一部には外貨建てのものがあり、為替の変動リスクに晒されております。

預金の一部には外貨建てのものがあり、為替の変動リスクに晒されております。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、未収運用受託報酬に関連して、投資顧問業務マニュアルに従い、投資顧問部が主要な取引先の状況を定期的にモニタリングしております。

また、財務部が未収運用受託報酬を取引相手ごとに期日及び残高を管理するとともに、財務状況等の悪化等による回収懸念の早期把握を図っております。また、係る状況が発生した場合には、速やかに経営委員会において報告を行っております。

関係会社貸付金は、貸付先の信用リスクに晒されておりますが、財務部が貸付先の信用格付を定期的にモニタリングし、期日及び残高の管理を行っております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

当社は、外貨建ての預金、債権債務に関する為替の変動リスクに関して、経理規定に従い、財務部が外貨建ての預金及び債権債務残高を把握しております。また、定期的に行われる本社との財務・資金委員会において報告を行っております。

2．金融商品の時価等に関する事項

平成24年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、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含まれておりません。

（（注） 2．参照）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
（1）現金及び預金	1,912,467	1,912,467	―
（2）関係会社貸付金	400,000	400,000	―
（3）未収委託者報酬	594,342	594,342	―
（4）未収運用受託報酬	1,272,104	1,272,104	―
（5）投資有価証券	151,425	151,425	―
資産計	4,330,340	4,330,340	―
（1）その他未払金	472,305	472,305	―
（2）未払手数料	260,408	260,408	―
（3）未払費用	1,012,629	1,012,629	―
負債計	1,745,344	1,745,344	―

（注）1．　金融資産の時価の算定方法に関する事項

資産

（1）現金及び預金、（2）関係会社貸付金、（3）未収委託者報酬、（4）未収運用受託報酬

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。

（5）投資有価証券

上記表の投資有価証券は金銭信託及び投資信託受益証券であります。これらの時価について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、投資信託受益証券については基準価額を基礎としております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記をご参照ください。

負債

（1）その他未払金、（2）未払手数料、（3）未払費用

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．　時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	9,285

上記については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため「（5）投資有価証券」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

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内
現金及び預金	1,912,467	―
関係会社貸付金	400,000	―
未収委託者報酬	594,342	―
未収運用受託報酬	1,272,104	―
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	―	150,425
合計	4,178,915	150,425

第15期事業年度（自　平成24年4月1日　至　平成25年3月31日）

1．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は公募及び私募投資信託の設定、運用等の投資信託委託業務及び年金基金等に対して投資一任

業務を行っております。
資金運用については、安全性の高い金融資産で運用し、デリバティブ取引は行っておらず、投機的な取引は行わない方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク
営業債権である未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されております。
なお、その一部には外貨建てのものがあり、為替の変動リスクに晒されております。
営業債務であるその他未払金、未払手数料、未払費用は、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。また、その一部には外貨建てのものがあり、為替の変動リスクに晒されております。
預金の一部には外貨建てのものがあり、為替の変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制
①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理
当社は、未収運用受託報酬に関連して、投資顧問業務マニュアルに従い、投資顧問部が主要な取引先の状況を定期的にモニタリングしております。
また、財務部が未収運用受託報酬を取引相手ごとに期日及び残高を管理するとともに、財務状況等の悪化等による回収懸念の早期把握を図っております。また、係る状況が発生した場合には、速やかに経営委員会において報告を行っております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理
当社は、外貨建ての預金、債権債務に関する為替の変動リスクに関して、経理規定に従い、財務部が外貨建ての預金及び債権債務残高を把握しております。また、定期的に行われる本社との財務・資金委員会において報告を行っております。

2．金融商品の時価等に関する事項
平成25年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。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含まれておりません。
（（注） 2．参照）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	2,032,268	2,032,268	―
(2) 未収委託者報酬	556,977	556,977	―
(3) 未収運用受託報酬	1,629,769	1,629,769	―
(4) 投資有価証券	152,485	152,485	―
資産計	4,371,500	4,371,500	―
(1) その他未払金	590,948	590,948	―
(2) 未払手数料	231,605	231,605	―
(3) 未払費用	1,179,396	1,179,396	―
負債計	2,001,951	2,001,951	―

(注) 1． 金融資産の時価の算定方法に関する事項
資産
(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬
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。
(4) 投資有価証券
上記表の投資有価証券は金銭信託及び投資信託受益証券であります。これらの時価について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、投資信託受益証券については基準価額を基礎としております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記をご参照ください。

負債

（1）その他未払金、（2）未払手数料、（3）未払費用

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.　時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	9,285

上記については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため「（4）投資有価証券」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

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内
現金及び預金	2,032,268	―
未収委託者報酬	556,977	―
未収運用受託報酬	1,629,769	―
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	9,235	141,250
合計	4,228,249	141,250

（有価証券関係）

第14期事業年度 （平成24年3月31日）	第15期事業年度 （平成25年3月31日）
1.その他有価証券 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 金銭信託 貸借対照表計上額　150,425千円 取得原価　150,425千円 差額　― 投資信託受益証券 貸借対照表計上額　1,000千円 取得原価　1,000千円 差額　― （注）非上場株式（貸借対照表計上額9,285千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上記「その他有価証券」には含めておりません。	1.その他有価証券 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 金銭信託 貸借対照表計上額　150,485千円 取得原価　150,485千円 差額　― 投資信託受益証券 貸借対照表計上額　2,000千円 取得原価　2,000千円 差額　― （注）同 左

（退職給付関係）

第14期事業年度 （自　平成23年4月1日　至　平成24年3月31日）	第15期事業年度 （自　平成24年4月1日　至　平成25年3月31日）
1.採用している退職給付制度の概要 当社は、退職一時金制度と確定給付年金制度を併用しております。	1.採用している退職給付制度の概要 同 左

2.退職給付債務に関する事項 ①退職給付債務　607,350千円 ②年金資産　496,885千円 ③未積立退職給付債務　110,464千円 ④前払年金費用　39,960千円 ⑤退職給付引当金　150,425千円 3.退職給付費用に関する事項 ①退職給付費用　91,953千円 4.退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 ①退職給付債務及び費用の計算にあたっては簡便法を用いております。	2.退職給付債務に関する事項 ①退職給付債務　731,260千円 ②年金資産　570,213千円 ③退職給付引当金　161,047千円 3.退職給付費用に関する事項 ①退職給付費用　128,612千円 4.退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 ①同 左

（ストック・オプション等関係）

第14期事業年度 （自 平成23年4月1日　至 平成24年3月31日）	第15期事業年度 （自 平成24年4月1日　至 平成25年3月31日）
1.ストック・オプション等に係る当事業年度における費用計上額及び科目名 諸経費　29,893千円 2.ストック・オプション等の内容 当社は、親会社であるレッグ・メイソン・インクの株式報酬プランに基づき当社の役員等が受領する株式報酬にかかる費用を負担しておりますが、これらの費用については、「ストック・オプション等に関する会計基準」（企業会計基準第8号 平成17年12月27日）及び「ストック・オプション等に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第11号 平成18年5月31日）に準じた方法により会計処理をしております。	1.ストック・オプション等に係る当事業年度における費用計上額及び科目名 諸経費　39,195千円 2.ストック・オプション等の内容 同 左

（税効果会計関係）

第14期事業年度 （自 平成23年4月1日　至 平成24年3月31日）	第15期事業年度 （自 平成24年4月1日　至 平成25年3月31日）
1.繰延税金資産の発生の主な原因別内訳 千円 繰延税金資産 未払金　154,528 役員退職慰労引当金　154,225 退職給付引当金　57,176 未払費用　95,446 有価証券評価損　34,480 前払年金費用認容　△15,188 長期差入保証金　18,828 繰延税金資産小計　499,497 評価性引当額　△284,554 繰延税金資産合計　214,942 2.法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	1.繰延税金資産の発生の主な原因別内訳 千円 繰延税金資産 未払金　196,081 役員退職慰労引当金　183,580 退職給付引当金　61,214 未払費用　88,783 有価証券評価損　34,480 長期差入保証金　21,659 繰延税金資産小計　585,799 評価性引当額　△327,054 繰延税金資産合計　258,745 2.法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

		(%)
法定実効税率		40.7
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目		4.8
住民税均等割		0.3
その他	3.6	
評価性引当金		△12.2
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	△1.3	
税効果会計適用後の法人税等の負担率		35.9

3.法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引き下げ及び復興特別法人税の課税が行なわれることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、従来の40.7%から平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については35.6%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額は15,155千円減少し、法人税等調整額が15,155千円増加しております。

	(%)
法定実効税率	38.0
（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	2.6
住民税均等割	0.3
評価性引当金	3.6
税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.5

3．法人税等の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

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

第14期事業年度（自 平成23年4月1日　至 平成24年3月31日）

1．資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

(1) 当該資産除去債務の概要

当社は、本社オフィスの賃貸借契約において、建物所有者との間で賃室賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約上の義務に関して資産除去債務を認識しております。

(2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を95ケ月と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する差入保証金が計上されているため、当該差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

(3) 当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

期首残高	44,000千円
有形固定資産の取得に伴う増加額	―
その他増減額（△は減少）	5,535千円
期末残高	49,535千円

（4）当該資産除去債務の金額の見積もりの変更
会計上の見積もりの変更にて、当該変更の内容及び影響額を記載しております。

2．貸借対照表に計上しているもの以外の資産除去債務
該当事項はありません。

第15期事業年度（自 平成24年4月1日　至 平成25年3月31日）

1．資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

（1）当該資産除去債務の概要
当社は、本社オフィスの賃貸借契約において、建物所有者との間で賃室賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約上の義務に関して資産除去債務を認識しております。

（2）当該資産除去債務の金額の算定方法
使用見込期間を95ケ月と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。
なお、当該賃貸借契約に関連する差入保証金が計上されているため、当該差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

（3）当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

期首残高	49,535千円
有形固定資産の取得に伴う増加額	―
その他増減額（△は減少）	7,449千円
期末残高	56,984千円

2．貸借対照表に計上しているもの以外の資産除去債務
該当事項はありません。

（セグメント情報等関係）

［セグメント情報］
当社は「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り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）を行っております。
また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。
当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。
従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。

［関連情報］
第14期事業年度（自 平成23年4月1日　至 平成24年3月31日）

1．製品およびサービスごとの情報

（単位：千円）

	投資運用業	投資助言・代理業	その他	合計
外部顧客への営業収益	10,249,870	2,143,793	173,155	12,566,819

2．地域ごとの情報

（1）営業収益
本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
LM・ブラジル国債ファンド（毎月分配型）	5,307,295
LM・オーストラリア毎月分配型ファンド	2,322,660
LM・グローバル・プラス（毎月分配型）	1,262,838

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14期事業年度（自 平成23年4月1日　至 平成24年3月31日）
該当事項はありません。

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14期事業年度（自 平成23年4月1日　至 平成24年3月31日）
該当事項はありません。

報告セグメントごと負ののれん発生益に関する情報
第14期事業年度（自 平成23年4月1日　至 平成24年3月31日）
該当事項はありません。

第15期事業年度（自 平成24年4月1日　至 平成25年3月31日）

1．製品およびサービスごとの情報

（単位：千円）

	投資運用業	投資助言・代理業	その他	合計
外部顧客への営業収益	10,223,443	2,546,566	266,965	13,036,975

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3．主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称	営業収益
LM・ブラジル国債ファンド（毎月分配型）	4,317,846
LM・オーストラリア毎月分配型ファンド	2,578,957

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15期事業年度（自 平成24年4月1日　至 平成25年3月31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15期事業年度（自 平成24年4月1日　至 平成25年3月31日）
該当事項はありません。

報告セグメントごと負ののれん発生益に関する情報
第15期事業年度（自 平成24年4月1日　至 平成25年3月31日）
該当事項はありません。

（関連当事者情報）

第14期事業年度 （自 平成23年4月1日　至 平成24年3月31日）

１．関連当事者との取引
（１）財務諸表提出会社の親会社及び主要会社（会社等の場合に限る。）等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	レッグ・メイソン・インク	米国 メリーランド州 ボルティモア	百万米ドル 13	持株会社	被所有 直接 100%	資金の貸付 ストック・オプション費用の負担	貸付金の貸付	千円 400,000	関係会社貸付金	千円 400,000
							利息の受取（注１）	647	-	-
							諸経費の支払	29,893	未払費用	2,813

（取引条件及び取引条件の決定方針等）
（注１）貸付金の利率については、市場金利を勘案して合理的に決定しております。

（２）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

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド	英国 ロンドン市	百万米ドル 11	金融業	―	サービス契約 投資顧問契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 42,194	その他未収収益	千円 5,229
							委託調査費の支払（注１）	298,467	未払費用	22,766
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー	米国 カリフォルニア州 パサディナ	百万米ドル 42	金融業	―	サービス契約 投資顧問契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 106,571	その他未収収益	千円 12,619
							委託調査費の支払（注１）	123,492	未払費用	9,183
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーワイ・リミテッド	オーストラリア ビクトリア州 メルボルン	百万豪ドル 18	金融業	―	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 1,215,392	未払費用	千円 168,468
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント（株）	東京都 千代田区	億円 10	金融業	―	役員の兼任 投資顧問契約 オフィスの賃借	委託調査費の支払（注１）	千円 50,134	未払費用	千円 3,003
							-	-	長期差入保証金	125,397
							不動産賃借料等の支払	171,682	前払費用	14,347
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ディーティーブイエム・リミターダ	ブラジル サンパウロ州 サンパウロ	百万ブラジルレアル 69	金融業	―	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 1,369,414	未払費用	千円 119,655

同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン・アセット・マネジメント・シンガポール・ピーティーイー・リミテッド	シンガポール	百万ＳＧドル 27	金融業	－	役員の兼任 サービス契約	諸経費の支払	千円 3,649	未払費用	千円 11
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン・インターナショナル・エクイティーズ・リミテッド	英国 ロンドン市	百万米ドル 11	金融業	－	サービス契約 投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 100,792	未払費用	千円 9,240
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン・インベストメンツ・（ヨーロッパ）リミテッド	英国 ロンドン市	百万英ポンド 33	金融業	－	役員の兼任 サービス契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 20,465	その他未収収益	千円 1,766
同一の親会社を持つ会社	クリアブリッジ・アドバイザーズ・エルエルシー	米国 ニューヨーク州 ニューヨーク	-	金融業	－	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 1,655	未払費用	千円 132
同一の親会社を持つ会社	バッテリーマーチ・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 マサチューセッツ州 ボストン	米ドル 1	金融業	－	投資顧問契約	諸経費の支払	千円 5,773	未払費用	千円 36,132
							委託調査費の支払（注１）	397,710		
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン＆カンパニー・エルエルシー	米国 メリーランド州 ボルティモア	米ドル 1	サービス業	－	役員の兼任 サービス契約	調査費・諸経費の支払	千円 57,986	未払費用	千円 3,633
同一の親会社を持つ会社	ブランディワイン・グローバル・インベストメント・マネジメント・エルエルシー	米国 ペンシルバニア州 フィラデルフィア	-	金融業	－	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 769,721	未払費用	千円 560,000
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン・アセット・マネジメント・オーストラリア・リミテッド	オーストラリア ビクトリア州 メルボルン	百万豪ドル 43	金融業	－	役員の兼任 投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 1,644	未払費用	千円 680
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン・インベストメンツ・（ルクセンブルグ）エス・エー	ルクセンブルグ	百万米ドル 1	金融業	－	サービス契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 3,923	その他未収収益	千円 215

（取引条件及び取引条件の決定方針等）

（注１）委託調査費の支払は国内投信及び国内年金に係る運用・助言業務の再委託に対する支払であります。料率は関係会社間で協議の上合理的に決定しております。

（注２）その他営業収益の内容はグループで発行しているファンドの販売支援等のサービス費であります。料率は関係会社間で協議の上合理的に決定しております。

（注３）取引金額には消費税等を含めておりません。期末残高には消費税等を含めております。

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

レッグ・メイソン・インク　（ニューヨーク証券取引所に上場）

第15期事業年度　（自　平成24年4月1日　至　平成25年3月31日）

１．関連当事者との取引

（１）財務諸表提出会社の親会社及び主要会社（会社等の場合に限る。）等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	レッグ・メイソン・インク	米国 メリーランド州 ボルティモア	百万米ドル 12	持株会社	被所有 直接 100%	資金の貸付 ストック・オプション費用の負担	貸付金の回収	千円 400,000	-	千円 -
							利息の受取（注１）	564	-	-
							諸経費の支払	39,195	未払費用	2,575

（取引条件及び取引条件の決定方針等）

（注１）貸付金の利率については、市場金利を勘案して合理的に決定しております。

（２）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

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド	英国 ロンドン市	百万米ドル 11	金融業	―	サービス契約 投資顧問契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 52,186	その他未収収益	千円 5,012
							委託調査費の支払（注１）	240,059	未払費用	20,625
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー	米国 カリフォルニア州 パサディナ	百万米ドル 89	金融業	―	サービス契約 投資顧問契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 188,900	その他未収収益	千円 19,598
							委託調査費の支払（注１）	128,280	未払費用	12,811
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーワイ・リミテッド	オーストラリア ビクトリア州 メルボルン	百万豪ドル 18	金融業	―	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 1,552,092	未払費用	千円 208,705
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント（株）	東京都 千代田区	億円 10	金融業	―	役員の兼任 投資顧問契約 オフィスの賃借	委託調査費の支払（注１）	千円 28,049	未払費用	千円 2,478
							-	-	長期差入保証金	125,397
							不動産賃借料等の支払	173,252	前払費用	14,347
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ディーティーブイエム・リミターダ	ブラジル サンパウロ州 サンパウロ	百万ブラジルレアル 69	金融業	―	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 1,188,103	未払費用	千円 94,942
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン・インターナショナル・エクイティーズ・リミテッド	英国 ロンドン市	百万米ドル 11	金融業	―	サービス契約 投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 58,913	未払費用	千円 3,258
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン・インベストメンツ・（ヨーロッパ）リミテッド	英国 ロンドン市	百万英ポンド 33	金融業	―	役員の兼任 サービス契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 20,647	その他未収収益	千円 1,931

同一の親会社を持つ会社	クリアブリッジ・インベストメンツ・エルエルシー	米国 ニューヨーク州 ニューヨーク	-	金融業	－	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 6,892	未払費用	千円 5,602
同一の親会社を持つ会社	バッテリーマーチ・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 マサチューセッツ州 ボストン	米ドル 1	金融業	－	投資顧問契約	諸経費の支払	千円 4,286	未払費用	千円 42,331
							委託調査費の支払（注１）	405,099		
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン＆カンパニー・エルエルシー	米国 メリーランド州 ボルティモア	米ドル 1	サービス業	－	サービス契約	調査費・諸経費の支払	千円 55,589	未払費用	千円 4,478
同一の親会社を持つ会社	ブランディワイン・グローバル・インベストメント・マネジメント・エルエルシー	米国 ペンシルバニア州 フィラデルフィア	-	金融業	－	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 972,737	未払費用	千円 671,106
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン・アセット・マネジメント・オーストラリア・リミテッド	オーストラリア ビクトリア州 メルボルン	百万豪ドル 47	金融業	－	役員の兼任 サービス契約 投資顧問契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 3,928	その他未収収益	千円 1,481
							委託調査費の支払（注１）	174,894	未払費用	22,676
同一の親会社を持つ会社	レッグ・メイソン・インベストメンツ・（ルクセンブルグ）エス・エー	ルクセンブルグ	百万米ドル 1	金融業	－	サービス契約	その他営業収益の受取（注２）	千円 1,302	その他未収収益	千円 74
同一の親会社を持つ会社	ウェスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーイー・リミテッド	シンガポール	百万ＳＧドル 38	金融業	－	投資顧問契約	委託調査費の支払（注１）	千円 588	未払費用	千円 588

（取引条件及び取引条件の決定方針等）

（注１）委託調査費の支払は国内投信及び国内年金に係る運用・助言業務の再委託に対する支払であります。料率は関係会社間で協議の上合理的に決定しております。

（注２）その他営業収益の内容はグループで発行しているファンドの販売支援等のサービス費であります。料率は関係会社間で協議の上合理的に決定しております。

（注３）取引金額には消費税等を含めておりません。期末残高には消費税等を含めております。

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

レッグ・メイソン・インク　（ニューヨーク証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

第14期事業年度 （自　平成23年4月1日　至　平成24年3月31日）	第15期事業年度 （自　平成24年4月1日　至　平成25年3月31日）

１株当たり純資産額　28,914円00銭 １株当たり当期純利益金額　9,258円28銭 (注) １株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下の通りであります。 当期純利益　724,645千円 普通株式に帰属しない金額　- 普通株式に係る当期純利益　724,645千円 期中平均株式数　78千株 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	１株当たり純資産額　32,060円18銭 １株当たり当期純利益金額　8,256円69銭 (注) １株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下の通りであります。 当期純利益　646,251千円 普通株式に帰属しない金額　- 普通株式に係る当期純利益　646,251千円 期中平均株式数　78千株 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（重要な後発事象）

第14期事業年度 （自　平成23年4月1日　至　平成24年3月31日）	第15期事業年度 （自　平成24年4月1日　至　平成25年3月31日）
該当事項はありません。	該当事項はありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

原届出書の第三部 委託会社等の情報 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につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

（更新・訂正後）

(1)受託会社

①名称

野村信託銀行株式会社

②資本金の額

平成25年３月末現在　30,000百万円

③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)投資顧問会社

①ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・リミテッド

a.資本金の額

平成25年３月末現在　11百万米国ドル（1,034百万円）（米国ドルの円貨換算は、便宜上、平成25年３月末現在の株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１米国ドル＝94.05円）によります。）

b.事業の内容

英国において資産運用業務を営んでいます。

②ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー

a.資本金の額

平成25年３月末現在　89百万米国ドル（8,370百万円）（米国ドルの円貨換算は、便宜上、平成25年３月末現在の株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１米国ドル＝94.05円）によります。）

b.事業の内容

米国において資産運用業務を営んでいます。

(3)販売会社

名称	資本金の額（百万円） 平成25年３月末現在	事業の内容
ＳＭＢＣ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。
野村證券株式会社＊	10,000	

＊ ＬＭ・ユーロ・アルファ ポートフォリオＢ（為替ヘッジあり）について、一部解約請求の受付、受益権の買取り、収益分配金の再投資、収益分配金・償還金・一部解約金の支払い、口座管理機関としての業務等のみを行います。

独立監査人の監査報告書

平成２５年８月１２日

レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社
取 締 役 会　御 中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　英 公一

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　松村 洋季

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ＬＭ・ユーロ・アルファ ポートフォリオＡ（為替ヘッジなし）の平成２４年１２月１９日から平成２５年６月１８日までの特定期間の財務諸表、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、ＬＭ・ユーロ・アルファ ポートフォリオＡ（為替ヘッジなし）の平成２５年６月１８日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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
レッグ・メイソン・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

※上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。なお、財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

ＬＭ・ユーロ・アルファポートフォリオＢ(当期)へ

独立監査人の監査報告書

平成２５年８月１２日

レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社
取 締 役 会　御 中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　英 公一

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　松村 洋季

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ＬＭ・ユーロ・アルファ ポートフォリオＢ（為替ヘッジあり）の平成２４年１２月１９日から平成２５年６月１８日までの特定期間の財務諸表、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、ＬＭ・ユーロ・アルファ ポートフォリオＢ（為替ヘッジあり）の平成２５年６月１８日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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

レッグ・メイソン・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

※上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。なお、財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

委託会社の監査報告書(当期)へ

独立監査人の監査報告書

平成25年６月26日

レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社
取締役会御中

あらた監査法人
指定社員
業務執行社員　公認会計士　鶴田光夫

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」に掲げられているレッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社の平成24年４月１日から平成25年３月31日までの第15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、レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社の平成25年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

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

LM・ユーロ・アルファポートフォリオB(当期)へ