

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成24年8月17日
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目33番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポート部 部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0521
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	外国株式インデックス・オープン
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	上限10兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】**(1)【ファンドの名称】**

外国株式インデックス・オープン

（以下「当ファンド」、「本ファンド」又は「ファンド」ということがあります。）

(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。

委託会社である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の依頼により、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】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額（ 1 ）に追加設定時信託財産留保額（ 2 ）を加えた価額（販売基準価額）とします。

1「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。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。

2「信託財産留保額」とは、当初設定日以降の買付又は信託期間終了前の解約に際し、取得申込者又は解約者にご負担いただいて投資信託財産に繰り入れる金額のことをいいます。追加設定又は解約に対応して投資信託財産で有価証券等の取引を行う場合には、売買委託手数料等のコストが発生するほか、組入有価証券等の市場価格が変動するリスクを負うこととなります。信託財産留保額は、こうしたコストの負担について、受益権を継続して保有される受益者との公平性を図る目的で導入されています。当ファンドにおいては、当初設定日以降の買付の際に、取得申込受付日の翌営業日の基準価額の0.1%を「追加設定時信託財産留保額」として、また、信託期間終了前の解約の際に、解約請求受付日の翌営業日の基準価額の0.1%を「解約時信託財産留保額」としてご負担いただいております。以下同じ。

(5)【申込手数料】

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

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。

(7) 【申込期間】

平成24年8月19日から平成25年8月18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ます。継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、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】

受益権の取得申込みの方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

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

当ファンドは「分配金再投資コース」（収益分配金が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。このため受益権の取得申込者は、申込みの際に販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

受益権の取得申込みの受付の中止等

分配金再投資コースの収益分配金の再投資の場合を除き、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及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場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、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、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。

受付不可日

申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

- ニューヨーク証券取引所の休業日
- ロンドン証券取引所の休業日
- フランクフルト証券取引所の休業日
- ユーロネクスト パリ証券取引所の休業日
- ニューヨークの銀行の休業日
- ロンドンの銀行の休業日

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。

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

日本を除く世界の主要国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果を目指します。

信託金限度額

上限 3,000億円

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

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

(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
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を除く)			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年2回	日本			
不動産投信	年4回	北米			日経225
その他資産 (投資信託証券 (株式一般))	年6回 (隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり ()	
資産複合 ()	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
資産複合 ()	年12回 (毎月)	オセアニア			
資産複合 ()	年12回 (毎月)	中南米			
資産複合 ()	年12回 (毎月)	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	
資産複合 ()	年12回 (毎月)	中近東 (中東)			その他 (MSCI コクサイ・ インデックス(除く 日本、円ベース))
資産複合 ()	年12回 (毎月)	エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（用語の定義について）

当ファンドが該当する商品分類及び属性区分に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、これ以外の用語の定義については、社団法人投資信託協会のホームページ<http://www.toushin.or.jp/>をご覧ください。

商品分類

「追加型投信」...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

「海外」...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

「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います。

「インデックス型」...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

属性区分

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

「株式 一般」...大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。

当ファンドでは主要投資対象の投資信託証券を通じて株式に投資します。このため、収益の源泉となる資産を記載する商品分類表の投資対象資産が「株式」であるのに対して、組み入れている資産そのものを記載する属性区分表の投資対象資産は「その他資産（投資信託証券）」となっています。

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

「グローバル（日本を除く）」...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産（日本を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

「ファミリーファンド」...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資する旨の記載があるものをいいます。

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

「その他（MSCI コクサイ・インデックス（除く日本、円ベース））」...目論見書又は投資信託約款において、日経225又はTOPIXにあてはまらない指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

ファンドの特色

1. 日本を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とし、ファミリーファンド方式で運用を行います。

原則として、為替ヘッジは行いません。

2. MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果を目指します。

?

MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）とは

インデックスの概要 (2012年6月末現在)		地域別構成比		
構成国	23カ国		北米(65.0%)	米国/カナダ
構成銘柄数	1,310銘柄		欧州(28.6%)	英国/ドイツ/アイルランド/オランダ/フランス ベルギー/ポルトガル/オーストリア/スペイン デンマーク/イタリア/フィンランド/スイス スウェーデン/ギリシャ/ノルウェー
時価総額	約1,704兆円		アジア・オセアニア (6.1%)	香港/シンガポール/オーストラリア ニュージーランド
			中東(0.3%)	イスラエル

(出所)MSCI社のデータをもとに三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※時価総額は米国ドル建てデータを当該日の三菱東京UFJ銀行の為替データをもとに三井住友トラスト・アセットマネジメントが円換算しています。

※地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。

※[MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)]とは、MSCI社が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要国の株式指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。またMSCI社は、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。

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】

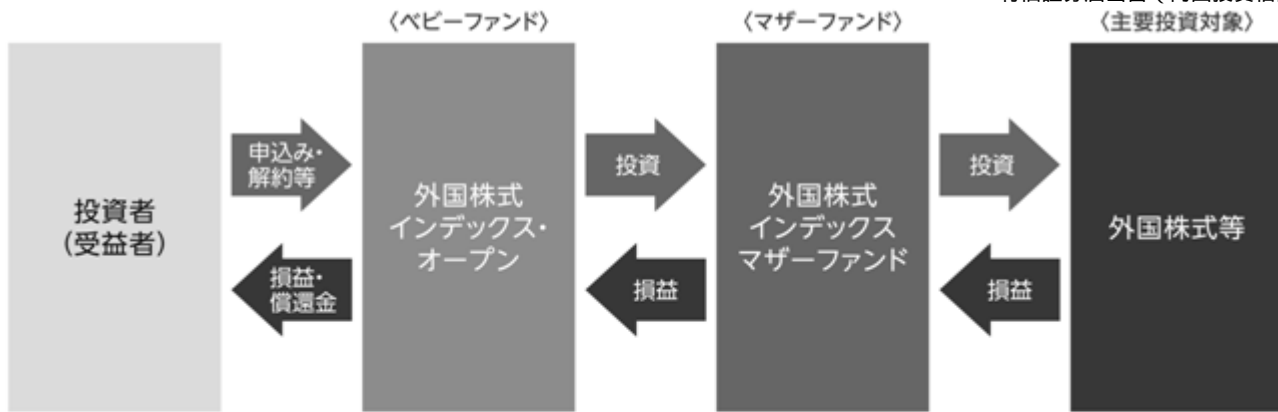
- 平成12年5月30日 当ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始
- 平成24年4月 1日 当ファンドの名称を「すみしん 外国株式インデックス・オープン」から「外国株式インデックス・オープン」に変更
- 当ファンドの主要投資対象である「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の名称を「外国株式インデックス マザーファンド」に変更

(3)【ファンドの仕組み】

ファミリーファンド方式での運用

ファミリーファンド方式()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、ベビーファンドごとにまとめ、その資金の全部又は一部をマザーファンドに投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。

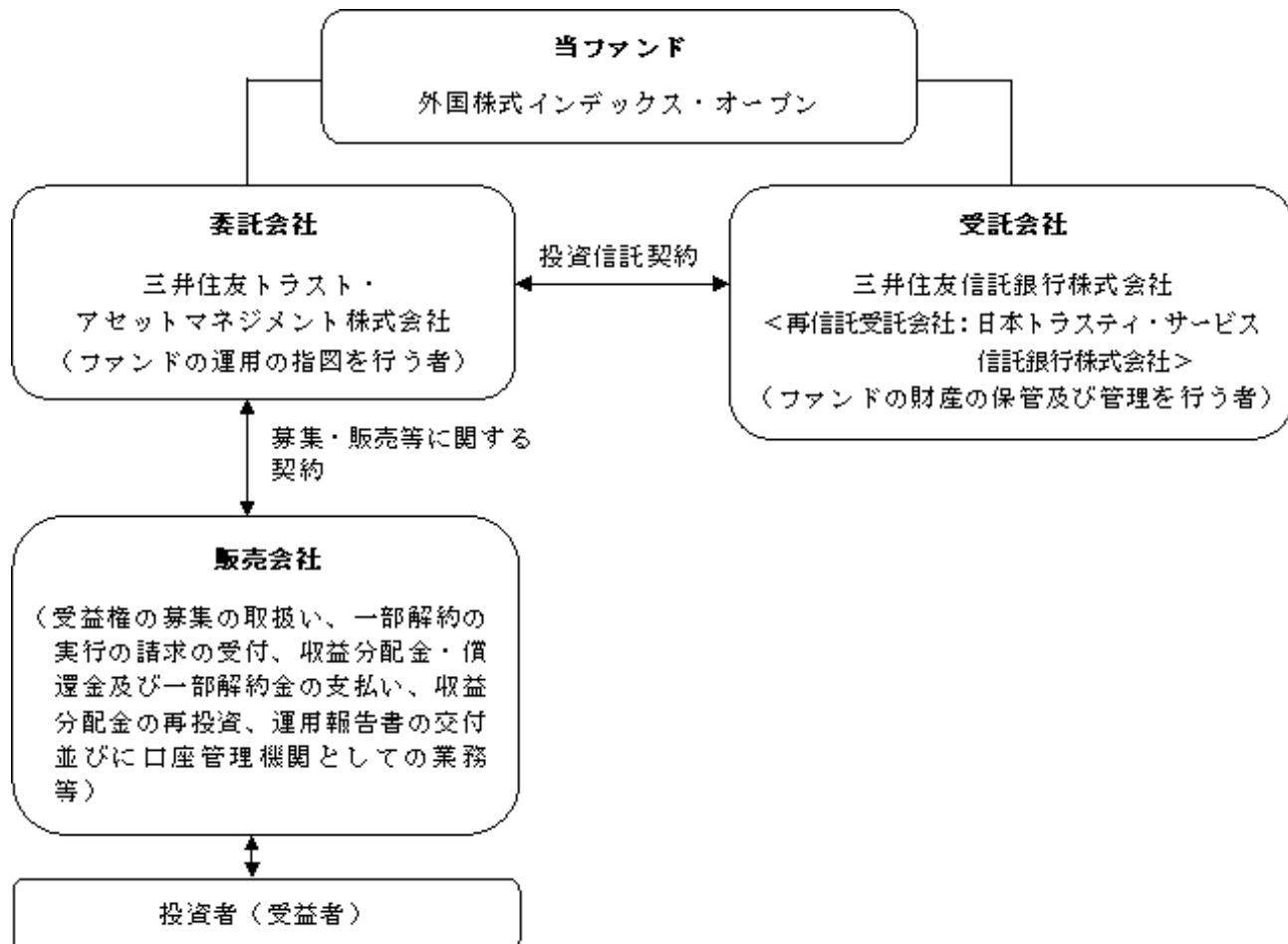


※マザーファンドの運用にあたっては、企業年金の運用等で国内外から定評のある三井住友信託銀行からモデルポートフォリオの提示等の投資助言を受けます。

〈マザーファンドの概要〉

マザーファンド	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
外国株式インデックスマザーファンド	原則として、MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)を構成している国の株式	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

当ファンドの関係法人



委託会社の概況

イ．資本金の額：3億円（平成24年6月29日現在）

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

八. 大株主の状況(平成24年6月29日現在)

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

当ファンドは、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

投資対象

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

投資態度

- 1)主として、外国株式インデックス マザーファンド受益証券に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- 2)株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- 3)外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。
- 4)運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の実質組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 5)有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、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、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。
- 6)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投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- 7)投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
- 8)投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、為替先渡取引を行うことができます。

(2)【投資対象】

有価証券の指図範囲

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外国株式インデックス マザーファンドの受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1.株券又は新株引受権証券
- 2.国債証券
- 3.地方債証券
- 4.特別の法律により法人の発行する債券
- 5.社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6.資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7.特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8.協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9.資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品

取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、前各号の証券又は証書の性質を有するもの

13. 証券投資信託又は外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14. 投資証券又は外国投資証券（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。）

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券又は証書、第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第1号の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券及び第12号並びに第17号の証券又は証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券及び第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

イ．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前号の権利の性質を有するもの

ロ．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、上記イ．第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（参考）マザーファンドの概要

「外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCI コクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

原則として、MSCI コクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）を構成している国の株式を主要

投資対象とします。

(2)投資態度

原則としてMSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

有価証券等の価格変動リスク及び為替変動リスクを回避するため、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、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、及び通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

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投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用並びに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

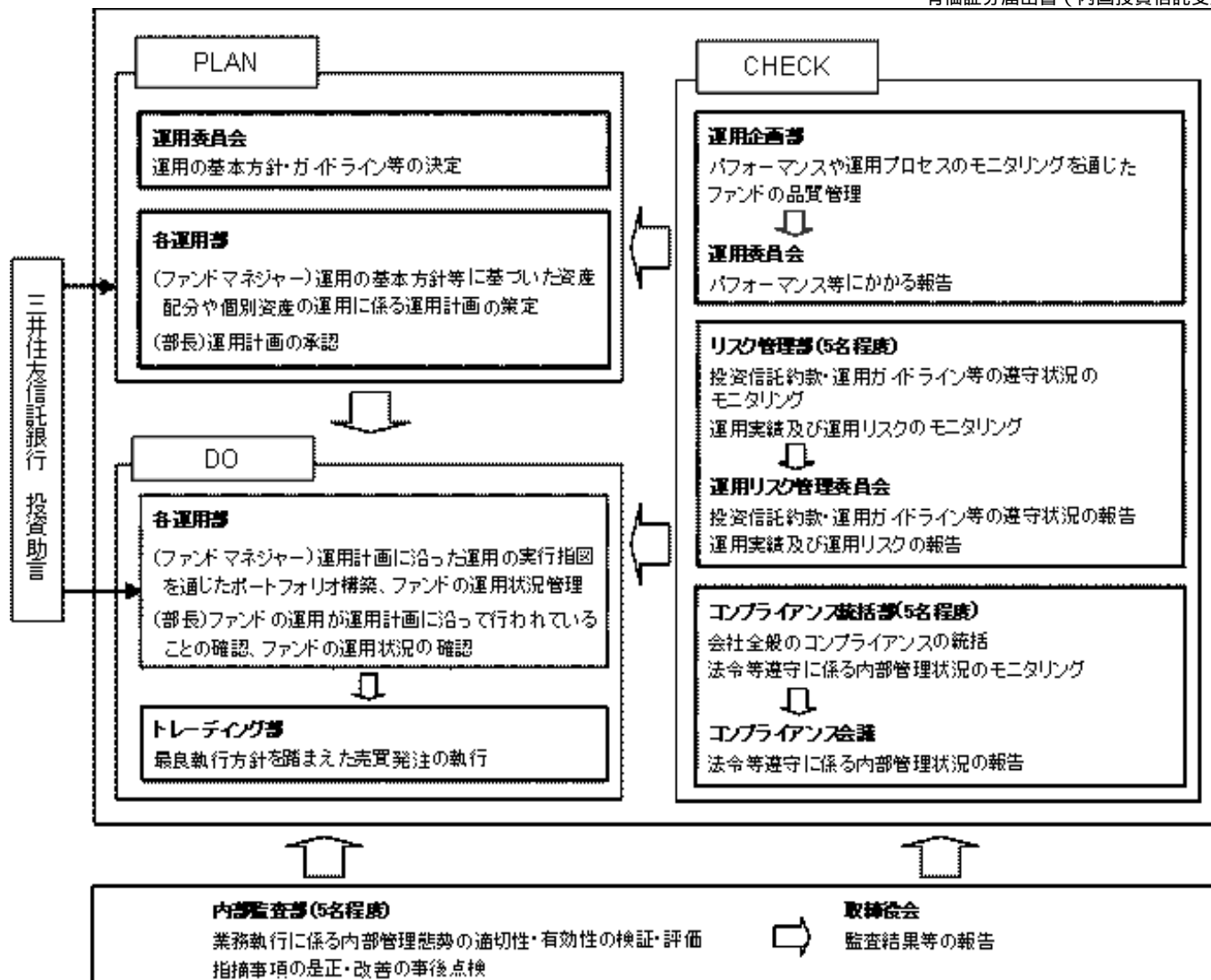
同一銘柄の転換社債、並びに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(3)【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、平成24年8月17日現在のものであり、今後変更されることがあります。



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

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

(4)【分配方針】

(イ) 分配方針

年1回の毎決算時（決算日は毎年5月29日、ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。

分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益（繰越分及びマザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）及び売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

分配対象額についての分配方針

委託会社が、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

(ロ) 収益の分配

投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- 1) 投資信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品賃料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とみなし配当等収益との合計額から諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
- 2) 売買損益に評価損益を加減して得た額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

上記におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの投資信託財産に係る配当等収益の額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

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】

(イ) 約款に定める投資制限

株式への実質投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の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、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付ける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、株券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ます。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券

2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券及び新株引受権付社債券の新株引受権の行使、並びに投資信託財産に属する新株予約権証券及び新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）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て取扱うものとします。（以下同じ。）また、委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及び先物オプション取引を行うことを指図することができます。

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、異なった通貨を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、並びに為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことを指図することができます。為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。

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

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、並びに運用の安定性を図るため、投資信託財産において一部解約の支払資金に不足額が生じるときは、資金借入れ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。当該資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とし、当該借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとします。また、借入金の利息は、投資信託財産中より支弁します。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 一部解約支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
3. 借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%以内

(ロ) 関連法令に基づく投資制限

デリバティブ取引に係る投資制限

(金融商品取引法、金融商品取引業等に関する内閣府令)

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

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

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。

株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化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。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

為替変動リスク

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

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。

カントリーリスク

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

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、MSCI コクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用
を行いますが、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率が小さかった
場合も同様です。

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

「分配金再投資コース」（ ）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

当ファンドは「分配金再投資コース」（収益分配金が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。

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「第2 管理及び運営 1申込（販売）手続等（1）申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(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 0.84%（税抜 0.8%）を乗じて得た額とします。その配分は下記の通りです。

委託会社	年率 0.378%	（税抜 0.36%）
販売会社	年率 0.3885%	（税抜 0.37%）
受託会社	年率 0.0735%	（税抜 0.07%）

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、売買委託手数料に対する消費税等相当額、先物取引・オプション取引に要する費用、組入資産の保管に要する費用（消費税等相当額を含みます。）等は、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（消費税等相当額を含みます。）は、受益者の負担とし、毎計算期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。

当初設定日以降の買付に際し、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を追加設定時信託財産留保額として当該基準価額に加算します。

信託期間終了前の解約に際し、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を解約時信託財産留保額として当該基準価額から控除します。

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

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

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ます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．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失については、確定申告により、上場株式等の譲渡所得の金額及び申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得の金額から控除することが可能となります。また、一部解約時及び償還時の差益については、上場株式等の譲渡損失との通算が可能となります。

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。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24年12月31日まで	7%
平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	7.147%
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

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

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24年6月29日現在のもので、税法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】

(1)【投資状況】

(平成24年6月29日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
外国株式インデックス マザーファンド	日本	1,199,913,785	99.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		323,781	0.03
合計(純資産総額)		1,200,237,566	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(参考情報)

外国株式インデックス マザーファンドの投資状況

(平成24年6月29日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	65,688,186,676	53.13
	イギリス	11,825,210,420	9.57
	カナダ	6,220,558,315	5.03
	スイス	4,888,790,486	3.95
	フランス	4,256,216,908	3.44
	オーストラリア	4,118,291,144	3.33
	ドイツ	4,023,676,352	3.25
	スウェーデン	1,550,084,944	1.25
	オランダ	1,471,241,929	1.19
	スペイン	1,326,823,588	1.07
	香港	1,283,990,538	1.04
	イタリア	1,028,774,260	0.83
	シンガポール	916,785,979	0.74
	アイルランド	781,073,072	0.63
	デンマーク	587,196,006	0.47
	ベルギー	566,019,666	0.46
	バミューダ	516,890,134	0.42
	アンティル	468,750,372	0.38
	ノルウェー	374,424,318	0.30
	フィンランド	366,571,173	0.30
ジャージー	349,748,061	0.28	
イスラエル	305,511,374	0.25	
ルクセンブルグ	213,764,984	0.17	
オーストリア	138,529,765	0.11	
ケイマン島	122,847,627	0.10	

	パナマ	84,695,524	0.07
	ポルトガル	73,473,785	0.06
	ニュージーランド	64,337,333	0.05
	マン島	36,980,123	0.03
	ギリシャ	24,055,590	0.02
	ガーンジー	21,747,057	0.02
	モーリシャス	18,930,681	0.02
	リベリア	18,592,801	0.02
	小計	113,732,770,985	92.00
投資信託受益証券	オーストラリア	45,463,675	0.04
	シンガポール	20,384,256	0.02
	小計	65,847,931	0.05
投資証券	アメリカ	1,813,430,687	1.47
	オーストラリア	347,297,611	0.28
	イギリス	140,617,665	0.11
	フランス	136,551,767	0.11
	香港	51,266,330	0.04
	シンガポール	36,885,959	0.03
	カナダ	30,342,358	0.02
	オランダ	15,191,996	0.01
	小計	2,571,584,373	2.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,255,481,152	5.87
合計(純資産総額)		123,625,684,441	100.00

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 【投資資産】(平成24年6月29日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

a . 投資有価証券の主要銘柄

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	1,369,608,247	0.8712	1,193,204,521	0.8761	1,199,913,785	99.97

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.97
合計	99.97

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考情報)

外国株式インデックス マザーファンドの投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	65,800	44,668.59	2,939,193,247	45,131.35	2,969,643,191	2.40
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	332,771	6,503.06	2,164,030,909	6,590.66	2,193,180,851	1.77
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	533,091	2,305.87	1,229,241,228	2,372.16	1,264,578,266	1.02
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	746,959	1,522.05	1,136,914,872	1,602.06	1,196,674,629	0.97
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	421,719	2,672.56	1,127,072,386	2,806.78	1,183,672,834	0.96
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	77,702	15,409.93	1,197,382,613	15,179.93	1,179,511,231	0.95
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	139,550	7,836.13	1,093,532,009	8,205.41	1,145,065,328	0.93
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	232,967	4,507.73	1,050,152,542	4,599.64	1,071,566,545	0.87
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエンス	193,298	4,957.66	958,307,328	5,309.01	1,026,221,285	0.83
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエンス	532,147	1,754.88	933,859,004	1,786.85	950,869,155	0.77
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用 品	194,452	4,955.36	963,581,064	4,781.59	929,791,663	0.75
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	353,656	2,526.15	893,388,906	2,575.98	911,013,895	0.74
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,274,538	628.08	800,519,262	687.25	875,933,683	0.71
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	143,768	5,965.84	857,696,907	6,072.76	873,069,522	0.71
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	121,534	6,769.74	822,753,679	6,790.52	825,279,325	0.67
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	18,216	46,898.58	854,304,544	44,755.42	815,264,841	0.66
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	3,517,935	212.51	747,602,044	222.60	783,095,708	0.63
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	268,250	2,654.62	712,103,108	2,845.64	763,343,681	0.62
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	352,649	2,042.51	720,290,184	2,048.57	722,428,736	0.58
アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	132,942	5,180.22	688,670,009	5,416.87	720,129,930	0.58
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエンス	162,389	4,105.95	666,762,393	4,336.57	704,212,483	0.57

アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	201,701	3,287.28	663,048,508	3,487.26	703,383,970	0.57
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	214,883	2,977.48	639,810,616	3,226.33	693,283,641	0.56
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,339,824	492.15	659,395,937	507.74	680,291,455	0.55
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	258,985	2,474.44	640,844,192	2,613.83	676,944,730	0.55
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	49,598	12,527.53	621,340,521	13,392.00	664,216,862	0.54
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	356,423	1,761.45	627,824,132	1,780.31	634,545,284	0.51
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	283,824	2,073.28	588,448,292	2,234.16	634,108,994	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	110,929	5,441.93	603,668,095	5,519.97	612,325,417	0.50
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	227,636	2,553.33	581,230,312	2,447.64	557,172,003	0.45

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	92.00
投資信託受益証券	0.05
投資証券	2.08
合計	94.13

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

c. 投資株式の業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	10.75
		素材	6.30
		資本財	6.83
		商業・専門サービス	0.77
		運輸	1.69
		自動車・自動車部品	1.11
		耐久消費財・アパレル	1.16
		消費者サービス	1.64
		メディア	2.57
		小売	2.88
		食品・生活必需品小売り	2.26
		食品・飲料・タバコ	6.94
		家庭用品・パーソナル用品	1.71
		ヘルスケア機器・サービス	2.66
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.82
銀行	6.82		

	各種金融	4.13
	保険	3.72
	不動産	0.67
	ソフトウェア・サービス	5.85
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.57
	電気通信サービス	3.97
	公益事業	3.64
	半導体・半導体製造装置	1.52
合計		92.00

(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業種の時価の比率です。

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	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	S&P 500 FUTU	シカゴ商業取引所	買建	アメリカドル	168	55,453,518.5	55,540,800	4,404,940,848	3.56
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	39	5,088,407.5	5,087,940	390,601,153	0.32
	SWISS MKT IX	ユーレックス・ ドイツ金融先物取引所	買建	スイスフラン	57	3,381,129	3,405,750	279,986,707	0.23
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	494	10,509,093	10,621,000	1,048,717,540	0.85
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア ドル	57	5,736,149	5,728,500	456,275,025	0.37
	FTSE 100	ロンドン国際金融 先物オプション取引所	買建	イギリスポンド	115	6,248,516.25	6,262,325	771,017,454	0.62

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

(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)	
第3期計算期間末 (平成15年 5月29日)	(分配付)	208,798,267	(分配付)	7,447
	(分配落)	208,798,267	(分配落)	7,447
第4期計算期間末 (平成16年 5月31日)	(分配付)	596,371,255	(分配付)	8,336
	(分配落)	596,371,255	(分配落)	8,336
第5期計算期間末 (平成17年 5月30日)	(分配付)	783,831,853	(分配付)	9,164
	(分配落)	775,806,504	(分配落)	9,070
第6期計算期間末 (平成18年 5月29日)	(分配付)	932,547,578	(分配付)	10,863
	(分配落)	916,491,244	(分配落)	10,676
第7期計算期間末 (平成19年 5月29日)	(分配付)	1,425,970,725	(分配付)	14,350
	(分配落)	1,398,185,125	(分配落)	14,071

第8期計算期間末 (平成20年 5月29日)	(分配付) 1,504,397,266 (分配落) 1,492,120,806	(分配付) 11,722 (分配落) 11,626
第9期計算期間末 (平成21年 5月29日)	(分配付) 1,018,126,762 (分配落) 1,003,204,349	(分配付) 6,801 (分配落) 6,701
第10期計算期間末 (平成22年 5月31日)	(分配付) 1,189,767,470 (分配落) 1,165,423,839	(分配付) 7,331 (分配落) 7,181
第11期計算期間末 (平成23年 5月30日)	(分配付) 1,408,612,396 (分配落) 1,382,676,461	(分配付) 8,147 (分配落) 7,997
第12期計算期間末 (平成24年 5月29日)	(分配付) 1,196,307,486 (分配落) 1,179,478,476	(分配付) 7,109 (分配落) 7,009
平成23年 6月末日	1,377,682,367	7,827
7月末日	1,320,483,560	7,495
8月末日	1,189,314,010	6,742
9月末日	1,111,910,422	6,328
10月末日	1,274,437,675	7,182
11月末日	1,153,152,434	6,576
12月末日	1,188,445,010	6,804
平成24年 1月末日	1,216,774,962	7,026
2月末日	1,357,617,760	7,814
3月末日	1,362,238,689	7,993
4月末日	1,335,689,309	7,845
5月末日	1,175,407,718	6,890
6月末日	1,200,237,566	7,042

【分配の推移】

期 間	1 万口当たりの分配金(円)
第3期計算期間 (平成14年 5月30日 ~ 平成15年 5月29日)	0
第4期計算期間 (平成15年 5月30日 ~ 平成16年 5月31日)	0
第5期計算期間 (平成16年 6月 1日 ~ 平成17年 5月30日)	100
第6期計算期間 (平成17年 5月31日 ~ 平成18年 5月29日)	200
第7期計算期間 (平成18年 5月30日 ~ 平成19年 5月29日)	300
第8期計算期間 (平成19年 5月30日 ~ 平成20年 5月29日)	100
第9期計算期間 (平成20年 5月30日 ~ 平成21年 5月29日)	100
第10期計算期間 (平成21年 5月30日 ~ 平成22年 5月31日)	150
第11期計算期間 (平成22年 6月 1日 ~ 平成23年 5月30日)	150
第12期計算期間 (平成23年 5月31日 ~ 平成24年 5月29日)	100

【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第3期計算期間 (平成14年 5月30日 ~ 平成15年 5月29日)	14.5

第4期計算期間（平成15年 5月30日～平成16年 5月31日）	11.9
第5期計算期間（平成16年 6月 1日～平成17年 5月30日）	9.9
第6期計算期間（平成17年 5月31日～平成18年 5月29日）	19.8
第7期計算期間（平成18年 5月30日～平成19年 5月29日）	34.4
第8期計算期間（平成19年 5月30日～平成20年 5月29日）	16.7
第9期計算期間（平成20年 5月30日～平成21年 5月29日）	41.5
第10期計算期間（平成21年 5月30日～平成22年 5月31日）	9.4
第11期計算期間（平成22年 6月 1日～平成23年 5月30日）	13.5
第12期計算期間（平成23年 5月31日～平成24年 5月29日）	11.1

(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）	受益権総口数（口）
第3期計算期間 （平成14年 5月30日～平成15年 5月29日）	161,667,909	1,002,246,445	280,376,553
第4期計算期間 （平成15年 5月30日～平成16年 5月31日）	571,050,572	136,015,859	715,411,266
第5期計算期間 （平成16年 6月 1日～平成17年 5月30日）	256,044,093	116,122,869	855,332,490
第6期計算期間 （平成17年 5月31日～平成18年 5月29日）	304,907,982	301,747,553	858,492,919
第7期計算期間 （平成18年 5月30日～平成19年 5月29日）	322,713,439	187,523,245	993,683,113
第8期計算期間 （平成19年 5月30日～平成20年 5月29日）	392,159,422	102,448,985	1,283,393,550
第9期計算期間 （平成20年 5月30日～平成21年 5月29日）	381,440,574	167,780,108	1,497,054,016
第10期計算期間 （平成21年 5月30日～平成22年 5月31日）	287,821,279	161,966,526	1,622,908,769
第11期計算期間 （平成22年 6月 1日～平成23年 5月30日）	272,270,796	166,117,168	1,729,062,397
第12期計算期間 （平成23年 5月31日～平成24年 5月29日）	176,510,360	222,671,729	1,682,901,028

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

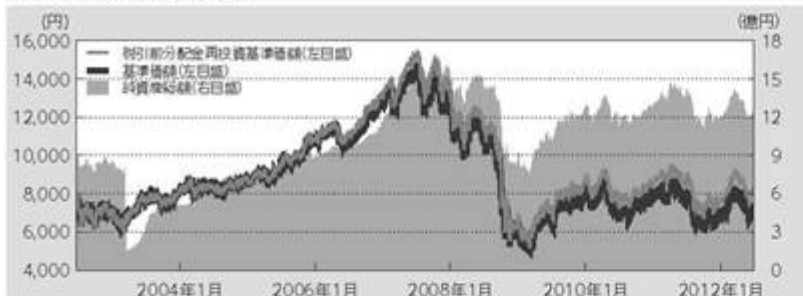
(参考情報) 交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2000年5月30日

作成基準日：2012年6月29日

基準価額・純資産の推移



※上記グラフ内の税引前分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
 ※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額 7,042円

純資産総額 12億円

〈基準価額の騰落率〉

1ヶ月 2.21%

3ヶ月 -10.64%

6ヶ月 4.97%

1年 -8.75%

3年 9.37%

5年 -46.50%

設定来 -20.01%

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額1,200円

決算期	2008年5月	2009年5月	2010年5月	2011年5月	2012年5月
分配金	100円	100円	150円	150円	100円

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

※上記は作成基準日からの期間です。

※騰落率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.4%
EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	1.8%
MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	1.0%
GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財	1.0%
AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	1.0%
INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	1.0%
CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	0.9%
NESTLE SA - REGISTERED	スイス	株式	食品・飲料・タバコ	0.9%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.8%
PFIZER	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.8%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※2012年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込手続

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

当ファンドは、収益の分配がなされた場合、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分配金再投資専用ファンドです。このため受益権の取得申込者は、申込みの際に販売会社との間で、自動けいぞく約款に従い分配金から税金を差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、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

販売会社によっては、定時定額で購入する「自動購入サービス」を利用することもできます。当該サービスを利用する場合には販売会社との間で「自動購入サービス」に関する取り決め（販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約又は規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。）を行うものとします。

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) 申込みの受付

申込期間中において、販売会社の営業日にお申込みいただけます。

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

(3) 申込単位

販売会社が定める単位とします（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。）。

詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、上記「(1) 申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

(4) 申込価額

ファンドの受益権の販売価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に追加設定時信託財産留保金（取得申込受付日の翌営業日の基準価額の0.1%）を加えた価額（販売基準価額）とします。

販売基準価額 = 取得申込受付日の翌営業日の基準価額 + 追加設定時信託財産留保金

= 取得申込受付日の翌営業日の基準価額 + （取得申込受付日の翌営業日の基準価額 × 0.1%）

なお、販売基準価額は、翌日の日本経済新聞に掲載されます（表示は1万口当たりには換算した価額で行われます。）。販売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、上記「(1) 申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

（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販売基準価額とします。

(5) 申込手数料

「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。

(6) 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。

(7) 受付不可日

申込日当日が下記のうちのいずれかの場合は、申込みを受け付けないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドン証券取引所の休業日
フランクフルト証券取引所の休業日
ユーロネクスト パリ証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行の休業日
ロンドンの銀行の休業日

(8) 申込受付の中止等

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を除き、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、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。

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

2【換金（解約）手続等】

(1) 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、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。

(2) 一部解約の受付

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

(3) 解約単位

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

(4) 解約価額

一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時信託財産留保額をを控除した価額（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。販売会社の詳細につきましては、上記「1申込（販売）手続等（1）申込手続」に記載の照会先に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。

なお、受益者の手取額は、当該解約価額から税額を差し引いた金額となります。

(5) 一部解約代金の支払い

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

(6) 受付不可日

一部解約受付日当日が下記のうちのいずれかの場合は、一部解約の実行の請求を受け付けません。

ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドン証券取引所の休業日

フランクフルト証券取引所の休業日

ユーロネクスト パリ証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドンの銀行の休業日

(7)一部解約受付の中止等

委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、上記(2)による一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及び既に受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

上記により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記(4)の規定に準じて計算された価額とします。

(8)その他

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。販売会社の詳細につきましては、上記「1申込（販売）手続等（1）申込手続」に記載の照会先までお問い合わせください。

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。

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を除きます。）を法令及び社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た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。

基準価額の算出頻度及び照会方法

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。

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、上記「1申込（販売）手続等（1）申込手続」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。

主要な投資対象資産の評価方法

イ．マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

ロ．マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします（平成12年5月30日設定）。

ただし、下記「(5)その他 信託の終了」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】

原則として、毎年5月30日から翌年5月29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】

信託の終了

イ．委託会社の所定の手続きによる終了

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

(ロ) 委託会社は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

(ハ) 所定の手続き

- a. 委託会社は、上記(イ)及び(ロ)の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- b. 上記a.の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- c. 上記b.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記(イ)及び(ロ)の投資信託契約の解約をしません。
- d. 委託会社は、上記(ロ)の投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。委託会社は、上記(イ)の投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- e. 上記b.からd.までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

ロ. 監督官庁の命令に伴う取扱い

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、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

ハ. 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、委託会社は、この投資信託契約を解約し信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この投資信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、後記「投資信託約款の変更等イ.(d)」に該当する場合を除き、この信託はその委託会社と受託会社との間において存続します。

ニ. 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。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し信託を終了させます。

投資信託約款の変更等

イ.(a) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しよう

する旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

- (b) 委託会社は、上記(a)の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (c) 上記(b)の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (d) 上記(c)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記(a)の投資信託約款の変更をしません。
- (e) 委託会社は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

ロ．委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、上記イ．に記載されている手続きにしたがいます。

反対者の買取請求権

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

運用報告書

委託会社は、毎決算時及び償還時に期中の運用経過のほか、投資信託財産の内容、有価証券売買状況等を記載した運用報告書を作成のうえ、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。

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。

投資信託財産の管理

イ．有価証券の保管

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

ロ．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。

八．信託財産の登記等及び記載等の留保等

- (イ) 信託の登記又は登録をすることができる信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。
- (ロ) 上記(イ)ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

(八) 信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

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

信託事務処理の再信託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き等

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。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

収益分配金は、原則として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12期計算期間(平成23年5月31日から平成24年5月29日まで)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。

(3) 住信アセットマネジメント株式会社は平成24年4月1日をもって中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、商号を三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に変更しております。

1【財務諸表】

外国株式インデックス・オープン

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 (平成23年5月30日現在)	第12期 (平成24年5月29日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	32,652,411	5,281,231
親投資信託受益証券	1,381,651,468	1,178,323,254
未収入金	-	18,082,529
未収利息	34	9
流動資産合計	1,414,303,913	1,201,687,023
資産合計	1,414,303,913	1,201,687,023
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	25,935,935	16,829,010
未払解約金	963	21,366
未払受託者報酬	492,125	463,106
未払委託者報酬	5,132,118	4,829,504
その他未払費用	66,311	65,561
流動負債合計	31,627,452	22,208,547
負債合計	31,627,452	22,208,547
純資産の部		
元本等		
元本	1,729,062,397	1,682,901,028
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	346,385,936	503,422,552
（分配準備積立金）	252,643,363	225,023,484
元本等合計	1,382,676,461	1,179,478,476
純資産合計	1,382,676,461	1,179,478,476
負債純資産合計	1,414,303,913	1,201,687,023

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期 (自 平成22年 6 月 1 日 至 平成23年 5 月30日)	第12期 (自 平成23年 5 月31日 至 平成24年 5 月29日)
営業収益		
受取利息	2,741	1,423
有価証券売買等損益	169,373,873	142,939,487
営業収益合計	169,376,614	142,938,064
営業費用		
受託者報酬	930,046	919,676
委託者報酬	9,698,962	9,590,813
その他費用	66,311	65,561
営業費用合計	10,695,319	10,576,050
営業利益又は営業損失（ ）	158,681,295	153,514,114
経常利益又は経常損失（ ）	158,681,295	153,514,114
当期純利益又は当期純損失（ ）	158,681,295	153,514,114
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（ ）	7,636,248	14,896,754
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	457,484,930	346,385,936
剰余金増加額又は欠損金減少額	46,651,252	45,732,266
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	46,651,252	45,732,266
剰余金減少額又は欠損金増加額	60,661,370	47,322,512
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	60,661,370	47,322,512
分配金	25,935,935	16,829,010
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	346,385,936	503,422,552

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第12期 (自 平成23年 5月31日 至 平成24年 5月29日)
資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法により親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第11期 (平成23年 5月30日現在)	第12期 (平成24年 5月29日現在)
1. 期首元本額	1,622,908,769円	1,729,062,397円
期中追加設定元本額	272,270,796円	176,510,360円
期中一部解約元本額	166,117,168円	222,671,729円
2. 元本の欠損	純資産額は、元本を346,385,936円下回っております。	純資産額は、元本を503,422,552円下回っております。
3. 計算期間末日における受益権の総数	1,729,062,397口	1,682,901,028口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	第11期 (自 平成22年 6月 1日 至 平成23年 5月30日)	第12期 (自 平成23年 5月31日 至 平成24年 5月29日)
分配金の計算過程	計算期間末における経費控除後の配当等収益（28,065,341円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、経費控除後繰越欠損補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（566,853,516円）及び分配準備積立金（250,513,957円）により、分配対象収益は845,432,814円（1万口当たり4,889円54銭）であり、うち25,935,935円（1万口当たり150円）を分配金額としております。	計算期間末における経費控除後の配当等収益（19,409,261円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、経費控除後繰越欠損補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（575,533,677円）及び分配準備積立金（222,443,233円）により、分配対象収益は817,386,171円（1万口当たり4,857円00銭）であり、うち16,829,010円（1万口当たり100円）を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第12期 (自 平成23年 5月31日 至 平成24年 5月29日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、金融商品に対する取組方針は投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドは、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。 なお、当ファンドには、以下のリスクがあります。 ・ 株価変動リスク ・ 為替変動リスク ・ 信用リスク
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行います（運用を外部委託しているファンドも含まれます。）。 モニタリング結果は、原則月1回（必要に応じ随時）開催される運用リスクの管理、コンプライアンスに関する委員会等に報告され、委員会等は適切な運用リスク管理・法令遵守に必要な措置を講じます。 内部監査部門は、独立した立場でリスク管理体制の適切性・有効性を検証し、評価を行います。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価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。

金融商品の時価に関する事項

項目	第12期 (平成24年 5月29日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	a. 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 b. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第11期 (平成23年 5月30日現在)	第12期 (平成24年 5月29日現在)
	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	163,359,445	123,962,928
合計	163,359,445	123,962,928

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、決算日現在の評価換え額です。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第11期 (平成23年 5月30日現在)	第12期 (平成24年 5月29日現在)
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第12期
（自 平成23年 5月31日
至 平成24年 5月29日）

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

(1口当たり情報)

第11期 （平成23年 5月30日現在）	第12期 （平成24年 5月29日現在）
1口当たり純資産額 = 0.7997円 （1万口当たり純資産額 = 7,997円）	1口当たり純資産額 = 0.7009円 （1万口当たり純資産額 = 7,009円）

(4)【附属明細表】（平成24年5月29日現在）

1)有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	総口数(口)	評価額(円)
親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	1,352,218,561	1,178,323,254
合計		1,352,218,561	1,178,323,254

2)信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3)デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「外国株式インデックス・オープン」は、「外国株式インデックス マザーファンド」を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、「外国株式インデックス マザーファンド」の受益証券です。

「外国株式インデックス マザーファンド」の状況は次の通りです。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「外国株式インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

(単位：円)

	(平成23年 5月30日現在)	(平成24年 5月29日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	4,166,665,780	7,803,187,408

コール・ローン	113,934,734	119,026,603
株式	119,149,817,799	107,375,117,053
投資信託受益証券	143,048,582	62,723,824
投資証券	1,997,261,296	2,265,587,678
派生商品評価勘定	137,273,224	7,380,188
未収入金	40,839,183	8,034,180
未収配当金	270,600,082	247,148,968
未収利息	121	208
差入委託証拠金	1,098,925,707	2,212,997,647
流動資産合計	127,118,366,508	120,101,203,757
資産合計	127,118,366,508	120,101,203,757
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	29,449,572	608,475,203
未払金	57,471,872	
未払解約金	11,730,820	37,060,809
流動負債合計	98,652,264	645,536,012
負債合計	98,652,264	645,536,012
純資産の部		
元本等		
元本	130,636,855,156	137,077,083,763
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,617,140,912	17,621,416,018
元本等合計	127,019,714,244	119,455,667,745
純資産合計	127,019,714,244	119,455,667,745
負債純資産合計	127,118,366,508	120,101,203,757

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	(自 平成23年 5月31日 至 平成24年 5月29日)
1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>

	<p>(3) 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(4) 先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。</p> <p>(5) 外国為替予約 個別法に基づき、時価評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として我が国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等の会計処理は「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条に基づいております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、株式・投資信託受益証券・投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、まだ確定していない場合には、入金日基準で計上しております。</p>

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

	（平成23年5月30日現在）	（平成24年5月29日現在）
1. 期首元本額	133,737,897,348円	130,636,855,156円
期中追加設定元本額	22,002,337,849円	34,052,038,424円
期中一部解約元本額	25,103,380,041円	27,611,809,817円
期末元本額	130,636,855,156円	137,077,083,763円
元本額の内訳		
SBI資産設計オープン（資産成長型）	692,882,100円	922,224,529円
SBI資産設計オープン（分配型）	30,366,895円	27,313,494円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	13,635,345,008円	16,931,142,182円
世界経済インデックスファンド	434,813,023円	677,038,637円
マイセレクション25	24,193,487円	20,608,341円
マイセレクション50	99,439,814円	79,360,999円
マイセレクション75	98,727,558円	90,682,169円
外国株式インデックス・オープン	1,421,013,544円	1,352,218,561円
DCマイセレクション25	700,382,280円	1,017,243,870円
DCマイセレクション50	4,411,475,905円	5,242,168,327円
DCマイセレクション75	4,648,577,341円	5,314,810,322円
DC外国株式インデックス・オープン	4,566,217,889円	5,188,697,010円

DCマイセレクションS25	102,084,518円	264,000,697円
DCマイセレクションS50	671,336,574円	1,383,438,336円
DCマイセレクションS75	572,689,257円	981,261,077円
DCターゲット・イヤールファンド2015	8,726,349円	9,388,350円
DCターゲット・イヤールファンド2025	76,552,323円	131,423,954円
DCターゲット・イヤールファンド2035	59,248,259円	116,702,956円
DCターゲット・イヤールファンド2045	21,800,326円	43,868,630円
すみしん DCマルチアセット ファンド	64,271円	
DC世界経済インデックスファンド		3,860,060円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	7,734,165,334円	8,366,723,548円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	280,638,964円	261,349,403円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	135,764,370円	135,243,322円
外国株式インデックス・オープンVA1 （適格機関投資家専用）	608,403,737円	569,346,726円
マイセレクション50VA2（適格機関投資家専用）	1,659,025円	1,244,902円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	1,341,821,388円	1,322,880,748円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	5,149,463,886円	5,159,243,731円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	12,964,911,863円	12,720,602,315円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	3,934,083,303円	3,901,967,648円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	6,107,126,519円	5,617,880,426円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,563,826,311円	1,539,756,283円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	9,579,125,024円	9,315,892,134円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	20,319,122,823円	20,347,793,563円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	9,151,778,858円	9,295,259,542円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,671,955,426円	1,616,365,370円
グローバルバランスファンドVA35 （適格機関投資家専用）	1,495,091,242円	1,565,163,546円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	544,413,259円	563,481,330円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,498,950,245円	525,666,833円
FOFs用外国株式インデックス・オープン （適格機関投資家専用）	7,690,117,006円	7,769,557,635円
外国株式ファンド・シリーズ1	6,588,499,852円	6,684,212,257円
2. 元本の欠損	純資産額は、元本を 3,617,140,912円下回って おります。	純資産額は、元本を 17,621,416,018円下回っ ております。
3. 計算期間末日における受益権の総数	130,636,855,156口	137,077,083,763口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成23年 5月31日 至 平成24年 5月29日)
----	----------------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、金融商品に対する取組方針は投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドは、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。 なお、当ファンドには、以下のリスクがあります。 ・ 株価変動リスク ・ 為替変動リスク ・ 信用リスク
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行います（運用を外部委託しているファンドも含まれます。）。 モニタリング結果は、原則月1回（必要に応じ随時）開催される運用リスクの管理、コンプライアンスに関する委員会等に報告され、委員会等は適切な運用リスク管理・法令遵守に必要な措置を講じます。 内部監査部門は、独立した立場でリスク管理体制の適切性・有効性を検証し、評価を行います。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価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。

金融商品の時価に関する事項

項目	(平成24年 5月29日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>a. 株式、投資信託受益証券、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>b. 先物取引 原則として計算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。 外貨建て先物取引の時価の邦貨換算額は計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。換算において円未満の端数は切り捨てております。</p>

- c. 外国為替予約
1. 計算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。
- 計算期間末日において為替予約の受渡日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。
- 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場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。
- ・ 計算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該当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。
 - ・ 計算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、該当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. 計算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、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
- d. コールローン等の金銭債権及び金銭債務
- これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	(平成23年 5月30日現在)	(平成24年 5月29日現在)
	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)
株式	17,283,303,576	7,327,992,863
投資信託受益証券	6,511,084	8,586,734
投資証券	345,261,679	39,552,145
合計	17,635,076,339	7,297,027,452

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、決算日現在の評価換え額です。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

区分	種 類	(平成23年 5月30日現在)		
		契 約 額 等(円)	時 価	評 価 損 益

区分	種類	(平成24年 5月29日現在)		
		契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建			
	S&P 500 FUTU	3,336,791,347	3,415,103,406	78,312,059
	S&P/TSE 60	352,873,336	352,783,946	89,390
	SPI 200 FUTU	367,416,059	365,411,964	2,004,095
	FTSE 100	690,148,526	703,273,566	13,125,040
	SWISS MKT IX	249,343,508	259,152,498	9,808,990
	DJ EURO STOXX	1,113,200,256	1,122,279,480	9,079,224
合計		6,109,773,032	6,218,004,860	108,231,828

(注) 時価の算定方法

前述の(金融商品の時価に関する事項)に記載していますのでここでは省略しております。

株式関連

区分	種類	(平成24年 5月29日現在)		
		契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建			
	S&P 500 FUTU	6,138,853,341	5,833,376,155	305,477,186
	S&P/TSE 60	570,494,588	537,759,149	32,735,439
	SPI 200 FUTU	609,537,159	579,542,985	29,994,174
	FTSE 100	1,088,669,903	1,016,876,783	71,793,120
	SWISS MKT IX	388,321,409	374,973,631	13,347,778
	DJ EURO STOXX	1,553,287,982	1,405,557,497	147,730,485
合計		10,349,164,382	9,748,086,200	601,078,182

(注) 時価の算定方法

前述の(金融商品の時価に関する事項)に記載していますのでここでは省略しております。

通貨関連

区分	種類	(平成23年 5月30日現在)		
		契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)

市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	348,167,877		347,741,000	426,877
	カナダドル	33,947,980		33,931,600	16,380
	オーストラリアドル	21,626,700		21,633,100	6,400
	イギリスポンド	54,653,720		54,653,000	720
	スイスフラン	21,856,946		21,856,900	46
	香港ドル	7,384,071		7,384,000	71
	シンガポールドル	5,241,584		5,241,600	16
	スウェーデンクローナ	16,296,278		16,380,000	83,722
	ノルウェークローネ	2,679,966		2,678,400	1,566
	デンマーククローネ	2,169,944		2,168,600	1,344
	イスラエルシェケル	1,634,360		1,633,800	560
	ユーロ	92,536,250		92,472,000	64,250
	売建				
カナダドル	4,190,000		4,138,000	52,000	
スイスフラン	2,817,600		2,850,900	33,300	
スウェーデンクローナ	8,444,800		8,450,000	5,200	
合 計	623,648,076		623,212,900	408,176	

（注）時価の算定方法

前述の（金融商品の時価に関する事項）に記載していますのでここでは省略しております。

通貨関連

区分	種 類	（平成24年 5月29日現在）			
		契 約 額 等（円）		時 価 （円）	評 価 損 益 （円）
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	34,966,448		35,006,400	39,952
	カナダドル	3,872,700		3,877,500	4,800
	オーストラリアドル	7,811,600		7,810,000	1,600
	イギリスポンド	12,468,650		12,458,000	10,650
	スイスフラン	12,462,375		12,433,500	28,875
	香港ドル	5,120,000		5,125,000	5,000
	スウェーデンクローナ	7,790,440		7,763,000	27,440
	売建				
ユーロ	21,916,180		21,914,200	1,980	
合 計	106,408,393		106,387,600	16,833	

（注）時価の算定方法

前述の（金融商品の時価に関する事項）に記載していますのでここでは省略しております。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成23年 5月31日 至 平成24年 5月29日)
当計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。

(1口当たり情報)

(平成23年 5月30日現在)	(平成24年 5月29日現在)
1口当たり純資産額 = 0.9723円 (1万口当たり純資産額 = 9,723円)	1口当たり純資産額 = 0.8714円 (1万口当たり純資産額 = 8,714円)

(3)附属明細表(平成24年5月29日現在)

1)有価証券明細表

株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	3 M COMPANY	44,515	84.78	3,773,981.70	
	ABBOTT LABORATORIES	104,153	62.25	6,483,524.25	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	6,225	36.23	225,531.75	
	ACCENTURE PLC-CL A	42,851	57.44	2,461,361.44	
	ACE LTD	22,520	73.18	1,648,013.60	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	34,426	12.24	421,374.24	
	ADOBE SYSTEMS INC	32,821	31.60	1,037,143.60	
	ADVANCE AUTO PARTS	5,036	73.67	371,002.12	
	ADVANCED MICRO DEVICES	39,607	6.22	246,355.54	
	AES CORP	45,207	12.55	567,347.85	
	AETNA INC	24,223	41.20	997,987.60	
	AFLAC	31,209	39.22	1,224,016.98	
	AGCO CORP	6,928	40.11	277,882.08	
	AGILENT TECHNOLOGIES	23,215	41.01	952,047.15	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	14,072	79.94	1,124,915.68	
	AIRGAS INC	4,822	87.77	423,226.94	
	AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	12,433	29.31	364,411.23	
	ALCOA	71,159	8.63	614,102.17	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	12,379	92.42	1,144,067.18	
	ALLEGHANY CORP	880	329.50	289,960.00	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	6,756	34.11	230,447.16	
	ALLERGAN INC	20,394	90.53	1,846,268.82	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,462	127.18	440,297.16	
	ALLIANT ENERGY CORPORATION	7,420	44.04	326,776.80	
	ALLSTATE CORP	33,788	33.57	1,134,263.16	
	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	15,231	11.17	170,130.27	
	ALTERA CORPORATION	21,453	34.42	738,412.26	
ALTRIA GROUP INC	137,491	32.11	4,414,836.01		

AMAZON.COM	24,400	212.89	5,194,516.00
AMEREN CORPORATION	16,196	32.06	519,243.76
AMERICAN ELECTRIC POWER	32,287	38.23	1,234,332.01
AMERICAN EXPRESS	69,891	55.81	3,900,616.71
AMERICAN INT'L GROUP	35,972	28.99	1,042,828.28
AMERICAN WATER WORKS CO INC	12,162	34.06	414,237.72
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,127	47.78	722,768.06
AMERISOURCEBERGEN CORP	17,273	36.90	637,373.70
AMETEK INC	10,704	49.22	526,850.88
AMGEN	53,053	69.05	3,663,309.65
AMPHENOL CORPORATION	11,081	53.22	589,730.82
ANADARKO PETROLEUM CORP	33,294	63.08	2,100,185.52
ANALOG DEVICES	19,922	36.19	720,977.18
AON PLC	19,453	47.39	921,877.67
APACHE CORP	25,678	82.38	2,115,353.64
APOLLO GROUP INC-CLA	8,140	33.12	269,596.80
APPLE INC	62,200	562.29	34,974,438.00
APPLIED MATERIALS	88,089	10.54	928,458.06
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,972	38.31	343,717.32
ARCH COAL INC	15,406	7.23	111,385.38
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	44,661	32.25	1,440,317.25
ARROW ELECTRONICS INC	7,742	34.34	265,860.28
ASSURANT INC	6,382	33.25	212,201.50
AT&T INC	400,219	33.69	13,483,378.11
AUTODESK INC	15,151	32.12	486,650.12
AUTOLIV INC	6,206	57.16	354,734.96
AUTOMATIC DATA PROCESS	32,674	52.68	1,721,266.32
AUTOZONE INC	1,605	374.37	600,863.85
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	15,310	33.15	507,526.50
AVERY DENNISON CORP	7,057	29.45	207,828.65
AVNET INC	10,281	30.55	314,084.55
AVON PRODUCTS INC	28,801	16.59	477,808.59
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,295	33.70	279,541.50
BAKER HUGHES	29,182	41.54	1,212,220.28
BALL CORP	10,706	39.88	426,955.28
BANK NEW YORK CO	81,076	20.64	1,673,408.64
BANK OF AMERICA CORP	677,679	7.15	4,845,404.85
BARD C R INC	5,944	99.90	593,805.60
BAXTER INTERNATIONAL	37,700	51.99	1,960,023.00
BB&T CORP	46,609	30.43	1,418,311.87
BEAM INC	9,355	57.99	542,496.45
BECTON DICKINSON & CO	14,368	74.42	1,069,266.56
BED BATH & BEYOND INC	16,408	72.40	1,187,939.20
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	60,651	79.25	4,806,591.75
BEST BUY COMPANY INC	21,408	19.17	410,391.36

BIOGEN IDEC INC	15,429	131.56	2,029,839.24
BLACKROCK INC	6,973	171.36	1,194,893.28
BLOCK H & R INC	20,508	15.19	311,516.52
BMC SOFTWARE	11,793	43.69	515,236.17
BOEING CO	47,208	70.00	3,304,560.00
BORGWARNER INC	7,359	74.33	546,994.47
BOSTON SCIENTIFIC CORP	99,053	5.87	581,441.11
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	113,296	33.09	3,748,964.64
BROADCOM CORP-CL A	32,494	31.68	1,029,409.92
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,768	87.71	505,911.28
BUNGE LIMITED	9,731	61.06	594,174.86
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10,977	59.69	655,217.13
CA INC	26,390	25.12	662,916.80
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	13,601	11.66	158,587.66
CABOT OIL & GAS CORP	13,973	34.77	485,841.21
CALPINE CORP	21,201	16.91	358,508.91
CAMERON INTERNATIONAL CORP	16,394	47.94	785,928.36
CAMPBELL SOUP CO (US)	12,847	32.58	418,555.26
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,318	51.13	1,703,549.34
CARDINAL HEALTH	23,100	41.67	962,577.00
CAREFUSION CORP	15,018	24.90	373,948.20
CARMAX INC	15,187	29.11	442,093.57
CARNIVAL CORPORATION	29,951	31.95	956,934.45
CATERPILLAR	43,233	89.94	3,888,376.02
CBRE GROUP INC-A	19,735	16.38	323,259.30
CBS CORP-CL B	40,978	31.56	1,293,265.68
CELANESE CORP-SERIES A	10,437	40.78	425,620.86
CELGENE CORP	29,681	68.90	2,045,020.90
CENTERPOINT ENERGY INC	27,054	20.18	545,949.72
CENTURYLINK INC	41,711	38.94	1,624,226.34
CERNER CORP	9,627	79.01	760,629.27
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,372	166.56	728,200.32
CHESAPEAKE ENERGY CORP	44,078	15.81	696,873.18
CHEVRON CORP	133,150	98.86	13,163,209.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,099	400.42	840,481.58
CHUBB CORPORATION	18,592	71.75	1,333,976.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,912	53.56	530,886.72
CIGNA CORP	19,086	44.50	849,327.00
CIMAREX ENERGY CO	5,941	54.05	321,111.05
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,669	35.66	380,456.54
CINTAS CORP	7,806	37.31	291,241.86
CISCO SYSTEMS	359,428	16.33	5,869,459.24
CIT GROUP INC	12,744	34.79	443,363.76
CITIGROUP	195,478	26.47	5,174,302.66
CITRIX SYSTEMS INC	12,469	75.43	940,536.67

CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	9,562	50.28	480,777.36
CLOROX COMPANY	8,819	69.59	613,714.21
CME GROUP INC	4,217	262.52	1,107,046.84
COACH INC	19,573	68.91	1,348,775.43
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	12,718	22.01	279,923.18
COCA-COLA CO	136,668	75.23	10,281,533.64
COCA-COLA ENTERPRISES	21,620	27.57	596,063.40
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,199	60.00	1,211,940.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	32,360	98.80	3,197,168.00
COMCAST CORP-CL A	140,349	28.85	4,049,068.65
COMCAST CORP-SPECIAL A	43,598	28.63	1,248,210.74
COMERICA INC	13,767	30.40	418,516.80
COMPUTER SCIENCES CORP	10,367	26.62	275,969.54
CONAGRA	27,713	25.25	699,753.25
CONCHO RESOURCES INC	6,586	89.67	590,566.62
CONOCOPHILLIPS	84,333	52.11	4,394,592.63
CONSOL ENERGY INC	15,165	29.59	448,732.35
CONSOLIDATED EDISON INC	19,583	59.61	1,167,342.63
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,392	19.34	239,661.28
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,121	75.95	237,039.95
COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	10,571	71.28	753,500.88
CORNING	105,075	12.91	1,356,518.25
COSTCO WHOLESALE CORP	28,975	84.48	2,447,808.00
COVANCE INC	4,199	46.55	195,463.45
COVENTRY HEALTH CARE INCON	9,997	30.63	306,208.11
COVIDIEN PLC	32,255	53.32	1,719,836.60
CREE INC	7,602	26.11	198,488.22
CROWN CASTLE INTL CORP	19,214	54.17	1,040,822.38
CROWN HOLDINGS INC	10,107	34.41	347,781.87
CSX CORP	70,199	21.37	1,500,152.63
CUMMINS INC	12,249	98.95	1,212,038.55
CVS CAREMARK CORPORATION	87,026	44.98	3,914,429.48
DANAHER CORP	39,005	52.76	2,057,903.80
DARDEN RESTAURANTS INC	9,164	53.06	486,241.84
DAVITA INC	6,479	81.76	529,723.04
DEERE&CO	27,675	75.14	2,079,499.50
DELL INC	108,102	12.46	1,346,950.92
DELTA AIR LINES INC	15,452	11.37	175,689.24
DENBURY RESOURCES INC	27,136	15.56	422,236.16
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	9,464	38.55	364,837.20
DEVON ENERGY CORPORATION	25,654	60.02	1,539,753.08
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	4,648	60.56	281,482.88
DIRECTV	47,323	46.40	2,195,787.20
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	36,748	32.73	1,202,762.04
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,466	50.56	478,600.96

DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	8,103	47.03	381,084.09
DISH NETWORK CORPORATION-A	13,929	28.24	393,354.96
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	3,573	43.96	157,069.08
DOLLAR GENERAL CORP	11,736	47.58	558,398.88
DOLLAR TREE INC	7,983	102.20	815,862.60
DOMINION RESOURCES	38,084	52.55	2,001,314.20
DOVER CORP	12,394	57.78	716,125.32
DOW CHEMICAL CO	79,015	31.30	2,473,169.50
DR HORTON INC	19,078	17.01	324,516.78
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	14,855	41.09	610,391.95
DTE ENERGY COMPANY	11,316	56.56	640,032.96
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	61,773	48.40	2,989,813.20
DUKE ENERGY CORP	89,106	21.96	1,956,767.76
DUN & BRADSTREET CORP	3,250	67.14	218,205.00
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	9,533	47.62	453,961.46
EATON CORP	21,227	43.30	919,129.10
EATON VANCE CORP	7,818	24.05	188,022.90
EBAY	77,680	40.35	3,134,388.00
ECOLAB INC	20,069	64.35	1,291,440.15
EDISON INTL	20,694	45.00	931,230.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,627	87.40	666,599.80
EL PASO CORP	51,562	28.75	1,482,407.50
ELECTRONIC ARTS INC	22,159	14.22	315,100.98
EMC CORP	136,391	24.24	3,306,117.84
EMERSON ELECTRIC CO	49,192	47.28	2,325,797.76
ENERGEN CORP	4,820	44.34	213,718.80
ENERGIZER HOLDINGS INC	4,636	72.87	337,825.32
ENTERGY CORP	11,775	64.51	759,605.25
EOG RESOURCES INC	17,975	101.75	1,828,956.25
EQT CORPORATION	9,492	46.90	445,174.80
EQUIFAX INC	8,390	45.65	383,003.50
ESTEE LAUDER CO-CL A	15,591	54.96	856,881.36
EVEREST RE GROUP LTD	3,722	100.83	375,289.26
EXELON CORP	56,924	36.90	2,100,495.60
EXPEDIA INC	6,477	44.89	290,752.53
EXPEDITORS INTL WASH INC	14,176	38.47	545,350.72
EXPRESS SCRIPTS HOLDING	51,803	52.63	2,726,391.89
EXXON MOBIL	320,471	82.08	26,304,259.68
F5 NETWORKS INC	5,314	109.04	579,438.56
FAMILY DOLLAR STORES	6,937	67.60	468,941.20
FASTENAL CO	18,750	44.40	832,500.00
FEDEX CORP	20,149	89.28	1,798,902.72
FIDELITY NATIONAL FINL-A	14,773	18.94	279,800.62
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	16,601	32.82	544,844.82
FIFTH THIRD BANCORP	61,496	13.52	831,425.92

FIRST SOLAR INC	4,092	14.33	58,638.36
FIRSTENERGY CORP	27,962	46.85	1,310,019.70
FISERV INC	9,418	67.17	632,607.06
FLEXTRONICS INTL LTD	49,418	6.42	317,263.56
FLIR SYSTEMS INC	10,809	21.31	230,339.79
FLOWSERVE CORP	3,850	105.93	407,830.50
FLUOR CORP	11,344	49.70	563,796.80
FMC CORP	9,760	51.39	501,566.40
FMC TECHNOLOGIES INC	15,931	41.72	664,641.32
FORD MOTOR COMPANY	237,614	10.60	2,518,708.40
FOREST LABORATORIES INC	17,862	33.38	596,233.56
FOSSIL INC	3,699	71.54	264,626.46
FRANKLIN RESOURCES INC	10,321	106.79	1,102,179.59
FREEPORT-MCMOR-B	63,377	32.41	2,054,048.57
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	67,207	3.50	235,224.50
GAMESTOP CORP-CLASS A	9,282	19.52	181,184.64
GAP	22,065	27.16	599,285.40
GARMIN LTD	7,814	43.19	337,486.66
GENERAL DYNAMICS CORP	20,238	63.58	1,286,732.04
GENERAL ELECTRIC CO	705,859	19.20	13,552,492.80
GENERAL MILLS INC	43,021	39.08	1,681,260.68
GENERAL MOTORS CO	52,468	22.44	1,177,381.92
GENUINE PARTS CO	10,440	61.91	646,340.40
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	32,823	5.19	170,351.37
GILEAD SCIENCES INC	50,221	50.49	2,535,658.29
GOLDMAN SACHS GROUP INC	31,270	96.70	3,023,809.00
GOODRICH CORP	8,372	125.73	1,052,611.56
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	17,889	10.59	189,444.51
GOOGLE INC-CL A	17,116	591.53	10,124,627.48
GRAINGER (WW) INC	3,964	193.90	768,619.60
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	9,107	25.31	230,498.17
HALLIBURTON CO	61,522	31.37	1,929,945.14
HARLEY-DAVIDSON	15,585	47.52	740,599.20
HARRIS CORP	8,024	39.37	315,904.88
HARTFORD FINANCIAL SVCS	28,312	17.33	490,646.96
HASBRO INC	8,070	34.91	281,723.70
HCA HOLDINGS INC	11,675	26.02	303,783.50
HEINZ (H.J) CO	21,411	53.50	1,145,488.50
HELMERICH & PAYNE	7,424	46.25	343,360.00
HENRY SCHEIN INC	6,041	75.53	456,276.73
HERBALIFE LTD	8,060	44.85	361,491.00
HERSHEY FOODS CORPORATION	10,998	67.72	744,784.56
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	18,747	13.57	254,396.79
HESS CORP	20,453	46.69	954,950.57
HEWLETT-PACKARD CO	132,848	22.33	2,966,495.84

HOLLYFRONTIER CORP	13,989	30.34	424,426.26
HOLOGIC INC	17,592	16.92	297,656.64
HOME DEPOT	103,393	49.44	5,111,749.92
HONEYWELL INTL INC	49,130	56.75	2,788,127.50
HORMEL FOODS CORP	9,753	30.15	294,052.95
HOSPIRA INC	11,012	32.38	356,568.56
HUDSON CITY BANCORP INC	32,951	6.33	208,579.83
HUMANA INC	10,932	77.28	844,824.96
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,471	56.69	366,840.99
IHS INC-CLASS A	2,825	102.02	288,206.50
ILLINOIS TOOL WORKS	29,075	56.29	1,636,631.75
ILLUMINA INC	8,415	43.84	368,913.60
INGERSOLL-RAND PLC	20,872	42.16	879,963.52
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	5,234	54.73	286,456.82
INTEL CORP	340,449	25.74	8,763,157.26
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	4,858	125.49	609,630.42
INTERPUBLIC GROUP OF COS	32,060	10.74	344,324.40
INTL BUSINESS MACHINES CORP	78,802	194.30	15,311,228.60
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,409	57.03	308,475.27
INT'L GAME TECHNOLOGY	19,960	14.13	282,034.80
INT'L PAPER CO	27,761	29.31	813,674.91
INTUIT INC	18,901	56.45	1,066,961.45
INTUITIVE SURGICAL INC	2,607	526.55	1,372,715.85
INVESCO LTD	30,153	21.54	649,495.62
IRON MOUNTAIN INC	9,646	29.30	282,627.80
J.C. PENNEY CO INC	11,122	28.08	312,305.76
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8,567	36.96	316,636.32
JM SMUCKER CO	7,611	77.58	590,461.38
JOHNSON & JOHNSON	182,583	62.51	11,413,263.33
JOHNSON CONTROLS INC	45,633	30.54	1,393,631.82
JOY GLOBAL INC	7,282	60.21	438,449.22
JPMORGAN CHASE & CO	254,050	33.50	8,510,675.00
JUNIPER NETWORKS INC	35,169	17.15	603,148.35
KANSAS CITY SOUTHERN	7,611	66.44	505,674.84
KBR INC	10,314	26.16	269,814.24
KELLOGG CO	16,809	50.27	844,988.43
KEY CORP	63,710	7.50	477,825.00
KIMBERLY-CLARK CORP	26,349	79.46	2,093,691.54
KINDER MORGAN INC	7,631	32.42	247,397.02
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	6,227	72.62	452,204.74
KLA-TENCOR CORP	11,143	46.15	514,249.45
KOHL'S CORP	16,148	50.49	815,312.52
KRAFT FOODS INC-A	112,218	38.57	4,328,248.26
KROGER CO	37,929	22.41	849,988.89
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	6,920	67.19	464,954.80

LABORATORY CRP OF AMER	6,626	85.73	568,046.98
LAM RESEARCH CORP	8,284	38.37	317,857.08
LAS VEGAS SANDS CORP	24,572	47.92	1,177,490.24
LEGG MASON INC	9,201	25.52	234,809.52
LEGGETT & PLATT INC	9,883	20.72	204,775.76
LEUCADIA NATIONAL CORP	14,405	21.03	302,937.15
LIBERTY GLOBAL INC-A	9,634	47.31	455,784.54
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	7,661	45.45	348,192.45
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	37,640	17.24	648,913.60
LIBERTY MEDIA CORP - LIBER-A	7,286	84.44	615,229.84
LIFE TECHNOLOGIES CORP	11,915	41.83	498,404.45
LILLY (ELI) & CO	69,667	41.11	2,864,010.37
LIMITED	17,007	46.41	789,294.87
LINCOLN NATIONAL CORP	20,903	21.27	444,606.81
LINEAR TECHNOLOGY CORP	15,228	29.15	443,896.20
LOCKHEED MARTIN CORP	18,389	82.71	1,520,954.19
LOEWS CORP	21,211	39.22	831,895.42
LORILLARD INC	9,027	124.84	1,126,930.68
LOWES COMPANIES	84,543	27.24	2,302,951.32
LSI CORP	39,045	6.90	269,410.50
LULULEMON ATHLETICA INC	6,982	72.06	503,122.92
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,304	39.60	764,438.40
M & T BANK CORP	7,559	81.82	618,477.38
MACY'S INC	28,210	37.76	1,065,209.60
MANPOWER GROUP	5,455	35.98	196,270.90
MARATHON OIL CORP	47,051	25.29	1,189,919.79
MARATHON PETROLEUM CORP	23,837	36.88	879,108.56
MARRIOTT INTL A	17,982	38.64	694,824.48
MARSH & MCLENNAN COS	35,968	32.30	1,161,766.40
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,055	68.44	209,084.20
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	34,422	13.07	449,895.54
MASCO CORP	25,016	12.60	315,201.60
MASTERCARD INC-CLASS A	7,303	413.96	3,023,149.88
MATTEL INC	22,713	31.26	710,008.38
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	19,504	25.52	497,742.08
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,331	56.87	473,783.97
MCDONALD'S CORP	68,627	91.05	6,248,488.35
MCGRAW-HILL COS	19,678	44.54	876,458.12
MCKESSON CORP	16,418	87.69	1,439,694.42
MDU RESOURCES GROUP INC	12,623	22.50	284,017.50
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	13,610	83.02	1,129,902.20
MEADWESTVACO CORP	11,416	27.73	316,565.68
MEDTRONIC	70,602	36.88	2,603,801.76
MERCK & CO	203,783	37.55	7,652,051.65

METLIFE INC	70,713	30.33	2,144,725.29
METROPCS COMMUNICATIONS INC	18,351	6.52	119,648.52
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,779	30.93	395,254.47
MICRON TECHNOLOGY	61,587	5.96	367,058.52
MICROSOFT CORP	506,191	29.06	14,709,910.46
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,920	69.66	273,067.20
MOLSON COORS BREWING CO -B	10,947	39.78	435,471.66
MONSANTO CO	35,797	73.56	2,633,227.32
MONSTER BEVERAGE CORP	9,898	71.58	708,498.84
MOODY'S CORP	13,844	37.36	517,211.84
MORGAN STANLEY	96,649	13.25	1,280,599.25
MOSAIC CO/THE	20,452	48.45	990,899.40
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,500	48.02	888,370.00
MURPHY OIL CORP	12,292	47.67	585,959.64
MYLAN INC	28,516	21.63	616,801.08
NABORS INDUSTRIES LTD	19,925	13.82	275,363.50
NASDAQ OMX GROUP	8,573	22.06	189,120.38
NATIONAL OILWELL VARCO INC	28,338	68.10	1,929,817.80
NETAPP INC	24,632	28.61	704,721.52
NETFLIX INC	3,654	70.22	256,583.88
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	30,308	12.70	384,911.60
NEWELL RUBBERMAID	20,125	18.94	381,167.50
NEWFIELD EXPLORATION CO	8,999	31.06	279,508.94
NEWMONT MINING CORP	33,083	48.82	1,615,112.06
NEWS CORP -CLASS A	115,502	19.43	2,244,203.86
NEWS CORP -CLASS B	29,456	19.63	578,221.28
NEXTERA ENERGY INC	26,838	65.33	1,753,326.54
NIELSEN HOLDINGS NV	6,225	27.74	172,681.50
NII HOLDINGS INC	12,436	11.14	138,537.04
NIKE B	23,811	108.79	2,590,398.69
NISOURCE INC	19,479	25.04	487,754.16
NOBLE CORP	17,467	33.75	589,511.25
NOBLE ENERGY INC	11,810	83.94	991,331.40
NORDSTROM INC	11,273	50.74	571,992.02
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,831	66.43	1,583,093.33
NORTHEAST UTILITIES	21,353	36.36	776,395.08
NORTHERN TRUST CORP	14,502	43.49	630,691.98
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,596	58.50	970,866.00
NRG ENERGY INC	15,935	15.64	249,223.40
NUANCE COMMUNICATIONS INC	16,087	20.71	333,161.77
NUCOR CORP	21,175	36.11	764,629.25
NVIDIA CORP	42,313	12.40	524,681.20
NYSE EURONEXT	17,517	24.47	428,640.99
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	54,276	81.02	4,397,441.52
OMNICARE INC	7,645	32.26	246,627.70

OMNICOM GROUP	18,503	49.78	921,079.34
ONEOK INC	6,779	83.60	566,724.40
ORACLE CORP	269,824	26.14	7,053,199.36
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8,607	96.30	828,854.10
OWENS-ILLINOIS INC	10,981	19.61	215,337.41
PACCAR INC	21,555	38.35	826,634.25
PALL CORP	7,979	56.95	454,404.05
PARKER HANNIFIN CORP	10,101	84.36	852,120.36
PARTNERRE LTD	4,303	72.31	311,149.93
PATTERSON COMPANIES INC	6,826	34.04	232,357.04
PAYCHEX INC	21,806	30.29	660,503.74
PEABODY ENERGY CORP	18,769	23.88	448,203.72
PENTAIR INC	6,840	41.60	284,544.00
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	24,989	11.93	298,118.77
PEPCO HOLDINGS INC	15,174	18.90	286,788.60
PEPSICO INC	104,529	68.64	7,174,870.56
PERRIGO CO	5,608	103.00	577,624.00
PETSMART INC	7,760	63.75	494,700.00
PFIZER	513,947	22.13	11,373,647.11
PG&E CORP	27,137	43.74	1,186,972.38
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	116,134	85.38	9,915,520.92
PHILLIPS 66	42,166	31.30	1,319,795.80
PINNACLE WEST CAPITAL	7,300	49.11	358,503.00
PIONEER NATURAL RESOURCES	7,332	99.21	727,407.72
PITNEY BOWES INC	13,348	13.93	185,937.64
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	9,770	36.46	356,214.20
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,176	62.09	2,184,077.84
PPG INDUSTRIES INC	10,325	103.18	1,065,333.50
PPL CORPORATION	38,665	27.52	1,064,060.80
PRAXAIR INC	20,042	107.87	2,161,930.54
PRECISION CASTPARTS CORP	9,640	165.70	1,597,348.00
PRICE T ROWE GROUP INC	16,891	57.20	966,165.20
PRICELINE.COM INC	3,339	652.88	2,179,966.32
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,145	24.44	516,783.80
PROCTER & GAMBLE CO	183,952	62.49	11,495,160.48
PROGRESS ENERGY INC	19,724	54.60	1,076,930.40
PROGRESSIVE CORP	39,171	21.61	846,485.31
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,424	47.20	1,483,212.80
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	33,825	30.47	1,030,647.75
QEP RESOURCES INC	12,261	26.64	326,633.04
QUALCOMM	112,390	57.32	6,442,194.80
QUANTA SERVICES INC	13,788	22.70	312,987.60
QUEST DIAGNOSTICS	10,548	58.00	611,784.00
RALCORP HOLDINGS INC	3,686	65.59	241,764.74
RALPH LAUREN CORPORATION	4,111	149.84	615,992.24

RANGE RESOURCES CORP	10,781	61.01	657,748.81
RAYTHEON COMPANY	23,140	49.67	1,149,363.80
RED HAT INC	12,893	52.09	671,596.37
REGIONS FINL CORP	87,230	6.32	551,293.60
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,672	77.80	285,681.60
REPUBLIC SERVICES INC	19,810	26.81	531,106.10
REYNOLDS AMERICAN INC	23,384	41.97	981,426.48
ROBERT HALF INTL INC	9,411	28.55	268,684.05
ROCK-TENN COMPANY -CL A	4,715	52.27	246,453.05
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,489	75.33	714,806.37
ROCKWELL COLLIN	10,486	50.15	525,872.90
ROPER INDUSTRIES INC	6,450	100.34	647,193.00
ROSS STORES INC	15,506	62.47	968,659.82
ROWAN COMPANIES PLC	8,660	31.79	275,301.40
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,472	24.42	231,306.24
SAFEWAY INC	23,552	19.22	452,669.44
SAIC INC	19,851	10.62	210,817.62
SALESFORCE.COM INC	8,638	147.00	1,269,786.00
SANDISK CORP	16,066	33.73	541,906.18
SARA LEE CORP	37,522	21.19	795,091.18
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	7,648	52.27	399,760.96
SCANA CORP	8,235	46.65	384,162.75
SCHLUMBERGER	89,734	65.41	5,869,500.94
SCHWAB (CHARLES) CORP	72,174	12.80	923,827.20
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	5,875	54.42	319,717.50
SEAGATE TECHNOLOGY	28,072	26.18	734,924.96
SEALED AIR CORP	11,974	16.00	191,584.00
SEARS HOLDINGS CORPORATION	3,037	56.84	172,623.08
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,349	18.13	187,627.37
SEMPRA ENERGY	15,232	64.35	980,179.20
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,897	126.31	744,850.07
SIGMA-ALDRICH	8,052	71.10	572,497.20
SIRIUS XM RADIO INC	250,755	1.93	483,957.15
SLM CORP	35,251	13.57	478,356.07
SOUTHERN CO	57,628	45.69	2,633,023.32
SOUTHWEST AIRLINES CO	12,987	8.76	113,766.12
SOUTHWESTERN ENERGY CO	23,290	28.77	670,053.30
SPECTRA ENERGY CORP	43,482	28.89	1,256,194.98
SPRINT NEXTEL CORPORATION	209,502	2.62	548,895.24
SPX CORP	3,411	74.60	254,460.60
ST JUDE MEDICAL INC	21,327	39.43	840,923.61
STANLEY BLACK&DECKER	10,728	68.53	735,189.84
STAPLES INC	46,910	13.41	629,063.10
STARBUCKS CORP	49,994	54.56	2,727,672.64
STARWOOD HOTELS & RESORTS	13,101	53.38	699,331.38

STATE STREET CORP	32,892	41.78	1,374,227.76
STERICYCLE INC	5,406	86.31	466,591.86
STRYKER CORP	19,189	51.85	994,949.65
SUNOCO INC	7,397	47.29	349,804.13
SUNTRUST BANKS	35,903	22.49	807,458.47
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	11,100	21.48	238,428.00
SYMANTEC CORP	49,286	15.08	743,232.88
SYNOPSIS INC	9,582	29.89	286,405.98
SYSCO CORP	39,441	27.94	1,101,981.54
TARGET (DAYTON HUDSON)	42,792	57.62	2,465,675.04
TD AMERITRADE HOLDING CORP	15,221	17.24	262,410.04
TE CONNECTIVITY LTD	28,379	31.61	897,060.19
TERADATA CORP	11,192	70.54	789,483.68
TEXAS INSTRUMENTS	76,397	28.94	2,210,929.18
TEXTRON	19,275	23.52	453,348.00
THE WALT DISNEY CO	114,467	44.50	5,093,781.50
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	25,292	51.68	1,307,090.56
TIFFANY & CO	8,110	56.32	456,755.20
TIME WARNER CABLE-A	21,403	76.42	1,635,617.26
TIME WARNER INC	67,129	34.70	2,329,376.30
TJX COMPANIES INC	50,590	40.87	2,067,613.30
TOLL BROTHERS INC	10,462	28.20	295,028.40
TORCHMARK CORP	7,064	46.47	328,264.08
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,427	23.56	269,220.12
TRAVELERS COS INC/THE	27,598	62.60	1,727,634.80
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,054	39.01	275,176.54
TYCO INTERNATIONAL LTD	30,888	54.60	1,686,484.80
TYSON FOODS INC	20,771	19.32	401,295.72
ULTRA PETROLEUM CORP	10,211	18.92	193,192.12
UNION PACIFIC CORP	32,298	111.88	3,613,500.24
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,391	23.57	127,065.87
UNITED HEALTHCARE CORP	71,274	56.12	3,999,896.88
UNITED PARCEL SERVICE B	48,381	74.94	3,625,672.14
UNITED STATES STEEL CORP	9,628	21.80	209,890.40
UNITED TECHNOLOGIES CORP	57,552	73.02	4,202,447.04
UNUM GROUP	20,259	20.13	407,813.67
URBAN OUTFITTERS INC	8,259	28.42	234,720.78
URS CORP	5,746	36.76	211,222.96
US BANCORP	127,595	30.93	3,946,513.35
VALERO ENERGY CORP	37,423	22.34	836,029.82
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,799	61.36	478,546.64
VERISIGN INC	10,471	39.80	416,745.80
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	9,632	47.96	461,950.72
VERIZON COMMUNICATIONS	191,201	41.45	7,925,281.45
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,945	64.85	904,333.25

VF CORP	5,922	141.20	836,186.40	
VIACOM INC-CLASS B	33,589	48.00	1,612,272.00	
VIRGIN MEDIA INC	19,809	22.26	440,948.34	
VISA INC-CLASS A SHARES	34,869	119.37	4,162,312.53	
VMWARE INC-CLASS A	5,718	94.02	537,606.36	
VULCAN MATERIALS CO	8,955	35.76	320,230.80	
WALGREEN CO	58,693	31.36	1,840,612.48	
WAL-MART STORES	126,742	65.31	8,277,520.02	
WALTER ENERGY INC	4,175	49.98	208,666.50	
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	10,203	20.20	206,100.60	
WASHINGTON POST -CL B	351	344.56	120,940.56	
WASTE MANAGEMENT INC	29,239	32.96	963,717.44	
WATERS CORP	6,209	82.10	509,758.90	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	8,811	72.67	640,295.37	
WEATHERFORD INTL LTD	50,709	12.99	658,709.91	
WELLPOINT INC	23,258	67.90	1,579,218.20	
WELLS FARGO & CO	334,956	31.86	10,671,698.16	
WESTERN DIGITAL CORP	15,631	34.21	534,736.51	
WESTERN UNION CO	41,395	16.90	699,575.50	
WEYERHAEUSER CO	35,864	19.77	709,031.28	
WHIRLPOOL CORP	5,127	60.56	310,491.12	
WHITING PETROLEUM CORP	8,134	44.68	363,427.12	
WHOLE FOODS MKT INC	10,201	87.27	890,241.27	
WILLIAMS COS	39,408	30.77	1,212,584.16	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	11,023	35.39	390,103.97	
WINDSTREAM CORP	40,803	9.49	387,220.47	
WISCONSIN ENERGY CORP	15,462	37.50	579,825.00	
WR BERKLEY CORP	8,075	38.70	312,502.50	
WYNN RESORTS LTD	5,448	102.04	555,913.92	
XCEL ENERGY INC	32,424	27.80	901,387.20	
XEROX CORP	92,738	7.07	655,657.66	
XILINX INC	17,548	31.98	561,185.04	
XL GROUP PLC	21,876	20.25	442,989.00	
XYLEM INC	11,723	25.65	300,694.95	
YAHOO	78,779	15.36	1,210,045.44	
YUM BRANDS INC	30,885	70.40	2,174,304.00	
ZIMMER HOLDINGS INC	11,980	62.04	743,239.20	
小計	20,143,491		805,945,581.37 (64,129,089,909)	
カナダドル				
AGNICO-EAGLE MINES	11,412	41.31	471,429.72	
AGRIUM INC	10,552	79.80	842,049.60	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	8,261	40.61	335,479.21	
ARC RESOURCES LTD	19,264	21.68	417,643.52	
ATHABASCA OIL CORPORATION	20,754	11.09	230,161.86	
BANK MONTREAL	42,723	54.57	2,331,394.11	
BANK NOVA SCOTIA	72,842	50.79	3,699,645.18	

BARRICK GOLD CORP	66,866	41.24	2,757,553.84
BAYTEX ENERGY CORP	7,844	47.87	375,492.28
BCE INC	17,338	40.50	702,189.00
BELL ALIANT INC	5,225	26.31	137,469.75
BOMBARDIER B	96,178	3.85	370,285.30
BONAVISTA ENERGY CORP	9,561	19.00	181,659.00
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	37,421	32.49	1,215,808.29
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	17,431	17.38	302,950.78
CAE INC	17,221	10.10	173,932.10
CAMECO CORP	26,391	19.76	521,486.16
CANADIAN IMPERIAL BANK	26,782	70.39	1,885,184.98
CANADIAN NATL RAILWAY CO	29,742	81.95	2,437,356.90
CANADIAN NATURAL RESOURCES	73,200	31.77	2,325,564.00
CANADIAN OIL SANDS LTD	32,393	20.97	679,281.21
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,233	67.67	354,117.11
CANADIAN UTILITIES LTD A	5,832	67.24	392,143.68
CENOVUS ENERGY INC	50,378	32.40	1,632,247.20
CENTERRA GOLD INC	11,462	10.90	124,935.80
CGI GROUP INC - CL A	15,749	20.65	325,216.85
CI FINANCIAL CORP	10,864	21.82	237,052.48
CP RAILWAY LIMITED	11,345	75.52	856,774.40
CRESCENT POINT ENERGY CORP	19,115	40.73	778,553.95
ELDORADO GOLD CORP	45,074	11.96	539,085.04
EMPIRE CO LTD 'A'	2,092	55.50	116,106.00
ENBRIDGE	49,492	40.70	2,014,324.40
ENCANA CORP	49,167	21.18	1,041,357.06
ENERPLUS CORP	13,454	14.22	191,315.88
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,328	404.33	536,950.24
FINNING INTERNATIONAL INC	11,888	24.85	295,416.80
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,845	18.47	588,177.15
FORTIS INC	12,503	32.66	408,347.98
FRANCO-NEVADA CORP	8,927	42.75	381,629.25
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,736	25.46	196,958.56
GOLDCORP INC	54,138	38.33	2,075,109.54
GREAT-WEST LIFECO INC	19,047	21.31	405,891.57
HUSKY ENERGY INC	22,407	23.65	529,925.55
IAMGOLD CORP	26,043	11.11	289,337.73
IGM FINANCIAL INC	7,746	40.17	311,156.82
IMPERIAL OIL	19,836	41.78	828,748.08
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,147	25.65	157,670.55
INMET MINING CORPORATION	3,603	43.64	157,234.92
INTACT FINANCIAL CORP	8,662	64.61	559,651.82
IVANHOE MINES LTD	19,754	9.57	189,045.78
KINROSS GOLD CORP	76,048	8.42	640,324.16

LOBLAW COMPANIES LTD	7,809	31.72	247,701.48
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,295	42.55	608,252.25
MANULIFE FINANCIAL CORP	119,918	11.49	1,377,857.82
MEG ENERGY CORP	8,388	38.56	323,441.28
METRO INC	6,726	50.62	340,470.12
NATIONAL BANK OF CANADA	10,725	72.39	776,382.75
NEW GOLD INC	28,614	9.33	266,968.62
NEXEN INC	35,295	16.76	591,544.20
NIKO RESOURCES LTD	3,389	32.76	111,023.64
ONEX CORP	6,404	38.91	249,179.64
OPEN TEXT CORP	3,975	50.20	199,545.00
OSISKO MINING CORP	24,037	7.18	172,585.66
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	17,259	27.28	470,825.52
PAN AMERICAN SILVER CORP	6,964	17.42	121,312.88
PEMBINA PIPELINE CORP	19,122	29.00	554,538.00
PENGROWTH ENERGY CORP	24,875	7.54	187,557.50
PENN WEST PETROLEUM LTD	31,512	14.10	444,319.20
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	57,264	40.93	2,343,815.52
POWER CORP OF CANADA	23,360	23.40	546,624.00
POWER FINANCIAL CORP	16,570	25.75	426,677.50
PRECISION DRILLING CORP	15,689	8.27	129,748.03
PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	13,474	11.56	155,759.44
RESEARCH IN MOTION	31,541	11.39	359,251.99
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	6,399	20.46	130,923.54
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,090	36.60	991,494.00
ROYAL BANK OF CANADA	96,167	50.43	4,849,701.81
SAPUTO INC	9,389	42.53	399,314.17
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	25,132	19.50	490,074.00
SHOPPERS DRUG MART CORP	14,365	41.13	590,832.45
SILVER WHEATON CORP	23,635	27.63	653,035.05
SNC-LAVALIN GROUP INC	10,086	39.75	400,918.50
SUN LIFE FINANCIAL INC	39,074	21.15	826,415.10
SUNCOR ENERGY	105,257	28.90	3,041,927.30
TALTSMAN ENERGY INC	68,947	10.75	741,180.25
TECK RESOURCES LTD-CL B	38,878	31.33	1,218,047.74
TELUS CORPORATION -NON VOTE	14,627	56.96	833,153.92
THOMSON REUTERS CORP	24,976	29.02	724,803.52
TIM HORTONS INC	10,622	54.92	583,360.24
TMX GROUP INC	4,989	45.99	229,444.11
TORONTO-DOMINION BANK	60,337	78.12	4,713,526.44
TOURMALINE OIL CORP	8,840	25.29	223,563.60
TRANSALTA CORP	14,721	17.53	258,059.13
TRANSCANADA CORP	47,016	42.01	1,975,142.16
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	18,932	49.17	930,886.44
VERMILION ENERGY INC	6,314	43.65	275,606.10

	VITERRA INC	24,851	16.03	398,361.53
	WESTON (GEORGE) LTD	3,577	58.03	207,573.31
	YAMANA GOLD INC	49,854	15.35	765,258.90
小計		2,557,596		77,006,808.49 (5,972,648,066)
オーストラリアドル	AGL ENERGY LTD	31,063	14.93	463,770.59
	ALUMINA LIMITED	163,150	0.97	159,071.25
	AMCOR	81,725	7.48	611,303.00
	AMP LTD	190,862	3.86	736,727.32
	ASCIANO GROUP	67,585	4.47	302,104.95
	ASX LTD	11,710	29.63	346,967.30
	AUST AND NZ BANKING GROUP	176,160	20.58	3,625,372.80
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	24,923	7.02	174,959.46
	BHP BILLITON LTD	214,719	32.05	6,881,743.95
	BORAL LIMITED	49,792	3.45	171,782.40
	BRAMBLES LTD	98,973	6.77	670,047.21
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	9,865	13.31	131,303.15
	CAMPBELL BROTHERS LTD	4,677	55.87	261,303.99
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	38,088	12.71	484,098.48
	COCHLEAR LIMITED	3,943	61.30	241,705.90
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	105,386	49.28	5,193,422.08
	COMPUTERSHARE LIMITED	30,802	7.74	238,407.48
	CROWN LTD	27,759	8.45	234,563.55
	CSL LIMITED	34,994	37.23	1,302,826.62
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	46,001	4.34	199,644.34
	FAIRFAX MEDIA LTD	155,308	0.64	100,173.66
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	83,275	4.55	378,901.25
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	38,812	1.97	76,459.64
	ILUKA RESOURCES LTD	27,994	12.99	363,642.06
	INCITEC PIVOT LTD	108,896	2.80	304,908.80
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	139,003	3.28	455,929.84
	JAMES HARDIE INDUSTRIES NV	30,195	7.54	227,670.30
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	10,493	17.57	184,362.01
	LYNAS CORP LTD	124,409	1.05	131,251.49
	MACQUARIE GROUP LIMITED	23,304	26.52	618,022.08
	METCASH LTD	51,572	3.93	202,677.96
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	147,373	23.65	3,485,371.45
	NEWCREST MINING LIMITED	51,181	25.35	1,297,438.35
	ORICA LTD	24,335	24.63	599,371.05
	ORIGIN ENERGY LIMITED	72,618	12.92	938,224.56
	OZ MINERALS LTD	21,913	8.31	182,097.03
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	77,149	1.50	115,723.50
	QBE INSURANCE GROUP	74,585	12.55	936,041.75
	QR NATIONAL LTD	114,196	3.29	375,704.84
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,782	21.36	187,583.52

	RIO TINTO LTD	29,135	56.90	1,657,781.50	
	SANTOS	63,146	12.02	759,014.92	
	SIMS METAL MANAGEMENT LIMITED	11,082	11.27	124,894.14	
	SONIC HEALTHCARE LTD	25,671	12.50	320,887.50	
	SP AUSNET	102,121	1.00	102,631.60	
	SUNCORP GROUP LIMITED	86,022	7.68	660,648.96	
	TABCORP HOLDINGS	47,608	2.95	140,443.60	
	TATTS GROUP LTD	89,642	2.58	231,276.36	
	TELSTRA CORP	291,178	3.52	1,024,946.56	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	47,207	4.58	216,208.06	
	TRANSURBAN GROUP	87,339	5.67	495,212.13	
	WESFARMERS LIMITED	67,254	28.66	1,927,499.64	
	WESTPAC BANKING	202,634	20.40	4,133,733.60	
	WHITEHAVEN COAL LTD	29,845	4.00	119,380.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	43,093	31.64	1,363,462.52	
	WOOLWORTHS LTD	81,919	26.26	2,151,192.94	
	WORLEYPARSONS LTD	12,928	25.28	326,819.84	
小計		4,115,394		49,348,714.83 (3,855,121,602)	
イギリスポンド	3I GROUP PLC	65,142	1.72	112,304.80	
	ADMIRAL GROUP PLC	13,626	11.28	153,701.28	
	AGGREKO PLC	17,829	21.75	387,780.75	
	AMEC PLC	22,211	9.94	220,888.39	
	ANGLO AMERICAN PLC	88,482	20.17	1,784,681.94	
	ANTOFAGASTA PLC	26,366	10.38	273,679.08	
	ARM HOLDINGS PLC	90,340	5.01	453,055.10	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	23,819	11.76	280,111.44	
	ASTRAZENECA	87,114	26.17	2,280,208.95	
	AVIVA PIC	194,910	2.69	526,062.09	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	24,884	8.46	210,518.64	
	BAE SYSTEMS PLC	216,753	2.75	596,070.75	
	BALFOUR BEATTY PLC	45,954	2.75	126,557.31	
	BARCLAYS	777,383	1.81	1,407,063.23	
	BG GROUP	226,907	12.63	2,865,835.41	
	BHP BILLITON PLC	141,212	17.16	2,423,903.98	
	BP PLC	1,267,878	3.99	5,067,708.36	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	131,682	30.50	4,016,301.00	
	BRITISH SKY BROADCASTING	76,121	6.91	526,376.71	
	BT GROUP PLC	519,789	2.05	1,067,126.81	
	BUNZL PLC	22,106	10.17	224,818.02	
	BURBERRY GROUP PLC	29,325	14.01	410,843.25	
	CAPITA GROUP PLC	41,016	6.29	257,990.64	
	CARNIVAL PLC	12,085	20.90	252,576.50	
	CENTRICA PLC	345,859	3.11	1,076,659.06	
	COBHAM PLC	74,736	2.25	168,679.15	
	COMPASS GROUP PLC	127,016	6.37	809,727.00	

DIAGEO	167,042	15.13	2,528,180.67
ESSAR ENERGY PLC	22,650	1.09	24,688.50
EURASIAN NATURAL RESOURCES	17,220	4.56	78,523.20
EXPERIAN PLC	67,185	9.07	609,367.95
FRESNILLO PLC	12,424	13.22	164,245.28
G4S PLC	94,317	2.80	264,842.13
GLAXOSMITHKLINE	337,508	14.31	4,831,427.02
GLENCORE INTERNATIONAL PLC	92,570	3.45	320,245.91
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,198,810	5.10	6,118,726.24
ICAP PLC	38,331	3.43	131,743.64
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	67,391	23.92	1,611,992.72
INMARSAT PLC	31,044	4.09	127,094.13
INTERCONTINENTAL HOTELS	19,418	14.32	278,065.76
INTERNATIONAL POWER PLC	102,174	4.13	422,693.83
INTERTEK GROUP PLC	10,708	26.09	279,371.72
INVENSYS PLC	54,300	2.16	117,722.40
INVESTEC PLC	37,356	3.29	123,162.73
ITV PLC	247,024	0.78	195,025.44
JOHNSON MATTHEY PLC	14,353	21.69	311,316.57
KAZAKHMYS PLC	14,727	6.90	101,689.93
KINGFISHER PLC	158,071	2.74	434,537.17
LEGAL & GENERAL GROUP	393,970	1.10	436,518.76
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,766,655	0.26	720,436.96
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	10,373	9.70	100,618.10
LONMIN PLC	10,840	7.46	80,866.40
MAN GROUP PLC	128,501	0.73	93,869.98
MARKS & SPENCER GROUP PLC	105,997	3.45	365,901.64
MEGGITT PLC	53,925	3.83	206,586.67
MORRISON SUPERMARKETS	145,034	2.73	396,232.88
NATIONAL GRID PLC	238,001	6.78	1,614,836.78
NEW GKN	103,842	1.85	192,107.70
NEXT PLC	11,521	29.87	344,132.27
OLD MUTUAL PLC	326,459	1.43	468,142.20
PEARSON	54,531	11.54	629,287.74
PETROFAC LTD	17,341	15.62	270,866.42
PRUDENTIAL	170,944	6.84	1,169,256.96
RANDGOLD RESOURCES LTD	6,128	51.05	312,834.40
RECKITT BENCKISER PLC	41,405	34.18	1,415,222.90
REED ELSEVIER PLC	81,344	4.92	400,212.48
RESOLUTION LTD	92,333	1.99	184,204.33
REXAM	58,634	4.00	234,946.43
RIO TINTO PLC REG	91,714	28.57	2,620,727.55
ROLLS-ROYCE GROUP PLC-C ENT S	13,268,762	0.001	13,268.76
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	125,177	8.15	1,020,818.43
ROYAL BANK OF SCOTLAND	1,187,993	0.20	249,003.33

ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	243,454	20.10	4,894,642.67
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	177,997	20.83	3,708,567.49
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	236,861	1.00	238,282.16
SABMILLER PLC	63,777	23.86	1,521,719.22
SAGE GROUP PLC	87,992	2.55	224,995.54
SAINSBURY (J) PLC	81,590	2.93	239,548.24
SCHRODERS PLC	7,582	11.98	90,832.36
SERCO GROUP PLC	34,428	5.33	183,673.38
SEVERN TRENT PLC	15,885	16.80	266,868.00
SHIRE PLC	37,606	18.96	713,009.76
SMITH & NEPHEW PLC	59,732	6.10	364,663.86
SMITHS GROUP PLC	26,245	10.27	269,536.15
SSE PLC	62,739	13.48	845,721.72
STANDARD CHARTERED PLC	159,773	13.29	2,123,383.17
STANDARD LIFE PLC	157,914	2.05	324,829.09
TATE & LYLE	31,264	6.73	210,563.04
TESCO	536,055	3.04	1,632,287.47
TUI TRAVEL PLC	34,970	1.67	58,644.69
TULLOW OIL PLC	60,482	14.32	866,102.24
UNILEVER PLC	85,811	20.20	1,733,382.20
UNITED UTILITIES GROUP PLC	45,585	6.47	294,934.95
VEDANTA RESOURCES PLC	7,996	9.72	77,761.10
VODAFONE GROUP PLC	3,361,387	1.72	5,801,753.96
WEIR GROUP PLC/THE	14,130	16.14	228,058.20
WHITBREAD PLC	12,283	18.60	228,463.80
WOLSELEY LTD	19,051	23.00	438,173.00
WPP PLC	84,356	7.95	670,630.20
XSTRATA PLC	138,752	9.39	1,303,991.29
小計	32,892,289		90,151,811.60 (11,232,014,207)
スイスフラン			
ABB LTD	146,564	15.61	2,287,864.04
ACTELION LTD-REG	7,679	38.69	297,100.51
ADECCO	8,858	37.79	334,743.82
ARYZTA AG	5,831	44.05	256,855.55
BALOISE HOLDING AG	3,304	62.60	206,830.40
BARRY CALLEBAUT AG-REG	132	863.50	113,982.00
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	34,901	55.45	1,935,260.45
CREDIT SUISSE GROUP AG	76,552	19.09	1,461,377.68
GAM HOLDING LTD	13,170	10.05	132,358.50
GEBERIT AG-REG	2,618	188.40	493,231.20
GIVAUDAN-REG	556	896.50	498,454.00
HOLCIM LTD	16,402	53.45	876,686.90
JULIUS BAER GROUP LTD	13,864	31.29	433,804.56
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,610	106.50	384,465.00
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	60	2,798.00	167,880.00
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	7	33,800.00	236,600.00

	LONZA GROUP AG-REG	3,361	35.13	118,071.93
	NESTLE SA - REGISTERED	220,636	54.80	12,090,852.80
	NOVARTIS	156,035	49.92	7,789,267.20
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,880	53.25	100,110.00
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	896	159.00	142,464.00
	ROCHE HOLDING GENUSS	46,973	152.40	7,158,685.20
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,440	108.00	155,520.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,250	108.00	351,000.00
	SGS SA	366	1,761.00	644,526.00
	SIKA AG-BR	142	1,800.00	255,600.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,285	89.35	293,514.75
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	545	158.30	86,273.50
	SULZER AG-REG	1,662	116.90	194,287.80
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,062	366.20	755,104.40
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,008	63.35	190,556.80
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,112	81.05	171,177.60
	SWISS RE LTD	23,165	54.95	1,272,916.75
	SWISSCOM	1,559	352.00	548,768.00
	SYNGENTA AG	6,325	304.30	1,924,697.50
	SYNTHES INC	4,366	158.00	689,828.00
	TRANSOCEAN LTD	23,126	41.53	960,422.78
	UBS AG-REG	244,178	11.15	2,722,584.70
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,887	201.60	1,993,219.20
小計		1,094,367		50,726,943.52 (4,204,756,348)
香港ドル	AIA GROUP LTD	563,600	24.65	13,892,740.00
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	94.55	1,304,790.00
	BANK EAST ASIA	104,160	26.05	2,713,368.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	247,500	22.10	5,469,750.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	82,000	12.02	985,640.00
	CHEUNG KONG HOLDINGS	93,000	92.50	8,602,500.00
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	33,000	43.65	1,440,450.00
	CLP HOLDINGS	128,500	63.80	8,198,300.00
	FIRST PACIFIC CO	142,000	7.83	1,111,860.00
	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	141,000	3.27	461,070.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	84,000	19.06	1,601,040.00
	HANG LUNG GROUP LTD	59,000	45.60	2,690,400.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	24.90	4,083,600.00
	HANG SENG BANK	51,100	101.20	5,171,320.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	63,000	39.20	2,469,600.00
	HONG KONG & CHINA GAS	316,601	18.32	5,800,130.32
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	68,600	109.50	7,511,700.00
	HOPEWELL HOLDINGS	41,500	20.55	852,825.00
	HUTCHISON WHAMPOA	143,000	66.95	9,573,850.00
	HYSAN DEVELOPMENT CO	43,000	31.00	1,333,000.00
	KERRY PROPERTIES LTD	48,000	31.00	1,488,000.00

	LI & FUNG	378,800	14.96	5,666,848.00	
	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	43,000	15.98	687,140.00	
	MTR CORP	96,500	25.20	2,431,800.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	248,500	8.24	2,047,640.00	
	NWS HOLDINGS LTD	91,000	11.52	1,048,320.00	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	14,500	40.90	593,050.00	
	PCCW LTD	292,000	2.93	855,560.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	93,000	54.60	5,077,800.00	
	SANDS CHINA LTD	161,600	26.20	4,233,920.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	94,000	15.50	1,457,000.00	
	SINO LAND CO	203,400	10.88	2,212,992.00	
	SJM HOLDINGS LTD	111,000	13.82	1,534,020.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	95,000	88.20	8,379,000.00	
	SWIRE PACIFIC A	48,500	84.90	4,117,650.00	
	WHARF HOLDINGS	101,000	41.25	4,166,250.00	
	WHEELOCK & CO LTD	63,000	23.60	1,486,800.00	
	WING HANG BANK LIMITED	12,500	73.80	922,500.00	
	WYNN MACAU LTD	108,000	18.40	1,987,200.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	51,500	25.85	1,331,275.00	
小計		4,937,161		136,992,698.32 (1,404,175,157)	
シンガポールドル	CAPITALAND LTD	171,500	2.44	418,460.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	99,000	1.44	142,560.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	33,000	10.11	333,630.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	131,000	1.47	192,570.00	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	68,000	0.92	62,900.00	
	DBS GROUP	118,000	13.29	1,568,220.00	
	FRASER AND NEAVE LTD	61,000	6.57	400,770.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	408,000	1.52	620,160.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	123,000	2.06	253,380.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	463,000	0.64	298,635.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	7,000	42.86	300,020.00	
	KEPPEL CORP LTD	95,300	10.17	969,201.00	
	KEPPEL LAND LTD	50,000	2.91	145,500.00	
	NEPTUNE ORIENT LINES LTD	61,000	1.04	63,440.00	
	NOBLE GROUP LTD	267,363	1.07	287,415.22	
	OCBC BANK	173,000	8.49	1,468,770.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	98,000	1.66	163,170.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	68,000	4.92	334,560.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	58,000	4.45	258,100.00	
	SINGAPORE AIRLINES	37,533	10.50	394,096.50	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	59,000	6.25	368,750.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	102,000	3.81	388,620.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	106,000	2.98	315,880.00	

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	533,243	3.08	1,642,388.44	
	STARHUB LTD	44,000	3.24	142,560.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	84,000	17.36	1,458,240.00	
	UOL GROUP LIMITED	31,300	4.23	132,399.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	128,000	3.76	481,280.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	133,000	1.03	136,990.00	
小計		3,811,239		13,742,665.16 (855,755,759)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	67,649	2.53	171,151.97	
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	4.80	122,414.40	
	FLETCHER BUILDING LTD	47,170	6.14	289,623.80	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	42,159	3.50	147,556.50	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	133,366	2.54	338,749.64	
小計		315,847		1,069,496.31 (64,597,577)	
スウェーデンクローナ	ALFA LAVAL AB	22,436	121.40	2,723,730.40	
	ASSA ABLOY B	21,005	190.20	3,995,151.00	
	ATLAS COPCO A	44,897	151.50	6,801,895.50	
	ATLAS COPCO B	26,090	134.80	3,516,932.00	
	BOLIDEN AB	18,952	95.10	1,802,335.20	
	ELECTROLUX AB-SER B	16,084	139.00	2,235,676.00	
	ERICSSON (LM) B	201,354	62.05	12,494,015.70	
	GETINGE AB-B SHS	13,382	182.20	2,438,200.40	
	HENNES & MAURITZ B	68,362	217.30	14,855,062.60	
	HEXAGON AB-B SHS	17,560	132.80	2,331,968.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,671	183.10	672,160.10	
	HUSQVARNA AB-B SHS	30,739	34.04	1,046,355.56	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,608	88.70	763,529.60	
	INVESTOR AB-B SHS	30,560	127.50	3,896,400.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	14,302	126.90	1,814,923.80	
	LUNDIN PETROLEUM AB	15,420	132.20	2,038,524.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	5,105	619.00	3,159,995.00	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	3,258	306.50	998,577.00	
	NORDEA BANK AB	176,504	54.00	9,531,216.00	
	RATOS AB-B SHS	12,855	66.30	852,286.50	
	SANDVIK AB	67,153	94.85	6,369,462.05	
	SCA SV CELLULOSA B	38,651	103.20	3,988,783.20	
	SCANIA AB-B SHS	21,395	115.50	2,471,122.50	
	SECURITAS B	20,935	53.45	1,118,975.75	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	94,636	40.55	3,837,489.80	
	SKANSKA B	26,739	96.05	2,568,280.95	
	SKF AB-B	26,194	144.20	3,777,174.80	
	SSAB AB-A SHS	10,878	58.00	630,924.00	
	SVENSKA HANDELSBK A	32,866	203.40	6,684,944.40	
	SWEDBANK AB-A	55,044	103.00	5,669,532.00	

	SWEDISH MATCH AB	14,241	272.10	3,874,976.10	
	TELE2 AB-B SHS	21,223	109.40	2,321,796.20	
	TELIASONERA AB	144,754	43.97	6,364,833.38	
	VOLVO B	93,046	80.90	7,527,421.40	
小計		1,418,899		135,174,650.89 (1,500,438,624)	
ノルウェークローネ	ACERGY S.A.	18,817	127.20	2,393,522.40	
	AKER SOLUTIONS ASA	10,992	81.45	895,298.40	
	DNB ASA	65,569	56.35	3,694,813.15	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	13,419	66.30	889,679.70	
	NORSK HYDRO	62,249	25.80	1,606,024.20	
	ORKLA	51,595	41.25	2,128,293.75	
	SEADRILL LTD	21,962	210.80	4,629,589.60	
	STATOIL ASA	74,617	140.70	10,498,611.90	
	TELENOR ASA	48,385	92.55	4,478,031.75	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,501	233.90	2,923,983.90	
小計		380,106		34,137,848.75 (451,302,360)	
デンマーククローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	38	34,980.00	1,329,240.00	
	A P MOLLER-MAERSK AIS	88	36,780.00	3,236,640.00	
	CARLSBERG AS-B	7,152	451.20	3,226,982.40	
	COLOPLAST-B	1,578	1,023.00	1,614,294.00	
	DANSKE BANK A/S	43,759	82.15	3,594,801.85	
	DSV A/S	13,165	123.00	1,619,295.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	28,433	839.00	23,855,287.00	
	NOVOZYMES A/S	15,416	163.10	2,514,349.60	
	TDC A/S	34,299	38.87	1,333,202.13	
	TRYG A/S	1,646	320.20	527,049.20	
	VESTAS WIND SYSEMS	13,620	37.45	510,069.00	
WILLIAM DEMANT HOLDING	1,560	530.00	826,800.00		
小計		160,754		44,188,010.18 (592,561,216)	
イスラエルシェケル	BANK HAPOLIM BM	73,582	12.76	938,906.32	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	81,988	10.07	825,619.16	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	117,901	4.50	530,554.50	
	CELLCOM ISRAEL LTD	3,998	29.30	117,141.40	
	DELEK GROUP LTD	299	656.80	196,383.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,551	134.60	208,764.60	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	29,730	40.70	1,210,011.00	
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	2,190.00	352,590.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,988	4.21	231,499.48	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	31.41	257,562.00	
	NICE SYSTEMS LTD	4,195	142.80	599,046.00	
	PARTNER COMMUNICATIONS CO	5,625	17.82	100,237.50	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	62,940	149.00	9,378,060.00		
小計		445,158		14,946,375.16 (308,044,792)	

ユーロ	ABERTIS INFRASTRUCTURAS	25,941	10.94	283,794.54
	ACCIONA SA	1,857	44.73	83,072.89
	ACCOR	9,861	24.97	246,229.17
	ACERINOX SA	6,932	8.43	58,436.76
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	9,467	13.81	130,786.60
	ADIDAS AG	13,988	59.59	833,544.92
	ADP	2,316	58.75	136,065.00
	AEGON	115,312	3.44	397,711.08
	AEM SPA	80,124	0.56	45,510.43
	AGEAS	153,311	1.36	209,116.20
	AHOLD (KON.)	77,683	9.55	742,183.38
	AIR LIQUIDE	18,971	95.06	1,803,383.26
	AKZO NOBEL	15,691	37.48	588,177.13
	ALCATEL-LUCENT	155,132	1.32	206,015.29
	ALLIANZ SE-REG	30,494	75.20	2,293,148.80
	ALSTOM RGPT	13,789	23.82	328,522.92
	AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	20,948	15.27	319,875.96
	ANHEUSER-BUSCH INBEV	53,677	53.85	2,890,506.45
	ARCELORMITTAL	57,399	11.42	655,783.57
	ARKEMA	3,700	55.52	205,424.00
	ASML HOLDING NV	28,836	37.23	1,073,708.46
	ASSICURAZIONI GENERALI	78,342	8.55	670,215.81
	ATLANTIA SPA	21,071	10.21	215,134.91
	ATOS	3,313	43.70	144,778.10
	AUTOGRILL SPA	7,704	7.00	53,966.52
	AXA	116,765	9.31	1,087,198.91
	AXEL SPRINGER AG	2,751	33.17	91,250.67
	BANCA CARIGE SPA	47,269	0.64	30,559.40
	BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	313,662	0.20	64,802.56
	BANCO BILBAO VIZCAYA	312,523	4.76	1,488,547.04
	BANCO DE SABADELL SA	139,248	1.40	194,947.20
	BANCO POPOLARE SPA	122,198	0.91	111,566.77
	BANCO POPULAR ESPANOL	71,010	1.71	121,711.14
	BANCO SANTANDER SA	575,942	4.40	2,538,176.39
	BANKINTER SA	15,579	2.81	43,776.99
	BASF SE	61,409	57.01	3,500,927.09
	BAYER	55,289	51.00	2,819,739.00
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,137	62.28	1,378,692.36
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,490	41.92	146,318.25
	BEIERSDORF AG	6,739	50.70	341,667.30
	BEKAERT NV	2,844	21.33	60,662.52
	BELGACOM	10,540	21.16	223,026.40
	BNP PARIBAS	64,825	26.29	1,704,573.37
	BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	4,726	24.34	115,030.84
	BOUYGUES ORD	12,631	20.53	259,377.58

BRENTAG AG	3,099	91.06	282,194.94
BUREAU VERITAS SA	3,786	68.09	257,788.74
CAIXABANK	54,400	2.16	117,776.00
CAP GEMINI SA	9,894	27.57	272,777.58
CARREFOUR	38,607	14.27	550,921.89
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,695	68.04	251,407.80
CELESIO AG	5,912	11.74	69,436.44
CHRISTIAN DIOR	3,645	106.25	387,281.25
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	9,997	18.58	185,744.26
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	14,731	5.39	79,517.93
CNP ASSURANCES	9,966	9.12	90,929.78
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	12,699	12.25	155,562.75
COLRUYT SA	5,063	31.82	161,104.66
COMMERZBANK AG	243,113	1.33	325,285.19
CONTINENTAL AG	5,349	67.32	360,094.68
CREDIT AGRICOLE SA	67,040	2.95	197,969.12
CRH	48,070	14.18	681,632.60
DAIMLER AG	60,598	37.85	2,293,634.30
DANONE (GROUPE)	39,044	51.61	2,015,060.84
DASSAULT SYSTEMES SA	3,946	73.91	291,648.86
DELHAIZE GROUP	6,809	31.30	213,155.74
DELTA LLOYD NV	6,994	10.18	71,198.92
DEUTSCHE BANK NAMEN	62,363	29.16	1,818,816.89
DEUTSCHE BOERSE	13,083	38.70	506,377.51
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,309	8.53	130,677.62
DEUTSCHE POST AG-REG	56,584	13.46	761,620.64
DEUTSCHE TELEKOM	187,799	8.09	1,520,232.90
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	40,137	3.66	147,222.51
E.ON AG	120,407	15.26	1,838,012.85
EDENRED	10,957	21.43	234,808.51
EDP RENOVAVEIS SA	14,634	3.09	45,219.06
EIFFAGE	2,815	24.95	70,248.32
ELAN CORPORATION PLC	33,479	11.37	380,656.23
ELECTRICITE DE FRANCE	16,070	15.71	252,459.70
ELISA A	9,453	15.91	150,397.23
ENAGAS	12,407	13.14	163,090.01
ENEL	440,093	2.37	1,044,780.78
ENEL GREEN POWER SPA	121,260	1.16	141,267.90
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	127,604	1.71	218,713.25
ENI	160,678	15.73	2,527,464.94
ERSTE GROUP BANK AG	13,309	14.55	193,645.95
ESSILOR INTERNATIONAL	13,444	69.36	932,475.84
EURAZEO	2,357	30.36	71,558.52
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	27,419	27.62	757,312.78
EUTELSAT COMMUNICATIONS	9,151	22.25	203,609.75

EXOR SPA	4,687	16.85	78,975.95
FERROVIAL SA	25,413	7.87	200,152.78
FIAT INDUSTRIAL	51,123	7.68	392,880.25
FIAT ORD	53,000	3.98	210,940.00
FINMECCANICA SPA	29,572	2.71	80,317.55
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	3,419	10.53	36,002.07
FORTUM OYJ	29,698	15.36	456,161.28
FRANCE TELECOM	123,971	10.25	1,271,322.60
FRAPORT AG	2,457	42.68	104,864.76
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	14,026	53.41	749,128.66
FRESENIUS SE&CO KGAA	7,603	75.64	575,090.92
FUGRO NV-CVA	4,794	46.46	222,729.24
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	16,031	10.05	161,191.70
GAS NATURAL SDG SA	23,206	9.55	221,640.50
GDF SUEZ	82,810	16.23	1,344,420.35
GEA GROUP AG	11,675	20.78	242,664.87
GRIFOLS SA	9,260	18.92	175,199.20
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,413	51.09	276,550.17
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	36,567	6.29	230,006.43
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	4,046	43.74	176,972.04
HEIDELBERGCEMENT AG	9,402	36.03	338,801.07
HEINEKEN HOLDING NV	7,703	32.89	253,390.18
HEINEKEN NV	17,330	38.96	675,263.45
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	17,908	1.48	26,503.84
HENKEL AG & CO KGAA	8,685	43.57	378,405.45
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	11,912	51.88	617,994.56
HOCHTIEF AG	2,831	36.66	103,784.46
IBERDROLA SA	255,645	3.26	833,402.70
ILIAD SA	1,280	107.80	137,984.00
IMERYS SA	2,361	39.49	93,247.69
IMMOFINANZ AG	68,672	2.42	166,186.24
INDITEX	14,586	69.00	1,006,434.00
INDRA SISTEMAS SA	6,845	7.82	53,541.59
INFINEON TECHNOLOGIES	72,659	6.14	446,416.89
ING GROEP	256,982	4.77	1,225,804.14
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	62,025	1.71	106,186.80
INTESA SANPAOLO	676,020	1.01	686,836.32
INTESA SANPAOLO-RNC	64,873	0.86	56,309.76
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION	45,054	0.00	0.00
JC DECAUX SA	4,621	17.63	81,491.33
JERONIMO MARTINS	15,262	13.88	211,912.87
K+S AG	11,517	33.23	382,709.91
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	6,017	47.40	285,205.80

KBC GROEP NV	11,204	12.60	141,226.42
KERRY GROUP PLC-A	9,389	34.00	319,226.00
KESKO OYJ-B SHS	4,473	20.09	89,862.57
KONE OYJ-B	10,410	45.45	473,134.50
KONINKLIJKE DSM NV	10,310	39.35	405,750.05
KPN (KON.)	98,787	7.63	754,139.95
LAFARGE (FRANCE)	13,444	29.47	396,261.90
LAGADERE S.C.A	8,178	20.14	164,745.81
LANXESS	5,563	53.35	296,786.05
LEGRAND SA	14,962	25.62	383,401.25
LINDE AG	11,417	123.20	1,406,574.40
LOREAL	16,073	90.71	1,457,981.83
LUXOTTICA GROUP SPA	8,092	25.95	209,987.40
LVMH	16,974	118.60	2,013,116.40
MAN SE	4,241	78.78	334,105.98
MAPFRE SA	55,064	1.74	96,251.87
MEDIASET	47,386	1.31	62,217.81
MEDIOBANCA	34,666	2.89	100,254.07
MERCK KGAA	4,321	75.27	325,241.67
METRO STAMM	8,668	22.45	194,596.60
METSO OYJ	8,544	27.73	236,925.12
MICHELIN	12,034	48.51	583,829.51
MOBISTAR SA	2,086	25.58	53,370.31
MUENCHENER RUECKVERSICH.	12,033	102.35	1,231,577.55
NATIXIS	63,795	1.91	122,295.01
NEOPOST SA	2,357	41.71	98,310.47
NESTE OIL OYJ	8,623	7.71	66,526.44
NOKIA CORP	250,386	2.25	563,368.50
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,364	31.18	229,609.52
OKO BANK-A	9,611	8.42	80,972.67
OMV AG	10,941	22.68	248,141.88
OPAP SA	14,930	4.12	61,511.60
ORION OYJ-CLASS B	6,894	14.48	99,825.12
PERNOD-RICARD	13,274	78.00	1,035,372.00
PEUGEOT SA	11,116	8.19	91,095.62
PHILIPS ELECTRS (KON.)	67,460	14.37	969,737.50
PIRELLI & CO	15,904	8.15	129,617.60
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	10,238	40.85	418,222.30
PORTUGAL TELECOM	46,591	3.29	153,377.57
PPR	5,088	118.30	601,910.40
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	5,151	17.47	89,987.97
PRYSMIAN SPA	14,113	11.30	159,476.90
PUBLICIS GROUPE	9,696	37.67	365,248.32
QIAGEN N.V.	16,222	13.26	215,103.72
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	3,400	23.39	79,543.00

RANDSTAD HOLDING NV	8,292	22.19	183,999.48
RED ELECTRICA CORPORACION SA	7,235	29.30	212,021.67
REED ELSEVIER NV	45,989	8.65	398,034.79
RENAULT SA	12,852	33.75	433,755.00
REPSOL YPF	53,057	13.81	732,982.45
RWE AG-NON VTG PFD	2,623	26.75	70,178.36
RWE STAMM	32,720	29.70	971,784.00
SAFRAN SA	11,153	26.99	301,019.47
SAINT-GOBAIN	26,856	30.33	814,542.48
SAIPEM	17,702	31.94	565,401.88
SALZGITTER AG	2,612	35.29	92,190.54
SAMPO OYJ-A SHS	28,183	18.88	532,095.04
SANOFI	76,173	54.74	4,169,710.02
SANOMA OYJ	5,948	6.73	40,030.04
SAP AG	61,519	46.17	2,840,332.23
SBM OFFSHORE NV	11,462	11.25	128,947.50
SCHNEIDER ELECTRIC	32,729	43.56	1,425,838.88
SCOR SE	11,593	17.87	207,166.91
SES	20,037	18.06	361,968.40
SIEMENS	55,011	68.14	3,748,449.54
SNAM SPA	107,446	3.16	340,174.03
SOCIETE BIC SA	1,994	79.00	157,526.00
SOCIETE GENERALE	44,259	16.15	714,782.85
SODEXO	6,303	58.75	370,301.25
SOLVAY SA	3,964	84.79	336,107.56
STMICROELECTRONICS	42,616	4.05	172,765.26
STORA ENSO OYJ R	40,312	4.50	181,404.00
SUEDZUCKER AG	4,431	24.58	108,936.13
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	18,707	9.02	168,737.14
TECHNIP S.A.	6,634	75.74	502,459.16
TELECOM ITALIA ORD	627,930	0.68	428,248.26
TELECOM ITALIA RNC	402,903	0.56	228,244.54
TELEFONICA	274,632	9.44	2,592,526.08
TELEFONICA SA-RIGHTS	274,632	0.24	67,834.10
TELEKOM AUSTRIA AG	23,022	7.30	168,244.77
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	8,577	6.10	52,362.58
TENARIS SA	31,572	13.46	424,959.12
TERNA SPA	83,565	2.72	227,631.06
THALES SA	6,763	23.88	161,500.44
THYSSEN KRUPP	25,799	14.15	365,184.84
TNT EXPRESS	24,466	8.96	219,386.62
TOTAL SA	141,922	35.06	4,976,494.93
UCB (GROUPE)	6,988	38.94	272,112.72
UMICORE	7,622	38.72	295,123.84
UNICREDIT SPA	270,620	2.49	676,008.76

UNILEVER NV-CVA	108,914	25.36	2,762,603.61	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	54,261	2.24	121,544.64	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,820	13.80	107,916.00	
UPM KYMMENE CORP	35,099	8.42	295,709.07	
VALLOUREC	7,564	32.08	242,653.12	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,321	9.49	230,903.57	
VERBUND AG	4,553	18.70	85,141.10	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,808	28.96	81,333.72	
VINCI S.A.	30,223	33.09	1,000,230.18	
VIVENDI	86,154	13.01	1,120,863.54	
VOESTALPINE AG	7,614	20.85	158,751.90	
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,669	128.95	1,246,817.55	
VOLKSWAGEN STAMM	2,044	121.30	247,937.20	
VOPAK	4,872	47.06	229,276.32	
WACKER CHEMIE AG	1,088	56.31	61,265.28	
WARTSILA OYJ	11,209	27.18	304,660.62	
WENDEL	2,197	54.32	119,341.04	
WOLTERS KLUWER	20,169	12.02	242,532.22	
ZARDOYA OTIS SA	10,201	8.85	90,278.85	
小計	11,777,344		128,534,545.64 (12,804,611,436)	
合計	84,049,645		(107,375,117,053)	

(注1)各種通貨ごとの小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

(注2)合計欄における()内の金額は、各通貨の邦貨換算額合計の数字であります。

(注3)外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	株式 559銘柄	100.0%	59.6%
カナダドル	株式 99銘柄	100.0%	5.6%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	100.0%	3.6%
イギリスポンド	株式 100銘柄	100.0%	10.5%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%	3.9%
香港ドル	株式 40銘柄	100.0%	1.3%
シンガポールドル	株式 29銘柄	100.0%	0.8%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデンクローナ	株式 34銘柄	100.0%	1.4%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%	0.4%
デンマーククローネ	株式 12銘柄	100.0%	0.6%
イスラエルシェケル	株式 13銘柄	100.0%	0.3%
ユーロ	株式 242銘柄	100.0%	11.9%

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数(口)	評価額	備考
----	----	----	-------	-----	----

投資信託 受益証券	アメリカドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	362,000.00	260,640.00		
	小計		362,000.00	260,640.00 (20,739,124)		
	オーストラリアドル	APA GROUP		37,655.00	186,392.25	
		LEND LEASE GROUP		37,640.00	277,030.40	
		SYDNEY AIRPORT		26,529.00	74,015.91	
小計		101,824.00	537,438.56 (41,984,700)			
投資信託受益証券計				(62,723,824)		
投資証券	アメリカドル	AMERICAN TOWER CORPORATION	26,277.00	1,727,712.75		
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	64,859.00	1,083,145.30		
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,357.00	888,962.88		
		BOSTON PROPERTIES	9,870.00	1,024,999.50		
		DIGITAL REALTY TRUST INC	7,231.00	513,907.17		
		DUKE REALTY CORP	17,553.00	240,827.16		
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	19,832.00	1,222,444.48		
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,245.00	418,514.55		
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	29,165.00	490,263.65		
		HCP INC	27,265.00	1,117,319.70		
		HEALTH CARE REIT INC	14,059.00	776,337.98		
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	47,218.00	715,352.70		
		KIMCO REALTY CORP	27,208.00	492,192.72		
		LIBERTY PROPERTY TRUST	7,758.00	270,288.72		
		MACERICH CO/THE	8,822.00	511,323.12		
		PLUM CREEK TIMBER COMMON	11,175.00	410,234.25		
		PROLOGIS INC	30,639.00	965,128.50		
		PUBLIC STORAGE	9,721.00	1,295,712.09		
		RAYONIER INC	8,145.00	348,443.10		
		REGENCY CENTERS CORP	6,012.00	263,445.84		
	SIMON PROPERTY GROUP	19,642.00	2,909,373.04			
	VENTAS INC	19,250.00	1,118,232.50			
	VORNADO REALTY TRUST	11,102.00	922,576.20			
	小計		433,405.00	19,726,737.90 (1,569,656,534)		
	カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	5,613.00	136,283.64		
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,783.00	237,580.15		
	小計		14,396.00	373,863.79 (28,996,875)		
オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	127,894.00	243,638.07			
	DEXUS PROPERTY GROUP	335,304.00	315,185.76			
	GOODMAN GROUP	93,939.00	325,028.94			
	GPT GROUP	115,994.00	371,180.80			
	MIRVAC GROUP	236,764.00	294,771.18			
	STOCKLAND	155,157.00	507,363.39			

	WESTFIELD GROUP	146,659.00	1,375,661.42	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	193,990.00	523,773.00	
小計		1,405,701.00	3,956,602.56 (309,089,791)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	56,659.00	282,048.50	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	37,520.00	119,313.60	
	HAMMERSON PLC	49,479.00	208,850.85	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	52,173.00	374,341.27	
	SEGRO PLC	49,761.00	109,424.43	
小計		245,592.00	1,093,978.65 (136,298,800)	
香港ドル	LINK REIT	150,500.00	4,499,950.00	
小計		150,500.00	4,499,950.00 (46,124,487)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	118,000.00	236,000.00	
	CAPITAMALL TRUST	145,000.00	258,100.00	
小計		263,000.00	494,100.00 (30,767,607)	
ユーロ	CORIO NV	4,082.00	138,318.57	
	FONCIERE DES REGIONS	1,911.00	101,741.64	
	GECINA SA	1,471.00	103,175.94	
	ICADE	1,564.00	99,767.56	
	KLEPIERRE	6,998.00	172,360.74	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,168.00	836,689.20	
小計		22,194.00	1,452,053.65 (144,653,584)	
投資証券計			(2,265,587,678)	
合計			(2,328,311,502)	

(注1)各種通貨ごとの小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

(注2)合計欄における()内の金額は、各通貨の邦貨換算額合計の数字であります。

(注3)外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券 1銘柄	1.3%		68.3%
	投資証券 23銘柄		98.7%	
カナダドル	投資証券 2銘柄		100.0%	1.2%
オーストラリアドル	投資信託受益証券 3銘柄	12.0%		15.1%
	投資証券 8銘柄		88.0%	
イギリスポンド	投資証券 5銘柄		100.0%	5.9%
香港ドル	投資証券 1銘柄		100.0%	2.0%
シンガポールドル	投資証券 2銘柄		100.0%	1.3%
ユーロ	投資証券 6銘柄		100.0%	6.2%

2)信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3) デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

前述の(デリバティブ取引に関する注記)に記載していますので、ここでは省略しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(平成24年6月29日現在)

資産総額	1,202,396,910 円
負債総額	2,159,344 円
純資産総額（ - ）	1,200,237,566 円
発行済口数	1,704,516,142 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7042 円
1万口当たり純資産額	7,042 円

(参考情報)

外国株式インデックス マザーファンド

資産総額	123,652,326,577 円
負債総額	26,642,136 円
純資産総額（ - ）	123,625,684,441 円
発行済口数	141,107,936,995 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8761 円
1万口当たり純資産額	8,761 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。

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

受益権の譲渡

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24年6月29日現在）

資本金の額　　：3億円

発行可能株式総数：12,000株

発行済株式総数　：3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

会社に取締役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、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

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

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

[CHECK（検証・評価）]

運用部門において各運用部から独立した運用企画部は、ファンド品質の維持・向上の観点から、毎月開催される運用委員会（委員長は運用企画部担当役員）にパフォーマンス等に係るモニタリング状況を報告します。

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

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

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

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

委託会社の機構は平成24年8月17日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

平成24年6月29日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	296	3,576,425
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	635
単位型公社債投資信託	0	0
合計	301	3,577,060

3【委託会社等の経理状況】

- (イ) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（旧社名 住信アセットマネジメント株式会社、以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）第2条に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
なお、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (ロ) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

(2)【損益計算書】

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
株主資本		

資本金		
当期首残高	300,000	300,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		
当期首残高	-	-
当期変動額		
自己株式の消却	-	3,019,410
その他利益剰余金より振替	-	3,019,410
当期変動額合計	-	-
当期末残高	-	-
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	50,500	53,500
当期変動額		
剰余金の配当に伴う積立	3,000	3,000
当期変動額合計	3,000	3,000
当期末残高	53,500	56,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	5,100,000	5,100,000
当期変動額		
繰越利益剰余金へ振替	-	3,000,000
当期変動額合計	-	3,000,000
当期末残高	5,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	942,449	1,421,205
当期変動額		
剰余金の配当	33,000	33,000
当期純利益	511,755	1,147,477
別途積立金より振替	-	3,000,000
その他資本剰余金へ振替	-	3,019,410
当期変動額合計	478,755	1,095,067
当期末残高	1,421,205	2,516,273
利益剰余金合計		
当期首残高	6,092,949	6,574,705
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	511,755	1,147,477
その他資本剰余金へ振替	-	3,019,410

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

(単位：千円)

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算末日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定率法によっております。

ただし、平成19年3月31日以前に取得したものについては、償却可能限度額まで償却が終了した翌年から5年間で均等償却する方法によっております。

(2)無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2)退職給付引当金

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

(3)移転関連費用引当金

本店事務所の移転に伴い発生する損失に備えるため、合理的な見積額を計上しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更

1. 耐用年数の変更

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

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

2. 資産除去債務の見積りの変更

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

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

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

追加情報

会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

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

2関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

（損益計算書関係）

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末

普通株式（株）	6,000	-	-	6,000
---------	-------	---	---	-------

2. 自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	配当金の 原資	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成23年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	5,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

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

2. 自己株式の種類及び株式数

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

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

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

3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額（千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成23年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成23年3月31日	平成23年6月29日

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

平成24年6月29日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

(1)配当金の総額 30,000千円

(2) 配当金の原資 利益剰余金

(3) 1株当たり配当額 10,000円

(4) 基準日 平成24年3月31日

(5) 効力発生日 平成24年6月29日

(リ - ス取引関係)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成23年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額

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

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

当事業年度（平成24年3月31日）

（単位：千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

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

「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成23年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	6,223,302	-	-	-
未収委託者報酬	953,916	-	-	-

当事業年度（平成24年3月31日）

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	4,826,115	-	-	-

未収委託者報酬	944,716	-	-	-
---------	---------	---	---	---

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度（平成23年3月31日現在）

（単位：千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	3,000	3,075	75
小計	3,000	3,075	75
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	50,925	36,515	14,409
小計	50,925	36,515	14,409
計	53,925	39,590	14,334

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

当事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位：千円）

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

2. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
7,639	756	480

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,483,441	1,277,954	12

（デリバティブ取引関係）

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務及びその他に関する事項（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

（注）2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

（注）2．金額には確定拠出年金への掛金支払額を含んでおり、前事業年度で13,307千円、当事業年度で12,680千円です。

4．退職給付債務等の計算基礎

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 （平成23年3月31日）	当事業年度 （平成24年3月31日）
繰延税金資産		
未払事業税	17,667 千円	4,898 千円
賞与引当金損金算入限度超過額	32,484 "	27,004 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	69,626 "	71,271 "
有価証券評価差額	5,832 "	5,459 "
移転関連費用引当金損金算入限度超過額		15,755 "
減価償却超過額		12,745 "
敷金償却超過額		19,348 "
その他	4,558 "	3,334 "

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

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

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
法定実効税率		40.69 %
(調整)		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目		4.14 "
税率変更による期末繰延税金負債の減額修正		2.30 "
その他		0.49 "
税効果会計適用後の法人税等の負担率		34.73 "

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

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

セグメント情報

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

関連情報

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容又は職 業	議決権等 の被所有 割合	関連 当事者 との関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	住友信託 銀行(株)	大阪市 中央区	342,037	信託業務 及び銀行 業務	直接30%, 間接70%	営業上の取引 役員の兼任	投信販売 代行手数料	3,761,890	未払手数料	333,570
							投資助言費用 の支払	692,451	未払費用	123,687

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等 の被所有 割合	関連 当事者 との関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	三井住友トラ スト・ホール ディングス(株)	東京都 千代田区	261,608	持株会社	100%	役員の兼任	投資有価証券 の譲渡	67,316	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投資有価証券の譲渡

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
兄弟会社	住友信託銀行(株)	大阪市中央区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	投信販売 代行手数料	2,721,441	未払手数料	286,815
							投資助言費用の 支払	820,269	未払費用	104,322
兄弟会社	すみしん不動産(株)	東京都中央区	300	不動産 仲介業務	-	-	投資有価証券の 譲渡	185,484	-	-
							自己株式の 取得	1,509,705	-	-
兄弟会社	住信カード(株)	東京都中央区	50	クレジット カード業務	-	-	投資有価証券の 譲渡	494,720	-	-
							自己株式の 取得	1,207,764	-	-
兄弟会社	住信情報サービス(株)	大阪府豊中市	100	コンピュー タ関連業務	-	-	投資有価証券の 譲渡	729,782	-	-
							自己株式の 取得	301,941	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投資有価証券の譲渡及び自己株式の取得

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成23年3月31日）

住友信託銀行株式会社（非上場）

当事業年度（平成24年3月31日）

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

（1株当たり情報）

	前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
1株当たり純資産額	1,144,367円30銭	1,654,304円66銭
1株当たり当期純利益	85,292円63銭	197,729円22銭

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

2. 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
当期純利益	511,755千円	1,147,477千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	511,755千円	1,147,477千円
期中平均株式数	6,000株	5,803株

（重要な後発事象）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

1. 企業結合の概要

(1) 結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 住信アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

(2) 企業結合日

平成24年4月1日

(3) 企業結合の法的形式

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

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5) その他取引の概要に関する事項

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

2. 実施した会計処理の概要

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

[次へ](#)

<参考> 中央三井アセットマネジメント株式会社の経理状況

(1) 委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」といいます。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2) 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 木村 充男

印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 松崎 雅則

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている中央三井アセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第26期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、中央三井アセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

(1) 貸借対照表

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

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

(2) 損益計算書

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

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

(3) 株主資本等変動計算書

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

重要な会計方針

項目	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)
<p>1．有価証券の評価基準及び評価方法</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>(2) 無形固定資産</p> <p>3．引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金</p> <p>(2) 賞与引当金</p> <p>(3) 役員賞与引当金</p> <p>(4) 退職給付引当金</p> <p>(5) 移転関連費用引当金</p> <p>4．その他財務諸表作成の基本となる重要な事項</p>	<p>その他有価証券</p> <p>(1) 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額については全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。</p> <p>(2) 時価のないもの 移動平均法に基づく原価法を採用しております。</p> <p>定率法を採用しております。 なお、耐用年数は、建物については主として10年～15年、器具備品については主として5年～20年であります。</p> <p>定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（5年）を耐用年数としております。</p> <p>一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当期負担分を計上しております。</p> <p>役員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当期負担分を計上しております。</p> <p>従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による期末退職給付債務相当額を計上しております。</p> <p>移転関連費用引当金は、当社グループの東京地区拠点ビルの統廃合に伴うオフィス移転で発生する損失に備えるため、合理的な見積額を計上しております。</p> <p>消費税等の会計処理は税抜方式を採用しております。</p>

追加情報

第26期
(平成23年4月1日から
平成24年3月31日まで)

1．会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

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

2．役員賞与引当金

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

注記事項

1. 貸借対照表関係

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

2. 損益計算書関係

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

3. 株主資本等変動計算書関係

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

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

4．リース取引関係

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

5．金融商品関係

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

1．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

2．金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次表には含めておりません。

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

満期のない預金については、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。満期のある預金については、預入期間が短期間（1年以内）であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2) 未収委託者報酬及び (4) 未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

1．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

2．金融商品の時価等に関する事項

平成24年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次表には含めておりません。

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

満期のない預金については、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。満期のある預金については、預入期間が短期間（1年以内）であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2) 未収委託者報酬及び (4) 未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

6．有価証券関係

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

7. デリバティブ関係

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

8. 退職給付関係

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

9. 税効果会計関係

第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)																																																																																										
<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td style="width: 80%;">貸倒引当金繰入超過額</td><td style="text-align: right;">15,294千円</td></tr> <tr><td>賞与引当金繰入超過額</td><td style="text-align: right;">20,418千円</td></tr> <tr><td>資産除去債務</td><td style="text-align: right;">6,650千円</td></tr> <tr><td>移転による除却予定資産減損</td><td style="text-align: right;">7,170千円</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">6,824千円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">19,740千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td style="text-align: right;">76,099千円</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">32,440千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;">43,658千円</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;">793千円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">806千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;">1,600千円</td></tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td style="width: 80%;">法定実効税率</td><td style="text-align: right;">40.7%</td></tr> <tr><td colspan="2">(調整)</td></tr> <tr><td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td><td style="text-align: right;">2.9%</td></tr> <tr><td>評価性引当額の減少</td><td style="text-align: right;">1.6%</td></tr> <tr><td>住民税均等割</td><td style="text-align: right;">0.1%</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">0.4%</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td style="text-align: right;">36.7%</td></tr> </table>	貸倒引当金繰入超過額	15,294千円	賞与引当金繰入超過額	20,418千円	資産除去債務	6,650千円	移転による除却予定資産減損	7,170千円	未払事業税	6,824千円	その他	19,740千円	<hr/>		繰延税金資産小計	76,099千円	評価性引当額	32,440千円	<hr/>		繰延税金資産合計	43,658千円	その他有価証券評価差額金	793千円	その他	806千円	<hr/>		繰延税金負債合計	1,600千円	法定実効税率	40.7%	(調整)		受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.9%	評価性引当額の減少	1.6%	住民税均等割	0.1%	その他	0.4%	<hr/>		税効果会計適用後の法人税等の負担率	36.7%	<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td style="width: 80%;">貸倒引当金繰入超過額</td><td style="text-align: right;">12,629千円</td></tr> <tr><td>賞与引当金繰入超過額</td><td style="text-align: right;">18,980千円</td></tr> <tr><td>資産除去債務</td><td style="text-align: right;">7,602千円</td></tr> <tr><td>移転による除却予定資産減損</td><td style="text-align: right;">6,698千円</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">7,012千円</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">28,721千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td style="text-align: right;">81,645千円</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">19,763千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;">61,881千円</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;">901千円</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;">901千円</td></tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td style="width: 80%;">法定実効税率</td><td style="text-align: right;">40.7%</td></tr> <tr><td colspan="2">(調整)</td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td style="text-align: right;">5.4%</td></tr> <tr><td>評価性引当額の減少</td><td style="text-align: right;">3.7%</td></tr> <tr><td>住民税均等割</td><td style="text-align: right;">0.2%</td></tr> <tr><td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td><td style="text-align: right;">1.6%</td></tr> <tr><td colspan="2"><hr/></td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td style="text-align: right;">44.2%</td></tr> </table>	貸倒引当金繰入超過額	12,629千円	賞与引当金繰入超過額	18,980千円	資産除去債務	7,602千円	移転による除却予定資産減損	6,698千円	未払事業税	7,012千円	その他	28,721千円	<hr/>		繰延税金資産小計	81,645千円	評価性引当額	19,763千円	<hr/>		繰延税金資産合計	61,881千円	その他有価証券評価差額金	901千円	<hr/>		繰延税金負債合計	901千円	法定実効税率	40.7%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	5.4%	評価性引当額の減少	3.7%	住民税均等割	0.2%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.6%	<hr/>		税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.2%
貸倒引当金繰入超過額	15,294千円																																																																																										
賞与引当金繰入超過額	20,418千円																																																																																										
資産除去債務	6,650千円																																																																																										
移転による除却予定資産減損	7,170千円																																																																																										
未払事業税	6,824千円																																																																																										
その他	19,740千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金資産小計	76,099千円																																																																																										
評価性引当額	32,440千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金資産合計	43,658千円																																																																																										
その他有価証券評価差額金	793千円																																																																																										
その他	806千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金負債合計	1,600千円																																																																																										
法定実効税率	40.7%																																																																																										
(調整)																																																																																											
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.9%																																																																																										
評価性引当額の減少	1.6%																																																																																										
住民税均等割	0.1%																																																																																										
その他	0.4%																																																																																										
<hr/>																																																																																											
税効果会計適用後の法人税等の負担率	36.7%																																																																																										
貸倒引当金繰入超過額	12,629千円																																																																																										
賞与引当金繰入超過額	18,980千円																																																																																										
資産除去債務	7,602千円																																																																																										
移転による除却予定資産減損	6,698千円																																																																																										
未払事業税	7,012千円																																																																																										
その他	28,721千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金資産小計	81,645千円																																																																																										
評価性引当額	19,763千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金資産合計	61,881千円																																																																																										
その他有価証券評価差額金	901千円																																																																																										
<hr/>																																																																																											
繰延税金負債合計	901千円																																																																																										
法定実効税率	40.7%																																																																																										
(調整)																																																																																											
交際費等永久に損金に算入されない項目	5.4%																																																																																										
評価性引当額の減少	3.7%																																																																																										
住民税均等割	0.2%																																																																																										
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.6%																																																																																										
<hr/>																																																																																											
税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.2%																																																																																										

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

10. 資産除去債務関係

第25期
平成23年3月31日

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

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

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3. 当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

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

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

第26期
平成24年3月31日

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

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

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3. 当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

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

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

11. セグメント情報等

第25期
(平成22年4月1日から
平成23年3月31日まで)

(セグメント情報)

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連情報)

1. 製品及びサービスごとの情報

投資信託委託業の区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
中央三井高金利ソブリンオープン	1,336,886千円
中央三井VAバランスファンド（株25/100）	1,150,446千円

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

当事業年度において、17,622千円の減損損失を計上しておりますが、当社は投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

第26期
(平成23年4月1日から
平成24年3月31日まで)

(セグメント情報)

第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連情報)

1. 製品及びサービスごとの情報

投資信託委託業の区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	2,529,799千円

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

12. 関連当事者との取引関係

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

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

(2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

1．関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

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

(2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

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

上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

13. 1株当たり情報

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

1株当たり当期純損益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

14. 重要な後発事象

第26期
(平成23年4月1日から
平成24年3月31日まで)

(企業結合)

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

(1) 企業結合の概要

結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 住信アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

企業結合日

平成24年4月1日

企業結合の法的形式

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

結合後の企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

その他取引の概要に関する事項

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

(2) 実施した会計処理の概要

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

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

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

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成24年8月17日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成24年4月1日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成24年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社愛媛銀行	19,078	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社八千代銀行	43,734	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
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。
楽天証券株式会社	7,495	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。
株式会社S B I証券	47,937	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

資本金の額は平成24年4月1日現在です。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、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24年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

平成24年7月13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 石井勝也
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている外国株式インデックス・オープンの平成23年5月31日から平成24年5月29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、外国株式インデックス・オープンの平成24年5月29日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲には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24年6月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	羽 太 典 明 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	石 井 勝 也 印

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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