【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年3月25日提出
【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 横山　邦男
【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（売出）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（売出）内国投資信託受益証券の金額】	継続募集額(平成27年9月25日から平成28年9月20日まで) 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成27年 9月24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28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、ファンド情報の更新等を行うため、本訂正届出書により訂正を行うものです。

2【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、＜更新後＞に記載している内容は原届出書が更新されます。また、原届出書の「第二部　ファンド情報　第３　ファンドの経理状況　１　財務諸表」に中間財務諸表（比較情報を除きます。）の記載事項が追加されます。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（３）【ファンドの仕組み】

＜更新後＞

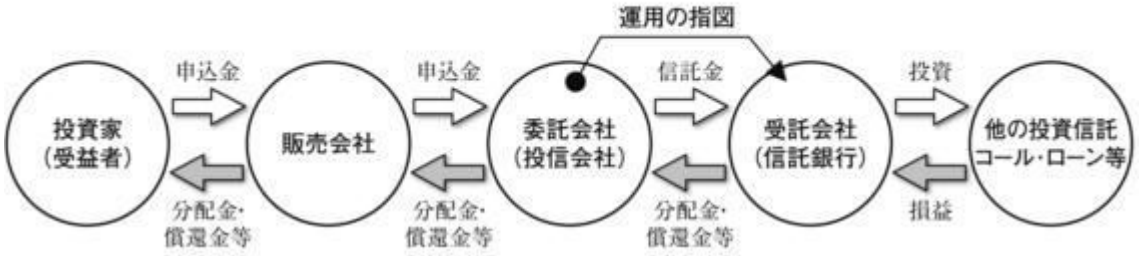
イ　当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社　「三井住友アセットマネジメント株式会社」
証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

（ロ）受託会社　「三井住友信託銀行株式会社」
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

（ハ）販売会社
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

運営の仕組み



ロ　委託会社の概況

（イ）資本金の額
2,000百万円（平成28年 1月29日現在）

（ロ）会社の沿革

昭和60年７月15日	**三生投資顧問株式会社設立**
昭和62年２月20日	**証券投資顧問業の登録**
昭和62年６月10日	**投資一任契約にかかる業務の認可**
平成11年１月１日	**三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合**
平成11年２月５日	**三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更**
平成12年１月27日	**証券投資信託委託業の認可取得**

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

（ハ）大株主の状況

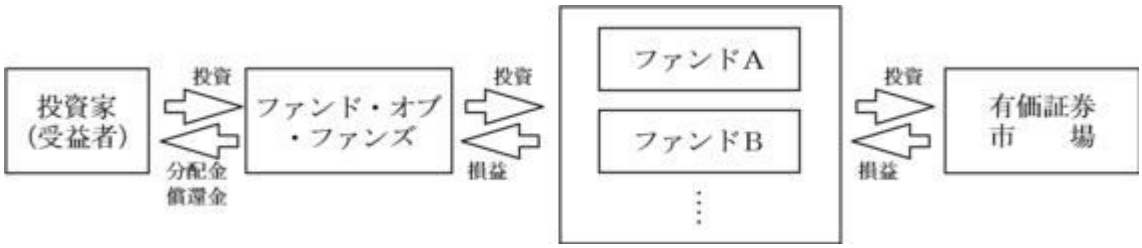
（平成28年 1月29日現在）

名称	住所	所有株式数	比率（%）
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	7,056	40.0
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	4,851	27.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目９番地	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

ハ　ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

一般に、「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券などの有価証券に直接投資するのではなく、複数の他の投資信託（ファンド）を組み入れることにより運用を行います（投資信託に投資する投資信託）。また、種々の特長を持った投資信託を購入することにより、効率的に資産配分を行います。

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



2【投資方針】

（1）【投資方針】

＜更新後＞

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	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。

※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。

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。

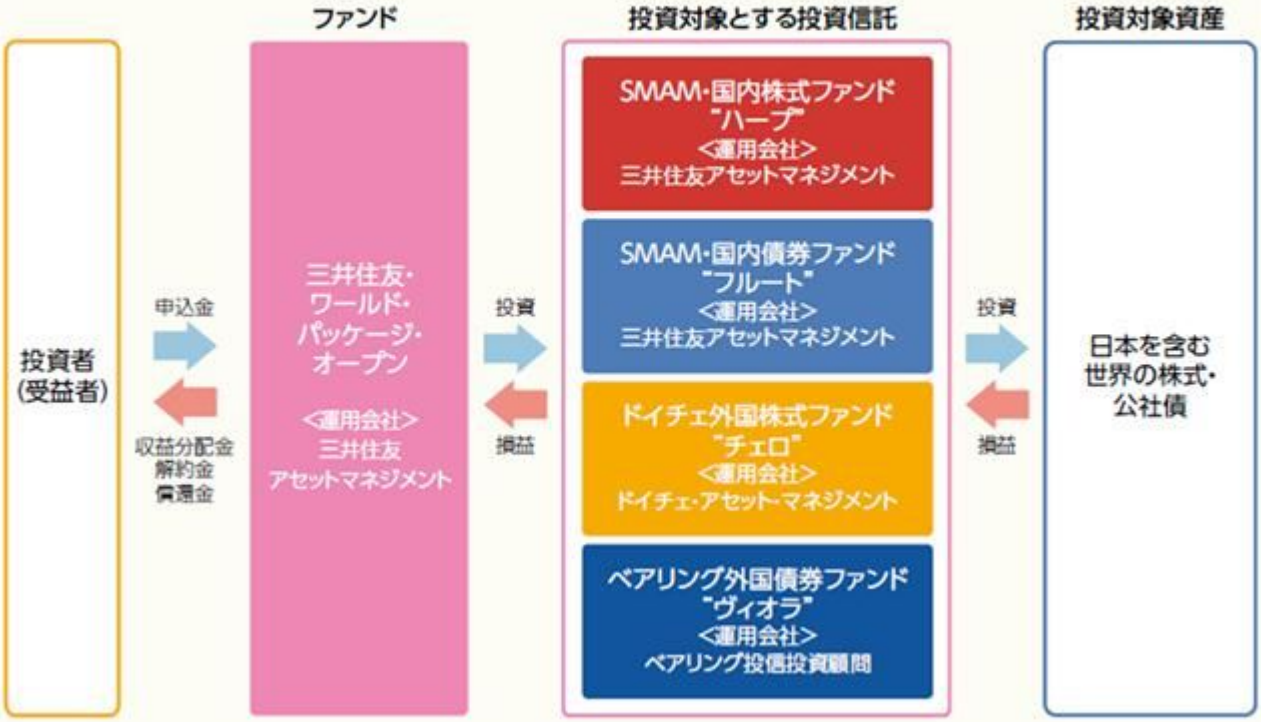
3 長期的な視点から運用を行い、安定した収益を目指します。

□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の獲得を目指します。

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

ファンドのしくみ

■ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



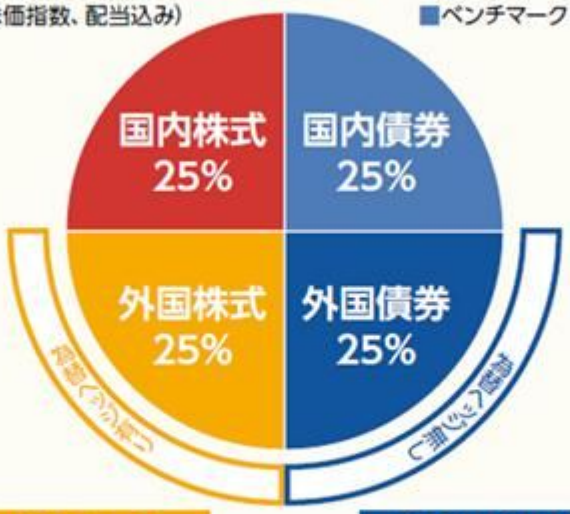
資産配分のイメージ

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：TOPIX（東証株価指数、配当込み）

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。(為替ヘッジ有り)

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。(為替ヘッジ無し)

世界分散投資と各資産への投資との元本成長比較

（期間：1996年1月末～2016年1月末）

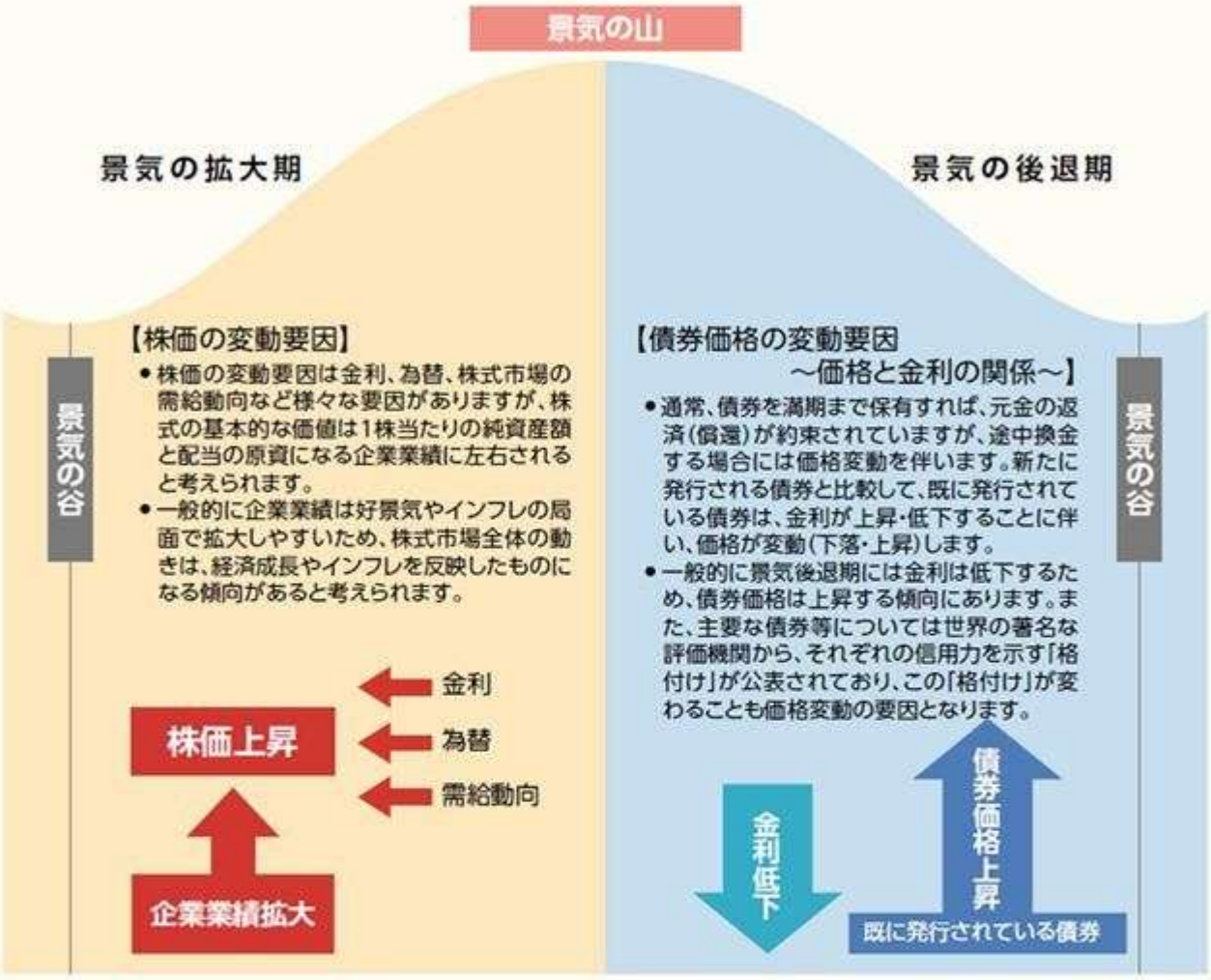
（注1）「国内株式」はTOPIX（東証株価指数、配当込み）、「国内債券」はNOMURA－BPI（総合）、「外国株式」はMSCIコクサイ（円ヘッジ・ベース）、「外国債券」はシティ世界国債インデックス（日本を除く・円換算）を用いて作成。
（注2）「4つの資産に分散」は上記の各資産を1/4ずつ保有し、3ヵ月毎にリバランスした場合を示しています。
（出所）FactSetのデータを基に三井住友アセットマネジメント作成

※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。

景気循環によって異なる値動きをする株式と債券

■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。

▶景気循環に伴う運用資産のイメージ



▶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】

＜更新後＞

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。

（ロ）実行（Do）

担当運用グループは、月次運用計画に基づき、ファンドのポートフォリオの構築、およびポートフォリオ管理の一環として日々のリスクモニタリングを行います。

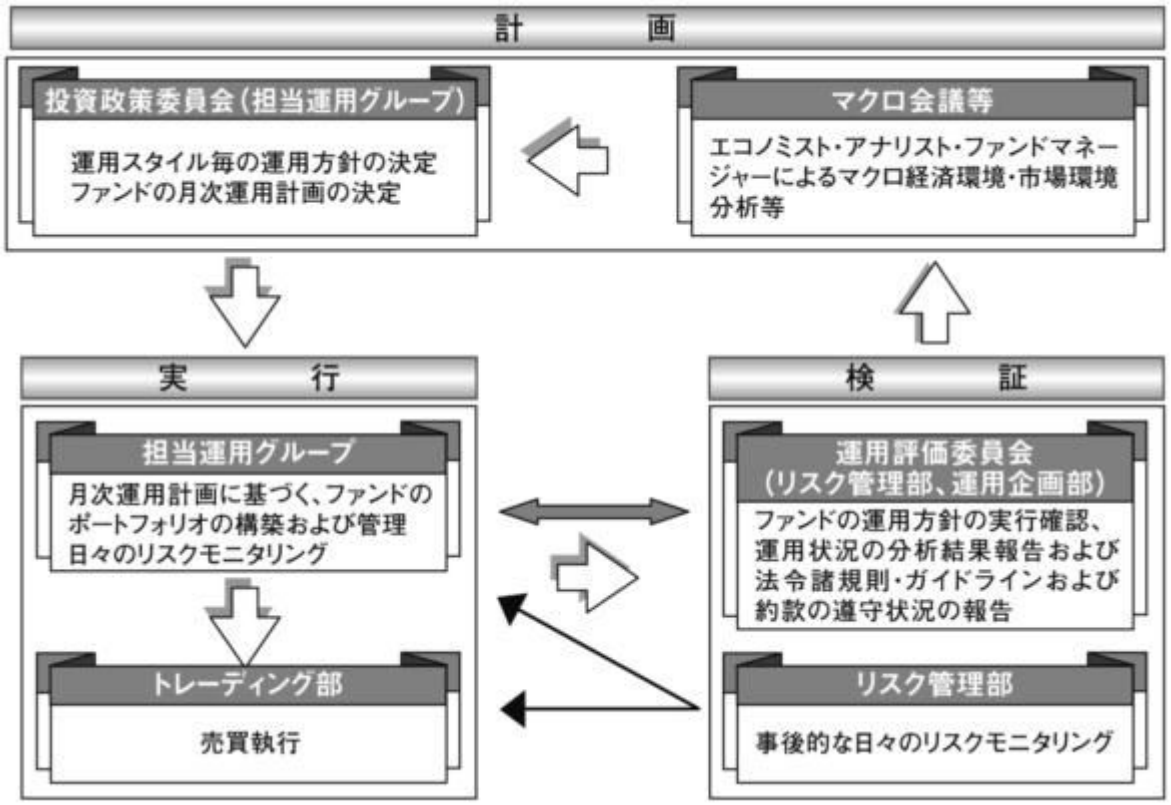
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

（ハ）検証（Check）

運用部門から組織的に分離されたリスク管理部が、約款の遵守状況等、ファンドの運営状況を日々モニタリングし、抵触があった場合直ちに担当運用グループへ状況確認がなされます。担当運用グループは対応結果をリスク管理部へ報告します。

運用評価委員会では、ファンドの運用方針の実行状況、運用状況の分析結果を確認します。また、運用の分析、評価結果、運用リスク状況、法令諸規則、運用ガイドライン、約款の遵守状況についても報告されます。

〔ファンドの運用体制〕



※リスク管理部は９名程度、運用企画部は11名程度で構成されています。

※ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。

※他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）の組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断します。

ロ　委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制
ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

（５）【投資制限】

＜更新後＞

Ⅰ　ファンドの信託約款に基づく投資制限

イ　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

ロ　外貨建資産への直接投資は行いません。

ハ　投資信託証券への投資を除いては、コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等、預金、指定金銭信託、コール・ローンおよび手形割引市場において売買される手形以外には投資を行いません。

ニ　資金の借入れ

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

（ハ）収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

（ニ）借入金の利息は信託財産中より支弁します。

Ⅱ　法令に基づく投資制限

イ　同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第９条）
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第３項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

ロ　デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第１項第８号）
委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引およ

び選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

〔ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”〕

主要運用対象	**国内株式マザーファンド（Ｅ号）を通じて、主としてわが国の取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）している株式に投資します。**
運用の基本方針	**国内株式マザーファンド（Ｅ号）を主要投資対象とし、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。** **マザーファンドの投資方針は以下の通りです。** **１．わが国の株式を投資対象とします。** **わが国の取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）している株式を主要投資対象とし、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。** **２．市場を上回る運用成果を目指します。** **中長期的にＴＯＰＩＸ（東証株価指数、配当込み）を上回る運用成果を目指します。** **３．バリュエーション指標に着目し割安銘柄を発掘することにより、超過収益を追求します。** **割安なバリュエーションを有する銘柄がファンダメンタルズを織り込み割安度が見直される過程を的確に捉えることにより、市場を上回る収益を追求します。**
ベンチマーク	**ＴＯＰＩＸ（東証株価指数、配当込み）**
決算日	**原則として５月25日**
主な投資制限	**外貨建資産への投資は行いません。**
信託報酬	**年0.6156%（税抜き0.57%）**
信託財産留保額	**換金申込受付日の基準価額に対して0.3%**
申込手数料	**ありません。**
委託会社	**三井住友アセットマネジメント株式会社**
受託会社	**三井住友信託銀行株式会社**

〔ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”〕

主要運用対象	**国内債券マザーファンド（Ｅ号）を通じて、主としてわが国の公社債を中心に投資します。**

運用の基本方針	国内債券マザーファンド（Ｅ号）を主要投資対象とし、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。 マザーファンドの投資方針は以下の通りです。 １．市場を上回る運用成果を目指します。 主としてわが国の公社債を中心に投資し、中長期的かつ安定的にＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）を上回る運用成果を目指して運用を行います。 ２．マクロ経済分析を行い、金利の動向を予測します。 公社債への投資にあたっては、マクロ経済分析による金利予測に基づいて、デュレーション・コントロールを行います。デュレーション、満期構成、セクター配分、個別銘柄選択等を機動的に決定、変更することにより、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）対比の超過収益を目指します。 ３．安全性に留意し、組入債券は、信用格付け最低Ａ－格以上です。 組入対象とする債券の信用格付けはＡ－格以上※と、信用度の高い銘柄に投資することにより、安全性にも十分に留意します。 ※格付けはＳ＆Ｐ、Ｍｏｏｄｙ’ｓ、Ｒ＆Ｉ、ＪＣＲのいずれかによるものとします。
ベンチマーク	ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）
決算日	原則として５月25日
主な投資制限	・株式への投資は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使による取得に限り信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。
信託報酬	年0.2592%（税抜き0.24%）
信託財産留保額	換金申込受付日の基準価額に対して0.1%
申込手数料	ありません。
委託会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

〔ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”〕

主要運用対象	ドイチェ外国株式マザーファンドＡ号を通じて、日本を除く世界各国の株式に投資します。
運用の基本方針	ドイチェ外国株式マザーファンドＡ号を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。実質組入外貨建資産については、原則として円に対する為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。 マザーファンドの投資方針は以下の通りです。 １．日本を除く世界各国の株式に分散投資します。 世界マクロ分析等に基づく地域配分に留意しながら、日本を除く世界各国の株式に分散投資します。 ２．企業の成長性を重視した銘柄選別を行います。 グローバルな視点から比較分析し、株価は企業がもたらすキャッシュフローの動向が決定するという考えのもと、企業の成長性を重視した銘柄選別を行います。 ３．市場を上回る運用を目指します。 ＭＳＣＩコクサイ（円ベース）を上回る運用成果を目指します。
ベンチマーク	ＭＳＣＩコクサイ（円ヘッジ・ベース）
決算日	原則として５月25日

主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。 ・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
信託報酬	年0.6804%（税抜き0.63%）
信託財産留保額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額に対して0.3%
申込手数料	ありません。
委託会社	ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

（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部門の日本における拠点であり、投資信託ビジネス・公的年金・企業年金運用の長年にわたる経験、ノウハウ及び実績を有します。グローバルな運用体制と独自の洞察力を駆使した質の高いサービスをご提供するとともに、日本市場の資産運用ニーズに的確にお応えすることを目指します。

〔ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”〕

主要運用対象	ベアリング ジャパン 外国債券 マザーファンドを通じて、信用度の高い世界各国の公社債を中心に投資を行います。
運用の基本方針	ベアリング ジャパン 外国債券 マザーファンドを主要投資対象とし、中長期的な観点から、ベンチマークであるシティ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。 マザーファンドの投資方針は以下の通りです。 １．信用度の高い世界各国の公社債を投資対象とし、市場を上回る運用を目指します。 シティ世界国債インデックス（日本を除く・円換算）を上回る運用成果を目指します。 ２．徹底したファンダメンタルズ調査により、超過収益を追求します。 ポートフォリオの構築にあたっては、信用度の調査、各国の金利動向の見通しに基づき、安定したリターンの獲得とリスクコントロールに努め、超過収益を追求します。
ベンチマーク	シティ世界国債インデックス（日本を除く・円換算）
決算日	原則として５月25日
主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への実質的投資割合には制限を設けません。
信託報酬	年0.486%（税抜き0.45%）
信託財産留保額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額に対して0.2%
申込手数料	ありません。
委託会社	ベアリング投信投資顧問株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

（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、創業250年を超える豊かな経験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、個人投資家向けに先進国および新興国の株式や債券、そしてアセット・アロケーションにおける資産運用サービスをグローバルに展開しています。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・フィナンシャル・グループの一員でもあります。

ベアリング・アセット・マネジメント・グループを含むマスミューチュアル・フィナンシャル・グループ傘下の運用会社４社は、経営統合することが予定されています。

なお、ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”の運用チーム、運用プロセス等に変更はありません。

3【投資リスク】

＜更新後＞

イ　ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、投資信託を組み入れることにより運用を行います。当ファンドが組み入れる投資信託は、主として内外の株式や債券を投資対象としており、その価格は、保有する株式や債券の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下します。当ファンドが組み入れる投資信託の価格の変動により、当ファンドの基準価額も上下します。基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

運用の結果としてファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。

当ファンドが有するリスク等（他の投資信託の組入れを通じた実質的なリスク等となります。）のうち主要なものは、以下の通りです。

（イ）株式市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、基準価額が大きく下落する要因となります。

（ロ）債券市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により債券相場が下落（金利が上昇）した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、ファンドが保有する個々の債券については、下記「信用リスク」を負うことにもなります。

（ハ）信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

（ニ）為替変動リスク

外貨建資産への投資は、円建資産に投資する場合の通常のリスクのほかに、為替変動による影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落（円高）する場合、円ベースでの評価額は下落することがあります。為替の変動（円高）は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ホ）カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

（ヘ）市場流動性リスク

ファンドの資金流出入に伴い、有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ト）換金制限等に関する留意点

投資資産の市場流動性が低下することにより投資資産の取引等が困難となった場合は、ファンドの換金申込みの受付けを中止すること、および既に受け付けた換金申込みを取り消すことがあります。

（チ）収益分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

ロ　投資リスクの管理体制

リスク管理の実効性を高め、また、コンプライアンスの徹底を図るために、運用部門から独立した組織（リスク管理部および法務コンプライアンス部）を設置し、ファンドの投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる確認等を行っています。リスク管理部では、主に投資信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングを行います。また、法務コンプライアンス部では、主に法令・諸規則等の遵守状況についての確認等を行います。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価委員会、リスク管理委員会およびコンプライアンス委員会への報告が義務づけられています。

（参考情報）投資リスクの定量的比較

※左グラフは2011年2月～2016年1月の各月末におけるファンドの直近1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。右グラフは同期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

※ファンドの分配金再投資基準価額は、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おり、実際の基準価額とは異なります。分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金再投資基準価額をもとに計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものとは異なります。

※右グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものであり、すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

<各資産クラスの指数>

日 本 株…TOPIX(配当込み)
先進国株…MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース)
新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース)
日本国債…NOMURA－BPI(国債)
先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債…JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース)
※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしております。

「TOPIX(配当込み)」は、株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象としています。
「MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース)」は、MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
「MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース)」は、MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
「NOMURA－BPI(国債)」は、野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
「シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」は、Citigroup Index LLCが開発した指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース)」は、J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。
※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

4【手数料等及び税金】

（3）【信託報酬等】

＜更新後＞

<table>
<tr><td rowspan="6"></td><td rowspan="5">ファンド</td><td colspan="3">純資産総額に年0.5562%（税抜き0.515%）の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。
信託報酬は、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。
信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率
信託報酬の実質的配分は以下の通りです。
＜信託報酬の配分（税抜き）＞</td></tr>
<tr><td>支払先</td><td>料率</td><td>役務の内容</td></tr>
<tr><td>委託会社</td><td>年0.14%</td><td>ファンド運用の指図等の対価</td></tr>
<tr><td>販売会社</td><td>年0.355%</td><td>交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価</td></tr>
<tr><td>受託会社</td><td>年0.02%</td><td>ファンド財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価</td></tr>
<tr><td colspan="3">※上記の各支払先の料率には別途消費税等相当額がかかります。</td></tr>
<tr><td>投資対象とする投資信託</td><td colspan="3">年0.5103%（税抜き0.4725%）程度
（基本資産配分による試算）</td></tr>
<tr><td colspan="2">実質的な負担</td><td colspan="3">ファンドの純資産総額に対して、年1.0665%（税抜き0.9875%）程度</td></tr>
</table>

（５）【課税上の取扱い】

＜更新後＞

イ　個別元本について

（イ）追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

（ロ）受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。

（ハ）受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）

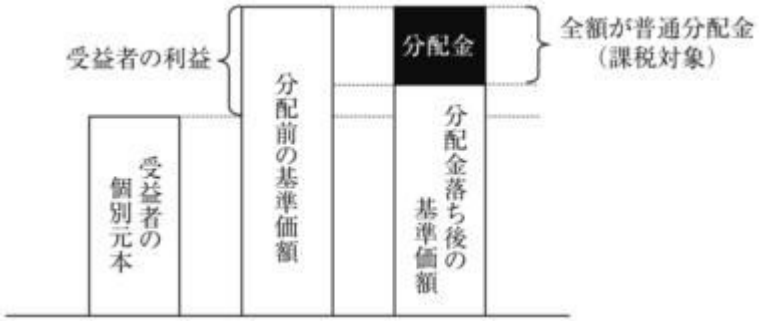
ロ　一部解約時および償還時の課税について

個人の受益者については、一部解約時および償還時の譲渡益が課税対象となり、法人の受益者については、一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

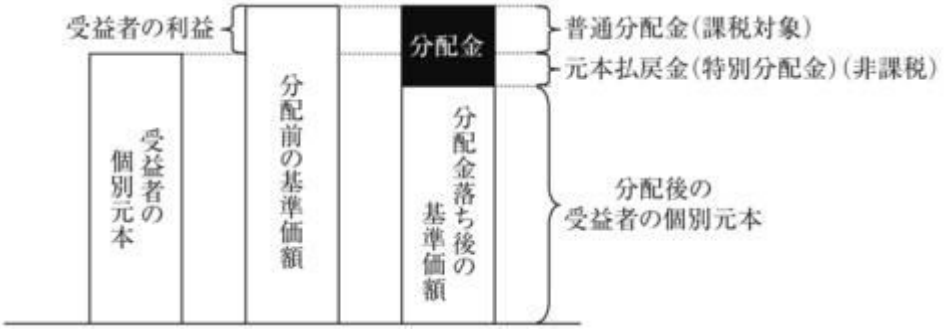
ハ　収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

①収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。



②収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



※上記①、②の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

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、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）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。

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、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）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。

また、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、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および利子等、他の上場株式等にかかる譲渡益および配当等との通算が可能です。

（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、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをＮＩＳＡの適用対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドは、受取配当にかかる益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

※少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が５年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。また、0歳から19歳の方を対象とした「ジュニアＮＩＳＡ」において、平成28年4月1日より年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となる予定です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
※当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合
外貨建資産への直接投資は行いません。
非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

※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28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】

＜更新後＞

（１）【投資状況】

三井住友・ワールド・パッケージ・オープン

平成28年 1月29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	2,770,210,942	99.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	22,444,577	0.80
合計(純資産総額)		2,792,655,519	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】

三井住友・ワールド・パッケージ・オープン

イ　主要投資銘柄

平成28年 1月29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	ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”	297,666,221	2.4138	718,508,212	2.4021	715,024,029	25.60
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”	560,292,144	1.2023	673,680,706	1.2343	691,568,593	24.76

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”	586,380,392	1.2957	759,827,150	1.1634	682,194,948	24.43
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”	564,793,512	1.4003	790,892,569	1.2065	681,423,372	24.40

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28年 1月29日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.20
合計	99.20

②【投資不動産物件】

三井住友・ワールド・パッケージ・オープン

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・ワールド・パッケージ・オープン

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

三井住友・ワールド・パッケージ・オープン

年月日	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第5期 (平成18年 6月26日)	8,259,845,247	8,408,327,725	11,126	11,326
第6期 (平成19年 6月26日)	8,284,824,296	8,420,868,747	12,180	12,380
第7期 (平成20年 6月26日)	7,146,716,630	7,278,602,597	10,838	11,038
第8期 (平成21年 6月26日)	5,512,044,153	5,512,044,153	8,661	8,661
第9期 (平成22年 6月28日)	4,964,773,110	4,964,773,110	8,851	8,851
第10期 (平成23年 6月27日)	4,322,419,063	4,322,419,063	9,077	9,077
第11期 (平成24年 6月26日)	3,464,359,450	3,464,359,450	9,024	9,024
第12期 (平成25年 6月26日)	3,234,601,973	3,294,328,417	10,831	11,031
第13期 (平成26年 6月26日)	2,838,520,015	2,885,973,775	11,963	12,163
第14期 (平成27年 6月26日)	3,072,425,834	3,118,153,004	13,438	13,638

平成27年 1月末日	2,911,141,795	—	12,926	—
2月末日	2,931,701,698	—	13,253	—
3月末日	2,912,377,926	—	13,352	—
4月末日	2,964,496,830	—	13,498	—
5月末日	3,158,866,295	—	13,695	—
6月末日	3,065,377,253	—	13,275	—
7月末日	3,087,842,106	—	13,469	—
8月末日	2,960,103,386	—	13,055	—
9月末日	2,828,924,498	—	12,503	—
10月末日	2,958,106,904	—	13,179	—
11月末日	2,952,733,247	—	13,247	—
12月末日	2,911,030,036	—	13,122	—
平成28年 1月末日	2,792,655,519	—	12,607	—

②【分配の推移】

三井住友・ワールド・パッケージ・オープン

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
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
第12期	平成24年 6月27日～平成25年 6月26日	200
第13期	平成25年 6月27日～平成26年 6月26日	200
第14期	平成26年 6月27日～平成27年 6月26日	200

③【収益率の推移】

三井住友・ワールド・パッケージ・オープン

	収益率（%）
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	22.2
第13期	12.3
第14期	14.0
第15期（中間期）	△3.0

（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】

三井住友・ワールド・パッケージ・オープン

	設定口数（口）	解約口数（口）
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	73,705,940	926,305,780
第13期	161,963,609	775,597,811
第14期	316,486,340	402,815,800
第15期（中間期）	108,901,527	177,793,619

（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）

（１）投資状況

ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ハープ”

平成28年 1月28日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	2,201,560,571	100.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	△2,571,189	△0.12
合計(純資産総額)		2,198,989,382	100.00

国内株式マザーファンド（Ｅ号）

平成28年 1月28日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	2,159,949,290	98.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	41,567,567	1.89
合計(純資産総額)		2,201,516,857	100.00

ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“ フルート ”

平成28年 1月28日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	6,745,370,910	100.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	△3,297,402	△0.05
合計(純資産総額)		6,742,073,508	100.00

国内債券マザーファンド（Ｅ号）

平成28年 1月28日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	3,832,217,850	56.81
地方債証券	日本	667,867,663	9.90
特殊債券	日本	792,919,736	11.75
社債券	日本	1,336,334,000	19.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	116,124,046	1.73
合計(純資産総額)		6,745,463,295	100.00

（２）投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

ＳＭＡＭ・国内株式ファンド“ ハープ ”

イ　主要投資銘柄

平成28年 1月28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）	1,670,126,363	1.5094	2,520,888,733	1.3182	2,201,560,571	100.12

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28年 1月28日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	100.12
合計	100.12

国内株式マザーファンド（Ｅ号）

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年 1月28日現在

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	17,900	8,214.93	147,047,247	6,883.00	123,205,700	5.60
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	29,100	2,184.31	63,563,421	2,461.50	71,629,650	3.25
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	103,500	889.57	92,070,495	627.00	64,894,500	2.95
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	261,600	249.44	65,253,504	209.30	54,752,880	2.49
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	10,200	4,748.57	48,435,414	4,475.00	45,645,000	2.07
日本	株式	大成建設	建設業	62,000	740.43	45,906,660	708.00	43,896,000	1.99
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	7,400	5,243.73	38,803,602	5,055.00	37,407,000	1.70
日本	株式	塩野義製薬	医薬品	7,100	4,659.11	33,079,681	5,177.00	36,756,700	1.67
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	1,700	19,595.79	33,312,843	21,540.00	36,618,000	1.66
日本	株式	花王	化学	5,600	5,814.74	32,562,544	6,195.00	34,692,000	1.58
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	31,100	1,257.28	39,101,408	1,101.50	34,256,650	1.56
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	6,300	7,295.37	45,960,831	5,099.00	32,123,700	1.46
日本	株式	三菱地所	不動産業	14,000	2,754.88	38,568,320	2,146.50	30,051,000	1.37
日本	株式	Ｔ＆Ｄホールディングス	保険業	21,000	1,814.26	38,099,460	1,388.50	29,158,500	1.32
日本	株式	東レ	繊維製品	29,000	1,047.78	30,385,620	1,002.50	29,072,500	1.32
日本	株式	ソニー	電気機器	11,600	3,566.74	41,374,184	2,378.00	27,584,800	1.25
日本	株式	ダイセル	化学	16,300	1,607.95	26,209,585	1,682.00	27,416,600	1.25
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	6,600	4,957.99	32,722,734	4,083.00	26,947,800	1.22
日本	株式	島津製作所	精密機器	15,000	1,642.00	24,630,000	1,789.00	26,835,000	1.22
日本	株式	国際石油開発帝石	鉱業	26,800	1,215.88	32,585,584	989.70	26,523,960	1.20
日本	株式	クボタ	機械	16,000	1,945.45	31,127,200	1,650.50	26,408,000	1.20
日本	株式	小糸製作所	電気機器	5,500	4,169.96	22,934,780	4,790.00	26,345,000	1.20
日本	株式	ヤマハ	その他製品	9,200	2,476.89	22,787,388	2,701.00	24,849,200	1.13
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	12,100	2,462.39	29,794,919	2,047.00	24,768,700	1.13
日本	株式	ディスコ	機械	2,200	10,789.83	23,737,626	11,050.00	24,310,000	1.10
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,700	17,424.47	29,621,599	13,620.00	23,154,000	1.05
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	17,000	1,607.67	27,330,390	1,347.50	22,907,500	1.04
日本	株式	東北電力	電気・ガス業	16,400	1,724.84	28,287,376	1,395.00	22,878,000	1.04
日本	株式	三井住友トラスト・ホールディングス	銀行業	57,000	547.66	31,216,620	388.20	22,127,400	1.01
日本	株式	ゆうちょ銀行	銀行業	14,000	1,664.15	23,298,100	1,578.00	22,092,000	1.00

ロ　種類別・業種別の投資比率

平成28年 1月28日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	国内	鉱業	1.20
		建設業	4.93
		食料品	2.19
		繊維製品	1.32
		パルプ・紙	0.49
		化学	9.93
		医薬品	3.79
		ガラス・土石製品	2.37
		鉄鋼	1.48
		機械	6.25
		電気機器	8.48
		輸送用機器	9.44
		精密機器	2.34
		その他製品	1.69
		電気・ガス業	1.04
		陸運業	3.85
		海運業	0.57
		空運業	0.78
		倉庫・運輸関連業	0.53
		情報・通信業	6.90
		卸売業	2.61
		小売業	3.76
		銀行業	10.56
		保険業	2.55
		その他金融業	1.31
		不動産業	3.03
		サービス業	4.71
合計			98.11

ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”

イ　主要投資銘柄

平成28年 1月28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）	5,268,586,199	1.2461	6,565,185,263	1.2803	6,745,370,910	100.05

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28年 1月28日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	100.05
合計	100.05

国内債券マザーファンド（E号）

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年 1月28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)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第３３４回利付国債（１０年）	770,000,000	102.06	785,862,000	104.06	801,331,300	0.600	2024/6/20	11.88
日本	国債証券	第１４１回利付国債（２０年）	510,000,000	110.62	564,162,000	115.88	591,013,500	1.700	2032/12/20	8.76
日本	国債証券	第２０回利付国債（３０年）	250,000,000	122.53	306,340,000	128.62	321,567,500	2.500	2035/9/20	4.77
日本	国債証券	第１２６回利付国債（５年）	310,000,000	100.30	310,938,300	100.43	311,360,900	0.100	2020/12/20	4.62
日本	国債証券	第３２回利付国債（３０年）	210,000,000	119.32	250,572,000	126.00	264,608,400	2.300	2040/3/20	3.92
日本	特殊債券	第６回政府保証地方公営企業等金融機構債券	201,000,000	103.95	208,947,540	103.70	208,455,090	1.300	2019/3/15	3.09
日本	国債証券	第３３５回利付国債（１０年）	200,000,000	101.03	202,068,000	103.20	206,404,000	0.500	2024/9/20	3.06
日本	特殊債券	第２７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	102.82	205,644,000	101.82	203,658,000	1.800	2017/2/28	3.02
日本	国債証券	第１１１回利付国債（２０年）	130,000,000	119.43	155,266,800	122.86	159,719,300	2.200	2029/6/20	2.37
日本	国債証券	第１３５回利付国債（２０年）	130,000,000	111.27	144,651,000	116.26	151,139,300	1.700	2032/3/20	2.24
日本	国債証券	第１４５回利付国債（２０年）	130,000,000	110.28	143,364,000	115.76	150,493,200	1.700	2033/6/20	2.23
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	140,136,000	107.26	150,309,873	107.25	150,307,070	1.850	2046/3/10	2.23
日本	国債証券	第４８回利付国債（３０年）	140,000,000	101.49	142,088,200	105.17	147,246,400	1.400	2045/9/20	2.18
日本	地方債証券	第６４８回東京都公募公債	140,100,000	103.69	145,273,893	102.46	143,550,663	1.840	2017/6/20	2.13
日本	国債証券	第１５０回利付国債（２０年）	125,000,000	109.59	136,995,250	109.81	137,272,500	1.400	2034/9/20	2.04
日本	地方債証券	第６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	114.55	114,559,000	115.37	115,377,000	2.000	2025/3/19	1.71
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	110,000,000	100.98	111,083,500	101.89	112,079,000	0.400	2025/9/20	1.66
日本	国債証券	第４回利付国債（４０年）	85,000,000	117.54	99,909,000	126.58	107,599,800	2.200	2051/3/20	1.60

日本	社債券	第７回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	106.03	106,036,000	105.61	105,617,000	1.606	2020/9/28	1.57
日本	社債券	第６回株式会社セブン＆アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	105.72	105,727,000	105.35	105,352,000	1.399	2020/6/19	1.56
日本	社債券	第４９回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105.76	105,769,000	105.28	105,282,000	1.472	2020/2/10	1.56
日本	社債券	第２０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105.59	105,597,000	104.84	104,842,000	1.603	2019/5/22	1.55
日本	地方債証券	平成２２年度第２回京都市公募公債	100,000,000	104.55	104,554,000	104.55	104,555,000	1.110	2020/8/27	1.55
日本	社債券	第２７回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105.09	105,091,000	104.45	104,456,000	1.608	2019/5/20	1.55
日本	社債券	第２９５回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104.72	104,720,000	104.22	104,220,000	1.434	2019/9/25	1.55
日本	社債券	第４６７回東北電力株式会社社債	100,000,000	103.32	103,324,000	103.21	103,217,000	1.095	2020/4/24	1.53
日本	国債証券	第３３６回利付国債（１０年）	100,000,000	100.92	100,921,000	103.15	103,158,000	0.500	2024/12/20	1.53
日本	国債証券	第２７回利付国債（３０年）	80,000,000	122.56	98,048,000	128.85	103,084,000	2.500	2037/9/20	1.53
日本	地方債証券	第５１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103.81	103,810,000	102.54	102,547,000	1.900	2017/6/23	1.52
日本	社債券	第４回花王株式会社無担保社債	100,000,000	101.92	101,925,000	101.97	101,976,000	0.624	2020/6/19	1.51

ロ　種類別の投資比率

平成28年 1月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	56.81
地方債証券	9.90
特殊債券	11.75
社債券	19.81
合計	98.28

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

平成28年 1月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(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	1,312,992,512	1.8620	2,444,792,058	1.6303	2,140,571,692	98.14

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ドイチェ外国株式マザーファンドA号

「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。

投資有価証券の主要銘柄(上位30銘柄)

平成28年 1月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	9,200	8,745.97	80,463,009	8,726.90	80,287,517	3.75
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,200	33,093.08	72,804,792	30,770.68	67,695,500	3.16
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	4,500	15,933.08	71,698,875	11,372.65	51,176,962	2.39
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	8,000	6,760.25	54,082,073	5,912.96	47,303,683	2.21
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	500	67,024.83	33,512,417	90,447.02	45,223,511	2.11
アメリカ	株式	CVS HEALTH CORP	食品・生活必需品小売り	3,500	12,571.68	44,000,910	11,300.13	39,550,477	1.85
香港	株式	AIA GROUP LTD	保険	59,600	796.74	47,486,223	655.29	39,055,731	1.82
ドイツ	株式	ALLIANZ SE	保険	2,000	20,150.63	40,301,277	19,188.57	38,377,146	1.79
アメリカ	株式	CELGENE CORP	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,200	14,049.92	44,959,772	11,749.77	37,599,273	1.76
アメリカ	株式	JP MORGAN CHASE&CO	銀行	5,400	8,022.14	43,319,566	6,923.43	37,386,541	1.75
イギリス	株式	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	家庭用品・パーソナル用品	3,300	10,185.08	33,610,789	10,631.16	35,082,836	1.64
アメリカ	株式	MICROSOFT CORPORATION	ソフトウェア・サービス	5,500	5,654.29	31,098,642	6,291.88	34,605,383	1.62
アメリカ	株式	UNITED TECHNOLOGIES CORPORATION	資本財	3,100	14,181.67	43,963,199	10,449.21	32,392,556	1.51
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	3,800	8,414.96	31,976,884	8,379.91	31,843,685	1.49
アメリカ	株式	TJX COMPANIES INC	小売	3,700	8,117.62	30,035,228	8,387.16	31,032,526	1.45
アメリカ	株式	WALT DISNEY CORPORATION	メディア	2,700	13,298.11	35,904,917	11,304.97	30,523,422	1.43
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	2,000	11,951.62	23,903,251	14,792.07	29,584,141	1.38
オランダ	株式	UNILEVER NV-CVA	家庭用品・パーソナル用品	5,200	5,196.92	27,024,007	5,219.39	27,140,845	1.27
イギリス	株式	NIELSEN HOLDINGS PLC	商業・専門サービス	4,700	5,537.05	26,024,158	5,663.96	26,620,651	1.24
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	301	68,077.61	20,491,361	88,351.13	26,593,692	1.24
アメリカ	株式	TIME WARNER INC	メディア	3,100	9,934.30	30,796,346	8,410.13	26,071,417	1.22
イギリス	株式	BRITISH AMERICAN TABACCO PLC	食品・飲料・タバコ	3,800	6,284.96	23,882,885	6,540.98	24,855,745	1.16
ドイツ	株式	BASF SE	素材	3,000	11,562.23	34,686,694	8,016.11	24,048,331	1.12
イギリス	株式	AON PLC	保険	2,300	12,400.05	28,520,122	10,405.69	23,933,106	1.12

アメリカ	株式	COLGATE-PALMOLIVE CO	家庭用品・パーソナル用品	3,000	8,279.59	24,838,785	7,858.96	23,576,902	1.10
アメリカ	株式	CENTENE CORP	ヘルスケア機器・サービス	3,300	8,673.63	28,622,983	7,134.95	23,545,355	1.10
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,900	12,286.81	23,344,952	12,361.37	23,486,612	1.10
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	4,800	6,636.97	31,857,465	4,881.93	23,433,309	1.09
オランダ	株式	KONINKLIJKE AHOLD NV	食品・生活必需品小売り	8,700	2,467.61	21,468,241	2,683.71	23,348,293	1.09
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,200	13,481.83	29,660,047	10,579.75	23,275,452	1.09

（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

平成28年1月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額単価（円）	帳簿価額金額（円）	評価額単価（円）	評価額金額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	ベアリング　ジャパン　外国債券　マザーファンド	879,370,309	2.5543	2,246,175,581	2.5722	2,261,916,308	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　ジャパン　外国債券　マザーファンド

「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銘柄は以下のとおりです。

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

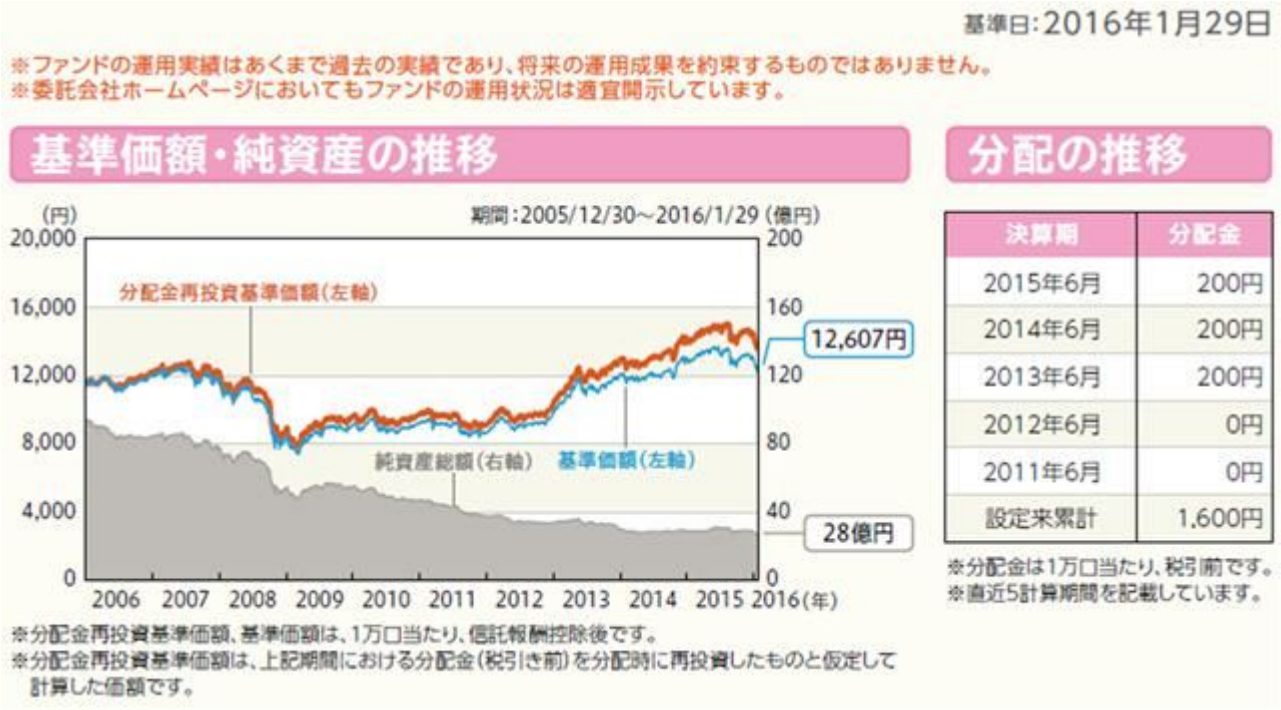
平成28年1月29日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額単価（円）	帳簿価額金額（円）	評価額単価（円）	評価額金額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
アメリカ	国債証券	US TRSY 1.75% 15MAY23	81,373,000	11,821.08	9,619,172,311	12,049.53	9,805,064,291	1.750	2023/5/15	13.56
アメリカ	国債証券	US TRSY 2.125% 15AUG21	55,830,000	12,275.55	6,853,443,585	12,464.11	6,958,715,070	2.125	2021/8/15	9.63
アメリカ	国債証券	US TRSY 2.625% 15AUG20	35,164,000	12,679.26	4,458,536,041	12,733.65	4,477,662,268	2.625	2020/8/15	6.19
アメリカ	国債証券	US TRSY SP 0% 15FEB19	29,388,200	11,548.18	3,393,802,499	11,724.35	3,445,576,880	—	2019/2/15	4.77
アメリカ	国債証券	US TRSY 3.75% 15AUG41	23,479,000	13,811.81	3,242,876,020	14,433.08	3,388,744,426	3.750	2041/8/15	4.69
イタリア	国債証券	ITALY 1.50% 01JUN25	21,781,000	13,236.91	2,883,133,355	13,350.49	2,907,870,597	1.500	2025/6/1	4.02
アメリカ	国債証券	US TRSY 1.625% 15AUG22	22,250,000	11,979.96	2,665,543,168	12,025.35	2,675,641,777	1.625	2022/8/15	3.70
アメリカ	国債証券	US TRSY 2.00% 31JUL20	20,772,000	12,308.19	2,556,657,663	12,419.39	2,579,756,210	2.000	2020/7/31	3.57
イタリア	国債証券	ITALY 4.00% 01FEB37	13,999,000	16,206.57	2,268,758,684	16,872.82	2,362,026,379	4.000	2037/2/1	3.27
イギリス	国債証券	UK TRSY 3.25% 22JAN44	11,004,000	19,547.45	2,151,001,772	20,224.37	2,225,490,379	3.250	2044/1/22	3.08
オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA 3.25% 21APR29	24,914,000	8,685.51	2,163,908,484	8,868.37	2,209,468,143	3.250	2029/4/21	3.06
イギリス	国債証券	UK TRSY 5.00% 07MAR25	8,361,000	22,090.25	1,846,966,128	22,433.22	1,875,642,211	5.000	2025/3/7	2.59
アメリカ	国債証券	US TRSY 4.50% 15FEB36	11,256,000	15,408.50	1,734,381,616	16,092.70	1,811,395,139	4.500	2036/2/15	2.51

アメリカ	国債証券	US TRSY 3.625% 15AUG19	13,165,000	13,184.49	1,735,739,373	13,114.39	1,726,510,102	3.625	2019/8/15	2.39
ドイツ	国債証券	GERMANY 2.50% 04JUL44	9,574,000	17,405.46	1,666,399,440	17,640.72	1,688,923,481	2.500	2044/7/4	2.34
オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA 5.75% 15JUL22	15,592,000	10,289.34	1,604,315,124	10,302.32	1,606,339,013	5.750	2022/7/15	2.22
アメリカ	国債証券	US TRSY 3.375% 15MAY44	10,944,000	12,993.52	1,422,011,376	13,524.14	1,480,082,352	3.375	2044/5/15	2.05
オーストラリア	国債証券	AUSTRALIA 3.25% 21APR25	16,043,000	8,799.85	1,411,760,224	8,997.72	1,443,505,246	3.250	2025/4/21	2.00
ドイツ	国債証券	GERMANY 5.50% 04JAN31	6,515,000	21,443.26	1,397,028,441	22,027.45	1,435,088,511	5.500	2031/1/4	1.99
ドイツ	国債証券	GERMANY 6.5% 04JUL27	6,260,000	21,880.62	1,369,727,260	22,078.99	1,382,145,306	6.500	2027/7/4	1.91
アメリカ	国債証券	US TRY SP 0% 15NOV22	12,250,000	10,497.55	1,285,951,039	10,756.06	1,317,618,453	—	2022/11/15	1.82
イギリス	国債証券	UK TRSY 4.75% 07DEC30	5,543,000	22,839.72	1,266,005,990	23,430.21	1,298,736,779	4.750	2030/12/7	1.80
アメリカ	国債証券	US TRSY 2.50% 15MAY24	9,493,000	12,426.64	1,179,661,381	12,640.58	1,199,970,696	2.500	2024/5/15	1.66
アメリカ	国債証券	US TRSY SP 0% 15AUG42	19,977,000	5,499.87	1,098,709,061	5,646.13	1,127,927,429	—	2042/8/15	1.56
イギリス	国債証券	UK TRSY 4.25% 07DEC27	5,143,000	21,330.01	1,097,002,790	21,836.84	1,123,068,769	4.250	2027/12/7	1.55
イギリス	国債証券	UK TRSY 2.25% 07SEP23	6,093,000	17,902.00	1,090,769,457	18,327.25	1,116,679,726	2.250	2023/9/7	1.54
フランス	国債証券	FRANCE 5.75% 25OCT32	5,015,000	21,492.16	1,077,832,010	21,990.44	1,102,820,797	5.750	2032/10/25	1.53
ドイツ	国債証券	GERMANY 0.50% 15FEB25	6,480,000	13,267.22	859,716,154	13,468.12	872,734,370	0.500	2025/2/15	1.21
オーストラリア	地方債証券	QUEENSLAND 4.75% 21JUL15	7,611,000	9,343.79	711,156,070	9,643.60	733,974,609	4.750	2025/7/21	1.02
アメリカ	国債証券	US TRSY SP 0% 15NOV24	6,875,000	9,778.38	672,263,831	10,174.34	699,486,445	—	2024/11/15	0.97

（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≫



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。
※2016年の収益率は、年初から2016年1月29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】

＜追加＞

１．当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)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。

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15期中間計算期間（平成27年 6月27日から平成27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。

【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15期中間計算期間 （平成27年12月26日現在）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	225,141
コール・ローン	32,877,643
投資信託受益証券	2,874,250,149
未収利息	18
流動資産合計	2,907,352,951
資産合計	2,907,352,951
負債の部	
流動負債	
未払解約金	8,517,372
未払受託者報酬	321,331
未払委託者報酬	7,952,995
その他未払費用	48,130
流動負債合計	16,839,828
負債合計	16,839,828
純資産の部	
元本等	
元本	2,217,466,454
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	673,046,669
元本等合計	2,890,513,123
純資産合計	2,890,513,123
負債純資産合計	2,907,352,951

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期中間計算期間 自　平成27年 6月27日 至　平成27年12月26日
営業収益	
受取利息	1,289

	第15期中間計算期間 自　平成27年 6月27日 至　平成27年12月26日
有価証券売買等損益	△83,255,342
営業収益合計	△83,254,053
営業費用	
受託者報酬	321,331
委託者報酬	7,952,995
その他費用	48,130
営業費用合計	8,322,456
営業利益又は営業損失（△）	△91,576,509
経常利益又は経常損失（△）	△91,576,509
中間純利益又は中間純損失（△）	△91,576,509
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	△3,469,358
期首剰余金又は期首欠損金（△）	786,067,288
剰余金増加額又は欠損金減少額	35,655,671
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	35,655,671
剰余金減少額又は欠損金増加額	60,569,139
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	60,569,139
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	673,046,669

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第15期中間計算期間 自　平成27年 6月27日 至　平成27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15期中間計算期間 （平成27年12月26日現在）
１．　当中間計算期間の末日における受益権の総数	2,217,466,454口
２．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.3035円
	(10,000口当たりの純資産額　13,035円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項　目	第15期中間計算期間 （平成27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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項　目	第15期中間計算期間 （平成27年12月26日現在）
期首元本額	2,286,358,546円
期中追加設定元本額	108,901,527円
期中一部解約元本額	177,793,619円

（参考）

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”

貸借対照表

（単位：円）

	（平成27年12月24日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,049
親投資信託受益証券	2,403,292,700
未収入金	5,089,998
流動資産合計	2,408,393,747
資産合計	2,408,393,747
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,089,998
未払受託者報酬	131,131
未払委託者報酬	1,114,581
流動負債合計	6,335,710
負債合計	6,335,710
純資産の部	
元本等	
元本	1,821,661,662
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	580,396,375
元本等合計	2,402,058,037
純資産合計	2,402,058,037
負債純資産合計	2,408,393,747

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 平成27年 5月26日 至 平成27年12月24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27年12月24日現在）	
1．　当計算期間の末日における受益権の総数		1,821,661,662口
2．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3186円
	(10,000口当たりの純資産額	13,186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27年12月24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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項　目	（平成27年12月24日現在）
期首元本額	2,535,992,355円
期中追加設定元本額	159,573,255円
期中一部解約元本額	873,903,948円

（参考）

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）

貸借対照表

（単位：円）

	（平成27年12月24日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,172,334
株式	2,396,212,080
未収入金	12,471,904
未収配当金	122,250
未収利息	3
流動資産合計	2,420,978,571
資産合計	2,420,978,571
負債の部	
流動負債	
未払金	12,525,196
未払解約金	5,089,998
流動負債合計	17,615,194
負債合計	17,615,194
純資産の部	
元本等	
元本	1,669,301,035
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	734,062,342
元本等合計	2,403,363,377
純資産合計	2,403,363,377
負債純資産合計	2,420,978,571

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 平成27年 5月26日 至 平成27年12月24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27年12月24日現在）	
1．　当計算期間の末日における受益権の総数		1,669,301,035口
2．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.4397円
	(10,000口当たりの純資産額	14,397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27年12月24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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成27年12月24日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,338,057,651円
同期中における追加設定元本額	131,264,220円
同期中における一部解約元本額	800,020,836円
平成27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”	1,669,301,035円
合計	1,669,301,035円

ＳＭＡＭ・国内債券ファンド“フルート”

貸借対照表

（単位：円）

	（平成27年12月24日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,749,910
親投資信託受益証券	7,439,209,051
未収入金	62,019,999
未収利息	1
流動資産合計	7,505,978,961
資産合計	7,505,978,961
負債の部	
流動負債	
未払解約金	66,719,999
未払受託者報酬	198,185

未払委託者報酬	1,387,274
流動負債合計	68,305,458
負債合計	68,305,458
純資産の部	
元本等	
元本	6,058,165,992
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,379,507,511
元本等合計	7,437,673,503
純資産合計	7,437,673,503
負債純資産合計	7,505,978,961

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 平成27年 5月26日 至 平成27年12月24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27年12月24日現在）	
1．　当計算期間の末日における受益権の総数		6,058,165,992口
2．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2277円
	(10,000口当たりの純資産額	12,277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27年12月24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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項　目	（平成27年12月24日現在）
期首元本額	8,873,035,724円
期中追加設定元本額	217,133,003円
期中一部解約元本額	3,032,002,735円

（参考）

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）

貸借対照表

（単位：円）

	（平成27年12月24日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	137,299,328
国債証券	4,317,057,500
地方債証券	668,113,382
特殊債券	795,991,841

社債券	1,536,654,000
未収入金	253,578,850
未収利息	13,412,717
前払費用	1,458,130
流動資産合計	7,723,565,748
資産合計	7,723,565,748
負債の部	
流動負債	
未払金	222,271,800
未払解約金	62,019,999
流動負債合計	284,291,799
負債合計	284,291,799
純資産の部	
元本等	
元本	5,842,922,598
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,596,351,351
元本等合計	7,439,273,949
純資産合計	7,439,273,949
負債純資産合計	7,723,565,748

注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 平成27年 5月26日 至 平成27年12月24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27年12月24日現在）	
1．　当計算期間の末日における受益権の総数		5,842,922,598口
2．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2732円
	(10,000口当たりの純資産額	12,732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27年12月24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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成27年12月24日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	8,580,770,191円
同期中における追加設定元本額	138,207,780円
同期中における一部解約元本額	2,876,055,373円
平成27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”	5,842,922,598円
合計	5,842,922,598円

ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”

(1)貸借対照表

区分	第13期計算期間 (平成26年5月26日現在)	第14期計算期間 (平成27年5月25日現在)
	金額(円)	金額(円)
資産の部		

流動資産		
親投資信託受益証券	3,917,538,982	3,575,193,295
派生商品評価勘定	37,317,930	3,812,973
未収入金	13,823,396	15,062,180
流動資産合計	3,968,680,308	3,594,068,448
資産合計	3,968,680,308	3,594,068,448
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	24,420,668	64,296,021
未払解約金	20,000	2,469,999
未払受託者報酬	1,487,047	1,340,061
未払委託者報酬	11,896,349	10,720,412
その他未払費用	420,000	432,000
流動負債合計	38,244,064	79,258,493
負債合計	38,244,064	79,258,493
純資産の部		
元本等		
元本	3,358,479,605	2,673,987,622
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	571,956,639	840,822,333
(分配準備積立金)	868,602,968	1,063,036,832
元本等合計	3,930,436,244	3,514,809,955
純資産合計	3,930,436,244	3,514,809,955
負債純資産合計	3,968,680,308	3,594,068,448

(2)損益及び剰余金計算書

区分	第13期計算期間 (自　平成25年5月28日 至　平成26年5月26日)	第14期計算期間 (自　平成26年5月27日 至　平成27年5月25日)
	金額(円)	金額(円)
営業収益		
有価証券売買等損益	569,189,586	965,442,667
為替差損益	△118,587,593	△511,926,431
営業収益合計	450,601,993	453,516,236
営業費用		
受託者報酬	3,094,799	2,803,396
委託者報酬	24,758,280	22,426,973
その他費用	929,250	1,002,240
営業費用合計	28,782,329	26,232,609
営業利益	421,819,664	427,283,627
経常利益	421,819,664	427,283,627
当期純利益	421,819,664	427,283,627
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	50,084,969	46,254,758
期首剰余金又は期首欠損金(△)	258,768,756	571,956,639
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,694,712	11,193,382
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,694,712	11,193,382
剰余金減少額又は欠損金増加額	61,241,524	123,356,557
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	61,241,524	123,356,557
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	571,956,639	840,822,333

(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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第13期計算期間 (平成26年5月26日現在)	第14期計算期間 (平成27年5月25日現在)
1.受益権の総数	3,358,479,605口	2,673,987,622口
2.1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1703円 (11,703円)	1.3144円 (13,144円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第13期計算期間 (自　平成25年5月28日 至　平成26年5月26日)	第14期計算期間 (自　平成26年5月27日 至　平成27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（84,966,792円）、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（132,164,088円）、収益調整金（424,877,835円）、分配準備積立金（651,472,088円）より、分配対象収益は、1,293,480,803円（1万口当たり3,851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(55,118,158円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(325,910,711円)、収益調整金(349,483,078円)、分配準備積立金(682,007,963円)より、分配対象収益は、1,412,519,910円(1万口当たり5,282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13期計算期間 (自　平成25年5月28日 至　平成26年5月26日)	第14期計算期間 (自　平成26年5月27日 至　平成27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・法令等遵守状況等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13期計算期間 (平成26年5月26日現在)	第14期計算期間 (平成27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13期計算期間 (平成26年5月26日現在)	第14期計算期間 (平成27年5月25日現在)
親投資信託受益証券	494,160,121	803,735,983
合計	494,160,121	803,735,983

(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13期計算期間(平成26年5月26日現在)			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち１年超(円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	113,548,247	-	113,970,888	422,641
	カナダドル	171,896,388	-	172,210,500	314,112
	ユーロ	90,742,358	-	88,802,064	△1,940,294
	イギリスポンド	89,346,308	-	88,747,988	△598,320
	スイスフラン	19,996,372	-	19,623,600	△372,772
	スウェーデンクローナ	4,455,462	-	4,390,712	△64,750
	ノルウェークローネ	14,057,255	-	13,837,366	△219,889
	オーストラリアドル	185,050,528	-	182,555,519	△2,495,009
	香港ドル	39,351,786	-	38,658,370	△693,416
	イスラエルシュケル	9,421,145	-	9,228,375	△192,770
	売建				
	アメリカドル	2,476,807,969	-	2,468,431,208	8,376,761
	カナダドル	225,457,446	-	232,369,368	△6,911,922
	ユーロ	780,864,713	-	766,605,060	14,259,653
	イギリスポンド	388,307,706	-	393,970,384	△5,662,678
	スイスフラン	405,149,337	-	393,894,000	11,255,337
	スウェーデンクローナ	54,423,055	-	52,193,708	2,229,347
	ノルウェークローネ	13,665,666	-	13,837,366	△171,700
	オーストラリアドル	177,965,307	-	182,555,519	△4,590,212
	香港ドル	76,744,340	-	76,828,875	△84,535
	イスラエルシュケル	9,266,053	-	9,228,375	37,678
	合計	5,346,517,441	-	5,321,939,245	12,897,262

区分	種類	第14期計算期間(平成27年5月25日現在)			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち１年超(円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	61,881,281	-	63,207,565	1,326,284
	カナダドル	2,166,567	-	2,166,348	△219
	ユーロ	27,685,542	-	28,359,891	674,349
	イギリスポンド	14,068,975	-	14,667,012	598,037
	スイスフラン	32,605,206	-	33,225,225	620,019
	スウェーデンクローナ	1,909,525	-	1,967,832	58,307
	ノルウェークローネ	3,583,196	-	3,792,930	209,734
	オーストラリアドル	1,123,280	-	1,138,920	15,640
	香港ドル	4,042,734	-	4,126,470	83,736
	売建				
	アメリカドル	2,303,105,526	-	2,309,454,771	△6,349,245
	カナダドル	38,702,811	-	40,151,628	△1,448,817
	ユーロ	456,600,670	-	472,852,044	△16,251,374
	イギリスポンド	238,479,226	-	249,207,408	△10,728,182
	スイスフラン	393,891,363	-	418,224,939	△24,333,576
	スウェーデンクローナ	32,653,036	-	33,499,480	△846,444

	ノルウェークローネ	53,221,146	-	56,724,141	△3,502,995
	オーストラリアドル	11,197,185	-	11,474,619	△277,434
	香港ドル	68,797,703	-	69,128,571	△330,868
	合計	3,745,714,972	-	3,813,369,794	△60,483,048

(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、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後２つの対顧客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13期計算期間 (平成26年5月26日現在)	第14期計算期間 (平成27年5月25日現在)
	金額(円)	金額(円)
元本の推移		
期首元本額	4,269,917,759	3,358,479,605
期中追加設定元本額	158,265,290	47,996,624
期中一部解約元本額	1,069,703,444	732,488,607

(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	1,909,111,601	3,575,193,295	
合計		1,909,111,601	3,575,193,295	

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に記載しております。

(参考)

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、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

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26年5月26日現在)	(平成27年5月25日現在)
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	16,681,527	9,501,709
コール・ローン	40,694,789	23,246,640
株式	3,866,149,603	3,550,813,047
未収配当金	7,906,001	6,622,373
未収利息	33	6
流動資産合計	3,931,431,953	3,590,183,775
資産合計	3,931,431,953	3,590,183,775
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	15,119	2,186
未払解約金	13,823,396	15,062,180
流動負債合計	13,838,515	15,064,366
負債合計	13,838,515	15,064,366
純資産の部		
元本等		
元本	2,707,726,695	1,909,111,601
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	1,209,866,743	1,666,007,808
元本等合計	3,917,593,438	3,575,119,409
純資産合計	3,917,593,438	3,575,119,409
負債純資産合計	3,931,431,953	3,590,183,775

(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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成26年5月26日現在)	(平成27年5月25日現在)
1.受益権の総数	2,707,726,695口	1,909,111,601口
2.1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4468円 (14,468円)	1.8727円 (18,727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25年5月28日 至 平成26年5月26日)	(自 平成26年5月27日 至 平成27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・法令等遵守状況等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26年5月26日現在)	(平成27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	(平成26年5月26日現在)	(平成27年5月25日現在)
株式	24,148,448	407,481,896
合計	24,148,448	407,481,896

(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26年5月26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	2,134,983	-	2,137,079	△2,096
	カナダドル	2,260,717	-	2,262,647	△1,930
	ユーロ	9,377,011	-	9,387,150	△10,139
	イギリスポンド	663,668	-	664,249	△581
	スウェーデンクローナ	1,175,235	-	1,175,235	0
	オーストラリアドル	390,261	-	390,593	△332
	シンガポールドル	66,695	-	66,736	△41
	合計	16,068,570	-	16,083,689	△15,119

区分	種類	(平成27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				
	ユーロ	4,868,950	-	4,871,136	△2,186
	合計	4,868,950	-	4,871,136	△2,186

(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、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後２つの対顧客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26年5月26日現在)	(平成27年5月25日現在)
	金額(円)	金額(円)
1.元本の推移		
期首元本額	3,738,353,911	2,707,726,695
期中追加設定元本額	165,618,007	56,062,611

期中一部解約元本額	1,196,245,223	854,677,705
期末元本額	2,707,726,695	1,909,111,601
2.元本の内訳		
ドイチェ外国株式ファンド“チェロ”	2,707,726,695	1,909,111,601

(3)附属明細表

①有価証券明細表

(ア)株式

通貨	銘柄	数量	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APACHE CORP	1,500	62.53	93,795.00	
	CHEVRON CORP	1,900	104.89	199,291.00	
	FMC TECHNOLOGIES INC	3,200	42.93	137,376.00	
	HALLIBURTON CO	3,400	45.91	156,094.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,900	77.01	146,319.00	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	500	320.92	160,460.00	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,200	118.35	142,020.00	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	2,100	102.90	216,090.00	
	PRAXAIR INC.	1,400	122.01	170,814.00	
	3M CO	700	160.98	112,686.00	
	CUMMINS INC	1,200	141.88	170,256.00	
	DEERE AND CO	2,300	93.35	214,705.00	
	DOVER CORPORATION	2,000	77.77	155,540.00	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	2,200	105.92	233,024.00	
	MIDDLEBY CORP	1,900	110.80	210,520.00	
	PARKER HANNIFIN CORP.	1,300	124.74	162,162.00	
	UNITED TECHNOLOGIES CORPORATION	4,300	118.62	510,066.00	
	WW GRAINGER INC	600	246.07	147,642.00	
	NIELSEN NV	6,500	45.84	297,960.00	
	UNION PACIFIC CORP	3,200	104.20	333,440.00	
	MCDONALD'S CORP	2,800	98.99	277,172.00	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	3,800	33.15	125,970.00	
	TIME WARNER INC	2,600	85.20	221,520.00	
	WALT DISNEY CORPORATION	4,800	110.26	529,248.00	
	ADVANCE AUTO PARTS INC	1,100	160.21	176,231.00	
	AUTOZONE INC	300	689.18	206,754.00	
	DOLLAR GENERAL CORP	2,500	73.56	183,900.00	
	GAP INC.	5,600	38.01	212,856.00	
	L BRANDS INC	1,000	87.46	87,460.00	
	PRICELINE GROUP INC/THE	200	1,208.50	241,700.00	
	TJX COMPANIES INC	5,200	67.16	349,232.00	
	CVS HEALTH CORP	4,800	103.95	498,960.00	
	WAL-MART STORES INC.	4,500	75.86	341,370.00	
	ARCHER DANIELS MIDLAND CO	3,100	52.67	163,277.00	
	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	1,100	98.00	107,800.00	
	MONSTER BEVERAGE CORP	2,100	129.41	271,761.00	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,600	84.15	134,640.00	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	4,200	68.50	287,700.00	
	AETNA INC	2,200	114.52	251,944.00	
	BAXTER INTERNATIONAL INC.	4,600	67.37	309,902.00	
	OMNICARE INC	2,300	96.12	221,076.00	
	AMGEN INC	1,200	163.58	196,296.00	
	BIOGEN INC	900	398.68	358,812.00	
	CELGENE CORP	4,500	116.09	522,405.00	
	GILEAD SCIENCES INC	3,000	111.71	335,130.00	
	ILLUMINA INC	900	205.00	184,500.00	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,000	183.06	183,060.00	

	JOHNSON & JOHNSON	2,100	101.35	212,835.00	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,200	125.08	150,096.00	
	CITIGROUP INC	6,700	54.97	368,299.00	
	JP MORGAN CHASE&CO	7,400	66.47	491,878.00	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,900	95.22	180,918.00	
	U.S. BANCORP	4,900	43.57	213,493.00	
	WELLS FARGO & COMPANY	11,100	56.00	621,600.00	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,300	128.27	166,751.00	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,200	144.60	173,520.00	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,800	59.54	107,172.00	
	MOODY'S CORPORATION	1,800	110.11	198,198.00	
	MSCI INC	3,700	63.42	234,654.00	
	NASDAQ OMX GROUP/THE	3,800	52.62	199,956.00	
	AON PLC	3,200	102.89	329,248.00	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,600	85.12	136,192.00	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1,100	300.31	330,341.00	
	EBAY INC	5,100	59.72	304,572.00	
	GOOGLE INC-CL A	700	554.52	388,164.00	
	GOOGLE INC-CL C	701	540.11	378,617.11	
	MICROSOFT CORPORATION	12,900	46.90	605,010.00	
	ORACLE CORP	3,500	43.93	153,755.00	
	VISA INC-CLASS A SHARES	5,100	69.62	355,062.00	
	APPLE INC	6,200	132.54	821,748.00	
	HEWLETT-PACKARD CO	4,000	34.76	139,040.00	
	TE CONNECTIVITY LTD	3,900	69.96	272,844.00	
	VERIZON COMMUNICATIONS	2,900	49.61	143,869.00	
	BROADCOM CORP-CL A	3,300	47.25	155,941.50	
小計				18,784,709.61	
				(2,286,099,159)	
カナダドル	SUNCOR ENERGY INC	5,700	37.11	211,527.00	
	BANK OF NOVA SCOTIA	2,700	64.61	174,447.00	
小計				385,974.00	
				(38,203,706)	
ユーロ	TOTAL SA	2,100	47.73	100,233.00	
	BASF SE	4,200	87.90	369,180.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	1,900	75.72	143,868.00	
	LINDE AG	600	176.58	105,950.40	
	SYMRISE AG	2,800	57.94	162,232.00	
	DEUTSCHE POST AG-REG	3,700	28.99	107,263.00	
	CONTINENTAL AG	700	218.05	152,635.00	
	LVMH MOET-HENNESSY LOUIS VUITTON	1,000	166.40	166,400.00	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	11,500	18.72	215,280.00	
	UNILEVER NV-CVA	7,100	39.44	280,059.50	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	5,200	57.47	298,844.00	
	BAYER AG	3,200	137.49	439,993.60	
	ING GROEP NV	14,300	15.00	214,500.00	
	KBC GROUPE	2,200	61.88	136,136.00	
	ALLIANZ SE	2,800	152.46	426,913.20	
小計				3,319,487.70	
				(443,815,505)	
イギリスポンド	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A UK	4,500	19.70	88,672.50	
	BHP BILLITON PLC	6,800	14.08	95,778.00	
	SOUTH32 LTD-W/I	6,800	1.16	7,905.00	
	INTERTEK GROUP PLC	3,900	26.27	102,453.00	
	COMPASS GROUP PLC	9,976	11.48	114,524.48	
	WHITBREAD PLC	1,200	52.10	62,520.00	
	NEXT PLC	1,900	74.50	141,550.00	

	BRITISH AMERICAN TABACCO PLC	5,100	36.21	184,671.00	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	4,600	58.70	270,020.00	
	OLD MUTUAL PLC	81,600	2.35	192,004.80	
小計				1,260,098.78	
				(237,352,206)	
スイスフラン	GIVAUDAN-REG	100	1,748.00	174,800.00	
	THE SWATCH GROUP AG-BR	400	391.40	156,560.00	
	NESTLE SA-REG	12,700	73.45	932,815.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,100	139.50	153,450.00	
	NOVARTIS AG-REG SHS	4,000	98.10	392,400.00	
	ROCHE HOLDING AG GENUSSCHEIN	3,200	277.90	889,280.00	
	SWISSCOM AG	500	554.00	277,000.00	
小計				2,976,305.00	
				(383,854,055)	
スウェーデンクローナ	HENNES AND MAURITZ AB B-F	3,200	340.30	1,088,960.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	5,000	223.10	1,115,500.00	
小計				2,204,460.00	
				(31,920,580)	
ノルウェークローネ	MARINE HARVEST	17,500	88.85	1,554,875.00	
	DNB ASA	12,700	139.50	1,771,650.00	
小計				3,326,525.00	
				(52,858,482)	
オーストラリアドル	AUST AND NZ BANKING GROUP	3,300	32.05	105,765.00	
小計				105,765.00	
				(10,052,963)	
香港ドル	AIA GROUP LTD	82,200	51.65	4,245,630.00	
小計				4,245,630.00	
				(66,656,391)	
合計				3,550,813,047	
				(3,550,813,047)	

(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	74銘柄	63.9%	64.3%
カナダドル	株式	2銘柄	1.1%	1.1%
ユーロ	株式	15銘柄	12.4%	12.5%
イギリスポンド	株式	10銘柄	6.6%	6.7%
スイスフラン	株式	7銘柄	10.7%	10.8%
スウェーデンクローナ	株式	2銘柄	0.9%	0.9%
ノルウェークローネ	株式	2銘柄	1.5%	1.5%
オーストラリアドル	株式	1銘柄	0.3%	0.3%
香港ドル	株式	1銘柄	1.9%	1.9%

(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に記載しております。

ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”

（1）貸借対照表

（単位：円）

期別 科目	第13期計算期間末 平成26年5月26日現在	第14期計算期間末 平成27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	3,899,244,916	3,469,463,976
流動資産合計	3,899,244,916	3,469,463,976
資産合計	3,899,244,916	3,469,463,976
負 債 の 部		
流動負債		
未払受託者報酬	852,285	759,142
未払委託者報酬	8,735,840	7,781,131
流動負債合計	9,588,125	8,540,273
負債合計	9,588,125	8,540,273
純 資 産 の 部		
元本等		
元本	1,833,908,771	1,445,800,439
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,055,748,020	2,015,123,264
(分配準備積立金)	(1,228,698,806)	(1,341,663,493)
元本等合計	3,889,656,791	3,460,923,703
純資産合計	3,889,656,791	3,460,923,703
負債純資産合計	3,899,244,916	3,469,463,976

（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14期計算期間 自平成26年5月27日 至平成27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。

（貸借対照表に関する注記）

期別 項 目	第13期計算期間末 平成26年5月26日現在	第14期計算期間末 平成27年5月25日現在
1.受益権の総数	1,833,908,771口	1,445,800,439口
2.1口当たりの純資産額	2.1210円	2.3938円
（１万口当たりの純資産額）	(21,210円)	(23,938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14期計算期間 自平成26年5月27日 至平成27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14期計算期間 自平成26年5月27日 至平成27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。 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13期計算期間（自 平成25年5月28日　至 平成26年5月26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	154,889,893
合 計	154,889,893

第14期計算期間（自 平成26年5月27日　至 平成27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	405,248,385
合 計	405,248,385

（デリバティブ取引に関する注記）

第13期計算期間末（平成26年5月26日現在）
該当事項はありません。

第14期計算期間末（平成27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14期計算期間（自 平成26年5月27日　至 平成27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14期計算期間（自 平成26年5月27日　至 平成27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13期計算期間末 平成26年5月26日現在	第14期計算期間末 平成27年5月25日現在
期首元本額	2,188,629,170円	1,833,908,771円
期中追加設定元本額	40,134,260円	26,641,087円
期中一部解約元本額	394,854,659円	414,749,419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	1,358,070,997	3,469,463,976	-
合 計	-	1,358,070,997	3,469,463,976	-

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、当ファンドの各計算期間末日（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）

対象年月日 科目	平成26年 5月26日現在	平成27年 5月25日現在
	金額	金額
資産の部		
流動資産		
預金	532,397,096	261,975,088
金銭信託	436,130	909,836
コール・ローン	593,492,985	683,276,159
国債証券	119,457,701,018	103,011,865,863
地方債証券	29,815,556,477	10,964,139,469
特殊債券	6,488,530,135	2,242,393,600
社債券	1,551,428,480	－
派生商品評価勘定	240,587,863	193,390,053
未収入金	641,942,457	3,250,152,161
未収利息	1,507,637,661	965,022,330
前払費用	202,394,867	71,665,648
流動資産合計	161,032,105,169	121,644,790,207
資産合計	161,032,105,169	121,644,790,207
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	842,878,102	1,721,038,301
未払金	－	2,499,537,577
未払解約金	542,754,605	－
流動負債合計	1,385,632,707	4,220,575,878
負債合計	1,385,632,707	4,220,575,878
純資産の部		
元本等		
元本	70,856,032,407	45,963,108,606
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	88,790,440,055	71,461,105,723
元本等合計	159,646,472,462	117,424,214,329
純資産合計	159,646,472,462	117,424,214,329
負債純資産合計	161,032,105,169	121,644,790,207

（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26年 5月27日
至 平成27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。

（貸借対照表に関する注記）

対象年月日 項目	平成26年 5月26日現在	平成27年 5月25日現在
1.受益権の総数	70,856,032,407口	45,963,108,606口
2.１口当たり純資産額	2.2531円	2.5547円
（１万口当たり純資産額）	(22,531円)	(25,547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26年 5月27日
至 平成27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

平成27年 5月25日現在

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

「（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、未収入金等の金銭債権及び未払金等の金銭債務

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25年 5月28日　至 平成26年 5月26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	△324,250,139
地方債証券	△490,158,724
特殊債券	△43,632,985
社債券	△5,555,200
合 計	△863,597,048

（自 平成26年 5月27日　至 平成27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	1,386,352,805
地方債証券	219,662,292
特殊債券	44,696,566
合 計	1,650,711,663

（デリバティブ取引に関する注記）

通貨関連

（単位：円）

平成26年 5月26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	16,286,829,675	－	16,347,682,500	60,852,825
	カナダドル	1,305,257,370	－	1,315,923,000	10,665,630
	メキシコペソ	101,579,935	－	101,846,800	266,865
	ユーロ	18,767,502,936	－	18,299,945,040	△467,557,896
	英ポンド	516,364,997	－	516,365,500	503
	スウェーデンクローナ	177,204,993	－	177,014,220	△190,773
	豪ドル	450,143,286	－	447,017,550	△3,125,736
	売 建				
	米ドル	2,742,951,725	－	2,754,250,750	△11,299,025
	カナダドル	5,791,679,874	－	5,866,019,320	△74,339,446
	メキシコペソ	1,383,780,590	－	1,429,189,000	△45,408,410
	ユーロ	1,040,689,800	－	1,018,391,400	22,298,400
	英ポンド	5,563,882,628	－	5,554,960,550	8,922,078
	スウェーデンクローナ	6,825,238,070	－	6,728,377,560	96,860,510
	ノルウェークローネ	5,358,517,119	－	5,321,932,740	36,584,379
	豪ドル	8,093,150,484	－	8,299,014,780	△205,864,296
	南アフリカランド	1,130,332,333	－	1,161,288,180	△30,955,847
合計		－	－	－	△602,290,239

（単位：円）

平成27年 5月25日現在

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち１年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買 建				
	米ドル	753,495,120	－	765,954,000	12,458,880
	カナダドル	1,968,648,528	－	2,034,206,400	65,557,872
	ユーロ	39,152,085,900	－	38,735,787,000	△416,298,900
	英ポンド	484,193,754	－	505,989,000	21,795,246
	スイスフラン	7,490,750,468	－	7,465,460,160	△25,290,308
	スウェーデンクローナ	255,056,920	－	259,264,400	4,207,480
	ノルウェークローネ	68,933,947	－	67,801,500	△1,132,447
	デンマーククローネ	1,196,828,623	－	1,200,855,000	4,026,377
	豪ドル	212,612,665	－	212,309,650	△303,015
	シンガポールドル	1,738,266,002	－	1,752,836,250	14,570,248
	南アフリカランド	159,313,600	－	161,120,000	1,806,400
	売 建				
	米ドル	26,807,829,070	－	27,208,487,200	△400,658,130
	カナダドル	8,185,186,223	－	8,439,582,000	△254,395,777
	メキシコペソ	79,549,063	－	81,370,000	△1,820,937
	ユーロ	740,743,550	－	742,090,500	△1,346,950
	英ポンド	3,948,332,533	－	4,186,767,450	△238,434,917
	スイスフラン	139,715,900	－	142,032,000	△2,316,100
	スウェーデンクローナ	1,658,806,894	－	1,682,793,200	△23,986,306
	ノルウェークローネ	1,994,191,690	－	2,137,452,200	△143,260,510
	デンマーククローネ	1,208,782,650	－	1,200,855,000	7,927,650
	豪ドル	4,875,560,400	－	4,908,183,000	△32,622,600
	シンガポールドル	3,582,653,496	－	3,700,785,000	△118,131,504
合計		－	－	－	△1,527,648,248

（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、当該日に最も近い日に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26年 5月27日 至 平成27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26年 5月27日 至 平成27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26年 5月26日現在		平成27年 5月25日現在	
期首元本額	84,196,168,545円	期首元本額	70,856,032,407円
期中追加設定元本額	5,273,995,587円	期中追加設定元本額	2,616,770,085円
期中一部解約元本額	18,614,131,725円	期中一部解約元本額	27,509,693,886円
期末元本額	70,856,032,407円	期末元本額	45,963,108,606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”	1,730,613,340円	ベアリング外国債券ファンド“ヴィオラ”	1,358,070,997円
ベアリング外国債券ファンドVA１（適格機関投資家専用）	54,374,276,560円	ベアリング外国債券ファンドVA１（適格機関投資家専用）	32,681,483,466円
ベアリング外国債券ファンド　VA2（適格機関投資家専用）	724,160,108円	ベアリング外国債券ファンド　VA2（適格機関投資家専用）	463,004,137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）	9,800,232,135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）	6,343,199,028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）	4,226,750,264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）	5,117,350,978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。

（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 1.375% 31JUL18		20,580,000.00	20,781,684.00	
		US TRSY 1.75% 15MAY23		132,076,000.00	129,170,328.00	
		US TRSY 2.00% 31JUL20		32,569,000.00	33,166,946.64	
		US TRSY 2.125% 15AUG21		84,810,000.00	86,133,036.00	
		US TRSY 2.50% 15MAY24		13,515,000.00	13,904,232.00	
		US TRSY 2.625% 15AUG20		54,878,000.00	57,567,022.00	
		US TRSY 3.375% 15MAY44		18,862,000.00	20,242,698.40	
		US TRSY 3.625% 15AUG19		49,135,000.00	53,599,375.63	
		US TRSY 3.75% 15AUG41		34,050,000.00	38,932,770.00	
		US TRSY 4.50% 15FEB36		19,024,000.00	24,252,627.49	
		US TRSY SP 0% 15AUG42		10,462,000.00	4,450,803.67	
		US TRSY SP 0% 15FEB19		46,532,200.00	44,459,357.99	
		US TRSY SP 0% 15MAY18		9,699,000.00	9,425,142.91	
		US TRSY SP 0% 15NOV24		11,828,000.00	9,569,320.38	
	計	銘柄数：	14	538,020,200.00	545,655,345.11	
					(66,406,255,499)	
		組入時価比率：	56.6%		57.0%	
	メキシコペソ	MEXICO 10.0% 05DEC24		31,300,000.00	40,554,471.00	
		MEXICO 7.75% 13NOV42		193,500,000.00	219,196,800.00	
	計	銘柄数：	2	224,800,000.00	259,751,271.00	
					(2,070,217,629)	
		組入時価比率：	1.8%		1.8%	
	ユーロ	GERMANY 2.50% 04JUL44		19,441,000.00	25,601,852.90	
		GERMANY 4.25% 04JUL39		5,308,000.00	8,729,536.80	
		ITALY 4.00% 01FEB37		12,327,000.00	14,862,663.90	
	計	銘柄数：	3	37,076,000.00	49,194,053.60	

					(6,577,244,966)
		組入時価比率：	5.6%		5.7%
	英ポンド	UK TRSY 2.25% 07SEP23		12,870,000.00	13,274,118.00
		UK TRSY 3.25% 22JAN44		13,724,000.00	15,407,934.80
		UK TRSY 4.25% 07DEC27		7,670,000.00	9,435,634.00
		UK TRSY 4.75% 07DEC30		8,474,000.00	11,167,037.20
		UK TRSY 4.75% 07MAR20		2,911,000.00	3,373,994.55
		UK TRSY 5.00% 07MAR25		13,324,000.00	16,957,588.04
	計	銘柄数：	6	58,973,000.00	69,616,306.59
					(13,112,927,509)
		組入時価比率：	11.2%		11.3%
	スウェーデンクローナ	SWEDEN 3.50% 01JUN22		171,545,000.00	206,728,879.50
	計	銘柄数：	1	171,545,000.00	206,728,879.50
					(2,993,434,175)
		組入時価比率：	2.5%		2.6%
	ノルウェークローネ	NORWAY 2.00% 24MAY23		138,833,000.00	144,316,903.50
	計	銘柄数：	1	138,833,000.00	144,316,903.50
					(2,293,195,596)
		組入時価比率：	2.0%		2.0%
	豪ドル	AUSTRALIA 3.25% 21APR29		26,287,000.00	26,481,523.80
		AUSTRALIA 5.75% 15JUL22		12,079,000.00	14,524,997.50
	計	銘柄数：	2	38,366,000.00	41,006,521.30
					(3,897,669,849)
		組入時価比率：	3.3%		3.4%
	シンガポールドル	SINGAPORE 2.875% 01SEP30		18,793,000.00	18,948,981.90
		SINGAPORE 3.00% 01SEP24		18,285,000.00	19,233,991.50
	計	銘柄数：	2	37,078,000.00	38,182,973.40
					(3,470,068,622)
		組入時価比率：	3.0%		3.0%
	南アフリカランド	SOUTH AFRICA 6.5%28FEB41		142,500,000.00	112,518,000.00
		SOUTH AFRICA10.5%21DEC26		19,460,000.00	23,151,562.00
		SOUTH AFRICA6.25%31MAR36		101,400,000.00	78,909,480.00
	計	銘柄数：	3	263,360,000.00	214,579,042.00
					(2,190,852,018)
		組入時価比率：	1.9%		1.9%
	小計				103,011,865,863
					(103,011,865,863)
地方債証券	カナダドル	ALBERTA 4.00% 01DEC19		17,029,000.00	18,961,621.21
		ALBERTA 2.55% 15DEC22		5,237,000.00	5,419,771.30
		BR COLMBA 3.20% 18JUN44		7,215,000.00	7,375,028.70
		BR COLMBA 4.10% 18DEC19		20,653,000.00	23,116,902.90
		BR COLMBA 7.875% 30NOV23		7,264,000.00	10,296,720.00
		BR COLMBA 8.75% 19AUG22		3,753,000.00	5,437,871.82
		ONTARIO 4.00% 02JUN21		10,054,000.00	11,289,636.60
		QUEBEC 9.375% 16JAN23		5,807,000.00	8,755,794.60
	計	銘柄数：	8	77,012,000.00	90,653,347.13
					(8,972,868,298)
		組入時価比率：	7.6%		7.7%
	豪ドル	NEW S WLS 6.00% 01MAY20		8,850,000.00	10,268,655.00
		NEW S WLS 6.00% 01MAY23		8,760,000.00	10,681,068.00
	計	銘柄数：	2	17,610,000.00	20,949,723.00
					(1,991,271,171)

		組入時価比率：	1.7%		1.7%	
	小計				10,964,139,469 (10,964,139,469)	
特殊債券	英ポンド	IBRD 5.40% 07JUN21		1,000,000.00	1,212,900.00	
	計	銘柄数：	1	1,000,000.00	1,212,900.00 (228,461,844)	
		組入時価比率：	0.2%		0.2%	
	豪ドル	EIB 6.25% 08JUN21		9,900,000.00	11,674,080.00	
		RENTENBK 6.25% 13APR18		8,610,000.00	9,514,050.00	
	計	銘柄数：	2	18,510,000.00	21,188,130.00 (2,013,931,756)	
		組入時価比率：	1.7%		1.7%	
	小計				2,242,393,600 (2,242,393,600)	
	合計				116,218,398,932 (116,218,398,932)	

（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・合計金額欄の（ ）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	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券　14銘柄	56.6%	-	-	57.0%
カナダドル	地方債証券 8銘柄	-	7.6%	-	7.7%
メキシコペソ	国債証券　2銘柄	1.8%	-	-	1.8%
ユーロ	国債証券　3銘柄	5.6%	-	-	5.7%
英ポンド	国債証券　6銘柄 特殊債券　1銘柄	11.2%	-	0.2%	11.5%
スウェーデンクローナ	国債証券　1銘柄	2.5%	-	-	2.6%
ノルウェークローネ	国債証券　1銘柄	2.0%	-	-	2.0%
豪ドル	国債証券　2銘柄 地方債証券 2銘柄 特殊債券　2銘柄	3.3%	1.7%	1.7%	6.8%
シンガポールドル	国債証券　2銘柄	3.0%	-	-	3.0%
南アフリカランド	国債証券　3銘柄	1.9%	-	-	1.9%

（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】

＜更新後＞

【純資産額計算書】

三井住友・ワールド・パッケージ・オープン

平成28年 1月29日現在

Ⅰ　資産総額	**2,795,986,399円**
Ⅱ　負債総額	**3,330,880円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**2,792,655,519円**
Ⅳ　発行済口数	**2,215,157,235口**
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.2607円**
（1万口当たり純資産額）	**（12,607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】

＜更新後＞

イ　資本金の額および株式数

	平成28年 1月29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

ロ　最近５年間における資本金の額の増減

該当ありません。

ハ　会社の機構

委託会社の取締役は７名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

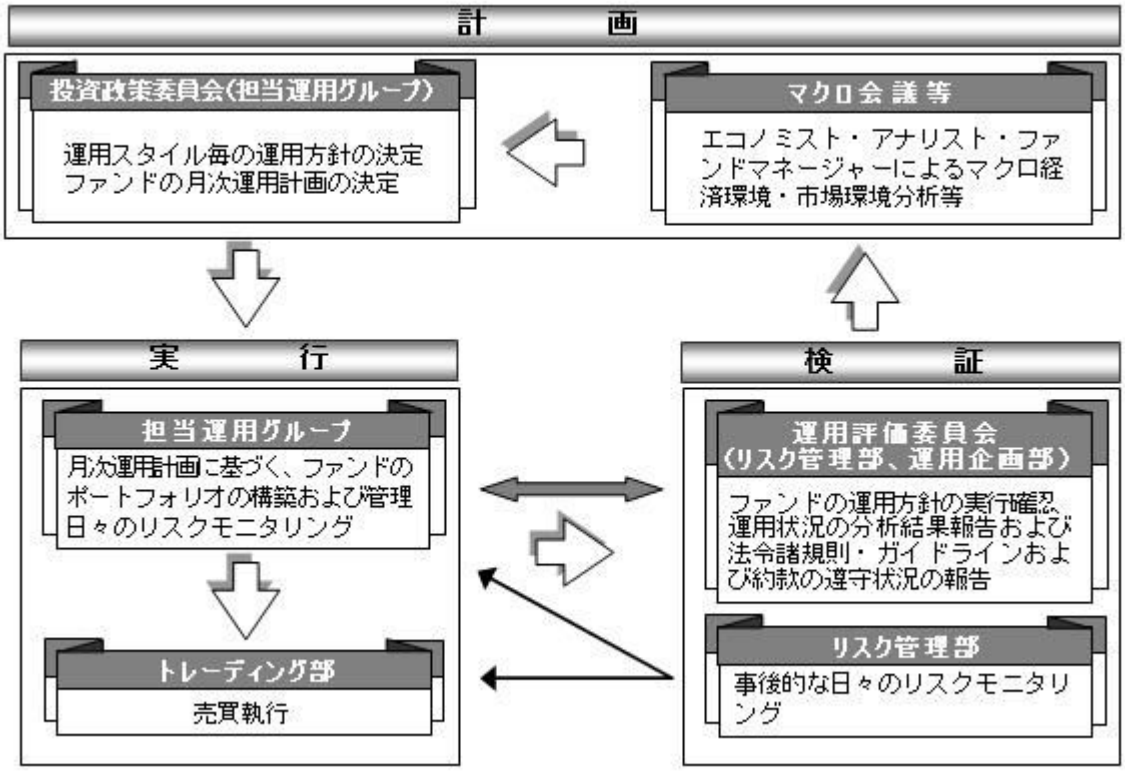
取締役の任期は、選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を１名選定し、必要に応じて取締役会長１名のほか、取締役副社長、専務取締役、常務取締役を若干名選定することができます。

ニ　投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

＜更新後＞

「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28年1月29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28年 1月29日現在）

		本　数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単位型	51 (14)	154,116 (56,306)
	追加型	468 (188)	5,031,754 (2,763,449)
	計	519 (202)	5,185,869 (2,819,755)
公社債投資信託	単位型	48 (48)	214,948 (214,948)
	追加型	4 (1)	224,496 (146,961)
	計	52 (49)	439,444 (361,909)
合　計		571 (251)	5,625,314 (3,181,664)

※（ ）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】

＜更新後＞

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30期（平成26年4月1日から平成27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31期中間会計期間(平成27年4月1日から平成27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。

（1）【貸借対照表】

(単位：千円)

		前事業年度 （平成26年３月31日）	当事業年度 （平成27年３月31日）
資産の部			
流動資産			
現金及び預金	※２	20,615,467	25,021,336
有価証券		4,999,802	-
前払費用		257,741	291,119
未収入金		4,026	41,860
未収委託者報酬		4,128,531	4,897,032
未収運用受託報酬		934,710	1,000,744
未収投資助言報酬	※２	453,941	455,390
未収収益		11,700	13,030
繰延税金資産		548,658	475,859
その他の流動資産		4,577	52,473
流動資産合計		31,959,157	32,248,847
固定資産			
有形固定資産	※１		
建物		124,723	120,234
器具備品		204,970	230,712
有形固定資産合計		329,694	350,947
無形固定資産			
ソフトウェア		517,480	497,668
ソフトウェア仮勘定		4,595	77,155
電話加入権		103	91
商標権		468	222
無形固定資産合計		522,646	575,137
投資その他の資産			
投資有価証券		6,843,224	7,151,933
関係会社株式		353,036	509,146
長期差入保証金		541,904	600,480
長期前払費用		41,193	36,031
会員権		9,480	17,299

繰延税金資産	463,476	665,425
投資その他の資産合計	8,252,316	8,980,317
固定資産合計	9,104,657	9,906,402
資産合計	41,063,815	42,155,249

（単位：千円）

		前事業年度 （平成26年３月31日）	当事業年度 （平成27年３月31日）
負債の部			
流動負債			
預り金		61,327	82,723
未払金			
未払収益分配金		671	711
未払償還金		143,230	143,201
未払手数料	※２	2,138,441	2,338,432
その他未払金		203,170	1,075,587
未払費用		1,615,419	2,095,111
未払消費税等		215,390	478,421
未払法人税等		1,623,022	454,520
賞与引当金		926,263	906,623
その他の流動負債		8	808
流動負債合計		6,926,944	7,576,142
固定負債			
退職給付引当金		1,802,340	2,633,080
固定負債合計		1,802,340	2,633,080
負債合計		8,729,285	10,209,222
純資産の部			
株主資本			
資本金		2,000,000	2,000,000
資本剰余金			
資本準備金		8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計		8,628,984	8,628,984
利益剰余金			
利益準備金		284,245	284,245
その他利益剰余金			
配当準備積立金		60,000	60,000
別途積立金		1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金		19,227,103	18,861,359
利益剰余金合計		21,048,308	20,682,564
株主資本計		31,677,292	31,311,548
評価・換算差額等			
その他有価証券			
評価差額金		657,238	634,478
評価・換算差額等合計		657,238	634,478
純資産合計		32,334,530	31,946,027
負債・純資産合計		41,063,815	42,155,249

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　平成25年４月１日 至　平成26年３月31日）	当事業年度 （自　平成26年４月１日 至　平成27年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	30,300,842	30,094,858
運用受託報酬	3,773,696	3,862,895
投資助言報酬	2,117,669	2,106,161
その他営業収益		
情報提供コンサルタント業務報酬	5,000	5,000
投資法人運用受託報酬	26,625	27,345
サービス支援手数料	24,883	18,274
その他	56,406	52,255
営業収益計	36,305,122	36,166,790
営業費用		
支払手数料	15,695,322	15,123,724
広告宣伝費	276,591	407,991
公告費	5,637	4,737
調査費		
調査費	1,028,700	1,319,743
委託調査費	3,053,376	3,550,675
営業雑経費		
通信費	38,776	38,911
印刷費	262,934	294,002
協会費	14,337	26,955
諸会費	32,186	18,577
情報機器関連費	2,277,699	2,403,857
販売促進費	40,388	28,281
その他	117,451	144,250
営業費用合計	22,843,403	23,361,707
一般管理費		
給料		
役員報酬	140,440	190,241
給料・手当	4,900,885	5,186,853
賞与	786,372	569,685
賞与引当金繰入額	926,263	906,623
交際費	24,915	22,609
寄付金	82	-
事務委託費	303,945	366,661
旅費交通費	196,933	226,254
租税公課	100,575	108,953
不動産賃借料	546,821	552,589
退職給付費用	330,002	387,799
固定資産減価償却費	227,090	287,833
諸経費	258,736	283,156
一般管理費合計	8,743,067	9,089,262
営業利益	4,718,652	3,715,820
営業外収益		
受取配当金	50,559	26,821

有価証券利息		2,660	1,187
受取利息	※１	5,190	6,113
時効成立分配金・償還金		5,958	12
原稿・講演料		2,456	1,899
還付加算金		182	-
雑収入		3,692	7,324
営業外収益合計		70,701	43,357
営業外費用			
為替差損		29,406	14,361
雑損失		38	-
営業外費用合計		29,444	14,361
経常利益		4,759,909	3,744,816
特別利益			
投資有価証券償還益		8,250	4,181
投資有価証券売却益		310,894	893,251
負ののれん発生益		186,047	-
企業結合に係る特定勘定取崩益		2,870	-
特別利益合計		508,062	897,432
特別損失			
固定資産除却損	※２	6,717	1,076
投資有価証券償還損		2,337	-
投資有価証券評価損		1,280	-
投資有価証券売却損		454	1,091
合併関連費用		17,767	-
事務所移転費用		1,313	-
その他の特別損失	※３	-	973,862
特別損失合計		29,870	976,030
税引前当期純利益		5,238,102	3,666,218
法人税、住民税及び事業税		2,147,762	1,574,213
法人税等調整額		△ 282,886	166,505
法人税等合計		1,864,875	1,740,718
当期純利益		3,373,226	1,925,499

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　平成25年４月１日　至　平成26年３月31日）

（単位　：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金合計	
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	16,718,237	18,539,441	29,168,425
当期変動額									
剰余金の配当							△ 864,360	△ 864,360	△ 864,360
当期純利益							3,373,226	3,373,226	3,373,226
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	－	－	－	－	－	－	2,508,866	2,508,866	2,508,866
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,227,103	21,048,308	31,677,292

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	529,488	529,488	29,697,914
当期変動額			
剰余金の配当			△ 864,360
当期純利益			3,373,226
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	127,749	127,749	127,749
当期変動額合計	127,749	127,749	2,636,616
当期末残高	657,238	657,238	32,334,530

当事業年度（自　平成26年４月１日　至　平成27年３月31日）

（単位　：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金合計	
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,227,103	21,048,308	31,677,292
会計方針の変更による累積的影響額							△ 439,043	△ 439,043	△ 439,043
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,788,060	20,609,264	31,238,248
当期変動額									
剰余金の配当							△ 1,852,200	△ 1,852,200	△ 1,852,200
当期純利益							1,925,499	1,925,499	1,925,499
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	－	－	－	－	－	－	73,299	73,299	73,299
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	657,238	657,238	32,334,530
会計方針の変更による累積的影響額			△ 439,043
会計方針の変更を反映した当期首残高	657,238	657,238	31,895,486
当期変動額			
剰余金の配当			△ 1,852,200
当期純利益			1,925,499
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 22,759	△ 22,759	△ 22,759
当期変動額合計	△ 22,759	△ 22,759	50,540
当期末残高	634,478	634,478	31,946,027

[注記事項]

(重要な会計方針)

１.有価証券の評価基準及び評価方法

(1)満期保有目的の債券

償却原価法

(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

決算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。

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、当事業年度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計上しております。

①退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、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。

(会計方針の変更)

(退職給付に関する会計基準等の適用)

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号　平成24年５月17日。以下「退職給付会

計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号　平成27年３月26日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当事業年度より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更いたしました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従って、当事業年度の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当事業年度の期首の退職給付引当金が682,168千円、繰延税金資産が243,124千円増加し、繰越利益剰余金が439,043千円減少しております。また、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ28,067千円減少しております。

なお、１株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

(貸借対照表関係)

※１　有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成26年３月31日)	当事業年度 (平成27年３月31日)
建物	241,339千円	258,412千円
器具備品	704,790千円	783,602千円

※２　関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (平成26年３月31日)	当事業年度 (平成27年３月31日)
現金及び預金	14,959,545千円	18,853,119千円
未収投資助言報酬	290,426千円	286,990千円
未払手数料	360,659千円	392,772千円

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。当事業年度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。

	前事業年度 (平成26年３月31日)	当事業年度 (平成27年３月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	－千円	－千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

４　保証債務

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、前事業年度は平成27年6月まで、当事業年度は平成35年６月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (平成26年３月31日)	当事業年度 (平成27年３月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York)Inc.	27,470千円	355,376千円

(損益計算書関係)

※１ 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

	前事業年度 （自　平成25年４月１日 至　平成26年３月31日）	当事業年度 （自　平成26年４月１日 至　平成27年３月31日）
受取利息	2,104千円	2,463千円

※２　固定資産除却損

	前事業年度 （自　平成25年４月１日 至　平成26年３月31日）	当事業年度 （自　平成26年４月１日 至　平成27年３月31日）
器具備品	864千円	1,076千円
ソフトウェア	5,853千円	－千円
計	6,717千円	1,076千円

※３　その他の特別損失

その他の特別損失は、中国において同国国家税務総局が平成26年11月17日付で公布した財税[2014]79号通達に基づき、当社が委託者として運用する証券投資信託に関し、適格国外機関投資家として課される平成21年11月17日から平成26年11月16日までに行われた中国A株投資のキャピタル・ゲインに対して遡及的に徴される源泉所得税等について納付すべきと見込まれる金額を計上したものであります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成25年４月１日　至 平成26年３月31日)

１.発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	－	－	17,640株

２.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

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25年６月24日定時株主総会	普通株式	864,360	49,000	平成25年３月31日	平成25年６月25日

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

平成26年６月26日開催の第29回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	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26年６月26日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,852,200	105,000	平成26年３月31日	平成26年６月27日

当事業年度(自 平成26年４月１日 至 平成27年３月31日)

１.発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	－	－	17,640株

２.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

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26年６月26日定時株主総会	普通株式	1,852,200	105,000	平成26年３月31日	平成26年６月27日

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

平成27年６月30日開催の第30回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	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27年６月30日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	952,560	54,000	平成27年３月31日	平成27年７月１日

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

（借主側）

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

（単位：千円）

	前事業年度 （平成26年３月31日）	当事業年度 （平成27年３月31日）
1年以内	525,188	572,402
1年超	751,482	1,340,637
合計	1,276,671	1,913,040

(金融商品関係)

１.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っています。そのため、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っていません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬及び未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。未収委託者報酬は、信託財産中から支弁されるものであり、信託財産については受託者である信託銀行において分別管理されているため、リスクは僅少となっています。

有価証券及び投資有価証券については、主に満期保有目的の債券及び事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の海外子会社の株式及び50%出資した海外関連会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて１年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスクの管理

当社は、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、営業債権について、取引先毎の期日管理及び残高管理を行うとともに、その状況について取締役会に報告しています。

満期保有目的の債券は、余資運用規則に基づき、短期の国債のみを対象としているため、信用リスクは僅少であります。

有価証券、投資有価証券、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

長期差入保証金についても、差入先の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

②市場リスクの管理

有価証券及び投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、企画部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。

なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等に基づく価額のほか、

これらの価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件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があります。

２.金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。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、次表には含まれていません（（注２）参照）。

前事業年度（平成26年３月31日）

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	20,615,467	20,615,467	－
(2)未収委託者報酬	4,128,531	4,128,531	－
(3)未収運用受託報酬	934,710	934,710	－
(4)未収投資助言報酬	453,941	453,941	－
(5)有価証券及び投資有価証券			
①満期保有目的の債券	4,999,802	4,999,500	△302
②その他有価証券	6,811,166	6,811,166	－
(6)長期差入保証金	541,904	541,904	－
資産計	38,485,524	38,485,221	△302
(1)未払金			
①未払手数料	2,138,441	2,138,441	－
負債計	2,138,441	2,138,441	－

当事業年度（平成27年３月31日）

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	25,021,336	25,021,336	－
(2)未収委託者報酬	4,897,032	4,897,032	－
(3)未収運用受託報酬	1,000,744	1,000,744	－
(4)未収投資助言報酬	455,390	455,390	－
(5)有価証券及び投資有価証券			
①満期保有目的の債券	－	－	－
②その他有価証券	7,131,075	7,131,075	－
(6)長期差入保証金	600,480	600,480	－
資産計	39,106,059	39,106,059	－
(1)未払金			
①未払手数料	2,338,432	2,338,432	－
負債計	2,338,432	2,338,432	－

(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)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の貸借対照表計上額

(単位：千円)

	前事業年度 （平成26年３月31日）	当事業年度 （平成27年３月31日）
その他有価証券		
非上場株式	298	298
投資証券	31,760	20,560
合計	32,058	20,858
子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	353,036	509,146
合計	353,036	509,146

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。

子会社株式及び関連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。

(注３)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成26年３月31日）

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	20,615,467	－	－	－
未収委託者報酬	4,128,531	－	－	－
未収運用受託報酬	934,710	－	－	－
未収投資助言報酬	453,941	－	－	－
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	5,000,000	－	－	－
その他有価証券のうち				
満期があるもの	－	－	－	－
長期差入保証金	23,475	518,429	－	－
合計	31,156,125	518,429	－	－

当事業年度（平成27年３月31日）

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	25,021,336	－	－	－
未収委託者報酬	4,897,032	－	－	－
未収運用受託報酬	1,000,744	－	－	－
未収投資助言報酬	455,390	－	－	－
長期差入保証金	4,148	596,332	－	－
合計	31,378,651	596,332	－	－

(有価証券関係)

１.満期保有目的の債券

前事業年度(平成26年３月31日)

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの ―	―	―	―
小計	―	―	―
(2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの 国債	4,999,802	4,999,500	△302
小計	4,999,802	4,999,500	△302
合計	4,999,802	4,999,500	△302

当事業年度（平成27年３月31日）

該当事項はありません。

２.子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成26年３月31日）

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額　関係会社株式353,036千円）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。

当事業年度（平成27年３月31日）

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額　関係会社株式509,146千円）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

前事業年度(平成26年３月31日)

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	6,390,685	5,387,490	1,003,195
小計	6,390,685	5,387,490	1,003,195
(2)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	420,480	424,165	△3,684
小計	420,480	424,165	△3,684
合計	6,811,166	5,811,655	999,510

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額　32,058千円）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「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、1,280千円です。

当事業年度（平成27年３月31日）

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	5,826,531	4,894,554	931,977
小計	5,826,531	4,894,554	931,977
(2)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	1,304,543	1,312,300	△7,756
小計	1,304,543	1,312,300	△7,756
合計	7,131,075	6,206,854	924,220

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額　20,858千円）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。

４.当事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成25年４月１日　至 平成26年３月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,097,321	310,894	454

当事業年度(自 平成26年４月１日　至 平成27年３月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
3,892,685	893,251	1,091

(退職給付関係)

１．採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

２．確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 （自 平成25年４月１日 至 平成26年３月31日）	当事業年度 （自 平成26年４月１日 至 平成27年３月31日）
退職給付債務の期首残高	1,605,470	1,802,340
会計方針の変更による累積的影響額	－	682,168
会計方針の変更を反映した期首残高	1,605,470	2,484,508
勤務費用	184,549	217,881
利息費用	25,192	18,161
数理計算上の差異の発生額	△21,670	△276
退職給付の支払額	△93,535	△87,196
過去勤務費用の発生額	27,157	－
その他	75,176	－
退職給付債務の期末残高	1,802,340	2,633,080

（注）その他は、トヨタアセットマネジメント株式会社との合併により引き継いだ退職給付債務額になります。

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 （平成26年３月31日）	当事業年度 （平成27年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	1,802,340	2,633,080
未認識数理計算上の差異	－	－
未認識過去勤務費用	－	－
退職給付引当金	1,802,340	2,633,080

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度 （自 平成25年４月１日 至 平成26年３月31日）	当事業年度 （自 平成26年４月１日 至 平成27年３月31日）
勤務費用	184,549	217,881
利息費用	25,192	18,161
数理計算上の差異の費用処理額	△21,670	△276

過去勤務費用の費用処理額	27,157	―
その他	114,773	152,031
確定給付制度に係る退職給付費用	330,002	387,799

（注）その他は、その他の関係会社等からの出向者の年金掛金負担分及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金並びに確定拠出年金への拠出額になります。

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

	前事業年度 （自 平成25年４月 １日 至 平成26年３月 31日）	当事業年度 （自 平成26年４月 １日 至 平成27年３月 31日）
割引率	1.5%	0.731%

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度43,539千円、当事業年度105,357千円であります。

(税効果会計関係)

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 （平成26年３月31日）	当事業年度 （平成27年３月31日）
流動の部		
繰延税金資産		
未払金	―	321,602
賞与引当金	330,120	299,729
調査費	62,002	77,863
未払事業税	123,029	49,504
その他	33,507	48,762
繰延税金資産小計	548,658	797,462
評価性引当額	―	△321,602
繰延税金資産合計	548,658	475,859
固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	642,354	849,431
特定外国子会社留保金額	226,680	211,024
ソフトウェア償却	105,651	62,560
投資有価証券評価損	50,143	43,051
その他	6,970	6,291
繰延税金資産小計	1,031,799	1,172,360
評価性引当額	△233,276	△217,192
繰延税金資産合計	798,523	955,168
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	334,588	289,742
その他	457	―
繰延税金負債合計	335,046	289,742
繰延税金資産の純額	1,012,135	1,141,285

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 （平成26年３月31日）	当事業年度 （平成27年３月31日）
法定実効税率	38.0%	35.6%
（調整）		
評価性引当額の増減	△0.5	9.6
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.3	0.2
受取配当等永久に益金に算入されない項目	－	△0.5
住民税均等割等	0.1	0.2
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.7	3.7
所得税額控除による税額控除	－	△1.3
負ののれん発生益	△1.3	－
企業結合に係る特定勘定取崩	△1.5	－
その他	△0.1	△0.1
税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.6	47.5

３．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第９号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第２号）が平成27年３月31日に公布されたことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算（ただし、平成27年４月１日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の35.6%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成27年４月１日から平成28年３月31日までのものは33.1%、平成28年４月１日以降のものについては32.3%にそれぞれ変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が106,175千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が136,532千円、その他有価証券評価差額金が30,357千円それぞれ増加しております。

(セグメント情報等)

前事業年度(自 平成25年４月１日 至 平成26年３月31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	30,300,842	3,773,696	2,117,669	112,914	36,305,122

(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、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。

３.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

４.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

５.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

当社は単一セグメントのため、記載を省略しております。

当事業年度(自 平成26年４月１日 至 平成27年３月31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	30,094,858	3,862,895	2,106,161	102,874	36,166,790

(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、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。

３.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

４.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

５.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 平成25年４月１日 至 平成26年３月31日)

１.親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) 直接 40 %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	3,299,099	未払手数料	257,411
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	270,000,000	生命保険業	(被所有) 直接27.5 %	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,127,963	未収投資助言報酬	290,426

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
２．取引条件及び取引条件の決定方針等
(1)投資助言契約の受託については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。
(2)投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

２.子会社及び関連会社等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
関連会社	UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.	Singapore	3,000,000(シンガポールドル)	投資運用業	(所有) 直接50 %	投信の販売委託 役員の兼任	出資の引受	118,725	－	－

（注）１．UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.の出資の引受は、新規法人設立のため行ったものであります。

３.その他の関係会社の子会社等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	－ %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,037,816	未払手数料	403,591

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
２．取引条件及び取引条件の決定方針等
(1)投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

当事業年度(自 平成26年４月１日 至 平成27年３月31日)

１.親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) 直接 40 %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,527,962	未払手数料	289,954
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	270,000,000	生命保険業	(被所有) 直接27.5 %	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,072,459	未収投資助言報酬	286,990

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
２．取引条件及び取引条件の決定方針等
(1)投資助言契約の受託については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。
(2)投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

２.子会社及び関連会社等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高

子会社	ソーラーエナジー投資合同会社	東京都港区	20,000	投資運用業	(所有) 100% 直接100	投資事業有限責任組合の運営及び管理	出資の引受	20,000	－	－
関連会社	UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.	Singapore	6,000,000 (シンガポールドル)	投資運用業	(所有) 50% 直接50	投信の販売委託 役員の兼任	増資の引受	136,110	－	－

（注）１．ソーラーエナジー投資合同会社の出資の引受は、新規法人設立のため行ったものであります。
２．UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.の増資の引受については、当社とUOBアセットマネジメント社がそれぞれ1,500,000(シンガポールドル）出資しました。

３.その他の関係会社の子会社等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	－ %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,705,879	未払手数料	697,658

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
２．取引条件及び取引条件の決定方針等
(1)投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

(１株当たり情報)

	前事業年度（自 平成25年４月１日 至 平成26年３月31日）	当事業年度（自 平成26年４月１日 至 平成27年３月31日）
１株当たり純資産額	1,833,023.27円	1,810,999.27円
１株当たり当期純利益金額	191,226.00円	109,155.30円

（注）１．潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
２．「会計方針の変更に関する注記」に記載のとおり、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当事業年度の期首の１株当たり純資産額が、24,889円09銭減少し、１株当たり当期純利益金額は、1,591円10銭減少しております。
３．１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度（自 平成25年４月１日 至 平成26年３月31日）	当事業年度（自 平成26年４月１日 至 平成27年３月31日）
１株当たり当期純利益金額		
当期純利益（千円）	3,373,226	1,925,499
普通株主に帰属しない金額（千円）	－	－
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	3,373,226	1,925,499
期中平均株式数（株）	17,640	17,640

(重要な後発事象)

１.日興グローバルラップ株式会社の株式の取得（子会社化）について

当社は、平成26年12月26日開催の取締役会において、当社が日興グローバルラップ株式会社（以下「NGW」）の発行済株式の全部を取得し子会社化することを決議し、平成26年12月26日付にて株式譲渡契約を締結し、平成27年4月1日付にて発行済株式を取得いたしました。

(1)株式取得の目的

NGWは、国内外資産の効率的な配分と、海外運用会社の評価・選定に特化した大変特徴ある運用

会社であり、既に「日興・新経済成長国エクイティ・ファンド（EG5）」や「日興ワールド　CBファンド」等の商品で当社と協働しております。本件子会社化は、外部委託運用機能の強化、アセットアロケーション機能の強化及びファンドラップビジネスへの参画の3つの分野において当社事業に対するプラスをもたらすと考えております。今後、当社はNGWと双方のリソースを活用した相乗効果の醸成を進め、更なるビジネスの拡大を目指していく考えです。

(2)取得する会社の概要（平成26年3月末現在）

名称	日興グローバルラップ株式会社
事業の内容	投資運用業等
資本金	1,499,000千円
純資産	7,620,283千円
総資産	8,134,920千円
営業利益	501,574千円
当期純利益	303,382千円

(3)株式取得日

平成27年4月1日

(4)取得する株式の数、取得価額及び取得後の持株比率

取得株式数	59,960株
取得価額	9,877,717千円
取得後の持株比率	100%

(5)支払資金の調達方法

自己資金によります。

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

（単位：千円）

		第31期中間会計期間 （平成27年９月30日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		10,975,719
顧客分別金信託		20,003
前払費用		325,776
未収委託者報酬		5,173,183
未収運用受託報酬		1,458,560
未収投資助言報酬		423,030
未収収益		31,637
繰延税金資産		519,032
その他		2,190
流動資産合計		18,929,133
固定資産		
有形固定資産	※１	421,791
無形固定資産		573,943
投資その他の資産		
投資有価証券		10,008,703
関係会社株式		10,412,523
その他		1,298,972
投資その他の資産合計		21,720,199
固定資産合計		22,715,935

資産合計		41,645,068
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		29
その他の預り金		61,740
未払金		2,614,352
未払費用		1,987,591
未払法人税等		406,231
賞与引当金		1,066,694
その他	※2	169,290
流動負債合計		6,305,931
固定負債		
退職給付引当金		2,705,437
固定負債合計		2,705,437
負債合計		9,011,368
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		19,580,326
利益剰余金合計		21,401,531
株主資本合計		32,030,515
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		603,184
評価・換算差額等合計		603,184
純資産合計		32,633,699
負債純資産合計		41,645,068

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

	第31期中間会計期間 （自　平成27年４月１日 至　平成27年９月30日）
営業収益	
委託者報酬	16,529,753
運用受託報酬	2,843,500
投資助言報酬	978,992
その他の営業収益	64,711
営業収益計	20,416,958

営業費用		13,207,542
一般管理費	※1	5,203,152
営業利益		2,006,263
営業外収益	※2	41,105
営業外費用	※3	48,535
経常利益		1,998,832
特別利益	※4	34,739
特別損失		7,932
税引前中間純利益		2,025,639
法人税、住民税及び事業税		368,130
法人税等調整額		△ 14,018
法人税等合計		354,112
中間純利益		1,671,526

(3)中間株主資本等変動計算書

第31期中間会計期間（自　平成27年４月１日　至　平成27年９月30日）

（単位　：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金合計	
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548
当中間期変動額									
剰余金の配当							△ 952,560	△ 952,560	△ 952,560
中間純利益							1,671,526	1,671,526	1,671,526
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	－	－	－	－	－	－	718,966	718,966	718,966
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,580,326	21,401,531	32,030,515

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	634,478	634,478	31,946,027
当中間期変動額			
剰余金の配当			△ 952,560
中間純利益			1,671,526
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 31,294	△ 31,294	△ 31,294
当中間期変動額合計	△ 31,294	△ 31,294	687,672
当中間期末残高	603,184	603,184	32,633,699

注記事項

（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

(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。

①退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、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。

（中間貸借対照表関係）

第31期中間会計期間 （平成27年９月30日）
※１.有形固定資産の減価償却累計額 **973,461千円**
※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35年６月までの賃借料総額337,247千円の支払保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

第31期中間会計期間 （自　平成27年４月１日　至　平成27年９月30日）
※１.減価償却実施額
有形固定資産　65,954千円
無形固定資産　95,946千円
※２.営業外収益のうち主要なもの
受取配当金　21,723千円
雑収入　17,209千円
※３.営業外費用のうち主要なもの
為替差損　48,535千円
※４.特別利益のうち主要なもの
投資有価証券清算益　24,751千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第31期中間会計期間（自 平成27年４月１日　至 平成27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27年６月30日定時株主総会	普通株式	952,560	54,000	平成27年３月31日	平成27年７月１日

（リース取引関係）

第31期中間会計期間 （自　平成27年４月１日　至　平成27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　585,430千円
１年超　1,047,704千円
合　計　1,633,134千円

（金融商品関係）

１．金融商品の時価等に関する事項

第31期中間会計期間（平成27年９月30日）

平成27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	10,975,719	10,975,719	－
(2)顧客分別金信託	20,003	20,003	－
(3)未収委託者報酬	5,173,183	5,173,183	－
(4)未収運用受託報酬	1,458,560	1,458,560	－
(5)未収投資助言報酬	423,030	423,030	－
(6)投資有価証券			
①その他有価証券	10,008,395	10,008,395	－
(7)投資その他の資産			
①長期差入保証金	600,466	600,466	－
資産計	28,659,358	28,659,358	－
(1)顧客からの預り金	29	29	－
(2)未払金			
①未払手数料	2,360,638	2,360,638	－
負債計	2,360,667	2,360,667	－

（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）顧客分別金信託、（3）未収委託者報酬、（4）未収運用受託報酬、及び（5）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おります。

（6）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。

（7）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おります。

負　債

（1）顧客からの預り金、及び（2）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おります。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

	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	10
合計	308
子会社株式及び関連会社株式	
非上場株式	10,412,523
合計	10,412,523

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、「(6)①その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式及び関連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31期中間会計期間（平成27年９月30日）

１．満期保有目的の債券

該当事項はありません。

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　10,412,523千円）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	6,450,671	5,524,611	926,060
小計	6,450,671	5,524,611	926,060
(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	3,557,723	3,605,760	△48,037
小計	3,557,723	3,605,760	△48,037
合計	10,008,395	9,130,371	878,023

（注）非上場株式等（中間貸借対照表計上額　308千円）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）

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31期中間会計期間（自　平成27年４月１日　至　平成27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	16,529,753	2,843,500	978,992	64,711	20,416,958

(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。

３．報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

４．報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

５．報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

第31期中間会計期間 （自　平成27年４月１日　至　平成27年９月30日）
１株当たり純資産額　1,849,982円98銭 １株当たり中間純利益　94,757円75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　32,633,699千円 普通株式に係る純資産額　32,633,699千円 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　1,671,526千円 普通株式に係る中間純利益　1,671,526千円 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）

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】

＜更新後＞

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27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27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27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。

第３【その他】

＜更新後＞

１．目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案およびキャッチコピーを採用すること、ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマーク、委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該目論見書の使用開始日などを記載することがあります。

２．目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。

３．目論見書に当ファンドの信託約款を掲載すること、および投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。

４．目論見書は、電子媒体等として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。

５．有価証券届出書の表紙記載情報を抜粋して、目論見書に記載することがあります。

６．目論見書の冒頭または巻末に届出書記載内容に関連する用語集を掲載することがあります。

７．評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。

８．有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。このため、有価証券届出書に他のファンドの情報を合わせて記載することがあります。

９．当ファンドとスイッチング対象ファンドにかかる投資信託説明書（交付目論見書）を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年2月9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　　小 澤　陽 一　　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27年6月27日から平成27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27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27年6月27日から平成27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．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。

次へ

独立監査人の監査報告書

平成27年６月15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　池　ヶ　谷　正　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26年４月１日から平成27年３月31日までの第30期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成27年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項
重要な後発事象に記載されているとおり、会社は平成27年４月１日付にて日興グローバルラップ株式会社の発行済株式の全部を取得している。
当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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

以　上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成27年11月25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　小　澤　陽　一　印
指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　池ヶ谷　正　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27年４月１日から平成28年３月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（平成27年４月１日から平成27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27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27年４月１日から平成27年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以　上

（注）１．上記は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．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。