【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成25年３月22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】	三島 克哉
【電話番号】	03-5405-0228
【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24年９月20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25年３月22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】

＜訂正前＞

（ 略 ）

ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（ 略 ）

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

（ 略 ）

項目	該当する属性区分	内容
投資形態	ファンド・オブ・ファンズ	社団法人投資信託協会「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり（部分ヘッジ）	目論見書または信託約款において、一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

（ 略 ）

※商品分類、属性区分は、社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等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。

＜訂正後＞

（ 略 ）

ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（ 略 ）

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

（ 略 ）

項目	該当する属性区分	内容
投資形態	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり（部分ヘッジ）	目論見書または信託約款において、一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

（ 略 ）

※商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般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。

（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24年７月31日現在）

（ロ）会社の沿革

（ 略 ）

平成14年12月１日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更

（ハ）大株主の状況

（平成24年７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

（ 略 ）

＜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25年１月31日現在）

（ロ）会社の沿革

（ 略 ）

平成14年12月１日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更

平成25年４月１日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併（予定）

（ハ）大株主の状況

（平成25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

（ 略 ）

２【投資方針】

※ 原届出書の「第二部 ファンド情報 第１ ファンドの状況 ２ 投資方針 （１）投資方針」の記載は、下記の通り更新されます。

（１）【投資方針】

イ 基本方針

日本を含む世界の株式および公社債（これらを主要投資対象とするマザーファンド受益証券を含みます。）を主要投資対象とする投資信託に投資することにより、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。なお、短期金融商品に直接投資することもできます。

ロ 投資態度

（イ）日本を含む世界の株式および公社債（これらを主要投資対象とするマザーファンド受益証券を含みます。）を主要投資対象とする投資信託に投資し、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

「国内株式」・「国内債券」・「外国株式」・「外国債券」の４つの資産にそれぞれ投資する投資信託に約25%ずつ投資することにより、分散投資を実現します。

原則それぞれの資産の時価変動等に伴う各資産比率の変化については、一定のレンジを設け、四半期毎に調整を行います。

（ロ）主要投資対象とする投資信託は、下記の通りとします。ただし、運用状況等により変更となる場合があります。

ａ．ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	国内株式
運用の基本方針	信託財産の中長期的な成長を図ることを目指して運用を行います。

ｂ．ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	国内債券
運用の基本方針	信託財産の中長期的な成長を図ることを目指して運用を行います。

ｃ．ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”

運用会社	ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社
主要運用対象	外国株式
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

ｄ．ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”

運用会社	ベアリング投信投資顧問株式会社

主要運用対象	外国債券
運用の基本方針	中長期的な観点から、シティグループ世界国債インデックス（日本を除く・円換算）を上回る投資成果の獲得を目指して運用を行います。

※上記投資信託の詳細に関しましては、後述の〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕をご覧ください。

ファンドの特色

1 日本を含む世界の株式・公社債にバランスよく分散投資します。

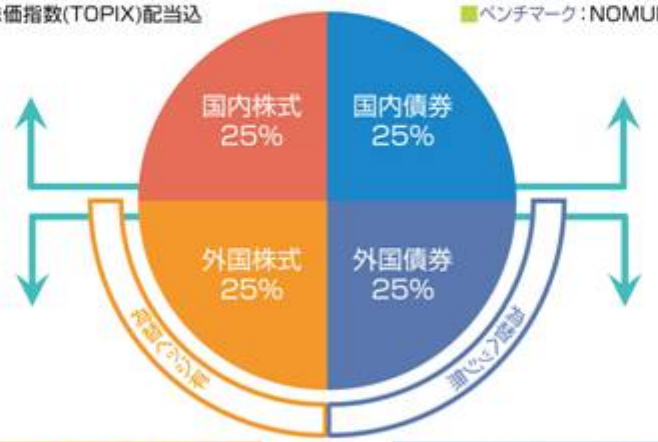
「国内株式」、「国内債券」、「外国株式」、「外国債券」の4つの資産に、それぞれ投資する投資信託に約25%ずつ投資することにより、分散投資を実現します。原則それぞれの資産の時価変動等に伴う各資産比率の変化については、一定のレンジを設け、四半期毎に調整を行います。

SMAM・国内株式ファンド"ハーブ"

■委託会社：三井住友アセットマネジメント
■ベンチマーク：東証株価指数(TOPIX)配当込

SMAM・国内債券ファンド"フルート"

■委託会社：三井住友アセットマネジメント
■ベンチマーク：NOMURA－BPI(総合)



ドイチェ外国株式ファンド"チェロ"

■委託会社：ドイチェ・アセット・マネジメント
■ベンチマーク：MSCIコクサイ（円ヘッジ・ベース）

※原則として、外貨建資産について円に対する為替ヘッジを行います。**（為替ヘッジ有）**

ベアリング外国債券ファンド"ヴィオラ"

■委託会社：ベアリング投信投資顧問
■ベンチマーク：シティグループ世界国債インデックス（日本を除く・円換算）

※原則として、外貨建資産について円に対する為替ヘッジを行いません。**（為替ヘッジ無）**

2 ファンド・オブ・ファンズの形態で運用を行います。

投資信託を主要投資対象とします。株式や公社債等の有価証券に直接投資するのではなく、他の投資信託を購入することにより、間接的に投資を行います。当ファンドは複数の投資信託に投資を行いますので、当ファンドの投資家は、複数の投資信託を購入したのと同じ効果が得られます。
当ファンドが投資を行う投資信託は、日本を含む世界の株式および公社債（これらを主要投資対象とするマザーファンドを含みます。）を主要投資対象とします。

[運用の仕組み]

3 長期的な視点から運用を行い、安定した収益を目指します。

4つの資産にそれぞれ分散投資することで、資産間の分散効果により収益の変動幅が縮小され、また長期的な視点から運用することにより安定した収益を目指します。

●世界分散投資と各資産への投資との元本成長比較（期間:1993年1月末～2013年1月末）

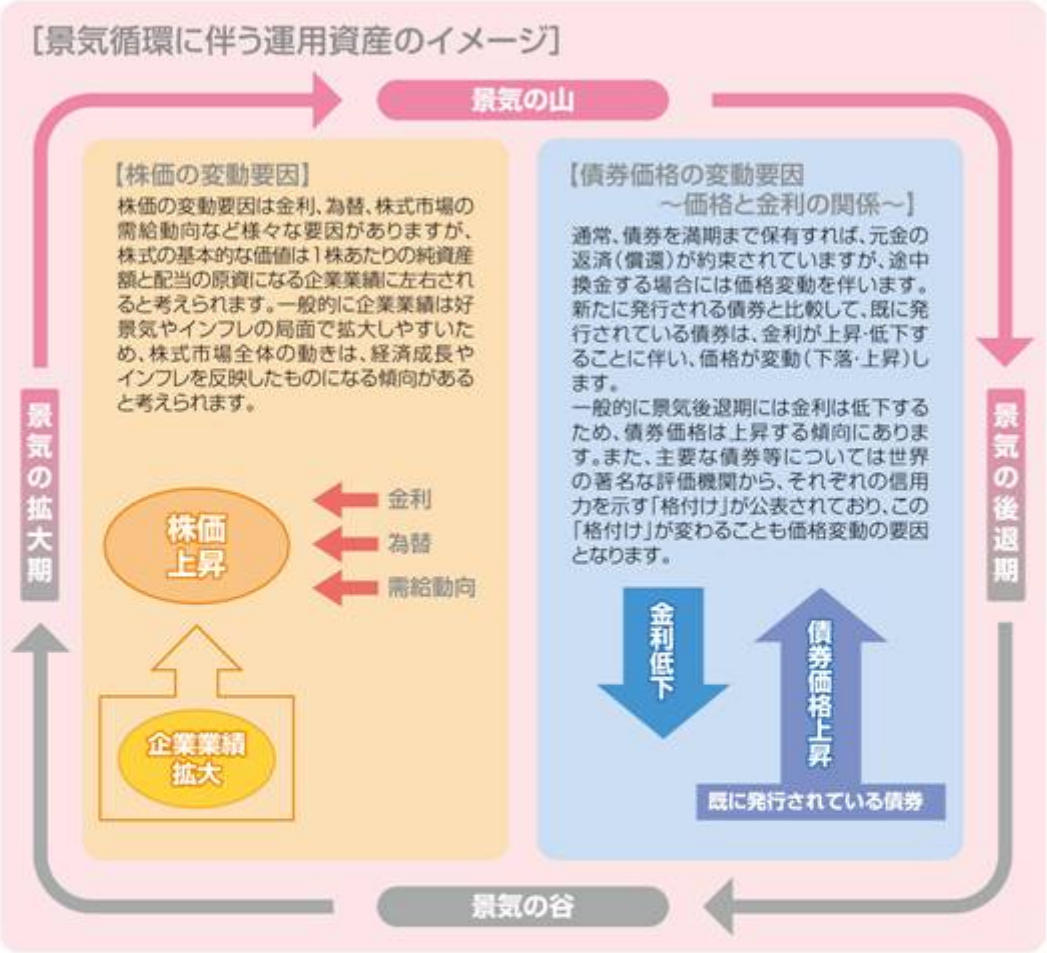
（注1）「国内株式」は東証株価指数（TOPIX）配当込、「国内債券」はNOMURA−BPI（総合）、「外国株式」はMSCIコクサイ（円ヘッジ・ベース）、「外国債券」はシティグループ世界国債インデックス（日本を除く・円換算）を用いて作成しました。
（注2）「4つの資産に分散」は上記の各資産を1/4ずつ保有し、3ヵ月毎にリバランスした場合を示しています。
（注3）上記各指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利はその指数を算出、公表しているそれぞれの主体に帰属します（TOPIX:株式会社東京証券取引所、NOMURA−BPI（総合）:野村證券株式会社、MSCIコクサイ:MSCI Inc.、シティグループ世界国債インデックス:シティグループ・グローバル・マーケッツ・インク）。また、各社は当ファンドの運用に関して責任を負うものではありません。
（出所）Bloomberg L.P.のデータ等を基に三井住友アセットマネジメント作成

※グラフ・データは、過去のデータを基に委託会社が行ったシミュレーションの結果であり、当ファンドの運用実績ではありません。また、当ファンドの将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものでもありません。一定の前提条件に基づくものであり、経費等は考慮されていません。実際の運用においては、市場動向等の諸条件が異なることによりパフォーマンス等は大きく異なります。

※資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

株式と債券
景気循環によって異なる値動き

4つの資産にそれぞれ分散投資することで、資産間の分散効果により収益の変動幅が縮小され、また長期的な視点から運用することにより安定した収益を目指します。



株式と債券の特徴

	景気拡大期	景気後退期	インフレ	デフレ
株式	◎ 企業の業績拡大が期待される。	× 企業の業績低下が予想される。	○ 物価の上昇に合わせて製品やサービスの価格が上昇するため、収益の改善が期待される。	△ 物価の下落に合わせて製品やサービスの価格が下落するため、収益の悪化が予想される。
債券	△ 金利の上昇に伴う債券価格の下落が予想される。	○ 金利の低下による債券価格の上昇が期待される。	× 金利の上昇に伴う債券価格の下落が予想される。	◎ 金利の低下による債券価格の上昇が期待される。

◎：強い ○：やや強い △：やや弱い ×：弱い
※実際の経済動向や市場環境によっては必ずしも一致するものではありません。

（３）【運用体制】

＜訂正前＞

イ 運用体制

（ 略 ）

※リスク管理部は８名程度、運用企画部は９名程度で構成されています。

（ 略 ）

＜訂正後＞

イ 運用体制

（ 略 ）

※リスク管理部は８名程度、運用企画部は８名程度で構成されています。

（ 略 ）

（５）【投資制限】

＜訂正前＞

（ 略 ）

〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

（ 略 ）

〔ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”〕

（ 略 ）

（ご参考：投資対象とする投資信託の運用会社 ドイチェ・アセット・マネジメントについて）

ドイツ銀行グループの資産運用ビジネスを担うグローバルな資産運用機関です。ドイチェ・アセット・マネジメント・グループ全体では800名を超えるファンド・マネジャーおよびリサーチ・スペシャリスト等が、世界主要都市に拠点を構え、緊密なチーム体制のもと、グローバルな観点から調査・分析、運用業務を行っています。（2012年３月末現在）

〔ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”〕

（ 略 ）

（ご参考：投資対象とする投資信託の運用会社 ベアリング投信投資顧問について）

ロンドンに本社を置き200年以上の投資運用の歴史を有するベアリング・アセット・マネジメント・グループの日本法人です。同グループは、機関投資家、個人顧客向けに先進国および新興国の株式・債券市場において資産運用サービスをグローバルで展開しています。また、米国の大手金融サービスグループのマスミューチュアル・ファイナンシャル・グループの一員でもあります。

＜訂正後＞

（ 略 ）

〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

（ 略 ）

〔ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”〕

（ 略 ）

（ご参考：投資対象とする投資信託の運用会社 ドイチェ・アセット・マネジメントについて）

ドイツ銀行グループのアセット・アンド・ウェルス・マネジメント（AWM）部門の日本における資産運用拠点です。投資信託のほか、ＥＴＦ、不動産投資戦略、ヘッジファンド運用戦略を中核としたオルタナティブ投資など多彩な運用ラインアップを取り揃え、個人および機関投資家など幅広い層のお客様を対象にグローバルな資産運用のソリューションを提供しています。（2012年12月末現在）

〔ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”〕

（ 略 ）

（ご参考：投資対象とする投資信託の運用会社 ベアリング投信投資顧問について）

ロンドンに本社を置き250年の投資運用の歴史を有するベアリング・アセット・マネジメント・グループの日本法人です。同グループは、機関投資家、個人顧客向けに先進国および新興国の株式・債券市場において資産運用サービスをグローバルで展開しています。また、米国の大手金融サービスグループのマスミューチュアル・ファイナンシャル・グループの一員でもあります。

４【手数料等及び税金】

（４）【その他の手数料等】

＜訂正前＞

イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.00315%（税抜き0.003%）の率を乗じて得た金額（ただし、年1,890,000円（税抜き1,800,000円）を上限とします。）が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。

（ 略 ）

＜訂正後＞

イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.00315%（税抜き0.003%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。

（ 略 ）

（５）【課税上の取扱い】

＜訂正前＞

（ 略 ）

ニ 個人、法人別の課税の取扱いについて

（イ）個人の受益者に対する課税

ｉ．収益分配時

収益分配金のうち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、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

時期	税率
平成24年12月31日まで	10%（所得税7%および地方税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%および地方税3%）
平成26年１月１日以降	20.315%（所得税15.315%および地方税5%）

ii．一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、以下の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

なお、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、上場株式等にかかる譲渡益との通算が可能です。

時期	税率
平成24年12月31日まで	10%（所得税7%および地方税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%および地方税3%）
平成26年１月１日以降	20.315%（所得税15.315%および地方税5%）

（ロ）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ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、以下の税率で源泉徴収されます。

時期	税率
平成24年12月31日まで	7%（所得税のみ）
平成25年１月１日から 平成25年12月31日まで	7.147%（所得税のみ）
平成26年１月１日以降	15.315%（所得税のみ）

（ 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24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 ）

ニ 個人、法人別の課税の取扱いについて

（イ）個人の受益者に対する課税

ｉ．収益分配時

収益分配金のうち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、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

時期	税率
平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7.147%および地方税3%）
平成26年１月１日以降	20.315%（所得税15.315%および地方税5%）

ii．一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、以下の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

なお、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、上場株式等にかかる譲渡益との通算が可能です。

時期	税率
平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7.147%および地方税3%）
平成26年１月１日以降	20.315%（所得税15.315%および地方税5%）

（ロ）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ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、以下の税率で源泉徴収されます。

時期	税率
平成25年12月31日まで	7.147%（所得税のみ）
平成26年１月１日以降	15.315%（所得税のみ）

（ 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25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25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	3,466,978,149	100.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		△1,193,363	△0.03
合計（純資産総額）		3,465,784,786	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比率をいいます。以下同じ。

（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25年1月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”	1,222,448,744	0.5712	698,317,732	0.7203	880,529,830	25.41
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”	895,733,909	0.8434	755,464,666	0.9666	865,816,396	24.98
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”	465,151,984	1.5871	738,242,713	1.8578	864,159,355	24.93
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”	751,885,320	1.1328	851,737,946	1.1391	856,472,568	24.71

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25年1月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	100.03
合 計	100.03

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2期（平成15年 6月26日）	（分配落）	19,575,607,663	9,063
	（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
	（分配付）	17,004,122,927	9,809

第4期（平成17年 6月27日）	（分配落） （分配付）	10,295,769,640 10,703,006,242	10,113 10,513
第5期（平成18年 6月26日）	（分配落） （分配付）	8,259,845,247 8,408,327,725	11,126 11,326
第6期（平成19年 6月26日）	（分配落） （分配付）	8,284,824,296 8,420,868,747	12,180 12,380
第7期（平成20年 6月26日）	（分配落） （分配付）	7,146,716,630 7,278,602,597	10,838 11,038
第8期（平成21年 6月26日）	（分配落） （分配付）	5,512,044,153 5,512,044,153	8,661 8,661
第9期（平成22年 6月28日）	（分配落） （分配付）	4,964,773,110 4,964,773,110	8,851 8,851
第10期（平成23年 6月27日）	（分配落） （分配付）	4,322,419,063 4,322,419,063	9,077 9,077
第11期（平成24年 6月26日）	（分配落） （分配付）	3,464,359,450 3,464,359,450	9,024 9,024
平成24年 1月末日		3,772,967,325	8,858
2月末日		3,841,924,462	9,366
3月末日		3,765,754,358	9,506
4月末日		3,671,212,951	9,376
5月末日		3,448,098,877	8,920
6月末日		3,468,813,227	9,052
7月末日		3,443,999,258	9,079
8月末日		3,430,709,266	9,144
9月末日		3,432,275,851	9,245
10月末日		3,387,665,005	9,220
11月末日		3,410,642,588	9,469
12月末日		3,378,729,311	9,829
平成25年 1月末日		3,465,784,786	10,290

②【分配の推移】

計算期間	１万口当たり分配金（円）
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

第10期（平成22年 6月29日～平成23年 6月27日）	0
第11期（平成23年 6月28日～平成24年 6月26日）	0

③【収益率の推移】

計算期間	収益率（%）
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	2.6
第11期	△0.6
第12期（中間期）	8.0

（注）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。

（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	133,093,115	980,705,066
第11期	93,195,467	1,016,166,948
第12期（中間期）	38,364,973	435,615,664

（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〕

〔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25年1月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(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）	5,614,917,879	0.5901	3,313,363,041	0.7737	4,344,261,962	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）」の投資有価証券は以下の通りです。

＜国内株式マザーファンド（Ｅ号）　平成25年1月30日現在の上位30銘柄＞

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	52,000	3,251.15	169,059,800	4,365.00	226,980,000	5.22
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	43,800	2,337.17	102,368,046	3,490.00	152,862,000	3.52
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	300,100	374.47	112,378,749	503.00	150,950,300	3.47
日本	株式	住友不動産	不動産業	45,000	1,681.00	75,645,000	2,829.00	127,305,000	2.93
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	34,000	2,618.94	89,043,960	3,475.00	118,150,000	2.72
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	638,700	125.31	80,035,497	178.00	113,688,600	2.62
日本	株式	Ｔ＆Ｄホールディングス	保険業	84,200	762.00	64,160,400	1,133.00	95,398,600	2.20
日本	株式	三井不動産	不動産業	44,000	1,929.39	84,893,160	2,096.00	92,224,000	2.12
日本	株式	信越化学工業	化学	16,100	4,206.06	67,717,566	5,670.00	91,287,000	2.10
日本	株式	日立製作所	電気機器	163,000	457.00	74,491,000	546.00	88,998,000	2.05
日本	株式	三井物産	卸売業	57,900	1,216.93	70,460,247	1,366.00	79,091,400	1.82
日本	株式	ＪＸホールディングス	石油・石炭製品	137,100	412.15	56,505,765	537.00	73,622,700	1.69
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	15,500	3,425.20	53,090,600	4,695.00	72,772,500	1.68
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	10,700	5,571.15	59,611,376	6,730.00	72,011,000	1.66
日本	株式	日東電工	化学	12,200	3,512.79	42,856,038	5,190.00	63,318,000	1.46
日本	株式	デンソー	輸送用機器	18,600	2,507.45	46,638,570	3,365.00	62,589,000	1.44
日本	株式	クボタ	機械	57,000	808.22	46,068,540	1,049.00	59,793,000	1.38
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	58,200	878.11	51,106,002	1,010.00	58,782,000	1.35
日本	株式	リコー	電気機器	56,000	624.91	34,994,960	1,043.00	58,408,000	1.34
日本	株式	オリックス	その他金融業	5,830	7,024.61	40,953,476	9,720.00	56,667,600	1.30
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	13,900	3,586.90	49,857,910	3,770.00	52,403,000	1.21
日本	株式	ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	保険業	27,000	1,863.18	50,306,012	1,940.00	52,380,000	1.21
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	7,900	4,843.09	38,260,411	6,200.00	48,980,000	1.13
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	202,000	174.86	35,322,203	241.00	48,682,000	1.12
日本	株式	三井住友トラスト・ホールディングス	銀行業	146,000	227.12	33,159,520	332.00	48,472,000	1.12
日本	株式	ＤＯＷＡホールディングス	非鉄金属	72,000	475.91	34,265,520	636.00	45,792,000	1.05
日本	株式	三菱マテリアル	非鉄金属	150,000	236.16	35,424,000	300.00	45,000,000	1.04
日本	株式	安川電機	電気機器	52,000	612.59	31,854,680	846.00	43,992,000	1.01
日本	株式	ソニー	電気機器	31,500	1,207.41	38,033,659	1,383.00	43,564,500	1.00
日本	株式	横河電機	電気機器	42,300	897.77	37,975,671	1,026.00	43,399,800	1.00

〔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25年1月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(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）	16,239,670,105	1.1608	18,851,473,710	1.1726	19,042,637,165	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）」の投資有価証券は以下の通りです。

＜国内債券マザーファンド（Ｅ号）　平成25年1月30日現在の上位30銘柄＞

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第２５９回利付国債（１０年）	1,470,000,000	102.39	1,505,216,600	101.60	1,493,622,900	1.500	2014/03/20	7.84
日本	国債証券	第３１２回利付国債（１０年）	1,070,000,000	104.30	1,116,031,300	105.14	1,125,083,600	1.200	2020/12/20	5.91
日本	国債証券	第３１０回利付国債（１０年）	980,000,000	102.51	1,004,598,000	103.75	1,016,769,600	1.000	2020/09/20	5.34
日本	国債証券	第２８０回利付国債（１０年）	850,000,000	106.33	903,822,000	106.10	901,850,000	1.900	2016/06/20	4.74
日本	国債証券	第２７４回利付国債（１０年）	830,000,000	104.65	868,649,800	104.09	864,013,400	1.500	2015/12/20	4.54
日本	国債証券	第３１５回利付国債（１０年）	810,000,000	104.42	845,856,600	104.95	850,135,500	1.200	2021/06/20	4.46
日本	国債証券	第２６９回利付国債（１０年）	760,000,000	102.74	780,880,500	102.60	779,782,800	1.300	2015/03/20	4.10
日本	国債証券	第８４回利付国債（２０年）	620,000,000	109.28	677,593,600	110.65	686,054,800	2.000	2025/12/20	3.60
日本	国債証券	第２９５回利付国債（１０年）	600,000,000	106.79	640,771,800	107.03	642,204,000	1.500	2018/06/20	3.37
日本	国債証券	第２５６回利付国債（１０年）	550,000,000	101.77	559,741,600	101.16	556,424,000	1.400	2013/12/20	2.92
日本	国債証券	第１１１回利付国債（２０年）	500,000,000	109.65	548,285,000	110.07	550,365,000	2.200	2029/06/20	2.89
日本	国債証券	第２８７回利付国債（１０年）	490,000,000	107.95	528,997,800	107.71	527,779,000	1.900	2017/06/20	2.77
日本	国債証券	第１３５回利付国債（２０年）	510,000,000	100.83	514,266,300	99.42	507,067,500	1.700	2032/03/20	2.66
日本	国債証券	第２４８回利付国債（１０年）	490,000,000	100.28	491,372,000	100.07	490,387,100	0.700	2013/03/20	2.58
日本	国債証券	第３２回利付国債（３０年）	440,000,000	109.87	483,454,400	107.44	472,775,600	2.300	2040/03/20	2.48
日本	国債証券	第２９７回利付国債（１０年）	440,000,000	106.48	468,512,000	106.72	469,603,200	1.400	2018/12/20	2.47
日本	国債証券	第２０回利付国債（３０年）	370,000,000	113.32	419,298,500	111.70	413,312,200	2.500	2035/09/20	2.17
日本	国債証券	第１２５回利付国債（２０年）	310,000,000	108.83	337,376,100	108.35	335,900,500	2.200	2031/03/20	1.76
日本	国債証券	第１４１回利付国債（２０年）	340,000,000	99.39	337,939,600	98.75	335,756,800	1.700	2032/12/20	1.76
日本	国債証券	第１０５回利付国債（２０年）	290,000,000	108.64	315,073,400	109.39	317,257,100	2.100	2028/09/20	1.67
日本	国債証券	第２８２回利付国債（１０年）	270,000,000	106.11	286,523,200	105.81	285,687,000	1.700	2016/09/20	1.50
日本	国債証券	第３２５回利付国債（１０年）	260,000,000	100.47	261,243,600	100.44	261,167,400	0.800	2022/09/20	1.37
日本	国債証券	第４７回変動利付国債（１５年）	250,000,000	103.25	258,125,000	103.45	258,625,000	0.330	2022/11/20	1.36

日本	社債券	第２０回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	108.64	217,284,000	109.57	219,156,000	2.210	2019/07/24	1.15
日本	特殊債券	第３回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	101.38	202,770,000	100.80	201,602,000	1.150	2013/12/20	1.06
日本	社債券	日本電産株式会社第１回無担保社債	200,000,000	100.00	200,000,000	100.11	200,238,000	0.386	2017/09/20	1.05
日本	社債券	第５１９回東京電力株式会社社債	200,000,000	88.21	176,422,000	96.14	192,298,000	1.590	2015/12/28	1.01
日本	特殊債券	第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,902,000	104.37	189,851,117	105.05	191,100,784	1.850	2046/03/10	1.00
日本	地方債証券	第６４８回東京都公募公債	140,100,000	107.69	150,876,492	107.24	150,253,047	1.840	2017/06/20	0.79
日本	国債証券	第９０回利付国債（２０年）	120,000,000	111.06	133,272,500	112.50	135,008,400	2.200	2026/09/20	0.71

〔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25年1月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(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	4,438,202,241	0.7975	3,539,466,288	1.0648	4,725,797,746	110.55

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25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	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	SEI INVESTMENTS COMPANY	各種金融	101,100	1,985.44	200,728,602	2,399.71	242,611,307	5.13
スペイン	株式	FERROVIAL SA	資本財	164,100	1,471.04	241,398,169	1,461.39	239,815,305	5.07
ドイツ	株式	ADIDAS AG	耐久消費財・アパレル	27,500	7,605.44	209,149,863	8,583.34	236,041,956	4.99
オランダ	株式	QIAGEN N.V.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	121,300	1,798.82	218,197,750	1,936.98	234,956,329	4.97
アメリカ	株式	SAIC INC	ソフトウェア・サービス	210,600	1,071.67	225,695,632	1,110.99	233,975,883	4.95
アメリカ	株式	WHOLE FOODS MARKET INC	食品・生活必需品小売り	26,900	8,415.66	226,381,254	8,681.08	233,521,186	4.94
香港	株式	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	銀行	744,000	260.70	193,966,905	313.72	233,411,400	4.94
アメリカ	株式	NOBLE ENERGY INC	エネルギー	23,500	8,549.22	200,906,757	9,864.08	231,805,931	4.91
アメリカ	株式	MARATHON OIL CORP	エネルギー	75,600	2,270.29	171,634,483	3,057.74	231,165,673	4.89
カナダ	株式	TORONTO-DOMINION BANK	銀行	29,200	7,264.65	212,127,869	7,580.83	221,360,355	4.68
イギリス	株式	OLD MUTUAL PLC	保険	783,800	267.19	209,430,152	272.10	213,274,566	4.51
アメリカ	株式	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	ヘルスケア機器・サービス	41,600	5,255.55	218,631,052	4,896.04	203,675,297	4.31

スウェーデン	株式	TELIASONERA AB	電気通信サービス	298,100	640.64	190,976,417	670.32	199,823,822	4.23
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	4,600	49,849.83	229,309,242	41,635.48	191,523,236	4.05
アメリカ	株式	NEXTERA ENERGY INC	公益事業	26,600	6,316.75	168,025,704	6,562.08	174,551,328	3.69
アメリカ	株式	YUM! BRANDS INC	消費者サービス	20,100	6,335.58	127,345,273	5,854.83	117,682,155	2.49
アメリカ	株式	THE COCA-COLA COMPANY	食品・飲料・タバコ	33,400	3,560.63	118,925,213	3,417.75	114,152,850	2.42
アメリカ	株式	CSX CORPORATION	運輸	51,400	1,983.71	101,962,783	2,016.92	103,670,109	2.19
ドイツ	株式	SAP AG	ソフトウェア・サービス	13,700	7,319.20	100,273,101	7,439.70	101,923,973	2.16
アメリカ	株式	MONSANTO CO	素材	10,600	6,871.54	72,838,358	9,362.81	99,245,809	2.10
フランス	株式	DASSAULT SYSTEMES SA	ソフトウェア・サービス	9,300	9,273.35	86,242,209	10,158.65	94,475,535	2.00
イギリス	株式	JOHNSON MATTHEY PLC	素材	28,300	3,272.89	92,622,956	3,319.94	93,954,534	1.99
アメリカ	株式	FREEPORT-MCMORAN COPRER-B	素材	24,000	2,992.26	71,814,309	3,204.48	76,907,577	1.63
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	30,600	2,034.72	62,262,473	2,507.26	76,722,198	1.62
アメリカ	株式	COCA-COLA ENTERPRISES	食品・飲料・タバコ	23,300	2,528.91	58,923,832	3,164.38	73,730,072	1.56
バミューダ	株式	NOBLE GROUP LTD	資本財	721,000	92.00	66,337,238	90.60	65,323,897	1.38
ドイツ	株式	BEIERSDORF AG	家庭用品・パーソナル用品	7,600	7,396.10	56,210,386	8,075.72	61,375,472	1.30
アメリカ	株式	ROCK TENN COMPANY -CL A	素材	6,900	6,763.78	46,670,142	7,201.88	49,692,991	1.05
オーストラリア	投資証券	LEND LEASE GROUP	その他	50,700	935.15	47,412,338	972.05	49,283,168	1.04
シンガポール	株式	SINGAPORE AIRLINES LTD	運輸	54,000	776.59	41,936,113	810.26	43,754,040	0.93

（注）ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社から入手した情報を基に三井住友アセットマネジメントが作成しています。

〔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25年1月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(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	2,167,006,483	1.6570	3,590,729,743	1.9618	4,251,233,318	100.08

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25年1月31日現在の上位30銘柄＞

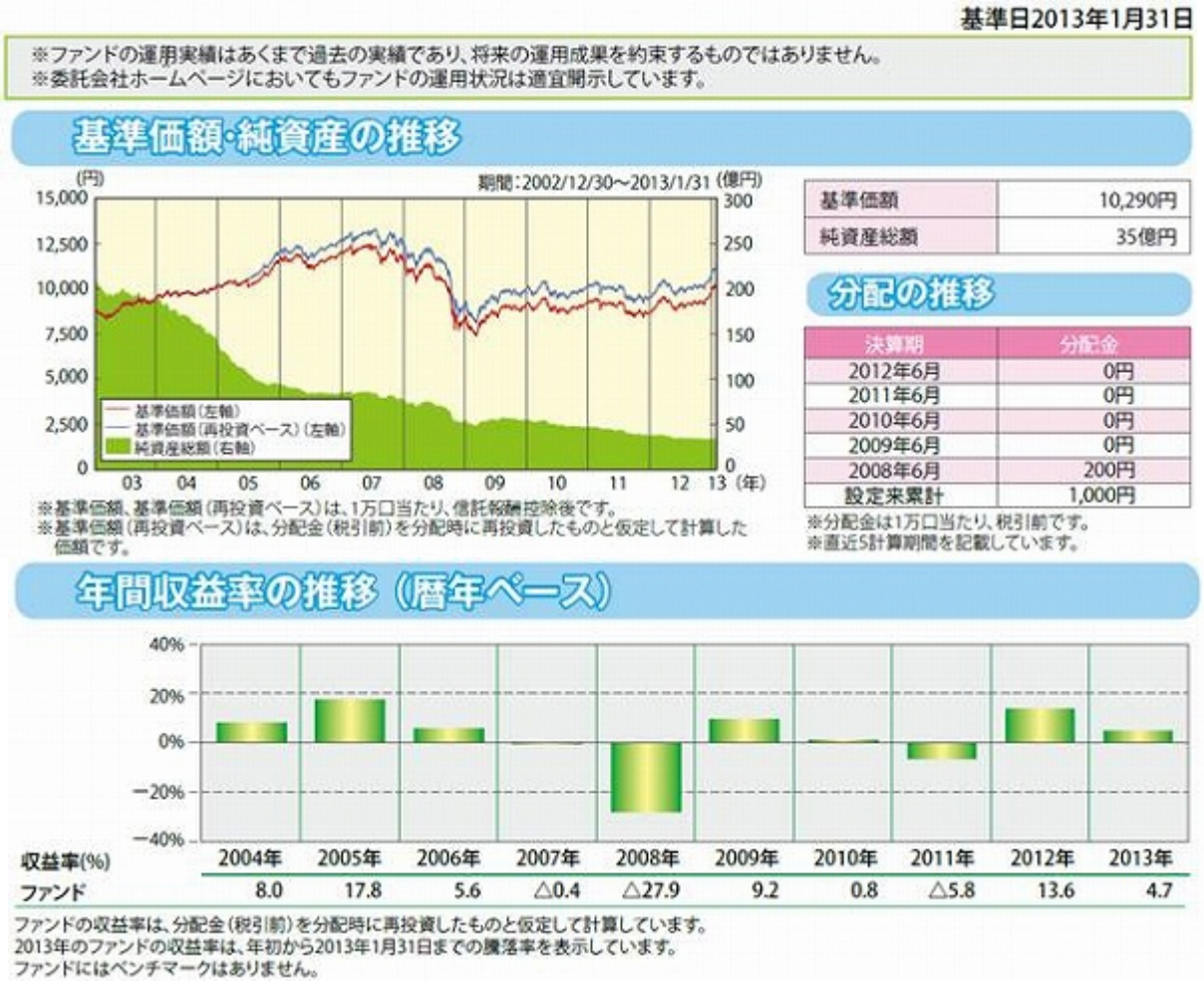
国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)

オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA 4.50% 15APR20	91,200,000	10,543.41	9,615,598,310	10,256.93	9,354,323,716	4.500	2020/04/15	5.61
アメリカ	国債証券	US TRSY 2.125% 15AUG21	73,610,000	9,492.23	6,987,231,239	9,380.12	6,904,712,809	2.125	2021/08/15	4.14
アメリカ	国債証券	US TRSY SP 0% 15FEB19	76,304,200	8,459.53	6,454,981,504	8,390.21	6,402,090,102	－	2019/02/15	3.84
カナダ	地方債証券	ONTARIO 4.75% 23APR19	39,277,000	14,800.32	5,813,124,893	14,651.08	5,754,504,887	4.750	2019/04/23	3.45
フランス	国債証券	FRANCE 0% SP 25OCT15	44,682,000	11,979.63	5,352,741,738	12,045.77	5,382,292,050	－	2015/10/25	3.22
カナダ	地方債証券	ALBERTA 4.00% 01DEC19	50,314,000	10,176.30	5,120,106,911	10,072.13	5,067,693,621	4.000	2019/12/01	3.04
アメリカ	国債証券	US TRSY 2.625% 15AUG20	48,452,000	9,939.72	4,815,997,204	9,830.36	4,763,006,221	2.625	2020/08/15	2.85
カナダ	国債証券	CANADA SP 0% 01JUN17	46,784,000	8,450.14	3,953,316,384	8,417.18	3,937,894,087	－	2017/06/01	2.36
アメリカ	国債証券	US TRSY SP 0% 15MAY30	71,014,000	5,738.22	4,074,946,079	5,263.06	3,737,510,904	－	2030/05/15	2.24
イギリス	国債証券	UK TRSY 5.00% 07MAR25	19,868,000	18,979.56	3,770,859,994	18,423.69	3,660,420,106	5.000	2025/03/07	2.19
国際機関	特殊債券	IADB 0.50% 22APR15	41,205,000	8,764.37	3,611,362,358	8,882.95	3,660,220,247	0.500	2015/04/22	2.19
オーストリア	国債証券	AUSTRIA 3.65% 20ARP22	25,802,000	14,056.07	3,626,747,391	14,176.11	3,657,720,134	3.650	2022/04/20	2.19
カナダ	地方債証券	BR COLMBA 4.10% 18DEC19	32,953,000	10,158.69	3,347,596,279	10,120.50	3,335,011,330	4.100	2019/12/18	2.00
イギリス	国債証券	UK TRSY SP 0% 07MAR36	53,411,000	6,605.95	3,528,304,198	6,132.62	3,275,498,766	－	2036/03/07	1.96
カナダ	地方債証券	ALBERTA 1.85% 01SEP16	35,376,000	9,143.92	3,234,753,422	9,169.38	3,243,760,293	1.850	2016/09/01	1.94
イタリア	国債証券	ITALY 3.75% 01AUG21	26,190,000	10,981.19	2,875,975,808	12,349.20	3,234,257,994	3.750	2021/08/01	1.94
カナダ	国債証券	CANADA 3.75% 01JUN19	31,467,000	10,386.93	3,268,456,490	10,200.52	3,209,799,956	3.750	2019/06/01	1.92
カナダ	地方債証券	ONTARIO 4.00% 03DEC19	22,434,000	14,198.37	3,185,263,469	14,234.24	3,193,310,568	4.000	2019/12/03	1.91
イギリス	国債証券	UK TRSY SP 0% 07SEP15	22,348,000	14,147.93	3,161,779,821	14,084.54	3,147,613,090	－	2015/09/07	1.88
メキシコ	国債証券	MEXICO 10.0% 05DEC24	305,900,000	948.70	2,902,073,300	1,020.58	3,121,973,797	10.000	2024/12/05	1.87
イギリス	国債証券	UK TRSY 4.75% 07MAR20	17,652,000	17,961.31	3,170,531,757	17,468.74	3,083,582,676	4.750	2020/03/07	1.85
カナダ	地方債証券	QUEBEC 5.00% 29APR19	20,604,000	14,951.64	3,080,637,389	14,895.98	3,069,169,099	5.000	2019/04/29	1.84
イタリア	国債証券	ITALY 4.00% 01FEB37	27,742,000	9,620.60	2,668,949,126	10,955.22	3,039,198,047	4.000	2037/02/01	1.82
フランス	国債証券	FRANCE 3.75% 25APR21	20,290,000	13,699.90	2,779,710,602	14,048.71	2,850,483,299	3.750	2021/04/25	1.71
イギリス	国債証券	UK TRSY SP 0% 07SEP16	20,315,000	13,963.65	2,836,715,558	13,742.95	2,791,880,642	－	2016/09/07	1.67
アメリカ	国債証券	US TRSY SP 0% 15MAY37	67,966,000	4,392.81	2,985,618,120	3,999.36	2,718,210,431	－	2037/05/15	1.63
アメリカ	国債証券	US TRSY 4.50% 15FEB36	23,164,000	12,105.95	2,804,223,488	11,485.77	2,660,565,184	4.500	2036/02/15	1.59
アメリカ	国債証券	US TRSY 4.25% 15MAY39	23,120,000	11,753.41	2,717,389,409	11,108.39	2,568,261,981	4.250	2039/05/15	1.54

ドイツ	国債証券	GERMANY 6.5% 04JUL27	12,990,000	19,846.06	2,578,003,258	19,241.21	2,499,434,010	6.500	2027/07/04	1.49
カナダ	地方債証券	QUEBEC 4.75% 29APR18	16,920,000	14,549.65	2,461,801,575	14,463.07	2,447,151,731	4.750	2018/04/29	1.46

（注）ベアリング投信投資顧問株式会社から入手した情報を基に三井住友アセットマネジメントが作成しています。

〔参考情報〕



第２【管理及び運営】

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

＜訂正前＞

イ　基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「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（基準価額は、便宜上１万口単位で表示される場合があります。）。

（ 略 ）

＜訂正後＞

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「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（基準価額は、便宜上１万口単位で表示される場合があります。）。

（ 略 ）

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」（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」（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11期（平成23年６月28日から平成24年６月26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。

＜訂正後＞

１．当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）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」（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11期（平成23年６月28日から平成24年６月26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．当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)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」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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12期中間計算期間（平成24年6月27日から平成24年12月26日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

１【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（比較情報を除きます。）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12期中間計算期間 （平成24年12月26日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	28,128,679
投資信託受益証券	3,333,580,596
未収入金	27,420,000
未収利息	38
流動資産合計	3,389,129,313
資産合計	3,389,129,313
負債の部	
流動負債	
未払解約金	25,157,979
未払受託者報酬	360,385
未払委託者報酬	8,919,556
その他未払費用	53,989
流動負債合計	34,491,909
負債合計	34,491,909
純資産の部	
元本等	
元本	3,441,671,357
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△87,033,953
元本等合計	3,354,637,404
純資産合計	3,354,637,404
負債純資産合計	3,389,129,313

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期中間計算期間 自 平成24年 6月27日 至 平成24年12月26日
営業収益	
受取利息	6,013
有価証券売買等損益	270,093,106
営業収益合計	270,099,119
営業費用	
受託者報酬	360,385
委託者報酬	8,919,556

その他費用	53,989
営業費用合計	9,333,930
営業利益	260,765,189
経常利益	260,765,189
中間純利益	260,765,189
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	13,319,400
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△374,562,598
剰余金増加額又は欠損金減少額	43,144,303
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	43,144,303
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,061,447
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,061,447
分配金	―
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△87,033,953

（３）【中間注記表】
（重要な会計方針の注記）

項 目	第12期中間計算期間 自 平成24年 6月27日 至 平成24年12月26日
有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券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の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、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。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項 目	第12期中間計算期間 （平成24年12月26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 3,441,671,357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 87,033,953円
３．１単位当たり純資産額	0.9747円 （１万口＝9,747円）

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

項 目	第12期中間計算期間 （平成24年12月26日現在）
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） 「重要な会計方針の注記」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）

第12期中間計算期間（平成24年12月26日現在）
該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第12期中間計算期間 （平成24年12月26日現在）
期首元本額	3,838,922,048円
期中追加設定元本額	38,364,973円
期中一部解約元本額	435,615,664円

（参考情報）

三井住友・ワールド・パッケージ・オープンは、「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投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」はこれら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

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（平成24年12月25日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,036
親投資信託受益証券	4,300,007,323
未収入金	38,799,998
流動資産合計	4,338,818,357
資産合計	4,338,818,357
負債の部	
流動負債	
未払解約金	38,799,998
未払受託者報酬	216,158
未払委託者報酬	1,837,326
流動負債合計	40,853,482
負債合計	40,853,482
純資産の部	
元本等	
元本	6,663,753,352
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△2,365,788,477
元本等合計	4,297,964,875
純資産合計	4,297,964,875
負債純資産合計	4,338,818,357

（２）注記表
（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成24年 5月26日 至 平成24年12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の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、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。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成24年12月25日現在）
１．受益権総数	平成24年12月25日における受益権の総数 6,663,753,352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 2,365,788,477円
３．１単位当たり純資産額	0.6450円 （１万口＝6,450円）

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成24年12月25日現在）
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） 「重要な会計方針の注記」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）

（平成24年12月25日現在）
該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成24年12月25日現在）	
期首（平成24年 5月26日）における元本額	7,234,403,735円

期首より平成24年12月25日現在までの追加設定元本額	59,978,542円
期首より平成24年12月25日現在までの一部解約元本額	630,628,925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

（単位：円）

	（平成24年12月25日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	22,903,263
株式	4,018,876,500
未収入金	396,427,472
未収利息	31
流動資産合計	4,438,207,266
資産合計	4,438,207,266
負債の部	
流動負債	
未払金	99,419,178
未払解約金	38,799,998
流動負債合計	138,219,176
負債合計	138,219,176
純資産の部	
元本等	
元本	6,210,293,651
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△1,910,305,561
元本等合計	4,299,988,090
純資産合計	4,299,988,090
負債純資産合計	4,438,207,266

（２）注記表
（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成24年 5月26日 至 平成24年12月25日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	株式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の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、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。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
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。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成24年12月25日現在）
１．受益権総数	平成24年12月25日における受益権の総数 6,210,293,651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 1,910,305,561円
３．１単位当たり純資産額	0.6924円 （１万口＝6,924円）

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成24年12月25日現在）
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） 「重要な会計方針の注記」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）

（平成24年12月25日現在）
該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成24年12月25日現在）	
開示対象ファンドの 期首（平成24年 5月26日）における当該親投資信託の元本額	6,782,930,843円

期首より平成24年12月25日現在までの追加設定元本額	55,994,418円
期首より平成24年12月25日現在までの一部解約元本額	628,631,610円
平成24年12月25日現在の元本の内訳	
ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”	6,210,293,651円
合 計	6,210,293,651円

「ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”」の状況

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（平成24年12月25日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	49,204
親投資信託受益証券	17,962,637,179
流動資産合計	17,962,686,383
資産合計	17,962,686,383
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	454,259
未払委託者報酬	3,179,800
流動負債合計	3,634,059
負債合計	3,634,059
純資産の部	
元本等	
元本	15,754,346,190
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,204,706,134
元本等合計	17,959,052,324
純資産合計	17,959,052,324
負債純資産合計	17,962,686,383

（２）注記表
（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成24年 5月26日 至 平成24年12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の最終相場に基づいて評価しております。

	(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、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。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成24年12月25日現在）
１．受益権総数	平成24年12月25日における受益権の総数 15,754,346,190口
２．１単位当たり純資産額	1.1399円 （１万口＝11,399円）

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成24年12月25日現在）
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） 「重要な会計方針の注記」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）

（平成24年12月25日現在）
該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成24年12月25日現在）	
期首（平成24年 5月26日）における元本額	15,841,465,192円
期首より平成24年12月25日現在までの追加設定元本額	499,341,659円
期首より平成24年12月25日現在までの一部解約元本額	586,460,661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

（単位：円）

	（平成24年12月25日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	192,576,163
国債証券	14,536,655,700
地方債証券	257,973,137
特殊債券	692,824,875
社債券	2,243,530,000
未収利息	37,072,656
前払費用	1,513,129
流動資産合計	17,962,145,660
資産合計	17,962,145,660
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	―
負債合計	―
純資産の部	
元本等	
元本	15,310,805,642
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,651,340,018
元本等合計	17,962,145,660
純資産合計	17,962,145,660
負債純資産合計	17,962,145,660

（２）注記表
（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成24年 5月26日 至 平成24年12月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、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の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、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。

	(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成24年12月25日現在）
１．受益権総数	平成24年12月25日における受益権の総数 15,310,805,642口
２．１単位当たり純資産額	1.1732円 （１万口＝11,732円）

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成24年12月25日現在）
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、社債券） 「重要な会計方針の注記」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）

（平成24年12月25日現在）
該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成24年12月25日現在）	
開示対象ファンドの	
期首（平成24年 5月26日）における当該親投資信託の元本額	15,435,381,170円
期首より平成24年12月25日現在までの追加設定元本額	483,579,619円
期首より平成24年12月25日現在までの一部解約元本額	608,155,147円
平成24年12月25日現在の元本の内訳	
ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”	15,310,805,642円
合 計	15,310,805,642円

「ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”」の状況

（１）貸借対照表

区分	第10期計算期間 （平成23年5月25日現在）	第11期計算期間 （平成24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	―	14,531,736
親投資信託受益証券	5,177,469,878	3,865,226,232
派生商品評価勘定	20,350,552	270,236,264
未収入金	32,374,263	―
未収利息	―	27
流動資産合計	5,230,194,693	4,149,994,259
資産合計	5,230,194,693	4,149,994,259
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	77,752,353	43,690,906
未払解約金	13,920,000	―
未払受託者報酬	2,003,806	1,567,980
未払委託者報酬	16,030,457	12,543,756
その他未払費用	420,000	420,000
流動負債合計	110,126,616	58,222,642
負債合計	110,126,616	58,222,642
純資産の部		
元本等		
元本	5,757,312,055	4,868,034,832
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△637,243,978	△776,263,215
(分配準備積立金)	1,121,872,449	913,182,175
元本等合計	5,120,068,077	4,091,771,617
純資産合計	5,120,068,077	4,091,771,617
負債純資産合計	5,230,194,693	4,149,994,259

（２）損益及び剰余金計算書

区分	第10期計算期間 (自 平成22年5月26日 至 平成23年5月25日)	第11期計算期間 (自 平成23年5月26日 至 平成24年5月25日)
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
受取利息	25	281
有価証券売買等損益	958,982,305	△478,814,960
為替差損益	169,232,749	241,782,385
営業収益合計	1,128,215,079	△237,032,294
営業費用		
受託者報酬	4,207,083	3,293,351
委託者報酬	33,656,636	26,346,638
その他費用	934,500	929,250

営業費用合計	38,798,219	30,569,239
営業利益又は営業損失(△)	1,089,416,860	△267,601,533
経常利益又は経常損失(△)	1,089,416,860	△267,601,533
当期純利益又は当期純損失(△)	1,089,416,860	△267,601,533
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(△)	219,465,415	△78,245,389
期首剰余金又は期首欠損金(△)	△2,143,922,700	△637,243,978
剰余金増加額又は欠損金減少額	638,183,109	182,253,320
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	638,183,109	182,253,320
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,455,832	131,916,413
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,455,832	131,916,413
分配金	―	―
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△637,243,978	△776,263,215

（３）注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
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。

(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より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第10期計算期間 (平成23年5月25日現在)	第11期計算期間 (平成24年5月25日現在)
1.受益権の総数	5,757,312,055口	4,868,034,832口
2.元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	637,243,978円	776,263,215円
3.1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8893円 (8,893円)	0.8405円 (8,405円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第10期計算期間 (自 平成22年5月26日 至 平成23年5月25日)	第11期計算期間 (自 平成23年5月26日 至 平成24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（96,549,483円）、収益調整金（508,718,373円）、分配準備積立金（1,025,322,966円）より、分配対象収益は、1,630,590,822円（1万口当たり2,832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（61,966,332円）、収益調整金（530,646,388円）、分配準備積立金（851,215,843円）より、分配対象収益は、1,443,828,563円（1万口当たり2,965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10期計算期間 (自　平成22年5月26日 至　平成23年5月25日)	第11期計算期間 (自　平成23年5月26日 至　平成24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。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンド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。	同左

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、コンプライアンス統括部から市場リスク、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。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期計算期間 (平成23年5月25日現在)	第11期計算期間 (平成24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。	同左
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。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左

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。	同左

(有価証券に関する注記)
売買目的有価証券
計算期間の損益に含まれた評価差額(円)

種類	第10期計算期間 (平成23年5月25日現在)	第11期計算期間 (平成24年5月25日現在)
親投資信託受益証券	791,620,846	△346,669,035
合計	791,620,846	△346,669,035

(デリバティブ取引に関する注記)
取引の時価等に関する事項
(通貨関連)

区分	種類	第10期計算期間(平成23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	80,455,832	－	80,668,086	212,254
	カナダドル	126,864,536	－	121,957,040	△4,907,496
	ユーロ	25,114,650	－	25,209,284	94,634
	イギリスポンド	123,038,080	－	119,093,170	△3,944,910
	スイスフラン	75,709,664	－	76,249,376	539,712
	スウェーデンクローナ	26,002,424	－	25,567,388	△435,036
	ノルウェークローネ	199,630,390	－	189,687,808	△9,942,582
	デンマーククローネ	6,232,941	－	5,929,572	△303,369
	オーストラリアドル	60,485,319	－	59,828,058	△657,261
	香港ドル	24,218,803	－	24,271,104	52,301
	シンガポールドル	4,837,192	－	4,853,145	15,953
	イスラエルシュケル	1,525,387	－	1,500,324	△25,063
	売建				
	アメリカドル	3,096,874,198	－	3,120,841,444	△23,967,246
	カナダドル	120,493,042	－	121,957,040	△1,463,998
	ユーロ	989,176,182	－	996,199,768	△7,023,586
	イギリスポンド	287,042,657	－	289,508,625	△2,465,968
	スイスフラン	73,618,730	－	76,249,376	△2,630,646
	スウェーデンクローナ	270,761,878	－	264,130,020	6,631,858
	ノルウェークローネ	332,862,452	－	339,964,288	△7,101,836
	デンマーククローネ	202,168,335	－	193,736,528	8,431,807
	オーストラリアドル	74,409,038	－	79,719,012	△5,309,974
	香港ドル	272,179,199	－	274,501,920	△2,322,721
	シンガポールドル	55,310,743	－	55,853,970	△543,227
	イスラエルシュケル	10,869,849	－	11,205,250	△335,401
	合計	6,539,881,521	－	6,558,681,596	△57,401,801

区分	種類	第11期計算期間(平成24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	325,535,695	－	317,277,814	△8,257,881
	カナダドル	30,855,512	－	29,065,479	△1,790,033
	ユーロ	335,596,291	－	314,259,864	△21,336,427
	イギリスポンド	100,792,168	－	96,347,394	△4,444,774
	スウェーデンクローナ	22,168,014	－	20,463,652	△1,704,362
	ノルウェークローネ	33,536,655	－	31,524,100	△2,012,555
	デンマーククローネ	2,376,107	－	2,177,555	△198,552
	ニュージーランドドル	17,862,844	－	16,166,694	△1,696,150
	香港ドル	73,604,198	－	72,846,000	△758,198
	シンガポールドル	16,807,022	－	16,446,696	△360,326
	イスラエルシュケル	27,072,218	－	26,475,365	△596,853
	売建				
	アメリカドル	2,607,482,515	－	2,496,711,686	110,770,829
	カナダドル	246,785,708	－	228,280,753	18,504,955
	ユーロ	912,815,581	－	837,423,393	75,392,188
	イギリスポンド	501,240,743	－	478,031,301	23,209,442
	スウェーデンクローナ	136,529,073	－	125,120,900	11,408,173
	ノルウェークローネ	118,558,207	－	108,915,106	9,643,101
	デンマーククローネ	19,258,620	－	17,674,645	1,583,975
	ニュージーランドドル	18,334,017	－	16,166,694	2,167,323
	香港ドル	334,195,297	－	322,390,746	11,804,551
	シンガポールドル	76,164,607	－	72,892,456	3,272,151
	イスラエルシュケル	32,446,896	－	30,502,115	1,944,781
	合計	5,990,017,988	－	5,677,160,408	226,545,358

(注1)時価の算定方法

1.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。

・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２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。

・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.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、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10期計算期間 (平成23年5月25日現在)	第11期計算期間 (平成24年5月25日現在)
	金額(円)	金額(円)
元本の推移		
期首元本額	8,171,028,828	5,757,312,055

期中追加設定元本額	6,575,832	627,231,415
期中一部解約元本額	2,420,292,605	1,516,508,638

（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	口数	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	4,900,134,676	3,865,226,232	
合計		4,900,134,676	3,865,226,232	

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) 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）
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、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、ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”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23年5月25日現在)	(平成24年5月25日現在)
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	4,345,319	10,782,444
コール・ローン	18,711,202	102,100,840
株式	5,088,089,589	3,790,612,583
派生商品評価勘定	―	8,042
未収入金	87,086,358	―
未収配当金	11,999,163	9,703,509
未収利息	35	195
流動資産合計	5,210,231,666	3,913,207,613
資産合計	5,210,231,666	3,913,207,613
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	393,123	13,145

未払金	―	48,136,869
未払解約金	32,374,263	―
流動負債合計	32,767,386	48,150,014
負債合計	32,767,386	48,150,014
純資産の部		
元本等		
元本	5,859,517,744	4,900,134,676
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	△682,053,464	△1,035,077,077
元本等合計	5,177,464,280	3,865,057,599
純資産合計	5,177,464,280	3,865,057,599
負債純資産合計	5,210,231,666	3,913,207,613

（２）注記表
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	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会社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。
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。
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。

(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より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用し

ております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成23年5月25日現在)	(平成24年5月25日現在)
1.受益権の総数	5,859,517,744口	4,900,134,676口
2.元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	682,053,464円	1,035,077,077円
3.1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8836円 (8,836円)	0.7888円 (7,888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22年5月26日 至　平成23年5月25日)	(自　平成23年5月26日 至　平成24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。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当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。	同左

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、コンプライアンス統括部から市場リスク、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。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成23年5月25日現在)	(平成24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。	同左
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。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左

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。	同左

(有価証券に関する注記)
売買目的有価証券
計算期間の損益に含まれた評価差額(円)

種類	(平成23年5月25日現在)	(平成24年5月25日現在)
株式	233,286,087	△87,453,478
合計	233,286,087	△87,453,478

(デリバティブ取引に関する注記)
取引の時価等に関する事項
(通貨関連)

区分	種類	(平成23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				
	売建				
	アメリカドル	53,310,242	－	53,495,855	△185,613
	ユーロ	17,284,204	－	17,388,008	△103,804
	イギリスポンド	3,245,997	－	3,269,647	△23,650
	スウェーデンクローナ	4,606,968	－	4,633,126	△26,158
	ノルウェークローネ	2,717,269	－	2,741,447	△24,178
	デンマーククローネ	4,017,439	－	4,037,772	△20,333
	オーストラリアドル	327,456	－	329,206	△1,750
	シンガポールドル	763,051	－	766,192	△3,141
	イスラエルシュケル	403,925	－	408,421	△4,496
	合計	86,676,551	－	87,069,674	△393,123

区分	種類	(平成24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	24,231,840	－	24,222,872	△8,968
	カナダドル	2,790,121	－	2,792,999	2,878
	ユーロ	34,954	－	34,982	28
	イギリスポンド	5,553,653	－	5,556,324	2,671
	スウェーデンクローナ	1,687,161	－	1,686,400	△761
	ノルウェークローネ	1,127,183	－	1,127,183	－
	香港ドル	3,897,474	－	3,894,058	△3,416
	シンガポールドル	1,023,722	－	1,026,187	2,465
	合計	40,346,108	－	40,341,005	△5,103

(注1)時価の算定方法

1.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。

・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２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。

・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.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、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23年5月25日現在)	(平成24年5月25日現在)
	金額(円)	金額(円)
1.元本の推移		
期首元本額	7,939,702,105	5,859,517,744
期中追加設定元本額	553,604,192	987,865,274
期中一部解約元本額	2,633,788,553	1,947,248,342
期末元本額	5,859,517,744	4,900,134,676
2.元本の内訳		
ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”	5,859,517,744	4,900,134,676

（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	MARATHON OIL CORP	84,100	24.88	2,092,408.00	
	NOBLE ENERGY INC	15,600	84.35	1,315,860.00	
	FREEPORT-MCMORAN COPRER-B	24,700	32.57	804,479.00	
	MONSANTO CO	33,900	73.94	2,506,566.00	
	PRECISION CASTPARTS CORP	10,900	168.27	1,834,143.00	
	CSX CORPORATION	58,700	21.35	1,253,245.00	

	YUM! BRANDS INC	21,200	70.49	1,494,388.00	
	ALTRIA GROUP INC	33,400	32.26	1,077,484.00	
	COCA-COLA ENTERPRISES	46,100	27.48	1,266,828.00	
	HJ HEINZ CO	46,200	53.55	2,474,010.00	
	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	2,800	51.67	144,676.00	
	BRISTOL MYERS SQUIBB CO.	3,000	32.99	98,970.00	
	CELGENE CORP	8,800	69.91	615,208.00	
	MERCK & CO. INC.	43,100	37.60	1,620,560.00	
	PFIZER INC	35,100	22.14	777,114.00	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2,600	62.20	161,720.00	
	BANK OF AMERICA CORP	37,800	7.14	269,892.00	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	5,000	96.86	484,300.00	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	131,000	18.14	2,376,340.00	
	ORACLE CORP	56,200	26.12	1,467,944.00	
	APPLE INC	4,000	565.32	2,261,280.00	
	AT&T INC	10,300	33.64	346,492.00	
	AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY	16,200	37.98	615,276.00	
小計				27,359,183.00	
				(2,180,253,293)	
カナダドル	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	30,700	19.48	598,036.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	10,900	49.34	537,806.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	14,100	78.99	1,113,759.00	
	RESEARCH IN MOTION	29,800	10.98	327,204.00	
小計				2,576,805.00	
				(200,063,140)	
ユーロ	LANXESS AG	1,400	53.45	74,830.00	
	DEUTSCHE POST AG-REG	98,300	13.14	1,291,662.00	
	RENAULT SA	1,100	33.22	36,542.00	
	ADIDAS AG	8,200	58.40	478,888.20	
	ING GROEP NV	147,400	4.81	708,994.00	
	DASSAULT SYSTEMES SA	23,300	73.61	1,715,113.00	
	FORTUM OYJ	59,800	15.54	929,292.00	
小計				5,235,321.20	
				(523,322,707)	
イギリスポンド	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	63,800	20.75	1,323,850.00	
	GLAXO SMITHKLINE	109,900	14.09	1,549,040.50	
	INMARSAT PLC	44,800	3.97	177,856.00	
小計				3,050,746.50	
				(380,855,193)	
スウェーデンクローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	5,500	149.80	823,900.00	
	TELIASONERA AB	198,300	44.28	8,780,724.00	
小計				9,604,624.00	
				(106,611,326)	
ノルウェークローネ	DNB ASA	103,100	56.50	5,825,150.00	
小計				5,825,150.00	
				(76,950,231)	
デンマーククローネ	NOVO-NORDISK A/S-B	1,400	824.00	1,153,600.00	

小計				1,153,600.00 (15,515,920)	
香港ドル	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	336,000	18.48	6,209,280.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	814,000	22.05	17,948,700.00	
小計				24,157,980.00 (247,860,874)	
シンガポールドル	WILMAR INTERNATIONAL LTD	183,000	3.75	686,250.00	
	CAPITALAND LTD	80,000	2.46	196,800.00	
小計				883,050.00 (55,146,472)	
イスラエルシュケル	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	46,000	4.24	195,040.00	
小計				195,040.00 (4,033,427)	
合計				3,790,612,583 (3,790,612,583)	

(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　23銘柄	56.4%	57.5%
カナダドル	株式　4銘柄	5.2%	5.3%
ユーロ	株式　7銘柄	13.5%	13.8%
イギリスポンド	株式　3銘柄	9.9%	10.1%
スウェーデンクローナ	株式　2銘柄	2.8%	2.8%
ノルウェークローネ	株式　1銘柄	2.0%	2.0%
デンマーククローネ	株式　1銘柄	0.4%	0.4%
香港ドル	株式　2銘柄	6.4%	6.5%
シンガポールドル	株式　2銘柄	1.4%	1.5%
イスラエルシュケル	株式　1銘柄	0.1%	0.1%

(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) 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

（１）貸借対照表

（単位：円）

期別 科目	第10期計算期間末 平成23年5月25日現在	第11期計算期間末 平成24年5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	5,239,103,250	4,042,458,500
未収入金	2,549,999	-
流動資産合計	5,241,653,249	4,042,458,500
資産合計	5,241,653,249	4,042,458,500
負 債 の 部		
流動負債		
未払解約金	2,549,999	-
未払受託者報酬	1,130,909	895,747
未払委託者報酬	11,591,736	9,181,367
流動負債合計	15,272,644	10,077,114
負債合計	15,272,644	10,077,114
純 資 産 の 部		
元本等		
元本	3,515,726,772	2,561,806,960
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,710,653,833	1,470,574,426
(分配準備積立金)	1,743,512,184	1,340,555,588
元本等合計	5,226,380,605	4,032,381,386
純資産合計	5,226,380,605	4,032,381,386
負債純資産合計	5,241,653,249	4,042,458,500

（２）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11期計算期間 自平成23年5月26日 至平成24年5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、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で評価しております。

（追加情報）
第11期計算期間（自 平成23年5月26日 至 平成24年5月25日）
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10期計算期間末 平成23年5月25日現在	第11期計算期間末 平成24年5月25日現在
1.受益権の総数　3,515,726,772口	1.受益権の総数　2,561,806,960口

2.1口当たりの純資産額	1.4866円	2.1口当たりの純資産額	1.5740円
（１万口当たりの純資産額）	（14,866円）	（１万口当たりの純資産額）	（15,740円）

（金融商品に関する注記）

（1）金融商品の状況に関する事項

第11期計算期間 自平成23年5月26日 至平成24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、有価証券等の金融商品への投資ならびにデリバティブ取引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金融商品に係るリスク 当ファンドは、ファミリー・ファンド方式により運用を行っております。したがって、ベビーファンドの金融商品には主要投資対象としている親投資信託受益証券が含まれ、マザーファンドの金融商品には有価証券、デリバティブ取引が含まれております。有価証券は、主として外国債券で構成されており、当ファンドはこれらの有価証券の運用により信用リスク、市場リスク（為替リスク・金利リスク・価格変動リスク・流動性リスク）に晒されております。 ３．金融商品に係るリスク管理体制 委託会社では、組織規定に基づき、運用にかかる法令・諸規則および投資ガイドライン等の遵守状況のモニタリングを担当する業務管理部および金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律その他の投資者保護および業務に関連した法令・諸規則等の遵守状況のモニタリングを担当する法務・コンプライアンス部が設置されております。 さらに、取締役会の委嘱を受けて運用考査にかかるすべての権限および責任が付与された運用考査委員会ならびに全社的なリスク管理にかかる権限および責任が付与されたリスク管理委員会が設置され、定期的に開催されております。 取引先の契約不履行による信用リスクについては、委託会社のトレーディング部署から独立した部署が取引先の信用状況をモニタリングし、取引先とリスク枠などを限定することで管理しております。 ４．金融商品の時価等に関する事項の補足説明 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いる場合があります。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。

（2）金融商品の時価等に関する事項

第11期計算期間 自平成23年5月26日 至平成24年5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 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。 未収入金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

第10期計算期間（自　平成22年5月26日　至　平成23年5月25日）

（単位：円）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	△19,508,731
合 計	△19,508,731

第11期計算期間（自 平成23年5月26日 至 平成24年5月25日）

（単位：円）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	244,938,341
合 計	244,938,341

（デリバティブ取引に関する注記）
第10期計算期間末（平成23年5月25日現在）
該当事項はありません。

第11期計算期間末（平成24年5月25日現在）
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11期計算期間（自 平成23年5月26日 至 平成24年5月25日）
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）
第11期計算期間（自 平成23年5月26日 至 平成24年5月25日）
該当事項はありません。

（その他の注記）
元本額の変動

期別 項目	第10期計算期間末 平成23年5月25日現在	第11期計算期間末 平成24年5月25日現在
期首元本額	4,184,955,097円	3,515,726,772円
期中追加設定元本額	136,755,851円	162,061,396円
期中一部解約元本額	805,984,176円	1,115,981,208円

（３）附属明細表
第１．有価証券明細表
1．株式
該当事項はありません。

2．株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
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	2,439,624,925	4,042,458,500	-
合 計	-	2,439,624,925	4,042,458,500	-

第２．信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３．デリバティブ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＞
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、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、ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”の各計算期間末日（以下「計算期間末日」という）及び各計算期間（以下「計算期間」という）における同親投資信託の状況は次の通りです。また、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

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）

科目　対象年月日	平成23年 5月25日現在	平成24年 5月25日現在
資産の部		
流動資産		
預金	2,289,443	102,288,450
金銭信託	254,369	450,860
コール・ローン	304,219,988	327,375,896
国債証券	154,349,219,252	105,198,482,664
地方債証券	1,658,702,500	26,689,774,580
特殊債券	1,092,192,429	13,984,139,586
社債券	723,991,926	2,685,597,656
派生商品評価勘定	1,825,705,559	2,303,908,667
未収入金	775,551,137	646,642,877
未収利息	928,613,806	1,134,582,178
前払費用	173,776,686	132,383,899
流動資産合計	161,834,517,095	153,205,627,313
資産合計	161,834,517,095	153,205,627,313
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	102,500,194	1,013,042,658
未払金	―	35,662,090
未払解約金	7,784,334	8,443,629
流動負債合計	110,284,528	1,057,148,377
負債合計	110,284,528	1,057,148,377
純資産の部		
元本等		
元本	103,832,249,958	91,823,195,664
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	57,891,982,609	60,325,283,272
元本等合計	161,724,232,567	152,148,478,936
純資産合計	161,724,232,567	152,148,478,936
負債純資産合計	161,834,517,095	153,205,627,313

（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26日 至 平成24年 5月25日
1.有価証券の評価基準及び評価方法 国債証券、地方債証券、特殊債券、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。 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、計算期間末日において、わが国における対顧客先物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。 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」（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。

（追加情報）
当計算期間（自 平成23年5月26日 至 平成24年5月25日）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）

対象年月日 項目	平成23年 5月25日現在	平成24年 5月25日現在
1.受益権の総数	103,832,249,958口	91,823,195,664口
2.１口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	1.5576円 (15,576円)	1.6570円 (16,570円)

（金融商品に関する注記）
（１）金融商品の状況に関する事項

自 平成23年 5月26日 至 平成24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、有価証券等の金融商品への投資ならびにデリバティブ取引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金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（3）附属明細表」に記載しております。当ファンドはこれらの有価証券の運用により信用リスク、市場リスク（為替リスク・金利リスク・価格変動リスク・流動性リスク）に晒されております。

また、当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクを回避することを目的として、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする通貨に係る為替変動の価格変動リスクを有しております。取引先の契約不履行による信用リスクについては、当社は優良な金融機関とのみ取引を行っているため限定的と考えられます。

３．金融商品に係るリスク管理体制

委託会社では、組織規定に基づき、運用にかかる法令・諸規則および投資ガイドライン等の遵守状況のモニタリングを担当する業務管理部および金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律その他の投資者保護および業務に関連した法令・諸規則等の遵守状況のモニタリングを担当する法務・コンプライアンス部が設置されております。

さらに、取締役会の委嘱を受けて運用考査にかかるすべての権限および責任が付与された運用考査委員会ならびに全社的なリスク管理にかかる権限および責任が付与されたリスク管理委員会が設置され、定期的に開催されております。

取引先の契約不履行による信用リスクについては、委託会社のトレーディング部署から独立した部署が取引先の信用状況をモニタリングし、取引先とリスク枠などを限定することで管理しております。

４．金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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いる場合があります。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または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

（２）金融商品の時価等に関する事項

自 平成23年 5月26日
至 平成24年 5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、未収入金、未払金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

（自 平成22年 5月26日 至 平成23年 5月25日）

（単位：円）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△869,761,634

地方債証券	20,459,846
特殊債券	8,978,918
社債券	△6,578,598
合 計	△846,901,468

（自 平成23年 5月26日 至 平成24年 5月25日）

（単位：円）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	9,999,183,699
地方債証券	862,015,084
特殊債券	391,697,939
社債券	69,026,007
合 計	11,321,922,729

（デリバティブ取引に関する注記）
通貨関連

（単位：円）

平成23年 5月25日現在					
区分	種類	契約額等	うち１年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買 建				
	米ドル	39,939,474,305	―	40,680,332,070	740,857,765
	カナダドル	3,010,683,388	―	2,963,558,160	△47,125,228
	ユーロ	424,845,538	―	408,089,760	△16,755,778
	英ポンド	358,365,868	―	362,867,140	4,501,272
	スイスフラン	3,757,027,010	―	3,780,699,450	23,672,440
	豪ドル	7,662,737,423	―	7,697,707,820	34,970,397
	売 建				
	米ドル	798,621,600	―	804,678,000	△6,056,400
	カナダドル	13,065,502,016	―	12,649,823,200	415,678,816
	ユーロ	10,561,182,373	―	10,444,362,020	116,820,353
	英ポンド	1,270,587,720	―	1,264,552,800	6,034,920
	ポーランドズロチ	1,827,999,520	―	1,816,466,400	11,533,120
	豪ドル	27,826,150,768	―	27,387,077,080	439,073,688
合計		―	―	―	1,723,205,365

（単位：円）

平成24年 5月25日現在					
区分	種類	契約額等	うち１年超	時価	評価損益

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	米ドル	46,881,042,463	－	46,119,550,447	△761,492,016
	ユーロ	477,884,400	－	454,636,000	△23,248,400
	スイスフラン	5,585,765,889	－	5,364,819,200	△220,946,689
	売建				
	米ドル	1,066,757,960	－	1,066,908,000	△150,040
	カナダドル	18,153,748,790	－	18,156,151,000	△2,402,210
	メキシコペソ	4,084,643,312	－	3,804,303,200	280,340,112
	ユーロ	7,506,106,504	－	7,252,493,360	253,613,144
	英ポンド	3,752,805,994	－	3,611,770,540	141,035,454
	豪ドル	17,732,087,454	－	16,107,970,800	1,624,116,654
合計		－	－	－	1,290,866,009

（注）時価の算定方法

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。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成23年 5月26日 至 平成24年 5月25日）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

（自 平成23年 5月26日 至 平成24年 5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23年 5月25日現在		平成24年 5月25日現在	
期首元本額	105,626,364,001円	期首元本額	103,832,249,958円
期中追加設定元本額	11,688,183,286円	期中追加設定元本額	7,177,085,269円
期中一部解約元本額	13,482,297,329円	期中一部解約元本額	19,186,139,563円
期末元本額	103,832,249,958円	期末元本額	91,823,195,664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”	3,363,574,249円	ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”	2,439,624,925円

ベアリング外国債券ファンドVA１（適格機関投資家専用）	81,295,314,652円	ベアリング外国債券ファンドVA１（適格機関投資家専用）	73,684,097,131円
ベアリング外国債券ファンド VA2（適格機関投資家専用）	2,786,388,742円	ベアリング外国債券ファンド VA2（適格機関投資家専用）	2,568,791,581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）	7,966,718,311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）	6,866,867,944円
ベアリング外国債券オープン	2,679,702,771円	ベアリング外国債券オープン	2,636,343,734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）	5,740,551,233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）	3,627,470,349円

（注）＊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。

（３）附属明細表

第１．有価証券明細表

１．株式

該当事項はありません。

２．株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	銘柄数比率	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TRSY 2.125% 15AUG21		80,417,000.00	83,754,305.50	
		US TRSY 2.625% 15AUG20		52,176,000.00	56,903,145.60	
		US TRSY 3.75% 15AUG41		16,988,000.00	20,106,996.80	
		US TRSY 4.25% 15MAY39		25,584,000.00	32,995,365.00	
		US TRSY 4.50% 15FEB36		23,164,000.00	30,768,306.87	
		US TRSY SP 0% 15FEB19		156,204,000.00	144,939,863.99	
		US TRSY SP 0% 15FEB42		25,586,000.00	10,235,628.12	
		US TRSY SP 0% 15MAY18		81,243,000.00	76,881,502.04	
		US TRSY SP 0% 15MAY30		76,014,000.00	47,858,908.48	
		US TRSY SP 0% 15MAY37		67,966,000.00	32,758,592.50	
	計	銘柄数:	10	605,342,000.00	537,202,614.90	
					(42,809,676,381)	
		組入時価比率:	28.1%		28.7%	
	カナダドル	CANADA 3.75% 01JUN19		39,900,000.00	45,577,770.00	
		CANADA 4.25% 01JUN18		21,207,000.00	24,513,171.30	
		CANADA SP 0% 01JUN17		51,368,000.00	47,740,391.84	
		CANADA SP 0% 01JUN37		31,994,000.00	17,107,831.68	
	計	銘柄数:	4	144,469,000.00	134,939,164.82	
					(10,476,676,756)	
		組入時価比率:	6.9%		7.1%	
	メキシコペソ	MEXICO 10.0% 05DEC24		325,900,000.00	431,833,795.00	
		MEXICO 8.50% 18NOV38		198,100,000.00	221,360,902.00	
	計	銘柄数:	2	524,000,000.00	653,194,697.00	

					(3,716,677,825)	
		組入時価比率:	2.4%		2.5%	
	ユーロ	DENMARK 1.75% 05OCT15		13,790,000.00	14,278,166.00	
		FRANCE 0% SP 25OCT15		51,925,000.00	50,294,035.75	
		FRANCE 3.75% 25APR21		20,290,000.00	22,473,204.00	
		GERMANY 2.75% 08APR16		23,789,000.00	26,067,986.20	
		GERMANY 4.00% 04JAN18		21,861,000.00	25,933,704.30	
		GERMANY 4.25% 04JUL39		13,851,000.00	20,381,746.50	
		GERMANY 6.5% 04JUL27		13,690,000.00	21,965,605.00	
		ITALY 3.75% 01AUG21		26,190,000.00	23,251,482.00	
		ITALY 4.00% 01FEB37		29,742,000.00	23,133,327.60	
	計	銘柄数:	9	215,128,000.00	227,779,257.35	
					(22,768,814,564)	
		組入時価比率:	15.0%		15.3%	
	英ポンド	UK TRSY 4.75% 07MAR20		21,400,000.00	26,692,220.00	
		UK TRSY 5.00% 07MAR25		21,868,000.00	28,829,677.80	
		UK TRSY SP 0% 07MAR36		54,581,000.00	25,014,472.30	
		UK TRSY SP 0% 07SEP15		24,552,000.00	24,127,250.40	
		UK TRSY SP 0% 07SEP16		20,315,000.00	19,703,518.50	
	計	銘柄数:	5	142,716,000.00	124,367,139.00	
					(15,525,993,632)	
		組入時価比率:	10.2%		10.5%	
	豪ドル	AUSTRALIA 4.50% 15APR20		103,899,000.00	115,288,408.38	
		AUSTRALIA 4.75% 21APR27		10,300,000.00	11,805,860.00	
	計	銘柄数:	2	114,199,000.00	127,094,268.38	
					(9,900,643,506)	
		組入時価比率:	6.5%		6.7%	
	小計				105,198,482,664	
					(105,198,482,664)	
地方債証券	カナダドル	ALBERTA 4.00% 01DEC19		35,773,000.00	39,923,741.19	
		ALBERTA 1.85% 01SEP16		35,376,000.00	35,574,105.60	
		BR COLMBA 4.10% 18DEC19		34,653,000.00	38,714,331.60	
		BR COLMBA 4.70% 18JUN37		12,559,000.00	15,403,613.50	
		ONTARIO 4.00% 02JUN21		21,054,000.00	23,073,078.60	
		ONTARIO 4.40% 02JUN19		17,101,000.00	19,207,843.20	
	計	銘柄数:	6	156,516,000.00	171,896,713.69	
					(13,346,060,850)	
		組入時価比率:	8.8%		9.0%	
	ユーロ	ONTARIO 4.00% 03DEC19		26,112,000.00	29,973,964.80	
		ONTARIO 4.75% 23APR19		31,277,000.00	37,310,333.30	
		QUEBEC 3.375% 20JUN16		10,000,000.00	10,880,000.00	
		QUEBEC 4.75% 29APR18		16,920,000.00	19,902,996.00	
		QUEBEC 5.00% 29APR19		20,604,000.00	24,906,115.20	
	計	銘柄数:	5	104,913,000.00	122,973,409.30	
					(12,292,421,993)	
		組入時価比率:	8.1%		8.3%	

	豪ドル	NEW S WLS 6.00% 01MAY23		11,430,000.00	13,495,401.00	
	計	銘柄数:	1	11,430,000.00	13,495,401.00 (1,051,291,737)	
		組入時価比率:	0.7%		0.7%	
	小計				26,689,774,580 (26,689,774,580)	
特殊債券	カナダドル	CA HOUS TS 1.85% 15DEC16		20,015,000.00	20,099,063.00	
		IADB 0.50% 22APR15		41,205,000.00	39,715,851.30	
	計	銘柄数:	2	61,220,000.00	59,814,914.30 (4,644,029,946)	
		組入時価比率:	3.1%		3.1%	
	ユーロ	BK NED GE 4.125% 28JUN16		13,169,000.00	14,580,716.80	
		GERMAN PST 4.25% 18JAN17		13,000,000.00	14,483,300.00	
		GERMAN PST3.375% 18JAN16		2,800,000.00	2,973,600.00	
		L RENTNBK 2.875% 30AUG21		14,293,000.00	15,447,874.40	
		NED WA BK 2.375% 04JUN15		14,100,000.00	14,664,000.00	
	計	銘柄数:	5	57,362,000.00	62,149,491.20 (6,212,463,140)	
		組入時価比率:	4.1%		4.2%	
	英ポンド	IBRD 5.40% 07JUN21		2,108,000.00	2,698,872.40	
	計	銘柄数:	1	2,108,000.00	2,698,872.40	
					(336,927,230)	
		組入時価比率:	0.2%		0.2%	
	豪ドル	EIB 6.00% 06AUG20		10,000,000.00	10,274,000.00	
		EIB 6.25% 08JUN21		2,000,000.00	2,090,800.00	
		IBRD 5.75% 17FEB15		11,269,000.00	11,976,693.20	
		IFFIM 5.75% 08DEC15		10,967,000.00	11,482,887.68	
	計	銘柄数:	4	34,236,000.00	35,824,380.88 (2,790,719,270)	
		組入時価比率:	1.8%		1.9%	
	小計				13,984,139,586 (13,984,139,586)	
社債券	ユーロ	CDP FI 3.50% 23JUN20		10,000,000.00	10,825,000.00	
	計	銘柄数:	1	10,000,000.00	10,825,000.00 (1,082,067,000)	
		組入時価比率:	0.7%		0.7%	
	豪ドル	COM BK AUS 4.50% 20FEB14		5,000,000.00	5,100,000.00	
		COM BK AUS 5.75% 17DEC13		14,933,000.00	15,484,475.69	
	計	銘柄数:	2	19,933,000.00	20,584,475.69 (1,603,530,656)	
		組入時価比率:	1.1%		1.1%	
	小計				2,685,597,656	

					(2,685,597,656)	
	合計				148,557,994,486 (148,557,994,486)	

（注）１．通貨種類毎の計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。
２．小計・合計金額の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
３．比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各計欄の合計額に対する比率であります。
４．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入国債証券時価比率	組入地方債証券時価比率	組入特殊債券時価比率	組入社債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券　10銘柄	28.1%	－	－	－	28.7%
カナダドル	国債証券　４銘柄 地方債証券　６銘柄 特殊債券　２銘柄	6.9%	8.8%	3.1%	－	19.2%
メキシコペソ	国債証券　２銘柄	2.4%	－	－	－	2.5%
ユーロ	国債証券　９銘柄 地方債証券　５銘柄 特殊債券　５銘柄 社債券　１銘柄	15.0%	8.1%	4.1%	0.7%	28.5%
英ポンド	国債証券　５銘柄 特殊債券　１銘柄	10.2%	－	0.2%	－	10.7%
豪ドル	国債証券　２銘柄 地方債証券　１銘柄 特殊債券　４銘柄 社債券　２銘柄	6.5%	0.7%	1.8%	1.1%	10.4%

（注）組入有価証券の時価比率については、通貨毎の評価額計の純資産に対する比率です。
（注）合計金額に対する比率は通貨毎に評価額計の各々の外貨建有価証券の合計金額に対する比率です。

第２．信用取引契約残高明細表
該当事項はございません。

第３．デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
(2) 注記表（デリバティブ取引に関する注記）で記載しており、ここでは省略しております。

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25年1月31日現在
Ⅰ 資産総額	3,481,754,602円
Ⅱ 負債総額	15,969,816円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,465,784,786円
Ⅳ 発行済口数	3,367,996,950口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0290円
（ １万口当たり純資産額	10,290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24年７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 ）

＜訂正後＞

イ 資本金の額および株式数

	平成25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 ）

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24年７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24年７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	28 (1)	31,601 (5,180)
	追加型	317 (137)	4,550,786 (2,982,095)
	計	345 (138)	4,582,387 (2,987,275)
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		345 (138)	4,582,387 (2,987,275)

※（ ）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25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25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	20 (4)	31,859 (18,420)
	追加型	320 (138)	5,069,835 (3,328,831)
	計	340 (142)	5,101,694 (3,347,251)
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		340 (142)	5,101,694 (3,347,251)

※（ ）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、「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ます。

２　当社は、第27期（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 あずさ監査法人の監査を受けております。

＜訂正後＞

１　当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。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ます。
　また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「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26期（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）及び第27期（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 あずさ監査法人の監査を受けており、第28期中間会計期間(平成24年４月１日から平成24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。

［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28期中間会計期間 （平成24年９月30日）
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	16,703,596
有価証券	3,999,207
前払費用	257,951
未収委託者報酬	3,221,255
未収運用受託報酬	414,813
未収投資助言報酬	455,610
未収収益	18,523
繰延税金資産	166,931
その他	2,597
流動資産合計	25,240,487

固定資産		
有形固定資産	※1	278,883
無形固定資産		387,892
投資その他の資産		
投資有価証券		5,955,910
その他		1,603,125
投資その他の資産合計		7,559,035
固定資産合計		8,225,811
資産合計		33,466,298
負債の部		
流動負債		
預り金		46,700
未払金		1,967,237
未払費用		962,591
未払法人税等		527,043
前受収益		7,481
賞与引当金		264,855
その他	※2	80,694
流動負債合計		3,856,605
固定負債		
退職給付引当金		1,583,169
固定負債合計		1,583,169
負債合計		5,439,775
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		15,729,295
利益剰余金合計		17,550,500
株主資本合計		28,179,484
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		△ 152,960
評価・換算差額等合計		△ 152,960
純資産合計		28,026,523
負債純資産合計		33,466,298

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

	第28期中間会計期間

		（自 平成24年４月１日 至 平成24年９月30日）
営業収益		
委託者報酬		12,101,664
運用受託報酬		947,312
投資助言報酬		834,061
その他の営業収益		62,525
営業収益計		13,945,563
営業費用		8,998,609
一般管理費	※１	3,693,404
営業利益		1,253,548
営業外収益	※２	24,695
営業外費用	※３	5,196
経常利益		1,273,048
特別利益		336
特別損失	※４	57,288
税引前中間純利益		1,216,096
法人税、住民税及び事業税		497,151
法人税等調整額		△ 47,995
法人税等合計		449,155
中間純利益		766,940

(3)中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

	第28期中間会計期間 （自 平成24年４月１日 至 平成24年９月30日）
株主資本	
資本金	
当期首残高	2,000,000
当中間期末残高	2,000,000
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	8,628,984
当中間期末残高	8,628,984
資本剰余金合計	
当期首残高	8,628,984
当中間期末残高	8,628,984
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	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	

当期首残高	60,000
当中間期末残高	60,000
別途積立金	
当期首残高	1,476,959
当中間期末残高	1,476,959
繰越利益剰余金	
当期首残高	15,791,435
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 829,080
中間純利益	766,940
当中間期変動額合計	△ 62,139
当中間期末残高	15,729,295
利益剰余金合計	
当期首残高	17,612,639
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 829,080
中間純利益	766,940
当中間期変動額合計	△ 62,139
当中間期末残高	17,550,500
株主資本合計	
当期首残高	28,241,623
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 829,080
中間純利益	766,940
当中間期変動額合計	△ 62,139
当中間期末残高	28,179,484
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	76,327
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）	△ 229,288
当中間期変動額合計	△ 229,288
当中間期末残高	△ 152,960
評価・換算差額等合計	
当期首残高	76,327
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）	△ 229,288
当中間期変動額合計	△ 229,288
当中間期末残高	△ 152,960
純資産合計	
当期首残高	28,317,951
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 829,080
中間純利益	766,940
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 229,288
当中間期変動額合計	△ 291,428
当中間期末残高	28,026,523

重要な会計方針

１．資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

①満期保有目的の債券

償却原価法

②子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

③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

（会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年４月１日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。これによる当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に与える影響は軽微であります。

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

３．引当金の計上基準

(1)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の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

従業員の退職金支給に備えるため、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、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に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

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第28期中間会計期間 （平成24年９月30日）
※１．有形固定資産の減価償却累計額 885,491千円
※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45,460千円の支払保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

第28期中間会計期間 （自 平成24年４月１日　至 平成24年９月30日）
※１．減価償却実施額 有形固定資産　54,001千円 無形固定資産　34,225千円
※２．営業外収益のうち主要なもの 受取利息　3,069千円 受取配当金　15,103千円
※３．営業外費用のうち主要なもの 為替差損　5,196千円
※４．特別損失のうち主要なもの 投資有価証券売却損　36,226千円 投資有価証券評価損　17,803千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第28期中間会計期間（自 平成24年４月１日 至 平成24年９月30日）

１．発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首株式数	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．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)	一株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年6月25日定時株主総会	普通株式	829,080	47,000	平成24年3月31日	平成24年6月26日

（リース取引関係）

第28期中間会計期間 （自 平成24年４月１日　至 平成24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　583,720千円 １年超　1,469,547千円 合　計　2,053,268千円

（金融商品関係）

１．金融商品の時価等に関する事項

第28期中間会計期間（平成24年９月30日）

平成24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）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	16,703,596	16,703,596	―
(2)未収委託者報酬	3,221,255	3,221,255	―
(3)未収運用受託報酬	414,813	414,813	―
(4)未収投資助言報酬	455,610	455,610	―
(5)有価証券及び投資有価証券			
①満期保有目的の債券	3,999,207	3,998,800	△407
②その他有価証券	5,922,072	5,922,072	―
(6)投資その他の資産			
①長期差入保証金	680,513	680,513	―
資産計	31,397,067	31,396,660	△407
(1)未払金			
①未払手数料	1,768,995	1,768,995	―
負債計	1,768,995	1,768,995	―

（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）

	中間貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	33,540
合計	33,838
子会社株式	
非上場株式	234,921
合計	234,921

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。当中間会計期間における減損処理額は、14,903千円です。

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。

（有価証券関係）

第28期中間会計期間（平成24年９月30日）

１．満期保有目的の債券

（単位：千円）

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	3,999,207	3,998,800	△407
小計	3,999,207	3,998,800	△407

合計	3,999,207	3,998,800	△407

２．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 234,921千円）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）

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	2,793,142	2,705,290	87,851
小計	2,793,142	2,705,290	87,851
(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	3,128,929	3,369,742	△240,812
小計	3,128,929	3,369,742	△240,812
合計	5,922,072	6,075,033	△152,960

（注）非上場株式等（中間貸借対照表計上額 33,838千円）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。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。当中間会計期間における減損処理額は、2,900千円です。

（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。

（資産除去債務等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第28期中間会計期間（自 平成24年４月１日　至 平成24年９月30日）

１．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。

２．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	12,101,664	947,312	834,061	62,525	13,945,563

(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。

（１株当たり情報）

第28期中間会計期間 （自 平成24年４月１日　至 平成24年９月30日）
１株当たり純資産額　1,588,805円19銭 １株当たり中間純利益　43,477円35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　28,026,523千円 普通株式に係る純資産額　28,026,523千円 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　766,940千円 普通株式に係る中間純利益　766,940千円 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

（追加情報）

第28期中間会計期間（自 平成24年４月１日　至 平成24年９月30日）

１．トヨタアセットマネジメント株式会社との経営統合

当社は、平成24年９月28日に、トヨタアセットマネジメント株式会社、トヨタファイナンシャルサービス株式会社、あいおいニッセイ同和損害保険株式会社、三井住友海上火災保険株式会社と、平成25年４月１日を効力発生日としてトヨタアセットマネジメント株式会社と経営統合する旨の合意書を締結致しました。

(1)目的

当社とトヨタアセットマネジメント株式会社の経営統合により、地域性や商品性などの相互補完関係を活かすことで、国内における事業基盤の飛躍的な拡大と運用・商品開発力の強化、更に、経営におけるシナジー発揮などを通じ、お客様サービスのより一層の向上が行えるとの

判断に至り、この度合意いたしました。

(2)合併する相手会社の名称
トヨタアセットマネジネント株式会社

(3)合併の方法、合併後の会社名
当該合併は、当社がトヨタアセットマネジメント株式会社の全株式を取得した後に行い、当社を存続会社とする吸収合併方式であり、トヨタアセットマネジメント株式会社は解散いたします。合併後の名称に変更はありません。

(4)合併比率、合併交付金の額、合併により発行する株式の種類及び数
当社は、トヨタアセットマネジメント株式会社の発行済株式の全てを所有する予定となっているため、合併に際しては新株の発行及び金銭等の交付はいたしません。

(5)相手会社の主な事業の内容、規模（平成24年３月期）

名称	トヨタアセットマネジメント株式会社
事業の内容	投資運用業等
資本金	600,000千円
純資産	1,385,963千円
総資産	1,833,325千円
営業収益	1,980,544千円
当期純利益	5,635千円

(6)合併の時期
平成25年４月１日（予定）

５【その他】

＜訂正前＞

イ　定款の変更、その他の重要事項

該当ありません。

ロ　訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

＜訂正後＞

イ　定款の変更、その他の重要事項

該当ありません。

ロ　訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

当ファンドの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、平成25年４月１日にトヨタアセットマネジメント株式会社と合併する予定です。

第２【その他の関係法人の概況】

原届出書「第三部 委託会社等の情報 第２ その他の関係法人の概況 １ 名称、資本金の額及び事業の内容」の記載は、下記の通り更新されます。

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社
（イ）名称　　三井住友信託銀行株式会社
（ロ）資本金の額　342,037百万円（平成24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24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24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２５年２月１２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２４年６月２７日から平成２４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。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・ワールド・パッケージ・オープンの平成２４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２４年６月２７日から平成２４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。

利害関係

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24年11月30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
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	辰 巳 幸 久

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24年４月１日から平成25年３月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成24年４月１日から平成24年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成24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24年４月１日から平成24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。

強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成24年９月28日に、トヨタアセットマネジメント株式会社、トヨタファイナンシャルサービス株式会社、あいおいニッセイ同和損害保険株式会社、三井住友海上火災保険株式会社と、平成25年４月１日を効力発生日としてトヨタアセットマネジメント株式会社と経営統合する旨の合意書を締結した。

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。