【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成23年３月25日
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 前田 良治
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目５番１号
【事務連絡者氏名】	隠地 保夫
【電話番号】	03-5405-0735
【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】	三井住友・ワールド・パッケージ・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】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

Ⅰ．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成22年９月21日付をもって提出しました「三井住友・ワールド・パッケージ・オープン」の有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について、平成23年３月25日に半期報告書を提出したことに伴う関係情報の更新、その他訂正すべき事項がありますので、本訂正届出書により訂正を行うものです。

Ⅱ．【訂正の内容】

＜訂正前＞および＜訂正後＞に記載している下線部＿＿＿＿＿は訂正部分を示します。

第一部【証券情報】

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

＜訂正前＞

追加型証券投資信託の受益権です。

＊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、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関およ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または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載また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。）。委託会社である三井住友アセットマネジメント株式会社は、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。

当初元本は１口当たり１円です。格付けは取得しておりません。

＜訂正後＞

追加型証券投資信託の受益権です。

＊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、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関およ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または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載また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。）。委託会社である三井住友アセットマネジメント株式会社は、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。

当初元本は１口当たり１円です。委託会社の依頼により、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また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。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（３）【ファンドの仕組み】

＜訂正前＞

（ 略 ）

ロ 委託会社の概況

（イ）資本金の額

2,000百万円（平成22年７月30日現在）

（ 略 ）

（ハ）大株主の状況

（平成22年７月30日現在）

名称	住所	所有株式数	比率（%）
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目４番35号	7,056	40.0
三井住友海上火災保険株式会社	東京都中央区新川二丁目27番２号	4,851	27.5
株式会社三井住友銀行	東京都千代田区有楽町一丁目１番２号	4,851	27.5
三井生命保険株式会社	東京都千代田区大手町二丁目１番１号	882	5.0

＜訂正後＞

（ 略 ）

ロ 委託会社の概況

（イ）資本金の額

2,000百万円（平成23年１月31日現在）

（ 略 ）

（ハ）大株主の状況

（平成23年１月31日現在）

名称	住所	所有株式数	比率（%）

住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目４番35号	7,056	40.0
三井住友海上火災保険株式会社	東京都中央区新川二丁目27番２号	4,851	27.5
株式会社三井住友銀行	東京都千代田区丸の内一丁目１番２号	4,851	27.5
三井生命保険株式会社	東京都千代田区大手町二丁目１番１号	882	5.0

2 【投資方針】

（3）【運用体制】

＜訂正前＞

イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

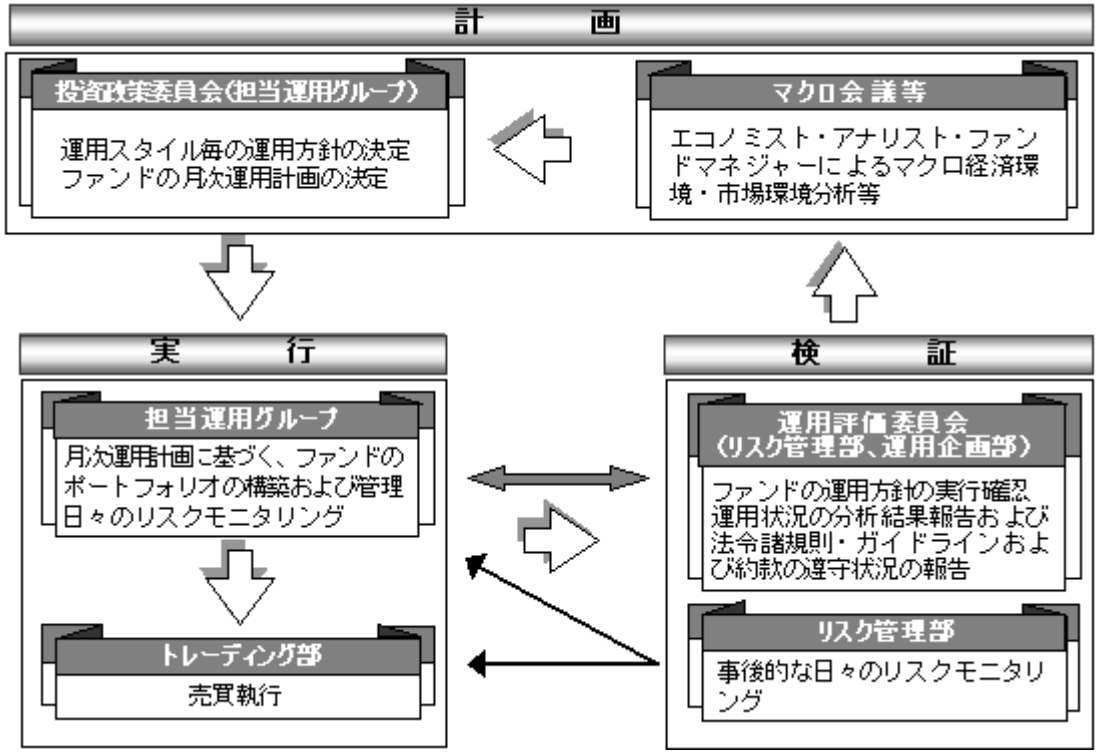
（イ）計画（Plan）

国内外のエコノミスト、アナリスト、ファンドマネジャーが、マクロ経済環境、市場環境に関する分析・検討を行います。

これを元に、担当運用グループは投資政策委員会にて、運用方針を決定し月次運用計画を策定します。

（ 略 ）

〔ファンドの運用体制〕



（ 略 ）

＜訂正後＞

イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

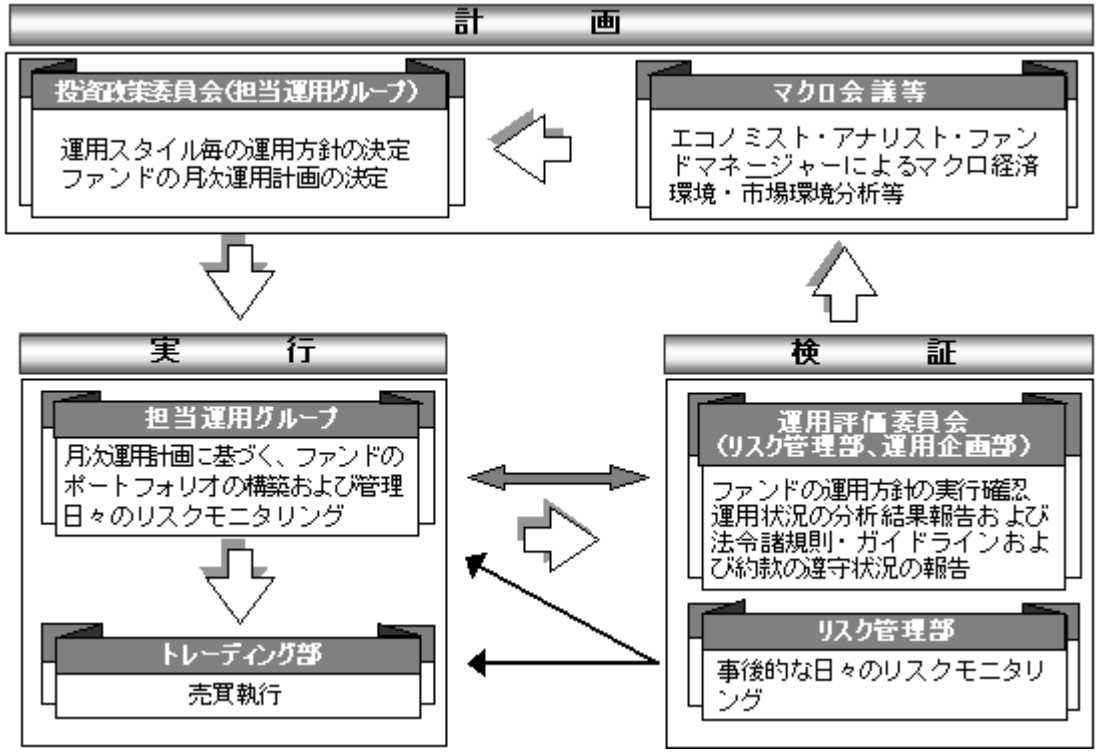
（イ）計画（Plan）

国内外のエコノミスト、アナリスト、ファンドマネージャーが、マクロ経済環境、市場環境に関する分析・検討を行います。

これを元に、担当運用グループは投資政策委員会にて、運用方針を決定し月次運用計画を策定します。

（ 略 ）

〔ファンドの運用体制〕



（ 略 ）

（5）【投資制限】

＜訂正前＞

（ 略 ）

〔参考情報：他の投資信託の概要（平成22年９月21日現在）〕

（ 略 ）

＜訂正後＞

（ 略 ）

〔参考情報：他の投資信託の概要（平成23年３月25日現在）〕

（ 略 ）

４【手数料等及び税金】

（３）【信託報酬等】

＜訂正前＞

（ 略 ）

※投資対象とする他の投資信託（「ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”」、「ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”」、「ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”」および「ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”」）を含めた信託報酬の総額は、当ファンドの基本的な資産配分に従った場合、年1.036875%（税抜き0.9875%）程度となります（平成22年９月現在の基本組入比率による試算）。

＜訂正後＞

（ 略 ）

※投資対象とする他の投資信託（「ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”」、「ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”」、「ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”」および「ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”」）を含めた信託報酬の総額は、当ファンドの基本的な資産配分に従った場合、年1.036875%（税抜き0.9875%）程度となります（平成23年３月現在の基本組入比率による試算）。

（５）【課税上の取扱い】

＜訂正前＞

（ 略 ）

※上記「(５)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成22年７月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

※課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

＜訂正後＞

（ 略 ）

※上記「(５)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成23年１月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

※課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

5 【運用状況】

原届出書「第二部 ファンド情報 第１ ファンドの状況 ５ 運用状況」の記載は、下記の通り更新されます。

（１）【投資状況】

平成23年１月31日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	日本	4,661,650,226	99.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,945,855	0.04
合計(純資産総額)		4,663,596,081	100.00

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

投資信託受益証券の明細は以下の通りです。

銘柄名	主要投資対象	時価合計（円）	投資比率（%）
ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”	国内株式	1,172,316,653	25.14
ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”	国内債券	1,173,080,946	25.15
ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”	外国株式	1,157,852,488	24.83
ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”	外国債券	1,158,400,139	24.84

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ 主要投資銘柄

平成23年１月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価／金額（円）	評価額 単価／金額（円）	投資比率（%）
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”	1,072,482,123	1.0941 1,173,411,270	1.0938 1,173,080,946	25.15
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”	1,662,860,501	0.6501 1,081,142,011	0.705 1,172,316,653	25.14
日本	投資信託受益証券	ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”	808,882,159	1.5028 1,215,636,430	1.4321 1,158,400,139	24.84

日本	投資信託 受益証券	ドイチェ外国株式ファンド “ チェロ ”	1,320,543,440	0.7479 987,745,364	0.8768 1,157,852,488	24.83

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成23年１月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.96
合計	99.96

②【投資不動産物件】
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】
該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

年月日	純資産総額 （円）	１万口当たりの 純資産額（円）
第１期（平成14年６月26日）　（分配落）	23,080,799,666	9,111
第１期（平成14年６月26日）　（分配付）	23,080,799,666	9,111
第２期（平成15年６月26日）　（分配落）	19,575,607,663	9,063
第２期（平成15年６月26日）　（分配付）	19,575,607,663	9,063
第３期（平成16年６月28日）　（分配落）	17,004,122,927	9,809
第３期（平成16年６月28日）　（分配付）	17,004,122,927	9,809
第４期（平成17年６月27日）　（分配落）	10,295,769,640	10,113
第４期（平成17年６月27日）　（分配付）	10,703,006,242	10,513
第５期（平成18年６月26日）　（分配落）	8,259,845,247	11,126
第５期（平成18年６月26日）　（分配付）	8,408,327,725	11,326
第６期（平成19年６月26日）　（分配落）	8,284,824,296	12,180
第６期（平成19年６月26日）　（分配付）	8,420,868,747	12,380
第７期（平成20年６月26日）　（分配落）	7,146,716,630	10,838
第７期（平成20年６月26日）　（分配付）	7,278,602,597	11,038
第８期（平成21年６月26日）　（分配落）	5,512,044,153	8,661
第８期（平成21年６月26日）　（分配付）	5,512,044,153	8,661
第９期（平成22年６月28日）　（分配落）	4,964,773,110	8,851
第９期（平成22年６月28日）　（分配付）	4,964,773,110	8,851
第10期（中間期）（平成22年12月28日）	4,701,448,641	9,197
平成22年１月末日	5,342,571,579	8,933
平成22年２月末日	5,220,816,178	8,883
平成22年３月末日	5,416,250,479	9,369

平成22年４月末日	5,393,631,393	9,439
平成22年５月末日	5,043,217,426	8,916
平成22年６月末日	4,887,214,066	8,717
平成22年７月末日	4,929,477,192	8,873
平成22年８月末日	4,730,727,114	8,682
平成22年９月末日	4,840,355,028	8,993
平成22年10月末日	4,695,821,365	8,888
平成22年11月末日	4,687,626,386	9,031
平成22年12月末日	4,698,688,803	9,186
平成23年１月末日	4,663,596,081	9,265

（注１）純資産総額（分配付）および１万口当たりの純資産額（分配付）の欄は、各計算期間にかかる収益分配金の総額を含んでいます。

（注２）純資産総額（分配落）および１万口当たりの純資産額（分配落）の欄は、収益分配時に外国税額控除規定が適用された場合には当該控除額を含んでいます。

②【分配の推移】

計算期間	１万口当たり分配金（円）
第１期（平成13年６月27日～平成14年６月26日）	0
第２期（平成14年６月27日～平成15年６月26日）	0
第３期（平成15年６月27日～平成16年６月28日）	0
第４期（平成16年６月29日～平成17年６月27日）	400
第５期（平成17年６月28日～平成18年６月26日）	200
第６期（平成18年６月27日～平成19年６月26日）	200
第７期（平成19年６月27日～平成20年６月26日）	200
第８期（平成20年６月27日～平成21年６月26日）	0
第９期（平成21年６月27日～平成22年６月28日）	0

③【収益率の推移】

計算期間	収益率（%）
第１期	△8.9
第２期	△0.5
第３期	8.2
第４期	7.2
第５期	12.0
第６期	11.3
第７期	△9.4
第８期	△20.1
第９期	2.2
第10期（中間期）	3.9

（注１）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

（注２）収益分配時に外国税額控除規定が適用された場合には、上記収益率は同期間における受益者の投資収益率と異なる場合があります。

（４）【設定及び解約の実績】

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）

第１期	27,007,227,945	1,673,057,008
第２期	743,462,163	4,478,230,310
第３期	722,820,039	4,987,107,066
第４期	567,142,804	7,721,343,511
第５期	1,360,195,151	4,116,986,291
第６期	768,646,775	1,390,548,118
第７期	776,030,194	983,954,379
第８期	407,535,391	637,676,274
第９期	199,231,064	953,883,089
第10期（中間期）	73,562,771	571,048,356

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

〔参考情報：他の投資信託の現況〕

〔ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”〕

投資有価証券の主要銘柄

主要投資銘柄

平成23年１月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価／金額 （円）	評価額 単価／金額 （円）	投資比率 （%）
日本	親投資信託 受益証券	国内株式 マザーファンド（Ｅ号）	7,489,035,286	0.6780 5,077,565,924	0.7477 5,599,551,683	100.11

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”」は「国内株式マザーファンド（Ｅ号）」受益証券を主要投資対象としており、「国内株式マザーファンド（Ｅ号）」の投資有価証券の上位30銘柄は以下の通りです。

＜国内株式マザーファンド（Ｅ号）　平成23年１月28日現在の上位30銘柄＞

国／地域	種類	銘柄名／業種	数量 （株）	帳簿価額 単価／金額 （円）	評価額 単価／金額 （円）	投資比率 （%）
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 〔銀行業〕	566,000	436.09 246,826,940	434.00 245,644,000	4.39
日本	株式	本田技研工業 〔輸送用機器〕	53,700	3,245.27 174,270,999	3,525.00 189,292,500	3.38
日本	株式	住友不動産 〔不動産業〕	90,000	1,565.34 140,880,600	2,015.00 181,350,000	3.24
日本	株式	東芝 〔電気機器〕	319,000	425.58 135,760,020	501.00 159,819,000	2.85
日本	株式	三井物産 〔卸売業〕	107,300	1,203.07 129,089,411	1,394.00 149,576,200	2.67
日本	株式	日立製作所 〔電気機器〕	324,000	347.84 112,700,160	461.00 149,364,000	2.67
日本	株式	日産自動車 〔輸送用機器〕	137,500	663.19 91,188,625	849.00 116,737,500	2.08

日本	株式	ソニー 〔電気機器〕	40,000	2,582.49 103,299,600	2,908.00 116,320,000	2.08
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ 〔銀行業〕	39,100	2,642.42 103,318,622	2,870.00 112,217,000	2.00
日本	株式	Ｔ＆Ｄホールディングス 〔保険業〕	51,500	2,036.55 104,882,325	2,085.00 107,377,500	1.92
日本	株式	東京海上ホールディングス 〔保険業〕	43,200	2,457.15 106,148,880	2,483.00 107,265,600	1.92
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 〔情報・通信業〕	699	138,322.56 96,687,469	146,500.00 102,403,500	1.83
日本	株式	富士フイルムホールディングス 〔化学〕	31,400	2,653.03 83,305,142	3,060.00 96,084,000	1.72
日本	株式	伊藤忠商事 〔卸売業〕	105,800	719.07 76,077,606	906.00 95,854,800	1.71
日本	株式	三井化学 〔化学〕	314,000	261.12 81,991,680	297.00 93,258,000	1.67
日本	株式	ファナック 〔電気機器〕	6,900	9,688.66 66,851,754	12,920.00 89,148,000	1.59
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ 〔銀行業〕	534,100	135.02 72,114,182	162.00 86,524,200	1.55
日本	株式	住生活グループ 〔金属製品〕	44,600	1,700.36 75,836,056	1,850.00 82,510,000	1.47
日本	株式	パイオニア 〔電気機器〕	213,300	301.25 64,256,625	367.00 78,281,100	1.40
日本	株式	タカタ 〔輸送用機器〕	28,500	2,015.05 57,428,925	2,546.00 72,561,000	1.30
日本	株式	中部電力 〔電気・ガス業〕	35,000	2,020.01 70,700,350	2,000.00 70,000,000	1.25
日本	株式	日東電工 〔化学〕	16,500	3,232.44 53,335,260	4,135.00 68,227,500	1.22
日本	株式	ＪＸホールディングス 〔石油・石炭製品〕	123,600	472.78 58,435,608	551.00 68,103,600	1.22

日本	株式	日立化成工業 〔化学〕	35,200	1,644.02 57,869,543	1,862.00 65,542,400	1.17
日本	株式	村田製作所 〔電気機器〕	10,300	4,300.63 44,296,489	6,240.00 64,272,000	1.15
日本	株式	千葉銀行 〔銀行業〕	123,000	539.41 66,347,430	517.00 63,591,000	1.14
日本	株式	アマダ 〔機械〕	88,000	630.14 55,452,320	721.00 63,448,000	1.13
日本	株式	日本たばこ産業 〔食料品〕	198	316,378.17 62,642,878	314,000.00 62,172,000	1.11
日本	株式	中央三井トラスト・ホールディングス 〔銀行業〕	179,000	320.61 57,389,190	337.00 60,323,000	1.08
日本	株式	日揮 〔建設業〕	30,000	1,558.15 46,744,500	2,010.00 60,300,000	1.08

〔ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”〕

投資有価証券の主要銘柄

主要投資銘柄

平成23年１月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価／金額 （円）	評価額 単価／金額 （円）	投資比率 （%）
日本	親投資信託 受益証券	国内債券 マザーファンド（Ｅ号）	20,448,461,393	1.1111 22,720,285,454	1.1203 22,908,411,298	100.04

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”」は「国内債券マザーファンド（Ｅ号）」受益証券を主要投資対象としており、「国内債券マザーファンド（Ｅ号）」の投資有価証券の上位30銘柄は以下の通りです。

＜国内債券マザーファンド（Ｅ号）　平成23年１月28日現在の上位30銘柄＞

国／地域	種類	銘柄名	額面金額 （円）	帳簿価額 単価／金額 （円）	評価額 単価／金額 （円）	利率(%)／ 償還期限	投資比率 （%）
日本	国債証券	第269回利付国債（10年）	2,000,000,000	103.92 2,078,540,000	103.61 2,072,220,000	1.3 2015/3/20	9.05
日本	国債証券	第264回利付国債（10年）	1,360,000,000	104.08 1,415,535,600	104.12 1,416,059,200	1.5 2014/9/20	6.18
日本	国債証券	第287回利付国債（10年）	1,130,000,000	107.57 1,215,575,300	107.65 1,216,501,500	1.9 2017/6/20	5.31
日本	国債証券	第121回利付国債（20年）	1,230,000,000	97.19 1,195,535,700	98.72 1,214,366,700	1.9 2030/9/20	5.30
日本	国債証券	第295回利付国債（10年）	1,120,000,000	104.81 1,173,931,500	104.65 1,172,169,600	1.5 2018/6/20	5.12
日本	国債証券	第297回利付国債（10年）	990,000,000	103.28 1,022,472,000	103.56 1,025,283,600	1.4 2018/12/20	4.48
日本	国債証券	第256回利付国債（10年）	920,000,000	104.06 957,370,400	103.25 949,973,600	1.4 2013/12/20	4.15
日本	国債証券	第274回利付国債（10年）	780,000,000	105.39 822,065,400	104.93 818,516,400	1.5 2015/12/20	3.57

日本	国債証券	第111回利付国債（20年）	710,000,000	104.55 742,312,800	104.08 739,010,600	2.2 2029/6/20	3.23
日本	国債証券	第292回利付国債（10年）	680,000,000	106.29 722,785,600	106.21 722,228,000	1.7 2018/3/20	3.15
日本	国債証券	第301回利付国債（10年）	650,000,000	104.00 676,029,000	103.94 675,642,500	1.5 2019/6/20	2.95
日本	国債証券	第270回利付国債（10年）	650,000,000	104.67 680,394,000	103.76 674,440,000	1.3 2015/6/20	2.94
日本	国債証券	第303回利付国債（10年）	510,000,000	102.36 522,036,000	102.93 524,953,200	1.4 2019/9/20	2.29
日本	国債証券	第20回利付国債（30年）	397,000,000	107.94 428,557,530	108.16 429,399,170	2.5 2035/9/20	1.87
日本	国債証券	第306回利付国債（10年）	360,000,000	101.97 367,092,000	102.44 368,802,000	1.4 2020/3/20	1.61
日本	国債証券	第282回利付国債（10年）	340,000,000	107.64 366,005,200	106.28 361,352,000	1.7 2016/9/20	1.58
日本	国債証券	第84回利付国債（20年）	340,000,000	103.05 350,397,200	103.99 353,579,600	2 2025/12/20	1.54
日本	国債証券	第105回利付国債（20年）	340,000,000	102.50 348,527,200	102.91 349,904,200	2.1 2028/9/20	1.53
日本	国債証券	第296回利付国債（10年）	330,000,000	106.05 349,990,700	104.47 344,751,000	1.5 2018/9/20	1.50
日本	国債証券	第92回利付国債（20年）	320,000,000	103.62 331,612,800	104.34 333,916,800	2.1 2026/12/20	1.46
日本	社債券	第519回東京電力社債	300,000,000	105.44 316,347,000	104.90 314,709,000	1.59 2015/12/28	1.37
日本	社債券	第339回中国電力社債	300,000,000	101.28 303,852,000	101.14 303,423,000	0.79 2015/5/25	1.32
日本	国債証券	第104回利付国債（20年）	280,000,000	102.68 287,529,200	103.08 288,635,200	2.1 2028/6/20	1.26
日本	国債証券	第248回利付国債（10年）	270,000,000	101.39 273,753,000	101.05 272,856,600	0.7 2013/3/20	1.19

日本	国債証券	第90回利付国債（20年）	240,000,000	105.24 252,583,200	105.91 254,188,800	2.2 2026/9/20	1.11
日本	国債証券	第47回変動利付国債（15年）	250,000,000	101.80 254,500,000	100.90 252,250,000	0.52 2022/11/20	1.10
日本	社債券	第20回三井住友銀行無担保社債	200,000,000	106.34 212,684,000	106.42 212,846,000	2.21 2019/7/24	0.93
日本	特殊債券	第3回阪神高速道路社債	200,000,000	102.62 205,242,000	102.13 204,260,000	1.15 2013/12/20	0.89
日本	社債券	第13回野村ホールディングス無担保社債	200,000,000	102.38 204,770,000	101.86 203,720,000	1.72 2012/6/15	0.89
日本	特殊債券	第112号商工債（3年）	200,000,000	101.09 202,180,000	100.78 201,566,000	0.85 2012/5/25	0.88

〔ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”〕

投資有価証券の主要銘柄

主要投資銘柄

平成23年１月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価／金額（円）	評価額 単価／金額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	ドイチェ外国株式マザーファンドＡ号	6,439,019,889	0.7479 4,815,742,975	0.8552 5,506,649,809	99.06

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”」は「ドイチェ外国株式マザーファンドＡ号」受益証券を主要投資対象としており、「ドイチェ外国株式マザーファンドＡ号」の投資有価証券の上位30銘柄は以下の通りです。

＜ドイチェ外国株式マザーファンドＡ号 平成23年１月31日現在の上位30銘柄＞

国／地域	種類	銘柄名／業種	数量（株）	帳簿価額 単価／金額（円）	評価額 単価／金額（円）	投資比率（%）
オランダ	株式	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE 〔資本財〕	113,100	2,106.23 238,214,677	2,416.91 273,353,035	4.96
アメリカ	株式	HJ HEINZ CO 〔食品・飲料・タバコ〕	67,700	3,972.21 268,918,950	3,911.03 264,776,771	4.81
香港	株式	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD 〔銀行〕	900,000	212.69 191,427,480	266.13 239,521,500	4.35
アメリカ	株式	SEI INVESTMENTS COMPANY 〔各種金融〕	120,300	1,957.48 235,486,022	1,869.27 224,874,239	4.08
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〕	8,100	20,333.74 164,703,337	27,599.78 223,558,270	4.06
アメリカ	株式	PFIZER INC 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	146,000	1,283.69 187,419,017	1,490.65 217,636,287	3.95
アメリカ	株式	DANAHER CORP 〔資本財〕	54,500	3,257.27 177,521,531	3,782.08 206,123,714	3.74
アメリカ	株式	WILLIAMS COS INC 〔エネルギー〕	90,500	1,601.53 144,938,917	2,184.65 197,711,549	3.59

アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A 〔ソフトウェア・サービス〕	4,000	40,075.33 160,301,334	49,359.30 197,437,234	3.59
アメリカ	株式	AUTOZONE INC 〔小売〕	9,400	20,109.94 189,033,479	20,619.55 193,823,843	3.52
アメリカ	株式	WISCONSIN ENERGY CORP 〔公益事業〕	38,600	4,851.87 187,282,422	4,930.26 190,308,186	3.46
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS 〔エネルギー〕	59,400	2,237.54 132,910,351	2,837.26 168,533,416	3.06
ノルウェー	株式	TELENOR ASA 〔電気通信サービス〕	134,200	1,161.41 155,862,161	1,240.80 166,515,360	3.02
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC. 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	58,300	2,682.36 156,381,926	2,716.03 158,345,079	2.88
アメリカ	株式	COMPUTER SCIENCES CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	30,600	3,998.08 122,341,505	4,307.71 131,816,186	2.39
スイス	株式	CREDIT SUISSE GROUP AG 〔各種金融〕	34,200	3,967.67 135,694,491	3,744.34 128,056,455	2.33
スペイン	株式	BANCO SANTANDER SA 〔銀行〕	127,700	1,040.20 132,834,204	990.65 126,506,050	2.30
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO 〔家庭用品・パーソナル用品〕	22,900	5,075.63 116,232,018	5,272.74 120,745,883	2.19
アメリカ	株式	OWENS-ILLINOIS INC 〔素材〕	46,900	2,385.87 111,897,607	2,426.12 113,785,037	2.07
ドイツ	株式	SAP AG 〔ソフトウェア・サービス〕	22,600	4,164.42 94,115,913	4,692.08 106,041,107	1.93
フランス	株式	VINCI SA 〔資本財〕	21,700	4,013.49 87,092,854	4,743.42 102,932,322	1.87
スウェーデン	株式	TELIASONERA AB 〔電気通信サービス〕	152,500	675.14 102,959,766	666.93 101,707,740	1.85
ノルウェー	株式	DNB NOR ASA 〔銀行〕	87,000	1,120.78 97,508,647	1,096.27 95,375,925	1.73
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A UK 〔エネルギー〕	32,200	2,326.00 74,897,496	2,865.23 92,260,478	1.68

ドイツ	株式	LANXESS AG 〔素材〕	14,900	6,234.53 92,894,565	5,981.17 89,119,580	1.62
アメリカ	株式	BLACKROCK INC 〔各種金融〕	5,500	12,946.97 71,208,352	15,956.21 87,759,190	1.59
アメリカ	株式	STARWOOD HOTELS & RESORTS 〔消費者サービス〕	17,800	5,031.28 89,556,851	4,799.67 85,434,254	1.55
カナダ	株式	ENBRIDGE INC 〔エネルギー〕	18,100	4,494.95 81,358,602	4,699.75 85,065,482	1.54
フランス	株式	BNP PARIBAS 〔銀行〕	13,067	5,235.62 68,413,913	6,147.47 80,329,105	1.46
スペイン	株式	TELEFONICA S.A 〔電気通信サービス〕	35,500	1,997.81 70,922,574	2,040.23 72,428,193	1.32

注１　投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の評価額の比率をいいます。

注２　評価金額（円）については、平成23年１月31日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算しております。

〔ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”〕

投資有価証券の主要銘柄

主要投資銘柄

平成23年１月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価／金額 （円）	評価額 単価／金額 （円）	投資比率 （%）
日本	親投資信託受益証券	ベアリングジャパン外国債券マザーファンド	3,689,142,213	1.5647 5,772,601,083	1.4984 5,527,810,691	100.09

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”」は「ベアリング ジャパン 外国債券 マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、「ベアリング ジャパン 外国債券 マザーファンド」の投資有価証券の主要銘柄上位30銘柄は以下の通りです。

＜ベアリング ジャパン 外国債券 マザーファンド 平成23年１月31日現在の上位30銘柄＞

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価／金額 （円）	評価額 単価／金額 （円）	利率(%）／償還期限	投資比率 （%）
フランス	国債証券	FRTRD 0 10/25/15	112,486,000	10,028.15 11,280,274,370	9,733.75 10,949,116,725	― 2015/10/25	7.22
ドイツ	国債証券	DBR 4 01/04/18	84,439,000	12,494.73 10,550,433,086	11,973.52 10,110,321,228	4 2018/1/4	6.66
オーストラリア	国債証券	ACGB 4 1/2 04/20	129,799,000	7,608.21 9,875,389,190	7,560.66 9,813,668,342	4.5 2020/4/15	6.47
ドイツ	国債証券	DBRR 0 01/04/15	96,925,000	10,320.88 10,003,522,607	10,017.29 9,709,258,490	― 2015/1/4	6.40
アメリカ	国債証券	SP 02/15/19	144,404,000	6,308.18 9,109,269,145	6,305.93 9,106,015,470	― 2019/2/15	6.00
フランス	国債証券	FRTRD 0 10/25/17	89,213,000	9,244.65 8,247,435,224	8,860.64 7,904,849,591	― 2017/10/25	5.21
アメリカ	国債証券	SP 0 05/15/16	108,619,100	7,067.93 7,677,126,209	7,169.67 7,787,633,026	― 2016/5/15	5.13

オーストラリア	国債証券	ACGB 6 1/4 04/15	87,097,000	8,570.16 7,464,355,042	8,449.86 7,359,582,228	6.25 2015/4/15	4.85
カナダ	国債証券	CANRDC0 06/01/14	79,978,000	7,424.40 5,937,894,309	7,492.72 5,992,532,314	― 2014/6/1	3.95
カナダ	国債証券	CAN 4 1/4 06/01/18	65,474,000	8,822.78 5,776,629,596	8,866.20 5,805,056,835	4.25 2018/6/1	3.83
アメリカ	国債証券	SP 05/15/18	80,543,000	6,469.56 5,210,781,650	6,501.88 5,236,811,644	― 2018/5/15	3.45
ドイツ	国債証券	DBR 4 1/4 01/04/14	38,988,000	12,362.84 4,820,027,719	11,951.19 4,659,533,388	4.25 2014/1/4	3.07
オーストラリア	国債証券	ACGB 6 02/15/17	51,002,000	8,514.07 4,342,351,081	8,389.72 4,278,925,810	6 2017/2/15	2.82
カナダ	国債証券	CAN3 3/4 06/01/19	47,900,000	8,504.93 4,073,863,577	8,543.43 4,092,306,227	3.75 2019/6/1	2.70
フランス	国債証券	FRTR 3 3/4 04/25/21	34,349,000	11,925.52 4,096,299,784	11,331.76 3,892,347,375	3.75 2021/4/25	2.57
カナダ	国債証券	CANRDC0 06/01/37	122,283,000	2,960.27 3,619,913,166	2,895.22 3,540,368,709	― 2037/6/1	2.33
イギリス	国債証券	UKT5 03/07/25	22,868,000	14,358.03 3,283,395,055	14,237.04 3,255,728,502	5 2025/3/7	2.15
イギリス	国債証券	UKT4 3/4 03/07/20	21,900,000	14,218.83 3,113,925,303	14,103.31 3,088,626,440	4.75 2020/3/7	2.04
ポーランド	国債証券	POLGB 6 1/4 10/15	104,133,000	2,939.05 3,060,530,516	2,876.82 2,995,724,802	6.25 2015/10/24	1.97
アメリカ	国債証券	SP 0 05/15/30	90,014,000	3,558.85 3,203,465,841	3,216.38 2,895,201,031	― 2030/5/15	1.91
イギリス	国債証券	UKTR 0 09/07/16	23,315,000	10,945.64 2,551,976,551	10,861.29 2,532,309,789	― 2016/9/7	1.67
ドイツ	国債証券	DBR4 1/4 07/04/39	18,351,000	12,973.54 2,380,775,499	12,390.94 2,273,861,803	4.25 2039/7/4	1.50
アメリカ	国債証券	T 4 1/4 05/15/39	28,584,000	8,393.68 2,399,251,206	7,867.79 2,248,931,192	4.25 2039/5/15	1.48

アメリカ	**国債証券**	SP 0 05/15/37	89,291,000	2,636.01 2,353,728,475	2,227.67 1,989,109,033	― 2037/5/15	1.31
カナダ	**国債証券**	CAN4 1/2 06/01/15	21,948,000	8,914.53 1,956,562,010	8,911.25 1,955,842,818	4.5 2015/6/1	1.29
アメリカ	**国債証券**	T 4 1/2 02/15/36	23,164,000	8,796.89 2,037,712,286	8,292.56 1,920,889,394	4.5 2036/2/15	1.27
イギリス	**国債証券**	UKTR 0 09/07/15	15,462,000	11,455.59 1,771,264,146	11,371.10 1,758,200,433	― 2015/9/7	1.16
イギリス	**国債証券**	UKTR 0 03/07/36	42,841,000	4,229.70 1,812,049,795	3,817.43 1,635,425,376	― 2036/3/7	1.08
ドイツ	**国債証券**	DBR 3 1/2 07/04/19	13,828,000	12,033.79 1,664,032,508	11,520.38 1,593,038,727	3.5 2019/7/4	1.05
アメリカ	**国債証券**	T 2 5/8 08/15/20	19,600,000	8,165.19 1,600,378,764	7,780.53 1,524,985,109	2.625 2020/8/15	1.00

注１　投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の評価額の比率をいいます。

注２　評価金額（円）については、平成23年１月31日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算しております。

〔参考情報〕

基準日2011年1月31日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,265円
純資産総額	47億円

※基準価額、基準価額(再投資ベース)は、1万口当たり、信託報酬控除後です。
※基準価額(再投資ベース)は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算した価額です。

分配の推移

決算期	分配金
2010年6月	0円
2009年6月	0円
2008年6月	200円
2007年6月	200円
2006年6月	200円
設定来累計	1,000円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

年間収益率の推移（暦年ベース）

ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。
2011年のファンドの収益率は、年初から2011年1月31日までの騰落率を表示しています。
ファンドにはベンチマークはありません。

第３【ファンドの経理状況】

＜訂正前＞

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」（以下「財務諸表等規則」といいます）（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第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」（以下「投資信託財産計算規則」といいます）（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

また、第８期（平成20年６月27日から平成21年６月26日まで）については、改正前の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づき、第９期（平成21年６月27日から平成22年６月28日まで）については、改正後の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則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８期（平成20年６月27日から平成21年６月26日まで）の財務諸表については、あずさ監査法人により監査を受け、第９期（平成21年６月27日から平成22年６月28日まで）の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年７月１日をもって有限責任 あずさ監査法人となっております。

＜訂正後＞

１．当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（以下「財務諸表等規則」といいます）（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第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」（以下「投資信託財産計算規則」といいます）（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

また、第８期（平成20年６月27日から平成21年６月26日まで）については、改正前の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づき、第９期（平成21年６月27日から平成22年６月28日まで）については、改正後の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則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８期（平成20年６月27日から平成21年６月26日まで）の財務諸表については、あずさ監査法人により監査を受け、第９期（平成21年６月27日から平成22年６月28日まで）の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年７月１日をもって有限責任 あずさ監査法人となっております。

３．当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（以下「中間財務諸表等規則」といいます）（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条の３、第57条の２の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（以下「投資信託財産計算規則」といいます）（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

また、第９期中間計算期間（平成21年６月27日から平成21年12月26日まで）については、改正前の中間財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づき、第10期中間計算期間（平成22年６月29日から平成22年12月28日まで）については、改正後の中間財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

４．当ファンドは、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第９期中間計算期間（平成21年６月27日から平成21年12月26日まで）の中間財務諸表については、あずさ監査法人により中間監査を受け、第10期中間計算期間（平成22年６月29日から平成22年12月28日まで）の中間財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年７月１日をもって有限責任 あずさ監査法人となっております。

１【財務諸表】

［追加］

原届出書「第二部 ファンド情報 第３ ファンドの経理状況 １ 財務諸表」に中間財務諸表が追加されます。

中間財務諸表

【三井住友・ワールド・パッケージ・オープン】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第９期中間計算期間 (平成21年12月26日現在)	第10期中間計算期間 (平成22年12月28日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	511,825	429,326
コール・ローン	32,015,830	20,731,681
投資信託受益証券	5,498,063,114	4,697,908,600
未収入金	7,400,000	4,850,000
未収利息	86	28
流動資産合計	5,537,990,855	4,723,919,635
資産合計	5,537,990,855	4,723,919,635
負債の部		
流動負債		
未払解約金	18,193,406	9,411,241
未払受託者報酬	586,181	504,244
未払委託者報酬	14,507,861	12,479,942
その他未払費用	87,866	75,567
流動負債合計	33,375,314	22,470,994
負債合計	33,375,314	22,470,994
純資産の部		
元本等		
元本	6,048,361,507	5,112,019,895
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△543,745,966	△410,571,254
元本等合計	5,504,615,541	4,701,448,641
純資産合計	5,504,615,541	4,701,448,641
負債純資産合計	5,537,990,855	4,723,919,635

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第９期中間計算期間 自 平成21年６月27日 至 平成21年12月26日	第10期中間計算期間 自 平成22年６月29日 至 平成22年12月28日
営業収益		
受取利息	14,242	11,662
有価証券売買等損益	288,608,404	192,899,504
営業収益合計	288,622,646	192,911,166
営業費用		
受託者報酬	586,181	504,244
委託者報酬	14,507,861	12,479,942
その他費用	87,866	75,567
営業費用合計	15,181,908	13,059,753
営業利益	273,440,738	179,851,413
経常利益	273,440,738	179,851,413
中間純利益	273,440,738	179,851,413
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	10,068,939	3,934,293
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△852,113,352	△644,732,370
剰余金増加額又は欠損金減少額	55,614,321	66,640,841
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	55,614,321	66,640,841
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,618,734	8,396,845
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,618,734	8,396,845
分配金	―	―
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△543,745,966	△410,571,254

（３）【中間注記表】

（中間財務諸表作成の基本となる重要な事項に関する注記）

項 目	第９期中間計算期間 自 平成21年６月27日 至 平成21年12月26日	第10期中間計算期間 自 平成22年６月29日 至 平成22年12月28日
１．資産の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。なお、「ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”」および「ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”」投資信託受益証券については前営業日の基準価額で評価し、「ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”」および「ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”」投資信託受益証券については、当日の基準価額で評価しております。	投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同 左
２．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	――――――――	計算期間の取扱い 当中間計算期間は前期末が休日のため、平成22年６月29日から平成22年12月28日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項 目	第９期中間計算期間 （平成21年12月26日現在）	第10期中間計算期間 （平成22年12月28日現在）
１．受益権総数	当中間計算期間の末日における受益権の総数 6,048,361,507口	当中間計算期間の末日における受益権の総数 5,112,019,895口
２．元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の６第10号に規定する額 543,745,966円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の６第10号に規定する額 410,571,254円
３．１単位当たり純資産額	0.9101円 （１万口＝9,101円）	0.9197円 （１万口＝9,197円）

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

前計算期間末より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年３月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年３月10日）を適用しております。

金融商品の時価等に関する事項

項 目	第10期中間計算期間 自 平成22年６月29日 至 平成22年12月28日
１．中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．時価の算定方法	（1）有価証券（投資信託受益証券） 「中間財務諸表作成の基本となる重要な事項に関する注記」に記載しております。 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 該当事項はありません。 （3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

第９期中間計算期間（自 平成21年６月27日 至 平成21年12月26日）

該当事項はありません。

第10期中間計算期間（平成22年12月28日現在）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第９期中間計算期間 （平成21年12月26日現在）	第10期中間計算期間 （平成22年12月28日現在）
期首元本額	6,364,157,505円	5,609,505,480円
期中追加設定元本額	95,249,077円	73,562,771円
期中一部解約元本額	411,045,075円	571,048,356円

（参考）

当ファンドは、「ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”」、「ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”」、「ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”」および「ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”」投資信託受益証券を主要対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、これらの投資信託の受益証券です。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外です。

「ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”」の状況

ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”

（１）貸借対照表

対象年月日	（平成21年12月24日現在）	（平成22年12月27日現在）
科 目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
Ⅰ 流動資産		
コール・ローン	3,201	3,201
親投資信託受益証券	7,210,781,042	5,635,335,195
未収入金	18,799,998	33,979,998
流動資産合計	7,229,584,241	5,669,318,394
資産合計	7,229,584,241	5,669,318,394
負債の部		
Ⅰ 流動負債		
未払解約金	18,799,998	33,979,998
未払受託者報酬	347,521	313,375
未払委託者報酬	2,953,922	2,663,683
流動負債合計	22,101,441	36,957,056
負債合計	22,101,441	36,957,056
純資産の部		
Ⅰ 元本等		
１ 元本		
元本	10,548,199,081	8,189,610,081

２ 剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	△3,340,716,281	△2,557,248,743
元本等合計	7,207,482,800	5,632,361,338
純資産合計	7,207,482,800	5,632,361,338
負債・純資産合計	7,229,584,241	5,669,318,394

（注）「ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”」は、毎年５月25日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年12月24日ならびに平成22年12月27日現在における同ファンドの状況です。

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	自 平成21年５月26日 至 平成21年12月24日	自 平成22年５月26日 至 平成22年12月27日
資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券(売買目的有価証券) 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券(売買目的有価証券) 同 左

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成21年12月24日現在）	（平成22年12月27日現在）
１．受益権総数	平成21年12月24日現在における受益権の総数 10,548,199,081口	平成22年12月27日現在における受益権の総数 8,189,610,081口
２．元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の６第10号に規定する額 3,340,716,281円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の６第10号に規定する額 2,557,248,743円
３．１単位当たり純資産額	0.6833円 （１万口＝6,833円）	0.6877円 （１万口＝6,877円）

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年３月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年３月10日）を適用しております。

金融商品の時価等に関する事項

項 目	自 平成22年５月26日 至 平成22年12月27日
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、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	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。

	（3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 **これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。**

（デリバティブ取引に関する注記）

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年12月24日現在）

平成21年12月24日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成22年12月27日現在）

平成22年12月27日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（その他の注記）

（平成21年12月24日現在）	
期　　首	平成21年５月26日
期首元本額	10,199,775,494円
期首より平成21年12月24日現在までの追加設定元本額	1,345,181,687円
期首より平成21年12月24日現在までの一部解約元本額	996,758,100円

（平成22年12月27日現在）	
期　　首	平成22年５月26日
期首元本額	9,104,958,867円
期首より平成22年12月27日現在までの追加設定元本額	532,376,795円
期首より平成22年12月27日現在までの一部解約元本額	1,447,725,581円

（参考情報）

ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”は、「国内株式マザーファンド（Ｅ号）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券です。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外です。

「国内株式マザーファンド（Ｅ号）」の状況

（１）貸借対照表

対象年月日	（平成21年12月24日現在）	（平成22年12月27日現在）
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
Ⅰ 流動資産		
コール・ローン	46,405,454	13,570,737
株式	7,145,915,080	5,594,742,600
未収入金	95,304,366	117,382,585
未収配当金	605,100	674,700
未収利息	63	18
流動資産合計	7,288,230,063	5,726,370,640
資産合計	7,288,230,063	5,726,370,640
負債の部		
Ⅰ 流動負債		
未払金	58,584,456	56,877,514
未払解約金	18,799,998	33,979,998
流動負債合計	77,384,454	90,857,512
負債合計	77,384,454	90,857,512
純資産の部		
Ⅰ 元本等		
１ 元本		
元本	10,017,756,380	7,730,226,605
２ 剰余金		

剰余金又は欠損金（△）	△2,806,910,771	△2,094,713,477
元本等合計	7,210,845,609	5,635,513,128
純資産合計	7,210,845,609	5,635,513,128
負債・純資産合計	7,288,230,063	5,726,370,640

（注）「国内株式マザーファンド（Ｅ号）」は、毎年５月25日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年12月24日ならびに平成22年12月27日現在における同マザーファンドの状況です。

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	自 平成21年５月26日 至 平成21年12月24日	自 平成22年５月26日 至 平成22年12月27日
１．資産の評価基準及び評価方法	株式（売買目的有価証券） 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、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）また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。	株式（売買目的有価証券） 同 左
２．収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。	受取配当金の計上基準 同 左

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成21年12月24日現在）	（平成22年12月27日現在）
１．受益権総数	平成21年12月24日現在における受益権の総数 10,017,756,380口	平成22年12月27日現在における受益権の総数 7,730,226,605口
２．元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の６第10号に規定する額 2,806,910,771円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の６第10号に規定する額 2,094,713,477円
３．１単位当たり純資産額	0.7198円 （１万口＝7,198円）	0.7290円 （１万口＝7,290円）

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年３月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年３月10日）を適用しております。

金融商品の時価等に関する事項

項 目	自 平成22年５月26日 至 平成22年12月27日
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、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	**（1）有価証券（株式）** **「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。** **（2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引）** **デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。** **（3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等** **これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。**

（デリバティブ取引に関する注記）

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年12月24日現在）

平成21年12月24日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成22年12月27日現在）

平成22年12月27日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（その他の注記）

（平成21年12月24日現在）	
期　首	平成21年５月26日
期首元本額	9,747,045,583円
期首より平成21年12月24日現在までの追加設定元本額	1,278,324,355円
期首より平成21年12月24日現在までの一部解約元本額	1,007,613,558円
平成21年12月24日現在における元本の内訳	
ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”	10,017,756,380円
合 計	10,017,756,380円

（平成22年12月27日現在）	
期　首	平成22年５月26日
期首元本額	8,648,531,840円
期首より平成22年12月27日現在までの追加設定元本額	503,364,305円
期首より平成22年12月27日現在までの一部解約元本額	1,421,669,540円
平成22年12月27日現在における元本の内訳	
ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”	7,730,226,605円
合 計	7,730,226,605円

「ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“ フルート ”」の状況

ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“ フルート ”

（１）貸借対照表

対象年月日	（平成21年12月24日現在）	（平成22年12月27日現在）
科 目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
Ⅰ 流動資産		
コール・ローン	30,385	30,385
親投資信託受益証券	26,699,811,405	23,134,691,986
未収入金	―	3,140,000
流動資産合計	26,699,841,790	23,137,862,371
資産合計	26,699,841,790	23,137,862,371
負債の部		
Ⅰ 流動負債		
未払解約金	―	3,140,000
未払受託者報酬	668,004	628,681
未払委託者報酬	4,676,018	4,400,764
流動負債合計	5,344,022	8,169,445
負債合計	5,344,022	8,169,445
純資産の部		
Ⅰ 元本等		
１ 元本		
元本	24,869,274,636	21,123,295,669
２ 剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	1,825,223,132	2,006,397,257
元本等合計	26,694,497,768	23,129,692,926
純資産合計	26,694,497,768	23,129,692,926
負債・純資産合計	26,699,841,790	23,137,862,371

（注）「ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“ フルート ”」は、毎年５月25日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に

決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年12月24日ならびに平成22年12月27日現在における同ファンドの状況です。

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	自 平成21年５月26日 至 平成21年12月24日	自 平成22年５月26日 至 平成22年12月27日
資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券(売買目的有価証券) 同 左

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成21年12月24日現在）	（平成22年12月27日現在）
１．受益権総数	平成21年12月24日現在における受益権の総数 24,869,274,636口	平成22年12月27日現在における受益権の総数 21,123,295,669口
２．１単位当たり純資産額	1.0734円 （１万口＝10,734円）	1.0950円 （１万口＝10,950円）

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年３月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年３月10日）を適用しております。

金融商品の時価等に関する事項

項 目	自 平成22年５月26日 至 平成22年12月27日
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、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	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年12月24日現在）
平成21年12月24日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成22年12月27日現在）
平成22年12月27日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（その他の注記）

（平成21年12月24日現在）	
期　　首	平成21年５月26日
期首元本額	25,029,322,913円
期首より平成21年12月24日現在までの追加設定元本額	2,039,445,751円
期首より平成21年12月24日現在までの一部解約元本額	2,199,494,028円

（平成22年12月27日現在）	
期　　首	平成22年５月26日
期首元本額	23,676,655,650円
期首より平成22年12月27日現在までの追加設定元本額	430,980,971円
期首より平成22年12月27日現在までの一部解約元本額	2,984,340,952円

（参考情報）

ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”は、「国内債券マザーファンド（Ｅ号）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券です。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外です。

「国内債券マザーファンド（Ｅ号）」の状況

（１）貸借対照表

対象年月日	（平成21年12月24日現在）	（平成22年12月27日現在）
科 目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
Ⅰ 流動資産		
コール・ローン	299,626,354	476,350,977
国債証券	19,543,127,290	17,122,261,920
地方債証券	485,889,044	257,139,366
特殊債券	2,050,277,244	1,877,761,865
社債券	4,270,933,000	3,603,787,000
未収利息	48,884,395	39,288,656
前払費用	1,850,135	15,329,801
流動資産合計	26,700,587,462	23,391,919,585
資産合計	26,700,587,462	23,391,919,585
負債の部		
Ⅰ 流動負債		
未払金	－	253,860,000
未払解約金	－	3,140,000
流動負債合計	－	257,000,000
負債合計	－	257,000,000
純資産の部		
Ⅰ 元本等		
１ 元本		

元本	24,352,254,109	20,632,027,099
２ 剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	2,348,333,353	2,502,892,486
元本等合計	26,700,587,462	23,134,919,585
純資産合計	26,700,587,462	23,134,919,585
負債・純資産合計	26,700,587,462	23,391,919,585

（注）「国内債券マザーファンド（Ｅ号）」は、毎年５月25日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年12月24日ならびに平成22年12月27日現在における同マザーファンドの状況です。

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	自 平成21年５月26日 至 平成21年12月24日	自 平成22年５月26日 至 平成22年12月27日
資産の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券（売買目的有価証券） 同 左

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成21年12月24日現在）	（平成22年12月27日現在）
１．受益権総数	平成21年12月24日現在における受益権の総数 24,352,254,109口	平成22年12月27日現在における受益権の総数 20,632,027,099口
２．１単位当たり純資産額	1.0964円 （１万口＝10,964円）	1.1213円 （１万口＝11,213円）

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年３月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年３月10日）を適用しております。

金融商品の時価等に関する事項

項 目	自 平成22年５月26日 至 平成22年12月27日
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、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	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。

	（3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 **これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。**

（デリバティブ取引に関する注記）
デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年12月24日現在）
平成21年12月24日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成22年12月27日現在）
平成22年12月27日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（その他の注記）

（平成21年12月24日現在）	
期　　首	平成21年５月26日
期首元本額	24,569,238,541円
期首より平成21年12月24日現在までの追加設定元本額	1,998,182,112円
期首より平成21年12月24日現在までの一部解約元本額	2,215,166,544円
平成21年12月24日現在における元本の内訳	
ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”	24,352,254,109円
合 計	24,352,254,109円

（平成22年12月27日現在）	
期　　首	平成22年５月26日
期首元本額	23,185,682,827円
期首より平成22年12月27日現在までの追加設定元本額	420,915,039円
期首より平成22年12月27日現在までの一部解約元本額	2,974,570,767円
平成22年12月27日現在における元本の内訳	
ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”	20,632,027,099円
合 計	20,632,027,099円

「ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”」の状況

ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”

（1）貸借対照表

区分	第8期計算期間 （平成21年5月25日現在）	第9期計算期間 （平成22年5月25日現在）
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	―	22,196,603
親投資信託受益証券	6,654,055,063	5,926,193,651
派生商品評価勘定	183,870,320	190,886,526
未収入金	21,085,226	―
未収利息	―	42
流動資産合計	6,859,010,609	6,139,276,822
資産合計	6,859,010,609	6,139,276,822
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	200,628,865	89,974,091
未払受託者報酬	2,296,145	2,419,625
未払委託者報酬	18,369,081	19,356,978
その他未払費用	420,000	420,000
流動負債合計	221,714,091	112,170,694
負債合計	221,714,091	112,170,694
純資産の部		
元本等		
元本	10,263,092,525	8,171,028,828
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△3,625,796,007	△2,143,922,700

(分配準備積立金)	1,724,731,163	1,451,993,568
元本等合計	6,637,296,518	6,027,106,128
純資産合計	6,637,296,518	6,027,106,128
負債純資産合計	6,859,010,609	6,139,276,822

（2）損益及び剰余金計算書

区分	第8期計算期間 (自 平成20年5月27日 至 平成21年5月25日)	第9期計算期間 (自 平成21年5月26日 至 平成22年5月25日)
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	9	106
有価証券売買等損益	△4,398,644,550	516,190,302
為替差損益	816,269,074	516,341,504
営業収益合計	△3,582,375,467	1,032,531,912
営業費用		
受託者報酬	5,345,895	5,003,810
委託者報酬	42,767,009	40,030,366
その他費用	940,800	949,200
営業費用合計	49,053,704	45,983,376
営業利益又は営業損失（△）	△3,631,429,171	986,548,536
経常利益又は経常損失（△）	△3,631,429,171	986,548,536
当期純利益又は当期純損失（△）	△3,631,429,171	986,548,536
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（△）	△289,771,497	266,079,376
期首剰余金又は期首欠損金（△）	282,641,878	△3,625,796,007
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,251,761	850,608,321
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	12,251,761	850,608,321
剰余金減少額又は欠損金増加額	579,031,972	89,204,174
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	579,031,972	89,204,174
分配金	―	―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△3,625,796,007	△2,143,922,700

（３）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第8期計算期間 (自 平成20年5月27日 至 平成21年5月25日)	第9期計算期間 (自 平成21年5月26日 至 平成22年5月25日)
1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約の評価は、個別法に基づき、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物相場の仲値によって計算しております。ただし、為替予約のうち対顧客先物相場が発表されていない通貨については、対顧客相場の仲値によって計算しております。	同左

（貸借対照表に関する注記）

項目	第8期計算期間 (平成21年5月25日現在)	第9期計算期間 (平成22年5月25日現在)
1.計算期間末日における受益権の総数	10,263,092,525口	8,171,028,828口
2.元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,625,796,007円です。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,143,922,700円です。
3.計算期間末日における１口当たり純資産額 (１万口当たり純資産額)	0.6467円 (6,467円)	0.7376円 (7,376円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第8期計算期間 (自 平成20年5月27日 至 平成21年5月25日)	第9期計算期間 (自 平成21年5月26日 至 平成22年5月25日)
分配金の計算方法	計算期間末における費用控除後の配当等収益（161,179,530円）、収益調整金（843,453,757円）、分配準備積立金（1,563,551,633円）より、分配対象収益は、2,568,184,920円（1万口当たり2,502円）でありますが、今期は分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（124,241,392円）、収益調整金（720,669,965円）、分配準備積立金（1,327,752,176円）より、分配対象収益は、2,172,663,533円（1万口当たり2,658円）でありますが、今期は分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	第8期計算期間 (自　平成20年5月27日 至　平成21年5月25日)	第9期計算期間 (自　平成21年5月26日 至　平成22年5月25日)
1.金融商品に対する取組方針	―	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	―	当ファンド及び主要投資対象である親投資信託が保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細は貸借対照表、注記表及び附属明細表に記載しております。当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等)、流動性リスク、信用リスク等があります。 当ファンドが行うデリバティブ取引については、外貨建金銭債権債務等の為替変動リスクを回避し、安定的な利益の確保を図る目的で利用しております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	―	委託会社では２つの検証機能を有しています。１つは運用評価会議で、ここではパフォーマンス分析及び定量的リスク分析が行われます。もう１つはインベストメント・コントロール・コミッティーで、ここでは運用部、業務部、コンプライアンス部から市場リスク、流動性リスク、信用リスク、運用ガイドライン・法令等遵守状況など様々なリスク管理状況が報告され、検証が行われます。このコミッティーで議論された内容は、取締役会から一部権限を委譲されたエグゼクティブ・コミッティーに報告され、委託会社として必要な対策を指示する体制がとられています。 運用部ではこうしたリスク管理の結果も考慮し、次の投資戦略を決定し、日々の運用業務を行っております。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期計算期間 (平成21年5月25日現在)	第9期計算期間 (平成22年5月25日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	―	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
2.時価の算定方法	―	（1）有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 （2）売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （3）デリバティブ取引 （デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	―	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等はあくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第8期計算期間(平成21年5月25日現在)

種類	貸借対照表計上額(円)	計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	6,654,055,063	△3,755,709,530
合計	6,654,055,063	△3,755,709,530

第9期計算期間(平成22年5月25日現在)

種類	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	280,771,992
合計	280,771,992

（デリバティブ取引に関する注記）

Ⅰ 取引の状況に関する事項

項目	第8期計算期間 (自 平成20年5月27日 至 平成21年5月25日)	第9期計算期間 (自 平成21年5月26日 至 平成22年5月25日)
1.取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約であります。	―
2.取引に対する取組方針	デリバティブ取引は、将来の為替の変動によるリスク回避を目的としており、投機的な取引は行わない方針であります。	―
3.取引の利用目的	デリバティブ取引は、外貨建金銭債権債務等の為替変動リスクを回避し、安定的な利益の確保を図る目的で利用しております。	―
4.取引に係るリスクの内容	為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動によるリスクであります。	―
5.取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限及び取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用部が行っております。	―
6.取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	―

Ⅱ 取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

区分	種類	第8期計算期間(平成21年5月25日現在)			
		契約額等(円)	うち１年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	391,323,444	―	381,029,024	△10,294,420
	カナダドル	215,347,130	―	222,770,322	7,423,192
	ユーロ	156,137,569	―	158,465,175	2,327,606
	イギリスポンド	179,940,060	―	185,825,640	5,885,580
	スイスフラン	28,749,233	―	29,136,272	387,039
	スウェーデンクローナ	18,845,327	―	19,741,492	896,165
	ノルウェークローネ	17,998,295	―	18,142,488	144,193
	オーストラリアドル	20,442,958	―	21,204,748	761,790
	香港ドル	36,734,908	―	35,721,576	△1,013,332
	シンガポールドル	10,099,530	―	10,144,401	44,871
	売建				
	アメリカドル	4,210,518,539	―	4,061,354,264	149,164,275
	カナダドル	201,977,581	―	222,770,322	△20,792,741
	ユーロ	1,351,514,554	―	1,412,371,323	△60,856,769
	イギリスポンド	694,913,621	―	751,455,705	△56,542,084
	スイスフラン	207,024,491	―	213,259,388	△6,234,897
	スウェーデンクローナ	108,810,509	―	124,851,084	△16,040,575
	ノルウェークローネ	91,547,104	―	97,186,362	△5,639,258
	オーストラリアドル	134,721,718	―	154,928,849	△20,207,131
	香港ドル	409,745,445	―	394,984,037	14,761,408
	シンガポールドル	64,667,876	―	65,601,333	△933,457
	合計	8,551,059,892	―	8,580,943,805	△16,758,545

区分	種類	第9期計算期間(平成22年5月25日現在)			
		契約額等(円)	うち１年超(円)	時価(円)	評価損益(円)

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	595,431,102	―	587,897,820	△7,533,282
	カナダドル	100,294,737	―	94,910,604	△5,384,133
	ユーロ	308,400,462	―	287,782,110	△20,618,352
	イギリスポンド	133,143,309	―	126,582,237	△6,561,072
	スイスフラン	68,951,986	―	63,849,170	△5,102,816
	ノルウェークローネ	25,240,008	―	24,116,378	△1,123,630
	オーストラリアドル	17,248,589	―	15,644,630	△1,603,959
	香港ドル	20,199,452	―	19,814,025	△385,427
	シンガポールドル	31,601,446	―	30,306,484	△1,294,962
	売建				
	アメリカドル	3,785,630,873	―	3,817,861,704	△32,230,831
	カナダドル	388,376,675	―	376,932,855	11,443,820
	ユーロ	1,281,397,986	―	1,173,806,620	107,591,366
	イギリスポンド	739,819,124	―	713,094,168	26,724,956
	スイスフラン	235,588,681	―	219,863,567	15,725,114
	ノルウェークローネ	185,669,661	―	168,806,378	16,863,283
	オーストラリアドル	80,206,473	―	74,395,130	5,811,343
	香港ドル	210,908,112	―	211,991,010	△1,082,898
	シンガポールドル	129,765,838	―	130,091,923	△326,085
	合計	8,337,874,514	―	8,137,746,813	100,912,435

（注1）時価の算定方法

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。

①計算期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②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当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・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、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2. 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相場の仲値で評価しております。

（注2）デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておりません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第8期計算期間 (平成21年5月25日現在)	第9期計算期間 (平成22年5月25日現在)
元本の推移		
期首元本額	9,364,866,387円	10,263,092,525円
期中追加設定元本額	1,854,226,374円	307,436,175円
期中一部解約元本額	956,000,236円	2,399,499,872円

（4）附属明細表

①有価証券明細表

(ア)株式

該当事項はありません。

(イ)株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考

親投資信託受益証券	ドイチェ外国株式マザーファンドA号	7,939,702,105	5,926,193,651	―
合計	―	7,939,702,105	5,926,193,651	―

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

(3)注記表（デリバティブ取引に関する注記）Ⅱ　取引の時価等に関する事項で記載しております。

（参考情報）
当ファンドは「ドイチェ外国株式マザーファンドＡ号」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券です。
なお、当ファンドの計算期間末日における同親投資信託の状況は次の通りです。

「ドイチェ外国株式マザーファンドＡ号」の状況
以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

（１）貸借対照表

区分	（平成21年5月25日現在）	（平成22年5月25日現在）
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	102,650,936	8,622,279
コール・ローン	121,232,705	226,558,038
株式	6,416,943,402	5,810,604,761
未収配当金	34,489,780	27,206,107
未収利息	199	434
流動資産合計	6,675,317,022	6,072,991,619
資産合計	6,675,317,022	6,072,991,619
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	－	156,427
未払金	－	146,763,513
未払解約金	21,085,226	－
流動負債合計	21,085,226	146,919,940
負債合計	21,085,226	146,919,940
純資産の部		
元本等		
元本	9,484,114,971	7,939,702,105
剰余金		

剰余金又は欠損金（△）	△2,829,883,175	△2,013,630,426
元本等合計	6,654,231,796	5,926,071,679
純資産合計	6,654,231,796	5,926,071,679
負債純資産合計	6,675,317,022	6,072,991,619

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	(自 平成20年5月27日 至 平成21年5月25日)	(自 平成21年5月26日 至 平成22年5月25日)
1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式につきましては移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 (1)金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券等の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場)で評価しております。 計算期間の末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でないと認められた場合は、当該金融商品取引所等における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。 (2)金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、日本証券業協会の公社債店頭売買参考統計値、金融機関の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3)時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	株式につきましては移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 (1)金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左 (2)金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左 (3)時価が入手できなかった有価証券 同左
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約の評価は、個別法に基づき、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物相場の仲値によって計算しております。ただし、為替予約のうち対顧客先物相場が発表されていない通貨については、対顧客相場の仲値によって計算しております。	同左
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。	外貨建取引等の処理基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成21年5月25日現在)	(平成22年5月25日現在)
1.受益権の総数	9,484,114,971口	7,939,702,105口
2.元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,829,883,175円です。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,013,630,426円です。
3.1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7016円 (7,016円)	0.7464円 (7,464円)

(金融商品に関する注記)

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

項目	(自　平成20年5月27日 至　平成21年5月25日)	(自　平成21年5月26日 至　平成22年5月25日)
1.金融商品に対する取組方針	―	当親投資信託は証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	―	当親投資信託が保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細は貸借対照表、注記表及び附属明細表に記載しております。当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等)、流動性リスク、信用リスク等があります。 当親投資信託が行うデリバティブ取引については、外貨建金銭債権債務等の為替変動リスクを回避し、安定的な利益の確保を図る目的で利用しております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	―	委託会社では２つの検証機能を有しています。１つは運用評価会議で、ここではパフォーマンス分析及び定量的リスク分析が行われます。もう１つはインベストメント・コントロール・コミッティーで、ここでは運用部、業務部、コンプライアンス部から市場リスク、流動性リスク、信用リスク、運用ガイドライン・法令等遵守状況など様々なリスク管理状況が報告され、検証が行われます。このコミッティーで議論された内容は、取締役会から一部権限を委譲されたエグゼクティブ・コミッティーに報告され、委託会社として必要な対策を指示する体制がとられています。 運用部ではこうしたリスク管理の結果も考慮し、次の投資戦略を決定し、日々の運用業務を行っております。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成21年5月25日現在)	(平成22年5月25日現在)
1.貸借対照表計上額、時価およびその差額	―	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
2.時価の算定方法	―	（1）有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 （2）売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （3）デリバティブ取引 （デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	―	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等はあくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（平成21年5月25日現在）

種類	貸借対照表計上額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	6,416,943,402	△1,395,469,097
合計	6,416,943,402	△1,395,469,097

（平成22年5月25日現在）

種類	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	△286,769,060
合計	△286,769,060

（デリバティブ取引に関する注記）

Ⅰ 取引の状況に関する事項

項目	(自 平成20年5月27日 至 平成21年5月25日)	(自 平成21年5月26日 至 平成22年5月25日)
1.取引の内容	当親投資信託の利用しているデリバティブ取引は、為替予約であります。	―
2.取引に対する取組方針	デリバティブ取引は、将来の為替の変動によるリスク回避を目的としており、投機的な取引は行わない方針であります。	―
3.取引の利用目的	デリバティブ取引は、外貨建金銭債権債務等の為替変動リスクを回避し、安定的な利益の確保を図る目的で利用しております。	―
4.取引に係るリスクの内容	為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動によるリスクであります。	―
5.取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限及び取引限度額等を定めた社内ルールに従い、運用部が行っております。	―

Ⅱ 取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成21年5月25日現在）

該当事項はありません。

区分	種類	(平成22年5月25日現在)			
		契約額等(円)	うち1年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	91,132,300	―	91,041,400	△90,900
	ユーロ	27,979,560	―	27,961,920	△17,640
	イギリスポンド	16,909,717	―	16,883,625	△26,092
	オーストラリアドル	1,464,992	―	1,453,802	△11,190
	香港ドル	4,219,703	―	4,214,594	△5,109
	シンガポールドル	1,467,698	―	1,462,202	△5,496
	合計	143,173,970	―	143,017,543	△156,427

（注1）時価の算定方法

1. 本書における開示対象ファンドの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。

①同計算期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同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。

・同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当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・同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、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2. 同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、同計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

（注2）デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておりません。

(関連当事者との取引に関する注記)
該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	(平成21年5月25日現在)	(平成22年5月25日現在)
1.元本の推移		
期首元本額	7,583,450,923円	9,484,114,971円
期中追加設定元本額	3,764,088,372円	994,571,401円
期中一部解約元本額	1,863,424,324円	2,538,984,267円
期末元本額	9,484,114,971円	7,939,702,105円
2.元本の内訳		
ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”	9,484,114,971円	7,939,702,105円

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(ア)株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	EXXON MOBIL CORP	31,600	60.19	1,902,004.00	
	NOBLE CORP	2,300	31.25	71,875.00	
	SCHLUMBERGER LTD.	26,100	57.60	1,503,360.00	

	SOUTHWESTERN ENERGY CO	7,900	35.89	283,531.00	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5,700	65.97	376,029.00	
	OWENS-ILLINOIS INC	53,100	29.10	1,545,210.00	
	3M CO	3,000	79.59	238,770.00	
	FLOWSERVE CORP	12,400	93.56	1,160,144.00	
	UNION PACIFIC CORP	21,600	69.33	1,497,528.00	
	COACH INC	44,900	38.74	1,739,426.00	
	VIRGIN MEDIA INC	84,300	15.18	1,279,674.00	
	AMAZON COM INC	3,100	122.12	378,572.00	
	J.C. PENNEY CO INC	8,500	27.00	229,500.00	
	KOHLS CORP	21,200	50.97	1,080,564.00	
	CVS CAREMARK CORP	53,050	33.95	1,801,047.50	
	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	24,200	55.79	1,350,118.00	
	GILEAD SCIENCES INC	38,500	36.35	1,399,475.00	
	MERCK & CO. INC.	61,200	31.86	1,949,832.00	
	PFIZER INC	116,700	15.22	1,776,174.00	
	PEOPLE’S UNITED FINANCIAL	116,900	14.20	1,659,980.00	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	20,600	27.17	559,702.00	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,800	136.69	246,042.00	
	JP MORGAN CHASE&CO	50,300	38.62	1,942,586.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	160,400	10.25	1,644,100.00	
	APPLE INC	10,500	246.76	2,590,980.00	
	CISCO SYSTEMS INC	75,469	23.37	1,763,710.53	
	HEWLETT-PACKARD COMPANY	44,300	45.69	2,024,067.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP CL A	13,100	31.66	414,746.00	
	ALLIANT ENERGY CORP	24,800	31.58	783,184.00	
	ENTERGY CORP.	22,300	73.80	1,645,740.00	
	PPL CORPORATION	8,700	24.71	214,977.00	
小計				37,052,648.03	
				(3,340,296,219)	
カナダドル	NIKO RESOURCES LTD	16,900	98.80	1,669,720.00	
	PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	9,800	23.04	225,792.00	

	BARRICK GOLD CORP	3,200	43.38	138,816.00	
	GREAT WEST LIFECO INC	52,000	25.19	1,309,880.00	
小計				3,344,208.00	
				(282,384,923)	
ユーロ	ARCELORMITTAL	32,500	23.79	773,175.00	
	BASF SE	5,598	41.87	234,416.25	
	PRYSMIAN SPA	5,400	11.85	63,990.00	
	VINCI SA	37,700	35.89	1,353,241.50	
	ATLANTIA SPA	73,600	14.41	1,060,576.00	
	VOLKSWAGEN AG PREFERED STOCK	8,000	68.15	545,200.00	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV	36,400	38.68	1,408,134.00	
	BANCO SANTANDER SA	21,500	8.50	182,879.00	
	BNP PARIBAS	29,567	46.55	1,376,343.85	
	GROUPE BRAUXELLES LAMBERT SA	22,000	57.89	1,273,580.00	
小計				8,271,535.60	
				(917,892,305)	
イギリスポンド	BP PLC	59,500	4.93	293,335.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A UK	24,300	17.88	434,605.50	
	BHP BILLITON PLC	28,100	18.13	509,593.50	
	XSTRATA PLC	30,100	9.57	288,057.00	
	BRITISH AMERICAN TABACCO PLC	58,900	20.10	1,183,890.00	
	DIAGEO PLC	9,000	10.54	94,860.00	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	65,300	17.99	1,174,747.00	
	STANDARD CHARTERED PLC	18,800	16.33	307,004.00	
	3I GROUP PLC	154,200	2.80	432,531.00	
小計				4,718,623.00	
				(610,731,374)	
スイスフラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	44,500	45.56	2,027,420.00	
小計				2,027,420.00	
				(157,611,630)	
ノルウェークローネ	TELENOR ASA	134,100	77.10	10,339,110.00	
小計				10,339,110.00	

				(142,679,718)	
オーストラリアドル	SANTOS LTD	51,400	12.29	631,706.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	5,000	42.83	214,150.00	
小計				845,856.00	
				(62,661,012)	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA	66,000	49.00	3,234,000.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	738,000	16.76	12,368,880.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	15,000	103.40	1,551,000.00	
小計				17,153,880.00	
				(198,298,852)	
シンガポールドル	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	204,000	3.77	769,080.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	267,000	2.87	766,290.00	
小計				1,535,370.00	
				(98,048,728)	
合計				5,810,604,761	
				(5,810,604,761)	

（注）1.通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
2.小計・合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
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	31銘柄	56.4%	57.4%
カナダドル	株式	4銘柄	4.8%	4.9%
ユーロ	株式	10銘柄	15.5%	15.8%
イギリスポンド	株式	9銘柄	10.3%	10.5%
スイスフラン	株式	1銘柄	2.7%	2.7%
ノルウェークローネ	株式	1銘柄	2.4%	2.5%
オーストラリアドル	株式	2銘柄	1.1%	1.1%
香港ドル	株式	3銘柄	3.3%	3.4%
シンガポールドル	株式	2銘柄	1.7%	1.7%

(イ)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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

(2)注記表(デリバティブ取引に関する注記)Ⅱ　取引の時価等に関する事項で記載しております。

「ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”」の状況

ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”

（1）中間貸借対照表

（単位：円）

期別 科目	第9期中間計算期間末 平成21年11月25日現在	第10期中間計算期間末 平成22年11月25日現在
	金　額	金　額
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	6,805,841,609	5,597,326,609
流動資産合計	6,805,841,609	5,597,326,609
資産合計	6,805,841,609	5,597,326,609
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	1,440,376	1,254,186
未払委託者報酬	14,763,798	12,855,333
流動負債合計	16,204,174	14,109,519
負債合計	16,204,174	14,109,519
純資産の部		
元本等		
元本	4,406,993,476	3,802,587,735
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	2,382,643,959	1,780,629,355
分配準備積立金	1,813,834,867	1,745,146,908
元本等合計	6,789,637,435	5,583,217,090
純資産合計	6,789,637,435	5,583,217,090
負債純資産合計	6,805,841,609	5,597,326,609

（2）中間注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

期別 項目	第9期中間計算期間 自平成21年 5月26日 至平成21年11月25日	第10期中間計算期間 自平成22年 5月26日 至平成22年11月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価している。	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

	第9期中間計算期間末 平成21年11月25日現在	第10期中間計算期間末 平成22年11月25日現在
1.受益権の総数	4,406,993,476口	3,802,587,735口
2.元本の欠損金 「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55条の6第10号に規定する額	2,382,643,959円	1,780,629,355円
3.１口当たりの純資産額 （１万口当たりの純資産額）	1.5407円 (15,407円)	1.4683円 (14,683円)

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

第10期中間計算期間（自 平成22年5月26日　至 平成22年11月25日）

当中間計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

金融商品の時価等に関する事項

第10期中間計算期間 自 平成22年 5月26日 至 平成22年11月25日
１．中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価または時価の近似値と考えられる帳簿価額で計上しているため、中間貸借対照表計上額と時価との間に重要な差額はありません。 ２．時価の算定方法 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。

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本額の変動

	第9期中間計算期間末 平成21年11月25日現在	第10期中間計算期間末 平成22年11月25日現在
期首元本額	4,316,005,760円	4,184,955,097円
期中追加設定元本額	141,958,431円	2,492,750円
期中一部解約元本額	50,970,715円	384,860,112円

ベアリング ジャパン 外国債券 マザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

対象年月日 科目	平成21年11月25日現在	平成22年11月25日現在
	金額	金額
資産の部		
流動資産		
預金	89,037,644	50,874,785
金銭信託	686,681	864,351
コール・ローン	1,083,846,955	560,069,636
国債証券	161,046,043,050	149,425,807,687
地方債証券	7,010,566,843	1,618,534,410
特殊債券	―	1,059,892,789
社債券	2,310,643,790	1,058,575,703
派生商品評価勘定	398,612,277	1,997,384,632
未収利息	3,357,481,566	2,590,732,099
前払費用	277,437,486	107,609,212
流動資産合計	175,574,356,292	158,470,345,304
資産合計	175,574,356,292	158,470,345,304
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,012,467,236	1,259,925,723
未払解約金	517,870,080	8,654,737
流動負債合計	1,530,337,316	1,268,580,460
負債合計	1,530,337,316	1,268,580,460
純資産の部		
元本等		
元本	108,586,052,985	102,415,102,747
剰余金		

剰余金又は欠損金（△）	65,457,965,991	54,786,662,097
元本等合計	174,044,018,976	157,201,764,844
純資産合計	174,044,018,976	157,201,764,844
負債純資産合計	175,574,356,292	158,470,345,304

（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21年 5月26日 至 平成21年11月25日	自 平成22年 5月26日 至 平成22年11月25日
１．有価証券の評価基準及び評価方法 国債証券、地方債、社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売り気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	１．有価証券の評価基準及び評価方法 国債証券、地方債、特殊債券、社債券 同左
２．デリバティブの評価基準及び評価方法 ・外国為替予約取引 個別法に基づき、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、開示対象ファンドの計算期間末日において、わが国における対顧客先物売買相場の仲値を適用して計算しております。ただし、為替予約のうち対顧客先物売買相場が発表されていない通貨については、対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております	２．デリバティブの評価基準及び評価方法 ・外国為替予約取引 同左
３．その他財務諸表作成のための基本となる事項 （1）外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。	３．その他財務諸表作成のための基本となる事項 （1）外貨建取引等の処理基準 同左

（貸借対照表に関する注記）

	平成21年11月25日現在	平成22年11月25日現在
１．受益権の総数	108,586,052,985口	102,415,102,747口
２．１口当たり純資産額	1.6028円	1.5349円
（１万口当たり純資産額）	（16,028円）	（15,349円）

（金融商品に関する注記）

（追加情報）
（自 平成22年5月26日　至 平成22年11月25日）
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

金融商品の時価等に関する事項

自 平成22年 5月26日 至 平成22年11月25日
1．貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則として時価または時価の近似値と考えられる帳簿価額で計上しているため、貸借対照表計上額と時価との間に重要な差額はありません。 2．時価の算定方法 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。 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）
（自 平成21年 5月26日 至 平成21年11月25日）
該当事項はありません。

（自 平成22年 5月26日 至 平成22年11月25日）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

Ⅰ　取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

平成21年11月25日現在					
区分	種類	契約額等（円）	うち１年超	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				
	米ドル	46,693,640,000	―	46,358,280,000	△335,360,000
	ユーロ	1,717,729,000	―	1,720,940,000	3,211,000
	英ポンド	1,776,355,993	―	1,727,276,540	△49,079,453
	ポーランドズロチ	3,823,075,435	―	3,842,973,720	19,898,285
	売建				
	米ドル	87,137,210	―	86,823,237	313,973
	カナダドル	1,273,504,588	―	1,217,256,340	56,248,248
	ユーロ	35,886,475,153	―	36,389,541,060	△503,065,907
	ポーランドズロチ	10,053,321,275	―	9,912,310,920	141,010,355
	豪ドル	6,290,973,700	―	6,238,005,160	52,968,540
合計		―	―	―	△613,854,959

平成22年11月25日現在					
区分	種類	契約額等（円）	うち１年超	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				
	米ドル	43,280,052,000	―	44,748,210,000	1,468,158,000
	カナダドル	847,090,780	―	856,101,620	9,010,840
	ユーロ	3,654,065,370	―	3,570,479,600	△83,585,770
	英ポンド	3,296,844,800	―	3,362,304,000	65,459,200
	スイスフラン	3,378,206,170	―	3,398,284,360	20,078,190
	ポーランドズロチ	200,690,838	―	198,703,800	△1,987,038
	豪ドル	1,082,070,136	―	1,095,217,760	13,147,624
	シンガポールドル	3,536,243,150	―	3,520,759,990	△15,483,160
	売建				
	米ドル	908,224,955	―	930,253,907	△22,028,952
	カナダドル	16,166,446,800	―	16,758,399,000	△591,952,200
	ユーロ	14,284,841,830	―	13,908,124,100	376,717,730
	ポーランドズロチ	2,094,656,000	―	2,053,440,000	41,216,000
	豪ドル	25,714,496,845	―	26,255,788,400	△541,291,555
合計		―	―	―	737,458,909

（注）時価の算定方法

為替予約取引については以下のように評価しております。

１．計算期間末日に対顧客先物相場が発表されている外貨については、以下のように算定しております。

（１）計算期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場が発表されている場合は、当該為替予約は当該対顧客先物相場の仲値により算定しております。

（２）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。

①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当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに算出したレートにより算定しております。

②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、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値により算定しております。

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。

＊上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

（重要な後発事象に関する注記）

（自 平成21年 5月26日 至 平成21年11月25日）
該当事項はありません。

（自 平成22年 5月26日 至 平成22年11月25日）
該当事項はありません。

（その他の注記）
各計算期間における元本額の変動

平成21年11月25日現在		平成22年11月25日現在	
期首元本額	102,149,710,103円	期首元本額	105,626,364,001円
期中追加設定元本額	10,322,905,478円	期中追加設定元本額	5,065,644,649円
期中一部解約元本額	3,886,562,596円	期中一部解約元本額	8,276,905,903円
期末元本額	108,586,052,985円	期末元本額	102,415,102,747円
元本の内訳＊		元本の内訳＊	
ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”	4,246,220,121円	ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”	3,646,704,417円
ベアリング外国債券ファンドVA1（適格機関投資家専用）	81,931,673,132円	ベアリング外国債券ファンドVA1（適格機関投資家専用）	79,183,789,072円
ベアリング外国債券ファンドVA2（適格機関投資家専用）	3,412,872,948円	ベアリング外国債券ファンドVA2（適格機関投資家専用）	2,918,875,343円
ベアリング外国債券年金ファンド（適格機関投資家専用）	13,920,769,716円	ベアリング外国債券年金ファンド（適格機関投資家専用）	9,131,315,208円
ベアリング外国債券ファンドVA3(適格機関投資家専用)	408,697,309円	ベアリング外国債券ファンドVA3(適格機関投資家専用)	390,852,199円
ベアリング外国債券オープン	1,825,702,589円	ベアリング外国債券オープン	2,560,922,990円
ベアリング・アクティブ外国債券ファンド（適格機関投資家専用）	2,840,117,170円	ベアリング・アクティブ外国債券ファンド（適格機関投資家専用）	4,582,643,518円

＊当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本であります。

2【ファンドの現況】

原届出書「第二部 ファンド情報 第３ ファンドの経理状況 ２ ファンドの現況」の記載は、下記の通り更新されます。

【純資産額計算書】

	平成23年１月31日現在
Ⅰ 資産総額	4,674,958,031円
Ⅱ 負債総額	11,361,950円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	4,663,596,081円

Ⅳ 発行済口数	5,033,632,342 **口**
Ⅴ １口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	0.9265 **円**
（ １万口当たり純資産額	9,265 **円）**

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

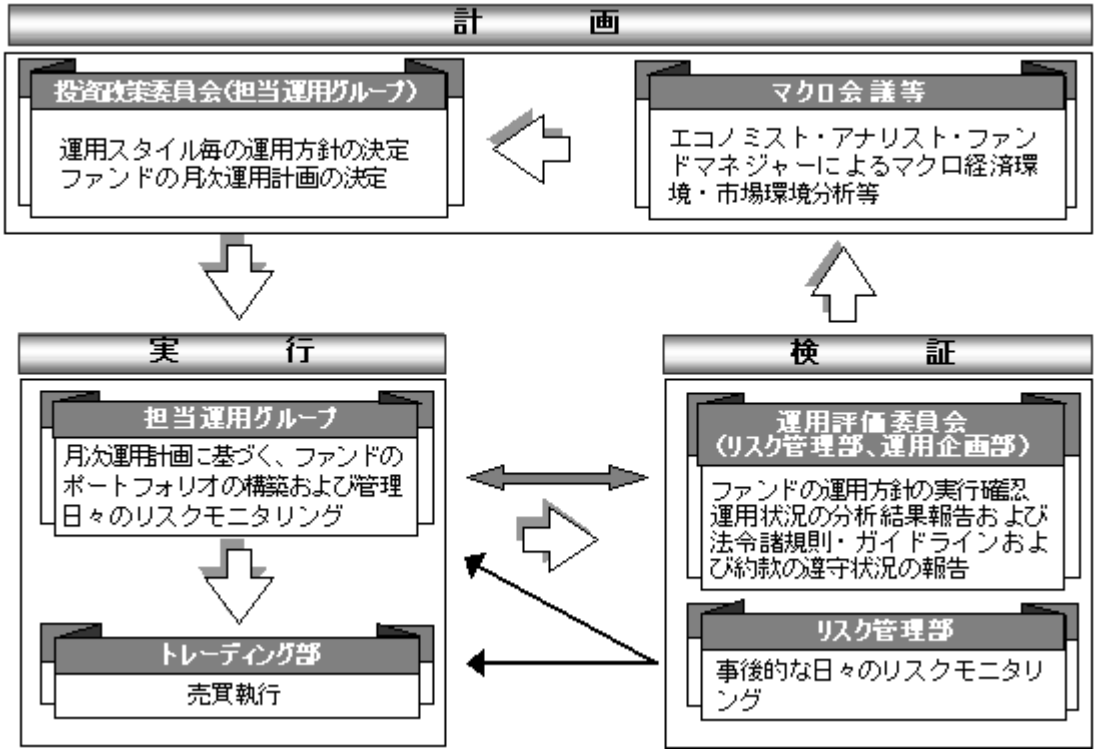
＜訂正前＞

イ 資本金の額および株式数

	平成22年７月30日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

（ 略 ）

ニ 投資信託の運用の流れ



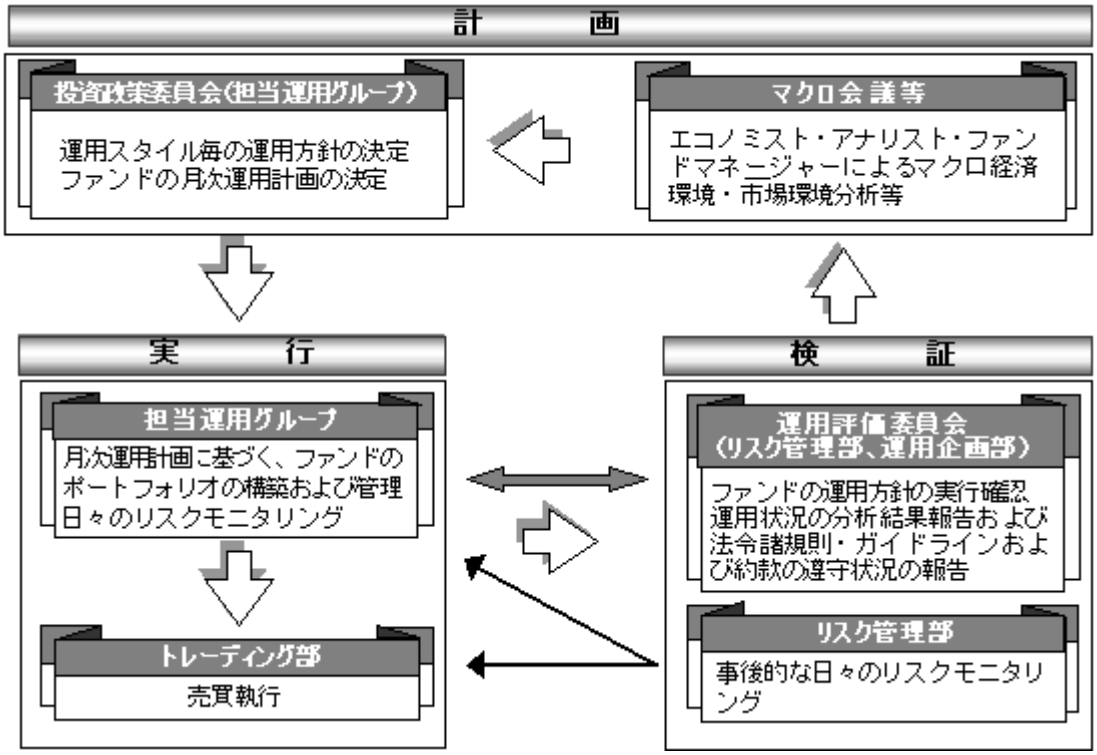
＜訂正後＞

イ 資本金の額および株式数

	平成23年１月31日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

（ 略 ）

ニ 投資信託の運用の流れ



２【事業の内容及び営業の概況】

＜訂正前＞

「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を行っています。
平成22年７月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成22年７月30日現在、単位：百万円）

		本 数	純資産総額
株式投資信託	単位型	66 (1)	154,704 (178)
	追加型	255 (119)	4,701,355 (2,873,553)
	計	321 (120)	4,856,058 (2,873,730)
公社債投資信託	単位型	0 (0)	0 (0)
	追加型	0 (0)	0 (0)
	計	0 (0)	0 (0)
合 計		321 (120)	4,856,058 (2,873,730)

※（ ）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

＜訂正後＞

「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を行っています。
平成23年１月31日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成23年１月31日現在、単位：百万円）

		本 数	純資産総額
株式投資信託	単位型	63 (1)	133,737 (191)
	追加型	260 (121)	4,949,638 (3,214,547)
	計	323 (122)	5,083,374 (3,214,738)
公社債投資信託	単位型	0 (0)	0 (0)
	追加型	0 (0)	0 (0)
	計	0 (0)	0 (0)
合 計		323 (122)	5,083,374 (3,214,738)

※（ ）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

３【委託会社等の経理状況】

＜訂正前＞

１　当社の財務諸表は、第24期（平成20年４月１日から平成21年３月31日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第２条の規定により、「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、第25期（平成21年４月１日から平成22年３月31日まで）については、改正後の「財務諸表等規則」並びに同規則第２条の規定により、「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。

２　当社は、第24期（平成20年４月１日から平成21年３月31日まで）及び第25期（平成21年４月１日から平成22年３月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、あずさ監査法人の監査を受けております。
　なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年７月１日をもって有限責任 あずさ監査法人となっております。

＜訂正後＞

１　当社の財務諸表は、第24期（平成20年４月１日から平成21年３月31日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第２条の規定により、「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、第25期（平成21年４月１日から平成22年３月31日まで）については、改正後の「財務諸表等規則」並びに同規則第２条の規定により、「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。
　また、中間財務諸表は「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「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。

２　当社は、第24期（平成20年４月１日から平成21年３月31日まで）及び第25期（平成21年４月１日から平成22年３月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、あずさ監査法人の監査を受けており、第26期中間会計期間(平成22年４月１日から平成22年９月30日まで)の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。
　なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年７月１日付をもって、名称を有限責任 あずさ監査法人に変更しております。

[追加]

原届出書「第三部 委託会社等の情報 第１ 委託会社等の概況 ３ 委託会社等の経理状況」に下記の記載が「中間財務諸表」として追加されます。

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

（単位：千円）

		第26期中間会計期間末 （平成22年９月30日現在）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		16,070,989
有価証券		4,943,990
前払費用		251,072
未収委託者報酬		3,680,857
未収運用受託報酬		476,281
未収投資助言報酬		424,563
未収収益		28,359
繰延税金資産		238,094
その他		3,965
流動資産合計		26,118,172
固定資産		
有形固定資産	※１	282,221
無形固定資産		5,332
投資その他の資産		
投資有価証券		4,108,176
その他		1,523,074
投資その他の資産合計		5,631,251
固定資産合計		5,918,806
資産合計		32,036,978
負債の部		
流動負債		
預り金		44,787
未払金		1,890,909

未払費用		764,737
未払法人税等		980,584
前受収益		6,563
賞与引当金		322,819
その他	※2	115,673
流動負債合計		4,126,076
固定負債		
退職給付引当金		1,226,435
固定負債合計		1,226,435
負債合計		5,352,511

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	
資本準備金	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984
利益剰余金	
利益準備金	284,245
その他利益剰余金	
配当準備積立金	60,000
別途積立金	1,476,959
繰越利益剰余金	14,195,382
利益剰余金合計	16,016,587
株主資本合計	26,645,571
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	38,896
評価・換算差額等合計	38,896
純資産合計	26,684,467
負債純資産合計	32,036,978

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第26期中間会計期間 （自 平成22年４月１日 至 平成22年９月30日）
営業収益		
委託者報酬		13,415,979
運用受託報酬		1,026,282
投資助言報酬		929,636
その他の営業収益		137,538
営業収益計		15,509,437
営業費用		9,566,713
一般管理費	※１	3,742,792
営業利益		2,199,930
営業外収益	※２	37,736
営業外費用		659
経常利益		2,237,008
特別利益		42,823
特別損失		26,822
税引前中間純利益		2,253,008
法人税、住民税及び事業税		923,945
法人税等調整額		△ 16,386
法人税等合計		907,558
中間純利益		1,345,450

(3)中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

	第26期中間会計期間 （自 平成22年４月１日 至 平成22年９月30日）
株主資本	
資本金	
前期末残高	2,000,000
当中間期末残高	2,000,000
資本剰余金	
資本準備金	
前期末残高	8,628,984
当中間期末残高	8,628,984
資本剰余金合計	
前期末残高	8,628,984
当中間期末残高	8,628,984
利益剰余金	
利益準備金	
前期末残高	284,245
当中間期末残高	284,245
その他利益剰余金	
配当準備積立金	
前期末残高	60,000
当中間期末残高	60,000
別途積立金	
前期末残高	1,476,959
当中間期末残高	1,476,959
繰越利益剰余金	
前期末残高	14,172,932
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 1,323,000
中間純利益	1,345,450

当中間期変動額合計	22,450
当中間期末残高	14,195,382
利益剰余金合計	
前期末残高	15,994,137
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 1,323,000
中間純利益	1,345,450
当中間期変動額合計	22,450
当中間期末残高	16,016,587
株主資本合計	
前期末残高	26,623,121
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 1,323,000
中間純利益	1,345,450
当中間期変動額合計	22,450
当中間期末残高	26,645,571

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	82,556
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 43,660
当中間期変動額合計	△ 43,660
当中間期末残高	38,896
評価・換算差額等合計	
前期末残高	82,556
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 43,660
当中間期変動額合計	△ 43,660
当中間期末残高	38,896
純資産合計	
前期末残高	26,705,677
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 1,323,000
中間純利益	1,345,450
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 43,660
当中間期変動額合計	△ 21,210
当中間期末残高	26,684,467

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

第26期中間会計期間
（自 平成22年４月１日 至 平成22年９月30日）

１．資産の評価基準及び評価方法

（1）有価証券

・満期保有目的の債券‥償却原価法

・子会社株式及び関連会社株式‥移動平均法による原価法

・その他有価証券

時価のあるもの‥中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの‥移動平均法による原価法

２．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物　３～50年

器具備品　３～20年

（2）無形固定資産

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

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

（2）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間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。

過去勤務債務については、発生時において全額を費用処理しております。

数理計算上の差異については、発生時において全額を費用処理しております。

４．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（1）消費税等の会計処理

税抜方式によっております。

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項の変更

第26期中間会計期間 （自平成22年４月１日　至　平成22年９月30日）
資産除去債務に関する会計基準 企業会計基準第18号「資産除去債務に関する会計基準」（平成20年３月31日 企業会計基準委員会）及び企業会計基準適用指針第21号「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（同前）が平成22年４月１日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当中間会計期間から同会計基準及び適用指針を適用しております。 これによる損益の影響はありません。

注　記　事　項

（中間貸借対照表関係）

第26期中間会計期間末 （平成22年９月30日現在）
※１．有形固定資産の減価償却累計額 908,018千円
※２．消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
３．　当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行１行と当座借越契約を締結しております。 当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。 当座借越極度額の総額　10,000,000千円 借入実行残高　－ 差引額　10,000,000千円
４．　当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年６月までの賃借料総額83,897千円の支払保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

第26期中間会計期間 （自 平成22年４月1日　至 平成22年９月30日）

※１．減価償却実施額

有形固定資産	38,651**千円**
無形固定資産	977**千円**

※２．営業外収益のうち主要なもの

受取利息	4,445**千円**
受取配当金	12,720**千円**
為替差益	10,801**千円**

（中間株主資本等変動計算書関係）

第26期中間会計期間
（自 平成22年４月１日 至 平成22年９月30日）

１．発行済株式数に関する事項

	前事業年度末株式数	当中間会計期間増加株式数	当中間会計期間減少株式数	当中間会計期間末株式数
普通株式	17,640株	－	－	17,640株

２．配当に関する事項

(決議)	株式の種類	配当金の総額(千円)	一株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成22年６月24日定時株主総会	普通株式	1,323,000	75,000	平成22年３月31日	平成22年６月25日

（リース取引関係）

第26期中間会計期間
（自 平成22年４月１日 至 平成22年９月30日）

１．オペレーティング・リース取引

（借主側）

未経過リース料（解約不能のもの）

１年以内 670,670千円

１年超 1,274,557千円

合 計 1,945,227千円

（金融商品関係）

１．金融商品の時価等に関する事項

平成22年９月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注２）参照）。

（単位：千円）

第26期中間会計期間末 （平成22年９月30日現在）			
区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
（1）現金及び預金	16,070,989	16,070,989	―
（2）未収委託者報酬	3,680,857	3,680,857	―
（3）未収運用受託報酬	476,281	476,281	―
（4）未収投資助言報酬	424,563	424,563	―
（5）有価証券及び投資有価証券			
①満期保有目的の債券	2,999,963	2,999,700	△263
②その他有価証券	6,003,462	6,003,462	―
（6）投資その他の資産			
①長期差入保証金	681,418	681,418	―
資産計	30,337,535	30,337,271	△263
（1）未払金			
①未払手数料	1,839,602	1,839,602	―
負債計	1,839,602	1,839,602	―

（注１）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

（1）現金及び預金、（2）未収委託者報酬、（3）未収運用受託報酬 及び（4）未収投資助言報酬

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います。

（5）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券については取引金融機関から提示された価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

（6）投資その他の資産

①長期差入保証金

これらの時価については、敷金の性質及び賃貸借契約の期間から帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

負 債

（1）未払金

①未払手数料

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います。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

第26期中間会計期間末 （平成22年９月30日現在）	
内容	中間貸借対照表計上額
（1）子会社株式	236,178
合計	236,178
（2）その他有価証券 ①非上場株式 ②投資証券	 298 48,443
合計	48,741

その他有価証券については、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ものであり、「(5)②その他有価証券」には含めておりません。また、上記の表中にある「中間貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。

子会社株式については、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ものであることから、時価開示の対象とはしておりません。

（追加情報）

前事業年度の下期より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年３月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年３月10日）を適用しております。

（有価証券関係）

１．満期保有目的の債券

（単位：千円）

第26期中間会計期間末 （平成22年９月30日現在）			
区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
（1）中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えるもの	―	―	―
小計	―	―	―

（2）中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えないもの	2,999,963	2,999,700	△263
小計	2,999,963	2,999,700	△263
合計	2,999,963	2,999,700	△263

2．子会社株式及び関連会社株式

第26期中間会計期間末 （平成22年９月30日現在）
子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 236,178千円）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、記載しておりません。

３．その他有価証券

（単位：千円）

第26期中間会計期間末 （平成22年９月30日現在）			
区分	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
（1）中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	2,912,845	2,755,148	157,696
小計	2,912,845	2,755,148	157,696
（2）中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,090,617	3,182,865	△92,248
小計	3,090,617	3,182,865	△92,248
合計	6,003,462	5,938,014	65,447

（注）非上場株式等（中間貸借対照表計上額 48,741千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

（デリバティブ取引関係）

第26期中間会計期間 （自 平成22年４月１日 至 平成22年９月30日）
当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（持分法損益等）

第26期中間会計期間 （自 平成22年４月1日 至 平成22年９月30日）
該当事項はありません。

（資産除去債務等）

第26期中間会計期間 （自 平成22年４月1日 至 平成22年９月30日）
該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第26期中間会計期間
（自 平成22年４月1日 至 平成22年９月30日）

（セグメント情報）

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の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

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	13,415,979	1,026,282	929,636	137,538	15,509,437

２．地域ごとの情報

（1）売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が中間損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高の記載を省略しております。

（2）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、中間損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

（追加情報）

当中間会計期間より、企業会計基準第17号「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（平成21年３月27日 企業会計基準委員会）及び企業会計基準適用指針第20号「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」（平成20年３月21日 企業会計基準委員会）を適用しております。

（１株当たり情報）

第26期中間会計期間 （自 平成22年４月1日 至 平成22年９月30日）
１株当たり純資産額 1,512,724円91銭 １株当たり中間純利益 76,272円68銭 なお、潜在株式調整後１株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 （注）１株当たり純資産額の算定上の基礎 中間貸借対照表の純資産の部の合計額 26,684,467千円 普通株式に係る純資産額 26,684,467千円 普通株式の発行済株式数 17,640株 １株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 17,640株 １株当たり中間純利益の算定上の基礎 中間損益計算書上の中間純利益 1,345,450千円 普通株式に係る中間純利益 1,345,450千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 17,640株

（重要な後発事象）

第26期中間会計期間 （自 平成22年４月１日 至 平成22年９月30日）
該当事項はありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

＜訂正前＞

イ 受託会社

（イ）名称　　中央三井アセット信託銀行株式会社

（ロ）資本金の額　11,000百万円（平成22年３月末現在）

（ハ）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。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

・ 名称　　日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

・ 資本金の額　51,000百万円（平成22年３月末現在）

・ 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。

ロ 販売会社

（イ）名称　　株式会社三井住友銀行

（ロ）資本金の額　1,770,996百万円（平成22年３月末現在）

（ハ）事業の内容　銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

＜訂正後＞

イ 受託会社

（イ）名称　　中央三井アセット信託銀行株式会社

（ロ）資本金の額　11,000百万円（平成22年９月末現在）

（ハ）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。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

・ 名称　　日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

・ 資本金の額　51,000百万円（平成22年９月末現在）

・ 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。

ロ 販売会社

（イ）名称　　株式会社三井住友銀行

（ロ）資本金の額　1,770,996百万円（平成22年９月末現在）

（ハ）事業の内容　銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

独立監査人の中間監査報告書

平成２３年２月２２日

三井住友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　鈴 木 敏 夫　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・ワールド・パッケージ・オープンの平成２２年６月２９日から平成２２年１２月２８日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・ワールド・パッケージ・オープンの平成２２年１２月２８日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成２２年６月２９日から平成２２年１２月２８日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

三井住友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

（注）１．上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．中間財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

委託会社の中間監査報告書へ

独立監査人の中間監査報告書

平成２２年２月２３日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員　公認会計士　鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・ワールド・パッケージ・オープンの平成２１年６月２７日から平成２１年１２月２６日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・ワールド・パッケージ・オープンの平成２１年１２月２６日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成２１年６月２７日から平成２１年１２月２６日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

三井住友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

（注）１．上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．中間財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成22年12月16日

三井住友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　鈴木 敏夫　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　辰巳 幸久　印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成22年４月１日から平成23年３月31日までの第26期事業年度の中間会計期間（平成22年４月１日から平成22年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成22年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成22年４月１日から平成22年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以 上

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