

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成25年3月8日

【発行者名】 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 鈴木 郁也

【本店の所在の場所】 東京都港区芝3丁目33番1号

【事務連絡者氏名】 ファンド・レポーティング部長 橋詰 廣志

【電話番号】 03-6737-0521

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンド
の名称】 外国債券オープン（3ヶ月決算型）

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 上限10兆円

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【証券情報】**(1)【ファンドの名称】**

外国債券オープン（3ヶ月決算型）

愛称として「世界・セレクト3M」という名称を用いることがあります。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

本ファンドについて、委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

本ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託者は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額 とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）をそのときの受益権総口数で除した1口当たりの純資産価額をいいます。基準価額は、組み入れる有価証券等の値動きにより、日々変動します。なお、基準価額は、翌日の日本経済新聞に掲載されます（表示は1万口当たりに換算した価額で行われます。）。また、委託者および指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）で入手できますので、委託者または指定販売会社（以下「販売会社」といいます。）にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、以下の通りです。

<お問い合わせ先>

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(5)【申込手数料】

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

申込手数料の詳細につきましては、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社の詳細につきましては、前記「(4)発行（売出）価格」に記載のお問い合わせ先までお問い合わせください。

「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

(6)【申込単位】

指定販売会社が個別に定める単位とします。詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「(4)発行（売出）価格」に記載されている先と同じです。

(7)【申込期間】

継続募集期間

平成25年3月10日から平成26年3月14日まで

継続募集を行う期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することによって更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「(4)発行（売出）価格」に記載されている先と同じです。

(9) 【払込期日】

取得申込者は、取得申込みに係る金額を指定販売会社が指定する期日までに申込みの指定販売会社に支払うものとします。各取得申込受付日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」または「委託会社」ということがあります。）の指定する口座を經由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託者」または「受託会社」ということがあります。）の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込みの指定販売会社とします。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「(4)発行（売出）価格」に記載されている先と同じです。

(11) 【振替機関に関する事項】

本ファンドの受益権に係る振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

振替受益権について

本ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、前記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

本ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および前記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

投資信託振替制度においては、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステムの帳簿（振替口座簿）への記載・記録によって行われますので、やむを得ない事情等がある場合を除き、受益証券は発行されません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

日本を除く世界の主要国の公社債に投資し、インカムゲイン（債券の利息収入等）を確保しつつ、海外の主要な債券市場の動きをとらえることを目指します。

なお、信託金の限度額は、5,000億円とします。ただし、委託者は、受託者と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

ファンドの特色

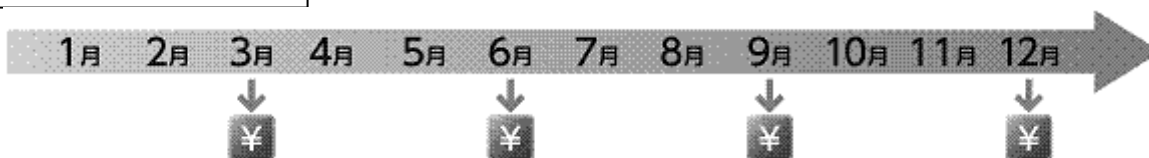
- 日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とし、ファミリーファンド方式で運用を行います。
投資対象は、原則としてシティグループ世界国債インデックス（除く日本）に採用されている国・地域の公社債です。
原則として、為替ヘッジは行いません。
- 原則として、年4回（3月、6月、9月、12月）の15日（休業日の場合は翌営業日）の決算時に収益の分配を行います。

分配方針

分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。

原則として、年4回（3月、6月、9月、12月の15日（休業日の場合は翌営業日））決算を行い、収益の分配を行います。

収益分配のイメージ



※上記はイメージであり、将来の分配金の支払い及びその金額について示唆あるいは保証するものではありません。

分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

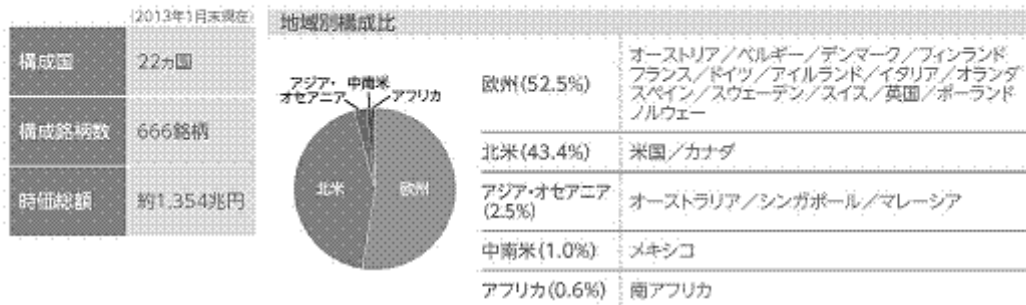
! 主な投資制限

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

+1 ご参考情報

シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)とは



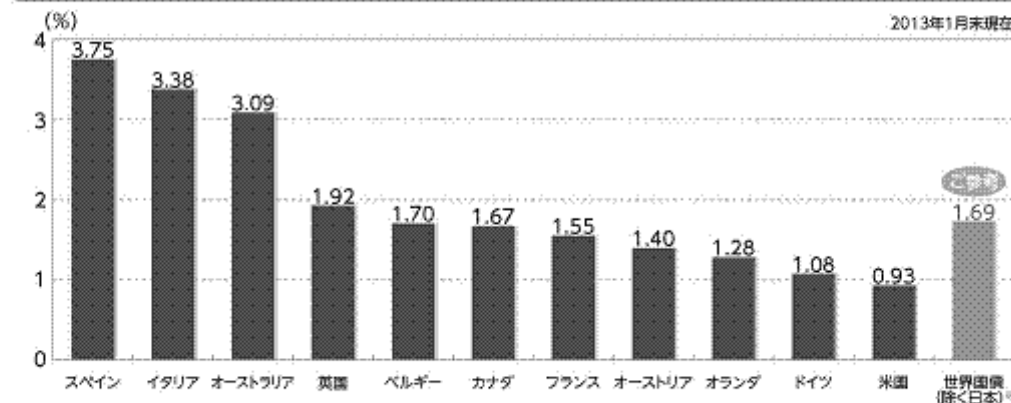
(出所)CGMI社のデータをもとに三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※時価総額は当該日の為替データをもとに三井住友トラスト・アセットマネジメントが再換算しています。

※地域別構成比は繰越処理の関係で合計額が100%と異なる場合があります。

※「シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」とは、シティグループ「グローバル・マーケッツ・インク(CGMI社)」が開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを含む市場の時価総額で加重平均した債券インデックス(円ベースの指数)です。シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、CGMI社の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など均指数に関するすべての権利は、CGMI社が有しています。なお、CGMI社は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

主な投資対象国の債券利回り



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

※世界国債(除く日本)は、シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の利回りです。

※上記は、シティグループ世界国債インデックスの各国債券利回りを使用しています。

[ファンドの商品分類]

本ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法において、以下のように分類・区分されます。本ファンドの商品分類・属性区分に該当しない定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
追加型投信	海外	債券
	内外	不動産投信
		その他資産
		()
		資産複合

(注) 本ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

[分類における定義]

分類項目	該当分類	分類の定義
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	海外	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資対象資産 (収益の源泉)	債券	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
-------------------	----	--

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (日本を除く) 日本	ファミリーファンド	あり ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア		
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券 (債券 公債))	その他 ()	アフリカ 中近東 (中東)		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) 本ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

[区分における定義]

区分項目	該当区分	定義
投資対象資産	その他資産 (投資信託証券 (債券 公債))	目論見書または投資信託約款において、組入れている資産が主として投資信託証券であり(投資形態がファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズのものを含みます。)、実質的に公債(日本国または各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。))に主として投資する旨の記載があるものをいいます。 本ファンドでは主要投資対象の投資信託証券を通じて債券に投資します。このため、収益の源泉となる資産を記載する商品分類表の投資対象資産が「債券」であるのに対して、組み入れている資産そのものを記載する属性区分表の投資対象資産は「その他資産(投資信託証券)」となっています。
決算頻度	年4回	目論見書または投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル (日本を除く)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界(日本を除きます。)の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズ)にのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資する旨の記載があるものをいいます。
為替ヘッジ	なし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

(2) 【ファンドの沿革】

平成15年12月16日 本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

平成24年 4月 1日 本ファンドの名称を「住信 外国債券オープン（3ヶ月決算型）」から「外国債券オープン（3ヶ月決算型）」に変更

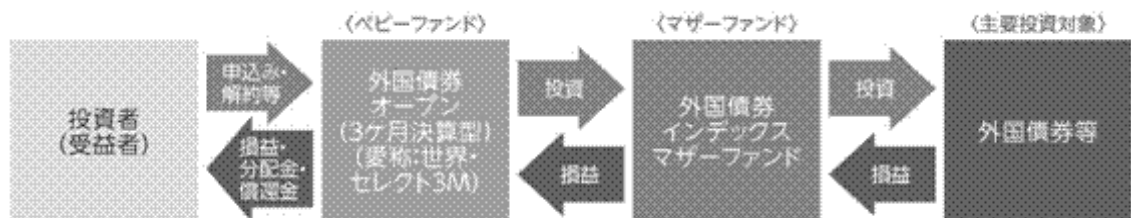
本ファンドの主要投資対象である「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の名称を「外国債券インデックス マザーファンド」に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

(イ) ファミリーファンド方式での運用

ファミリーファンド方式（ ）で運用します。

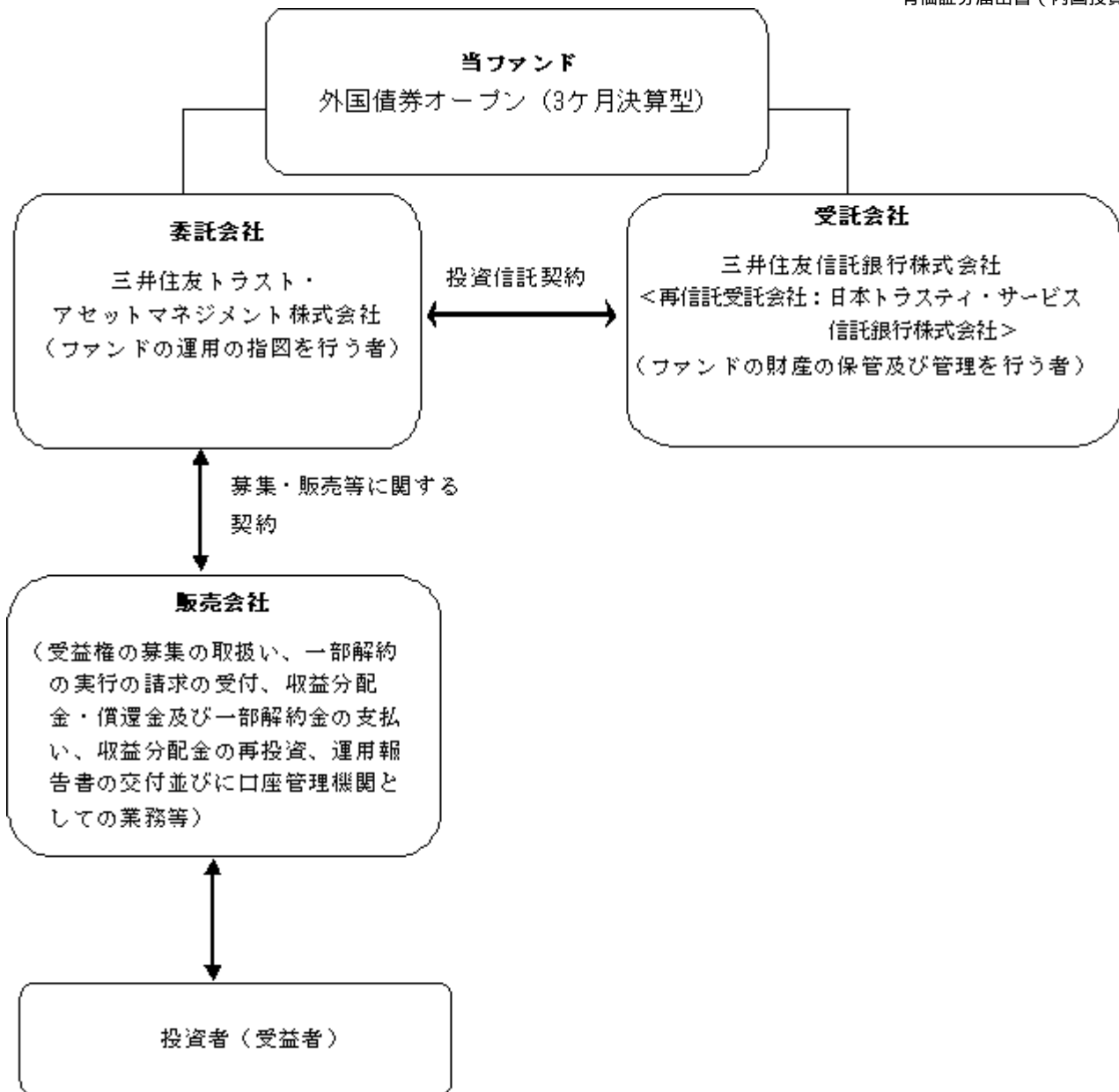
ファミリーファンド方式とは、投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンド（外国債券オープン（3ヶ月決算型））とし、その資金をマザーファンド（外国債券インデックス マザーファンド）に投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



〈マザーファンドの概要〉

マザーファンド	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
外国債券インデックスマザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

(ロ) 本ファンドの関係法人図



(八) 委託会社等の概況

資本金

平成25年1月31日現在 3億円

会社の沿革

昭和61年11月 1日 住信キャピタルマネジメント株式会社設立

昭和62年 2月20日 投資顧問業の登録

昭和62年 9月 9日 投資一任契約に係る業務の認可

平成 2年10月 1日 住信投資顧問株式会社に商号変更

平成11年 2月15日 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更

平成11年 3月25日 証券投資信託委託業の認可

平成19年 9月30日 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録
(登録番号：関東財務局長(金商)第347号)

平成24年 4月 1日 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

大株主の状況(平成25年1月31日現在)

株主名	住所	持株数	持株比率
-----	----	-----	------

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

(イ)基本方針

本ファンドは、日本を除く世界の主要国の公社債に投資し、インカムゲインを確保しつつ、海外の主要な債券市場の動きをとらえることを目指して運用を行います。

(ロ)運用方法

投資対象

外国債券インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。なお、世界の主要国の公社債（シティグループ世界国債インデックス（除く日本）に採用されている国・地域の公社債）に直接投資する場合があります。

投資態度

- 1)債券への実質投資比率は、原則として高位を維持します。
- 2)原則として、為替ヘッジは行いません。
- 3)国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（スワップ取引）、ならびに金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。
- 4)ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

(参考)「外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1.基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2.運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプショ

ン取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

3. 運用制限

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(2) 【投資対象】

(イ) 本ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第26条、第27条および第28条に定めるものに限りません。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

(ロ) 委託者は、信託金を、主としてマザーファンド受益証券および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

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

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

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

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

(八) 委託者は、信託金を、前記(ロ)に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

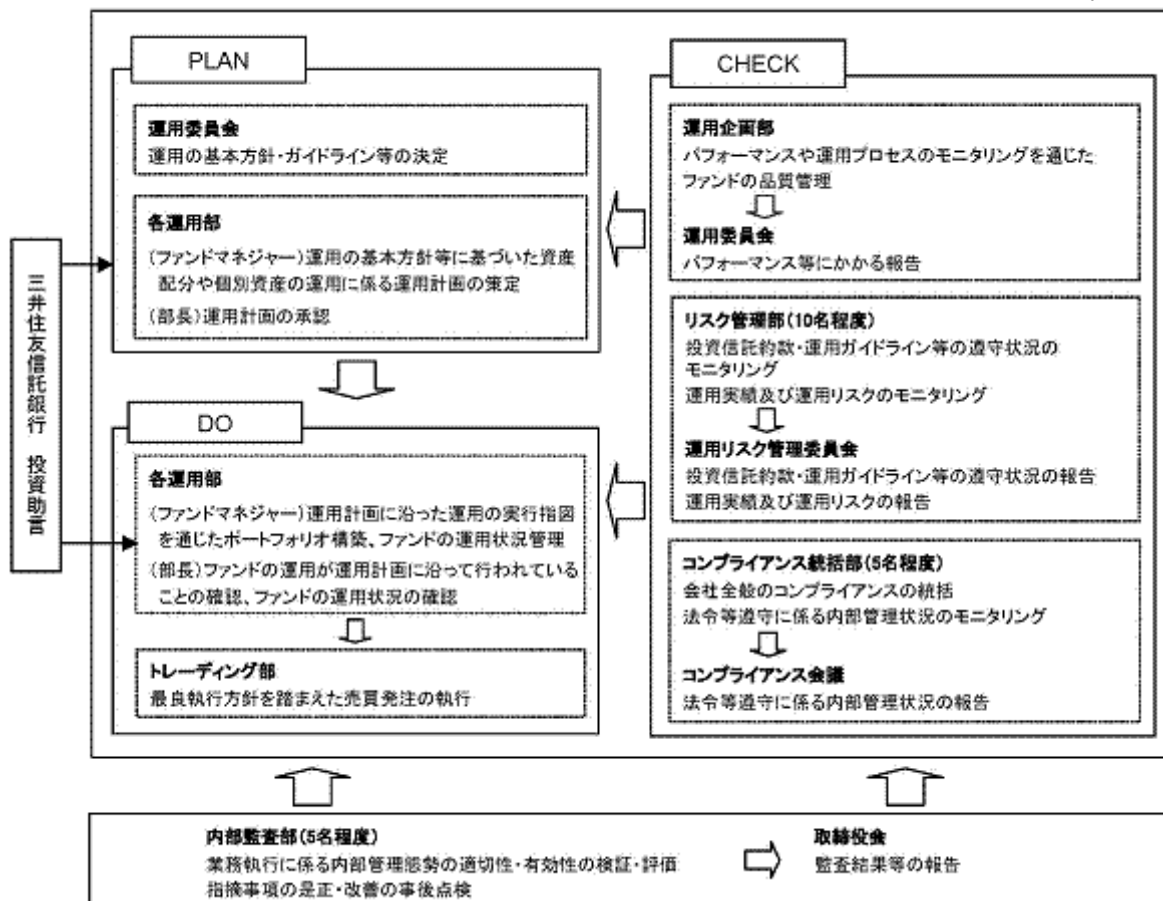
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

(二) 前記(ロ)の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前記(八)第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、平成25年3月8日現在のものであり、今後変更されることがあります。



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

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

(4) 【分配方針】

(イ) 分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき収益分配を行います。

分配対象額の範囲

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

分配対象額についての分配方針

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

留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

(ロ) 収益の分配

投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1) 投資信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とみなし配当等収益との合計額から諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 売買損益に評価損益を加減して得た額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(5) 【投資制限】

(イ) 投資信託約款にもとづく投資制限

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第22条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第25条）

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券

4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求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り取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（以下同じ。）委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことを指図することができます。また、委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。（投資信託約款第26条）

委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第27条）

委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことを指図することができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として本ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする外貨建資産（以下「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。（投資信託約款第28条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。（投資信託約款第29条）

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合

計額を超えないものとします。

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

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算において投資信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（投資信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとし、売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第30条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第31条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。この指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第33条）

委託者は、投資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（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。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。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資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投資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間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資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、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資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。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第40条）

前記 から における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記 から に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。前記 、 および における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

（ロ）法律等で規制される取引等

委託者は、「金融商品取引法」および「投資信託及び投資法人に関する法律」等関係法令を遵守し、受益者のため忠実に、また受益者に対し善良な管理者の注意をもって、投資信託財産の運用の指図その他の業務を遂行しなければなりません。関係法令に定める運用上の禁止行為または規制事項のうち後記される利害関係人との取引制限を除く主なものは、以下の通りです。

< 同一の法人の発行する株式への投資制限 >（投資信託及び投資法人に関する法律）

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、投資信託財産として有する同一の法人の発行する株式に係る議決権の総数が、当該法人の総発行株式の数に係る議決権の総数に100分の50の率を乗

じて得た数を超えることとなる場合には、かかる株式を取得することを受託会社に指図してはならない。

<デリバティブ取引に係る投資制限>（金融商品取引業等に関する内閣府令）

投資信託財産に関し、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係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託者が定めた合理的な方法により算出した額が当該投資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係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てはならない。

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様様に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

為替変動リスク

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

金利変動リスク

債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

カントリーリスク

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

流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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

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

ではありません。

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

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

(2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

申込手数料（受益権1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、1.05%（税抜 1.0%）の率を上限として、指定販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料の詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、以下の通りです。

<お問い合わせ先>

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬総額	配分		
	委託者	指定販売会社	受託者
純資産総額に対して 年率0.9450% （税抜0.90%）	純資産総額に対して 年率0.4200% （税抜0.40%）	純資産総額に対して 年率0.4725% （税抜0.45%）	純資産総額に対して 年率0.0525% （税抜0.05%）

信託報酬は信託期間を通じて毎日計算し、投資信託財産の費用として計上します。

上記により日々計算された信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき、投資信託財産中から支弁するものとします。マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

(4) 【その他の手数料等】

(イ) ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保金として当該基準価額から控除します。

「信託財産留保金」（以下「信託財産留保額」ということがあります。）とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から頂く一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。以下同じ。

(ロ) 投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に関する諸費用（消費税等を含みます。）ならびに受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。投資信託約款の定めにもとづいて、資金の借入れを行う場合の利息も同様です。負担の水準・計算方法は、個別の費用・税金等

により異なり、実費での負担（運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。）となります。（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）

（八）証券取引に伴う売買委託手数料等の手数料（消費税等を含みます。）または税金、先物・オプション取引に要する費用（消費税等を含みます。）、組入資産の保管に要する費用（消費税等を含みます。）等は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。負担の水準・計算方法は、個別の費用・税金等により異なり、実費での負担（運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。）となります。（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）

（二）投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）は、毎計算期末または信託終了のとき、投資信託財産中から支弁します。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

（5）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

（イ）個人の受益者に対する課税

収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

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

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

一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記の表の通りです。

損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡所得の金額及び申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得の金額から控除することが可能となります。また、一部解約時及び償還時の差益については、上場株式等の譲渡損失との通算が可能となります。

（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並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税率（所得税のみ）
平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	7.147%
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

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

（ハ）個別元本について

追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。

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。

ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

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「（二）普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

（二）普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

上記は、平成25年1月31日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

(平成25年1月31日現在)

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	648,908,220	100.57
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,708,358	0.57
合計(純資産総額)		645,199,862	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a . 投資有価証券の主要銘柄

(平成25年1月31日現在)

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	302,464,911	1.9727	596,672,530	2.1454	648,908,220	100.57

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b . 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.57
合計	100.57

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

c . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1特定期間末 (平成16年 6月15日)	1,507,785,861	1,522,165,315	10,026	10,122
第2特定期間末 (平成16年12月15日)	1,906,465,819	1,923,759,753	10,562	10,658
第3特定期間末 (平成17年 6月15日)	2,032,108,194	2,050,845,572	10,391	10,487
第4特定期間末 (平成17年12月15日)	2,073,640,556	2,091,762,971	10,963	11,059
第5特定期間末 (平成18年 6月15日)	1,867,866,681	1,888,769,011	10,711	10,830
第6特定期間末 (平成18年12月15日)	1,919,401,254	1,939,635,178	11,370	11,489
第7特定期間末 (平成19年 6月15日)	1,877,792,260	1,897,542,132	11,401	11,521
第8特定期間末 (平成19年12月17日)	1,812,278,240	1,831,467,118	11,333	11,453
第9特定期間末 (平成20年 6月16日)	1,769,532,399	1,788,929,479	10,947	11,067
第10特定期間末 (平成20年12月15日)	1,455,646,250	1,475,550,002	8,776	8,896
第11特定期間末 (平成21年 6月15日)	1,536,306,770	1,555,855,341	9,431	9,551
第12特定期間末 (平成21年12月15日)	1,381,615,989	1,400,289,608	8,879	8,999
第13特定期間末 (平成22年 6月15日)	1,177,318,965	1,194,445,065	8,249	8,369
第14特定期間末 (平成22年12月15日)	928,323,926	942,928,572	7,628	7,748
第15特定期間末 (平成23年 6月15日)	814,421,412	827,391,690	7,535	7,655
第16特定期間末 (平成23年12月15日)	672,862,123	684,451,574	6,967	7,087
第17特定期間末 (平成24年 6月15日)	628,834,971	639,683,910	6,956	7,076
第18特定期間末 (平成24年12月17日)	607,656,284	612,439,381	7,623	7,683
平成24年 1月末日	667,463,661		6,984	
2月末日	706,498,497		7,495	
3月末日	684,413,010		7,443	
4月末日	671,851,999		7,356	
5月末日	636,204,528		7,002	
6月末日	619,741,203		6,917	
7月末日	603,800,816		6,879	
8月末日	610,555,345		6,992	
9月末日	583,923,960		6,980	

10月末日	586,518,031		7,168
11月末日	594,985,039		7,459
12月末日	630,353,331		7,886
平成25年 1月末日	645,199,862		8,293

【分配の推移】

期 間	1 万口当たりの分配金(円)
第1特定期間(平成15年12月16日～平成16年 6月15日)	190
第2特定期間(平成16年 6月16日～平成16年12月15日)	192
第3特定期間(平成16年12月16日～平成17年 6月15日)	192
第4特定期間(平成17年 6月16日～平成17年12月15日)	192
第5特定期間(平成17年12月16日～平成18年 6月15日)	216
第6特定期間(平成18年 6月16日～平成18年12月15日)	240
第7特定期間(平成18年12月16日～平成19年 6月15日)	240
第8特定期間(平成19年 6月16日～平成19年12月17日)	240
第9特定期間(平成19年12月18日～平成20年 6月16日)	240
第10特定期間(平成20年 6月17日～平成20年12月15日)	240
第11特定期間(平成20年12月16日～平成21年 6月15日)	240
第12特定期間(平成21年 6月16日～平成21年12月15日)	240
第13特定期間(平成21年12月16日～平成22年 6月15日)	240
第14特定期間(平成22年 6月16日～平成22年12月15日)	240
第15特定期間(平成22年12月16日～平成23年 6月15日)	240
第16特定期間(平成23年 6月16日～平成23年12月15日)	240
第17特定期間(平成23年12月16日～平成24年 6月15日)	240
第18特定期間(平成24年 6月16日～平成24年12月17日)	120

【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第1特定期間(平成15年12月16日～平成16年 6月15日)	2.2
第2特定期間(平成16年 6月16日～平成16年12月15日)	7.3
第3特定期間(平成16年12月16日～平成17年 6月15日)	0.2
第4特定期間(平成17年 6月16日～平成17年12月15日)	7.4
第5特定期間(平成17年12月16日～平成18年 6月15日)	0.3
第6特定期間(平成18年 6月16日～平成18年12月15日)	8.4
第7特定期間(平成18年12月16日～平成19年 6月15日)	2.4
第8特定期間(平成19年 6月16日～平成19年12月17日)	1.5
第9特定期間(平成19年12月18日～平成20年 6月16日)	1.3
第10特定期間(平成20年 6月17日～平成20年12月15日)	17.6
第11特定期間(平成20年12月16日～平成21年 6月15日)	10.2
第12特定期間(平成21年 6月16日～平成21年12月15日)	3.3
第13特定期間(平成21年12月16日～平成22年 6月15日)	4.4
第14特定期間(平成22年 6月16日～平成22年12月15日)	4.6
第15特定期間(平成22年12月16日～平成23年 6月15日)	1.9
第16特定期間(平成23年 6月16日～平成23年12月15日)	4.4
第17特定期間(平成23年12月16日～平成24年 6月15日)	3.3
第18特定期間(平成24年 6月16日～平成24年12月17日)	11.3

(注1)収益率とは、各特定期間末の基準価額(分配落)から前特定期間末の基準価額(分配落)を控除した額に特定期間中の分配金累計額を加算し、前特定期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
-----	---------	---------	-----------

第1特定期間 (平成15年12月16日～平成16年 6月15日)	1,539,345,245	35,452,375	1,503,892,870
第2特定期間 (平成16年 6月16日～平成16年12月15日)	325,506,850	24,341,134	1,805,058,586
第3特定期間 (平成16年12月16日～平成17年 6月15日)	223,277,575	72,747,703	1,955,588,458
第4特定期間 (平成17年 6月16日～平成17年12月15日)	112,809,069	176,926,612	1,891,470,915
第5特定期間 (平成17年12月16日～平成18年 6月15日)	45,031,142	192,553,306	1,743,948,751
第6特定期間 (平成18年 6月16日～平成18年12月15日)	93,166,121	148,919,212	1,688,195,660
第7特定期間 (平成18年12月16日～平成19年 6月15日)	91,723,995	132,925,901	1,646,993,754
第8特定期間 (平成19年 6月16日～平成19年12月17日)	76,391,525	124,312,077	1,599,073,202
第9特定期間 (平成19年12月18日～平成20年 6月16日)	76,296,434	58,946,258	1,616,423,378
第10特定期間 (平成20年 6月17日～平成20年12月15日)	125,861,420	83,638,777	1,658,646,021
第11特定期間 (平成20年12月16日～平成21年 6月15日)	70,962,349	100,560,786	1,629,047,584
第12特定期間 (平成21年 6月16日～平成21年12月15日)	41,379,680	114,292,347	1,556,134,917
第13特定期間 (平成21年12月16日～平成22年 6月15日)	76,018,695	204,978,574	1,427,175,038
第14特定期間 (平成22年 6月16日～平成22年12月15日)	28,488,400	238,609,567	1,217,053,871
第15特定期間 (平成22年12月16日～平成23年 6月15日)	33,862,956	170,060,256	1,080,856,571
第16特定期間 (平成23年 6月16日～平成23年12月15日)	24,850,133	139,919,059	965,787,645
第17特定期間 (平成23年12月16日～平成24年 6月15日)	26,776,241	88,485,634	904,078,252
第18特定期間 (平成24年 6月16日～平成24年12月17日)	41,571,007	148,466,309	797,182,950

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

(参考情報)

外国債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

(平成25年1月31日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	93,178,479,501	40.47
	フランス	22,504,437,119	9.78
	イタリア	21,414,200,974	9.30
	ドイツ	20,399,900,505	8.86
	イギリス	17,048,261,855	7.41
	スペイン	10,194,814,952	4.43
	オランダ	6,202,996,716	2.69
	カナダ	6,185,874,163	2.69
	ベルギー	6,083,368,173	2.64
	オーストリア	3,898,279,897	1.69
	オーストラリア	3,464,695,840	1.50
	メキシコ	2,210,291,847	0.96

デンマーク	1,828,530,938	0.79
アイルランド	1,793,844,958	0.78
ポーランド	1,722,947,234	0.75
スウェーデン	1,393,883,314	0.61
フィンランド	1,380,643,514	0.60
南アフリカ	1,374,223,806	0.60
マレーシア	1,202,814,739	0.52
スイス	960,536,937	0.42
シンガポール	881,238,584	0.38
ノルウェー	589,203,396	0.26
小計	225,913,468,962	98.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	4,302,541,239	1.87
合計(純資産総額)	230,216,010,201	100.00

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

(平成25年1月31日現在)

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額			
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/14	37,400,000	9,567.92	3,578,403,115	9,440.46	3,530,733,341	2.625	2014/07/31	1.53
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/30/15	29,100,000	9,381.13	2,729,909,219	9,364.81	2,725,161,828	1.375	2015/11/30	1.18
アメリカ	国債証券	T 0.875% 02/28/17	22,900,000	9,180.22	2,102,270,912	9,191.61	2,104,879,794	0.875	2017/02/28	0.91
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/14	22,600,000	9,335.79	2,109,890,416	9,257.82	2,092,269,135	1.750	2014/01/31	0.91
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/14	22,000,000	9,358.22	2,058,810,128	9,279.00	2,041,381,973	1.750	2014/03/31	0.89
アメリカ	国債証券	T 2.5% 03/31/15	20,700,000	9,625.02	1,992,379,458	9,549.22	1,976,690,600	2.500	2015/03/31	0.86
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	18,000,000	10,692.57	1,924,662,985	10,511.18	1,892,013,356	3.625	2021/02/15	0.82
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	19,200,000	9,602.81	1,843,739,743	9,507.57	1,825,455,163	2.375	2015/02/28	0.79
アメリカ	国債証券	T 1.5% 07/31/16	18,800,000	9,493.14	1,784,710,771	9,422.30	1,771,393,977	1.500	2016/07/31	0.77
アメリカ	国債証券	T 0.75% 06/30/17	19,400,000	9,184.81	1,781,854,261	9,117.02	1,768,703,014	0.750	2017/06/30	0.77
アメリカ	国債証券	T 2.625% 06/30/14	16,000,000	9,549.38	1,527,902,064	9,422.66	1,507,626,214	2.625	2014/06/30	0.65
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	9,483.11	1,422,467,550	9,432.45	1,414,867,841	1.750	2015/07/31	0.61
アメリカ	国債証券	T 1.875% 04/30/14	15,100,000	9,387.42	1,417,500,420	9,303.75	1,404,866,775	1.875	2014/04/30	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/30/16	14,000,000	9,942.80	1,391,993,250	9,851.13	1,379,158,368	2.750	2016/11/30	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.625% 08/15/20	13,500,000	9,960.67	1,344,691,590	9,847.92	1,329,469,615	2.625	2020/08/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	12,800,000	10,366.53	1,326,916,282	10,195.74	1,305,055,971	3.125	2019/05/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	9,105.34	1,274,747,838	9,094.06	1,273,168,837	0.250	2015/07/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	10,212.30	1,276,538,739	10,010.27	1,251,283,845	4.250	2015/08/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	13,100,000	9,512.28	1,246,108,915	9,453.99	1,238,473,707	1.875	2015/06/30	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.125% 11/30/14	12,600,000	9,519.29	1,199,431,747	9,423.91	1,187,412,969	2.125	2014/11/30	0.52
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 08/01/14	9,200,000	12,377.65	1,138,744,563	12,858.25	1,182,959,533	4.250	2014/08/01	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/31/14	12,500,000	9,529.11	1,191,139,419	9,420.53	1,177,566,395	2.375	2014/08/31	0.51
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/14	12,000,000	9,899.01	1,187,881,939	9,677.39	1,161,286,922	4.250	2014/08/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	11,500,000	9,948.84	1,144,116,876	9,829.95	1,130,444,281	2.625	2020/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/22	12,500,000	9,227.60	1,153,450,104	8,998.47	1,124,809,094	1.750	2022/05/15	0.49
イギリス	国債証券	UKT 4% 09/07/16	6,850,000	16,389.60	1,122,687,605	16,097.06	1,102,649,277	4.000	2016/09/07	0.48
アメリカ	国債証券	T 1% 09/30/16	11,500,000	9,259.47	1,064,839,474	9,257.29	1,064,589,433	1.000	2016/09/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 3.75% 11/15/18	10,000,000	10,676.19	1,067,619,428	10,498.89	1,049,889,964	3.750	2018/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/15/15	11,500,000	9,106.88	1,047,291,216	9,128.23	1,049,747,147	0.375	2015/04/15	0.46
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000	13,387.95	1,057,648,699	13,187.58	1,041,818,853	3.500	2015/04/25	0.45

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.13
合計	98.13

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

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

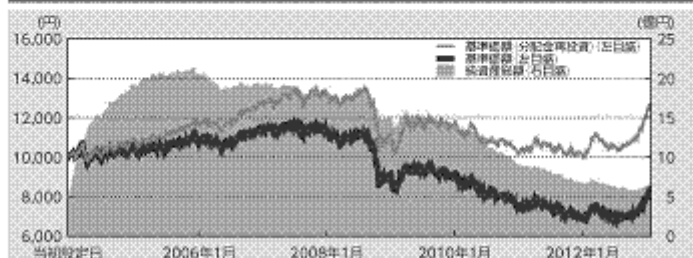
資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先物取引	US 5YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	17	2,110,208.64	2,102,820.27	191,651,039	0.08
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	9	1,188,723.50	1,180,687.50	107,607,858	0.05
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	6	872,617.75	858,375	78,232,297	0.03
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融 先物取引所	買建	ユーロ	9	993,746	991,665	122,659,043	0.05
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融 先物取引所	買建	ユーロ	9	1,136,876	1,128,060	139,529,741	0.06
	EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金融 先物取引所	買建	ユーロ	15	2,147,500	2,121,450	262,402,150	0.11

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

(参考情報) 交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2003年12月16日
作成基準日：2013年1月31日

基準価額・純資産の推移

※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	8,293円
純資産総額	645百万円

〈基準価額の騰落率〉

1ヶ月	5.16%
3ヶ月	16.61%
6ヶ月	22.54%
1年	24.74%
3年	13.19%
5年	-1.58%
設定来	27.38%

※上記は作成基準日からの期間です。
※騰落率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

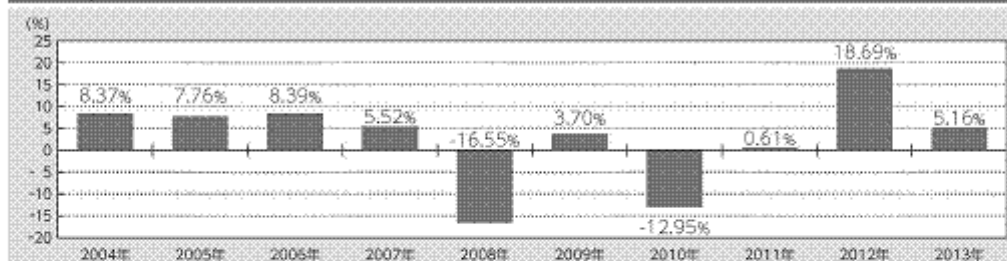
設定来分配金合計額:3,982円 最近1年間分配金合計額:360円

決算期	2011年12月	2012年3月	2012年6月	2012年9月	2012年12月
分配金	120円	120円	120円	60円	60円

※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	利率	償還期限	実質投資比率
T 2.625% 07/31/14	アメリカ	国債証券	2.625%	2014/07/31	1.6%
T 1.375% 11/30/15	アメリカ	国債証券	1.375%	2015/11/30	1.2%
T 0.875% 02/28/17	アメリカ	国債証券	0.875%	2017/02/28	0.9%
T 1.75% 01/31/14	アメリカ	国債証券	1.750%	2014/01/31	0.9%
T 1.75% 03/31/14	アメリカ	国債証券	1.750%	2014/03/31	0.9%
T 2.5% 03/31/15	アメリカ	国債証券	2.500%	2015/03/31	0.9%
T 3.625% 02/15/21	アメリカ	国債証券	3.625%	2021/02/15	0.8%
T 2.375% 02/28/15	アメリカ	国債証券	2.375%	2015/02/28	0.8%
T 1.5% 07/31/16	アメリカ	国債証券	1.500%	2016/07/31	0.8%
T 0.75% 06/30/17	アメリカ	国債証券	0.750%	2017/06/30	0.8%

年間収益率の推移(暦年ベース)

※収益率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※2013年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】**1【申込(販売)手続等】**

本ファンドの受益権の取得申込者は、指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された本ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、指定販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託者は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記

録を行います。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

(イ) 申込手続

本ファンドの受益権の取得申込者は、指定販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行います。取得申込みは、申込期間における毎営業日に、指定販売会社の営業所等で受け付けます。ただし、分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、ニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、取得の申込みは受け付けないものとします。ニューヨークおよびロンドンの銀行の休業日については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、以下の通りです。

<お問い合わせ先>

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<http://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

取得申込みの受付は、原則として、指定販売会社の営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付になります。

本ファンドの受益権の販売価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

(注) 分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

申込代金の払込みについては、指定販売会社が指定する期日までに申込みの指定販売会社に支払うものとします。

申込みには、収益の分配がなされた場合、税金を差し引いた後の分配金を受領する「一般コース」と、税金を差し引いた後の分配金が自動的に無手数料で再投資される「自動けいぞく投資コース」があり（以下、「一般コース」は「分配金受取りコース」、「自動けいぞく投資コース」は「分配金再投資コース」とそれぞれ読み替えるものとします。）、「自動けいぞく投資コース」を選択した場合には、取得申込者は指定販売会社との間で「分配金再投資に関する契約」を別途締結します。なお、指定販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。指定販売会社によって取扱いコースが異なる場合があります。取扱いコースの詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記に記載されている先と同じです。

なお、指定販売会社によっては、定時定額で購入する「自動購入サービス」を利用することもできます。当該サービスを利用する場合には指定販売会社との間で「自動購入サービス」に関する取り決め（指定販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。）を行うものとします。「外国債券オープン（3ヶ月決算型）」または「外国債券オープン（毎月決算型）」のいずれかのファンドを解約した受取金額をもって解約請求受付日当日に他方のファンドの取得申込みを行うこと（以下「スイッチング」といいます。なお、スイッチングの方法等は、購入、換金の場合と同様です。）ができます。ただし、指定販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合がありますので、詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記に記載されている先と同じです。

分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

(ロ) 申込単位

指定販売会社が個別に定める単位とします。詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指

定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。

（八）申込手数料

「第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (1)申込手数料」をご覧ください。
スイッチングの場合には、申込手数料はかかりません。（平成25年3月8日現在）
分配金再投資に関する契約にもとづいて収益分配金を再投資する場合には、申込手数料はかかりません。

2【換金（解約）手続等】

（イ）受益権の買取請求

本ファンドのご換金の方法は、ご解約の請求のほか受益権の買取の方法によることができます。ただし、受益権の買取は、指定販売会社によっては行わない場合がありますので、詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。

（ロ）受益権のご解約の請求

ご解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの投資信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者にご解約の請求をすることができます。ご解約の請求の受付は、原則として、指定販売会社の営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付になります。ただし、ニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、ご解約の請求を受け付けないものとし、ニューヨークおよびロンドンの銀行の休業日については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。なお、解約単位は、指定販売会社が個別に定める単位とします。

受益者が前記のご解約の請求をするときは、指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

委託者は、前記のご解約の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

ご解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た額を信託財産留保金として控除した価額（解約価額）とします。

$$\begin{aligned} \text{解約価額} &= \text{解約請求受付日の翌営業日の基準価額} - \text{信託財産留保金} \\ &= \text{解約請求受付日の翌営業日の基準価額} - (\text{解約請求受付日の翌営業日の基準価額} \times 0.1\%) \end{aligned}$$

ご解約の受取金額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた額（解約代金）となります。

解約代金は、原則として、解約請求受付日より起算して5営業日目から指定販売会社の営業所等において支払います。

委託者は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、前記によるご解約の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けたご解約の請求の受付を取り消すことができます。

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

解約単位および解約価額に関する投資者の皆様による照会方法等については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ

先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。

（八）換金制限

本ファンドの規模および商品性格などにもとづき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間および金額の制限を行う場合があります。詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

（イ）基準価額の算出方法

基準価額とは、投資信託財産に属する有価証券（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）、金融商品等のすべての資産を時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した純資産総額を、本ファンドの基準価額計算日における受益権総口数で除した1口当たり純資産価額をいいます。なお、投資信託財産に属する有価証券等の資産の時価評価は、原則として、法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって評価します。

[主要な投資対象の評価方法]

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象である公社債の評価方法

原則として、計算時において知り得る直近の日（外国で取引されているものについては、原則として、本ファンドの基準価額計算日の前日）の次のいずれかから入手した価額で評価します。

1) 価格情報会社の提供する価額

2) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

外貨建資産の円換算については、原則として、わが国における本ファンドの基準価額計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則として、わが国における本ファンドの基準価額計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

（ロ）基準価額の算出頻度

基準価額は、委託者の営業日において日々算出されます。

（ハ）基準価額に関する投資者による照会方法等

基準価額は、委託者および指定販売会社で入手できます。投資者の皆様による照会方法等については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。なお、基準価額は、翌日の日本経済新聞に掲載されます。ただし、表示は1万口当たりに換算した価額で行われます。

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

平成15年12月16日から投資信託約款第4条の規定による信託終了の日までとします。（原則無期限）

（4）【計算期間】

原則として、毎年12月16日から翌年3月15日まで、3月16日から6月15日まで、6月16日から9月15日まで、および9月16日から12月15日までとします。なお、当該計算期間終了の該当日が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、投資信託約款第4条に定める信託期間の終了日とします。

（5）【その他】

（イ）信託の終了

- (a) 委託者は、投資信託約款の規定による信託終了前にこの投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- (b) 委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- (c) 委託者は、前記(a)および(b)の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (d) 前記(c)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (e) 前記(d)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記(a)および(b)の投資信託契約の解約をしません。
- (f) 委託者は、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (g) 前記(d)から(f)までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記(d)の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

委託者は、監督官庁より、この投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

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

受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し信託を終了させます。

(ロ) 投資信託約款の変更

- (a) 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- (b) 委託者は、前記(a)の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (c) 前記(b)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (d) 前記(c)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記(a)の投資信託約款の変更をしません。
- (e) 委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべて

の受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

委託者は、監督官庁の命令にもとづいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、前記 に記載されている手続きにしたがいます。

(八) 指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約の更改等に関する手続

指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約の有効期間は、契約締結の日から1年間とします。ただし、契約満了日の3ヶ月前までに別段の意思表示のないときは、同一条件にて自動的に1年間更新され、以後も同様とします。期間の途中において必要あるときは、契約の一部を変更することができます。

(二) 運用報告書

委託者は、2計算期間の末日（6月および12月）ごとおよび償還時に、期間中の運用経過のほか投資信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、原則として当該投資信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。

(ホ) 信託事務処理の再信託

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

(ヘ) 公告

委託者が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

本ファンドの受益者が有する主な権利は、以下の通りです。なお、本ファンドの受益権の1口当たり投資信託財産持分は、すべて均等かつ同一であり、取得申込日の前後等により受益者間で1口当たり持分の差異が生じることはありません。

(イ) 収益分配金請求権

受益者は、委託者が支払いを決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として、決算日から起算して5営業日目までに受益者に支払います。収益分配金の支払いは指定販売会社の営業所等において行います。

前記にかかわらず、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者については、収益分配金は、自動的に本ファンドの受益権に再投資されます。この場合、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に支払われ、指定販売会社は、受益者に対して遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は委託者に帰属するものとします。

分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については、原則として、取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日目までにお支払いします。「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、分配金は、税金を差し引いた後、無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(ロ) 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、原則として、償還日から起算して5営業日目までに受益者に支払います。償還金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行われます。

受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属するものとします。

(八) 換金(解約)請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、ご解約の請求をすることにより換金する権利を有します。

(二) 反対者の買取請求権

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

(ホ) 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は、委託者に対し、当該受益者に係る投資信託財産に関する書類の閲覧または謄写の請求をすることができます。

なお、受益者には、議決権、受益者集会の権利はありません。

第3【ファンドの経理状況】

- (1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和38年大蔵省令第59号)」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2)当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。
- (3)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18特定期間(平成24年6月16日から平成24年12月17日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

外国債券オープン（3ヶ月決算型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第17特定期間 (平成24年 6月15日現在)	第18特定期間 (平成24年12月17日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,061	11,062
親投資信託受益証券	628,276,823	614,241,409
未収入金	12,989,000	6,389,000
流動資産合計	641,276,884	620,641,471
資産合計		
	641,276,884	620,641,471
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	10,848,939	4,783,097
未払解約金	-	6,817,927
未払受託者報酬	88,012	76,476
未払委託者報酬	1,496,194	1,300,072
その他未払費用	8,768	7,615
流動負債合計	12,441,913	12,985,187
負債合計		
	12,441,913	12,985,187
純資産の部		
元本等		
元本	904,078,252	797,182,950
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	275,243,281	189,526,666
（分配準備積立金）	25,238,527	20,162,555
元本等合計	628,834,971	607,656,284
純資産合計		
	628,834,971	607,656,284
負債純資産合計		
	641,276,884	620,641,471

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第17特定期間 (自 平成23年12月16日 至 平成24年 6月15日)	第18特定期間 (自 平成24年 6月16日 至 平成24年12月17日)
営業収益		
受取利息	89	89
有価証券売買等損益	26,088,928	66,924,878
営業収益合計	26,089,017	66,924,967
営業費用		
受託者報酬	176,816	160,295
委託者報酬	3,005,914	2,724,961
その他費用	17,621	15,968
営業費用合計	3,200,351	2,901,224
営業利益又は営業損失()	22,888,666	64,023,743
経常利益又は経常損失()	22,888,666	64,023,743
当期純利益又は当期純損失()	22,888,666	64,023,743
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	354,451	1,336,790
期首剰余金又は期首欠損金()	292,925,522	275,243,281
剰余金増加額又は欠損金減少額	24,570,201	44,495,513
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	24,570,201	44,495,513
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,405,268	11,619,998
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,405,268	11,619,998
分配金	22,016,907	9,845,853
期末剰余金又は期末欠損金()	275,243,281	189,526,666

(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、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 第18特定期間（自 平成24年 6月16日 至 平成24年 12月17日） 第18特定期間は当特定期間末日が休業日のため、平成24年 6月16日から平成24年 12月17日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第17特定期間 (平成24年 6月15日現在)	第18特定期間 (平成24年12月17日現在)
1. 期首元本額	965,787,645円	904,078,252円
期中追加設定元本額	26,776,241円	41,571,007円
期中一部解約元本額	88,485,634円	148,466,309円
2. 当該特定期間の末日における受益権総数	904,078,252口	797,182,950口
3. 「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 275,243,281円	元本の欠損 189,526,666円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6956円 (6,956円)	0.7623円 (7,623円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

分配金の計算過程

		第17特定期間 自 平成23年12月16日 至 平成24年 6月15日	第18特定期間 自 平成24年 6月16日 至 平成24年12月17日
		第33期 自 平成23年12月16日 至 平成24年3月15日	第35期 自 平成24年6月16日 至 平成24年9月18日
費用控除後の配当等収益額	A	5,475,944円 (5,621,062円)	4,397,736円 (4,886,506円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	- 円
収益調整金額	C	30,409,320円	16,571,968円
分配準備積立金額	D	26,253,779円	23,240,946円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	62,139,043円	44,210,650円
当ファンドの期末残存口数	F	930,664,010口	843,792,711口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	667.68円	523.95円
10,000口当たり分配金額	H	120円	60円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	11,167,968円	5,062,756円

		第34期 自 平成24年3月16日 至 平成24年6月15日	第36期 自 平成24年9月19日 至 平成24年12月17日
費用控除後の配当等収益額	A	3,908,395円 (5,501,308円)	4,309,356円 (4,430,962円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	- 円
収益調整金額	C	23,700,908円	16,394,660円
分配準備積立金額	D	25,850,523円	20,636,296円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	53,459,826円	41,340,312円
当ファンドの期末残存口数	F	904,078,252口	797,182,950口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	591.31円	518.57円
10,000口当たり分配金額	H	120円	60円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	10,848,939円	4,783,097円

(注)()内は、親投資信託の信託財産に属する配当等収益のうち、当ファンドに帰属すべき金額で、内書であります。

(金融商品に関する注記)

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	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク（為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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で評価しているため、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)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。

<p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>4. 金銭債権の特定期間末日後の償還予定額</p>	<p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>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。</p> <p>金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。</p>
--	---

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第17特定期間 (平成24年 6月15日現在)	第18特定期間 (平成24年12月17日現在)
	計算期間(自 平成24年3月16日 至 平成24年 6月15日)の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間(自 平成24年9月19日 至 平成24年12月17日)の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	35,455,160	50,649,123
合計	35,455,160	50,649,123

(デリバティブ取引に関する注記)

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、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)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	311,686,918	614,241,409	
親投資信託受益証券 小計		311,686,918	614,241,409	
合計		311,686,918	614,241,409	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等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。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

<参考>

「外国債券オープン（3ヶ月決算型）」は、「外国債券インデックス マザーファンド」の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ている「親投資信託受益証券」は、全て同マザーファンドの受益証券であります。

同マザーファンドの平成24年12月17日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

「外国債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

項目	平成24年12月17日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	121,398,656
コール・ローン	875,758,078
国債証券	214,804,612,523
派生商品評価勘定	11,346,096
未収入金	6,379,850
未収利息	2,262,476,342
前払費用	148,181,303
差入委託証拠金	31,559,391
流動資産合計	218,261,712,239
資産合計	218,261,712,239
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	836,497
未払解約金	340,467,009
流動負債合計	341,303,506
負債合計	341,303,506
純資産の部	
元本等	
元本	110,582,125,663
剰余金	
剰余金又は欠損金()	107,338,283,070
元本等合計	217,920,408,733

純資産合計	217,920,408,733
負債純資産合計	218,261,712,239

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成24年12月17日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）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、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又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。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)債券先物取引 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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成24年12月17日現在
1. 特定期間の期首元本額	110,927,805,834円
特定期間中の追加設定元本額	8,582,627,040円
特定期間中の一部解約元本額	8,928,307,211円
計算日の元本額	110,582,125,663円
計算日の元本額の内訳	

外国債券オープン(毎月決算型)	6,669,240,028円
外国債券オープン(3ヶ月決算型)	311,686,918円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	2,551,528,619円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	1,883,285,067円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	470,564,974円
SBI資産設計オープン(分配型)	12,407,898円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	3,162,814,028円
世界経済インデックスファンド	375,711,208円
マイセレクション25	19,390,253円
マイセレクション50	12,423,032円
マイセレクション75	8,617,397円
DCマイセレクション25	1,042,906,675円
DCマイセレクション50	910,609,197円
DCマイセレクション75	540,763,517円
DC外国債券インデックス・オープン	1,119,118,051円
DCマイセレクションS25	305,687,743円
DCマイセレクションS50	259,144,319円
DCマイセレクションS75	105,079,125円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	2,207,918円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	33,069,627円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	21,619,260円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	6,666,118円
DC世界経済インデックスファンド	127,604,467円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	7,211,653,721円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	4,348,100,174円
マイセレクション50V A1(適格機関投資家専用)	42,309,987円
マイセレクション75V A1(適格機関投資家専用)	12,302,346円
外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	535,477,914円
マイセレクション50V A 2(適格機関投資家専用)	205,400円
バランス30V A 1(適格機関投資家専用)	1,527,891,213円
バランス50V A 1(適格機関投資家専用)	2,495,810,991円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	30,410,238,282円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	3,127,413,694円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	9,823,924,669円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,325,472,503円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,343,310,437円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	5,003,198,283円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	5,316,914,343円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,482,047,939円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	3,409,795,507円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	578,548,176円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	801,464,482円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	5,211,114,686円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	716,969,031円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	294,067,930円
外国債券ファンド・シリーズ1	1,270,326,141円
コア投資戦略ファンド(安定型)	470,068,186円
コア投資戦略ファンド(成長型)	242,540,181円

FOFs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	628,814,008円
2. 計算日における受益権総数	110,582,125,663口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9707円 (19,707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

	平成24年12月17日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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。 これらは、市場リスク（為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として、債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	平成24年12月17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で評価しているため、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)国債証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

	(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 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又は契約上の想定元本であり、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。
4. 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成24年12月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	2,532,062,317	
合計	2,532,062,317	

(注)当期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券インデックス マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成24年5月30日から平成24年12月17日まで)に対応するものです。

(デリバティブ取引に関する注記)

・ヘッジ会計が適用されていないもの

債券関連

区分	種類	平成24年12月17日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	345,856,573	-	345,543,672	312,901
	合計	345,856,573	-	345,543,672	312,901

(注)1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

区分	種類	平成24年12月17日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		

市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	198,048,000	-	201,504,000	3,456,000
	カナダドル	41,808,500	-	42,560,000	751,500
	イギリスポンド	39,882,600	-	40,698,000	815,400
	ユーロ	193,226,400	-	199,026,000	5,799,600
	計	472,965,500	-	483,788,000	10,822,500
	合計	472,965,500	-	483,788,000	10,822,500

(注)時価の算定方法

わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算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によって評価しております。

計算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、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

．ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年12月17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)

平成24年12月17日現在
該当事項はありません。

(3) 附属明細表(平成24年12月17日現在)

有価証券明細表

A．株式

該当事項はありません。

B．株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.125% 12/31/13	3,000,000.00	2,998,710.90	
		T 0.25% 04/30/14	9,000,000.00	9,003,870.00	
		T 0.25% 07/15/15	14,000,000.00	13,980,859.20	
		T 0.25% 10/15/15	8,000,000.00	7,982,812.80	
		T 0.25% 12/15/14	10,000,000.00	10,000,390.00	
		T 0.375% 04/15/15	11,500,000.00	11,525,610.50	
		T 0.375% 06/15/15	10,000,000.00	10,019,140.00	
		T 0.75% 06/30/17	19,400,000.00	19,520,493.40	
		T 0.75% 12/15/13	15,000,000.00	15,086,715.00	
		T 0.875% 02/28/17	22,900,000.00	23,208,623.30	
		T 1% 01/15/14	3,900,000.00	3,934,277.10	
		T 1% 03/31/17	1,400,000.00	1,425,593.40	
		T 1% 06/30/19	9,000,000.00	8,981,015.40	
		T 1% 09/30/16	11,500,000.00	11,726,412.00	
		T 1% 09/30/19	4,000,000.00	3,976,562.40	
		T 1.25% 04/15/14	2,100,000.00	2,128,711.20	
		T 1.25% 10/31/19	1,700,000.00	1,715,804.90	
T 1.375% 02/28/19	4,400,000.00	4,512,406.80			

T 1.375% 09/30/18	3,900,000.00	4,012,429.20	
T 1.375% 12/31/18	2,000,000.00	2,054,844.00	
T 1.5% 03/31/19	11,000,000.00	11,353,199.00	
T 1.5% 07/31/16	20,000,000.00	20,754,680.00	
T 1.5% 12/31/13	8,650,000.00	8,769,274.85	
T 1.625% 08/15/22	4,500,000.00	4,486,992.30	
T 1.625% 11/15/22	2,100,000.00	2,085,234.48	
T 1.75% 01/31/14	22,600,000.00	22,995,500.00	
T 1.75% 03/31/14	22,000,000.00	22,434,852.00	
T 1.75% 05/15/22	12,500,000.00	12,655,275.00	
T 1.75% 07/31/15	15,000,000.00	15,563,670.00	
T 1.875% 02/28/14	7,800,000.00	7,956,608.40	
T 1.875% 04/30/14	15,100,000.00	15,440,927.80	
T 1.875% 06/30/15	13,100,000.00	13,625,532.70	
T 1.875% 08/31/17	9,800,000.00	10,361,589.00	
T 1.875% 09/30/17	3,000,000.00	3,171,915.00	
T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,643,847.50	
T 2% 01/31/16	10,300,000.00	10,822,240.90	
T 2% 02/15/22	10,000,000.00	10,380,470.00	
T 2% 11/15/21	2,400,000.00	2,498,812.80	
T 2% 11/30/13	11,100,000.00	11,293,384.20	
T 2.125% 02/29/16	4,800,000.00	5,068,123.20	
T 2.125% 08/15/21	6,100,000.00	6,432,163.30	
T 2.125% 11/30/14	12,600,000.00	13,060,681.20	
T 2.25% 01/31/15	5,400,000.00	5,626,967.40	
T 2.25% 05/31/14	10,100,000.00	10,396,687.50	
T 2.25% 07/31/18	5,750,000.00	6,201,242.75	
T 2.25% 11/30/17	2,000,000.00	2,152,344.00	
T 2.375% 02/28/15	19,200,000.00	20,086,502.40	
T 2.375% 03/31/16	9,600,000.00	10,220,620.80	
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,339,220.00	
T 2.375% 06/30/18	550,000.00	596,814.35	
T 2.375% 08/31/14	12,500,000.00	12,953,125.00	
T 2.375% 10/31/14	6,000,000.00	6,238,362.00	
T 2.5% 03/31/15	21,700,000.00	22,807,893.50	
T 2.625% 02/29/16	1,000,000.00	1,071,562.00	
T 2.625% 04/30/16	9,100,000.00	9,773,609.30	
T 2.625% 04/30/18	5,000,000.00	5,487,890.00	
T 2.625% 06/30/14	16,000,000.00	16,588,128.00	
T 2.625% 07/31/14	37,400,000.00	38,850,708.60	
T 2.625% 08/15/20	13,500,000.00	14,857,384.50	
T 2.625% 11/15/20	11,500,000.00	12,646,412.00	
T 2.625% 12/31/14	3,550,000.00	3,722,231.80	
T 2.75% 02/15/19	5,300,000.00	5,877,201.80	
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	4,191,875.00	
T 2.75% 05/31/17	8,000,000.00	8,762,184.00	
T 2.75% 08/15/42	8,000,000.00	7,829,375.20	
T 2.75% 11/15/42	1,500,000.00	1,465,546.80	

T 2.75% 11/30/16	14,000,000.00	15,228,276.00	
T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,329,304.20	
T 3% 02/28/17	9,500,000.00	10,466,701.00	
T 3% 05/15/42	8,000,000.00	8,256,872.00	
T 3% 08/31/16	8,700,000.00	9,507,812.40	
T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,868,319.00	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	7,214,239.50	
T 3.125% 05/15/19	12,800,000.00	14,513,996.80	
T 3.125% 05/15/21	9,500,000.00	10,809,964.50	
T 3.125% 10/31/16	8,500,000.00	9,356,307.00	
T 3.125% 11/15/41	9,300,000.00	9,859,450.80	
T 3.25% 06/30/16	6,100,000.00	6,702,612.90	
T 3.25% 07/31/16	7,000,000.00	7,703,829.00	
T 3.25% 12/31/16	3,500,000.00	3,882,676.00	
T 3.375% 11/15/19	8,300,000.00	9,560,562.50	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,500,673.30	
T 3.5% 02/15/39	6,000,000.00	6,864,846.00	
T 3.625% 02/15/20	5,150,000.00	6,030,330.70	
T 3.625% 02/15/21	18,000,000.00	21,193,596.00	
T 3.625% 08/15/19	3,900,000.00	4,549,899.90	
T 3.75% 08/15/41	7,000,000.00	8,328,908.00	
T 3.75% 11/15/18	10,000,000.00	11,667,190.00	
T 3.875% 08/15/40	8,800,000.00	10,705,745.60	
T 4% 02/15/14	5,450,000.00	5,690,568.45	
T 4.0% 02/15/15	7,200,000.00	7,778,246.40	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,884,720.40	
T 4.125% 05/15/15	6,700,000.00	7,315,823.80	
T 4.25% 05/15/39	1,500,000.00	1,936,171.50	
T 4.25% 08/15/14	12,000,000.00	12,799,692.00	
T 4.25% 08/15/15	12,500,000.00	13,798,825.00	
T 4.25% 11/15/14	7,700,000.00	8,287,425.30	
T 4.25% 11/15/17	4,600,000.00	5,396,195.60	
T 4.25% 11/15/40	10,000,000.00	12,922,660.00	
T 4.375% 02/15/38	2,800,000.00	3,673,031.60	
T 4.375% 05/15/40	4,900,000.00	6,453,834.10	
T 4.375% 05/15/41	2,000,000.00	2,637,188.00	
T 4.375% 11/15/39	6,500,000.00	8,556,132.00	
T 4.5% 02/15/36	3,900,000.00	5,187,608.40	
T 4.5% 05/15/17	9,800,000.00	11,471,742.80	
T 4.5% 05/15/38	2,000,000.00	2,672,656.00	
T 4.5% 08/15/39	4,500,000.00	6,033,865.50	
T 4.5% 11/15/15	3,100,000.00	3,472,846.30	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,839,650.00	
T 4.625% 02/15/40	1,150,000.00	1,571,995.95	
T 4.75% 02/15/37	1,500,000.00	2,068,593.00	
T 4.75% 05/15/14	6,200,000.00	6,595,733.60	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,546,339.60	
T 5.0% 05/15/37	500,000.00	713,203.00	

	T 5.125% 05/15/16	5,800,000.00	6,722,559.60	
	T 5.25% 02/15/29	1,900,000.00	2,653,914.30	
	T 5.25% 11/15/28	1,300,000.00	1,811,366.70	
	T 5.375% 02/15/31	2,010,000.00	2,895,499.47	
	T 5.5% 08/15/28	1,200,000.00	1,709,719.20	
	T 6.0% 02/15/26	3,300,000.00	4,805,367.60	
	T 6.125% 08/15/29	1,400,000.00	2,139,484.20	
	T 6.125% 11/15/27	2,220,000.00	3,323,235.66	
	T 6.25% 05/15/30	1,880,000.00	2,932,800.00	
	T 6.25% 08/15/23	4,900,000.00	7,059,826.90	
	T 6.5% 11/15/26	600,000.00	917,531.40	
	T 6.875% 08/15/25	1,000,000.00	1,549,453.00	
	T 7.25% 05/15/16	6,350,000.00	7,818,932.80	
	T 7.25% 08/15/22	2,600,000.00	3,931,891.60	
	T 7.5% 11/15/16	5,100,000.00	6,483,375.00	
	T 8.0% 11/15/21	2,560,000.00	3,970,401.28	
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	3,066,491.40	
	アメリカドル小計	970,070,000.00	1,053,592,855.34 (88,491,263,920)	
カナダドル	CAN 0.75% 05/01/14	1,300,000.00	1,293,786.00	
	CAN 1% 02/01/15	200,000.00	199,454.00	
	CAN 1.25% 03/01/18	400,000.00	396,884.00	
	CAN 1.5% 09/01/17	900,000.00	905,643.00	
	CAN 2% 03/01/14	2,900,000.00	2,931,552.00	
	CAN 2% 06/01/16	1,400,000.00	1,434,342.00	
	CAN 2% 12/01/14	5,300,000.00	5,388,033.00	
	CAN 2.5% 06/01/15	3,000,000.00	3,097,560.00	
	CAN 2.75% 06/01/22	2,000,000.00	2,166,660.00	
	CAN 2.75% 09/01/16	3,100,000.00	3,261,107.00	
	CAN 3% 12/01/15	1,000,000.00	1,051,240.00	
	CAN 3.0% 06/01/14	5,150,000.00	5,289,925.50	
	CAN 3.25% 06/01/21	2,300,000.00	2,582,601.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	2,350,000.00	2,660,670.00	
	CAN 3.5% 12/01/45	1,350,000.00	1,696,680.00	
	CAN 3.75% 06/01/19	3,300,000.00	3,748,437.00	
	CAN 4% 06/01/16	4,000,000.00	4,367,640.00	
	CAN 4% 06/01/17	2,400,000.00	2,674,344.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,850,000.00	3,800,931.00	
	CAN 4.25% 06/01/18	1,750,000.00	2,009,560.00	
	CAN 4.5% 06/01/15	3,000,000.00	3,242,610.00	
	CAN 5% 06/01/14	2,600,000.00	2,745,314.00	
	CAN 5% 06/01/37	2,500,000.00	3,693,475.00	
CAN 5.75% 06/01/29	2,160,000.00	3,208,636.80		
CAN 5.75% 06/01/33	2,400,000.00	3,725,376.00		
CAN 8.0% 06/01/27	950,000.00	1,642,550.00		
CAN 9% 06/01/25	650,000.00	1,151,553.00		
	カナダドル小計	61,210,000.00	70,366,564.30 (5,995,934,944)	

オーストラリア ドル	ACGB 2.75% 04/21/24	950,000.00	885,010.50	
	ACGB 3.25% 04/21/29	550,000.00	509,569.50	
	ACGB 4.25% 07/21/17	1,300,000.00	1,375,647.00	
	ACGB 4.5% 04/15/20	3,300,000.00	3,587,991.00	
	ACGB 4.5% 10/21/14	3,000,000.00	3,091,200.00	
	ACGB 4.75% 04/21/27	1,000,000.00	1,115,000.00	
	ACGB 4.75% 06/15/16	3,000,000.00	3,190,950.00	
	ACGB 4.75% 10/21/15	1,000,000.00	1,052,570.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	2,800,000.00	3,146,556.00	
	ACGB 5.5% 01/21/18	2,400,000.00	2,686,344.00	
	ACGB 5.5% 04/21/23	2,000,000.00	2,367,940.00	
	ACGB 5.5% 12/15/13	2,500,000.00	2,565,250.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	2,750,000.00	3,255,065.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,550,000.00	3,055,384.50	
	ACGB 6% 02/15/17	3,200,000.00	3,594,176.00	
	ACGB 6.25% 04/15/15	2,100,000.00	2,260,629.00	
ACGB 6.25% 06/15/14	1,200,000.00	1,260,636.00		
オーストラリアドル小計		35,600,000.00	38,999,918.50 (3,455,002,779)	
イギリスポンド	UKT 1% 09/07/17	5,000,000.00	5,034,250.00	
	UKT 1.75% 01/22/17	800,000.00	834,120.00	
	UKT 1.75% 09/07/22	2,300,000.00	2,277,529.00	
	UKT 2% 01/22/16	1,300,000.00	1,359,670.00	
	UKT 2.25% 03/07/14	4,500,000.00	4,605,075.00	
	UKT 2.75% 01/22/15	5,250,000.00	5,511,082.50	
	UKT 3.75% 07/22/52	1,650,000.00	1,818,184.50	
	UKT 3.75% 09/07/19	3,100,000.00	3,605,083.00	
	UKT 3.75% 09/07/20	3,350,000.00	3,913,470.00	
	UKT 3.75% 09/07/21	3,200,000.00	3,749,696.00	
	UKT 4% 01/22/60	2,050,000.00	2,412,296.50	
	UKT 4% 03/07/22	2,550,000.00	3,049,545.00	
	UKT 4% 09/07/16	5,700,000.00	6,421,221.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	3,650,000.00	4,430,662.00	
	UKT 4.25% 06/07/32	3,300,000.00	4,045,140.00	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,750,000.00	2,115,400.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	2,300,000.00	2,834,129.00	
	UKT 4.25% 12/07/40	3,450,000.00	4,168,048.50	
	UKT 4.25% 12/07/46	2,950,000.00	3,572,450.00	
	UKT 4.25% 12/07/49	2,500,000.00	3,034,125.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	3,100,000.00	3,801,468.00	
	UKT 4.5% 03/07/19	3,400,000.00	4,091,968.00	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,550,000.00	3,210,067.50	
	UKT 4.5% 12/07/42	3,500,000.00	4,414,830.00	
	UKT 4.75% 03/07/20	4,050,000.00	5,001,345.00	
	UKT 4.75% 09/07/15	2,850,000.00	3,186,385.50	
	UKT 4.75% 12/07/30	2,700,000.00	3,520,800.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	3,550,000.00	4,636,761.50	
UKT 5% 03/07/18	2,800,000.00	3,381,084.00		

	UKT 5% 03/07/25	2,900,000.00	3,811,122.00	
	UKT 5.0% 09/07/14	5,100,000.00	5,509,173.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	1,960,000.00	2,888,608.80	
	UKT 8% 06/07/21	2,600,000.00	3,941,938.00	
	UKT 8% 12/07/15	2,995,000.00	3,668,515.60	
	UKT 8.75% 08/25/17	1,500,000.00	2,050,800.00	
イギリスポンド小計		106,205,000.00	125,906,043.90 (17,087,968,278)	
スイスフラン	SWISS 2.25% 07/06/20	100,000.00	114,878.00	
	SWISS 3% 01/08/18	4,200,000.00	4,826,514.00	
	SWISS 3.75% 06/10/15	600,000.00	659,658.00	
	SWISS 4% 02/11/23	2,300,000.00	3,092,396.00	
	SWISS 4% 04/08/28	300,000.00	435,936.00	
	SWISS 4.25% 01/06/14	850,000.00	890,018.00	
スイスフラン小計		8,350,000.00	10,019,400.00 (916,073,742)	
シンガポールドル	SIGB 0.25% 02/01/14	800,000.00	800,160.00	
	SIGB 1.125% 04/01/16	850,000.00	873,375.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	400,000.00	433,620.00	
	SIGB 2.375% 04/01/17	450,000.00	489,285.00	
	SIGB 2.5% 06/01/19	650,000.00	718,445.00	
	SIGB 2.75% 04/01/42	350,000.00	373,380.00	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,250,000.00	1,332,250.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	500,000.00	558,000.00	
	SIGB 3% 09/01/24	350,000.00	400,225.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	950,000.00	1,107,035.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	750,000.00	867,412.50	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,100,000.00	1,315,050.00	
	SIGB 3.625% 07/01/14	1,300,000.00	1,368,315.00	
	SIGB 3.75% 09/01/16	900,000.00	1,014,345.00	
	SIGB 4% 09/01/18	900,000.00	1,073,295.00	
シンガポールドル小計		11,500,000.00	12,724,192.50 (875,933,411)	
マレーシア リンギット	MGS 3.314% 10/31/17	2,550,000.00	2,556,222.00	
	MGS 3.418% 08/15/22	400,000.00	396,964.00	
	MGS 3.434% 08/15/14	3,000,000.00	3,020,010.00	
	MGS 3.492% 03/31/20	1,000,000.00	1,001,130.00	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,200,000.00	2,139,834.40	
	MGS 3.58% 09/28/18	2,500,000.00	2,528,275.00	
	MGS 3.741% 02/27/15	4,800,000.00	4,863,456.00	
	MGS 3.814% 02/15/17	1,100,000.00	1,124,035.00	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,150,000.00	1,174,242.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	700,000.00	720,769.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,750,000.00	2,884,447.50	
	MGS 4.24% 02/07/18	2,650,000.00	2,761,883.00	
	MGS 4.262% 09/15/16	7,000,000.00	7,257,250.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	3,100,000.00	3,278,281.00	
	MGS 4.392% 04/15/26	300,000.00	322,617.00	
MGS 4.72% 09/30/15	1,300,000.00	1,354,782.00		

	MGS 5.094% 04/30/14	2,050,000.00	2,107,502.50	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,800,000.00	2,114,982.00	
マレーシアリングット小計		40,350,000.00	41,606,682.40 (1,144,599,832)	
スウェーデン クローナ	SGB 1.5% 11/13/23	4,700,000.00	4,656,807.00	
	SGB 3% 07/12/16	9,450,000.00	10,161,585.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	7,400,000.00	9,252,590.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	9,050,000.00	10,646,148.50	
	SGB 3.75% 08/12/17	13,000,000.00	14,651,780.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	11,500,000.00	13,635,665.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	5,900,000.00	6,471,297.00	
	SGB 5% 12/01/20	13,500,000.00	17,213,040.00	
	SGB 6.75% 05/05/14	15,300,000.00	16,558,119.00	
スウェーデンクローナ小計		89,800,000.00	103,247,031.50 (1,297,815,185)	
ノルウェー クローネ	NGB 3.75% 05/25/21	6,100,000.00	6,950,950.00	
	NGB 4.25% 05/19/17	8,700,000.00	9,705,981.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	7,200,000.00	8,396,280.00	
	NGB 5% 05/15/15	11,000,000.00	11,909,700.00	
ノルウェークローネ小計		33,000,000.00	36,962,911.00 (551,856,261)	
デンマーク クローネ	DGB 2% 11/15/14	11,700,000.00	12,183,795.00	
	DGB 2.5% 11/15/16	2,000,000.00	2,190,460.00	
	DGB 3% 11/15/21	16,500,000.00	19,170,195.00	
	DGB 4% 11/15/15	15,300,000.00	17,128,350.00	
	DGB 4% 11/15/17	9,800,000.00	11,588,010.00	
	DGB 4% 11/15/19	15,400,000.00	18,861,612.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	20,300,000.00	30,646,910.00	
	DGB 7% 11/10/24	4,200,000.00	6,826,050.00	
デンマーククローネ小計		95,200,000.00	118,595,382.00 (1,757,583,561)	
メキシコペソ	MBONO 5% 06/15/17	13,900,000.00	13,872,478.00	
	MBONO 6% 06/18/15	79,900,000.00	82,156,376.00	
	MBONO 8% 06/11/20	38,700,000.00	45,452,763.00	
	MBONO 8% 12/07/23	14,700,000.00	17,808,609.00	
	MBONO 8% 12/19/13	43,700,000.00	45,147,344.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	65,900,000.00	82,705,818.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	34,550,000.00	43,418,639.50	
メキシコペソ小計		291,350,000.00	330,562,027.50 (2,171,792,520)	
ポーランドズロチ	POLGB 4% 10/25/23	200,000.00	201,686.00	
	POLGB 4.75% 04/25/17	2,100,000.00	2,218,545.00	
	POLGB 4.75% 10/25/16	8,400,000.00	8,824,452.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	6,000,000.00	6,505,800.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	3,200,000.00	3,544,640.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	5,700,000.00	5,978,616.00	
	POLGB 5.5% 10/25/19	4,700,000.00	5,262,355.00	
	POLGB 5.75% 04/25/14	6,500,000.00	6,707,675.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,350,000.00	1,622,700.00	

	POLGB 5.75% 09/23/22	5,600,000.00	6,475,448.00	
	POLGB 5.75% 10/25/21	2,800,000.00	3,207,260.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	9,600,000.00	10,355,520.00	
	ポーランドズロチ小計	56,150,000.00	60,904,697.00 (1,648,081,100)	
南アフリカランド	SAGB 10.5% 12/21/26	20,700,000.00	26,400,780.00	
	SAGB 13.5% 09/15/15	8,850,000.00	10,647,700.50	
	SAGB 6.25% 03/31/36	11,000,000.00	8,864,790.00	
	SAGB 6.5% 02/28/41	6,900,000.00	5,645,580.00	
	SAGB 6.75% 03/31/21	16,100,000.00	16,395,435.00	
	SAGB 7% 02/28/31	8,000,000.00	7,366,400.00	
	SAGB 7.25% 01/15/20	15,800,000.00	16,572,462.00	
	SAGB 7.75% 02/28/23	2,500,000.00	2,660,550.00	
	SAGB 8% 12/21/18	14,800,000.00	16,186,612.00	
	SAGB 8.25% 09/15/17	15,500,000.00	17,005,825.00	
	SAGB 8.75% 02/28/48	3,100,000.00	3,258,596.00	
	SAGB 8.75% 12/21/14	9,200,000.00	9,840,964.00	
	南アフリカランド小計	132,450,000.00	140,845,694.50 (1,370,428,607)	
ユーロ	BGB 3.25% 09/28/16	3,800,000.00	4,187,334.00	
	BGB 3.5% 03/28/15	900,000.00	968,490.00	
	BGB 3.75% 09/28/15	2,450,000.00	2,688,311.50	
	BGB 3.75% 09/28/20	4,700,000.00	5,417,455.00	
	BGB 4% 03/28/14	2,000,000.00	2,100,160.00	
	BGB 4% 03/28/18	2,300,000.00	2,661,905.00	
	BGB 4% 03/28/22	3,100,000.00	3,630,813.00	
	BGB 4% 03/28/32	150,000.00	173,857.50	
	BGB 4.0% 03/28/17	3,500,000.00	3,986,080.00	
	BGB 4.0% 03/28/19	2,400,000.00	2,801,592.00	
	BGB 4.25% 03/28/41	2,100,000.00	2,536,443.00	
	BGB 4.25% 09/28/14	2,500,000.00	2,684,625.00	
	BGB 4.25% 09/28/21	1,200,000.00	1,428,636.00	
	BGB 4.25% 09/28/22	1,950,000.00	2,314,903.50	
	BGB 4.5% 03/28/26	1,550,000.00	1,895,464.00	
	BGB 5% 03/28/35	3,000,000.00	3,948,690.00	
	BGB 5.5% 03/28/28	3,550,000.00	4,822,852.50	
	BGB 5.5% 09/28/17	1,650,000.00	2,010,409.50	
	BGB 8.0% 03/28/15	1,550,000.00	1,826,179.00	
	BKO 0.25% 03/14/14	3,300,000.00	3,311,220.00	
	BKO 0.25% 12/13/13	4,100,000.00	4,111,070.00	
	BTNS 1.75% 02/25/17	1,100,000.00	1,158,443.00	
	BTNS 2% 07/12/15	2,200,000.00	2,307,030.00	
	BTNS 2.25% 02/25/16	2,900,000.00	3,087,833.00	
	BTNS 2.5% 01/12/14	5,750,000.00	5,902,950.00	
	BTNS 2.5% 01/15/15	5,300,000.00	5,569,664.00	
	BTNS 2.5% 07/25/16	5,900,000.00	6,366,395.00	
BTNS 3% 07/12/14	6,100,000.00	6,383,650.00		
BTPS 3% 04/01/14	2,500,000.00	2,543,500.00		

BTPS 3% 04/15/15	3,800,000.00	3,854,340.00	
BTPS 3% 06/15/15	4,900,000.00	4,970,070.00	
BTPS 3% 11/01/15	2,800,000.00	2,839,984.00	
BTPS 3.5% 06/01/14	3,750,000.00	3,837,300.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	3,800,000.00	3,705,380.00	
BTPS 3.75% 04/15/16	2,200,000.00	2,273,744.00	
BTPS 3.75% 08/01/15	6,050,000.00	6,242,874.00	
BTPS 3.75% 08/01/16	7,000,000.00	7,226,100.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	8,000,000.00	7,733,040.00	
BTPS 3.75% 12/15/13	3,900,000.00	3,988,335.00	
BTPS 4% 02/01/17	5,200,000.00	5,387,720.00	
BTPS 4% 02/01/37	4,400,000.00	3,813,480.00	
BTPS 4% 09/01/20	3,500,000.00	3,498,950.00	
BTPS 4.25% 02/01/15	6,300,000.00	6,572,664.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	5,000,000.00	5,136,250.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	2,950,000.00	2,998,173.50	
BTPS 4.25% 08/01/14	9,200,000.00	9,539,756.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	3,250,000.00	3,325,010.00	
BTPS 4.5% 02/01/18	3,250,000.00	3,408,372.50	
BTPS 4.5% 02/01/20	7,050,000.00	7,276,305.00	
BTPS 4.5% 03/01/19	4,900,000.00	5,095,412.00	
BTPS 4.5% 03/01/26	2,900,000.00	2,839,477.00	
BTPS 4.5% 08/01/18	5,100,000.00	5,324,910.00	
BTPS 4.75% 06/01/17	3,900,000.00	4,136,340.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	6,300,000.00	6,408,864.00	
BTPS 4.75% 09/01/21	4,000,000.00	4,137,520.00	
BTPS 4.75% 09/15/16	2,050,000.00	2,186,427.50	
BTPS 5% 03/01/22	2,000,000.00	2,088,860.00	
BTPS 5% 03/01/25	4,450,000.00	4,572,731.00	
BTPS 5% 08/01/34	3,500,000.00	3,489,850.00	
BTPS 5% 09/01/40	3,700,000.00	3,688,160.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	3,200,000.00	3,192,640.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	5,040,000.00	5,457,211.20	
BTPS 5.25% 11/01/29	4,800,000.00	4,940,880.00	
BTPS 5.5% 09/01/22	2,100,000.00	2,261,448.00	
BTPS 5.5% 11/01/22	2,000,000.00	2,150,300.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,000,000.00	3,247,050.00	
BTPS 6% 05/01/31	5,330,000.00	5,914,594.40	
BTPS 6.5% 11/01/27	3,800,000.00	4,389,000.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	1,900,000.00	2,343,840.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	1,082,560.00	
DBR 1.5% 09/04/22	2,500,000.00	2,534,575.00	
DBR 1.75% 07/04/22	4,400,000.00	4,574,592.00	
DBR 2% 01/04/22	2,600,000.00	2,773,940.00	
DBR 2.25% 09/04/20	3,900,000.00	4,275,102.00	
DBR 2.25% 09/04/21	4,000,000.00	4,366,120.00	
DBR 2.5% 01/04/21	3,200,000.00	3,565,056.00	
DBR 2.5% 07/04/44	1,000,000.00	1,059,350.00	

DBR 3% 07/04/20	5,100,000.00	5,872,650.00	
DBR 3.25% 01/04/20	2,300,000.00	2,683,295.00	
DBR 3.25% 07/04/15	5,300,000.00	5,740,960.00	
DBR 3.25% 07/04/21	3,000,000.00	3,521,400.00	
DBR 3.25% 07/04/42	2,200,000.00	2,699,400.00	
DBR 3.5% 01/04/16	5,400,000.00	5,973,102.00	
DBR 3.5% 07/04/19	4,100,000.00	4,833,613.00	
DBR 3.75% 01/04/15	2,550,000.00	2,748,135.00	
DBR 3.75% 01/04/17	6,700,000.00	7,666,475.00	
DBR 3.75% 01/04/19	3,700,000.00	4,391,974.00	
DBR 4% 07/04/16	4,400,000.00	5,007,552.00	
DBR 4.0% 01/04/18	3,000,000.00	3,543,060.00	
DBR 4.0% 01/04/37	4,200,000.00	5,630,646.00	
DBR 4.25% 01/04/14	4,500,000.00	4,701,375.00	
DBR 4.25% 07/04/14	7,700,000.00	8,208,354.00	
DBR 4.25% 07/04/17	3,200,000.00	3,776,096.00	
DBR 4.25% 07/04/18	5,000,000.00	6,030,100.00	
DBR 4.25% 07/04/39	2,800,000.00	3,961,440.00	
DBR 4.75% 07/04/28	3,100,000.00	4,273,133.00	
DBR 4.75% 07/04/34	3,500,000.00	5,071,675.00	
DBR 4.75% 07/04/40	3,200,000.00	4,889,920.00	
DBR 5.5% 01/04/31	2,950,000.00	4,472,642.50	
DBR 5.625% 01/04/28	1,470,000.00	2,187,727.50	
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	675,304.00	
DBR 6.25% 01/04/24	2,000,000.00	2,979,760.00	
DBR 6.25% 01/04/30	1,700,000.00	2,736,150.00	
DBR 6.5% 07/04/27	2,000,000.00	3,199,960.00	
FRTR 2.25% 10/25/22	1,000,000.00	1,024,650.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	5,050,000.00	5,430,871.00	
FRTR 2.75% 10/25/27	700,000.00	720,825.00	
FRTR 3% 04/25/22	6,500,000.00	7,133,425.00	
FRTR 3% 10/25/15	5,000,000.00	5,405,000.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	7,200,000.00	7,924,176.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	4,150,000.00	4,661,197.00	
FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000.00	8,534,212.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	5,600,000.00	6,441,680.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	5,650,000.00	6,371,053.00	
FRTR 3.75% 04/25/17	6,100,000.00	6,952,353.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	6,600,000.00	7,695,732.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	6,200,000.00	7,234,036.00	
FRTR 4% 04/25/14	5,100,000.00	5,374,278.00	
FRTR 4% 04/25/18	4,100,000.00	4,788,308.00	
FRTR 4% 04/25/55	2,700,000.00	3,220,020.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,600,000.00	1,910,448.00	
FRTR 4% 10/25/14	3,700,000.00	3,972,320.00	
FRTR 4% 10/25/38	5,000,000.00	5,938,000.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	6,000,000.00	7,171,800.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	5,750,000.00	6,738,712.50	

FRTR 4.25% 10/25/18	3,050,000.00	3,625,626.50	
FRTR 4.25% 10/25/23	7,100,000.00	8,570,055.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	3,400,000.00	4,371,958.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	3,400,000.00	4,449,410.00	
FRTR 5% 10/25/16	6,010,000.00	7,075,392.70	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,480,000.00	6,224,064.00	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,300,000.00	6,294,125.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,800,000.00	3,958,024.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,607,300.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,660,097.60	
IRISH 4% 01/15/14	550,000.00	563,695.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,600,000.00	1,605,568.00	
IRISH 4.5% 02/18/15	1,500,000.00	1,593,495.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	4,000,000.00	4,000,000.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	1,000,000.00	1,035,420.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	2,000,000.00	2,122,460.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	2,050,000.00	2,087,576.50	
IRISH 5.5% 10/18/17	400,000.00	437,892.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	1,250,000.00	1,361,100.00	
NETHER 0.75% 04/15/15	2,300,000.00	2,337,720.00	
NETHER 1% 01/15/14	1,100,000.00	1,111,638.00	
NETHER 1.25% 01/15/18	200,000.00	206,496.00	
NETHER 2.25% 07/15/22	2,000,000.00	2,124,800.00	
NETHER 2.5% 01/15/17	2,100,000.00	2,281,923.00	
NETHER 2.5% 01/15/33	800,000.00	828,904.00	
NETHER 2.75% 01/15/15	1,400,000.00	1,479,100.00	
NETHER 3.25% 07/15/15	4,300,000.00	4,651,654.00	
NETHER 3.25% 07/15/21	2,900,000.00	3,339,060.00	
NETHER 3.5% 07/15/20	3,050,000.00	3,563,925.00	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,900,000.00	2,275,782.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,200,000.00	2,856,304.00	
NETHER 3.75% 07/15/14	4,000,000.00	4,233,720.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,750,000.00	3,602,087.50	
NETHER 4% 07/15/16	3,100,000.00	3,514,935.00	
NETHER 4% 07/15/19	3,150,000.00	3,758,422.50	
NETHER 4.0% 07/15/18	2,850,000.00	3,359,010.00	
NETHER 4.5% 07/15/17	2,700,000.00	3,193,290.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	2,100,000.00	3,029,817.00	
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	1,085,315.00	
OBL 0.5% 04/07/17	2,400,000.00	2,427,792.00	
OBL 0.75% 02/24/17	3,000,000.00	3,068,490.00	
OBL 1.25% 10/14/16	500,000.00	521,350.00	
OBL 1.75% 10/09/15	2,500,000.00	2,623,125.00	
OBL 2.25% 04/10/15	3,500,000.00	3,685,500.00	
OBL 2.25% 04/11/14	2,900,000.00	2,986,565.00	
OBL 2.5% 02/27/15	2,200,000.00	2,323,200.00	
OBL 2.5% 10/10/14	3,800,000.00	3,974,800.00	
OBL 2.75% 04/08/16	5,500,000.00	5,991,590.00	

RAGB 3.15% 06/20/44	300,000.00	335,055.00	
RAGB 3.2% 02/20/17	1,000,000.00	1,115,250.00	
RAGB 3.4% 10/20/14	800,000.00	849,864.00	
RAGB 3.4% 11/22/22	750,000.00	863,497.50	
RAGB 3.5% 07/15/15	2,900,000.00	3,154,620.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	3,200,000.00	3,716,000.00	
RAGB 3.65% 04/20/22	400,000.00	469,272.00	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,700,000.00	3,206,196.00	
RAGB 4% 09/15/16	2,650,000.00	3,013,924.50	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,150,000.00	2,780,917.50	
RAGB 4.3% 07/15/14	2,200,000.00	2,347,620.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	700,000.00	822,486.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	1,450,000.00	1,746,351.00	
RAGB 4.65% 01/15/18	3,250,000.00	3,896,327.50	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,700,000.00	2,243,371.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,700,000.00	2,564,926.00	
RFGB 1.625% 09/15/22	800,000.00	804,560.00	
RFGB 1.75% 04/15/16	600,000.00	632,070.00	
RFGB 2.75% 07/04/28	500,000.00	545,150.00	
RFGB 3.125% 09/15/14	1,250,000.00	1,318,187.50	
RFGB 3.375% 04/15/20	1,250,000.00	1,447,750.00	
RFGB 3.5% 04/15/21	400,000.00	467,940.00	
RFGB 3.875% 09/15/17	1,450,000.00	1,680,767.50	
RFGB 4% 07/04/25	1,350,000.00	1,672,582.50	
RFGB 4.25% 07/04/15	1,400,000.00	1,550,542.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	1,600,000.00	1,949,680.00	
SPGB 3% 04/30/15	700,000.00	697,816.00	
SPGB 3.15% 01/31/16	7,650,000.00	7,561,872.00	
SPGB 3.25% 04/30/16	1,000,000.00	986,350.00	
SPGB 3.3% 10/31/14	2,100,000.00	2,117,430.00	
SPGB 3.4% 04/30/14	1,250,000.00	1,262,500.00	
SPGB 3.75% 10/31/15	400,000.00	403,540.00	
SPGB 3.8% 01/31/17	4,000,000.00	3,958,200.00	
SPGB 4% 04/30/20	4,700,000.00	4,434,450.00	
SPGB 4% 07/30/15	4,550,000.00	4,634,084.00	
SPGB 4.1% 07/30/18	2,900,000.00	2,844,407.00	
SPGB 4.2% 01/31/37	2,800,000.00	2,199,680.00	
SPGB 4.25% 01/31/14	5,000,000.00	5,094,750.00	
SPGB 4.25% 10/31/16	1,950,000.00	1,971,489.00	
SPGB 4.3% 10/31/19	2,100,000.00	2,040,990.00	
SPGB 4.4% 01/31/15	7,000,000.00	7,212,800.00	
SPGB 4.6% 07/30/19	3,000,000.00	2,982,540.00	
SPGB 4.65% 07/30/25	1,800,000.00	1,638,324.00	
SPGB 4.7% 07/30/41	1,800,000.00	1,506,780.00	
SPGB 4.75% 07/30/14	2,700,000.00	2,783,835.00	
SPGB 4.8% 01/31/24	3,200,000.00	3,002,240.00	
SPGB 4.85% 10/31/20	4,100,000.00	4,032,432.00	
SPGB 4.9% 07/30/40	2,500,000.00	2,149,325.00	

	SPGB 5.5% 04/30/21	3,400,000.00	3,456,950.00	
	SPGB 5.5% 07/30/17	3,800,000.00	3,998,930.00	
	SPGB 5.75% 07/30/32	2,650,000.00	2,640,937.00	
	SPGB 5.85% 01/31/22	2,850,000.00	2,945,617.50	
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,300,000.00	1,323,270.00	
	SPGB 6.0% 01/31/29	3,250,000.00	3,342,560.00	
	ユーロ小計	719,210,000.00	796,168,189.40 (88,040,278,383)	
	国債証券合計		214,804,612,523 (214,804,612,523)	
	合計		214,804,612,523 (214,804,612,523)	

(注)有価証券明細表注記

(1)通貨ごとの小計の欄における()内は、邦貨換算額であります。

(2)合計金額欄の記載は、邦貨額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(3)通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

(4)外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 131銘柄	100.0%	41.2%
カナダドル	国債証券 27銘柄	100.0%	2.8%
オーストラリアドル	国債証券 17銘柄	100.0%	1.6%
イギリスポンド	国債証券 35銘柄	100.0%	8.0%
スイスフラン	国債証券 6銘柄	100.0%	0.4%
シンガポールドル	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングギット	国債証券 18銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.8%
メキシコペソ	国債証券 7銘柄	100.0%	1.0%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	100.0%	0.8%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	0.6%
ユーロ	国債証券 227銘柄	100.0%	41.0%

(注)組入債券時価比率は、通貨ごとの合計金額に対する債券の比率であります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

注記事項(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等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。

その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

借入金明細表
該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(平成25年1月31日現在)

資産総額	651,957,128 円
負債総額	6,757,266 円
純資産総額(-)	645,199,862 円
発行済口数	778,025,089 口
1口当たり純資産額(/)	0.8293 円
1万口当たり純資産額	8,293 円

(参考情報)

外国債券インデックス マザーファンド

資産総額	230,368,893,551 円
負債総額	152,883,350 円
純資産総額(-)	230,216,010,201 円
発行済口数	107,304,485,611 口
1口当たり純資産額(/)	2.1454 円
1万口当たり純資産額	21,454 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(イ) 名義書換

該当事項はありません。

(ロ) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(ハ) 譲渡制限

該当事項はありません。

(ニ) 振替受益権の取扱い

本ファンドの受益権は、社振法の適用を受けています。

受益証券の不発行

委託者は、本ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

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

受益権の譲渡

- 1) 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- 2) 前記1)の申請のある場合には、前記1)の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記1)の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- 3) 委託者は、前記1)に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

受益権の再分割

委託者は、受託者と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については、原則として取得申込者として）に支払います。

質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、投資信託約款の規定によ

るほか、民法その他の法令等にしがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（平成25年1月31日現在）

資本金の額　　：3億円

発行可能株式総数：12,000株

発行済株式総数　：3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

会社に取締役3名以上、監査役2名以内をおきます。取締役及び監査役は、株主総会において選任され、又は解任されます。

取締役及び監査役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査役の任期は、選任後4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、会長1名及び副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

社長にさしつかえあるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

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

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成25年3月8日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成25年1月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	302	4,020,793
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	5	755
単体型公社債投資信託	0	0
合計	307	4,021,548

3【委託会社等の経理状況】

- (イ) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（旧社名 住信アセットマネジメント株式会社、以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）第2条に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。また、委託者の中間財務諸表は、「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）第38条及び第57条に基づき、同規則並びに、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- (ロ) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。また、委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第27期事業年度の中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）の中間財務諸表について、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23年3月31日現在)		当事業年度 (平成24年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金	2	6,223,302		4,826,115
前払費用		34,720		30,184
未収委託者報酬		953,916		944,716
未収運用受託報酬		42,516		26,998
未収入金		-		75,514
一年以内返還予定保証金		-		187,128
繰延税金資産		50,152		69,857
その他		34		31,325
流動資産合計		7,304,641		6,191,840
固定資産				
有形固定資産				
建物		38,802		3,525
器具備品		27,919		14,970
建設仮勘定		-		62,454
有形固定資産合計	1	66,721	1	80,949
無形固定資産				
ソフトウェア		91,774		60,130
ソフトウェア仮勘定		-		12,151
その他無形固定資産		1,415		928
無形固定資産合計		93,189		73,209
投資その他の資産				
投資有価証券		239,090		43,194
敷金・保証金		228,451		-
長期前払費用		409		357
繰延税金資産		80,017		-
その他の投資		195		165
投資その他の資産合計		548,164		43,717
固定資産合計		708,076		197,876
資産合計		8,012,717		6,389,717

(単位：千円)

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

(2)【損益計算書】

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

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

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

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

(単位：千円)

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定率法によっております。

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

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2)退職給付引当金

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

(3)移転関連費用引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更

1. 耐用年数の変更

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

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

2. 資産除去債務の見積りの変更

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

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

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

追加情報

会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

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

2関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

（損益計算書関係）

1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末

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

2. 自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

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

2. 自己株式の種類及び株式数

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

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

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

3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

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

(1)配当金の総額 30,000千円

(2) 配当金の原資 利益剰余金

(3) 1株当たり配当額 10,000円

(4) 基準日 平成24年3月31日

(5) 効力発生日 平成24年6月29日

(リ - ス取引関係)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成23年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額

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

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

当事業年度（平成24年3月31日）

（単位：千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

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

「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成23年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成24年3月31日）

（単位：千円）

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

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

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度（平成23年3月31日現在）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位：千円）

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

2. 売却したその他有価証券

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

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
7,639	756	480

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

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

（デリバティブ取引関係）

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務及びその他に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

（注）2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項

（単位：千円）

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

（注）1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

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

4．退職給付債務等の計算基礎

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

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

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

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

セグメント情報

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

関連情報

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投資有価証券の譲渡

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投資有価証券の譲渡及び自己株式の取得

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（平成23年3月31日）

住友信託銀行株式会社（非上場）

当事業年度（平成24年3月31日）

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

（1株当たり情報）

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

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

2. 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

（重要な後発事象）

前事業年度（自平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

1. 企業結合の概要

(1) 結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 住信アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

(2) 企業結合日

平成24年4月1日

(3) 企業結合の法的形式

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

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5) その他取引の概要に関する事項

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

2. 実施した会計処理の概要

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

[次へ](#)

<参考> 中央三井アセットマネジメント株式会社の経理状況

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

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

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 木村 充男

印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 松崎 雅則

印

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

(1) 貸借対照表

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

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

(2) 損益計算書

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

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

(3) 株主資本等変動計算書

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

重要な会計方針

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

追加情報

第26期
(平成23年4月1日から
平成24年3月31日まで)

1．会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

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

2．役員賞与引当金

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

注記事項

1. 貸借対照表関係

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

2. 損益計算書関係

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

3. 株主資本等変動計算書関係

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

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

4．リース取引関係

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

5．金融商品関係

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

1．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

2．金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び (4) 未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

1．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

2．金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び (4) 未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

6．有価証券関係

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

7. デリバティブ関係

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

8. 退職給付関係

第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)	第26期 (平成23年4月1日から 平成24年3月31日まで)																
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成23年3月31日現在）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 70%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">18,693千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">18,693千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 （平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 70%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">7,250千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;">7,250千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	18,693千円	退職給付引当金	18,693千円	勤務費用	7,250千円	退職給付費用	7,250千円	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成24年3月31日現在）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 70%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">20,003千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">20,003千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 （平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 70%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">7,090千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;">7,090千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	20,003千円	退職給付引当金	20,003千円	勤務費用	7,090千円	退職給付費用	7,090千円
退職給付債務	18,693千円																
退職給付引当金	18,693千円																
勤務費用	7,250千円																
退職給付費用	7,250千円																
退職給付債務	20,003千円																
退職給付引当金	20,003千円																
勤務費用	7,090千円																
退職給付費用	7,090千円																

9. 税効果会計関係

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

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

10. 資産除去債務関係

第25期
平成23年3月31日

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

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

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3. 当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

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

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

第26期
平成24年3月31日

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

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

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3. 当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

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

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

11. セグメント情報等

第25期
(平成22年4月1日から
平成23年3月31日まで)

(セグメント情報)

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連情報)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

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

第26期
(平成23年4月1日から
平成24年3月31日まで)

(セグメント情報)

第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連情報)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

12. 関連当事者との取引関係

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

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

(2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

第26期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）

1．関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

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

(2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

13. 1株当たり情報

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

1株当たり当期純損益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

14. 重要な後発事象

第26期
(平成23年4月1日から
平成24年3月31日まで)

(企業結合)

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

(1) 企業結合の概要

結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 住信アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

企業結合日

平成24年4月1日

企業結合の法的形式

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

結合後の企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

その他取引の概要に関する事項

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

(2) 実施した会計処理の概要

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

中間貸借対照表

(単位：千円)

第27期中間会計期間末 (平成24年9月30日)		
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		7,260,016
未収委託者報酬		1,814,969
未収運用受託報酬		28,372
繰延税金資産		101,482
その他	2	93,819
流動資産合計		9,298,659
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	86,364
器具備品	1	125,490
有形固定資産合計		211,855
無形固定資産		
投資その他の資産		
投資有価証券		74,123
長期貸付金		33,338
会員権		25,000
その他		1,550
貸倒引当金		33,338
投資その他の資産合計		100,673
固定資産合計		497,530
資産合計		9,796,190
負債の部		
流動負債		
未払金		962,627
未払費用		281,477
未払法人税等		5,190
賞与引当金		95,026
その他		19,459
流動負債合計		1,363,781
固定負債		
退職給付引当金		247,039
繰延税金負債		300,749
資産除去債務		12,177
固定負債合計		559,966
負債合計		1,923,747

(単位：千円)

第27期中間会計期間末

（平成24年9月30日）

純資産の部	
株主資本	
資本金	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	350,000
資本剰余金合計	350,000
利益剰余金	
利益準備金	59,500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100,000
繰越利益剰余金	5,076,855
利益剰余金合計	7,236,355
株主資本合計	7,886,355
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	13,912
評価・換算差額等合計	13,912
純資産合計	7,872,442
負債純資産合計	9,796,190

中間損益計算書

（単位：千円）

		第27期中間会計期間
		（自 平成24年4月1日
		至 平成24年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		9,035,190
運用受託報酬		44,467
営業収益合計		9,079,657
営業費用		
一般管理費	1	1,564,871
営業利益		553,930
営業外収益	2	8,237
営業外費用		542
経常利益		561,626
特別損失	1 3	484,725
税引前中間純利益		76,900
法人税、住民税及び事業税		1,327
法人税等調整額		24,285
法人税等合計		25,612
中間純利益		51,287

中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

第27期中間会計期間

（自 平成24年4月1日

至 平成24年9月30日）

株主資本	
資本金	
当期首残高	300,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	300,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	
当期首残高	-
当中間期変動額	
合併による受入	350,000
当中間期変動額合計	350,000
当中間期末残高	350,000
資本剰余金合計	
当期首残高	-
当中間期変動額	
合併による受入	350,000
当中間期変動額合計	350,000
当中間期末残高	350,000
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	56,500
当中間期変動額	
剰余金の配当に伴う積立	3,000
当中間期変動額合計	3,000
当中間期末残高	59,500
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	2,100,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	2,100,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	2,516,273
当中間期変動額	
剰余金の配当	33,000
中間純利益	51,287
合併による受入	2,542,294
当中間期変動額合計	2,560,582
当中間期末残高	5,076,855
利益剰余金合計	
当期首残高	4,672,773
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	51,287
合併による受入	2,542,294
当中間期変動額合計	2,563,582
当中間期末残高	7,236,355
株主資本合計	
当期首残高	4,972,773
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	51,287
合併による受入	2,892,294
当中間期変動額合計	2,913,582
当中間期末残高	7,886,355

（単位：千円）

第27期中間会計期間
（自 平成24年4月1日
至 平成24年9月30日）

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	9,859
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	4,053
当中間期変動額合計	4,053
当中間期末残高	13,912
評価・換算差額等合計	
当期首残高	9,859
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	4,053
当中間期変動額合計	4,053
当中間期末残高	13,912
純資産合計	
当期首残高	4,962,913
当中間期変動額	
剰余金の配当	30,000
中間純利益	51,287
合併による受入	2,892,294
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	4,053
当中間期変動額合計	2,909,528
当中間期末残高	7,872,442

重要な会計方針

第27期中間会計期間 （自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）	
1. 資産の評価基準及び評価方法	
有価証券	
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によっております。 （評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）
時価のないもの	移動平均法による原価法によっております。
2. 固定資産の減価償却の方法	
(1) 有形固定資産	
定率法によっております。	
(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更)	
当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。	
これにより、従来の方法に比べて、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ5,543千円増加しております。	
(2) 無形固定資産	
定額法によっております。	
ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、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) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

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

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

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第27期中間会計期間末 (平成24年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額
	建 物 16,512千円
	器具備品 213,925千円
	計 230,438千円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動資産の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第27期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 33,259千円
	無形固定資産 34,512千円
2	営業外収益の主要項目
	受取利息 2,688千円
3	特別損失の主要項目
	統合関連損失 484,725千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当期首	当期増加	当期減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成24年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成24年 3月31日	平成24年 6月29日

（リ・ス取引関係）

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第27期中間会計期間末（平成24年9月30日）

平成24年9月30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（（注2）を参照ください）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	7,260,016	7,260,016	-
(2)未収委託者報酬	1,814,969	1,814,969	-
(3)投資有価証券 その他有価証券	64,123	64,123	-
(4)未払金	(962,627)	(962,627)	-

(*)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及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額10,000千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)

投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第27期中間会計期間末（平成24年9月30日）

その他有価証券

（単位：千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
その他	4,200	4,311	111
小計	4,200	4,311	111
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他	81,539	59,812	21,727
小計	81,539	59,812	21,727
計	85,739	64,123	21,616

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 10,000千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

（企業結合等関係）

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

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

1. 企業結合の概要

(1) 結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称 当社

事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称 中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業

(2) 企業結合日

平成24年4月1日

(3) 企業結合の法的形式

当社を吸収合併存続会社、中央三井アセットマネジメント株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併

合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

(4) 結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5) その他取引の概要に関する事項

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

2. 実施した会計処理の概要

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

（資産除去債務関係）

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

セグメント情報

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

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

関連情報

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が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、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
PIMCO 米国ハイイールド債券 通貨選択型ファンド（ブラジル・リアルコース）	1,110,941千円

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

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27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

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27期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

第27期中間会計期間 （自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）	
1株当たり純資産額	2,624,147円63銭
1株当たり中間純利益	17,096円00銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第27期中間会計期間 （自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）	
中間純利益	51,287千円
普通株式に係る中間純利益	51,287千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1)定款の変更

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

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成25年3月8日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成24年9月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成24年9月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	47,937	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	7,425	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成24年9月末日現在）

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

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

第3【その他】

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

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

平成25年2月15日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山田 信之

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」に掲げられている外国債券オープン（3ヶ月決算型）の平成24年6月16日から平成24年12月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、外国債券オープン（3ヶ月決算型）の平成24年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

その他の事項

ファンドの平成24年6月15日をもって終了した前特定期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成24年7月27日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以上

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月6日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波 博之
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	白川 芳樹
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊藤 浩之

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トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第27期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成24年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

上記は、当社が、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。