

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成24年12月26日
【計算期間】	第12期中 （自 平成24年3月27日 至 平成24年9月26日）
【ファンド名】	年金積立 グローバル・ラップ・バランス （積極成長型）
【発行者名】	日興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 村上 雅彦
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	小濱 公哉
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【ファンドの運用状況】

以下の運用状況は2012年10月31日現在です。

・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。

（1）【投資状況】

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	2,811,430,396	99.20
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	－	22,704,404	0.80
合計（純資産総額）		2,834,134,800	100.00

（2）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第2計算期間末	2003年 3月25日	73	73	0.9072	0.9072
第3計算期間末	2004年 3月25日	118	119	1.1255	1.1355
第4計算期間末	2005年 3月25日	222	224	1.2176	1.2276
第5計算期間末	2006年 3月27日	601	605	1.5128	1.5228
第6計算期間末	2007年 3月26日	2,077	2,090	1.6245	1.6345
第7計算期間末	2008年 3月25日	2,335	2,352	1.3167	1.3267
第8計算期間末	2009年 3月25日	2,107	2,107	0.9543	0.9543
第9計算期間末	2010年 3月25日	2,829	2,853	1.1634	1.1734
第10計算期間末	2011年 3月25日	2,781	2,806	1.1065	1.1165
第11計算期間末	2012年 3月26日	2,876	2,902	1.1218	1.1318
2011年10月末日		2,663	－	1.0450	－
11月末日		2,544	－	0.9936	－
12月末日		2,587	－	1.0067	－
2012年 1月末日		2,642	－	1.0319	－
2月末日		2,853	－	1.1128	－
3月末日		2,914	－	1.1245	－
4月末日		2,857	－	1.1042	－
5月末日		2,650	－	1.0198	－
6月末日		2,712	－	1.0412	－
7月末日		2,742	－	1.0484	－
8月末日		2,758	－	1.0551	－
9月末日		2,801	－	1.0731	－
10月末日		2,834	－	1.0851	－

② 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第2期	2002年 3月26日～2003年 3月25日	0
第3期	2003年 3月26日～2004年 3月25日	0.0100
第4期	2004年 3月26日～2005年 3月25日	0.0100
第5期	2005年 3月26日～2006年 3月27日	0.0100
第6期	2006年 3月28日～2007年 3月26日	0.0100
第7期	2007年 3月27日～2008年 3月25日	0.0100
第8期	2008年 3月26日～2009年 3月25日	0
第9期	2009年 3月26日～2010年 3月25日	0.0100
第10期	2010年 3月26日～2011年 3月25日	0.0100
第11期	2011年 3月26日～2012年 3月26日	0.0100
当中間期	2012年 3月27日～2012年 9月26日	—

③ 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第2期	2002年 3月26日～2003年 3月25日	△15.73
第3期	2003年 3月26日～2004年 3月25日	25.17
第4期	2004年 3月26日～2005年 3月25日	9.07
第5期	2005年 3月26日～2006年 3月27日	25.07
第6期	2006年 3月28日～2007年 3月26日	8.04
第7期	2007年 3月27日～2008年 3月25日	△18.33
第8期	2008年 3月26日～2009年 3月25日	△27.52
第9期	2009年 3月26日～2010年 3月25日	22.96
第10期	2010年 3月26日～2011年 3月25日	△4.03
第11期	2011年 3月26日～2012年 3月26日	2.29
当中間期	2012年 3月27日～2012年 9月26日	△4.15

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち、以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

2 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第2期	2002年 3月26日～2003年 3月25日	37,399,700	5,355,262
第3期	2003年 3月26日～2004年 3月25日	38,932,566	15,340,915
第4期	2004年 3月26日～2005年 3月25日	85,137,083	7,098,358
第5期	2005年 3月26日～2006年 3月27日	242,672,494	27,811,589
第6期	2006年 3月28日～2007年 3月26日	964,910,688	83,677,014
第7期	2007年 3月27日～2008年 3月25日	659,889,205	165,516,241
第8期	2008年 3月26日～2009年 3月25日	633,701,841	198,483,964
第9期	2009年 3月26日～2010年 3月25日	429,119,944	205,858,017
第10期	2010年 3月26日～2011年 3月25日	325,642,397	243,705,700
第11期	2011年 3月26日～2012年 3月26日	289,224,288	238,452,113
当中間期	2012年 3月27日～2012年 9月26日	136,824,947	89,324,846

（参考）日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は2012年10月31日現在です。

・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。

（１）投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	38,404,987,100	98.50
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	586,792,021	1.50
合計（純資産総額）		38,991,779,121	100.00

（参考）日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は2012年10月31日現在です。

・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。

（１）投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	13,306,779,060	94.93
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	710,208,456	5.07
合計（純資産総額）		14,016,987,516	100.00

（参考）日本債券グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は2012年10月31日現在です。

・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。

（１）投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	32,921,383,551	70.11
地方債証券	日本	111,206,000	0.24
特殊債券	日本	2,870,662,000	6.11
	韓国	200,819,000	0.43
	小計	3,071,481,000	6.54
社債券	日本	9,918,588,382	21.12
	オーストラリア	205,236,000	0.44
	韓国	99,958,880	0.21
	小計	10,223,783,262	21.77
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	628,927,921	1.34
合計（純資産総額）		46,956,781,734	100.00

（参考）北米株式グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は2012年10月31日現在です。

・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。

（１）投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	30,285,235,850	87.16
	カナダ	1,470,597,823	4.23
	イギリス	495,525,992	1.43
	スイス	423,293,693	1.22
	オランダ	524,186,989	1.51
	アイルランド	295,917,017	0.85
	小計	33,494,757,364	96.40
出資金	アメリカ	470,476,997	1.35
投資証券	アメリカ	452,074,476	1.30
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	327,914,276	0.94
合計（純資産総額）		34,745,223,113	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約先物取引	売建	—	6,009,102	△0.02

（注）為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

（参考）欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は2012年10月31日現在です。

・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。

（１）投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	151,419,893	0.50
	カナダ	54,050,325	0.18
	ドイツ	4,006,465,911	13.33
	イタリア	517,666,517	1.72
	フランス	4,077,573,271	13.56
	イギリス	8,882,231,999	29.54
	スイス	6,177,967,484	20.55
	バミューダ	355,466,289	1.18
	オランダ	2,209,320,122	7.35
	スペイン	666,666,150	2.22
	ベルギー	307,413,858	1.02
	スウェーデン	845,557,353	2.81
	オーストリア	189,384,196	0.63
	フィンランド	130,776,062	0.43
	デンマーク	472,081,752	1.57
	チェコ	152,301,835	0.51
	ポルトガル	240,875,919	0.80
	小計	29,437,218,936	97.92
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	626,788,049	2.08
合計（純資産総額）		30,064,006,985	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約先物取引	買建	—	30,283,618	0.10
	売建	—	113,832,542	△0.38

（注）為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

（参考）アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は2012年10月31日現在です。

・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。

（１）投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	239,714,170	2.51
	オーストラリア	5,414,291,991	56.71
	バミューダ	329,667,331	3.45
	香港	1,908,209,665	19.99
	シンガポール	1,122,651,487	11.76
	アイルランド	192,904,785	2.02
	中国	30,475,060	0.32
	小計	9,237,914,489	96.76
投資証券	オーストラリア	110,004,064	1.15
	香港	99,598,808	1.04
	小計	209,602,872	2.20
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	100,020,218	1.05
合計（純資産総額）		9,547,537,579	100.00

（参考）海外債券グローバル・ラップマザーファンド

以下の運用状況は2012年10月31日現在です。

・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。

（１）投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	7,110,446,576	30.66
	カナダ	1,118,456,884	4.82
	ドイツ	2,000,239,071	8.63
	イタリア	1,898,337,666	8.19
	フランス	2,093,518,457	9.03
	オーストラリア	251,057,504	1.08
	イギリス	1,900,088,050	8.19
	スイス	39,047,960	0.17
	シンガポール	70,103,776	0.30
	マレーシア	127,588,363	0.55
	オランダ	632,385,022	2.73
	スペイン	909,550,900	3.92
	ベルギー	592,183,793	2.55
	スウェーデン	417,723,066	1.80
	ノルウェー	99,880,888	0.43
	オーストリア	334,599,589	1.44
	フィンランド	115,450,478	0.50
	デンマーク	227,372,648	0.98
	メキシコ	299,596,743	1.29
	アイルランド	115,486,995	0.50
	ポーランド	126,081,741	0.54
	南アフリカ	108,205,988	0.47
	小計	20,587,402,158	88.78
地方債証券	アメリカ	50,179,148	0.22
特殊債券	アメリカ	34,351,510	0.15
	ドイツ	29,211,022	0.13
	フランス	61,853,658	0.27
	国際機関	57,852,419	0.25
	小計	183,268,609	0.79
社債券	アメリカ	937,859,945	4.04
	カナダ	59,770,791	0.26
	イギリス	131,990,392	0.57
	スイス	62,466,033	0.27
	シンガポール	45,406,200	0.20
	オランダ	58,822,798	0.25
	ベルギー	67,144,185	0.29
	小計	1,363,460,344	5.88
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,003,831,538	4.33
合計（純資産総額）		23,188,141,797	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
その他先物取引	売建	アメリカ	19,851,272	△0.09
債券先物取引	買建	アメリカ	1,481,541,573	6.39
	買建	ドイツ	1,169,573,328	5.04
	売建	アメリカ	904,688,693	△3.90
	売建	イギリス	519,744,706	△2.24
	売建	ドイツ	158,289,858	△0.68
	売建	カナダ	76,272,095	△0.33

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約先物取引	買建	—	2,723,585,325	11.75
	売建	—	2,777,786,180	△11.98

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

3【ファンドの経理状況】

- (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）並びに同規則第38条の3及び第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）に基づき作成しております。
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、当中間計算期間（平成24年3月27日から平成24年9月26日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

中間財務諸表

年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 平成24年 3 月26日現在	当中間計算期間末 平成24年 9 月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	43,398,681	22,564,469
親投資信託受益証券	2,853,731,717	2,786,542,818
未収入金	28,363,749	157,808
未収利息	81	42
流動資産合計	2,925,494,228	2,809,265,137
資産合計	2,925,494,228	2,809,265,137
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	25,645,472	—
未払解約金	2,796,871	284,569
未払受託者報酬	691,399	4,059
未払委託者報酬	19,360,786	113,662
その他未払費用	110,572	397
流動負債合計	48,605,100	402,687
負債合計	48,605,100	402,687
純資産の部		
元本等		
元本	2,564,547,296	2,612,047,397
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	312,341,832	196,815,053
（分配準備積立金）	197,542,634	190,885,614
元本等合計	2,876,889,128	2,808,862,450
純資産合計	2,876,889,128	2,808,862,450
負債純資産合計	2,925,494,228	2,809,265,137

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自 平成23年 3 月26日 至 平成23年 9 月25日	当中間計算期間 自 平成24年 3 月27日 至 平成24年 9 月26日
営業収益		
受取利息	11,256	11,313
有価証券売買等損益	△288,664,131	△98,087,101
営業収益合計	△288,652,875	△98,075,788
営業費用		
受託者報酬	720,780	732,520
委託者報酬	20,183,538	20,512,449
その他費用	115,272	71,728
営業費用合計	21,019,590	21,316,697
営業利益又は営業損失（△）	△309,672,465	△119,392,485
経常利益又は経常損失（△）	△309,672,465	△119,392,485
中間純利益又は中間純損失（△）	△309,672,465	△119,392,485
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（△）	△1,918,156	△4,757,271
期首剰余金又は期首欠損金（△）	267,776,881	312,341,832
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,674,954	9,872,608
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	15,674,954	9,872,608
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,709,557	10,764,173
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,709,557	10,764,173
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（△）	△38,012,031	196,815,053

（３）【中間注記表】**（重要な会計方針に係る事項に関する注記）**

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当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	--

（追加情報）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

		前計算期間末 平成24年 3月26日現在	当中間計算期間末 平成24年 9月26日現在
1.	期首元本額	2,513,775,121円	2,564,547,296円
	期中追加設定元本額	289,224,288円	136,824,947円
	期中一部解約元本額	238,452,113円	89,324,846円
2.	受益権の総数	2,564,547,296口	2,612,047,397口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

前中間計算期間 自 平成23年 3月26日 至 平成23年 9月25日	当中間計算期間 自 平成24年 3月27日 至 平成24年 9月26日
信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用 6,481,539円	信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用 6,230,086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**

	前計算期間末 平成24年 3月26日現在	当中間計算期間末 平成24年 9月26日現在
中間貸借対照表計上額、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。	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1) 有価証券 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「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
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。	同左

（1口当たり情報）

	前計算期間末 平成24年 3月26日現在	当中間計算期間末 平成24年 9月26日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1218円 (11,218円)	1.0753円 (10,753円)

（参考）

当ファンドは、「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」「日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド」「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」「アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」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「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

1. 「日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本大型株式グローバル・ラップマザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		131,544,745	155,581,280
株式		46,367,358,100	38,846,299,600
未収入金		768,486,118	524,766,873
未収配当金		48,590,100	417,268,650
未収利息		247	291
流動資産合計		47,315,979,310	39,943,916,694
資産合計		47,315,979,310	39,943,916,694
負債の部			
流動負債			
未払金		561,994,584	582,197,680
未払解約金		97,743,222	43,277,528
流動負債合計		659,737,806	625,475,208
負債合計		659,737,806	625,475,208
純資産の部			
元本等			
元本		46,554,581,226	43,870,061,040
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		101,660,278	△4,551,619,554
元本等合計		46,656,241,504	39,318,441,486
純資産合計		46,656,241,504	39,318,441,486
負債純資産合計		47,315,979,310	39,943,916,694

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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、以下のとお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（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）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、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、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）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な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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
-----------------	---

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
1.	期首	平成23年 3月26日	平成24年 3月27日
	期首元本額	61,350,258,342円	46,554,581,226円
	期首からの追加設定元本額	5,030,299,037円	339,890,079円
	期首からの一部解約元本額	19,825,976,153円	3,024,410,265円
	元本の内訳 ※		
	GW7つの卵	25,922,294,135円	23,776,809,528円
	グローバル・ラップ・バランス 安定型	140,151円	137,436円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	813,155,741円	811,624,931円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	1,479,871,222円	1,478,109,326円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	9,024,995,520円	8,743,083,229円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	3,928,520,659円	3,777,666,437円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	3,687,152,870円	3,560,431,871円
	日本大型株式ファンド	232,221,780円	196,549,239円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	51,759,548円	55,741,248円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	145,787,726円	158,592,784円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	207,655,440円	217,054,036円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	581,620,916円	599,657,505円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	479,405,518円	494,603,470円
	計	46,554,581,226円	43,870,061,040円
2.	受益権の総数	46,554,581,226口	43,870,061,040口
3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	—	4,551,619,554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額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
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
時価の算定方法	(1) 有価証券 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「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
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。	同左

(1口当たり情報)

平成24年 3月26日現在		平成24年 9月26日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0022円 (10,022円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8962円 (8,962円)

２．「日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本小型株式グローバル・ラップマザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		787,215,680	349,856,438
株式		15,228,339,270	13,698,186,540
未収入金		76,928,842	61,416,934
未収配当金		36,773,900	107,733,780
未収利息		1,478	654
流動資産合計		16,129,259,170	14,217,194,346
資産合計		16,129,259,170	14,217,194,346
負債の部			
流動負債			
未払金		30,801,095	7,797,726
未払解約金		54,803,134	—
流動負債合計		85,604,229	7,797,726
負債合計		85,604,229	7,797,726
純資産の部			
元本等			
元本		9,023,082,692	8,551,295,037
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		7,020,572,249	5,658,101,583
元本等合計		16,043,654,941	14,209,396,620
純資産合計		16,043,654,941	14,209,396,620
負債純資産合計		16,129,259,170	14,217,194,346

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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、以下のとお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（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）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、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、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）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な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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
-----------------	---

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
1.	期首	平成23年 3月26日	平成24年 3月27日
	期首元本額	13,856,082,098円	9,023,082,692円
	期首からの追加設定元本額	878,890,362円	237,955,060円
	期首からの一部解約元本額	5,711,889,768円	709,742,715円
	元本の内訳 ※		
	GW7つの卵	5,058,865,968円	4,652,420,458円
	グローバル・ラップ・バランス 安定型	59,844円	59,121円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	232,468,792円	226,713,456円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	392,984,319円	384,686,041円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	1,756,225,768円	1,680,402,971円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	675,568,591円	633,893,058円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	464,195,777円	542,181,264円
	日本小型株式ファンド	127,673,181円	105,843,890円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	22,049,833円	23,893,939円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	41,598,220円	44,724,682円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	55,339,237円	56,855,598円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	113,425,200円	116,077,479円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	82,627,962円	83,543,080円
	計	9,023,082,692円	8,551,295,037円
2.	受益権の総数	9,023,082,692口	8,551,295,037口

※ 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額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
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

時価の算定方法	(1) 有価証券 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「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
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。	同左

(1口当たり情報)

平成24年 3月26日現在		平成24年 9月26日現在	
1口当たり純資産額	1.7781円	1口当たり純資産額	1.6617円
(1万口当たり純資産額)	(17,781円)	(1万口当たり純資産額)	(16,617円)

３．「日本債券グローバル・ラップマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本債券グローバル・ラップマザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		889,343,298	372,682,077
国債証券		33,581,159,000	32,543,960,912
地方債証券		108,138,000	111,191,000
特殊債券		3,095,854,000	2,986,236,000
社債券		11,645,283,058	11,243,887,253
未収入金		6,177,345,000	—
未収利息		105,857,133	79,006,533
前払費用		3,214,546	11,821,138
流動資産合計		55,606,194,035	47,348,784,913
資産合計		55,606,194,035	47,348,784,913
負債の部			
流動負債			
未払金		6,512,065,000	—
未払解約金		2,189,102	—
流動負債合計		6,514,254,102	—
負債合計		6,514,254,102	—
純資産の部			
元本等			
元本		41,673,248,685	39,392,275,130
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		7,418,691,248	7,956,509,783
元本等合計		49,091,939,933	47,348,784,913
純資産合計		49,091,939,933	47,348,784,913
負債純資産合計		55,606,194,035	47,348,784,913

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券は個別法に基づき、以下のとお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（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）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、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、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）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な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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
-----------------	---

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
1.	期首	平成23年 3月26日	平成24年 3月27日
	期首元本額	40,106,051,526円	41,673,248,685円
	期首からの追加設定元本額	12,028,165,730円	2,774,643,214円
	期首からの一部解約元本額	10,460,968,571円	5,055,616,769円
	元本の内訳 ※		
	GW7つの卵	24,144,745,522円	22,248,611,085円
	グローバル・ラップ・バランス 安定型	895,089円	841,414円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	2,956,155,880円	2,769,131,846円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	3,348,107,729円	3,227,812,608円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	8,315,561,811円	8,101,396,989円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	808,529,476円	925,879,826円
	日本債券ファンド	94,609,523円	78,552,158円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	338,834,501円	340,623,683円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	536,657,848円	542,361,033円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	481,411,408円	474,568,255円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	546,133,867円	560,195,664円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	101,606,031円	122,300,569円
	計	41,673,248,685円	39,392,275,130円
2.	受益権の総数	41,673,248,685口	39,392,275,130口

※ 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額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
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

時価の算定方法	(1) 有価証券 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「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
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。	同左

(1口当たり情報)

平成24年 3月26日現在		平成24年 9月26日現在	
1口当たり純資産額	1.1780円	1口当たり純資産額	1.2020円
(1万口当たり純資産額)	(11,780円)	(1万口当たり純資産額)	(12,020円)

4. 「北米株式グローバル・ラップマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

北米株式グローバル・ラップマザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		384,353,693	409,846,180
コール・ローン		60,919,302	54,538,114
出資金		—	460,450,087
株式		41,665,286,306	33,540,296,794
投資信託受益証券		351,197,293	—
投資証券		507,095,141	414,949,291
派生商品評価勘定		229,659	214,597
未収入金		82,783,025	157,486,267
未収配当金		32,901,229	35,221,537
未収利息		114	102
流動資産合計		43,084,765,762	35,073,002,969
資産合計		43,084,765,762	35,073,002,969
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		278,880	—
未払金		—	54,368,678
未払解約金		145,261,175	112,393,477
流動負債合計		145,540,055	166,762,155
負債合計		145,540,055	166,762,155
純資産の部			
元本等			
元本		44,692,584,124	38,147,999,504
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		△1,753,358,417	△3,241,758,690
元本等合計		42,939,225,707	34,906,240,814
純資産合計		42,939,225,707	34,906,240,814
負債純資産合計		43,084,765,762	35,073,002,969

(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	出資金、株式、投資信託受益証券及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとお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（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）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、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、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）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な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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
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条にしたがって処理しております。

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
1.	期首	平成23年 3月26日	平成24年 3月27日
	期首元本額	55,423,284,990円	44,692,584,124円
	期首からの追加設定元本額	5,305,393,691円	210,091,953円
	期首からの一部解約元本額	16,036,094,557円	6,754,676,573円
	元本の内訳 ※		
	GW7つの卵	25,086,209,342円	20,595,548,189円
	グローバル・ラップ・バランス 安定型	174,469円	158,823円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	851,847,840円	723,318,683円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	1,451,293,145円	1,261,143,985円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	8,783,823,443円	7,803,954,554円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	3,486,382,078円	3,031,095,743円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	3,484,703,707円	3,289,131,733円
	北米株式ファンド	137,195,781円	118,930,373円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	63,586,920円	61,708,525円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	152,812,957円	143,762,362円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	203,187,135円	185,678,297円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	565,269,864円	536,112,574円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	426,097,443円	397,455,663円
	計	44,692,584,124円	38,147,999,504円
2.	受益権の総数	44,692,584,124口	38,147,999,504口

3.	元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	1,753,358,417円	3,241,758,690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額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
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
時価の算定方法	(1) 有価証券 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「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
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。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成24年3月26日現在）

（単位：円）

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	3,525,238	—	3,525,212	△26
	米ドル	3,525,238	—	3,525,212	△26
	売建	148,786,413	—	148,835,608	△49,195
	米ドル	145,261,175	—	145,306,540	△45,365
	加ドル	3,525,238	—	3,529,068	△3,830
合計		152,311,651	—	152,360,820	△49,221

（平成24年9月26日現在）

（単位：円）

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				
	売建	112,393,477	—	112,178,880	214,597
	米ドル	112,393,477	—	112,178,880	214,597
合計		112,393,477	—	112,178,880	214,597

（注）1.時価の算定方法

- （1）本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

- ①同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- ②同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
- ・同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値を用いております。
- (2) 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
- 2.換算において円未満の端数は切り捨てております。
- 3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成24年 3月26日現在		平成24年 9月26日現在	
1口当たり純資産額	0.9608円	1口当たり純資産額	0.9150円
(1万口当たり純資産額)	(9,608円)	(1万口当たり純資産額)	(9,150円)

5. 「欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

欧州先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		463,560,836	515,720,589
コール・ローン		20,000,277	19,999,942
株式		35,102,691,876	29,980,213,489
派生商品評価勘定		1,409,892	1,011,768
未収入金		721,507,105	349,544,063
未収配当金		49,455,607	38,872,804
未収利息		37	37
流動資産合計		36,358,625,630	30,905,362,692
資産合計		36,358,625,630	30,905,362,692
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,310,501	392,109
未払金		566,911,085	60,525,195
未払解約金		150,046,501	158,690,640
流動負債合計		719,268,087	219,607,944
負債合計		719,268,087	219,607,944
純資産の部			
元本等			
元本		24,499,349,341	21,182,230,760
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		11,140,008,202	9,503,523,988
元本等合計		35,639,357,543	30,685,754,748
純資産合計		35,639,357,543	30,685,754,748
負債純資産合計		36,358,625,630	30,905,362,692

(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	株式は移動平均法に基づき、以下のとお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（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）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、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、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）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な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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
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条にしたがって処理しております。

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
1.	期首	平成23年 3月26日	平成24年 3月27日
	期首元本額	27,001,147,812円	24,499,349,341円
	期首からの追加設定元本額	4,929,601,186円	124,437,344円
	期首からの一部解約元本額	7,431,399,657円	3,441,555,925円
	元本の内訳 ※		
	GW7つの卵	13,463,823,177円	10,992,865,902円
	グローバル・ラップ・バランス 安定型	72,055円	67,921円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	373,628,348円	335,626,791円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	748,455,416円	689,439,267円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	4,701,515,947円	4,234,476,573円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	1,989,136,571円	1,792,745,043円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	2,364,703,541円	2,311,227,305円
	欧州先進国株式ファンド	116,007,906円	102,332,486円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	26,412,537円	25,880,214円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	66,754,486円	67,902,701円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	104,697,437円	102,151,478円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	302,208,656円	291,298,466円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	241,933,264円	236,216,613円
	計	24,499,349,341円	21,182,230,760円
2.	受益権の総数	24,499,349,341口	21,182,230,760口

※ 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額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
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
時価の算定方法	(1) 有価証券 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「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
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。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成24年3月26日現在）

（単位：円）

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	285,056,275	—	284,668,106	△388,169
	ユーロ	285,056,275	—	284,668,106	△388,169
	売建	435,102,594	—	435,615,034	△512,440
	デンマーククローネ	285,056,275	—	284,700,806	355,469
	ユーロ	150,046,319	—	150,914,228	△867,909
合計		720,158,869	—	720,283,140	△900,609

（平成24年9月26日現在）

（単位：円）

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	116,218,276	—	115,826,167	△392,109
	英ポンド	60,688,116	—	60,520,390	△167,726
	ユーロ	55,530,160	—	55,305,777	△224,383
	売建	274,909,010	—	273,897,242	1,011,768
	米ドル	189,507	—	189,263	244
	スイスフラン	55,340,653	—	55,161,149	179,504
	ユーロ	219,378,850	—	218,546,830	832,020
合計		391,127,286	—	389,723,409	619,659

（注）1.時価の算定方法

- (1) 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
- ① 同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 - ② 同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値を用いております。
- (2) 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成24年 3月26日現在		平成24年 9月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4547円	1口当たり純資産額	1.4487円
(1万口当たり純資産額)	(14,547円)	(1万口当たり純資産額)	(14,487円)

6. 「アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

アジア太平洋先進国株式グローバル・ラップマザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		37,072,605	32,415,455
コール・ローン		172,661,789	78,324,810
株式		12,121,553,196	9,169,826,331
投資証券		249,784,244	207,084,769
派生商品評価勘定		—	90,433
未収配当金		66,441,485	77,427,453
未収利息		324	146
流動資産合計		12,647,513,643	9,565,169,397
資産合計		12,647,513,643	9,565,169,397
負債の部			
流動負債			
未払解約金		21,757,048	39,265,428
流動負債合計		21,757,048	39,265,428
負債合計		21,757,048	39,265,428
純資産の部			
元本等			
元本		3,771,096,645	2,789,445,339
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		8,854,659,950	6,736,458,630
元本等合計		12,625,756,595	9,525,903,969
純資産合計		12,625,756,595	9,525,903,969
負債純資産合計		12,647,513,643	9,565,169,397

(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	株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとお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（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）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、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、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）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な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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
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条にしたがって処理しております。

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
1.	期首	平成23年 3月26日	平成24年 3月27日
	期首元本額	3,903,904,803円	3,771,096,645円
	期首からの追加設定元本額	1,749,580,706円	13,617,881円
	期首からの一部解約元本額	1,882,388,864円	995,269,187円
	元本の内訳 ※		
	GW7つの卵	2,067,724,418円	1,439,796,056円
	グローバル・ラップ・バランス 安定型	10,352円	9,888円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	50,074,518円	37,299,158円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	102,124,360円	67,889,086円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	720,033,694円	539,734,117円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	286,873,515円	218,546,467円
	グローバル・ラップ・バランス 超積極型	371,004,333円	339,641,771円
	アジア太平洋先進国株式ファンド	64,454,157円	59,204,197円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	3,835,077円	3,934,664円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	9,016,497円	7,350,785円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	14,420,248円	10,008,794円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	46,497,906円	37,228,913円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	35,027,570円	28,801,443円
	計	3,771,096,645円	2,789,445,339円
2.	受益権の総数	3,771,096,645口	2,789,445,339口

※ 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額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
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
時価の算定方法	(1) 有価証券 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「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 同左
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。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（平成24年3月26日現在）

該当事項はありません。

（平成24年9月26日現在）

（単位：円）

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				
	売建	13,011,960	—	12,921,527	90,433
	豪ドル	10,381,450	—	10,300,963	80,487
	シンガポールドル	2,630,510	—	2,620,564	9,946
合計		13,011,960	—	12,921,527	90,433

（注）1.時価の算定方法

（1）本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値をもとに計算しております。

- ・同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値を用いております。

（2）本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成24年 3月26日現在		平成24年 9月26日現在	
1口当たり純資産額	3.3480円	1口当たり純資産額	3.4150円
(1万口当たり純資産額)	(33,480円)	(1万口当たり純資産額)	(34,150円)

7. 「海外債券グローバル・ラップマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

海外債券グローバル・ラップマザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

科目	対象年月日	平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
預金		1,015,450,104	737,817,944
コール・ローン		10,000,066	10,100,799
国債証券		17,367,386,323	20,079,629,221
地方債証券		52,673,467	49,098,519
特殊債券		474,466,889	178,385,355
社債券		1,722,647,294	1,421,750,978
派生商品評価勘定		202,952,045	49,586,175
未収入金		57,648,474	16,283,186
未収利息		207,650,476	211,152,167
前払費用		24,553,544	22,082,257
差入委託証拠金		232,656,406	291,582,940
流動資産合計		21,368,085,088	23,067,469,541
資産合計		21,368,085,088	23,067,469,541
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		163,888,954	53,428,008
未払金		45,833,368	60,422,757
未払解約金		15,405,832	—
流動負債合計		225,128,154	113,850,765
負債合計		225,128,154	113,850,765
純資産の部			
元本等			
元本		12,637,158,436	14,199,376,597
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		8,505,798,498	8,754,242,179
元本等合計		21,142,956,934	22,953,618,776
純資産合計		21,142,956,934	22,953,618,776
負債純資産合計		21,368,085,088	23,067,469,541

(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	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券は個別法に基づき、以下のとお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（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）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、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、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）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な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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 (2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
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条にしたがって処理しております。

(追加情報)

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

(貸借対照表に関する注記)

		平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
1.	期首	平成23年 3月26日	平成24年 3月27日
	期首元本額	21,340,840,528円	12,637,158,436円
	期首からの追加設定元本額	364,825,177円	2,445,767,092円
	期首からの一部解約元本額	9,068,507,269円	883,548,931円
	元本の内訳 ※		
	GW7つの卵	7,620,728,724円	8,386,546,333円
	グローバル・ラップ・バランス 安定型	78,154円	86,283円
	グローバル・ラップ・バランス 安定成長型	325,439,461円	361,265,099円
	グローバル・ラップ・バランス 成長型	528,349,845円	591,553,454円
	グローバル・ラップ・バランス 積極成長型	2,622,346,628円	3,065,754,734円
	グローバル・ラップ・バランス 積極型	927,875,018円	1,096,085,776円
	海外債券ファンド	161,351,270円	145,279,373円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定型）	29,099,967円	34,761,794円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（安定成長型）	58,846,548円	72,750,569円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（成長型）	75,628,069円	88,103,944円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）	171,773,945円	212,313,517円
	年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極型）	115,640,807円	144,875,721円
	計	12,637,158,436円	14,199,376,597円
2.	受益権の総数	12,637,158,436口	14,199,376,597口

※ 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額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	平成24年 3月26日現在	平成24年 9月26日現在
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
時価の算定方法	(1) 有価証券 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「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
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。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(債券関連)

(平成24年3月26日現在)

(単位：円)

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	債券先物取引				
	買建	2,968,924,888	—	2,969,624,698	699,810
	売建	349,906,935	—	351,795,246	△1,888,311
合計		3,318,831,823	—	3,321,419,944	△1,188,501

(平成24年9月26日現在)

(単位：円)

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	債券先物取引				
	買建	3,863,406,267	—	3,859,735,483	△3,670,784
	売建	1,711,978,767	—	1,713,564,197	△1,585,430
合計		5,575,385,034	—	5,573,299,680	△5,256,214

(注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2.債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は、本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客電信売

買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（金利関連）
（平成24年3月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	金利先物取引				
	売建	123,521,141	—	123,520,476	665
	合計	123,521,141	—	123,520,476	665

（注）1. 時価の算定方法

金利先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 金利先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
また契約額等及び時価の邦貨換算は、本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（平成24年9月26日現在）
該当事項はありません。

(通貨関連)

(平成24年3月26日現在)

(単位：円)

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	12,044,788,129	—	12,233,051,734	188,263,605
	米ドル	6,537,024,936	—	6,643,566,214	106,541,278
	加ドル	64,268,550	—	64,503,980	235,430
	豪ドル	212,416,280	—	214,347,360	1,931,080
	英ポンド	650,906,978	—	663,084,080	12,177,102
	スイスフラン	221,016,384	—	226,673,230	5,656,846
	シンガポールドル	89,420,169	—	91,675,320	2,255,151
	ニュージーランドドル	42,272,771	—	41,831,400	△441,371
	スウェーデンクローナ	517,576,742	—	519,449,140	1,872,398
	ノルウェークローネ	487,740,631	—	492,442,050	4,701,419
	デンマーククローネ	66,277,656	—	66,789,000	511,344
	メキシコペソ	144,485,748	—	143,208,000	△1,277,748
	ポーランドズロチ	98,648,779	—	99,429,920	781,141
	ユーロ	2,912,732,505	—	2,966,052,040	53,319,535
	売建	12,051,387,043	—	12,199,399,721	△148,012,678
	米ドル	5,628,762,107	—	5,679,280,565	△50,518,458
	加ドル	141,202,000	—	140,947,000	255,000
	豪ドル	303,940,700	—	302,806,800	1,133,900
	英ポンド	492,419,400	—	502,146,000	△9,726,600
	スイスフラン	189,405,380	—	196,073,710	△6,668,330
	シンガポールドル	33,463,700	—	33,491,700	△28,000
	ニュージーランドドル	20,794,800	—	20,937,400	△142,600
	スウェーデンクローナ	1,003,895,290	—	1,013,144,860	△9,249,570
	ノルウェークローネ	350,275,930	—	351,740,300	△1,464,370
	デンマーククローネ	104,021,520	—	105,740,640	△1,719,120
	メキシコペソ	165,692,900	—	169,060,920	△3,368,020
	ポーランドズロチ	113,198,880	—	115,408,160	△2,209,280
	ユーロ	3,504,314,436	—	3,568,621,666	△64,307,230
合計		24,096,175,172	—	24,432,451,455	40,250,927

(平成24年9月26日現在)

(単位：円)

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	6,541,068,549	—	6,519,286,509	△21,782,040
	米ドル	3,348,927,850	—	3,333,589,195	△15,338,655
	加ドル	336,725,235	—	334,914,170	△1,811,065
	豪ドル	400,444,005	—	396,951,860	△3,492,145
	英ポンド	465,122,988	—	465,915,564	792,576
	スイスフラン	92,595,373	—	92,348,400	△246,973
	シンガポールドル	32,486,499	—	32,373,760	△112,739
	ニュージーランドドル	221,277,202	—	220,934,900	△342,302
	スウェーデンクローナ	257,659,962	—	257,882,170	222,208
	ノルウェークローネ	268,139,620	—	268,248,700	109,080
	デンマーククローネ	28,910,711	—	28,508,280	△402,431
	メキシコペソ	203,694,467	—	204,096,600	402,133
	ポーランドズロチ	51,821,600	—	50,958,880	△862,720
	ユーロ	833,263,037	—	832,564,030	△699,007

売建	6,528,968,549	—	6,505,772,128	23,196,421
米ドル	3,386,740,699	—	3,370,889,268	15,851,431
加ドル	399,141,150	—	398,749,370	391,780
豪ドル	432,145,210	—	427,974,680	4,170,530
英ポンド	479,962,920	—	481,570,940	△1,608,020
スイスフラン	69,400,710	—	69,196,980	203,730
シンガポールドル	16,396,800	—	16,189,440	207,360
ニュージーランドドル	135,186,800	—	133,498,650	1,688,150
スウェーデンクローナ	443,650,740	—	441,907,750	1,742,990
ノルウェークローネ	210,243,500	—	210,957,700	△714,200
デンマーククローネ	56,931,840	—	57,016,560	△84,720
メキシコペソ	220,552,800	—	221,343,900	△791,100
ポーランドズロチ	102,380,640	—	101,686,320	694,320
ユーロ	576,234,740	—	574,790,570	1,444,170
合計	13,070,037,098	—	13,025,058,637	1,414,381

(注)1.時価の算定方法

- (1) 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
- ① 同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 - ② 同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値を用いております。
- (2) 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

平成24年 3月26日現在		平成24年 9月26日現在	
1口当たり純資産額	1.6731円	1口当たり純資産額	1.6165円
(1万口当たり純資産額)	(16,731円)	(1万口当たり純資産額)	(16,165円)

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

平成24年10月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

●過去5年間における主な資本金の増減

年月日	変更後（変更前）
平成20年6月23日	16,403,045,900円（16,287,728,400円）
平成21年10月1日	17,363,045,900円（16,403,045,900円）

(2)【事業の内容及び営業の状況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「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）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、平成24年10月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	433	68,426
株式投資信託	368	54,932
単位型	44	1,244
追加型	324	53,687
公社債投資信託	65	13,494
単位型	48	570
追加型	17	12,923
投資法人合計	1	30

(3)【その他】

① 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

② 訴訟事件その他の重要事項

委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

5【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定により、「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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

	第52期 (平成23年 3月31日)		第53期 (平成24年 3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金	※3	21,290	※3	17,352
前払費用		330		332
未収入金		4		1
未収委託者報酬		6,173		5,872
未収収益	※3	422	※3	543
関係会社短期貸付金		—		33
立替金		504		1,094
繰延税金資産		1,142		1,084
その他	※2	30	※2	30
流動資産合計		29,897		26,345
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	67	※1	66
器具備品	※1	147	※1	137
有形固定資産合計		215		203
無形固定資産				
ソフトウェア		101		72
無形固定資産合計		101		72
投資その他の資産				
投資有価証券		7,030		3,002
関係会社株式		16,225		24,320
関係会社長期貸付金		60		60
長期差入保証金		962		774
繰延税金資産		868		723
投資その他の資産合計		25,147		28,880
固定資産合計		25,463		29,156
資産合計		55,361		55,502

	第52期 (平成23年 3 月31日)	第53期 (平成24年 3 月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	150	194
未払金	3,354	3,086
未払収益分配金	8	7
未払償還金	181	129
未払手数料 ※3	2,870	2,486
その他未払金	294	462
未払費用 ※3	3,253	2,807
未払法人税等	945	1,295
未払消費税等	108	281
賞与引当金	2,149	2,039
役員賞与引当金	237	105
流動負債合計	10,199	9,809
固定負債		
退職給付引当金	818	907
その他	55	55
固定負債合計	874	963
負債合計	11,073	10,773
純資産の部		
株主資本		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
その他資本剰余金	4	—
資本剰余金合計	5,225	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	21,703	22,172
利益剰余金合計	21,703	22,172
自己株式	△68	△68
株主資本合計	44,224	44,687
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	63	42
評価・換算差額等合計	63	42
純資産合計	44,287	44,729
負債純資産合計	55,361	55,502

（２）【損益計算書】

(単位：百万円)

	第52期 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)	第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)
営業収益		
委託者報酬	52,650	56,698
その他営業収益	2,581	2,025
営業収益合計	55,231	58,724
営業費用		
支払手数料	26,518	29,251
広告宣伝費	803	673
公告費	13	3
調査費	11,373	11,397
調査費	698	719
委託調査費	10,654	10,660
図書費	20	18
委託計算費	335	348
営業雑経費	557	577
通信費	176	206
印刷費	287	247
協会費	41	43
諸会費	8	9
その他	43	70
営業費用計	39,601	42,252
一般管理費		
給料	7,045	6,991
役員報酬	239	237
役員賞与引当金繰入額	237	105
給料・手当	4,391	4,508
賞与	27	101
賞与引当金繰入額	2,149	2,039
交際費	73	74
寄付金	140	111
旅費交通費	389	328
租税公課	133	145
不動産賃借料	921	749
退職給付費用	305	307
退職金	12	8
固定資産減価償却費	175	143
諸経費	2,953	3,110
一般管理費計	12,149	11,971
営業利益	3,480	4,500

	第52期 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)	第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)
営業外収益		
受取利息	2	15
受取配当金	※ 1 1,071	※ 1 757
有価証券償還益	29	19
時効成立分配金・償還金	8	35
その他	10	18
営業外収益合計	1,121	846
営業外費用		
支払利息	10	10
時効成立後支払分配金・償還金	34	77
支払源泉所得税	106	74
為替差損	1	35
弁護士報酬等	—	180
その他	0	4
営業外費用合計	153	381
経常利益	4,448	4,965
特別利益		
投資有価証券売却益	49	1
子会社投資損失引当金戻入額	576	—
その他	23	—
特別利益合計	649	1
特別損失		
投資有価証券売却損	0	0
固定資産処分損	4	6
役員退職一時金	—	369
過年度敷金償却費用	58	—
特別損失合計	62	376
税引前当期純利益	5,034	4,590
法人税、住民税及び事業税	1,134	1,795
法人税等調整額	705	224
法人税等合計	1,839	2,020
当期純利益	3,195	2,570

(3) 【株主資本等変動計算書】

	(単位：百万円)	
	第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	17,363	17,363
当期末残高	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	5,220	5,220
当期末残高	5,220	5,220
その他資本剰余金		
当期首残高	4	4
当期変動額		
自己株式の処分	—	△4
当期変動額合計	—	△4
当期末残高	4	—
資本剰余金合計		
当期首残高	5,225	5,225
当期変動額		
自己株式の処分	—	△4
当期変動額合計	—	△4
当期末残高	5,225	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
当期首残高	18,814	21,703
当期変動額		
剰余金の配当	△305	△1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の処分	—	△599
当期変動額合計	2,889	468
当期末残高	21,703	22,172
利益剰余金合計		
当期首残高	18,814	21,703
当期変動額		
剰余金の配当	△305	△1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の処分	—	△599
当期変動額合計	2,889	468
当期末残高	21,703	22,172

	第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
自己株式		
当期首残高	△53	△68
当期変動額		
自己株式の取得	△14	△8,700
自己株式の処分	—	8,700
当期変動額合計	△14	—
当期末残高	△68	△68
株主資本合計		
当期首残高	41,349	44,224
当期変動額		
剰余金の配当	△305	△1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の取得	△14	△8,700
自己株式の処分	—	8,095
当期変動額合計	2,874	463
当期末残高	44,224	44,687
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	121	63
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	△57	△21
当期変動額合計	△57	△21
当期末残高	63	42
評価・換算差額等合計		
当期首残高	121	63
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	△57	△21
当期変動額合計	△57	△21
当期末残高	63	42
純資産合計		
当期首残高	41,470	44,287
当期変動額		
剰余金の配当	△305	△1,502
当期純利益	3,195	2,570
自己株式の取得	△14	△8,700
自己株式の処分	—	8,095
株主資本以外の項目の当期変動額 (純額)	△57	△21
当期変動額合計	2,817	441
当期末残高	44,287	44,729

重要な会計方針

	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)				
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 ① 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ② その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 時価のないもの 総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 定率法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 <table border="0"> <tr> <td>建物</td><td>4年～5年</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>4年～20年</td></tr> </table> (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、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。	建物	4年～5年	器具備品	4年～20年
建物	4年～5年				
器具備品	4年～20年				
3 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理することとしております。				
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。				

追加情報

第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」等の適用 当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

第52期 (平成23年3月31日)	第53期 (平成24年3月31日)
※1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 971百万円 器具備品 571百万円 ※2 信託資産 その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。なお、野村信託銀行株式会社は平成22年7月20日付でN C T信託銀行株式会社を合併しております。 ※3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金 10,013百万円 未収収益 31百万円 (流動負債) 未払手数料 24百万円 未払費用 226百万円 ※4 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務112百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワーアソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務177百万円に対して保証を行っております。	※1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,012百万円 器具備品 590百万円 ※2 信託資産 その他流動資産の30百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。 ※3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 現金・預金 5,802百万円 未収収益 217百万円 (流動負債) 未払手数料 42百万円 未払費用 259百万円 ※4 保証債務 当社は、Nikko Asset Management Europe Ltd がロンドン ウォール リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務110百万円に対して保証を行っております。また当社は、Nikko Asset Management Americas, Inc. がマディソン タワーアソシエイツ リミテッド パートナーシップに支払うオフィス賃借料等の債務138百万円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
※1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 1,066百万円	※1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 743百万円

（株主資本等変動計算書関係）

第52期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	197,012,500	—	—	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	85,000	24,600	—	109,600

（注）自己株式の増加は、自己株式の取得であります。

3 新株予約権等に関する事項

区分	新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
			当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
提出会社	平成21年度 ストックオプション（1）	普通株式	19,559,100	—	231,000	19,328,100	—
	平成21年度 ストックオプション（2）	普通株式	—	1,702,800	—	1,702,800	—
	平成22年度 ストックオプション（1）	普通株式	—	2,310,000	—	2,310,000	—
合計			19,559,100	4,012,800	231,000	23,340,900	—

（注）1 平成21年度ストックオプション（1）の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

2 平成21年度ストックオプション（2）の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

3 平成22年度ストックオプション（1）の増加は、新株予約権の発行によるものであります。

4 平成21年度ストックオプション（1）、平成21年度ストックオプション（2）及び平成22年度ストックオプション（1）は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成22年5月20日 取締役会	普通株式	305	1.55	平成22年3月31日	平成22年6月23日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成23年5月23日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,502	7.63	平成23年3月31日	平成23年6月22日

第53期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	197,012,500	—	—	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	109,600	14,283,400	14,283,400	109,600

（注） 自己株式の増加は、自己株式の取得であり、自己株式の減少は、自己株式の処分であります。

3 新株予約権等に関する事項

区分	新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年 度末残高 (百万円)
			当事業年 度期首	当事業年度 増加	当事業年度 減少	当事業 年度末	
提出会社	平成21年度 ストックオプション（1）	普通株式	19,328,100	—	112,200	19,215,900	—
	平成21年度 ストックオプション（2）	普通株式	1,702,800	—	26,400	1,676,400	—
	平成22年度 ストックオプション（1）	普通株式	2,310,000	—	—	2,310,000	—
	第1回新株予約権	普通株式	—	2,955,200	—	2,955,200	—
	平成23年度 ストックオプション（1）	普通株式	—	6,101,700	9,900	6,091,800	—
合計			23,340,900	9,056,900	148,500	32,249,300	—

（注） 1 平成21年度ストックオプション（1）の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

2 平成21年度ストックオプション（2）の減少は、新株予約権の失効によるものであります。

3 第1回新株予約権の増加は、新株予約権の発行によるものであります。第1回新株予約権の新株予約権の目的となる株式の数は、新株予約権の行使に関する通知が当社に提出された日における、当社の発行済株式数×0.25%に6を乗じた数で算出され、当事業年度末の発行済株式に基づき算出しております。

4 平成23年度ストックオプション（1）の増加は、新株予約権の発行によるものであり、減少は新株予約権の失効によるものであります。

5 平成21年度ストックオプション（1）9,837,300株、平成21年度ストックオプション（2）871,200株、平成22年度ストックオプション（1）1,155,000株、第1回新株予約権2,955,200株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。また、平成23年度ストックオプション（1）は、権利行使期間の初日が到来していません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成23年5月23日 取締役会	普通株式	1,502	7.63	平成23年3月31日	平成23年6月22日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年5月28日 取締役会	普通株式	利益剰余金	1,468	7.46	平成24年3月31日	平成24年6月19日

(リース取引関係)

第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)		第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	731百万円	1年内	740百万円
1年超	2,234百万円	1年超	1,548百万円
合計	2,966百万円	合計	2,288百万円

（金融商品関係）

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬、未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻または債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されております。

営業債務である未払金（未払手数料）、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日であります。未払金（未払手数料）については、債権（未収委託者報酬）を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、預金を預入れる金融機関の選定に関しては、短期間の取引が想定される金融機関の場合を除き、相手方の財政状態及び経営成績、または必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

②市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また投資有価証券に関しては、毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。これらの結果、当社の財政状態、経営成績に与える影響が著しいと判断される場合には、必要に応じて、ヘッジ取引規程に則り、それを回避する目的で、ヘッジ取引を行うことが可能であります。

③流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

2 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日（当期の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(※)	時価(※)	差額
(1) 現金及び預金	21,290	21,290	—
(2) 未収委託者報酬	6,173	6,173	—
(3) 未収収益	422	422	—
(4) 投資有価証券 その他有価証券	6,882	6,882	—
(5) 関係会社株式 子会社株式	1,404	1,672	268
(6) 未払金	(3,354)	(3,354)	—
(7) 未払費用	(3,253)	(3,253)	—

(※)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額147百万円）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ため、「(4)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（貸借対照表計上額11,928百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）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ため、「(5)関係会社株式」には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,290	—	—	—
未収委託者報酬	6,173	—	—	—
未収収益	422	—	—	—
投資有価証券 投資信託	—	5,733	556	421
合 計	27,885	5,733	556	421

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されており、また一部外貨建て預金を保有しているため為替変動リスクにも晒されております。営業債権である未収委託者報酬、未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻または債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されております。

営業債務である未払金（未払手数料）、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日であります。未払金（未払手数料）については、債権（未収委託者報酬）を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、預金を預入れる金融機関の選定に関しては、短期間の取引が想定される金融機関の場合を除き、相手方の財政状態及び経営成績、または必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

②市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また投資有価証券に関しては、毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。これらの結果、当社の財政状態、経営成績に与える影響が著しいと判断される場合には、必要に応じて、ヘッジ取引規程に則り、それを回避する目的で、ヘッジ取引を行うことが可能であります。

③流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

2 金融商品の時価等に関する事項

平成24年3月31日（当期の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(※)	時価(※)	差額
(1) 現金及び預金	17,352	17,352	—
(2) 未収委託者報酬	5,872	5,872	—
(3) 未収収益	543	543	—
(4) 投資有価証券			
其他有価証券	2,854	2,854	—
(5) 関係会社株式			
関連会社株式	1,404	1,615	210
(6) 未払金	(3,086)	(3,086)	—
(7) 未払費用	(2,807)	(2,807)	—

(※)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収収益

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

(4) 投資有価証券及び(5) 関係会社株式

これらの時価について、株式は市場価格、投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額147百万円）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ため、「(4)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（貸借対照表計上額20,023百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）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ため、「(5)関係会社株式」には含めておりません。

4 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	17,352	—	—	—
未収委託者報酬	5,872	—	—	—
未収収益	543	—	—	—
投資有価証券				
投資信託	—	362	479	439
合 計	23,768	362	479	439

（有価証券関係）

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時 価	差 額
子会社株式	1,404	1,672	268
合 計	1,404	1,672	268

（注）子会社株式（貸借対照表計上額11,928百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）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、上表の「子会社株式及び関連会社株式」には含めておりません。

2 その他有価証券

（単位：百万円）

	種 類	貸借対照表計上額	取 得 原 価	差 額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株 式	31	7	24
	そ の 他	5,560	5,363	196
	小 計	5,591	5,370	220
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	そ の 他	1,291	1,404	△ 113
	小 計	1,291	1,404	△ 113
合 計		6,882	6,775	107

（注）1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度については、該当ございません。

2 非上場株式等（貸借対照表計上額 147百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

種 類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	144	49	0
合 計	144	49	0

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時 価	差 額
関連会社株式	1,404	1,615	210
合 計	1,404	1,615	210

(注) 子会社株式（貸借対照表計上額20,023百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額2,892百万円）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、上表の「子会社株式及び関連会社株式」には含めておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種 類	貸借対照表計上額	取 得 原 価	差 額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株 式	35	7	28
	そ の 他	1,177	999	177
	小 計	1,212	1,006	206
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	そ の 他	1,642	1,784	△ 141
	小 計	1,642	1,784	△ 141
合 計		2,854	2,790	64

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当事業年度については、該当ございません。

2 非上場株式等（貸借対照表計上額 147百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種 類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	112	1	0
合 計	112	1	0

(持分法損益等)

第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円) (1) 関連会社に対する投資の金額 2,892 (2) 持分法を適用した場合の投資の金額 4,703 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,054	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円) (1) 関連会社に対する投資の金額 4,407 (2) 持分法を適用した場合の投資の金額 6,834 (3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 927

(退職給付関係)

第52期 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	第53期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)																																																
1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュ・バランスプラン型退職金制度を設けております。 2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円) <table> <tr> <td>イ 退職給付債務</td><td>△890</td></tr> <tr> <td>ロ 未積立退職給付債務</td><td>△890</td></tr> <tr> <td>ハ 未認識数理計算上の差異</td><td>72</td></tr> <tr> <td>ニ 退職給付引当金残高</td><td>△818</td></tr> </table> 3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円) <table> <tr> <td>イ 勤務費用</td><td>95</td></tr> <tr> <td>ロ 利息費用</td><td>14</td></tr> <tr> <td>ハ 数理計算上の差異の費用処理額</td><td>30</td></tr> <tr> <td>ニ 確定拠出型企業年金への掛金</td><td>165</td></tr> <tr> <td>ホ 退職給付費用合計</td><td>305</td></tr> </table> 4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 <table> <tr> <td>イ 退職給付見込額の期間配分方法</td><td>勤続期間比例</td></tr> <tr> <td>ロ 割引率</td><td>1.6%</td></tr> <tr> <td>ハ 数理計算上の差異の処理年数</td><td>10年</td></tr> </table>	イ 退職給付債務	△890	ロ 未積立退職給付債務	△890	ハ 未認識数理計算上の差異	72	ニ 退職給付引当金残高	△818	イ 勤務費用	95	ロ 利息費用	14	ハ 数理計算上の差異の費用処理額	30	ニ 確定拠出型企業年金への掛金	165	ホ 退職給付費用合計	305	イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例	ロ 割引率	1.6%	ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年	1 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュ・バランスプラン型退職金制度を設けております。 2 退職給付債務に関する事項 (単位：百万円) <table> <tr> <td>イ 退職給付債務</td><td>△985</td></tr> <tr> <td>ロ 未積立退職給付債務</td><td>△985</td></tr> <tr> <td>ハ 未認識数理計算上の差異</td><td>77</td></tr> <tr> <td>ニ 退職給付引当金残高</td><td>△907</td></tr> </table> 3 退職給付費用に関する事項 (単位：百万円) <table> <tr> <td>イ 勤務費用</td><td>97</td></tr> <tr> <td>ロ 利息費用</td><td>14</td></tr> <tr> <td>ハ 数理計算上の差異の費用処理額</td><td>27</td></tr> <tr> <td>ニ 確定拠出型企業年金への掛金</td><td>168</td></tr> <tr> <td>ホ 退職給付費用合計</td><td>307</td></tr> </table> 4 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 <table> <tr> <td>イ 退職給付見込額の期間配分方法</td><td>勤続期間比例</td></tr> <tr> <td>ロ 割引率</td><td>1.4%</td></tr> <tr> <td>ハ 数理計算上の差異の処理年数</td><td>10年</td></tr> </table>	イ 退職給付債務	△985	ロ 未積立退職給付債務	△985	ハ 未認識数理計算上の差異	77	ニ 退職給付引当金残高	△907	イ 勤務費用	97	ロ 利息費用	14	ハ 数理計算上の差異の費用処理額	27	ニ 確定拠出型企業年金への掛金	168	ホ 退職給付費用合計	307	イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例	ロ 割引率	1.4%	ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年
イ 退職給付債務	△890																																																
ロ 未積立退職給付債務	△890																																																
ハ 未認識数理計算上の差異	72																																																
ニ 退職給付引当金残高	△818																																																
イ 勤務費用	95																																																
ロ 利息費用	14																																																
ハ 数理計算上の差異の費用処理額	30																																																
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	165																																																
ホ 退職給付費用合計	305																																																
イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例																																																
ロ 割引率	1.6%																																																
ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																
イ 退職給付債務	△985																																																
ロ 未積立退職給付債務	△985																																																
ハ 未認識数理計算上の差異	77																																																
ニ 退職給付引当金残高	△907																																																
イ 勤務費用	97																																																
ロ 利息費用	14																																																
ハ 数理計算上の差異の費用処理額	27																																																
ニ 確定拠出型企業年金への掛金	168																																																
ホ 退職給付費用合計	307																																																
イ 退職給付見込額の期間配分方法	勤続期間比例																																																
ロ 割引率	1.4%																																																
ハ 数理計算上の差異の処理年数	10年																																																

（ストックオプション等関係）

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定条件	平成24年1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	同左

	平成22年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社の従業員 1名
株式の種類別のストックオプションの付与数（注）	普通株式 2,310,000株
付与日	平成22年8月20日
権利確定条件	平成24年1月22日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	19,559,100	—
付与	0	1,702,800
失効	231,000	0
権利確定	0	0
権利未確定残	19,328,100	1,702,800
権利確定後(株)		
期首	—	—
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
権利未行使残	—	—

	平成22年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日
権利確定前(株)	
期首	—
付与	2,310,000
失効	0
権利確定	0
権利未確定残	2,310,000
権利確定後(株)	
期首	—
権利確定	—
権利行使	—
失効	—
権利未行使残	—

(注) 株式数に換算して記載しております。

② 単価情報

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価 (円) (注) 1	0	0

	平成22年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日
権利行使価格(円)	625
付与日における公正な評価単価 (円) (注) 1	0

(注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法による評価額と行使価格との差額）の見積りに
よっております。

2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 — 百万円

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 271名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 48名
株式の種類別のストックオプション の付与数（注）	普通株式 19,724,100株	普通株式 1,702,800株
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定条件	平成24年1月22日（以下「権利行使 可能初日」といいます。）、当該権利 行使可能初日から1年経過した日の 翌日、及び当該権利行使可能初日か ら2年経過した日の翌日まで原則と して従業員等の地位にあることを要 し、それぞれ保有する新株予約権の 2分の1、4分の1、4分の1ずつ権 利確定する。ただし、本新株予約権の 行使時において、当社が株式公開し ていることを要する。	同左
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2年を経過した日まで	同左
権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	同左

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社の従業員 1名	当社の従業員 186名
株式の種類別のストックオプション の付与数（注）	普通株式 2,310,000株	普通株式 6,101,700株
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定条件	平成24年1月22日（以下「権利行使 可能初日」といいます。）、当該権利 行使可能初日から1年経過した日の 翌日、及び当該権利行使可能初日か ら2年経過した日の翌日まで原則と して従業員等の地位にあることを要 し、それぞれ保有する新株予約権の 2分の1、4分の1、4分の1ずつ権 利確定する。ただし、本新株予約権の 行使時において、当社が株式公開し ていることを要する。	平成25年10月7日（以下「権利行使 可能初日」といいます。）、当該権利 行使可能初日から1年経過した日の 翌日、及び当該権利行使可能初日か ら2年経過した日の翌日まで原則と して従業員等の地位にあることを要 し、それぞれ保有する新株予約権の 2分の1、4分の1、4分の1ずつ権 利確定する。ただし、本新株予約権の 行使時において、当社が株式公開し ていることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2 年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2 年を経過した日まで
権利行使期間	平成24年1月22日から 平成32年1月21日まで	平成25年10月7日から 平成33年10月6日まで

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① ストックオプション（新株予約権）の数

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利確定前(株)		
期首	19,328,100	1,702,800
付与	0	0
失効	112,200	26,400
権利確定	0	0
権利未確定残	19,215,900	1,676,400
権利確定後(株)		
期首	—	—
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
権利未行使残	—	—

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利確定前(株)		
期首	2,310,000	—
付与	0	6,101,700
失効	0	9,900
権利確定	0	0
権利未確定残	2,310,000	6,091,800
権利確定後(株)		
期首	—	—
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
権利未行使残	—	—

(注) 株式数に換算して記載しております。

② 単価情報

	平成21年度ストックオプション(1)	平成21年度ストックオプション(2)
付与日	平成22年2月8日	平成22年8月20日
権利行使価格(円)	625	625
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

	平成22年度ストックオプション(1)	平成23年度ストックオプション(1)
付与日	平成22年8月20日	平成23年10月7日
権利行使価格(円)	625	737 (注) 3
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

(注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（取引事例比準法による評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。

2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額

当事業年度末における本源的価値の合計額 — 百万円

3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するよう調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

(税効果会計関係)

第52期 (平成23年3月31日)		第53期 (平成24年3月31日)	
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		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：百万円)		(単位：百万円)	
繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)	
賞与引当金繰入超過額	886	賞与引当金繰入超過額	775
その他	255	その他	309
	<u>1,142</u>		<u>1,084</u>
繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)	
投資有価証券等評価損	60	投資有価証券等評価損	52
関係会社株式評価損	185	関係会社株式評価損	205
退職給付引当金超過額	333	退職給付引当金超過額	329
固定資産減価償却超過額	234	固定資産減価償却超過額	190
その他	99	その他	28
	<u>912</u>		<u>806</u>
繰延税金資産合計	2,054	繰延税金資産小計	1,890
		評価性引当金	<u>△61</u>
繰延税金負債(固定)		繰延税金資産合計	1,829
その他有価証券評価差額金	43		
繰延税金負債合計	43	繰延税金負債(固定)	
繰延税金資産の純額	<u>2,010</u>	その他有価証券評価差額金	22
		繰延税金負債合計	22
		繰延税金資産の純額	<u>1,807</u>
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		2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	40.6%	法定実効税率	40.6%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	2.7%	交際費等永久に損金に算入されない項目	2.5%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△7.3%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△5.6%
海外子会社の留保利益の影響額等	0.5%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.8%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>36.5%</u>	海外子会社の留保利益の影響額等	2.7%
		税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>44.0%</u>

第52期 (平成23年3月31日)	第53期 (平成24年3月31日)
	3 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正 経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律及び東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法が平成23年12月2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24年4月1日以降解消されるものに限り）に使用した法定実効税率は、前事業年度の40.6%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成24年4月1日から平成27年3月31日までのものは38.0%、平成27年4月1日以降のものについては35.6%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（繰延税金負債を控除した金額）が170百万円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が174百万円、その他有価証券評価差額金額が4百万円、それぞれ増加しております。

（関連当事者情報）

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の 名称又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	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 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	住友信託銀行株式会社	大阪市 中央区	342,037	信託銀行 業	(被所有) 直接 98.60 (注)2	投資信託受 益証券の募 集販売	信託約款に定める 受益者に対する収 益分配金及び償還 金の支払委託に係 る代行手数料の支 払 (注)1	308	未払手 数料	24

上記の金額のうち、取引金額には消費税が含まれておらず、未払手数料の期末残高には消費税が含まれております。

(注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

信託約款に定める受益者の負担する信託報酬のうち委託者報酬分を、市場価格を勘案し両者協議の上配分を合理的に決定しております。

2 議決権等の被所有割合は、自己株式（109,600 株）を控除して計算しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は 氏名	所在地	資本金又は出 資金 (千SGD)	事業の 内容	議決権等の所 有(被所有)割 合(%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)
子会社	Nikko Asset Management Singapore Limited	シンガポール 国	115,000	アセットマネ ジメント業	直接 100.00	—	増資の引受 (注)1	7,351

(注) 1 取引条件及び取引条件の決定方針等

Nikko Asset Management Singapore Limitedの行った112,500千株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成22年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	9,325百万円
負債合計	1,342百万円
純資産合計	7,982百万円

営業収益	9,228百万円
税引前当期純利益	3,523百万円
当期純利益	2,729百万円

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の 名称又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	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 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	住友信託銀行株式会社 (注)3	大阪市 中央区	342,037	信託銀行 業	(被所有) 直接 91.34 (注)2	投資信託受 益証券の募 集販売	自己株式の取得 (注)1	8,700	—	—

上記の金額のうち、取引金額には消費税が含まれておりません。

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 当社株式14,283,400株を1株につき609.10円で取得したものであります。
- 2 議決権等の被所有割合は、自己株式（109,600株）を控除して計算しております。
- 3 住友信託銀行株式会社は、平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社及び中央三井アセット信託銀行株式会社を吸収合併し、三井住友信託銀行株式会社に社名を変更しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の 名称又は氏名	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	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 (百万円)	科目	期末残 高(百万 円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール 国	252,000	アセットマネ ジメント業	直接 100.00	—	増資の引受 (注1)	8,095	—	—
							株式売買代金 相当額の引受 (注2)	8,095	—	—

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 Nikko Asset Management Singapore Limitedの行った137,000,000株の新株発行増資を、1株につき1シンガポールドルで当社が引受けたものであります。なお、Nikko Asset Management Singapore Limitedは、当事業年度中にNikko Asset Management International Limited に社名を変更しております。
- 2 DBS Asset Management Ltd（現社名Nikko Asset Management Asia Limited）株式の売買代金相当額をNikko Asset Management Singapore Limited（現社名Nikko Asset Management International Limited）から当社が受領したものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

住友信託銀行株式会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は平成23年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	9,309百万円
負債合計	1,103百万円
純資産合計	8,206百万円
営業収益	7,961百万円
税引前当期純利益	2,868百万円
当期純利益	2,181百万円

（セグメント情報等）

セグメント情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

関連情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

（1）営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無い場合、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無い場合、記載しておりません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

（1）営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無い場合、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無い場合、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第52期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

第53期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

	第52期 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)	第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)
1株当たり純資産額	224円92銭	227円16銭
1株当たり当期純利益金額	16円22銭	13円09銭

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。

2 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。

項目	第52期 (自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日)	第53期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益（百万円）	3,195	2,570
普通株主に帰属しない金額（百万円）	—	—
普通株式に係る当期純利益（百万円）	3,195	2,570
普通株式の期中平均株式数（千株）	196,926	196,278
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	平成21年度ストックオプション(1) 19,328,100株、平成21年度ストックオプション(2) 1,702,800株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株	平成21年度ストックオプション(1) 19,215,900株、平成21年度ストックオプション(2) 1,676,400株、平成22年度ストックオプション(1) 2,310,000株、第1回新株予約権2,955,200株、平成23年度ストックオプション(1) 6,091,800株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第52期 (平成23年 3 月31日)	第53期 (平成24年 3 月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	44,287	44,729
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	—	—
普通株式に係る期末の純資産額（百万円）	44,287	44,729
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数（千株）	196,903	196,903

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

独立監査人の中間監査報告書

平成24年11月7日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 佐々木 貴 司
業務執行社員

指定社員 公認会計士 和 田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）の平成24年3月27日から平成24年9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、年金積立 グローバル・ラップ・バランス（積極成長型）の平成24年9月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成24年3月27日から平成24年9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

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

以 上

(注) 1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月15日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員

公認会計士 佐々木 貴 司

業務執行社員

指定社員

公認会計士 辻 村 和 之

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第53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きが実施される。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、日興アセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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