

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成21年10月9日
【計算期間】	特定6期（自 平成21年1月10日 至 平成21年7月9日）
【ファンド名】	ニュー・グローバル・バランス・ファンド
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 前田 良治
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	古池 典生
【連絡場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【電話番号】	03-5405-0739
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【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】

イ 当ファンドは、次の各投資信託に投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

- a. グローバル好利回り債券マザーファンド
- b. アライアンス・バーンスタイン・エマージング市場債券ファンドB（適格機関投資家専用）
- c. グローバル好利回り株式マザーファンド
- d. 中小型株マザーファンド
- e. アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド（適格機関投資家専用）
- f. グローバル・リート・マザーファンド

ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、金1兆円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
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	内外	目論見書または信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に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）	資産複合	目論見書または信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分固定型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式、債券および不動産投信であり、ファンドの収益はそれぞれの市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。

決算頻度	年6回（隔月）	目論見書または信託約款において、年6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（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界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	ファンド・オブ・ファンズ	社団法人投資信託協会「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、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。

※一部の組入マザーファンドの運用は、ファンド・オブ・ファンズ（投資信託証券への投資を目的とする投資信託）の投資形態で行うため、当ファンドとマザーファンドを一体とみなした場合、ファンド・オブ・ファンズの性質を有します。

《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	国 内	株 式
		債 券
追 加 型	海 外	不 動 産 投 信
		そ の 他 資 産
	内 外	(資 産 複 合)

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

《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	年 1 回	グ ロー バ ル (日本を含む)		
一 般	年 2 回	日 本		
大 型 株	年 4 回	北 米	ファミリーファンド	あ り
中 小 型 株	年6回(隔月)	欧 州		
債 券	年12回(毎月)	ア ジ ア		
一 般	日 々	オ セ ア ニ ア		
公 債	そ の 他	中 南 米	ファンド・オブ・ファンズ	な し
社 債	()	ア フ リ カ		
その他債券		中近東(中東)		
クレジット属性		エマージング		
()				
不動産投信				
その他資産				
(投資信託証券/資産複合(株式、債券、不動産投資/資産配分固定型))				
資産複合				
()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

※商品分類、属性区分は、社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの仕組み】**イ 当ファンドの関係法人とその役割****（イ）委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」**

証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

（ロ）受託会社 「住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

（ハ）販売会社

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

（ニ）運用の委託先（投資顧問会社）

委託会社との間で締結される投資一任契約（運用委託契約）に基づき、グローバル・リート・マザーファンドの運用指図に関する権限の一部の委託を受け、信託財産の運用を行います。

名称：フォルティス・インベストメント・マネジメント・ネイザーランズ・エヌ・ブイ

（Fortis Investment Management Netherlands N.V.）

役割：当ファンドが主要投資対象とするグローバル・リート・マザーファンドに関する資金配分（為替取引を含む）および欧州地域のリート取引にかかる運用の指図を行います。

名称：フォルティス・インベストメント・マネジメント・ユーエスエー・インク

（Fortis Investment Management USA, Inc.）

役割：当ファンドが主要投資対象とするグローバル・リート・マザーファンドに関する北米地域のリート取引にかかる運用の指図を行います。

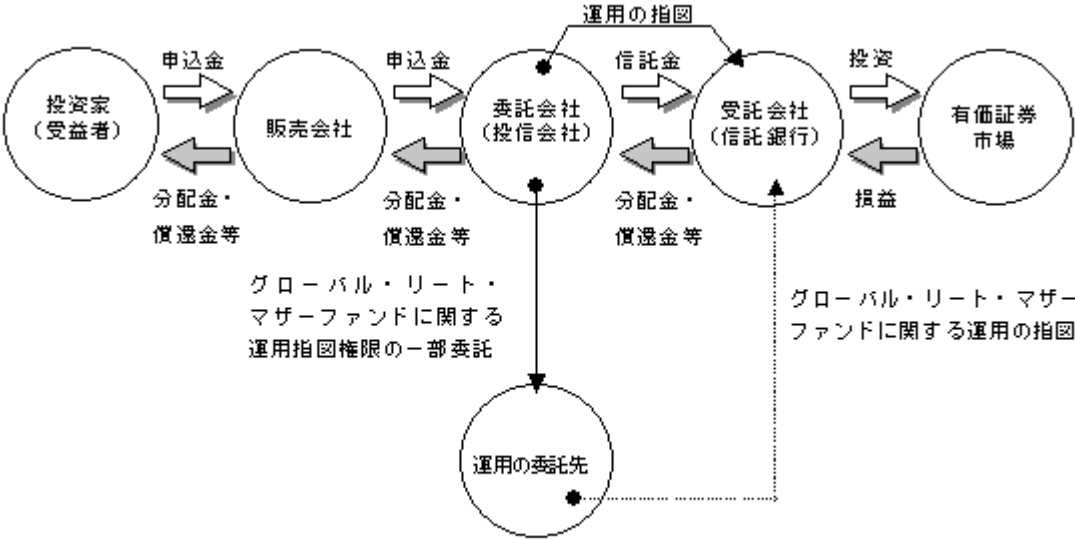
名称：エービーエヌ・アムロ・アセットマネジメント（アジア）リミテッド

（ABN AMRO Asset Management (Asia) Ltd.）

役割：当ファンドが主要投資対象とするグローバル・リート・マザーファンドに関するアジア・オセアニア地域（日本を含む）のリート取引にかかる運用の指図を行います。

※運用委託先である上記３社を総称して、以下「フォルティス・インベストメンツ・グループ」ということがあります。なお、将来、フォルティス・インベストメンツ・グループ内の組織変更等に伴い、運用委託先の形式的な変更が生じることがあります。

運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（平成21年8月31日現在）

(ロ) 会社の沿革

昭和60年7月 三生投資顧問株式会社設立

昭和62年2月 証券投資顧問業の登録

昭和62年6月 投資一任契約にかかる業務の認可

平成11年1月 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合

平成11年2月 三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更

平成12年1月 証券投資信託委託業の認可取得

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

(ハ) 大株主の状況

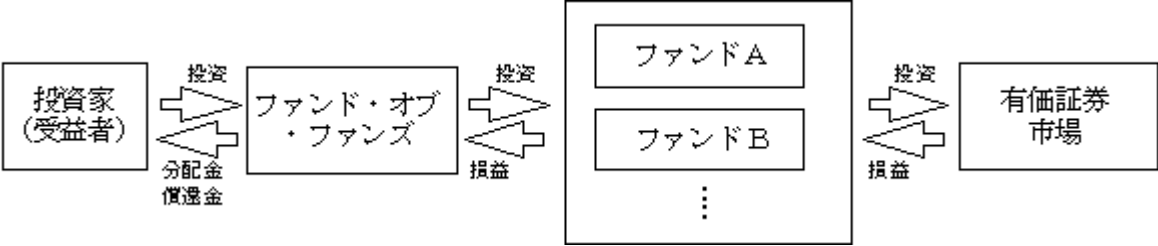
（平成21年8月31日現在）

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	7,056	40.0
三井住友海上火災保険株式会社	東京都中央区新川二丁目27番2号	4,851	27.5
株式会社三井住友銀行	東京都千代田区有楽町一丁目1番2号	4,851	27.5
三井生命保険株式会社	東京都千代田区大手町一丁目2番3号	882	5.0

ハ ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



2【投資方針】

（1）【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、次の各投資信託に投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

- a. グローバル好利回り債券マザーファンド
- b. アライアンス・バーンスタイン・エマージング市場債券ファンドB（適格機関投資家専用）
- c. グローバル好利回り株式マザーファンド
- d. 中小型株マザーファンド
- e. アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド（適格機関投資家専用）
- f. グローバル・リート・マザーファンド

ロ 投資態度

（イ）内外の債券、株式、不動産投資信託（リート）を主要投資対象とする6つの投資信託に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指します。

（ロ）各投資信託への基本投資比率は以下の通りとします。

- a. グローバル好利回り債券マザーファンド：35%
- b. アライアンス・バーンスタイン・エマージング市場債券ファンドB（適格機関投資家専用）
：15%
- c. グローバル好利回り株式マザーファンド：15%
- d. 中小型株マザーファンド：10%
- e. アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド（適格機関投資家専用）
：15%
- f. グローバル・リート・マザーファンド：10%

（ハ）基本投資比率からの乖離は、一定の範囲を設けて調整を行うものとします。

（ニ）実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

（ヘ）主要投資対象とするファンドは、下記の通りとします。ただし、運用状況等により変更となる場合があります。

a. グローバル好利回り債券マザーファンド

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	外国債券（含む日本）
運用の基本方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指した運用を行います。

b. アライアンス・バーンスタイン・エマージング市場債券ファンドB（適格機関投資家専用）

運用会社	アライアンス・バーンスタイン株式会社
------	--------------------

主要運用対象	外国債券
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

c. グローバル好利回り株式マザーファンド

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	外国株式（含む日本）
運用の基本方針	信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

d. 中小型株マザーファンド

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	国内株式
運用の基本方針	信託財産の成長を目指して運用を行います。

e. アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	アライアンス・バーンスタイン株式会社
主要運用対象	外国株式
運用の基本方針	長期的な信託財産の成長を図ることを目標に積極的な運用を行います。

f. グローバル・リート・マザーファンド

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社 ^(注)
主要運用対象	外国リート（含む日本）
運用の基本方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

（注）フォルティス・インベストメンツ・グループに運用指図に関する権限を委託します。

※上記ファンドの詳細に関しましては、後述の「参考情報：他の投資信託の概要」をご覧ください。

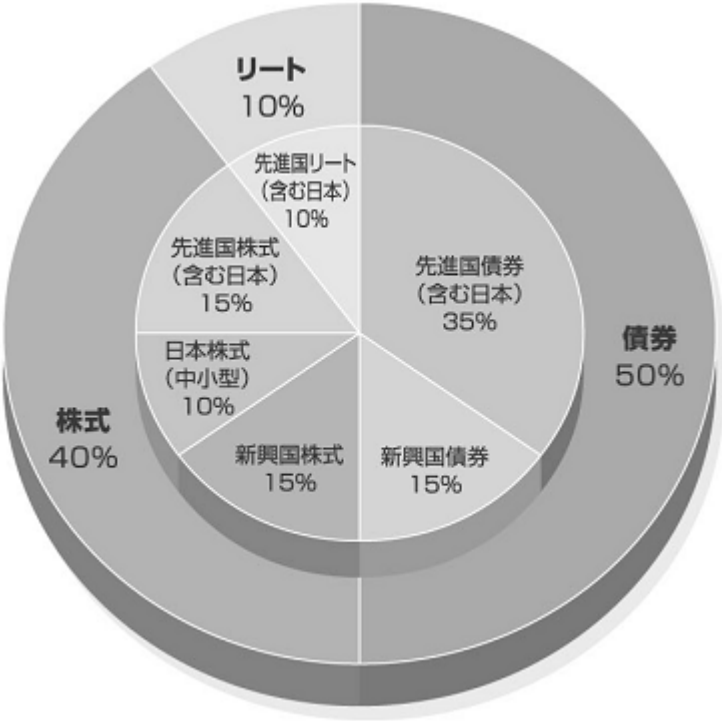
ファンドの特色

- ・国内外の債券・株式・不動産投資信託（リート）に分散投資を行い、信託財産の中長期的な成長と安定的なインカム収入（利息・配当収入）の確保を目指します。

基本投資比率

債券：株式：リート＝50：40：10

先進国：新興国＝70：30



（２）【投資対象】**イ 投資対象とする資産の種類**

当ファンドが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。

（イ）次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

- １．有価証券
- ２．金銭債権
- ３．約束手形

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

- １．為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、住友信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託である「グローバル好利回り債券マザーファンド」、「グローバル好利回り株式マザーファンド」、「中小型株マザーファンド」および「グローバル・リート・マザーファンド」の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．アライアンス・バーンスタイン・エマージング市場債券ファンドＢ（適格機関投資家専用）受益証券
- ２．アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド（適格機関投資家専用）受益証券
- ３．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）
- ４．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- ５．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
- ６．投資信託または外国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。）
- ７．投資証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。）
- ８．外国法人が発行する譲渡性預金証書

なお、親投資信託、第１号、第２号、第６号の証券および第７号の証券を以下「投資信託証券」といいます。また、第３号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

ハ 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上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

※主要投資対象となるファンドの名称、運用会社、主要運用対象、運用の基本方針に関しましては、上記「（１）投資方針」の記載をご覧ください。

（３）【運用体制】**イ 運用体制**

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

（イ）計画（Plan）

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

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

（ロ）実行（Do）

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

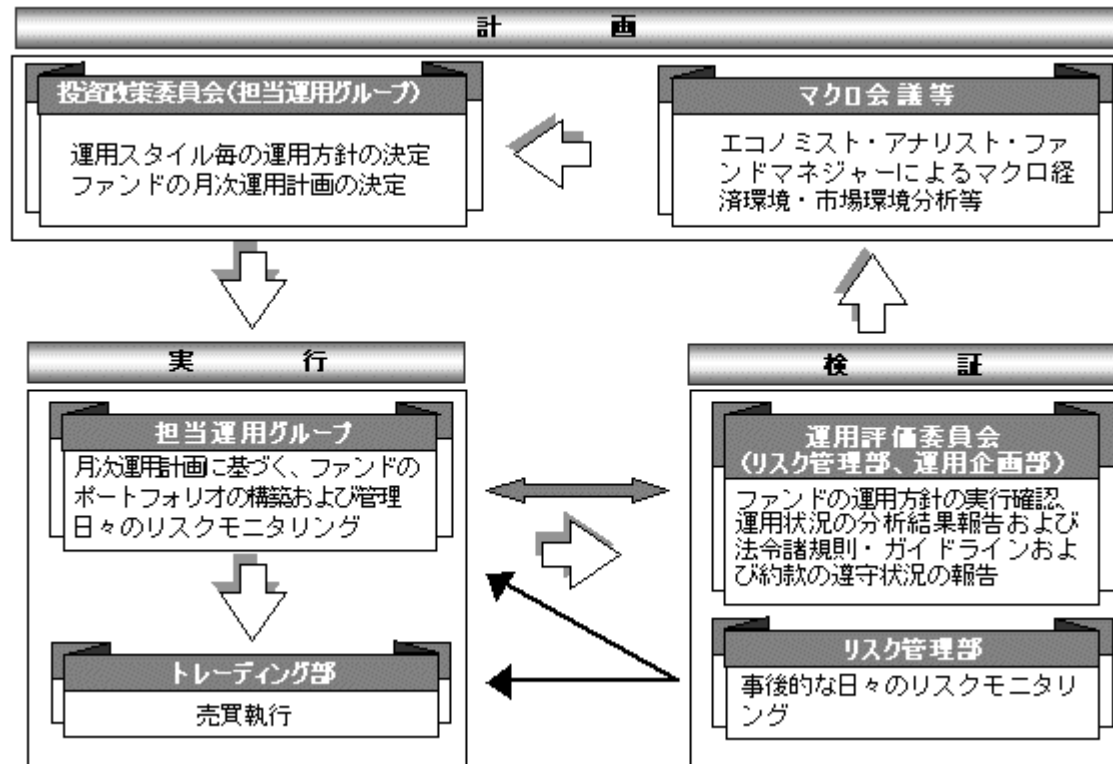
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

（ハ）検証（Check）

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

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

【ファンドの運用体制】



※リスク管理部は8名程度、運用企画部は10名程度で構成されています。

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

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

運用委託先に対しては、運用内容に関する十分な情報開示を求め、投資判断と委託の内容に齟齬がないかを確認します。また、定性・定量面における運用委託先の評価を継続的に実施します。

運用委託先管理部会において運用委託先との契約について年1回見直しの検討および継続可否判断等を行い、運用実績に優位性がある等の合理的理由のないままでの契約の継続は行いません。

（４）【分配方針】

毎年6回（原則として1月、3月、5月、7月、9月、11月の9日。ただし、休業日の場合は翌営業日。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

イ 分配対象額の範囲は、経費控除後の、繰越分を含めた利子、配当収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。

ロ 収益分配金額は、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、分配対象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により収益分配を行わない場合があります。

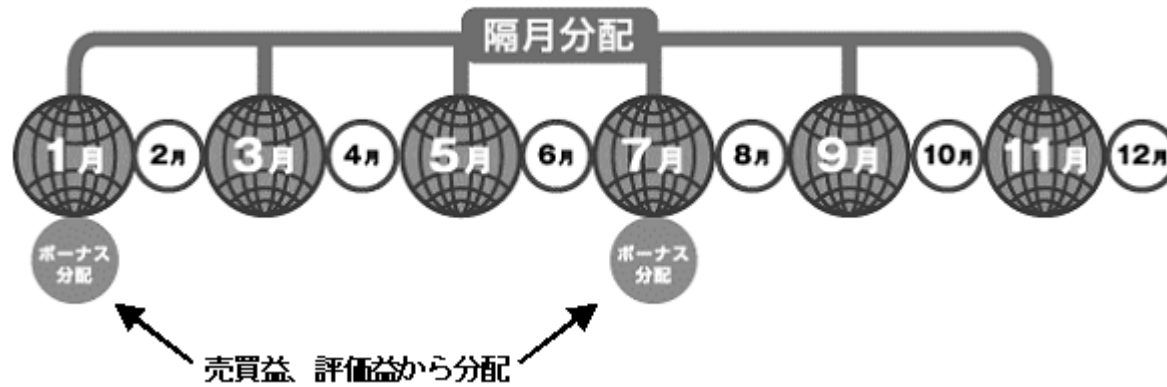
ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、前記「（１）投資方針」と同一の運用を行います。

収益分配のイメージ

原則として隔月（奇数月）分配を目指します。

- ・隔月決算（決算日は奇数月の9日、休業日の場合は翌営業日）を行い、配当等収益を中心に安定した分配を目指します。
- ・売買益等については、基準価額水準・市況動向等を勘案して、毎年1月、7月の決算時に分配する予定です（ボーナス分配）。

配当等収益を中心に分配



※上記の図は、分配金支払いのイメージを示したものであり、将来の分配金の支払いをお約束するものではありません。

※分配金額は、委託会社が収益分配方針に基づき、基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。

（５）【投資制限】

Ⅰ ファンドの信託約款に基づく投資制限

イ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

ロ 投資信託証券、コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りです。

ハ 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

※実質投資割合とは、ファンドが保有するある種類の資産の評価額がファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のファンドが組み入れている投資信託証券における組入比率に当該投資信託証券のファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます（以下同じ。）。

ニ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

ホ 外国為替予約取引の指図

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

ヘ 資金の借入れ

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

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

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

（ニ）借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

Ⅱ 法令に基づく投資制限

イ 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第９条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全

部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

ロ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

（参考情報：他の投資信託の概要）**（グローバル好利回り債券マザーファンド）****（１）投資方針等****イ 基本方針**

世界の主要国の公社債に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

（イ）主として、世界の主要国のソブリン債等を中心に投資します。

※ソブリン債等には国債や政府機関が発行する債券のほか、地方債、世界銀行、アジア開発銀行などの国際機関が発行する債券も含まれます。

（ロ）投資対象とする債券の格付けは、取得時において主要格付機関の長期信用格付けでＡＡ－格相当以上とします。

（ハ）主要投資対象国および国別配分については、信用力、流動性、金利・経済状況、通貨分散等を勘案して決定します。

（ニ）主要投資対象国および国別配分は、随時見直します。

（ホ）外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

（ヘ）資金動向、市況動向等により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

（２）投資対象**イ 投資対象とする資産の種類**

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。

（イ）次に掲げる特定資産

- １．有価証券
- ２．デリバティブ取引にかかる権利
- ３．金銭債権
- ４．約束手形

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

- １．為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（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書
- 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と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. 特定目的会社にかかる特定社債券（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かかる優先出資証券（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. 特定目的会社にかか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. 投資信託または外国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、有価証券にかかるものに限ります。）
 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ます。）
 20. 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
 21. 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号の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（ただし、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。

ハ 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上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

（3）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- （イ）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- （ロ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- （ハ）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- （ニ）同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- （ホ）同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- （ヘ）同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

ロ 法令に基づく投資制限

前記「（5）投資制限 II 法令に基づく投資制限」は、当投資信託についても課されます。（以下の「投資対象とする各投資信託」についても同じ。）

（アライアンス・バーンスタイン・エマージング市場債券ファンドB（適格機関投資家専用））**（１）運用会社等**

- イ 委託会社 アライアンス・バーンスタイン株式会社
- ロ 受託会社 住友信託銀行株式会社

（２）投資方針等

イ 基本方針

アライアンス・バーンスタイン・新興国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、高水準のインカム・ゲインを確保するとともに、信託財産の長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。なお、債券等に直接投資する場合があります。

ロ 投資態度

- （イ）アライアンス・バーンスタイン・新興国債券マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。
 - ・主としてエマージング・カントリーの政府、政府機関および企業の発行する債券（エマージング・マーケット債）に分散投資することにより、高水準のインカム・ゲインを確保するとともに、信託財産の長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。
 - ・エマージング・マーケット債への投資にあたっては、独自の調査に基づき国別配分や銘柄の選択等を行います。
 - ・アライアンス・バーンスタイン・新興国債券マザーファンドの運用にあたっては、アライアンス・バーンスタイン・エル・ピーおよびその傘下の関連会社であるアライアンス・バーンスタイン・リミテッド、アライアンス・バーンスタイン・オーストラリア・リミテッド、アライアンス・バーンスタイン・香港・リミテッドに運用の指図に関する権限（国内余剰資金の運用に関する権限を除きます。）を委託します。
 - （ロ）実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
 - （ハ）信託財産の効率的な運用に資するため、先物取引等、スワップ取引、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。
 - （ニ）当初設定（平成18年6月29日）後数カ月の間は、追加設定・一部解約の資金状況をみながら、エマージング・マーケット債への投資を段階的に進めることもあります。
 - （ホ）投資環境に重大な変化が生じた場合には、信託財産を保全する目的で、主要投資対象への投資を大幅に縮小する場合があります。
 - （ヘ）投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資金凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）を含む市場動向等に急激な変化が生じたときまたは予想されるとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
- ハ 投資制限
- （イ）外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
 - （ロ）株式への投資は、優先証券のうち株券または新株引受権証書の性質を有するものまたは転換社債を転換お

よび新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限り、株式への実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以内とします。

（ハ）同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

（ニ）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、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

（ホ）投資信託証券（アライアンス・バーンスタイン・新興国債券マザーファンドを除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

（3）その他

イ 信託報酬	このファンドの信託財産の純資産総額に年0.798%（税抜き0.76%）を乗じて得た額
ロ 手数料	取得申込時および換金時には手数料はかかりません。
ハ 信託財産留保額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額に対し0.25%
ニ 決算日	原則として毎月7日

（グローバル好利回り株式マザーファンド）**（１）投資方針等****イ 基本方針**

世界の主要国の上場株式に投資し、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

（イ）世界の主要国の上場株式を主要投資対象とします。

（ロ）主要国の好配当銘柄に分散投資を行い、配当収入等による安定収益に加え、中長期的な信託財産の成長を狙います。

配当利回りと増配期待に着目した銘柄選定を行います。

（ハ）外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

（ニ）資金動向、市況動向等により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

（２）投資対象**イ 投資対象とする資産の種類**

前記「参考情報：投資対象とする投資信託の概要」において記載したグローバル好利回り債券マザーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「参考情報：投資対象とする投資信託の概要」において記載したグローバル好利回り債券マザーファンドが投資対象とする有価証券に同じです。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「参考情報：投資対象とする投資信託の概要」において記載したグローバル好利回り債券マザーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

（３）投資制限

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

（ハ）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（ニ）新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

（ホ）同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

（ヘ）同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

（ト）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

（中小型株マザーファンド）**（１）投資方針等****イ 基本方針**

わが国の取引所に上場している株式（これに準ずるものを含みます。）を主要投資対象とし、信託財産の成長を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- （イ）主として、わが国の取引所に上場している株式のうち、中小型株に投資を行い、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行います。
- （ロ）組入銘柄の選定は、徹底したボトムアップリサーチにより推計した「企業価値」を基本に行います。
- （ハ）非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- （ニ）資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（２）投資対象**イ 投資対象とする資産の種類**

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。

（イ）次に掲げる特定資産

- １．有価証券
- ２．デリバティブ取引にかかる権利
- ３．金銭債権
- ４．約束手形

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

- １．為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

前記「参考情報：投資対象とする投資信託の概要」において記載したグローバル好利回り債券マザーファンドが投資対象とする有価証券に同じです。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「参考情報：投資対象とする投資信託の概要」において記載したグローバル好利回り債券マザーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

（３）投資制限

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- （イ）株式への投資割合には制限を設けません。
- （ロ）外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- （ハ）同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします
- （ニ）投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

（ホ）新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

（アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド（適格機関投資家専用））**（１）運用会社等**

- イ 委託会社 アライアンス・バーンスタイン株式会社
- ロ 受託会社 三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社

（２）投資方針等

イ 基本方針

ＡＢエマージング・グロース株式マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、新興国の株式に分散投資することにより、長期的な信託財産の成長を目指します。

ロ 投資態度

- （イ）主としてＡＢ エマージング・グロース株式マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。
 - ・エマージング市場担当アナリストの徹底した個別企業分析に基づき成長性が高いと判断される銘柄を選択します。
 - ・ＡＢ エマージング・グロース株式マザーファンドの運用にあたっては、アライアンス・バーンスタイン・エル・ピーおよびその傘下の関連会社であるアライアンス・バーンスタイン・リミテッド、アライアンス・バーンスタイン・オーストラリア・リミテッド、アライアンス・バーンスタイン・香港・リミテッドに運用の指図に関する権限の一部（国内余剰資金の運用に関する権限を除きます。）を委託します。
- （ロ）株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- （ハ）実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- （ニ）当初設定日（平成18年5月29日）直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市場動向等に急激な変化が生じたときまたは予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

ハ 投資制限

- （イ）株式への実質投資割合は、制限を設けません。
- （ロ）外貨建資産への実質投資割合は、制限を設けません。
- （ハ）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、取得時において信託財産の純資産総額の25%以内とします。
- （ニ）同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- （ホ）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、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- （ヘ）同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- （ト）投資信託証券（ＡＢエマージング・グロース株式マザーファンドを除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

（3）その他

イ 信託報酬	このファンドの信託財産の純資産総額に年0.945％（税抜き0.9％）を乗じて得た額
ロ 手数料	取得申込時および換金時には手数料はかかりません。
ハ 信託財産留保額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額に対し0.5％
ニ 決算日	原則として毎年１回（５月29日）

（グローバル・リート・マザーファンド）**（１）投資方針等****イ 基本方針**

主として日本を含む世界各国において上場（準ずるものを含みます。以下同じ。）しているリートに投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- （イ）主として日本を含む世界各国において上場しているリートに投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。
- （ロ）安定的かつ相対的に高い配当収益の確保を目指すために、賃貸事業収入比率の高い銘柄を中心に分散投資します。
- （ハ）外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないものとします。
- （ニ）フォルティス・インベストメント・マネジメント・ネイザーランズ・エヌ・ブイに資金配分（為替取引を含む）およびリートの運用指図に関する権限、フォルティス・インベストメント・マネジメント・ユーエスエー・インク、エービーエヌ・アムロ・アセットマネジメント（アジア）リミテッドにリートの運用指図に関する権限を委託します。
- （ホ）なお資金動向、市場動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（２）投資対象**イ 投資対象とする資産の種類**

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。

- （イ）次に掲げる特定資産
 - １．有価証券
 - ２．金銭債権
 - ３．約束手形
- （ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産
 - １．為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（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．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）
- ２．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- ３．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
- ４．投資信託または外国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。）

５．投資証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。）

６．外国法人が発行する譲渡性預金証書

なお、第１号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）に限り行うことができるものとします。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「参考情報：投資対象とする投資信託の概要」において記載したグローバル好利回り債券マザーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

（３）投資制限

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）主要投資対象とするリート、コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、債券買い現先取引に限ります。

（ロ）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

（ハ）リートへの投資割合には、制限を設けません。

（ニ）同一銘柄のリートへの投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、投資信託を組み入れることにより運用を行います。当ファンドが組み入れる投資信託は、主に内外の株式、債券および不動産投資信託（リート）を投資対象としており、その基準価額は、保有する株式、債券およびリートの値動き、為替相場の変動等の影響により上下します。また、保有する株式、債券およびリートの発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等にも影響を受けます。当ファンドが組み入れる投資信託の基準価額の変動により、当ファンドの基準価額も上下し、投資元本を割り込むことがあります。

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

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

（イ）株式市場リスク

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

（ロ）債券市場リスク

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

（ハ）不動産投資信託（リート）に関するリスク

不動産投資信託（リート）の価格は、不動産市況や金利・景気動向等の影響を受け変動します。また、不動産等にかかる法制度（税制、建築規制、会計制度等）の変更によって、価格が上下したり、配当の額に影響を及ぼすことがあります。リートに組み入れられている個々の不動産等の価値、それらの賃貸収入等がマーケット要因によって上下するほか、自然災害等の予測困難な事態により個々の不動産等の毀損・滅失が生じる可能性もあります。これらの影響により、ファンドが組み入れているリートの価格が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ニ）為替変動リスク

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

（ホ）信用リスク

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

（ヘ）カントリーリスク

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

特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

（ト）市場流動性リスク

大口の解約請求があった場合、解約資金を手当てするために保有資産を大量に売却しなければならないことがあります。その際、市場動向や取引量等の状況によっては、取引ができなかったり、通常よりも著しく不利な価格での取引を余儀なくされたりすることがあり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（チ）ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

ロ 投資リスクの管理体制

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

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

原則として、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に、3.15%（税抜き3.0%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

※累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

※申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号※	インターネット・ ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

※お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

（２）【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

ただし、解約の際には、1口につき解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た信託財産留保額が差し引かれます。

（３）【信託報酬等】

純資産総額に年1.31355%（税抜き1.251%）の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。

信託報酬は、各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

委託会社	販売会社	受託会社
年0.57855% (0.551%)	年0.68250% (0.650%)	年0.05250% (0.050%)

※（ ）内は税抜き。

※投資対象とする投資信託のうち「アライアンス・バーンスタイン・エマージング市場債券ファンドB（適格機関投資家専用）」および「アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド（適格機関投資家専用）」には信託報酬等がかかります。なお、当ファンドの信託報酬に上記2ファンドの信託報酬を含めた実質的な信託報酬の総額は、当ファンドの基本投資比率に従った場合、年1.575%（税抜き1.5%）程度となります（実質的に投資対象とするリートにおいても、運用報酬等の負担がありますが、その銘柄、構成等は運用状況により流動的なため、その上限額等を記載できません。）。

（４）【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、年2,100,000円（税抜き2,000,000円）を上限として、日割りした金額が信託財産の費用として計上され、各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）等は、信託財産中から支弁するものとします。
- ※ 上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。
- ※ 当ファンドが組み入れる他の投資信託は、その委託会社、受託会社の業務の対価として、信託報酬を支払います。また、その他、当該他の投資信託の諸経費は、その信託財産から支弁されます。この費用は、当該他の投資信託の基準価額に反映され、結果的に当ファンドがその持分に応じて負担することになります。なお、現在、当ファンドが投資を行っている他の投資信託については、取得時、換金時に手数料はかかりません。
- ※ リートを実質的な主要投資対象とする当ファンドでは、株式と同様に取引所等の市場で売買される多数の銘柄のリートの中から、約款上の選定基準に従って適宜組入銘柄を選定して分散投資を行い、また売却を行いますので、組み入れるリートの銘柄や構成比は流動的となります。
- リーートの多くは法人形態をとっており、その費用には、運用者等に支払う費用以外に、一般の会社と同じように多種多様なものがあり、また、国・地域によっては、開示する項目の基準が異なります。
- したがって、委託会社において、当ファンドが実質的に組み入れる様々なリートの費用等を網羅的に調査し、当ファンドへの投資等のための参考になるような情報として、その上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

※ 上記（１）～（４）にかかる手数料等および他の投資信託（ファンド）の組入れを通じて間接的に負担する手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあったりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

（５）【課税上の取扱い】**イ 個別元本について**

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

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

ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

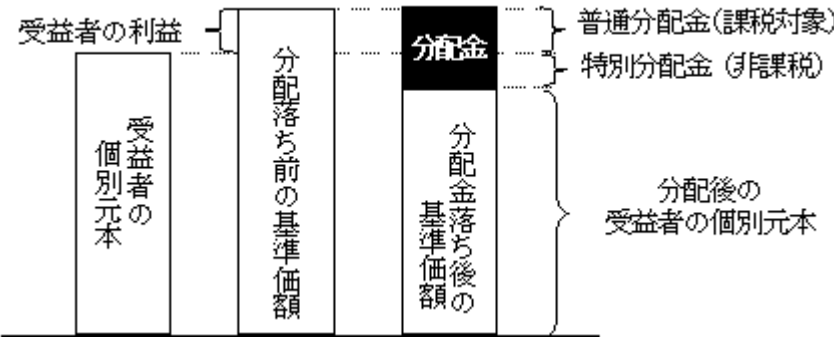
ハ 収益分配金の課税について

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

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



②収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が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特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

（イ）個人の受益者に対する課税

i. 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、平成23年12月31日までは10%（所得税7%および地方税3%）、平成24年1月1日以降は20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

ii. 一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、平成23年12月31日までは10%（所得税7%および地方税3%）、平成24年1月1日以降は20%（所得税15%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

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

（ロ）法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、平成23年12月31日までは7%（所得税のみ）、平成24年1月1日以降は15%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、受取配当にかかる益金不算入制度の適用はありません。

※当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

※上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成21年8月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

5【運用状況】

（１）【投資状況】

平成21年8月31日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	日本	1,919,927,718	28.87
グローバル好利回り債券マザーファンド受益証券	日本	2,281,178,556	34.30
グローバル好利回り株式マザーファンド受益証券	日本	982,004,091	14.77
中小型株マザーファンド受益証券	日本	671,912,068	10.10
グローバル・リート・マザーファンド受益証券	日本	726,458,468	10.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		69,310,526	1.04
合計(純資産総額)		6,650,791,427	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ 主要投資銘柄

平成21年8月31日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価／金額 (円)	評価額 単価／金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	グローバル好利回り債券 マザーファンド	2,215,596,889	0.9804 2,172,219,445	1.0296 2,281,178,556	34.30
日本	親投資信託 受益証券	グローバル好利回り株式 マザーファンド	1,108,982,599	0.7677 851,380,248	0.8855 982,004,091	14.77
日本	投資信託 受益証券	アライアンス・バーンスタイン・ エマージング成長株ファンド (適格機関投資家専用)	1,134,095,018	0.738 836,962,123	0.8533 967,723,278	14.55
日本	投資信託 受益証券	アライアンス・バーンスタイン・ エマージング市場債券ファンドB (適格機関投資家専用)	1,185,661,114	0.7498 889,008,703	0.8031 952,204,440	14.32
日本	親投資信託 受益証券	グローバル・リート・ マザーファンド	771,514,941	0.7216 556,725,182	0.9416 726,458,468	10.92

日本	親投資信託 受益証券	中小型株マザーファンド	1,099,872,432	0.5658 622,307,822	0.6109 671,912,068	10.10
----	---------------	-------------	---------------	-----------------------	-----------------------	-------

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成21年8月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	28.87
親投資信託受益証券	70.09
合計	98.96

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】**①【純資産の推移】**

年月日	純資産総額 (円)	1万口当たりの 純資産額 (円)
特定１期（平成19年１月９日）（分配落）	1,005,308	10,053
特定１期（平成19年１月９日）（分配付）	1,005,308	10,053
特定２期（平成19年７月９日）（分配落）	9,416,314,443	10,824
特定２期（平成19年７月９日）（分配付）	9,668,961,226	11,183
特定３期（平成20年１月９日）（分配落）	10,454,081,359	9,511
特定３期（平成20年１月９日）（分配付）	10,715,365,353	9,751
特定４期（平成20年７月９日）（分配落）	9,298,803,322	8,621
特定４期（平成20年７月９日）（分配付）	9,559,382,602	8,861
特定５期（平成21年１月９日）（分配落）	5,673,180,555	5,545
特定５期（平成21年１月９日）（分配付）	5,891,418,192	5,755
特定６期（平成21年７月９日）（分配落）	6,015,023,078	5,926
特定６期（平成21年７月９日）（分配付）	6,167,394,486	6,076
平成20年８月末日	8,980,393,685	8,445
平成20年９月末日	7,656,828,173	7,296
平成20年10月末日	5,949,324,362	5,779
平成20年11月末日	5,658,789,028	5,500
平成20年12月末日	5,596,951,546	5,468
平成21年１月末日	5,280,645,969	5,165
平成21年２月末日	5,422,417,316	5,335
平成21年３月末日	5,590,501,233	5,503
平成21年４月末日	5,980,761,918	5,885
平成21年５月末日	6,269,171,195	6,165
平成21年６月末日	6,393,553,832	6,300
平成21年７月末日	6,580,759,876	6,482
平成21年８月末日	6,650,791,427	6,566

（注１）純資産総額（分配付）および1万口当たり純資産額（分配付）の欄は、収益分配時の支払外国税調整額を考慮していません。

（注２）純資産総額（分配付）および1万口当たり純資産額（分配付）の欄は、各特定期間にかかる収益分配金

の総額を含んでいます。

②【分配の推移】

計算期間	1 万口当たり分配金（円）
特定 1 期（平成18年12月20日～平成19年 1 月 9 日）	0
特定 2 期（平成19年 1 月10日～平成19年 7 月 9 日）	360
特定 3 期（平成19年 7 月10日～平成20年 1 月 9 日）	240
特定 4 期（平成20年 1 月10日～平成20年 7 月 9 日）	240
特定 5 期（平成20年 7 月10日～平成21年 1 月 9 日）	210
特定 6 期（平成21年 1 月10日～平成21年 7 月 9 日）	150

③【収益率の推移】

計算期間	収益率（％）
特定１期	0.5
特定２期	11.2
特定３期	△9.9
特定４期	△6.8
特定５期	△33.2
特定６期	9.6

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

（注２）収益分配時の支払外国税調整額を考慮していませんので、上記収益率は同期間における受益者の投資収益率と異なる場合があります。

〔参考情報：他の投資信託証券の投資状況・投資資産〕

〔グローバル好利回り債券マザーファンド〕

（１）投資状況

平成21年 8 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	7,621,152,801	12.66
	カナダ	5,719,042,193	9.50
	ドイツ	2,374,740,624	3.95
	フランス	6,049,616,002	10.05
	イギリス	3,742,671,371	6.22
	ニュージーランド	334,394,562	0.56
	ノルウェー	11,664,333,018	19.38
	小 計	37,505,950,571	62.32
地方債証券	オーストラリア	7,356,993,603	12.22
特殊債券	国際機関	12,700,627,251	21.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,623,163,018	4.36
合計(純資産総額)		60,186,734,443	100.00

（２）投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成21年 8 月31日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価／金額 (円)	評価額 単価／金額 (円)	利率／ 償還期限	投資 比率 (%)
ノルウェー	国債 証券	NORWAY GOV 6.5% 130515	219,500,000	1,704.41 3,741,183,462	1,707.48 3,747,935,282	6.5 2013/5/15	6.23
ノルウェー	国債 証券	NORWAY GOV 6% 110516	229,170,000	1,633.35 3,743,161,945	1,629.81 3,735,055,285	6 2011/5/16	6.21

オーストラリア	地方債 証券	NSWTC 7% 10/12/01	38,800,000	8,098.87 3,142,363,500	8,072.27 3,132,040,760	7 2010/12/1	5.20
国際機関	特殊 債券	ASIA 6.25% 11/06/15	39,000,000	7,993.23 3,117,362,625	7,958.02 3,103,629,750	6.25 2011/6/15	5.16
国際機関	特殊 債券	EIB 8.75% 17/08/25	15,000,000	19,972.95 2,995,943,580	20,113.37 3,017,006,685	8.75 2017/8/25	5.01
フランス	国債 証券	FRTR 8.5% 19/10/25	14,600,000	18,976.90 2,770,628,714	18,939.76 2,765,205,982	8.5 2019/10/25	4.59
アメリカ	国債 証券	US T 9.875% 15/11/15	21,000,000	12,996.64 2,729,294,727	12,970.55 2,723,817,270	9.875 2015/11/15	4.53
オーストラリア	地方債 証券	NSWTC 6% 12/05/01	32,500,000	8,008.61 2,602,799,428	7,960.86 2,587,281,279	6 2012/5/1	4.30
ノルウェー	国債 証券	NORWAY GOV 5% 150515	157,000,000	1,628.74 2,557,124,940	1,635.66 2,567,990,910	5 2015/5/15	4.27
国際機関	特殊 債券	EUROFIMA 6.5% 11/08/22	30,500,000	8,036.27 2,451,063,875	8,003.41 2,441,040,050	6.5 2011/8/22	4.06
アメリカ	国債 証券	US T 11.25% 15/02/15	18,300,000	13,367.60 2,446,271,085	13,334.99 2,440,304,578	11.25 2015/2/15	4.05
フランス	国債 証券	FRTR 8.5% 12/12/26	14,900,000	15,981.67 2,381,269,128	15,956.46 2,377,513,806	8.5 2012/12/26	3.95
国際機関	特殊 債券	EIB 7.75% 10/10/26	30,000,000	6,641.38 1,992,415,320	6,634.39 1,990,317,840	7.75 2010/10/26	3.31
国際機関	特殊 債券	EIB 7% 12/01/24	20,000,000	8,161.47 1,632,295,000	8,116.09 1,623,218,000	7 2012/1/24	2.70
ノルウェー	国債 証券	NORWAY GOV 4.25% 170519	103,000,000	1,552.45 1,599,030,916	1,566.36 1,613,351,541	4.25 2017/5/19	2.68
アメリカ	国債 証券	US T 8.75% 20/08/15	11,490,000	13,351.66 1,534,105,948	13,383.54 1,537,768,889	8.75 2020/8/15	2.55
カナダ	国債 証券	CAN 9.5% 10/06/01	16,940,000	9,070.06 1,536,468,360	9,050.82 1,533,209,785	9.5 2010/6/1	2.55
ドイツ	国債 証券	DBR 6% 16/06/20	8,670,000	15,785.35 1,368,589,845	15,697.80 1,360,999,346	6 2016/6/20	2.26

カナダ	国債 証券	CAN 9% 25/06/01	8,970,000	13,409.68 1,202,848,412	13,413.66 1,203,205,667	9 2025/6/1	2.00
カナダ	国債 証券	CAN 8% 23/06/01	8,700,000	12,202.56 1,061,622,720	12,198.74 1,061,290,962	8 2023/6/1	1.76
オーストラリア	地方債 証券	QTC 6% 11/06/14	12,700,000	7,997.15 1,015,638,050	7,958.80 1,010,768,552	6 2011/6/14	1.68
イギリス	国債 証券	UKT 8.75% 17/08/25	4,630,000	20,919.66 968,580,466	20,931.29 969,118,760	8.75 2017/8/25	1.61
カナダ	国債 証券	CAN 8% 27/06/01	7,600,000	12,721.42 966,828,149	12,718.96 966,641,382	8 2027/6/1	1.61
フランス	国債 証券	FRTR 6.5% 11/04/25	6,300,000	14,401.81 907,314,061	14,395.17 906,896,214	6.5 2011/4/25	1.51
イギリス	国債 証券	UKT 8% 21/06/07	3,900,000	21,153.69 824,994,261	21,398.75 834,551,475	8 2021/6/7	1.39
イギリス	国債 証券	UKT 9% 11/07/12	4,640,000	17,258.15 800,778,484	17,362.03 805,598,568	9 2011/7/12	1.34
カナダ	国債 証券	CAN 6% 11/06/01	7,200,000	9,209.03 663,050,502	9,192.93 661,891,259	6 2011/6/1	1.10
オーストラリア	地方債 証券	QTC 6% 13/08/14	7,900,000	7,995.95 631,680,269	7,935.48 626,903,012	6 2013/8/14	1.04
ドイツ	国債 証券	DBR 6.5% 27/07/04	3,500,000	17,578.77 615,257,230	17,511.12 612,889,427	6.5 2027/7/4	1.02
アメリカ	国債 証券	US T 8.125% 19/08/15	4,600,000	12,764.79 587,180,411	12,766.24 587,247,068	8.125 2019/8/15	0.98

ロ 種類別の投資比率

平成21年8月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	62.32
地方債証券	12.22
特殊債券	21.10
合計	95.64

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

平成21年8月31日現在

種類	取引所等および 資産の名称	買建／ 売建	数量 (枚)	簿価（円）	時価（円）	投資 比率 (%)
為替予約取引	市場外取引 米ドル	売建	1,719,000	159,463,035	159,402,870	0.26
為替予約取引	市場外取引 オーストラリアドル	売建	237,000	18,490,740	18,540,510	0.03

(注)

1. 基準日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。
 - (1) 基準日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という）の対顧客先物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顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
 - (2) 基準日において当該日の対顧客先物売買相場が発表されていない場合は、以下の計算方法によっております。
 - ①基準日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後の二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ②基準日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 基準日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、基準日の対顧客直物売買相場の仲値で評価しております。

〔アライアンス・バーンスタイン・エマージング市場債券ファンドB（適格機関投資家専用）〕

投資有価証券の主要銘柄

主要投資銘柄

平成21年 8月31日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価／金額 （円）	評価額 単価／金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託 受益証券	アライアンス・バーンスタイン・新興国債 券マザーファンド	20,483,304,789	1.1293 23,131,796,099	1.1088 22,711,888,350	100.05

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「アライアンス・バーンスタイン・エマージング市場債券ファンドB（適格機関投資家専用）」は「アライアンス・バーンスタイン・新興国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、「アライアンス・バーンスタイン・新興国債券マザーファンド」の投資有価証券の上位30銘柄は以下の通りです。

＜アライアンス・バーンスタイン・新興国債券マザーファンド 平成21年 8月31日現在の上位30銘柄＞

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価／金額 （円）	評価額 単価／金額 （円）	利率／ 償還期限	投資 比率 （％）
ロシア	国債 証券	RUSSIAN FEDERATION	39,435,311.04	8,569.74 3,379,505,894	9,598.58 3,785,233,821	7.5 2030/3/31	5.50
トルコ	国債 証券	REPUBLIC OF TURKEY	22,537,000	8,624.81 1,943,775,683	9,760.88 2,199,810,652	7.375 2025/2/5	3.19
アルゼンチン	国債 証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	36,467,000	3,868.20 1,410,620,031	5,573.93 2,032,645,709	7 2015/10/3	2.95
ブラジル	国債 証券	REPUBLIC OF BRAZIL	16,751,000	10,804.20 1,809,813,217	11,546.12 1,934,092,236	8.875 2024/4/15	2.81
ブラジル	国債 証券	REPUBLIC OF BRAZIL	15,531,000	10,654.89 1,654,812,301	11,592.50 1,800,431,175	8.875 2019/10/14	2.61
ルクセンブルク	社債券	RUSSIA AGRICULTURE BANK	18,763,000	6,859.05 1,286,963,626	8,949.40 1,679,177,798	7.75 2018/5/29	2.44
メキシコ	国債 証券	UNITED MEXICAN STATES	14,822,000	10,572.35 1,567,035,199	10,896.95 1,615,145,929	8 2022/9/24	2.34

メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	15,864,000	8,791.75 1,394,723,537	9,389.92 1,489,617,702	5.625 2017/1/15	2.16
ブラジル	国債証券	REPUBLIC OF BRAZIL	27,097,000	5,084.99 1,377,880,528	5,433.11 1,472,212,526	12.5 2016/1/5	2.14
トルコ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT	19,863,006	6,133.51 1,218,300,354	6,963.17 1,383,096,860	16 2012/3/7	2.01
ルクセンブルク	社債券	GAZPROM	17,383,000	6,614.21 1,149,749,306	7,593.08 1,319,906,400	6.51 2022/3/7	1.91
ブラジル	国債証券	REPUBLIC OF BRAZIL	12,453,000	8,878.00 1,105,577,364	9,691.32 1,206,861,324	6 2017/1/17	1.75
ベネズエラ	国債証券	REPUBLIC OF VENEZUELA	18,591,000	4,638.85 862,409,495	6,306.31 1,172,407,951	9.25 2028/5/7	1.70
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	11,700,000	8,369.78 979,264,845	9,633.36 1,127,103,997	7 2020/6/5	1.63
インドネシア	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	11,453,000	7,817.05 895,287,263	9,552.21 1,094,015,756	6.875 2018/1/17	1.59
ウクライナ	国債証券	UKRAINE GOVERNMENT	11,414,000	7,020.50 801,320,549	8,532.07 973,851,611	7.65 2013/6/11	1.41
パナマ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	7,763,000	11,314.27 878,327,556	11,870.71 921,523,993	9.375 2029/4/1	1.34
インドネシア	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	10,400,000	6,974.97 725,397,441	8,555.26 889,747,560	6.625 2037/2/17	1.29
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	9,063,000	8,502.40 770,572,802	9,774.79 885,889,761	7.375 2037/9/18	1.28
カザフスタン	社債券	KAZMUNAIGAZ FINANCE SUB	9,792,000	8,068.37 790,055,769	9,018.96 883,137,052	8.375 2013/7/2	1.28
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT	8,775,000	9,301.23 816,183,423	9,946.27 872,785,390	6.375 2019/7/15	1.26
フィリピン	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	6,490,000	11,917.09 773,419,141	12,566.27 815,550,923	10.625 2025/3/16	1.18
フィリピン	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	6,860,000	11,128.80 763,435,680	11,499.76 788,883,536	9.5 2024/10/21	1.14

トルコ	国債 証券	REPUBLIC OF TURKEY	7,455,000	8,810.30 656,807,865	10,120.25 754,464,823	8 2034/2/14	1.09
南アフリカ	国債 証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,880,000	8,624.34 679,598,720	9,204.44 725,310,266	5.875 2022/5/30	1.05
ブラジル	国債 証券	REPUBLIC OF BRAZIL	6,300,000	9,394.56 591,857,406	11,476.57 723,024,225	8.25 2034/1/20	1.05
インドネシア	国債 証券	REPUBLIC OF INDONESIA	7,150,000	8,731.47 624,300,176	9,958.42 712,027,115	7.25 2015/4/20	1.03
コロンビア	国債 証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	13,093,000,000	4.84 633,703,137	5.34 699,690,024	12 2015/10/22	1.01
ハンガリー	国債 証券	HUNGARY GOVERNMENT	1,558,180,000	40.96 638,358,861	44.43 692,431,966	5.5 2014/2/12	1.00
ブラジル	国債 証券	REPUBLIC OF BRAZIL	15,049,000	4,580.82 689,368,752	4,573.84 688,318,428	10 2014/1/1	1.00

〔グローバル好利回り株式マザーファンド〕

（１）投資状況

平成21年 8 月31日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	1,642,716,000	2.75
	アメリカ	17,246,731,932	28.88
	カナダ	3,171,536,015	5.31
	ドイツ	2,439,079,324	4.08
	イタリア	2,525,260,152	4.23
	フランス	4,618,963,201	7.73
	オーストラリア	7,489,226,213	12.54
	イギリス	6,694,974,658	11.21
	スイス	1,354,401,405	2.27
	香港	3,242,071,651	5.43
	シンガポール	1,219,911,820	2.04
	ニュージーランド	443,432,568	0.74
	オランダ	1,930,422,486	3.23
	スペイン	750,036,262	1.26
	ノルウェー	1,287,306,000	2.16
	ルクセンブルク	1,285,328,093	2.15
	キプロス	217,865,451	0.36
	ケイマン諸島	60,218,600	0.10
	マーシャル諸島	556,383,836	0.93
	小 計	58,175,865,667	97.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,542,721,058	2.58
合計(純資産総額)		59,718,586,725	100.00

（２）投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成21年8月31日現在

国／ 地域	種類	銘柄名／業種	数量 (株)	帳簿価額 単価／金額 (円)	評価額 単価／金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	INTEL CORP 〔半導体・半導体製造装置〕	840,000	1,743.51 1,464,550,080	1,877.98 1,577,507,400	2.64
香港	株式	HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS 〔公益事業〕	2,819,000	510.09 1,437,954,986	525.04 1,480,099,036	2.48
イタリア	株式	ENEL SPA 〔公益事業〕	2,606,300	525.40 1,369,350,332	548.45 1,429,430,543	2.39
カナダ	株式	ENBRIDGE INC 〔エネルギー〕	406,000	3,501.45 1,421,591,460	3,459.08 1,404,389,240	2.35
オランダ	株式	KONINKLIJKE KPN NV 〔電気通信サービス〕	961,100	1,374.25 1,320,795,519	1,441.24 1,385,177,926	2.32
スイス	株式	SWISSCOM AG-REG 〔電気通信サービス〕	42,000	30,802.74 1,293,715,395	32,247.65 1,354,401,405	2.27
アメリカ	株式	SOUTHERN COPPER CORPORATION 〔素材〕	473,800	2,527.16 1,197,370,777	2,732.12 1,294,478,645	2.17
ノルウェー	株式	STATOILHYDRO ASA 〔エネルギー〕	620,000	2,006.78 1,244,205,088	2,076.30 1,287,306,000	2.16
アメリカ	株式	NSTAR 〔公益事業〕	414,000	2,969.53 1,229,387,407	2,977.88 1,232,842,899	2.06
ドイツ	株式	E.ON AG 〔公益事業〕	303,000	3,682.36 1,115,756,292	3,960.92 1,200,161,487	2.01
オーストラリア	株式	TELSTRA CORPORATION LIMITED 〔電気通信サービス〕	4,430,000	285.61 1,265,263,375	263.70 1,168,202,075	1.96
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD 〔素材〕	380,000	2,872.55 1,091,571,850	2,961.76 1,125,469,750	1.88
ルクセンブルク	株式	ARCELOR MITTAL 〔素材〕	330,000	3,256.55 1,074,663,975	3,409.10 1,125,004,650	1.88
香港	株式	CLP HOLDINGS LTD 〔公益事業〕	1,777,500	622.51 1,106,525,745	626.10 1,112,903,415	1.86

イタリア	株式	ENI SPA 〔エネルギー〕	500,000	2,113.28 1,056,641,482	2,191.65 1,095,829,609	1.83
イギリス	株式	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC 〔食品・飲料・タバコ〕	419,000	2,563.81 1,074,236,473	2,612.12 1,094,481,213	1.83
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORPORATION 〔消費者サービス〕	205,000	5,160.98 1,058,001,105	5,199.93 1,065,986,019	1.79
アメリカ	株式	AT&T INC 〔電気通信サービス〕	434,082	2,353.74 1,021,716,687	2,430.71 1,055,129,802	1.77
アメリカ	株式	NORTHEAST UTILITIES 〔公益事業〕	469,000	2,202.57 1,033,007,675	2,228.54 1,045,186,291	1.75
シンガポール	株式	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS 〔電気通信サービス〕	4,880,000	202.18 986,660,848	208.62 1,018,083,168	1.70
オーストラリア	株式	BLUESCOPE STEEL LTD 〔素材〕	4,422,400	241.79 1,069,303,152	229.27 1,013,934,704	1.70
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	440,000	2,192.37 964,644,384	2,288.82 1,007,082,208	1.69
アメリカ	株式	UNITED TECHNOLOGIES CORP 〔資本財〕	180,000	5,193.44 934,819,200	5,531.01 995,582,448	1.67
アメリカ	株式	ALTRIA GROUP INC 〔食品・飲料・タバコ〕	578,820	1,637.78 947,984,681	1,689.72 978,045,351	1.64
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC. 〔食品・飲料・タバコ〕	223,820	4,246.56 950,466,088	4,206.68 941,540,550	1.58
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION 〔エネルギー〕	136,000	6,321.15 859,677,542	6,554.86 891,461,395	1.49
アメリカ	株式	TRAVELERS COS INC(THE) 〔保険〕	190,000	4,447.81 845,083,976	4,600.83 874,157,966	1.46
イギリス	株式	UNITED UTILITIES GROUP PLC 〔公益事業〕	1,266,500	660.58 836,626,153	683.68 865,884,164	1.45
ドイツ	株式	RWE AG 〔公益事業〕	100,000	7,993.48 799,348,900	8,607.65 860,765,850	1.44
フランス	株式	GDF SUEZ 〔公益事業〕	215,000	3,706.24 796,841,815	3,925.11 843,899,402	1.41

ロ 種類別・業種別の投資比率

平成21年 8月31日現在

種類	業種	投資 比率 (%)	種類	業種	投資 比率 (%)
株式（国内）	鉄鋼	0.50	株式（外国）	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.94
	電気・ガス業	0.61		銀行	7.76
	海運業	0.50		各種金融	2.22
	情報・通信業	0.60		保険	6.58
	小売業	0.54		不動産	0.69
株式（外国）	エネルギー	11.90		ソフトウェア・サービス	1.69
	素材	9.69		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	0.10
	資本財	4.10		電気通信サービス	13.32
	運輸	0.93		公益事業	19.64
	消費者サービス	1.79		半導体・半導体製造装置	3.52
	メディア	1.59	合計		97.42
	食品・飲料・タバコ	8.21			

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

〔中小型株マザーファンド〕

（１）投資状況

平成21年 8月31日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	618,115,900	91.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		53,823,971	8.01
合計(純資産総額)		671,939,871	100.00

（２）投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成21年 8月31日現在

国／ 地域	種類	銘柄名／業種	数量 (株)	帳簿価額 単価／金額 (円)	評価額 単価／金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	ティーガイア 〔情報・通信業〕	94	105,600.00 9,926,400	164,000.00 15,416,000	2.29
日本	株式	ビジョン 〔その他製品〕	3,300	2,337.30 7,713,090	3,850.00 12,705,000	1.89
日本	株式	第一精工 〔電気機器〕	3,000	1,571.53 4,714,590	4,190.00 12,570,000	1.87
日本	株式	クリエイトSDホールディングス 〔小売業〕	5,300	1,597.00 8,464,100	2,340.00 12,402,000	1.85
日本	株式	リンテック 〔その他製品〕	6,200	1,237.00 7,669,400	1,951.00 12,096,200	1.80
日本	株式	トランコム 〔倉庫・運輸関連業〕	6,800	968.79 6,587,772	1,777.00 12,083,600	1.80
日本	株式	ぐるなび 〔サービス業〕	53	192,943.62 10,226,011	223,300.00 11,834,900	1.76
日本	株式	セリア 〔小売業〕	108	67,000.00 7,236,000	109,000.00 11,772,000	1.75

日本	株式	メッセージ 〔サービス業〕	68	122,968.19 8,361,836	171,600.00 11,668,800	1.74
日本	株式	ケーズホールディングス 〔小売業〕	4,000	1,613.00 6,452,000	2,855.00 11,420,000	1.70
日本	株式	ユーシン精機 〔機械〕	7,300	1,457.43 10,639,255	1,558.00 11,373,400	1.69
日本	株式	オイレス工業 〔機械〕	7,100	1,227.70 8,716,706	1,533.00 10,884,300	1.62
日本	株式	アインファーマシーズ 〔小売業〕	3,800	1,445.00 5,491,000	2,805.00 10,659,000	1.59
日本	株式	日本M&Aセンター 〔サービス業〕	27	353,191.22 9,536,163	394,000.00 10,638,000	1.58
日本	株式	イリソ電子工業 〔電気機器〕	7,400	555.00 4,107,000	1,420.00 10,508,000	1.56
日本	株式	トラスコ中山 〔卸売業〕	6,600	1,417.50 9,355,503	1,561.00 10,302,600	1.53
日本	株式	ヒラノテクシード 〔機械〕	9,000	815.00 7,335,000	1,138.00 10,242,000	1.52
日本	株式	ニフコ 〔化学〕	6,100	1,144.00 6,978,400	1,658.00 10,113,800	1.51
日本	株式	マニー 〔精密機器〕	1,600	5,250.00 8,400,000	6,300.00 10,080,000	1.50
日本	株式	アルファシステムズ 〔情報・通信業〕	4,900	1,683.28 8,248,113	2,040.00 9,996,000	1.49
日本	株式	大黒天物産 〔小売業〕	5,400	1,586.34 8,566,236	1,849.00 9,984,600	1.49
日本	株式	ハイデイ日高 〔小売業〕	8,900	933.00 8,303,700	1,112.00 9,896,800	1.47
日本	株式	プロトコーポレーション 〔情報・通信業〕	3,700	2,080.00 7,696,000	2,630.00 9,731,000	1.45
日本	株式	新晃工業 〔機械〕	28,000	218.00 6,104,000	346.00 9,688,000	1.44

日本	株式	プレステージ・インターナショナル 〔サービス業〕	61	126,100.00 7,692,100	158,100.00 9,644,100	1.44
日本	株式	イーピーエス 〔サービス業〕	25	355,871.52 8,896,788	383,000.00 9,575,000	1.42
日本	株式	あさひ 〔小売業〕	2,800	1,782.62 4,991,362	3,350.00 9,380,000	1.40
日本	株式	ヴィレッジヴァンガードコーポレーション 〔小売業〕	27	249,136.95 6,726,697	338,000.00 9,126,000	1.36
日本	株式	東海カーボン 〔ガラス・土石製品〕	19,000	450.73 8,563,981	478.00 9,082,000	1.35
日本	株式	アコーディア・ゴルフ 〔サービス業〕	96	54,000.00 5,184,000	92,500.00 8,880,000	1.32

ロ 種類別・業種別の投資比率

平成21年8月31日現在

種類	業種	投資 比率 (%)	種類	業種	投資 比率 (%)
株式（国内）	建設業	0.58	株式（国内）	精密機器	2.75
	食料品	0.96		その他製品	4.19
	化学	3.17		倉庫・運輸関連業	2.66
	ガラス・土石製品	2.24		情報・通信業	12.84
	鉄鋼	1.30		卸売業	6.30
	非鉄金属	0.50		小売業	17.94
	金属製品	0.92		不動産業	0.40
	機械	8.33		サービス業	17.82
	電気機器	7.69		合計	91.99
	輸送用機器	1.39			

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

〔アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド（適格機関投資家専用）〕

投資有価証券の主要銘柄

主要投資銘柄

平成21年8月31日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価／金額 （円）	評価額 単価／金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託 受益証券	A Bエマージング・グロース 株式マザーファンド	4,111,344,105	0.9625 3,957,168,702	1.0510 4,321,022,654	100.23

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド（適格機関投資家専用）」は「A Bエマージング・グロース株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、「A Bエマージング・グロース株式マザーファンド」の投資有価証券の上位30銘柄は以下の通りです。

＜A Bエマージング・グロース株式マザーファンド 平成21年8月31日現在の上位30銘柄＞

国／ 地域	種類	銘柄名／業種	数量 （株）	帳簿価額 単価／金額 （円）	評価額 単価／金額 （円）	投資 比率 （％）
ブラジル	株式	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR 〔エネルギー〕	86,600	1,853.87 160,545,367	3,194.89 276,677,733	4.48
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 〔半導体・半導体製造装置〕	4,241	38,349.17 162,638,842	56,918.00 241,389,238	3.91
ブラジル	株式	ITAUSA INVESTIMENTOS ITAU PR 〔銀行〕	378,247	388.28 146,868,992	485.40 183,604,119	2.97
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-ADR SERIES L 〔電気通信サービス〕	37,600	3,023.32 113,676,982	4,338.37 163,122,982	2.64
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H 〔銀行〕	2,583,000	54.67 141,234,885	62.79 162,186,570	2.62
ブラジル	株式	VALE SA-SP PREF ADR 〔素材〕	97,800	985.82 96,413,802	1,656.33 161,989,699	2.62

イスラエル	株式	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR [医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス]	31,500	4,045.45 127,431,760	4,803.93 151,323,858	2.45
香港	株式	CHINA MOBILE LTD [電気通信サービス]	156,500	954.76 149,421,036	932.28 145,902,133	2.36
韓国	株式	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD [銀行]	46,404	2,459.33 114,122,936	3,110.37 144,333,841	2.33
香港	株式	CNOOC LTD [エネルギー]	1,054,000	86.98 91,684,220	124.14 130,848,619	2.12
韓国	株式	POSCO [素材]	3,238	30,912.51 100,094,711	35,126.74 113,740,416	1.84
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD [電気通信サービス]	70,833	1,186.24 84,024,972	1,573.43 111,451,475	1.80
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY [テクノロジー・ハードウェアおよび機器]	355,300	214.33 76,152,244	313.02 111,216,006	1.80
韓国	株式	GS ENGINEERING & CONSTRUCT [資本財]	14,313	5,991.51 85,756,565	7,181.79 102,793,103	1.66
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H [銀行]	1,467,000	60.29 88,457,856	69.72 102,289,215	1.65
ブラジル	株式	ELETROPAULO METROPOLITANA-PREF B [公益事業]	57,434	1,266.98 72,768,234	1,766.68 101,467,958	1.64
トルコ	株式	TURKIYE GARANTI BANKASI [銀行]	265,816	161.06 42,814,983	356.21 94,686,981	1.53
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H [保険]	227,000	291.65 66,205,462	397.67 90,271,090	1.46
ブラジル	株式	USINAS SIDERURGICAS DE MINAS [素材]	39,700	1,394.13 55,347,008	2,272.30 90,210,341	1.46
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING [半導体・半導体製造装置]	531,664	127.97 68,037,892	167.78 89,207,902	1.44
ロシア	株式	OA O GAZPROM-SPON ADR REG S [エネルギー]	43,047	1,373.47 59,124,167	1,966.08 84,634,190	1.37
ロシア	株式	LUKOIL-SPON ADR [エネルギー]	17,564	3,168.92 55,659,012	4,701.91 82,584,487	1.33

インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE 〔銀行〕	16,353	3,136.10 51,284,774	4,871.63 79,665,781	1.29
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD 〔ソフトウェア・サービス〕	56,600	621.80 35,193,902	1,380.18 78,118,414	1.26
台湾	株式	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO 〔各種金融〕	1,313,000	51.35 67,431,930	59.07 77,570,727	1.25
インド	株式	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD 〔ソフトウェア・サービス〕	17,039	2,339.54 39,863,536	4,249.86 72,413,381	1.17
チリ	株式	ENERSIS S.A. -SPONS ADR 〔公益事業〕	43,500	1,246.42 54,219,513	1,653.55 71,929,607	1.16
韓国	株式	LG ELECTRONICS INC 〔耐久消費財・アパレル〕	6,640	6,604.07 43,851,043	10,765.25 71,481,260	1.15
インド	株式	BHARAT HEAVY ELECTRICALS 〔資本財〕	15,075	2,853.27 43,013,177	4,520.49 68,146,401	1.10
タイ	株式	SIAM COMMERCIAL BANK-FOR REG 〔銀行〕	324,700	151.17 49,087,840	208.76 67,784,372	1.09

〔グローバル・リート・マザーファンド〕

（１）投資状況

平成21年 8 月31日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	8,240,160,000	6.35
	アメリカ	48,490,730,030	37.39
	カナダ	6,454,294,778	4.98
	フランス	13,565,835,470	10.46
	オーストラリア	23,902,072,144	18.43
	イギリス	14,470,787,605	11.16
	シンガポール	6,109,287,445	4.71
	オランダ	2,088,504,342	1.61
	ベルギー	289,864,397	0.22
	小 計	123,611,536,211	95.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,088,618,269	4.69
合計(純資産総額)		129,700,154,480	100.00

（２）投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成21年 8 月31日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価／金額 (円)	評価額 単価／金額 (円)	投資 比率 (%)
オーストラリア	投資 証券	WESTFIELD GROUP	11,802,042	943.69 11,137,528,025	978.12 11,543,872,331	8.90
フランス	投資 証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	500,000	18,199.58 9,099,790,000	18,318.96 9,159,482,500	7.06
アメリカ	投資 証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	1,129,365	5,795.32 6,545,034,508	6,006.76 6,783,835,575	5.23

イギリス	投資 証券	SEGRO PLC	9,437,441	516.38 4,873,360,520	542.96 5,124,153,341	3.95
オーストラリア	投資 証券	STOCKLAND	13,897,767	263.70 3,664,875,902	302.04 4,197,751,033	3.24
イギリス	投資 証券	BRITISH LAND CO PLC	5,691,739	762.79 4,341,615,365	732.30 4,168,069,007	3.21
アメリカ	投資 証券	BOSTON PROPERTIES INC	692,596	5,413.37 3,749,282,838	5,668.26 3,925,820,297	3.03
カナダ	投資 証券	CANADIAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,762,744	2,025.28 3,570,060,744	2,076.12 3,659,685,700	2.82
イギリス	投資 証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	3,551,938	952.74 3,384,097,918	932.36 3,311,696,457	2.55
オーストラリア	投資 証券	MIRVAC GROUP	26,496,522	100.94 2,674,625,171	110.72 2,933,794,277	2.26
アメリカ	投資 証券	EQUITY RESIDENTIAL	1,038,876	2,526.23 2,624,447,612	2,578.17 2,678,401,014	2.07
アメリカ	投資 証券	VENTAS INS	691,428	3,556.57 2,459,118,304	3,676.21 2,541,837,017	1.96
フランス	投資 証券	ICADE	283,000	8,631.85 2,442,816,075	8,688.57 2,458,866,725	1.90
アメリカ	投資 証券	KIMCO REALTY CORPORATION	1,988,577	1,059.90 2,107,697,080	1,176.87 2,340,297,807	1.80
アメリカ	投資 証券	HCP,INC.	849,775	2,638.56 2,242,190,125	2,707.08 2,300,409,416	1.77
アメリカ	投資 証券	VORNADO REALTY TRUST	429,778	5,290.85 2,273,894,071	5,348.31 2,298,588,467	1.77
アメリカ	投資 証券	DOUGLAS EMMETT INC	1,955,951	1,076.71 2,106,010,726	1,135.13 2,220,273,523	1.71
アメリカ	投資 証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	366,665	6,023.87 2,208,742,783	6,040.15 2,214,713,873	1.71
カナダ	投資 証券	BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	673,405	2,923.52 1,968,719,719	3,149.78 2,121,081,506	1.64

アメリカ	投資証券	EASTGROUP PROPERTIES INC	581,386	3,367.64 1,957,903,910	3,532.46 2,053,726,626	1.58
日本	投資証券	野村不動産オフィスファンド投資法人	3,155	606,000 1,911,930,000	645,000 2,034,975,000	1.57
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	2,429	835,000 2,028,215,000	820,000 1,991,780,000	1.54
フランス	投資証券	SOCIETE DE LA TOUR EIFFEL	303,084	5,410.79 1,639,924,937	6,425.56 1,947,486,245	1.50
シンガポール	投資証券	SUNTEC REIT	29,181,000	65.03 1,897,754,235	65.67 1,916,543,881	1.48
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,508	758,000 1,901,064,000	758,000 1,901,064,000	1.47
イギリス	投資証券	HAMMERSON PLC	3,053,640	609.99 1,862,719,178	611.35 1,866,868,800	1.44
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	299,960	5,585.73 1,675,495,630	5,813.87 1,743,928,625	1.34
アメリカ	投資証券	NATIONWIDE HEALTH PROPERTIES INC	581,792	2,868.44 1,668,840,215	2,965.82 1,725,493,374	1.33
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	503,152	3,290.46 1,655,604,696	3,425.81 1,723,705,970	1.33
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	257,662	6,610.72 1,703,331,889	6,627.20 1,707,577,709	1.32

ロ 種類別の投資比率

平成21年8月31日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	95.31
合計	95.31

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

第二部【ファンドの詳細情報】

第1【ファンドの沿革】

平成18年12月20日 信託契約締結、設定、運用開始。

平成19年4月20日 投資対象とするマザーファンドの一部の入替えを実施（「中小型株・オープン・マザーファンド」から「中小型株マザーファンド」に変更）。

第2【手続等】

1【申込（販売）手続等】

イ 申込方法

（イ）ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。お申込みの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

（ロ）原則として午後3時まで（わが国の取引所の半日立会日の場合は午前11時まで）に取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。

なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受け付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

（ハ）当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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かかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリングオフ制度の適用はありません。

（ニ）申込不可日

上記にかかわらず、取得申込日がニューヨークの取引所または銀行の休業日に当たる場合には、当ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

ハ 申込手数料

原則として、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に、3.15%（税抜き3.0%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

※累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

※申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

申込手数料、申込単位の詳細についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号※	インターネット・ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

※お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求（一部解約の実行請求）により換金することができます。

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、ニューヨークの取引所または銀行の休業日に当たる場合には、解約請求の受付けは行いません。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時まで（わが国の取引所の半日立会日の場合は午前11時まで）に解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。

解約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かかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従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。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（0.3%）を差し引いた価額となります。

一部解約価額は、委託会社の営業日において日々算出されますので、委託会社（電話：0120-88-2976）にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせします。

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、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一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

第3【管理及び運営】

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

なお、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計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとし、予約為替の評価は、原則として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るものとします。

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「世界一周」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号※	インターネット・ ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

※お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

(2)【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3)【信託期間】

平成18年12月20日から下記「（5）その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4)【計算期間】

毎年1月10日から3月9日、3月10日から5月9日、5月10日から7月9日、7月10日から9月9日、9月10日から11月9日および11月10日から翌年1月9日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）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するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が10億口を下回ることとなるとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、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会社は、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。
- 委託会社は、上記a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当ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドの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。
- 上記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会社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。
- 上記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2分の1を超えると

きは、信託契約の解約をしません。

e. 委託会社は、当ファンドの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。

f. 上記c～eまでの取扱いは、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、上記c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。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社は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、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。

b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。

c. 委託会社が新受託会社を選任できないとき、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

a. 分配金額は、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。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わないことがあります。

b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の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（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため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、）に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、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

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の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かか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、）に支払われます。

ハ 信託約款の変更

(イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの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内容を監督官庁に届け出ます。

(ロ) 委託会社は、上記（イ）の変更事項のうち、その内容が重大なものについては、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当ファンドの知られたる受益者に交付します。ただし、当ファンドの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。

(ハ) 上記（ロ）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会社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。

(ニ) 上記（ハ）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2分の1を超える

ときは、（イ）の信託約款の変更をしません。

- （ホ）委託会社は、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、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。

ニ 反対者の買取請求権

当ファンドの信託契約の解約または重大な信託約款の変更が行われる場合において、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間内に委託会社に異議を述べた受益者は、自己に帰属する受益権を、受託会社に信託財産をもって買い取るよう請求をすることができます。

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの）は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからでも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。

ト 公告

委託会社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。

チ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は6ヵ月（原則として1月、7月の各決算時までの期間）毎に、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、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」を作成します。

運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。

2 【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

受益者は、委託会社の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、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の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（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため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、）に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、累積投資契約に基づき、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、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。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

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、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の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かか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い前のため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、）に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ハ 一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第2 手続等 2 換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

ニ 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または重大な信託約款の変更を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に異議のある受益者は、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間中に異議を申し立てることができます。異議を申し立てた受益者の受益権の口数が、受益権の総口数の過半数となるときは、当該解約または信託約款変更は行われません。

当該解約または信託約款変更が行われる場合において、前述の異議を申し立てた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第4【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、特定5期（平成20年7月10日から平成21年1月9日まで）及び特定6期（平成21年1月10日から平成21年7月9日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【ニュー・グローバル・バランス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	特定５期 (平成21年１月９日現在)	特定６期 (平成21年７月９日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	147,434,616	208,587,228
投資信託受益証券	1,692,892,121	1,734,321,132
親投資信託受益証券	3,892,911,233	4,130,127,213
未収配当金	5,474,473	6,402,570
未収利息	605	457
流動資産合計	5,738,713,048	6,079,438,600
資産合計	5,738,713,048	6,079,438,600
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	51,151,940	50,747,677
未払解約金	2,005,637	—
未払受託者報酬	480,805	532,711
未払委託者報酬	11,548,931	12,795,707
その他未払費用	345,180	339,427
流動負債合計	65,532,493	64,415,522
負債合計	65,532,493	64,415,522
純資産の部		
元本等		
元本	10,230,398,187	10,150,613,021
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△4,557,217,632	△4,135,589,943
元本等合計	5,673,180,555	6,015,023,078
純資産合計	5,673,180,555	6,015,023,078
負債純資産合計	5,738,713,048	6,079,438,600

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	特定５期 自 平成20年 7 月10日 至 平成21年 1 月 9 日	特定６期 自 平成21年 1 月10日 至 平成21年 7 月 9 日
営業収益		
受取配当金	49,221,619	41,237,478
受取利息	546,090	58,361
有価証券売買等損益	△3,014,407,448	533,644,991
営業収益合計	△2,964,639,739	574,940,830
営業費用		
受託者報酬	1,916,906	1,512,798
委託者報酬	46,044,056	36,337,428
その他費用	1,045,180	1,028,854
営業費用合計	49,006,142	38,879,080
営業利益又は営業損失（△）	△3,013,645,881	536,061,750
経常利益又は経常損失（△）	△3,013,645,881	536,061,750
当期純利益又は当期純損失（△）	△3,013,645,881	536,061,750
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△50,341,929	△1,756,526
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△1,487,269,989	△4,557,217,632
剰余金増加額又は欠損金減少額	144,364,777	88,716,637
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	144,364,777	88,716,637
剰余金減少額又は欠損金増加額	32,770,831	52,535,816
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	32,770,831	52,535,816
分配金	218,237,637	152,371,408
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△4,557,217,632	△4,135,589,943

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	特定５期 自 平成20年 7 月10日 至 平成21年 1 月 9 日	特定６期 自 平成21年 1 月10日 至 平成21年 7 月 9 日
有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	(1)投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同 左 (2)親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同 左

（貸借対照表に関する注記）

項 目	特定５期 (平成21年 1 月 9 日現在)	特定６期 (平成21年 7 月 9 日現在)
１．受益権総数	当該特定期間の末日における受益権の総数 10,230,398,187口	当該特定期間の末日における受益権の総数 10,150,613,021口
２．元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の 6 第10号に規定する額 4,557,217,632円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の 6 第10号に規定する額 4,135,589,943円
３．１単位当たり純資産額	0.5545円 (1 万口＝5,545円)	0.5926円 (1 万口＝5,926円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	特定５期 自 平成20年７月10日 至 平成21年１月９日
1. 委託者報酬	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 1,577,889円
2. 分配金の計算過程	(自 平成20年７月10日 至 平成20年９月９日) 第11計算期間末における費用控除後の配当等収益(49,798,369円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(2,068,829円)、および分配準備積立金(265,404,305円)より、分配対象収益は317,271,503円(１万口当たり299.44円)であり、うち84,762,560円(１万口当たり80円)を分配金額としております。 (自 平成20年９月10日 至 平成20年11月10日) 第12計算期間末における費用控除後の配当等収益(42,941,963円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(1,744,528円)、および分配準備積立金(224,736,883円)より、分配対象収益は269,423,374円(１万口当たり261.81円)であり、うち82,323,716円(１万口当たり80円)を分配金額としております。 (自 平成20年11月11日 至 平成21年１月９日) 第13計算期間末における費用控除後の配当等収益(32,109,357円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(1,518,715円)、および分配準備積立金(184,675,848円)より、分配対象収益は218,303,920円(１万口当たり213.38円)であり、うち51,151,990円(１万口当たり50円)を分配金額としております。 なお、特定５期の分配金額と損益及び剰余金計算書上の分配金額との差額は、支払外国税調整額629円によるものです。

項 目	特定 6 期 自 平成21年 1 月10日 至 平成21年 7 月 9 日
1. 委託者報酬	委託者報酬に含まれる、信託財産の運用の指図にかかる権限の全部または一部を委託するために要する費用 1,321,322円
2. 分配金の計算過程	(自 平成21年 1 月10日 至 平成21年 3 月 9 日) 第14計算期間末における費用控除後の配当等収益(31,016,946円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(1,037,438円)、および分配準備積立金(165,153,974円)より、分配対象収益は197,208,358円(1 万口当たり194.07円)であり、うち50,807,760円(1 万口当たり50円)を分配金額としております。 (自 平成21年 3 月10日 至 平成21年 5 月11日) 第15計算期間末における費用控除後の配当等収益(59,795,392円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(802,939円)、および分配準備積立金(145,723,491円)より、分配対象収益は206,321,822円(1 万口当たり202.98円)であり、うち50,821,521円(1 万口当たり50円)を分配金額としております。 (自 平成21年 5 月12日 至 平成21年 7 月 9 日) 第16計算期間末における費用控除後の配当等収益(36,858,886円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(1,416,650円)、および分配準備積立金(153,969,928円)より、分配対象収益は192,245,464円(1 万口当たり189.39円)であり、うち50,753,065円(1 万口当たり50円)を分配金額としております。 なお、特定 6 期の分配金額と損益及び剰余金計算書上の分配金額との差額は、支払外国税調整額10,938円によるものです。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

特定 5 期 (自 平成20年 7 月10日 至 平成21年 1 月 9 日)

種 類	貸借対照表計上額	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	1,692,892,121円	△119,481,837円
親投資信託受益証券	3,892,911,233円	△194,348,956円
合 計	5,585,803,354円	△313,830,793円

特定 6 期 (自 平成21年 1 月10日 至 平成21年 7 月 9 日)

種 類	貸借対照表計上額	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	1,734,321,132円	△56,974,733円
親投資信託受益証券	4,130,127,213円	△135,266,793円
合 計	5,864,448,345円	△192,241,526円

（デリバティブ取引に関する注記）

I. 取引の状況に関する事項

項 目	特定５期 自 平成20年７月10日 至 平成21年１月９日	特定６期 自 平成21年１月10日 至 平成21年７月９日
１．取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 ①外国為替の売買の予約取引。	同 左
２．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては投資信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。	同 左
３．取引の利用目的	信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため。	同 左
４．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。	同 左
５．取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図る為に運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況に係る、投資信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等に係るチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。	同 左
６．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。	同 左

II. 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

特定５期(平成21年１月９日現在)

特定５期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

特定６期(平成21年７月９日現在)

特定６期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

特定５期（自 平成20年７月10日 至 平成21年１月９日）

該当事項はありません。

特定６期（自 平成21年１月10日 至 平成21年７月９日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

項 目	特定５期 (平成21年１月９日現在)	特定６期 (平成21年７月９日現在)
期首元本額	10,786,073,311円	10,230,398,187円
期中追加設定元本額	121,358,659円	121,933,668円
期中一部解約元本額	677,033,783円	201,718,834円

(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 別	銘柄名	元本額	評価額	
			単価	金額
親投資信託 受益証券	グローバル好利回り債券マザーファンド	2,144,396,161円	0.9780円	2,097,219,445円
投資信託 受益証券	アライアンス・バーンスタイン・エマージング市場債券ファン ドＢ（適格機関投資家専用）	1,185,661,114円	0.7498円	889,008,703円
親投資信託 受益証券	グローバル好利回り株式マザーファンド	1,095,975,314円	0.7677円	841,380,248円
親投資信託 受益証券	中小型株マザーファンド	1,099,872,432円	0.5658円	622,307,822円
投資信託 受益証券	アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファン ド（適格機関投資家専用）	1,145,409,796円	0.7380円	845,312,429円
親投資信託 受益証券	グローバル・リート・マザーファンド	788,829,959円	0.7216円	569,219,698円
合 計	—————	7,460,144,776円	———	5,864,448,345円

〔参考情報〕

当ファンドは、「グローバル好利回り債券マザーファンド」、「アライアンス・バーンスタイン・エマージング市場債券ファンドB（適格機関投資家専用）」、「グローバル好利回り株式マザーファンド」、「中小型株マザーファンド」、「アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド（適格機関投資家専用）」および「グローバル・リート・マザーファンド」（以下「同ファンド」という。）受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」および「投資信託受益証券」は、同ファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「グローバル好利回り債券マザーファンド」の状況

（１）貸借対照表

対象年月日	（平成21年１月９日現在）	（平成21年７月９日現在）
科 目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
I 流動資産		
預金	35,407,368	29,755,723
コール・ローン	1,275,135,318	590,242,428
国債証券	39,465,946,474	34,013,967,030
地方債証券	5,443,573,332	6,330,950,048
特殊債券	11,387,734,857	13,344,533,157
未収利息	1,081,354,041	884,175,531
前払費用	59,403,046	153,116,711
流動資産合計	58,748,554,436	55,346,740,628
資産合計	58,748,554,436	55,346,740,628
負債の部		
I 流動負債		
流動負債合計	—	—
負債合計	—	—
純資産の部		
I 元本等		
1 元本		
元本	65,281,616,809	56,588,882,162

元本合計	65,281,616,809	56,588,882,162
2 剰余金		
欠損金	6,533,062,373	1,242,141,534
剰余金合計	△6,533,062,373	△1,242,141,534
元本等合計	58,748,554,436	55,346,740,628
純資産合計	58,748,554,436	55,346,740,628
負債・純資産合計	58,748,554,436	55,346,740,628

（注）「グローバル好利回り債券マザーファンド」は、毎月20日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年1月9日並びに平成21年7月9日現在における同マザーファンドの状況です。

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	自 平成20年 7月10日 至 平成21年 1月 9日	自 平成21年 1月10日 至 平成21年 7月 9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券・地方債証券・特殊債券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額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。	国債証券・地方債証券・特殊債券（売買目的有価証券） 同 左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によっております。	為替予約取引 同 左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいて処理しております。	外貨建資産等の会計処理 同 左

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成21年 1月 9日現在）	（平成21年 7月 9日現在）
1. 受益権総数	平成21年 1月 9日現在における受益権の総数 65,281,616,809口	平成21年 7月 9日現在における受益権の総数 56,588,882,162口
2. 元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 6,533,062,373円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 1,242,141,534円
3. 1単位当たり純資産額	0.8999円 （1万口＝8,999円）	0.9780円 （1万口＝9,780円）

(デリバティブ取引に関する注記)

I. 取引の状況に関する事項

項 目	自 平成20年7月10日 至 平成21年1月9日	自 平成21年1月10日 至 平成21年7月9日
1. 取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 ① a. わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 b. わが国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 c. わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 ② 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」）。 ③ 金利先渡取引および為替先渡取引。 ④ 外国為替の売買の予約取引。	同 左
2. 取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては、投資信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。	同 左
3. 取引の利用目的	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。	同 左
4. 取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとして価格変動リスクがあります。	同 左
5. 取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図る為に運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況に係る、投資信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等に係るチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。	同 左
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。	同 左

II. 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年1月9日現在）

平成21年1月9日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成21年7月9日現在）

平成21年7月9日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成20年7月10日 至 平成21年1月9日）

該当事項はありません。

（自 平成21年1月10日 至 平成21年7月9日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成21年1月9日現在）	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	85,983,875,789円
同期中における追加設定元本額	－円
同期中における一部解約元本額	20,702,258,980円
平成21年1月9日現在における元本の内訳	
グローバル3資産ファンド	63,087,038,802円
ニュー・グローバル・バランス・ファンド	2,194,578,007円
合 計	65,281,616,809円

（平成21年7月9日現在）	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	65,281,616,809円
同期中における追加設定元本額	4,043,187,747円

同期中における一部解約元本額	12,735,922,394円
平成21年7月9日現在における元本の内訳	
グローバル3資産ファンド	54,444,486,001円
ニュー・グローバル・バランス・ファンド	2,144,396,161円
合 計	56,588,882,162円

(3) 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	評価額	備 考
国債証券	米ドル			
	US T11.25%15/02/15	18,300,000.00	26,769,468.75	
	US T7.5%16/11/15	800,000.00	1,036,625.00	
	US T8.125%19/08/15	5,600,000.00	7,805,875.00	
	US T8.75%20/08/15	6,490,000.00	9,471,343.75	
	US T9.875%15/11/15	10,500,000.00	14,928,046.87	
	米ドル 小計	41,690,000.00	60,011,359.37	
	(邦貨換算額)		(5,578,655,967)	(単位：円)
	カナダドル			
	CAN5.75%29/06/01	2,800,000.00	3,491,852.00	
	CAN6%11/06/01	5,200,000.00	5,668,104.00	
	CAN8%23/06/01	8,700,000.00	12,688,776.00	
	CAN8%27/06/01	6,600,000.00	10,020,384.00	
	CAN9%25/06/01	8,970,000.00	14,355,677.70	
	CAN9.5%10/06/01	16,940,000.00	18,298,757.40	
	カナダドル 小計	49,210,000.00	64,523,551.10	
	(邦貨換算額)		(5,157,367,439)	(単位：円)
	ユーロ			
	DBR5.25%11/01/04	2,860,000.00	3,039,322.00	
	DBR6%16/06/20	6,670,000.00	7,912,621.00	
	DBR6.5%27/07/04	3,500,000.00	4,521,650.00	
	FRTR6.5%11/04/25	6,300,000.00	6,883,380.00	
	FRTR8.5%12/12/26	14,900,000.00	18,061,780.00	
	FRTR8.5%19/10/25	14,600,000.00	20,591,840.00	
	ユーロ 小計	48,830,000.00	61,010,593.00	
	(邦貨換算額)		(7,875,247,344)	(単位：円)

	英ポンド			
	UKT6.0%281207	2,500,000.00	3,101,700.00	
	UKT8%13/09/27	600,000.00	726,780.00	
	UKT8%15/12/07	1,810,000.00	2,341,959.00	
	UKT8%21/06/07	3,900,000.00	5,483,400.00	
	UKT8.75%17/08/25	4,630,000.00	6,403,706.70	
	UKT9%11/07/12	6,640,000.00	7,637,195.20	
	英ポンド 小計	20,080,000.00	25,694,740.90	
	(邦貨換算額)		(3,841,877,659)	(単位：円)
	ノルウェークローネ			
	NORWAY GOV4.25%170519	103,000,000.00	106,254,800.00	
	NORWAY GOV5%150515	192,000,000.00	207,168,000.00	
	NORWAY GOV6%110516	229,170,000.00	246,266,082.00	
	NORWAY GOV6.5%130515	210,500,000.00	238,075,500.00	
	ノルウェークローネ 小計	734,670,000.00	797,764,382.00	
	(邦貨換算額)		(11,312,298,936)	(単位：円)
	ニュージーランドドル			
	NORWAY GOV6.5%130515	4,000,000.00	4,264,968.00	
	ニュージーランドドル 小計	4,000,000.00	4,264,968.00	
	(邦貨換算額)		(248,519,685)	(単位：円)
地方債証券	オーストラリアドル			
	NSWTC6%12/05/01	29,500,000.00	30,570,555.00	
	NSWTC7%10/12/01	33,800,000.00	35,368,320.00	
	QTC6%11/06/14	12,700,000.00	13,143,230.00	
	QTC6%13/08/14	7,900,000.00	8,289,549.00	
	オーストラリアドル 小計	83,900,000.00	87,371,654.00	
	(邦貨換算額)		(6,330,950,048)	(単位：円)
特殊債券	英ポンド			
	EIB8.75%17/08/25	15,000,000.00	19,627,500.00	
	英ポンド 小計	15,000,000.00	19,627,500.00	
	(邦貨換算額)		(2,934,703,800)	(単位：円)
	オーストラリアドル			

	ASIA6.25%11/06/15	39,000,000.00	40,267,500.00	
	EIB7%12/01/24	20,000,000.00	21,175,800.00	
	EUROFIMA6.5%11/08/22	48,500,000.00	50,328,450.00	
	オーストラリアドル 小計	107,500,000.00	111,771,750.00	
	(邦貨換算額)		(8,098,981,005)	(単位：円)
	ニュージーランドドル			
	EIB7%12/01/18	7,800,000.00	8,283,600.00	
	EIB7.75%10/10/26	30,000,000.00	31,374,000.00	
	ニュージーランドドル 小計	37,800,000.00	39,657,600.00	
	(邦貨換算額)		(2,310,848,352)	(単位：円)
	合 計		53,689,450,235	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(53,689,450,235)	(単位：円)

(注)

1. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書きであります。

2. 米ドル表示の債券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率10.1%、
合計に対する比率10.4%です。

カナダドル表示の債券については、6銘柄、信託財産純資産総額に対する比率9.3%、
合計に対する比率9.6%です。

ユーロ表示の債券については、6銘柄、信託財産純資産総額に対する比率14.2%、
合計に対する比率14.7%です。

英ポンド表示の債券については、7銘柄、信託財産純資産総額に対する比率12.2%、
合計に対する比率12.6%です。

ノルウェークローネ表示の債券については、4銘柄、信託財産純資産総額に対する比率20.4%、
合計に対する比率21.1%です。

オーストラリアドル表示の債券については、7銘柄、信託財産純資産総額に対する比率26.0%、
合計に対する比率26.9%です。

ニュージーランドドル表示の債券については、3銘柄、信託財産純資産総額に対する比率4.6%、
合計に対する比率4.8%です。

アライアンス・バーンスタイン・エマージング市場債券ファンドB（適格機関投資家専用）**（１）貸借対照表**

(単位：円)

	前期 (平成20年10月 7日現在)	当期 (平成21年 4月 7日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	24,081,866,423	24,176,077,709
未収入金	190,400,000	186,500,000
流動資産合計	24,272,266,423	24,362,577,709
資産合計	24,272,266,423	24,362,577,709
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	172,604,352	170,678,181
未払受託者報酬	1,100,395	939,442
未払委託者報酬	15,625,643	13,340,068
その他未払費用	99,393	89,738
流動負債合計	189,429,783	185,047,429
負債合計	189,429,783	185,047,429
純資産の部		
元本等		
元本	30,822,205,820	32,822,727,178
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△6,739,369,180	△8,645,196,898
（分配準備積立金）	368,578,167	311,392,821
元本等合計	24,082,836,640	24,177,530,280
純資産合計	24,082,836,640	24,177,530,280
負債純資産合計	24,272,266,423	24,362,577,709

（２）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	前期 （自 平成20年 4月 8日 至 平成20年10月 7日）	当期 （自 平成20年10月 8日 至 平成21年 4月 7日）
営業収益		
受取利息	2,213	373
有価証券売買等損益	△3,448,527,827	48,716,690
営業収益合計	△3,448,525,614	48,717,063
営業費用		
受託者報酬	6,989,585	5,439,374
委託者報酬	99,252,099	77,239,111
その他費用	629,951	535,790
営業費用合計	106,871,635	83,214,275
営業利益又は営業損失（△）	△3,555,397,249	△34,497,212
経常利益又は経常損失（△）	△3,555,397,249	△34,497,212
当期純利益又は当期純損失（△）	△3,555,397,249	△34,497,212
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（△）	1,707,794	△56,611,971
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△1,785,007,121	△6,739,369,180
剰余金増加額又は欠損金減少額	33,107,146	438,931,643
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	33,107,146	438,931,643
剰余金減少額又は欠損金増加額	393,505,721	1,340,360,630
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	393,505,721	1,340,360,630
分配金	1,036,858,441	1,026,513,490
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△6,739,369,180	△8,645,196,898

（３）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	前期 (自 平成20年 4月 8日 至 平成20年10月 7日)	当期 (自 平成20年10月 8日 至 平成21年 4月 7日)
1. 運用資産の評価基準及び評価方法	(1) 親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。	(1) 親投資信託受益証券 同左
2. 費用・収益の計上基準	(1) 有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。	(1) 有価証券売買等損益の計上基準 同左
3. その他	当ファンドの特定期間は、平成20年4月8日から平成20年10月7日までとなっております。	当ファンドの特定期間は、平成20年10月8日から平成21年4月7日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

前期 (平成20年10月 7日現在)	当期 (平成21年 4月 7日現在)
1. 特定期間の末日における受益権の総数 30,822,205,820口	1. 特定期間の末日における受益権の総数 32,822,727,178口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損 6,739,369,180円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損 8,645,196,898円
3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.7813円 (10,000口当たり純資産額 7,813円)	3. 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.7366円 (10,000口当たり純資産額 7,366円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 (自 平成20年 4月 8日 至 平成20年10月 7日)	当期 (自 平成20年10月 8日 至 平成21年 4月 7日)																				
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 一円	1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 一円																				
2. 分配金の計算過程 平成20年4月8日から平成20年5月7日まで 計算期末における分配対象金額 3,227,595,633円（10,000口当たり1,233円）のうち、149,147,145円（10,000口当たり57円）を分配金額としております。	2. 分配金の計算過程 平成20年10月8日から平成20年11月7日まで 計算期末における分配対象金額 3,786,777,928円（10,000口当たり1,215円）のうち、202,472,387円（10,000口当たり65円）を分配金額としております。																				
<table> <tr> <th>項目</th><th></th></tr> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A 146,906,260円</td></tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B -</td></tr> <tr> <td>収益調整金額</td><td>C 2,619,190,374円</td></tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td><td>D 461,498,999円</td></tr> </table>	項目		費用控除後の配当等収益額	A 146,906,260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 -	収益調整金額	C 2,619,190,374円	分配準備積立金額	D 461,498,999円	<table> <tr> <th>項目</th><th></th></tr> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A 182,868,605円</td></tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B -</td></tr> <tr> <td>収益調整金額</td><td>C 3,239,940,699円</td></tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td><td>D 363,968,624円</td></tr> </table>	項目		費用控除後の配当等収益額	A 182,868,605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 -	収益調整金額	C 3,239,940,699円	分配準備積立金額	D 363,968,624円
項目																					
費用控除後の配当等収益額	A 146,906,260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 -																				
収益調整金額	C 2,619,190,374円																				
分配準備積立金額	D 461,498,999円																				
項目																					
費用控除後の配当等収益額	A 182,868,605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 -																				
収益調整金額	C 3,239,940,699円																				
分配準備積立金額	D 363,968,624円																				

当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D 3,227,595,633円
当ファンドの期末残存口数	F 26,166,165,815口
10,000口当たりの収益分配対象額	G=E/F×10,000 1,233円
10,000口当たりの分配額	H 57円
収益分配金金額	I=F×H/10,000 149,147,145円

当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D 3,786,777,928円
当ファンドの期末残存口数	F 31,149,598,092口
10,000口当たりの収益分配対象額	G=E/F×10,000 1,215円
10,000口当たりの分配額	H 65円
収益分配金金額	I=F×H/10,000 202,472,387円

平成20年5月8日から平成20年6月9日まで

計算期末における分配対象金額 3,370,185,520円（10,000口当たり1,235円）のうち、177,352,613円（10,000口当たり65円）を分配金額としております。

項目	
費用控除後の配当等収益額	A 155,723,635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 -
収益調整金額	C 2,755,517,102円
分配準備積立金額	D 458,944,783円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D 3,370,185,520円
当ファンドの期末残存口数	F 27,285,017,431口
10,000口当たりの収益分配対象額	G=E/F×10,000 1,235円
10,000口当たりの分配額	H 65円
収益分配金金額	I=F×H/10,000 177,352,613円

平成20年6月10日から平成20年7月7日まで

計算期末における分配対象金額 3,507,918,556円（10,000口当たり1,221円）のうち、157,953,120円（10,000口当たり55円）を分配金額としております。

項目	
費用控除後の配当等収益額	A 140,691,860円

平成20年11月8日から平成20年12月8日まで

計算期末における分配対象金額 3,929,702,973円（10,000口当たり1,201円）のうち、173,369,069円（10,000口当たり53円）を分配金額としております。

項目	
費用控除後の配当等収益額	A 158,758,893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 -
収益調整金額	C 3,429,064,511円
分配準備積立金額	D 341,879,569円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D 3,929,702,973円
当ファンドの期末残存口数	F 32,711,145,244口
10,000口当たりの収益分配対象額	G=E/F×10,000 1,201円
10,000口当たりの分配額	H 53円
収益分配金金額	I=F×H/10,000 173,369,069円

平成20年12月9日から平成21年1月7日まで

計算期末における分配対象金額 3,880,532,053円（10,000口当たり1,190円）のうち、127,134,756円（10,000口当たり39円）を分配金額としております。

項目	
費用控除後の配当等収益額	A 137,022,710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 -
収益調整金額	C 2,931,918,365円
分配準備積立金額	D 435,308,331円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$ 3,507,918,556円
当ファンドの期末残存口数	F 28,718,749,136口
10,000口当たりの収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$ 1,221円
10,000口当たりの分配額	H 55円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$ 157,953,120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 -
収益調整金額	C 3,417,376,523円
分配準備積立金額	D 326,132,820円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$ 3,880,532,053円
当ファンドの期末残存口数	F 32,598,655,482口
10,000口当たりの収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$ 1,190円
10,000口当たりの分配額	H 39円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$ 127,134,756円

平成20年7月8日から平成20年8月7日まで

計算期末における分配対象金額 3,660,001,288円（10,000口当たり1,229円）のうち、184,487,896円（10,000口当たり62円）を分配金額としております。

項目	
費用控除後の配当等収益額	A 183,202,214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 -
収益調整金額	C 3,060,375,388円
分配準備積立金額	D 416,423,686円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D 3,660,001,288円
当ファンドの期末残存口数	F 29,756,112,338口
10,000口当たりの収益分配対象額	G=E/F×10,000 1,229円
10,000口当たりの分配額	H 62円
収益分配金金額	I=F×H/10,000 184,487,896円

平成20年8月8日から平成20年9月8日まで

計算期末における分配対象金額 3,628,498,442円（10,000口当たり1,226円）のうち、195,313,315円（10,000口当たり66円）を分配金額としております。

項目	
費用控除後の配当等収益額	A 171,661,098円

平成21年1月8日から平成21年2月9日まで

計算期末における分配対象金額 3,982,957,960円（10,000口当たり1,202円）のうち、182,102,140円（10,000口当たり55円）を分配金額としております。

項目	
費用控除後の配当等収益額	A 167,462,654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 -
収益調整金額	C 3,481,635,761円
分配準備積立金額	D 333,859,545円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D 3,982,957,960円
当ファンドの期末残存口数	F 33,109,480,116口
10,000口当たりの収益分配対象額	G=E/F×10,000 1,202円
10,000口当たりの分配額	H 55円
収益分配金金額	I=F×H/10,000 182,102,140円

平成21年2月10日から平成21年3月9日まで

計算期末における分配対象金額 3,934,140,498円（10,000口当たり1,198円）のうち、170,756,957円（10,000口当たり52円）を分配金額としております。

項目	
費用控除後の配当等収益額	A 164,325,108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 -
収益調整金額	C 3,043,592,539円
分配準備積立金額	D 413,244,805円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$ 3,628,498,442円
当ファンドの期末残存口数	F 29,592,926,626口
10,000口当たりの収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$ 1,226円
10,000口当たりの分配額	H 66円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$ 195,313,315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 -
収益調整金額	C 3,453,093,649円
分配準備積立金額	D 316,721,741円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$ 3,934,140,498円
当ファンドの期末残存口数	F 32,837,876,398口
10,000口当たりの収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$ 1,198円
10,000口当たりの分配額	H 52円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$ 170,756,957円

平成20年9月9日から平成20年10月7日まで

計算期末における分配対象金額 3,734,026,515円（10,000口当たり1,211円）のうち、172,604,352円（10,000口当たり56円）を分配金額としております。

項目	
費用控除後の配当等収益額	A 153,302,446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 -
収益調整金額	C 3,192,843,996円
分配準備積立金額	D 387,880,073円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D 3,734,026,515円
当ファンドの期末残存口数	F 30,822,205,820口
10,000口当たりの収益分配対象額	G=E/F×10,000 1,211円
10,000口当たりの分配額	H 56円
収益分配金金額	I=F×H/10,000 172,604,352円

平成21年3月10日から平成21年4月7日まで

計算期末における分配対象金額 3,933,571,532円（10,000口当たり1,198円）のうち、170,678,181円（10,000口当たり52円）を分配金額としております。

項目	
費用控除後の配当等収益額	A 171,910,316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 -
収益調整金額	C 3,451,500,530円
分配準備積立金額	D 310,160,686円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D 3,933,571,532円
当ファンドの期末残存口数	F 32,822,727,178口
10,000口当たりの収益分配対象額	G=E/F×10,000 1,198円
10,000口当たりの分配額	H 52円
収益分配金金額	I=F×H/10,000 170,678,181円

（関連当事者との取引に関する注記）

前期 （自 平成20年 4月 8日 至 平成20年10月 7日）	当期 （自 平成20年10月 8日 至 平成21年 4月 7日）
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して一般の取引の条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

前期 （自 平成20年 4月 8日 至 平成20年10月 7日）	当期 （自 平成20年10月 8日 至 平成21年 4月 7日）
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

１．元本の移動

前期 (自 平成20年 4月 8日 至 平成20年10月 7日)		当期 (自 平成20年10月 8日 至 平成21年 4月 7日)	
期首元本額	25,536,829,435 円	期首元本額	30,822,205,820 円
期中追加設定元本額	5,935,775,721 円	期中追加設定元本額	3,386,890,631 円
期中一部解約元本額	650,399,336 円	期中一部解約元本額	1,386,369,273 円

２．売買目的有価証券の貸借対照表計上額等

前期（自 平成20年 4月 8日 至 平成20年10月 7日）

(単位：円)

種類	貸借対照表計上額	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託受益証券	24,081,866,423	△4,789,023,073
合計	24,081,866,423	△4,789,023,073

当期（自 平成20年10月 8日 至 平成21年 4月 7日）

(単位：円)

種類	貸借対照表計上額	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託受益証券	24,176,077,709	2,884,129,176
合計	24,176,077,709	2,884,129,176

３．デリバティブ取引等関係

前期（自 平成20年 4月 8日 至 平成20年10月 7日）

該当事項はございません。

当期（自 平成20年10月 8日 至 平成21年 4月 7日）

該当事項はございません。

（４）附属明細表

第１．有価証券明細表

（１）株式（平成21年 4月 7日現在）

該当事項はございません。

（２）株式以外の有価証券

（平成21年 4月 7日現在）

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	アライアンス・バーンスタイン・新興国債券マザーファンド	24,566,688,049	24,176,077,709	
計	銘柄数：1	24,566,688,049	24,176,077,709	
	組入時価比率：100.0%		100.0%	
合計			24,176,077,709	

（注）比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第２．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

該当事項はございません。

参考

当ファンドは「アライアンス・バーンスタイン・新興国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同親投資信託の受益証券です。
なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

１ 「アライアンス・バーンスタイン・新興国債券マザーファンド」の状況

以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

（１）貸借対照表

（単位：円）

対象年月日	（平成21年 4月 7日現在）
資産の部	
流動資産	
預金	814,763,233
金銭信託	239,229
コール・ローン	764,530
国債証券	63,516,918,111

地方債証券	170,057,752
社債券	17,326,876,812
派生商品評価勘定	1,213,960
未収入金	1,232,148,455
未収利息	1,811,309,492
前払費用	191,310,210
流動資産合計	85,065,601,784
資産合計	85,065,601,784
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,700,641
未払金	1,140,349,530
未払解約金	690,251,000
流動負債合計	1,851,301,171
負債合計	1,851,301,171
純資産の部	
元本等	
元本	84,554,794,891
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△1,340,494,278
元本等合計	83,214,300,613
純資産合計	83,214,300,613
負債純資産合計	85,065,601,784

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	（自 平成20年10月 8日 至 平成21年 4月 7日）
1. 運用資産の評価基準及び評価方法	（１）国債証券・地方債証券・社債券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 （２）外国為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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期間末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。
3. 費用・収益の計上基準	（１）有価証券売買等損益、派生商品取引等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
4. その他	当該親投資信託の貸借対照表は、平成21年4月7日現在であります。 なお、当該親投資信託の直近の計算期間は、平成19年10月10日から平成20年10月7日までとなっております。

（その他の注記）

（平成21年 4月 7日現在）	
1. 元本の移動	
期首	平成20年10月8日
期首元本額	127,566,281,053円
平成20年10月8日より平成21年4月7日までの期中追加設定元本額	7,061,736,737円
平成20年10月8日より平成21年4月7日までの期中一部解約元本額	50,073,222,899円
期末元本額	84,554,794,891円

期末元本額の内訳 ＊	
アライアンス・バーンスタイン・新興国債券 F C（適格機関投資家専用）	369,562,120円
アライアンス・バーンスタイン・新興国債券 F D（適格機関投資家専用）	54,176,105,160円
アライアンス・バーンスタイン・エマージング市場債券ファンド B（適格機関投資家専用）	24,566,688,049円
アライアンス・バーンスタイン・新興国債券 P－H（適格機関投資家専用）	3,661,627,373円
アライアンス・バーンスタイン・新興国債券 P（適格機関投資家専用）	1,780,812,189円
2. 元本の欠損	1,340,494,278円
3. 平成21年4月7日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9841円
(10,000口当たり純資産額	9,841円)

（注）＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託毎の元本額

（３）附属明細表**第１．有価証券明細表****（１）株式（平成21年 4月 7日現在）**

該当事項はございません。

（２）株式以外の有価証券**（平成21年 4月 7日現在）**

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	GABONESE REPUBLIC		6,437,000.00	4,731,195.00	
		MALAYSIA		5,143,000.00	5,553,180.47	
		REPUBLIC OF ARGENTINA		20,790,000.00	5,339,564.30	
		REPUBLIC OF ARGENTINA		6,836,675.42	1,914,269.11	
		REPUBLIC OF BRAZIL		21,453,000.00	21,903,513.00	
		REPUBLIC OF BRAZIL		23,531,000.00	28,119,545.00	
		REPUBLIC OF BRAZIL		3,359,000.00	4,962,922.50	
		REPUBLIC OF BRAZIL		23,836,000.00	28,126,480.00	
		REPUBLIC OF BRAZIL		3,844,000.00	4,468,650.00	
		REPUBLIC OF BRAZIL		13,950,000.00	15,798,375.00	
		REPUBLIC OF BRAZIL		4,507,000.00	4,653,477.50	
		REPUBLIC OF CHILE		3,712,000.00	3,953,280.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA		6,063,000.00	6,214,575.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA		1,260,000.00	1,279,530.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA		10,963,000.00	10,085,960.00	
		REPUBLIC OF COSTA RICA		2,296,000.00	2,456,720.00	
		REPUBLIC OF DOMINICAN		5,186,175.33	4,304,525.51	
		REPUBLIC OF DOMINICAN		2,542,000.00	1,779,400.00	
		REPUBLIC OF EL SALVADOR		10,166,000.00	7,929,480.00	
		REPUBLIC OF GHANA		5,482,000.00	3,481,070.00	
		REPUBLIC OF HUNGARY		3,070,000.00	2,570,382.06	
		REPUBLIC OF INDONESIA		2,190,000.00	2,069,550.00	
		REPUBLIC OF INDONESIA		8,650,000.00	8,087,750.00	
		REPUBLIC OF INDONESIA		3,415,000.00	3,175,950.00	
		REPUBLIC OF INDONESIA		14,953,000.00	12,635,285.00	
		REPUBLIC OF INDONESIA		3,344,000.00	3,728,560.00	

		REPUBLIC OF INDONESIA		4,437,000.00	3,860,190.00	
		REPUBLIC OF INDONESIA		12,900,000.00	9,159,000.00	
		REPUBLIC OF INDONESIA		10,775,000.00	8,916,312.50	
		REPUBLIC OF PANAMA		9,669,000.00	9,427,275.00	
		REPUBLIC OF PANAMA		5,847,000.00	6,314,760.00	
		REPUBLIC OF PANAMA		11,549,000.00	12,790,517.50	
		REPUBLIC OF PERU		7,109,000.00	7,926,535.00	
		REPUBLIC OF PERU		3,542,000.00	3,648,260.00	
		REPUBLIC OF PERU		5,840,000.00	6,564,160.00	
		REPUBLIC OF PHILIPPINES		4,245,000.00	4,849,912.50	
		REPUBLIC OF PHILIPPINES		4,540,000.00	5,266,400.00	
		REPUBLIC OF PHILIPPINES		8,466,000.00	10,243,860.00	
		REPUBLIC OF PHILIPPINES		4,901,000.00	5,476,867.50	
		REPUBLIC OF PHILIPPINES		10,960,000.00	11,398,400.00	
		REPUBLIC OF PHILIPPINES		6,860,000.00	7,991,900.00	
		REPUBLIC OF PHILIPPINES		8,990,000.00	11,653,737.00	
		REPUBLIC OF PHILIPPINES		2,059,000.00	2,511,980.00	
		REPUBLIC OF SERBIA		4,100,000.00	3,157,000.00	
		REPUBLIC OF TURKEY		3,830,000.00	4,404,500.00	
		REPUBLIC OF TURKEY		1,324,000.00	1,482,880.00	
		REPUBLIC OF TURKEY		13,200,000.00	12,573,000.00	
		REPUBLIC OF TURKEY		30,037,000.00	28,384,965.00	
		REPUBLIC OF TURKEY		9,955,000.00	9,681,237.50	
		REPUBLIC OF TURKEY		9,164,000.00	7,881,040.00	
		REPUBLIC OF URUGUAY		2,403,000.00	2,210,760.00	
		REPUBLIC OF URUGUAY		6,000,000.00	4,905,000.00	
		REPUBLIC OF VENEZUELA		8,905,000.00	5,810,512.50	
		REPUBLIC OF VENEZUELA		21,089,000.00	11,071,725.00	
		REPUBLIC OF VENEZUELA		17,573,000.00	8,874,365.00	
		REPUBLIC OF VENEZUELA		10,707,000.00	4,978,755.00	
		REPUBLIC OF VENEZUELA		6,026,600.00	3,284,497.00	
		REPUBLIC OF VENEZUELA		24,553,000.00	11,539,910.00	
		REPUBLIC OF VENEZUELA		20,684,000.00	11,221,070.00	
		REPUBLIC OF VENEZUELA		9,030,000.00	4,966,500.00	
		REPUBLIC OF VENEZUELA		6,864,000.00	3,105,960.00	
		RUSSIAN FEDERATION		52,347,311.04	51,367,369.37	
		UKRAINE GOVERNMENT		4,465,000.00	2,076,225.00	

		UKRAINE GOVERNMENT		2,898,000.00	1,354,815.00	
		UNITED MEXICAN STATES		20,034,000.00	20,234,340.00	
		UNITED MEXICAN STATES		19,822,000.00	22,844,855.00	
	小計	銘柄数：	66	644,678,761.79	564,734,537.82	
					(56,812,294,504)	
		組入時価比率：	68.3%		70.1%	
	ブラジルリアル	REPUBLIC OF BRAZIL		24,945,000.00	25,973,981.25	
		REPUBLIC OF BRAZIL		1,661,000.00	1,737,821.25	
		REPUBLIC OF BRAZIL		32,974,000.00	30,129,992.50	
	小計	銘柄数：	3	59,580,000.00	57,841,795.00	
					(2,621,968,567)	
		組入時価比率：	3.2%		3.2%	
	コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA		11,040,000,000.00	12,843,494,400.00	
		REPUBLIC OF COLOMBIA		6,098,000,000.00	6,465,404,500.00	
	小計	銘柄数：	2	17,138,000,000.00	19,308,898,900.00	
					(805,181,084)	
		組入時価比率：	1.0%		1.0%	
	ペルーヌエボソル	PERU BONO SOBERANO		6,499,000.00	7,596,681.10	
		PERU BONO SOBERANO		6,036,000.00	6,707,505.00	
	小計	銘柄数：	2	12,535,000.00	14,304,186.10	
					(463,598,671)	
		組入時価比率：	0.6%		0.6%	
	ウルグアイペソ	REPUBLIC OF URUGUAY		87,822,000.00	43,155,730.80	
	小計	銘柄数：	1	87,822,000.00	43,155,730.80	
					(180,822,512)	
		組入時価比率：	0.2%		0.2%	
	トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT		31,918,006.00	33,130,890.22	
	小計	銘柄数：	1	31,918,006.00	33,130,890.22	
					(2,098,841,895)	
		組入時価比率：	2.5%		2.6%	
	ハンガリーフォリント	HUNGARY GOVERNMENT		1,495,030,000.00	1,165,890,175.32	
	小計	銘柄数：	1	1,495,030,000.00	1,165,890,175.32	
					(534,210,878)	
		組入時価比率：	0.6%		0.7%	
	国債証券計				63,516,918,111	
					(63,516,918,111)	
地方債証券	コロンビアペソ	SANTA FE BOGOTA D.C.		4,899,000,000.00	4,078,123,560.00	

	小計	銘柄数：	1	4,899,000,000.00	4,078,123,560.00	
					(170,057,752)	
		組入時価比率：	0.2%		0.2%	
	地方債証券計				170,057,752	
					(170,057,752)	
社債券	米ドル	ALB FINANCE BV		4,109,000.00	616,350.00	
		ALFA BOND ISSUANCE		2,880,000.00	1,591,200.00	
		ATF BANK		3,979,000.00	1,671,180.00	
		BANCO BMG SA		3,707,000.00	2,631,970.00	
		CENTERCREDIT INTERNATIONAL		1,789,000.00	787,160.00	
		CHAODA MOD AGR		5,344,000.00	4,395,440.00	
		CITIGROUP SEVERSTAL		2,280,000.00	1,601,700.00	
		CODELCO INC		1,827,000.00	2,072,673.03	
		DIGICEL LIMITED		4,430,000.00	4,031,300.00	
		EVRAZ GROUP SA		5,710,000.00	3,454,550.00	
		GALLERY CAPITAL SA		3,705,000.00	555,750.00	
		GAZPROM		8,101,000.00	6,075,750.00	
		GAZPROM		20,683,000.00	13,754,195.00	
		GTL TRADE FINANCE INC		1,640,000.00	1,410,400.00	
		IIRSA NORTE FINANCE LTD		1,750,000.00	1,286,250.00	
		INDONESIA RECAP LINKED		1,497,000.00	1,213,767.60	
		INDONESIA RECAP LINKED		700,000.00	581,630.00	
		INDONESIA RECAP LINKED		829,000.00	803,574.57	
		INTERGAS FINANCE BV		5,000,000.00	3,125,000.00	
		KAZKOMMERTS INTL BV		2,570,000.00	1,349,730.59	
		KAZMUNAIGAZ FINANCE SUB		15,792,000.00	13,581,120.00	
		KAZMUNAIGAZ FINANCE SUB		5,604,000.00	4,287,060.00	
		MAJAPAHIT HOLDING BV		4,140,000.00	3,105,000.00	
		MAJAPAHIT HOLDING BV		4,633,000.00	2,733,470.00	
		MMG FIDUCIARY		3,840,000.00	2,002,798.08	
		MOBILE TELESYSTEMS FIN		850,000.00	776,730.00	
		NOBLE GROUP LTD		6,480,000.00	4,320,442.80	
		PETROLEOS DE VENEZUELA		12,482,000.00	5,492,080.00	
		PETROLEOS DE VENEZUELA		7,180,000.00	2,656,600.00	
		PETRONAS CAPITAL LTD		2,824,000.00	3,032,092.08	
		RS FINANCE		2,750,000.00	1,650,000.00	
		RUSSIA AGRICULTURE BANK		11,754,000.00	8,580,420.00	

		RUSSIA AGRICULTURE BANK		34,063,000.00	26,228,510.00	
		RUSSIAN STANDARD BANK		1,600,000.00	920,000.00	
		SEVERSTAL OAO		4,921,000.00	3,518,613.42	
		SOUTHERN PERU		3,180,000.00	2,307,970.86	
		TNK-BP FINANCE SA		7,593,000.00	5,504,925.00	
		TRANSNEFT		4,229,000.00	3,769,037.04	
		USIMINAS COMMERCIAL LTD		3,354,000.00	3,186,300.00	
		VALE OVERSEAS LIMITED		4,275,000.00	3,653,444.92	
		VEDANTA RESOURCES PLC		6,205,000.00	4,715,800.00	
		VIP FIN (VIMPELCOM)		4,305,000.00	3,174,937.50	
		VTB CAPITAL SA		5,181,000.00	4,170,705.00	
	小計	銘柄数：	43	239,765,000.00	166,377,627.49	
					(16,737,589,325)	
		組入時価比率：	20.1%		20.7%	
	ブラジルリアル	UNIBANCO(CAYMAN)		3,300,000.00	3,654,189.00	
	小計	銘柄数：	1	3,300,000.00	3,654,189.00	
					(165,644,387)	
		組入時価比率：	0.2%		0.2%	
	ユーロ	YIOULA GLASSWORKS SA		841,000.00	134,560.00	
	小計	銘柄数：	1	841,000.00	134,560.00	
					(18,066,025)	
		組入時価比率：	0.0%		0.0%	
	ロシアルーブル	JPMORGAN CHASE		84,000,000.00	28,904,400.00	
		RED ARROW INTL LEASING		136,873,564.91	105,392,644.98	
	小計	銘柄数：	2	220,873,564.91	134,297,044.98	
					(405,577,075)	
		組入時価比率：	0.5%		0.5%	
	社債券計				17,326,876,812	
					(17,326,876,812)	
合計					81,013,852,675	
					(81,013,852,675)	

（注１）通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

（注２）合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

（注３）比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第２．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

(単位：円)

区分	種類	(平成21年 4月 7日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	1,068,902,699	—	1,086,341,628	△ 17,438,929
	米ドル	690,254,860	—	689,041,500	1,213,360
	トルコリラ	378,647,839	—	397,300,128	△ 18,652,289
	買建	378,647,839	—	376,600,087	△ 2,047,752
	米ドル	378,647,839	—	376,600,087	△ 2,047,752
合計		1,447,550,538	—	1,462,941,715	△ 19,486,681

(注)時価の算定方法

為替予約取引

- 1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。
 - ① 計算期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 - ② 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

「グローバル好利回り株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

対象年月日	(平成21年1月9日現在)	(平成21年7月9日現在)
科 目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
I 流動資産		
預金	171,823,073	76,890
コール・ローン	341,425,836	2,236,104,580
株式	57,038,194,860	49,909,103,599
未収入金	39,023,526	—
未収配当金	160,826,744	280,460,947
未収利息	1,403	4,901
流動資産合計	57,751,295,442	52,425,750,917
資産合計	57,751,295,442	52,425,750,917
負債の部		
I 流動負債		
流動負債合計	—	—
負債合計	—	—
純資産の部		
I 元本等		
1 元本		
元本	70,086,536,518	68,291,398,866
元本合計	70,086,536,518	68,291,398,866
2 剰余金		
欠損金	12,335,241,076	15,865,647,949
剰余金合計	△12,335,241,076	△15,865,647,949
元本等合計	57,751,295,442	52,425,750,917
純資産合計	57,751,295,442	52,425,750,917
負債・純資産合計	57,751,295,442	52,425,750,917

(注) 「グローバル好利回り株式マザーファンド」は、毎月20日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を

行います。上記の貸借対照表は平成21年1月9日並びに平成21年7月9日現在における同マザーファンドの状況です。

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	自 平成20年 7月10日 至 平成21年 1月 9日	自 平成21年 1月10日 至 平成21年 7月 9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、取引所または店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式（売買目的有価証券） 同 左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によっております。	為替予約取引 同 左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	受取配当金の計上基準 同 左
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいて処理しております。	外貨建資産等の会計処理 同 左

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成21年 1月 9日現在）	（平成21年 7月 9日現在）
1. 受益権総数	平成21年 1月 9日現在における受益権の総数 70,086,536,518口	平成21年 7月 9日現在における受益権の総数 68,291,398,866口
2. 元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の 6 第10号に規定する額 12,335,241,076円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の 6 第10号に規定する額 15,865,647,949円
3. 1 単位当たり純資産額	0.8240円 （1 万口＝8,240円）	0.7677円 （1 万口＝7,677円）

(デリバティブ取引に関する注記)

I. 取引の状況に関する事項

項 目	自 平成20年7月10日 至 平成21年1月9日	自 平成21年1月10日 至 平成21年7月9日
1. 取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 ① a. わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 b. わが国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 c. わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 ② 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」）。 ③ 金利先渡取引および為替先渡取引。 ④ 外国為替の売買の予約取引。	同 左
2. 取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては、投資信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。	同 左
3. 取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。	同 左
4. 取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。	同 左
5. 取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図る為に運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況に係る、投資信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等に係るチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。	同 左
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。	同 左

II. 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年1月9日現在）

平成21年1月9日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成21年7月9日現在）

平成21年7月9日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成20年7月10日 至 平成21年1月9日）

該当事項はありません。

（自 平成21年1月10日 至 平成21年7月9日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成21年1月9日現在）	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	77,957,225,831円
同期中における追加設定元本額	－円
同期中における一部解約元本額	7,870,689,313円
平成21年1月9日現在における元本の内訳	
グローバル3資産ファンド	69,049,951,522円
ニュー・グローバル・バランス・ファンド	1,036,584,996円
合 計	70,086,536,518円

（平成21年7月9日現在）	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	70,086,536,518円
同期中における追加設定元本額	1,448,225,038円

同期中における一部解約元本額	3,243,362,690円
平成21年7月9日現在における元本の内訳	
グローバル3資産ファンド	67,195,423,552円
ニュー・グローバル・バランス・ファンド	1,095,975,314円
合 計	68,291,398,866円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

銘 柄	株 数	評価額 単価	評価額 金額	備 考
日本円				
ジェイ エフ イー ホールディングス	92,000	2,895	266,340,000	
東北電力	180,000	2,035	366,300,000	
商船三井	500,000	558	279,000,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	2,520	140,600	354,312,000	
ローソン	80,000	4,010	320,800,000	
日本円 小計	854,520		1,586,752,000	単位：円
米ドル				
CHEVRON CORPORATION	136,000	62.78	8,538,080.00	
MARATHON OIL CORP	250,000	28.03	7,007,500.00	
SOUTHERN COPPER CORPORATION	353,800	19.16	6,778,808.00	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	180,000	49.68	8,942,400.00	
GENERAL MARITIME CORP	734,320	8.74	6,417,956.80	
MCDONALD'S CORPORATION	335,000	57.04	19,108,400.00	
ALTRIA GROUP INC	968,820	16.40	15,888,648.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	383,820	43.49	16,692,331.80	
PFIZER INC	590,000	14.61	8,619,900.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	130,000	36.35	4,725,500.00	
GFI GROUP INC	160,000	5.95	952,000.00	
JPMORGAN CHASE & CO	200,000	32.71	6,542,000.00	
TRAVELERS COS INC(THE)	190,000	39.07	7,423,300.00	
MICROSOFT CORP	440,000	22.56	9,926,400.00	
INTEL CORP	840,000	15.94	13,389,600.00	
XILINX INC	250,000	19.15	4,787,500.00	
AT&T INC	604,082	23.54	14,220,090.28	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	250,000	28.65	7,162,500.00	
NORTHEAST UTILITIES	469,000	21.75	10,200,750.00	
NSTAR	414,000	30.83	12,763,620.00	
PORTLAND GENERAL ELECTRIC CO	88,000	18.92	1,664,960.00	
米ドル 小計	7,966,842		191,752,244.88	

(邦貨換算額)			(17,825,288,684)	(単位：円)
カナダドル				
SUNCOR ENERGY INC	150,000	30.45	4,567,500.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	91,000	51.90	4,722,900.00	
ENBRIDGE INC	406,000	38.83	15,764,980.00	
TRANSCANADA CORP	180,000	30.31	5,455,800.00	
カナダドル 小計	827,000		30,511,180.00	
(邦貨換算額)			(2,438,758,617)	(単位：円)
ユーロ				
ENI SPA	500,000	16.00	8,003,845.00	
TOTAL SA	100,000	36.21	3,621,000.00	
ARCELOR MITTAL	150,000	21.01	3,151,500.00	
KONINKLIJKE DSM NV	160,000	21.75	3,480,000.00	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	150,000	22.27	3,341,250.00	
SES	89,000	13.25	1,179,250.00	
VIVENDI SA	300,000	16.69	5,007,000.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	450,000	8.70	3,915,000.00	
ALLIANZ SE-REG	35,000	62.58	2,190,300.00	
AXA SA	300,000	11.85	3,555,000.00	
SCOR SE	297,000	15.00	4,455,000.00	
FRANCE TELECOM SA	403,000	15.79	6,365,385.00	
KONINKLIJKE KPN NV	961,100	9.78	9,399,558.00	
E.ON AG	303,000	23.33	7,068,990.00	
ENEL SPA	2,606,300	3.29	8,582,233.14	
GDF SUEZ	215,000	24.77	5,326,625.00	
RWE AG	100,000	53.30	5,330,000.00	
ユーロ 小計	7,119,400		83,971,936.14	
(邦貨換算額)			(10,839,097,516)	(単位：円)
英ポンド				
BP PLC	632,000	4.65	2,938,800.00	
BAE SYSTEMS PLC	1,000,000	3.29	3,297,500.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	407,000	16.98	6,910,860.00	
DIAGEO PLC	400,000	8.83	3,532,000.00	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	419,000	16.00	6,704,000.00	

HSBC HOLDINGS PLC	740,000	4.93	3,648,200.00	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	490,000	1.30	637,000.00	
VODAFONE GROUP PLC	2,960,000	1.15	3,409,920.00	
NATIONAL GRID PLC	925,000	5.35	4,953,375.00	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,746,500	4.73	8,274,043.75	
英ポンド 小計	9,719,500		44,305,698.75	
(邦貨換算額)			(6,624,588,077)	(単位：円)
スイスフラン				
SWISSCOM AG-REG	55,000	331.00	18,205,000.00	
スイスフラン 小計	55,000		18,205,000.00	
(邦貨換算額)			(1,553,068,550)	(単位：円)
ノルウェークローネ				
PROSAFE SE	467,200	29.06	13,576,832.00	
STATOILHYDRO ASA	380,000	120.20	45,676,000.00	
ノルウェークローネ 小計	847,200		59,252,832.00	
(邦貨換算額)			(840,205,157)	(単位：円)
オーストラリアドル				
BHP BILLITON LTD	180,000	32.14	5,785,200.00	
BLUESCOPE STEEL LTD	2,022,400	2.28	4,611,072.00	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	650,000	8.47	5,505,500.00	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	400,000	16.30	6,520,000.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	180,000	37.26	6,706,800.00	
WESTPAC BANKING CORPORATION	267,320	19.12	5,111,158.40	
ASX LTD	86,000	34.01	2,924,860.00	
AMP LIMITED	1,110,000	4.62	5,128,200.00	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	200,000	19.65	3,930,000.00	
TELSTRA CORPORATION LIMITED	4,000,000	3.36	13,440,000.00	
オーストラリアドル 小計	9,095,720		59,662,790.40	
(邦貨換算額)			(4,323,165,792)	(単位：円)
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	659,900	6.41	4,229,959.00	
ニュージーランドドル 小計	659,900		4,229,959.00	
(邦貨換算額)			(246,479,710)	(単位：円)

香港ドル				
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	720,000	27.40	19,728,000.00	
CLP HOLDINGS LTD	1,777,500	51.85	92,163,375.00	
HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	2,819,000	42.50	119,807,500.00	
香港ドル 小計	5,316,500		231,698,875.00	
(邦貨換算額)			(2,778,069,511)	(単位：円)
シンガポールドル				
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,380,000	3.06	10,342,800.00	
STARHUB LIMITED	1,424,760	2.17	3,091,729.20	
シンガポールドル 小計	4,804,760		13,434,529.20	
(邦貨換算額)			(853,629,985)	(単位：円)
合 計	47,266,342		49,909,103,599	単位：円
(外貨建有価証券邦貨換算額合計)			(48,322,351,599)	(単位：円)

(注)

1. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書きであります。
2. 米ドル表示の株式については、21銘柄、信託財産純資産総額に対する比率34.0%、
合計に対する比率36.9%です。
カナダドル表示の株式については、4銘柄、信託財産純資産総額に対する比率4.7%、
合計に対する比率5.0%です。
ユーロ表示の株式については、17銘柄、信託財産純資産総額に対する比率20.7%、
合計に対する比率22.4%です。
英ポンド表示の株式については、10銘柄、信託財産純資産総額に対する比率12.6%、
合計に対する比率13.7%です。
スイスフラン表示の株式については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率3.0%、
合計に対する比率3.2%です。
ノルウェークローネ表示の株式については、2銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.6%、
合計に対する比率1.7%です。
オーストラリアドル表示の株式については、10銘柄、信託財産純資産総額に対する比率8.2%、
合計に対する比率8.9%です。
ニュージーランドドル表示の株式については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.5%、
合計に対する比率0.5%です。
香港ドル表示の株式については、3銘柄、信託財産純資産総額に対する比率5.3%、
合計に対する比率5.7%です。

シンガポールドル表示の株式については、2銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.6%、合計に対する比率1.8%です。

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

「中小型株マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

対象年月日	(平成21年1月9日現在)	(平成21年7月9日現在)
科 目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
I 流動資産		
コール・ローン	100,391,204	32,731,654
株式	454,935,100	580,690,550
未収入金	3,590,182	11,480,965
未収配当金	1,398,680	1,211,000
未収利息	412	71
流動資産合計	560,315,578	626,114,240
資産合計	560,315,578	626,114,240
負債の部		
I 流動負債		
未払金	4,572,354	3,833,533
流動負債合計	4,572,354	3,833,533
負債合計	4,572,354	3,833,533
純資産の部		
I 元本等		
1 元本		
元本	1,187,041,191	1,099,872,432
元本合計	1,187,041,191	1,099,872,432
2 剰余金		
欠損金	631,297,967	477,591,725
剰余金合計	△631,297,967	△477,591,725
元本等合計	555,743,224	622,280,707
純資産合計	555,743,224	622,280,707
負債・純資産合計	560,315,578	626,114,240

(注) 「中小型株マザーファンド」は、毎年4月8日及び10月8日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算

を行います。上記の貸借対照表は平成21年1月9日並びに平成21年7月9日現在における同マザーファンドの状況です。

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	自 平成20年 7月10日 至 平成21年 1月 9日	自 平成21年 1月10日 至 平成21年 7月 9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、取引所または店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式（売買目的有価証券） 同 左
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	受取配当金の計上基準 同 左

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成21年 1月 9日現在）	（平成21年 7月 9日現在）
1. 受益権総数	平成21年 1月 9日現在における受益権の総数 1,187,041,191口	平成21年 7月 9日現在における受益権の総数 1,099,872,432口
2. 元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の 6 第10号に規定する額 631,297,967円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の 6 第10号に規定する額 477,591,725円
3. 1 単位当たり純資産額	0.4682円 （1 万口＝4,682円）	0.5658円 （1 万口＝5,658円）

（デリバティブ取引に関する注記）

I. 取引の状況に関する事項

項 目	自 平成20年 7月10日 至 平成21年 1月 9日	自 平成21年 1月10日 至 平成21年 7月 9日
-----	--------------------------------	--------------------------------

1. 取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 ① a. わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 b. わが国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引、ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引。 c. わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引、ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 ②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」）。 ③金利先渡し取引および為替先渡し取引。 ④外国為替の売買の予約取引。	同 左
2. 取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては、投資信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。	同 左
3. 取引の利用目的	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。	同 左
4. 取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。	同 左
5. 取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図る為に運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況に係る、投資信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等に係るチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。	同 左
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。	同 左

II. 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年1月9日現在）

平成21年1月9日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成21年7月9日現在）

平成21年7月9日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成20年7月10日 至 平成21年1月9日）

該当事項はありません。

（自 平成21年1月10日 至 平成21年7月9日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年1月9日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,565,613,818円
同期中における追加設定元本額	647,266,839円
同期中における一部解約元本額	2,025,839,466円
平成21年1月9日現在における元本の内訳	
ニュー・グローバル・バランス・ファンド	1,187,041,191円
合 計	1,187,041,191円

(平成21年7月9日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,187,041,191円
同期中における追加設定元本額	－円
同期中における一部解約元本額	87,168,759円
平成21年7月9日現在における元本の内訳	
ニュー・グローバル・バランス・ファンド	1,099,872,432円
合 計	1,099,872,432円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位：円)

銘 柄	株 数	評価額 単価	評価額 金額	備 考
東鉄工業	6,000	602	3,612,000	
わらべや日洋	4,000	1,109	4,436,000	
藤倉化成	7,800	504	3,931,200	
上村工業	2,200	3,170	6,974,000	
ニフコ	6,100	1,432	8,735,200	

東海カーボン	19,000	462	8,778,000	
S E Cカーボン	5,000	722	3,610,000	
東京鐵鋼	28,000	336	9,408,000	
カナレ電気	4,900	1,019	4,993,100	
オーネックス	45,000	143	6,435,000	
ヒラノテクシード	9,000	1,090	9,810,000	
オイレス工業	7,100	1,358	9,641,800	
ハーモニック・ドライブ・システムズ	19	225,000	4,275,000	
キャノンマシナリー	7,100	1,050	7,455,000	
新晃工業	33,000	349	11,517,000	
ユーシン精機	7,300	1,383	10,095,900	
第一精工	4,200	2,600	10,920,000	
アクセル	2,300	3,230	7,429,000	
ローランド ディー. ジー.	2,300	1,244	2,861,200	
古野電気	12,000	596	7,152,000	
フェローテック	5,100	1,085	5,533,500	
イリソ電子工業	7,400	1,020	7,548,000	
芝浦電子	6,300	1,061	6,684,300	
日本精機	3,000	1,085	3,255,000	
マニー	1,600	6,180	9,888,000	
朝日インテック	1,500	1,118	1,677,000	
SHOEI	6,900	929	6,410,100	
ビジョン	3,300	3,200	10,560,000	
リンテック	6,200	1,722	10,676,400	
トランコム	7,800	1,375	10,725,000	
宇徳	20,000	297	5,940,000	
東北新社	600	590	354,000	
ティーガイア	94	137,900	12,962,600	
GMOペイメントゲートウェイ	61	117,800	7,185,800	
ザッパラス	50	192,900	9,645,000	
ビットアイル	89	68,200	6,069,800	
バンクテック・ジャパン	61	50,100	3,056,100	
プロトコーポレーション	3,700	2,750	10,175,000	
インテージ	4,000	1,554	6,216,000	
シンプレクス・テクノロジー	141	45,000	6,345,000	
アルファシステムズ	4,900	2,075	10,167,500	
沖縄セルラー電話	19	169,200	3,214,800	

エムティーアイ	32	207,000	6,624,000	
D T S	4,000	925	3,700,000	
J Pホールディングス	4,600	1,155	5,313,000	
トシン・グループ	2,200	1,490	3,278,000	
チェルト	5,200	1,404	7,300,800	
アズワン	4,900	1,707	8,364,300	
トラスコ中山	6,600	1,528	10,084,800	
住金物産	25,000	218	5,450,000	
サンエー	2,000	3,310	6,620,000	
ヴィレッジヴァンガードコーポレーション	48	308,000	14,784,000	
セリア	113	97,400	11,006,200	
大黒天物産	5,900	1,903	11,227,700	
アークランドサービス	24	144,400	3,465,600	
クリエイトSDホールディングス	5,300	1,844	9,773,200	
あさひ	2,800	3,010	8,428,000	
ワンダーコーポレーション	40	108,000	4,320,000	
サンマルクホールディングス	1,100	3,080	3,388,000	
トリドール	45	179,000	8,055,000	
ハイデイ日高	8,900	1,003	8,926,700	
トップカルチャー	9,000	359	3,231,000	
ゼビオ	1,800	1,957	3,522,600	
ケーズホールディングス	4,000	2,425	9,700,000	
アインファーマシーズ	3,800	2,040	7,752,000	
ネクスト	39	108,800	4,243,200	
日本M&Aセンター	18	332,000	5,976,000	
アコーディア・ゴルフ	96	74,500	7,152,000	
タケエイ	1,100	1,310	1,441,000	
リニカル	3,200	1,170	3,744,000	
シイエム・シイ	1,600	2,495	3,992,000	
クックパッド	100	9,500	950,000	
メッセージ	68	155,000	10,540,000	
ベネフィット・ワン	96	77,000	7,392,000	
ベストブライダル	26	257,100	6,684,600	
ぐるなび	53	278,600	14,765,800	
ヒビノ	4,300	750	3,225,000	
インフォマート	39	194,500	7,585,500	
イーピーエス	25	358,000	8,950,000	

プレステージ・インターナショナル	66	161,800	10,678,800	
ボックスグループ	305	14,530	4,431,650	
みらかホールディングス	2,700	2,280	6,156,000	
エイジス	2,700	2,060	5,562,000	
共立メンテナンス	4,200	1,559	6,547,800	
合 計	413,267		580,690,550	

(b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド（適格機関投資家専用）

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	第2期 (平成20年 5月29日現在)	第3期 (平成21年 5月29日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	7,278,432,691	3,975,474,786
未収入金	68,000,000	16,500,000
流動資産合計	7,346,432,691	3,991,974,786
資産合計	7,346,432,691	3,991,974,786
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	5,940,719	1,319,389
未払委託者報酬	60,892,186	13,523,700
その他未払費用	631,913	217,261
流動負債合計	67,464,818	15,060,350
負債合計	67,464,818	15,060,350
純資産の部		
元本等		
元本	5,002,269,152	5,079,255,252
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,276,698,721	△1,102,340,816
（分配準備積立金）	798,851,482	724,469,217
元本等合計	7,278,967,873	3,976,914,436
純資産合計	7,278,967,873	3,976,914,436
負債純資産合計	7,346,432,691	3,991,974,786

（２）損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	第2期 （自 平成19年 5月30日 至 平成20年 5月29日）	第3期 （自 平成20年 5月30日 至 平成21年 5月29日）
営業収益		
受取利息	—	201
有価証券売買等損益	135,827,476	△3,433,164,325
営業収益合計	135,827,476	△3,433,164,124
営業費用		
受託者報酬	5,940,719	3,633,108
委託者報酬	60,892,186	37,239,257
その他費用	631,913	500,818
営業費用合計	67,464,818	41,373,183
営業利益又は営業損失（△）	68,362,658	△3,474,537,307
経常利益又は経常損失（△）	68,362,658	△3,474,537,307
当期純利益又は当期純損失（△）	68,362,658	△3,474,537,307
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（△）	16,475,411	△352,409,579
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,007,943,772	2,276,698,721
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,322,308,271	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	1,322,308,271	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	105,440,569	256,911,809
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	105,440,569	214,448,439
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	—	42,463,370
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,276,698,721	△1,102,340,816

（３）注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第2期 (自 平成19年 5月30日 至 平成20年 5月29日)	第3期 (自 平成20年 5月30日 至 平成21年 5月29日)
1. 運用資産の評価基準及び評価方法	(1) 親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。	(1) 親投資信託受益証券 同左
2. 費用・収益の計上基準	(1) 有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。	(1) 有価証券売買等損益の計上基準 同左
3. その他	当ファンドの計算期間は、平成19年5月30日から平成20年5月29日までとなっております。	当ファンドの計算期間は、平成20年5月30日から平成21年5月29日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第2期 (平成20年 5月29日現在)	第3期 (平成21年 5月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数 5,002,269,152口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 5,079,255,252口
—	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第10号に規定する額 元本の欠損 1,102,340,816円
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.4551円 (10,000口当たり純資産額 14,551円)	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.7830円 (10,000口当たり純資産額 7,830円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 (自 平成19年 5月30日 至 平成20年 5月29日)	第3期 (自 平成20年 5月30日 至 平成21年 5月29日)
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 14,919,593円	1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 —円
2. 分配金の計算過程 該当事項はございません。	2. 分配金の計算過程 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 (自 平成19年 5月30日 至 平成20年 5月29日)	第3期 (自 平成20年 5月30日 至 平成21年 5月29日)
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して一般の取引の条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

第2期 （自 平成19年 5月30日 至 平成20年 5月29日）	第3期 （自 平成20年 5月30日 至 平成21年 5月29日）
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1. 元本の移動

第2期 (自 平成19年 5月30日 至 平成20年 5月29日)		第3期 (自 平成20年 5月30日 至 平成21年 5月29日)	
期首元本額	2,376,696,187円	期首元本額	5,002,269,152円
期中追加設定元本額	2,865,741,785円	期中追加設定元本額	598,645,214円
期中一部解約元本額	240,168,820円	期中一部解約元本額	521,659,114円

2. 売買目的有価証券の貸借対照表計上額等

第2期（自 平成19年 5月30日 至 平成20年 5月29日）

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた 評価差額
親投資信託受益証券	7,278,432,691	117,134,633
合計	7,278,432,691	117,134,633

第3期（自 平成20年 5月30日 至 平成21年 5月29日）

（単位：円）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた 評価差額
親投資信託受益証券	3,975,474,786	△3,039,339,916
合計	3,975,474,786	△3,039,339,916

3. デリバティブ取引等関係

第2期（自 平成19年 5月30日 至 平成20年 5月29日）

該当事項はございません。

第3期（自 平成20年 5月30日 至 平成21年 5月29日）

該当事項はございません。

（4）附属明細表

第1．有価証券明細表

（1）株式（平成21年 5月29日現在）

該当事項はございません。

（2）株式以外の有価証券

（平成21年 5月29日現在）

種類	銘柄	口数	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	A Bエマージング・グロース株式 マザーファンド	4,131,221,850	3,975,474,786	
計	銘柄数：1	4,131,221,850	3,975,474,786	
	組入時価比率：100.0%		100.0%	
合計			3,975,474,786	

(注)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2．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

該当事項はございません。

参考

当ファンドは「ＡＢエマージング・グロース株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同親投資信託の受益証券です。

なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

１．「ＡＢエマージング・グロース株式マザーファンド」の状況

以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

（１）貸借対照表

（単位：円）

対象年月日	（平成21年 5月29日現在）
資産の部	
流動資産	
預金	124,327,977
コール・ローン	447,353
株式	5,340,599,482
オプション証券等	36,581,783
派生商品評価勘定	848,404
未収入金	77,244,037
未収配当金	31,609,379
流動資産合計	5,611,658,415
資産合計	5,611,658,415
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,011,838
未払金	52,755,875
未払解約金	16,595,000
流動負債合計	70,362,713
負債合計	70,362,713
純資産の部	
元本等	

元本	5,758,353,043
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△217,057,341
元本等合計	5,541,295,702
純資産合計	5,541,295,702
負債純資産合計	5,611,658,415

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	（自 平成20年 5月30日 至 平成21年 5月29日）
1. 運用資産の評価基準及び評価方法 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 3. 費用・収益の計上基準 4. その他	（１）株式・オプション証券等 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価額のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。 （２）外国為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。 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期間末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。 （１）受取配当金の計上基準 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 （２）有価証券売買等損益及び為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。 当該親投資信託の貸借対照表は、平成21年5月29日現在であります。 なお、当該親投資信託の直近の計算期間は、平成19年12月21日から平成20年12月22日までとなっております。

（その他の注記）

（平成21年 5月29日現在）	
1. 元本の移動	
期首	平成20年5月30日
期首元本額	5,733,949,457 円
平成20年5月30日より平成21年5月29日までの期中追加設定元本額	531,319,429 円
平成20年5月30日より平成21年5月29日までの期中一部解約元本額	506,915,843 円
期末元本額	5,758,353,043 円
期末元本額の内訳 ＊	
適格機関投資家私募 A Bエマージング・グロース株式ファンド－F	1,577,423,651 円
アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド（適格機関投資家専用）	4,131,221,850 円
アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド（SMA専用）	49,707,542 円
2. 元本の欠損	217,057,341 円
3. 平成21年5月29日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9623 円
(10,000口当たり純資産額)	9,623 円)

（注）＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託毎の元本額

（3）附属明細表

第1. 有価証券明細表

（1）株式

（平成21年 5月29日現在）					
通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	LUKOIL-SPON ADR	20,297	50.30	1,020,939.10	
	OA O GAZPROM-SPON ADR REG S	49,786	22.12	1,101,266.32	
	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	99,800	34.64	3,457,072.00	
	ROSNEFT OJSC-GDR	68,972	6.33	436,592.76	

	TENARIS SA-ADR	8,600	30.29	260,494.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	8,990	28.22	253,697.80	
	EVRAZ GROUP SA-GDR REG S	1,125	22.58	25,402.50	
	GERDAU SA-SPON ADR	12,800	10.12	129,536.00	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE ADR	4,100	35.80	146,780.00	
	VALE SA-SP PREF ADR	105,400	16.42	1,730,668.00	
	ORASCOM CONSTRUCTION-GDR	6,614	36.49	241,344.86	
	GAFISA SA-ADR	7,300	18.55	135,415.00	
	CTRIPO.COM INTERNATIONAL-ADR	7,400	37.69	278,906.00	
	BRASIL DISTR PAO ACU-SP ADR	6,000	36.09	216,540.00	
	X5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	24,263	14.70	356,666.10	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	1,700	32.34	54,978.00	
	COMPANHIA DE BEBIDAS-PR ADR	4,105	64.72	265,675.60	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SA	12,300	32.66	401,718.00	
	CHINA MEDICAL TECH-SPON ADR	26,100	20.10	524,610.00	
	PHARMSTANDARD-REG S GDR	17,351	15.70	272,410.70	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	31,100	46.31	1,440,241.00	
	BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	5,900	41.27	243,493.00	
	CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,500	23.30	174,750.00	
	SHANDA INTERACTIVE-SPON ADR	12,900	55.00	709,500.00	
	AMERICA MOVIL-ADR SERIES L	38,500	39.00	1,501,500.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	13,800	38.72	534,336.00	
	TELE NORTE LESTE PART-ADR	23,100	17.67	408,177.00	
	ENERSIS S.A. -SPONS ADR	44,500	16.40	729,800.00	
小計	銘柄数：28			17,052,509.74	
				(1,645,226,139)	
	組入時価比率：29.7%			30.8%	
メキシコペソ	URBI DESARROLLOS URBANOS SA	371,500	18.16	6,746,440.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	38,400	18.49	710,016.00	
小計	銘柄数：2			7,456,456.00	
				(54,432,128)	
	組入時価比率：1.0%			1.0%	
ブラジルリアル	USINAS SIDER MINAS GER-PF A	750	37.15	27,862.50	
	USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	45,900	35.88	1,646,892.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	28,900	12.41	358,649.00	
	PDG REALTY SA	6,700	23.63	158,321.00	
	LOJAS RENNER SA	12,173	21.80	265,371.40	

	ULTRAPAR PARTICIPACOES-PREF	8,900	63.10	561,590.00	
	MARFRIG FRIGORIFICOS E COMERCIO	32,500	14.30	464,750.00	
	HYPERMARCAS S.A	16,100	22.90	368,690.00	
	ITAUSA INVESTIMENTOS ITAU PR	366,776	8.97	3,289,980.72	
	ITAUSA INVESTIMENTOS RTS	6,843	2.98	20,392.14	
	BM&FBOVESPA SA	31,400	11.05	346,970.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	35,800	17.00	608,600.00	
	GVT HOLDING SA	28,100	32.50	913,250.00	
	ELETROPAULO METROPOLITANA-PREF B	63,334	30.15	1,909,520.10	
小計	銘柄数：14			10,940,838.86	
				(523,847,364)	
	組入時価比率：9.5%			9.8%	
チリペソ	CENCOSUD SA	57,487	1,449.00	83,298,663.00	
	CERVECERIAS UNIDAS SA	11,600	3,650.10	42,341,160.00	
小計	銘柄数：2			125,639,823.00	
				(21,434,153)	
	組入時価比率：0.4%			0.4%	
英ポンド	RANDGOLD RESOURCES LIMITED	1,565	43.88	68,672.20	
小計	銘柄数：1			68,672.20	
				(10,562,471)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	22,095	18.00	397,710.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	321,421	3.84	1,234,256.64	
小計	銘柄数：2			1,631,966.64	
				(100,986,095)	
	組入時価比率：1.8%			1.9%	
チェココルナ	CEZ AS	5,929	883.20	5,236,492.80	
小計	銘柄数：1			5,236,492.80	
				(26,287,193)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
ポーランドズロチ	PKO BANK POLSKI SA	30,269	25.60	774,886.40	
小計	銘柄数：1			774,886.40	
				(23,114,861)	
	組入時価比率：0.4%			0.4%	
香港ドル	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	750,000	6.44	4,830,000.00	
	CNOOC LTD	1,035,000	9.78	10,122,300.00	
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	291,600	6.97	2,032,452.00	

	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	80,000	34.75	2,780,000.00	
	CHINA SHIPPING DEVELOPMENT-H	108,000	10.66	1,151,280.00	
	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	275,500	6.75	1,859,625.00	
	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	948,000	11.12	10,541,760.00	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,139,000	5.01	5,706,390.00	
	IND & COMM BK OF CHINA-H	1,913,000	4.82	9,220,660.00	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	223,000	27.75	6,188,250.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LIMITED	263,600	15.72	4,143,792.00	
	GUANGZHOU R&F PROPERTIES COMPANY LIMITED	106,000	16.80	1,780,800.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	64,600	80.70	5,213,220.00	
	AAC ACOUSTIC TECHNOLOGIES HOLD	165,000	6.16	1,016,400.00	
	ZTE CORP-H	29,760	25.20	749,952.00	
	CHINA MOBILE LTD	109,500	74.85	8,196,075.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	114,000	16.38	1,867,320.00	
小計	銘柄数：17			77,400,276.00	
				(962,859,433)	
	組入時価比率：17.4%			18.0%	
マレーシアリングット	BUMIPUTRA-COMMERCE HLDGS BHD	127,000	8.70	1,104,900.00	
小計	銘柄数：1			1,104,900.00	
				(30,373,701)	
	組入時価比率：0.5%			0.6%	
タイバーツ	SIAM COMMERCIAL BANK-FOR REG	344,900	67.00	23,108,300.00	
小計	銘柄数：1			23,108,300.00	
				(64,703,240)	
	組入時価比率：1.2%			1.2%	
インドネシアルピア	BANK CENTRAL ASIA PT	55,500	3,450.00	191,475,000.00	
小計	銘柄数：1			191,475,000.00	
				(1,799,865)	
	組入時価比率：0.0%			0.0%	
韓国ウォン	POSCO	2,047	406,000.00	831,082,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	9,413	77,700.00	731,390,100.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	5,460	64,500.00	352,170,000.00	
	HYUNDAI MOBIS	3,338	120,500.00	402,229,000.00	
	LG ELECTRONICS INC	6,520	119,500.00	779,140,000.00	

	KT&G CORP	10,694	66,900.00	715,428,600.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	36,874	32,000.00	1,179,968,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	4,061	559,000.00	2,270,099,000.00	
小計	銘柄数：8			7,261,506,700.00	
				(557,683,714)	
	組入時価比率：10.1%			10.4%	
新台湾ドル	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,299,000	24.20	31,435,800.00	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	189,000	52.70	9,960,300.00	
	AU OPTRONICS CORP	217,799	33.60	7,318,046.40	
	COMPAL ELECTRONICS	119,000	27.50	3,272,500.00	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	242,000	123.00	29,766,000.00	
	HTC CORPORATION	25,000	524.00	13,100,000.00	
	QUANTA COMPUTER INC	96,800	52.00	5,033,600.00	
	WISTRON CORP	114,000	51.00	5,814,000.00	
	SILICONWARE PRECISION INDS	88,000	42.25	3,718,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	835,656	60.40	50,473,622.40	
小計	銘柄数：10			159,891,868.80	
				(473,279,931)	
	組入時価比率：8.5%			8.9%	
インドルピー	CAIRN INDIA LIMITED	62,110	217.45	13,505,819.50	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	14,805	2,127.55	31,498,377.75	
	ITC LTD	171,183	183.90	31,480,553.70	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	14,820	2,183.25	32,355,765.00	
	ICICI BANK LTD	27,638	730.30	20,184,031.40	
	INFOSYS TECHNOLOGIES LTD	16,734	1,579.00	26,422,986.00	
	BHARTI AIRTEL LIMITED	36,698	795.90	29,207,938.20	
小計	銘柄数：7			184,655,471.55	
				(380,390,271)	
	組入時価比率：6.9%			7.1%	
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	26,724	43.50	1,162,494.00	
小計	銘柄数：1			1,162,494.00	
				(28,202,104)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
エジプトポンド	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	24,953	45.57	1,137,108.21	
小計	銘柄数：1			1,137,108.21	
				(19,512,776)	

	組入時価比率：0.4%			0.4%	
南アフリカランド	SASOL LTD	3,843	287.14	1,103,479.02	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	9,811	325.00	3,188,575.00	
	BHP BILLITON PLC	22,994	183.61	4,221,928.34	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	16,217	183.50	2,975,819.50	
	AVENG LIMITED	39,542	34.36	1,358,663.12	
	BIDVEST GROUP LIMITED	26,215	92.00	2,411,780.00	
	NASPERS LTD-N SHS	21,872	196.00	4,286,912.00	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	31,997	58.80	1,881,423.60	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	27,761	55.63	1,544,344.43	
	AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	51,210	26.20	1,341,702.00	
	FIRSTRAND LTD	158,019	13.77	2,175,921.63	
	MTN GROUP LTD	69,566	119.50	8,313,137.00	
小計	銘柄数：12			34,803,685.64	
				(415,904,043)	
	組入時価比率：7.5%			7.8%	
合計				5,340,599,482	
				(5,340,599,482)	

（注1）通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

（注2）合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

（注3）比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

（2）株式以外の有価証券

（平成21年 5月29日現在）

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額	備考
オプション証券等	米ドル	AIR ARABIA(CW/ML) 8/13/2010		405,500.00	108,755.10	
		SBERBANK(CW/DB)2/28/2018		59,100.00	78,012.00	
		SBERBANK(CW/ML)2/23/2010		141.00	192,397.32	
	小計	銘柄数：	3		379,164.42	
					(36,581,783)	
		組入時価比率：	0.7%		100.0%	
	オプション証券等計				36,581,783	
					(36,581,783)	
	合計				36,581,783	
					(36,581,783)	

（注1）通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

（注2）合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

（注3）比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2. 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

(単位：円)

区分	種類	平成21年 5月29日現在			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	63,589,558	—	64,433,608	844,050
	米ドル	22,901,358	—	23,297,154	395,796
	ブラジルレアル	2,111,875	—	2,118,010	6,135
	香港ドル	21,594,288	—	21,889,603	295,315
	南アフリカランド	16,982,037	—	17,128,841	146,804
	売建	79,890,858	—	80,898,342	△ 1,007,484
	米ドル	56,989,500	—	57,572,539	△ 583,039
	香港ドル	14,488,989	—	14,689,734	△ 200,745
	南アフリカランド	8,412,369	—	8,636,069	△ 223,700
	合計	143,480,416	—	145,331,950	△ 163,434

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

- 1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。
 - ① 計算期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 - ② 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

「グローバル・リート・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

対象年月日	(平成21年1月9日現在)	(平成21年7月9日現在)
科 目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
I 流動資産		
預金	2,560,652,450	2,775,139,663
コール・ローン	915,808,747	906,674,166
投資証券	92,752,102,283	98,046,660,396
派生商品評価勘定	—	6,570,000
未収入金	183,993,318	500,000,000
未収配当金	812,728,888	558,721,366
未収利息	3,763	1,987
流動資産合計	97,225,289,449	102,793,767,578
資産合計	97,225,289,449	102,793,767,578
負債の部		
I 流動負債		
派生商品評価勘定	—	17,543,132
未払金	843,166,008	1,648,515,691
流動負債合計	843,166,008	1,666,058,823
負債合計	843,166,008	1,666,058,823
純資産の部		
I 元本等		
1 元本		
元本	120,701,283,185	140,137,865,146
元本合計	120,701,283,185	140,137,865,146
2 剰余金		
欠損金	24,319,159,744	39,010,156,391
剰余金合計	△24,319,159,744	△39,010,156,391
元本等合計	96,382,123,441	101,127,708,755

純資産合計	96,382,123,441	101,127,708,755
負債・純資産合計	97,225,289,449	102,793,767,578

（注）「グローバル・リート・マザーファンド」は、毎月17日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年1月9日並びに平成21年7月9日現在における同マザーファンドの状況です。

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	自 平成20年 7月10日 至 平成21年 1月 9日	自 平成21年 1月10日 至 平成21年 7月 9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、取引所または店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	投資証券（売買目的有価証券） 同 左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によっております。	為替予約取引 同 左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	受取配当金の計上基準 同 左
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいて処理しております。	外貨建資産等の会計処理 同 左

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成21年 1月 9日現在）	（平成21年 7月 9日現在）
1. 受益権総数	平成21年 1月 9日現在における受益権の総数 120,701,283,185口	平成21年 7月 9日現在における受益権の総数 140,137,865,146口
2. 元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の 6 第10号に規定する額 24,319,159,744円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の 6 第10号に規定する額 39,010,156,391円
3. 1 単位当たり純資産額	0.7985円 （1 万口＝7,985円）	0.7216円 （1 万口＝7,216円）

(デリバティブ取引に関する注記)

I. 取引の状況に関する事項

項 目	自 平成20年7月10日 至 平成21年1月9日	自 平成21年1月10日 至 平成21年7月9日
1. 取引の内容	当ファンドが行うことができるデリバティブ取引は次の通りです。 ①外国為替の売買の予約取引。	同 左
2. 取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては、投資信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。	同 左
3. 取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため。なお、外貨建資産に対する為替ヘッジは原則行いません。	同 左
4. 取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。	同 左
5. 取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図る為に運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況に係る、投資信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等に係るチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。	同 左
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。	同 左

II. 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

通貨関連

（平成21年1月9日現在）

平成21年1月9日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成21年7月9日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場外取引	為替予約取引				
	買 建				
	ユーロ	500,000,000	—	491,657,778	△8,342,222
	オーストラリアドル	393,780,000	—	384,579,090	△9,200,910
	売 建				
	ユーロ	393,780,000	—	387,210,000	6,570,000
	買建 合計	893,780,000	—	876,236,868	△17,543,132
	売建 合計	393,780,000	—	387,210,000	6,570,000

（注）時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法について

計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。

- ①計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。
- ②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。
 - ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
 - ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成20年7月10日 至 平成21年1月9日）

該当事項はありません。

（自 平成21年1月10日 至 平成21年7月9日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年1月9日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	112,683,127,580円
同期中における追加設定元本額	18,279,905,673円
同期中における一部解約元本額	10,261,750,068円
平成21年1月9日現在における元本の内訳	
三井住友・グローバル・リート・オープン	39,318,188,549円
三井住友・グローバル・リート・オープン（3カ月決算型）	5,340,924,256円
グローバル3資産ファンド	70,756,797,940円
三井住友・グローバル・リート・オープン（1年決算型）	890,115,604円
グローバル不動産投信（隔月決算型）	3,618,914,061円
ニュー・グローバル・バランス・ファンド	636,307,783円
DCグローバル・リート・オープン	596,726円
SMAM・年金グローバルリートファンド＜適格機関投資家限定＞	62,178,439円
グローバル・リート・ファンドVA＜適格機関投資家限定＞	77,259,827円
合 計	120,701,283,185円

(平成21年7月9日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	120,701,283,185円
同期中における追加設定元本額	32,177,021,733円
同期中における一部解約元本額	12,740,439,772円
平成21年7月9日現在における元本の内訳	
三井住友・グローバル・リート・オープン	59,207,701,848円
三井住友・グローバル・リート・オープン（3カ月決算型）	5,469,808,841円
グローバル3資産ファンド	69,970,391,347円
三井住友・グローバル・リート・オープン（1年決算型）	1,027,663,384円
グローバル不動産投信（隔月決算型）	3,475,395,850円

ニュー・グローバル・バランス・ファンド	788,829,959円
DCグローバル・リート・オープン	596,726円
SMAM・年金グローバルリートファンド＜適格機関投資家限定＞	62,178,439円
グローバル・リート・ファンドVA＜適格機関投資家限定＞	135,298,752円
合 計	140,137,865,146円

(3) 附属明細表**①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	口数	評価額	備考
投資証券	日本円			
	日本ビルファンド投資法人	2,119	1,739,699,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,321	1,782,528,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,746	1,196,010,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	3,038	1,847,104,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,681	1,025,410,000	
	小計	10,905	7,590,751,000	単位：円
	米ドル			
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	580,348	30,131,668.16	
	BOSTON PROPERTIES INC	736,396	32,357,240.24	
	BRANDYWINE REALTY TRUST	1,154,853	8,176,359.24	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	795,584	20,756,786.56	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	139,186	4,918,833.24	
	DOUGLAS EMMETT INC	2,123,785	17,351,323.45	
	EASTGROUP PROPERTIES INC	565,740	18,522,327.60	
	ENTERTAINMENT PROPERTIES TRUST	393,044	7,676,149.32	
	EQUITY RESIDENTIAL	398,778	7,991,511.12	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	172,258	10,109,822.02	
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	511,841	25,162,103.56	
	HCP,INC.	772,936	16,022,963.28	
	HEALTH CARE REIT INC	593,421	20,425,550.82	
	HOME PROPERTIES INC	265,286	8,077,958.70	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	1,201,808	8,773,198.40	
	KILROY REALTY CORP	380,741	7,275,960.51	
	KIMCO REALTY CORPORATION	945,284	8,346,857.72	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	842,211	14,149,144.80	
	NATIONWIDE HEALTH PROPERTIES INC	619,980	16,014,083.40	
	PROLOGIS	1,059,009	7,285,981.92	
	PUBLIC STORAGE	233,385	14,801,276.70	

	REGENCY CENTERS CORP	465,440	14,828,918.40	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	1,227,193	58,377,571.01	
	TAUBMAN CENTERS INC	585,405	13,698,477.00	
	VENTAS INS	508,201	14,570,122.67	
	VORNADO REALTY TRUST	313,238	12,830,228.48	
	米ドル 小計	17,585,351	418,632,418.32	
	(邦貨換算額)		(38,916,069,607)	(単位：円)
	カナダドル			
	BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	673,405	21,346,938.50	
	CANADIAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,748,944	41,904,698.24	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	463,991	6,690,750.22	
	カナダドル 小計	2,886,340	69,942,386.96	
	(邦貨換算額)		(5,590,494,989)	(単位：円)
	ユーロ			
	COFINIMMO	38,286	3,014,256.78	
	CORIO NV	154,500	5,075,325.00	
	ICADE	205,000	12,060,150.00	
	SOCIETE DE LA TOUR EIFFEL	316,374	7,577,157.30	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	540,000	58,179,600.00	
	VASTNED OFFICES/INDUSTRIAL	550,000	5,236,000.00	
	WERELDHAVE NV	34,600	1,795,048.00	
	ユーロ 小計	1,838,760	92,937,537.08	
	(邦貨換算額)		(11,996,377,286)	(単位：円)
	英ポンド			
	BRITISH LAND CO PLC	4,200,000	14,931,000.00	
	HAMMERSON PLC	4,800,000	13,680,000.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	5,350,000	22,296,125.00	
	SEGRO PLC	112,500,000	25,875,000.00	
	英ポンド 小計	126,850,000	76,782,125.00	
	(邦貨換算額)		(11,480,463,330)	(単位：円)
	オーストラリアドル			
	CHALLENGER DIVERSIFIED PROPERTY GROUP	9,137,904	4,386,193.92	
	DEXUS PROPERTY GROUP	23,270,647	16,289,452.90	

	GOODMAN GROUP	15,513,764	6,593,349.70	
	GPT GROUP	34,905,970	18,500,164.10	
	MACQUARIE OFFICE TRUST	55,849,552	11,169,910.40	
	MIRVAC GROUP	24,172,218	25,864,273.26	
	STOCKLAND	12,551,572	38,282,294.60	
	WESTFIELD GROUP	11,476,833	125,556,553.02	
	オーストラリアドル 小計	186,878,460	246,642,191.90	
	(邦貨換算額)		(17,871,693,225)	(単位：円)
	シンガポールドル			
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,980,275	15,768,834.50	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	16,974,000	13,494,330.00	
	CAPITAMALL TRUST	9,692,000	13,374,960.00	
	LIPPO-MAPLETREE INDONESIA RETAIL TRUST	24,052,000	8,658,720.00	
	SUNTEC REIT	23,588,000	21,111,260.00	
	シンガポールドル 小計	84,286,275	72,408,104.50	
	(邦貨換算額)		(4,600,810,959)	(単位：円)
	合 計		98,046,660,396	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(90,455,909,396)	(単位：円)

(注)

1. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書きであります。
2. 米ドル表示の投資証券については、26銘柄、信託財産純資産総額に対する比率38.5%、合計に対する比率43.0%です。
カナダドル表示の投資証券については、3銘柄、信託財産純資産総額に対する比率5.5%、合計に対する比率6.2%です。
ユーロ表示の投資証券については、7銘柄、信託財産純資産総額に対する比率11.9%、合計に対する比率13.3%です。
英ポンド表示の投資証券については、4銘柄、信託財産純資産総額に対する比率11.4%、合計に対する比率12.7%です。
オーストラリアドル表示の投資証券については、8銘柄、信託財産純資産総額に対する比率17.7%、合計に対する比率19.8%です。
シンガポールドル表示の投資証券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率4.5%、合計に対する比率5.1%です。

②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

※「（デリバティブ取引に関する注記）Ⅱ．取引の時価等に関する事項」に同様の内容が記載されている為、省略しております。

2 【ファンドの現況】**【純資産額計算書】**

平成21年8月31日現在

I 資産総額	6,694,196,072 円
II 負債総額	43,404,645 円
III 純資産総額(I － II)	6,650,791,427 円
IV 発行済口数	10,128,512,464 口
V 1口当たり純資産額(III／IV)	0.6566 円
（ 1 万口当たり純資産額	6,566 円）

第5 【設定及び解約の実績】

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
特定1期	1,000,000	—
特定2期	8,700,136,567	1,930,146
特定3期	2,580,051,481	287,790,074
特定4期	223,499,716	428,894,233
特定5期	121,358,659	677,033,783
特定6期	121,933,668	201,718,834

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

第三部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	平成21年8月31日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減
該当ありません。

ハ 会社の機構

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

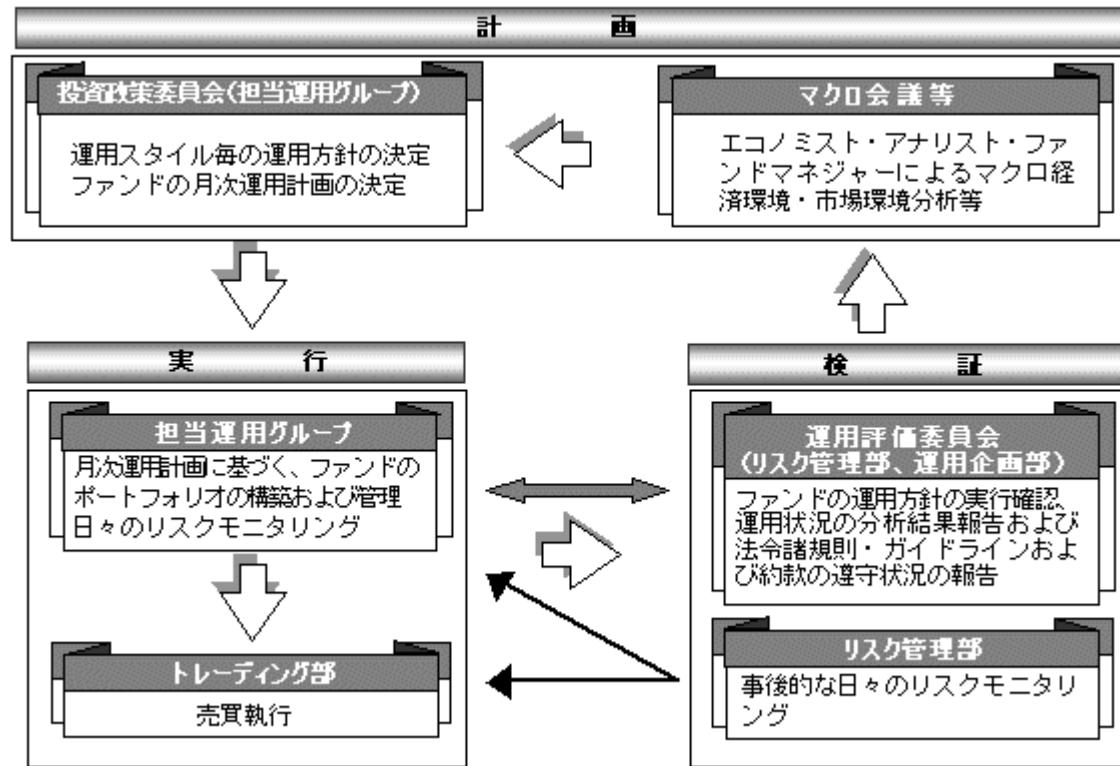
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

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

ニ 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成21年8月31日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成21年8月31日現在、単位：百万円）

		本 数	純資産総額
株式投資信託	単位型	77 (1)	204,209 (193)
	追加型	225 (103)	3,624,283 (2,440,929)
	計	302 (104)	3,828,492 (2,441,122)
公社債投資信託	単位型	0 (0)	0 (0)
	追加型	0 (0)	0 (0)
	計	0 (0)	0 (0)
合 計		302 (104)	3,828,492 (2,441,122)

※（ ）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、第23期（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しており、第24期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）については、改正後の「財務諸表等規則」並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、第23期（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）及び第24期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、あずさ監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

		第 23 期	第 24 期
		(平成20年3月31日現在)	(平成21年3月31日現在)
(資 産 の 部)			
流動資産			
現金及び預金	※ 2	18,130,988	15,883,303
有価証券		5,994,478	2,998,947
前払費用		222,628	323,949
未収入金		-	3,593
未収委託者報酬		4,184,389	2,158,082
未収運用受託報酬		1,008,548	635,902
未収投資助言報酬	※ 2	493,368	406,959
未収収益		8,180	8,062
未収還付法人税等		-	1,068,737
未収還付消費税等		-	182,000
繰延税金資産		439,833	68,795
その他の流動資産		24,816	2,641
流動資産計		30,507,231	23,740,977
固定資産			
有形固定資産	※ 1		
建物		169,017	169,629
器具備品		225,583	200,701
有形固定資産合計		394,601	370,331
無形固定資産	※ 1		
電話加入権		173	161
商標権		10,048	8,104
無形固定資産合計		10,222	8,266
投資その他の資産			
投資有価証券		1,598,911	2,542,125

関係会社株式	236,178	236,178
長期差入保証金	702,453	783,231
長期前払費用	18,200	14,643
会員権	17,113	20,113
繰延税金資産	15,024	34,393
投資その他の資産合計	2,587,882	3,630,686
固定資産計	2,992,706	4,009,284
資産合計	33,499,937	27,750,261

(単位：千円)

	第 23 期 (平成20年3月31日現在)	第 24 期 (平成21年3月31日現在)
(負 債 の 部)		
流動負債		
預り金	40,052	44,497
未払金		
未払収益分配金	2,787	947
未払償還金	28,571	23,376
未払手数料	※ 2 1,727,481	891,493
その他未払金	149,275	112,743
未払費用	760,613	612,126
未払消費税等	366,587	-
未払法人税等	3,334,415	-
前受収益	5,985	-
賞与引当金	375,721	291,836
その他の流動負債	254	-
流動負債計	6,791,746	1,977,020
固定負債		
退職給付引当金	749,327	972,202
固定負債計	749,327	972,202
負債合計	7,541,073	2,949,223
(純 資 産 の 部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		

利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	13,483,283	12,356,655
利益剰余金合計	15,304,488	14,177,860
株主資本計	25,933,472	24,806,844
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	25,392	△ 5,805
評価・換算差額等計	25,392	△ 5,805
純資産合計	25,958,864	24,801,038
負債・純資産合計	33,499,937	27,750,261

（２）【損益計算書】

(単位：千円)

	第 23 期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第 24 期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	32,260,683	20,072,582
運用受託報酬	4,320,395	3,506,635
投資助言報酬	2,276,198	2,048,748
その他営業収益		
情報提供コンサルタント業務報酬	5,000	5,000
投資法人運用受託報酬	75,471	60,260
その他	-	2,749
営業収益計	38,937,748	25,695,976
営業費用		
支払手数料	15,226,126	9,326,200
広告宣伝費	834,129	529,276
公告費	8,062	1,227
受益証券発行費	218	-
調査費		
調査費	541,419	538,515
委託調査費	2,298,023	1,310,113
営業雑経費		
通信費	27,577	30,202
印刷費	325,929	302,661
協会費	18,986	23,322
諸会費	15,281	14,373
情報機器関連費	1,936,376	2,036,426
販売促進費	36,029	55,223
その他	60,681	55,485
営業費用計	21,328,842	14,223,029

一般管理費		
給料		
役員報酬	166,266	174,486
給料・手当	3,698,904	4,004,575
賞与	1,119,415	1,051,279
賞与引当金繰入額	375,721	291,836
交際費	20,571	23,229
寄付金	-	4,000
事務委託費	250,163	356,543
旅費交通費	249,775	258,981
租税公課	116,931	81,166
不動産賃借料	624,843	762,812
退職給付費用	277,530	262,634
固定資産減価償却費	149,507	119,811
諸経費	398,374	281,968
一般管理費計	7,448,006	7,673,326
営業利益	10,160,899	3,799,620

営業外収益		
受取配当金	8,036	-
有価証券利息	7,450	22,216
受取利息	※ 1	34,555
為替差益	634	11,209
時効成立分配金・償還金	5,827	7,832
原稿・講演料	4,424	3,910
雑収入	3,743	4,132
営業外収益計	64,671	85,555
営業外費用		
時効成立後支払分配金・償還金	1,826	693
雑損失	0	82
営業外費用計	1,826	775
経常利益	10,223,744	3,884,401
特別利益		
貸倒引当金戻入益	25,000	-
投資有価証券償還益	5,787	1,136
投資有価証券売却益	124,622	122
ゴルフ会員権売却益	5,555	-
特別利益計	160,966	1,259
特別損失		
固定資産除却損	※ 2	12,288
投資有価証券償還損	503	84,238
投資有価証券評価損	17,700	65,553
投資有価証券売却損	56	464,272
投資有価証券清算損	256	-
ゴルフ会員権売却損	24,476	-
特別損失計	55,282	614,753
税引前当期純利益	10,329,428	3,270,907
法人税、住民税及び事業税	4,544,339	1,206,047
法人税等調整額	△134,250	369,088
法人税等合計	4,410,088	1,575,135

当期純利益		
	5,919,339	1,695,771

（３）【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第 23 期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第 24 期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,000	2,000,000
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	284,245	284,245
当期末残高	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		
前期末残高	60,000	60,000
当期末残高	60,000	60,000
特別償却準備金		
前期末残高	9,041	-
当期変動額		
特別償却準備金取崩	△ 9,041	-
当期変動額合計	△ 9,041	-
当期末残高	-	-
別途積立金		

前期末残高	1,476,959	1,476,959
当期末残高	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金		
前期末残高	8,613,302	13,483,283
当期変動額		
特別償却準備金取崩	9,041	-
剰余金の配当	△ 1,058,400	△ 2,822,400
当期純利益	5,919,339	1,695,771
当期変動額合計	4,869,980	△ 1,126,628
当期末残高	13,483,283	12,356,655
利益剰余金合計		
前期末残高	10,443,548	15,304,488
当期変動額		
剰余金の配当	△ 1,058,400	△ 2,822,400
当期純利益	5,919,339	1,695,771
当期変動額合計	4,860,939	△ 1,126,628
当期末残高	15,304,488	14,177,860

株主資本合計		
前期末残高	21,072,532	25,933,472
当期変動額		
剰余金の配当	△ 1,058,400	△ 2,822,400
当期純利益	5,919,339	1,695,771
当期変動額合計	4,860,939	△ 1,126,628
当期末残高	25,933,472	24,806,844
評価・換算差額等		
 その他有価証券評価差額金		
前期末残高	433,303	25,392
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 407,911	△ 31,197
当期変動額合計	△ 407,911	△ 31,197
当期末残高	25,392	△ 5,805
評価・換算差額合計		
前期末残高	433,303	25,392
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 407,911	△ 31,197
当期変動額合計	△ 407,911	△ 31,197
当期末残高	25,392	△ 5,805
純資産合計		
前期末残高	21,505,836	25,958,864
当期変動額		
剰余金の配当	△ 1,058,400	△ 2,822,400
当期純利益	5,919,339	1,695,771
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 407,911	△ 31,197
当期変動額合計	4,453,028	△ 1,157,826
当期末残高	25,958,864	24,801,038

重要な会計方針

項 目	第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	満期保有目的の債券 償却原価法 子会社株式 移動平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの 移動平均法による原価法	満期保有目的の債券 同左 子会社株式 同左 その他有価証券 時価のあるもの 同左 時価のないもの 同左
2 固定資産の減価償却の方法	有形固定資産 定率法によっております。但し、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)については、定額法によっております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3～50年 器具備品 3～20年 無形固定資産 定額法によっております。	有形固定資産 同左 無形固定資産 同左
3 引当金の計上基準 (1) 賞与引当金 (2) 退職給付引当金	従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当期の負担額を計上しております。 従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき計上しております。	同左 従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき計上しております。 過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。 数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4 リース取引の処理方法	リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。
5 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は税抜方式によっております。	同左

会計方針の変更

(会計処理の変更)

第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
有形固定資産の減価償却の方法 法人税法の改正（（所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日 法律第6号）及び（法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号））に伴い、当事業年度から平成19年4月1日以降に取得したもののについては、改正後の法人税法に基づく方法に変更しております。 なお、この変更による影響は軽微であります。	—
—	リース取引に関する会計基準 所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、企業会計基準第13号「リース取引に関する会計基準」（平成19年3月30日 企業会計基準委員会）及び企業会計基準適用指針第16号「リース取引に関する会計基準の適用指針」（同前）が平成20年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当事業年度から同会計基準及び適用指針を適用しております。 当事業年度において、通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理による取引はありません。

(表示方法の変更)

第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
1.前事業年度において区分掲記しておりました「現金」（当事業年度877千円）及び「預金」（当事業年度18,130,111千円）は、金融商品取引法の施行により「現金及び預金」として表示しております。 2.金融商品取引法の施行に伴い、区分表示をより明瞭にするため、以下の表示方法の変更を行っております。 (貸借対照表) 前事業年度において「未収投資顧問料」として表示しておりました投資一任契約の未収運用受託報酬及び投資顧問（助言）契約の未収投資助言報酬は、当事業年度においては「未収運用受託報酬」及び「未収投資助言報酬」として区分して表示しております。なお、前事業年度における「未収運用受託報酬」及び「未収投資助言報酬」は、それぞれ1,001,467千円、444,216千円であります。 (損益計算書) 前事業年度において「投資顧問料」として表示しておりました投資一任契約の運用受託報酬及び投資顧問（助言）契約の投資助言報酬は、当事業年度においては「運用受託報酬」及び「投資助言報酬」として区分して表示しております。なお、前事業年度における「運用受託報酬」及び「投資助言報酬」は、それぞれ3,970,091千円、2,451,535千円であります。 3.前事業年度において区分掲記しておりました「時効成立分配金」（当事業年度53千円）及び「時効成立償還金」（当事業年度5,773千円）は、金額的重要性が乏しいため、「時効成立分配金・償還金」として表示しております。	—

(追加情報)

第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
(有形固定資産の減価償却の方法) 当事業年度から、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。なお、この変更による影響は軽微であります。 (退職給付会計) 退職給付債務の算定にあたり、従来、簡便法によっておりましたが、従業員の増加に伴い、当事業年度より原則法による算定方法に変更しております。 この結果、従来と同一の方法を採用した場合と比べ、営業利益、経常利益、税引前当期純利益及び当期純利益は、それぞれ123,774千円減少しております。 また、この変更は従業員の増加等に伴い、当下期に行ったため、当中間会計期間は、前事業年度と同一の方法によっております。従って当中間会計期間は、変更後の方法によった場合に比べ、営業利益、経常利益及び税引前中間純利益及び中間純利益は128,390千円多く計上されております。	—

注 記 事 項

(貸借対照表関係)

第23期 (平成20年3月31日現在)	第24期 (平成21年3月31日現在)
※1 有形固定資産の減価償却累計額 建 物 126,027千円 器具備品 859,261千円 無形固定資産の減価償却累計額 電話加入権 60千円 ソフトウェア 111,411千円 商標権 9,393千円	※1 有形固定資産の減価償却累計額 建 物 150,704千円 器具備品 941,423千円 無形固定資産の減価償却累計額 電話加入権 72千円 商標権 11,337千円
※2 関係会社に対する債権債務 現金及び預金 12,481,426千円 未収投資助言報酬 478,296千円 未払手数料 509,702千円	※2 関係会社に対する債権債務 現金及び預金 10,311,398千円 未収投資助言報酬 398,818千円 未払手数料 331,400 千円
3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。 当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。 当座貸越極度額の総額 10,000,000千円 借入実行残高 一十千円	3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。 当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。 当座貸越極度額の総額 10,000,000千円 借入実行残高 一十千円

差引額	10,000,000千円	差引額	10,000,000千円
4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額149,005千円の支払保証を行っております。		4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額128,926千円の支払保証を行っております。	

(損益計算書関係)

第23期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
※1 関係会社との取引に係るもの 受取利息 24,820千円	※1 関係会社との取引に係るもの 受取利息 18,943千円
※2 固定資産除却損は、器具備品12,082千円、電話加入権206千円であります。	※2 固定資産除却損は、器具備品688千円であります。

(株主資本等変動計算書関係)

第23期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

	前期末株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	—	—	17,640株

2.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成19年6月25日 定時株主総会	普通株式	1,058,400	60,000	平成19年 3月31日	平成19年 6月26日

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

平成20年6月23日開催の第23回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成20年6月23日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,822,400	160,000	平成20年 3月31日	平成20年 6月24日

第24期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

	前期末株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	—	—	17,640株

2.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成20年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000	平成20年 3月31日	平成20年 6月24日

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

平成21年6月30日開催の第24回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成21年6月30日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	846,720	48,000	平成21年 3月31日	平成21年 7月1日

(リース取引関係)

第23期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)																								
1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 (借主側) ①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額(単位：千円)	1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 (借主側) ①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額(単位：千円)																								
<table><tr><td></td><td>器具備品</td><td>合計</td></tr><tr><td>取得価額相当額</td><td>9,504</td><td>9,504</td></tr><tr><td>減価償却累計額相当額</td><td>7,603</td><td>7,603</td></tr><tr><td>期末残高相当額</td><td>1,900</td><td>1,900</td></tr></table>		器具備品	合計	取得価額相当額	9,504	9,504	減価償却累計額相当額	7,603	7,603	期末残高相当額	1,900	1,900	<table><tr><td></td><td>器具備品</td><td>合計</td></tr><tr><td>取得価額相当額</td><td>5,330</td><td>5,330</td></tr><tr><td>減価償却累計額相当額</td><td>5,330</td><td>5,330</td></tr><tr><td>期末残高相当額</td><td>-</td><td>-</td></tr></table>		器具備品	合計	取得価額相当額	5,330	5,330	減価償却累計額相当額	5,330	5,330	期末残高相当額	-	-
	器具備品	合計																							
取得価額相当額	9,504	9,504																							
減価償却累計額相当額	7,603	7,603																							
期末残高相当額	1,900	1,900																							
	器具備品	合計																							
取得価額相当額	5,330	5,330																							
減価償却累計額相当額	5,330	5,330																							
期末残高相当額	-	-																							
②未経過リース料期末残高相当額(単位：千円)	②未経過リース料期末残高相当額(単位：千円)																								
<table><tr><td>1年以内</td><td>2,030</td></tr><tr><td>合計</td><td>2,030</td></tr></table>	1年以内	2,030	合計	2,030	<table><tr><td>1年以内</td><td>-</td></tr><tr><td>合計</td><td>-</td></tr></table>	1年以内	-	合計	-																
1年以内	2,030																								
合計	2,030																								
1年以内	-																								
合計	-																								
③支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 (単位：千円)	③支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 (単位：千円)																								
<table><tr><td>支払リース料</td><td>2,067</td></tr><tr><td>減価償却費相当額</td><td>1,900</td></tr><tr><td>支払利息相当額</td><td>104</td></tr></table>	支払リース料	2,067	減価償却費相当額	1,900	支払利息相当額	104	<table><tr><td>支払リース料</td><td>2,067</td></tr><tr><td>減価償却費相当額</td><td>1,900</td></tr><tr><td>支払利息相当額</td><td>37</td></tr></table>	支払リース料	2,067	減価償却費相当額	1,900	支払利息相当額	37												
支払リース料	2,067																								
減価償却費相当額	1,900																								
支払利息相当額	104																								
支払リース料	2,067																								
減価償却費相当額	1,900																								
支払利息相当額	37																								
④減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法	④減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法																								
減価償却費相当額の算定方法	減価償却費相当額の算定方法																								
・リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。	・同左																								
利息相当額の算定方法	利息相当額の算定方法																								
・リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。	・同左																								
2.オペレーティング・リース取引	2.オペレーティング・リース取引																								

(借主側)			(借主側)		
未経過リース料 (単位:千円)			未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円)		
1年以内		1,119	1年以内		710,121
1年超		1,959	1年超		962,627
合計		3,078	合計		1,672,748

(有価証券関係)

第23期(平成20年3月31日現在)

1.満期保有目的の債券で時価のあるもの

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	—	—	—
小計	—	—	—
(2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの	5,994,478	5,993,700	△778
小計	5,994,478	5,993,700	△778
合計	5,994,478	5,993,700	△778

2.その他有価証券で時価のあるもの

(単位：千円)

区分	取得原価	貸借対照表計上額	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	800,100	877,780	77,680
小計	800,100	877,780	77,680
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	655,700	620,832	△34,867
小計	655,700	620,832	△34,867
合計	1,455,800	1,498,613	42,813

3.時価評価されていない有価証券の内容及び貸借対照表計上額

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	摘要
(1)子会社株式 子会社株式	236,178	
合計	236,178	
(2)その他有価証券 非上場株式 投資証券	298 100,000	
合計	100,298	

4.当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
-----	---------	---------

628,566	124,622	56
---------	---------	----

5. その他有価証券のうち満期があるもの及び満期保有目的の債券の決算日後における償還予定額

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
(1)満期保有目的の債券 国債・地方債等	6,000,000	—	—	—
小計	6,000,000	—	—	—
(2)その他有価証券	—	—	—	—
小計	—	—	—	—
合計	6,000,000	—	—	—

第24期(平成21年3月31日現在)

1.満期保有目的の債券で時価のあるもの

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	—	—	—
小計	—	—	—
(2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの	2,998,947	2,998,800	△147
小計	2,998,947	2,998,800	△147
合計	2,998,947	2,998,800	△147

2.その他有価証券で時価のあるもの

(単位：千円)

区分	取得原価	貸借対照表計上額	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	329,907	346,809	16,902
小計	329,907	346,809	16,902
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	2,117,725	2,095,017	△22,707
小計	2,117,725	2,095,017	△22,707
合計	2,447,632	2,441,827	△5,805

3.時価評価されていない有価証券の内容及び貸借対照表計上額

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	摘要
(1)子会社株式 子会社株式	236,178	
合計	236,178	
(2)その他有価証券 非上場株式 投資証券	298 100,000	
合計	100,298	

4.当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
882,530	122	464,272

5. 其他有価証券のうち満期があるもの及び満期保有目的の債券の決算日後における償還予定額

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
(1)満期保有目的の債券 国債・地方債等	3,000,000	—	—	—
小計	3,000,000	—	—	—
(2)其他有価証券	—	—	—	—
小計	—	—	—	—
合計	3,000,000	—	—	—

（デリバティブ取引関係）

第23期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

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。

第24期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

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）

第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)																						
1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております	1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。																						
2. 退職給付債務の額 (単位：千円) <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td style="text-align: right;">749,327</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td style="text-align: right;">749,327</td></tr> </table>	退職給付債務	749,327	退職給付引当金	749,327	2. 退職給付債務の額 (単位：千円) <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td style="text-align: right;">972,202</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td style="text-align: right;">972,202</td></tr> </table>	退職給付債務	972,202	退職給付引当金	972,202														
退職給付債務	749,327																						
退職給付引当金	749,327																						
退職給付債務	972,202																						
退職給付引当金	972,202																						
3. 退職給付費用の額 (単位：千円) <table> <tr> <td>勤務費用</td><td style="text-align: right;">126,881</td></tr> <tr> <td>利息費用</td><td style="text-align: right;">9,519</td></tr> <tr> <td>簡便法から原則法への変更による差額</td><td style="text-align: right;">125,138</td></tr> <tr> <td>その他</td><td style="text-align: right;">15,991</td></tr> <tr> <td>退職給付費用</td><td style="text-align: right;">277,530</td></tr> </table>	勤務費用	126,881	利息費用	9,519	簡便法から原則法への変更による差額	125,138	その他	15,991	退職給付費用	277,530	3. 退職給付費用の額 (単位：千円) <table> <tr> <td>勤務費用</td><td style="text-align: right;">145,258</td></tr> <tr> <td>利息費用</td><td style="text-align: right;">12,449</td></tr> <tr> <td>過去勤務債務の費用処理額</td><td style="text-align: right;">87,363</td></tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td><td style="text-align: right;">6,153</td></tr> <tr> <td>その他</td><td style="text-align: right;">11,409</td></tr> <tr> <td>退職給付費用</td><td style="text-align: right;">262,634</td></tr> </table>	勤務費用	145,258	利息費用	12,449	過去勤務債務の費用処理額	87,363	数理計算上の差異の費用処理額	6,153	その他	11,409	退職給付費用	262,634
勤務費用	126,881																						
利息費用	9,519																						
簡便法から原則法への変更による差額	125,138																						
その他	15,991																						
退職給付費用	277,530																						
勤務費用	145,258																						
利息費用	12,449																						
過去勤務債務の費用処理額	87,363																						
数理計算上の差異の費用処理額	6,153																						
その他	11,409																						
退職給付費用	262,634																						
4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 退職給付見込額の期間配分方法 勤務期間を基準とする方法 割引率 1.5%	4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 退職給付見込額の期間配分方法 勤務期間を基準とする方法 割引率 1.5% 過去勤務債務の額の処理年数																						

	1年（発生時において費用処理する方法） 数理計算上の差異の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法）
--	---

(税効果会計関係)

第23期 (平成20年3月31日現在)	第24期 (平成21年3月31日現在)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)
(1) 流動の部 繰延税金資産	(1) 流動の部 繰延税金資産
賞与引当金 152,880	賞与引当金 118,748
未払事業税 260,640	未払社会保険料 12,792
未払社会保険料 13,739	未払事業所税 6,134
未払事業所税 5,846	その他 5,436
その他 6,726	繰延税金資産計 143,111
繰延税金資産計 439,833	評価性引当額 —
評価性引当額 —	繰延税金資産合計 143,111
繰延税金資産合計 439,833	繰延税金負債
繰延税金資産の純額 439,833	未収還付事業税 74,316
	繰延税金負債合計 74,316
	繰延税金資産の純額 68,795
(2) 固定の部 繰延税金資産	(2) 固定の部 繰延税金資産
退職給付引当金 304,901	退職給付引当金 395,589
ソフトウェア償却 78,264	ソフトウェア償却 101,933
投資有価証券評価損 29,953	投資有価証券評価損 56,627
特定外国子会社留保金額 159,153	特定外国子会社留保金額 193,760
その他 13,042	その他有価証券評価差額金 2,362
繰延税金資産計 585,314	その他 14,742
評価性引当額 △552,870	繰延税金資産計 765,014
繰延税金資産合計 32,444	評価性引当額 △730,620
繰延税金負債	繰延税金資産合計 34,393
その他有価証券評価差額金 17,420	繰延税金資産の純額 34,393
繰延税金負債合計 17,420	

繰延税金資産の純額		15,024
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		
	(%)	
法定実効税率	40.7	
(調整)		
評価性引当額の増減	2.4	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1	
住民税均等割等	0.0	
その他	△0.5	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	42.7	
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		
	(%)	
法定実効税率	40.7	
(調整)		
評価性引当額の増減	5.4	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.5	
住民税均等割等	0.2	
その他	1.4	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	48.2	

(関連当事者との取引)

第23期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

(1) 親会社及び法人主要株主等

(単位：千円)

属性	会社等の 名称	住所	資本金、 出資金又 は基金	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有(被 所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の 兼任等	事業上の関係				
その他の 関係会社	住友生命 保険(相)	大阪市 中央区	199,000,000	生命保険業	% (被所有) 直接 35	—	当社の主要顧客 投信の販売委託	投資助言報酬 委託販売手数料	1,324,757 276,418	未収投資 助言報酬 未払手数料	331,981 42,572
その他の 関係会社	三井生命 保険(株)	東京都 千代田区	137,280,000	生命保険業	% (被所有) 直接 30	—	当社の主要顧客 投信の販売委託	投資助言報酬 委託販売手数料	273,276 251,915	未収投資 助言報酬 未払手数料	143,563 88,117
その他の 関係会社	三井住友 海上火災 保険(株)	東京都 中央区	139,595,523	損害保険業	% (被所有) 直接17.5	—	当社の主要顧客 投信の販売委託	投資助言報酬 委託販売手数料	579,567 441,750	未払手数料	53,804
その他の 関係会社	(株)三井 住友銀行	東京都 千代田区	664,986,500	銀行業	% (被所有) 直接17.5	1名	投信の販売委託	委託販売手数料	2,407,945	未払手数料	325,208

(注) 1. 上記金額のうち、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投資助言契約の受託については、当社規定の投資助言料率に基づき決定しております。

(2) その他営業取引については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

(2) 子会社等

(単位：千円)

属性	会社等の 名称	住所	資本金、 出資金又 は基金	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有(被 所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の 兼任等	事業上の関係				
子会社	Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	米国 ニューヨーク	65,334	投資顧問業	% 直接100	出向 2 名	業務委託	調査費	199,897	未払金	2,360
子会社	Sumitomo Mitsui Asset Management (London) Limited	英国 ロンドン	106,622	投資顧問業	% 直接100	出向 2 名	業務委託	調査費	139,844	—	—
子会社	Sumitomo Mitsui Asset Management (Hong Kong) Limited	香港	52,736	投資顧問業	% 直接100	出向 2 名	業務委託	調査費	563,312	未払費用	227,521

（注） 1．取引条件及び取引条件の決定方針等
（１）その他営業取引については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

（３）兄弟会社等

（単位：千円）

属性	会社等の 名称	住所	資本金、 出資金 又は基金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の 兼任等	事業上の関係				
主要株主 の子会社	住生コン ピュー ターサー ビス(株)	大阪市 淀川区	300,000	情報処理 サービス業	%	—	IT機器等購入	IT機器・消耗品購入 IT運用保守サポート等	542,560	前払費用	4,225
							ITサポート			長期前払費用	11,572
主要株主 の子会社	エムエル アイ・シ ステムズ (株)	千葉県 柏市	100,000	情報システ ムの企画、 設計、保守 等	%	—	ITサポート	IT運用保守サポート等	116,364	未払費用	40,881
										未払金	1,412
主要株主 の子会社	エムエル アイ・シ ステムズ (株)	千葉県 柏市	100,000	情報システ ムの企画、 設計、保守 等	%	—	ITサポート	IT運用保守サポート等	116,364	前払費用	560
										未払費用	8,785

（注） 1．上記金額のうち、期末残高には消費税等が含まれております。
2．取引条件及び取引条件の決定方針等
（１）その他営業取引については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

第24期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

(単位：千円)

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金、 出資金 又は基金	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有(被所 有)割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の 関係会社	住友生命 保険(相)	大阪府 大阪市 中央区	199,000,000	生命保険業	% (被所有) 直接 40	当社の主要顧客 投信の販売委託	投資助言報酬 委託販売手数料	1,151,492 227,288	未収投資助言報酬 未払手数料	267,215 34,564
その他の 関係会社	(株)三井 住友銀行	東京都 千代田区	664,986,500	銀行業	% (被所有) 直接27.5	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,114,655	未払手数料	180,287

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投資助言契約の受託については、当社規定の投資助言料率に基づき決定しております。

(2) その他営業取引については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

(追加情報)

当事業年度から平成18年10月17日公表の、「関連当事者の開示に関する会計基準」（企業会計基準委員会 企業会計基準第11号）及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 企業会計基準第13号）を適用しております。

(1 株当たり情報)

第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)		第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)	
1 株当たり純資産額	1,471,590円96銭	1 株当たり純資産額	1,405,954円57銭
1 株当たり当期純利益	335,563円48銭	1 株当たり当期純利益	96,132円19銭
なお、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。		なお、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。	
(1 株当たり純資産額の算定上の基礎)		(1 株当たり純資産額の算定上の基礎)	
貸借対照表の純資産の部の合計額	25,958,864千円	貸借対照表の純資産の部の合計額	24,801,038千円
普通株式に係る純資産額	25,958,864千円	普通株式に係る純資産額	24,801,038千円
普通株式の発行済株式数	17,640株	普通株式の発行済株式数	17,640株
1 株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640株	1 株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640株
(1 株当たり当期純利益の算定上の基礎)		(1 株当たり当期純利益の算定上の基礎)	
損益計算書上の当期純利益	5,919,339千円	損益計算書上の当期純利益	1,695,771千円
普通株式に係る当期純利益	5,919,339千円	普通株式に係る当期純利益	1,695,771千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。		該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	17,640株	普通株式の期中平均株式数	17,640株

(重要な後発事象)

第23期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

該当事項はありません。

第24期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

該当事項はありません。

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。

- イ 自己また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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 通常の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。）または子法人等（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または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等また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。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等また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、また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】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
平成21年6月30日に開催された定時株主総会において、株券不発行会社に移行するため株券を発行することを定める条項を削除する定款変更が決議されました。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

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】

イ 受託会社

- (イ) 名称 住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 287,537百万円（平成21年3月末現在）
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

【参考情報：再信託受託会社の概要】

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円（平成21年3月末現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

- (イ) 名称 株式会社常陽銀行
- (ロ) 資本金の額 85,113百万円（平成21年3月末現在）
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

ハ 投資顧問会社（運用の委託先）

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額※	(ハ) 事業の内容
フォルティス・インベストメント・マネジメント・ネイザーランズ・エヌ・ブイ	1,454千ユーロ	オランダ証券監督庁の監督下で、投資顧問業を営んでおります。
フォルティス・インベストメント・マネジメント・ユーエスエー・インク	243,798千米ドル	米国証券取引委員会の監督下で、投資顧問業を営んでおります。
エービーエヌ・アムロ・アセットマネジメント（アジア）リミテッド	831,667千香港ドル	香港証券監督委員会の監督下で、投資顧問業を営んでおります。

※フォルティス・インベストメント・マネジメント・ネイザーランズ・エヌ・ブイの資本金の額は、平成21年1月末現在、フォルティス・インベストメント・マネジメント・ユーエスエー・インクの資本金の額は平成21年7月末現在、エービーエヌ・アムロ・アセットマネジメント（アジア）リミテッドの資本金の額

は平成21年5月末現在。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、一部解約の実行の請求の受付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

ハ 投資顧問会社（運用の委託先）

委託会社との間で締結される投資一任契約（運用委託契約）に基づき、当ファンドが主要投資対象とするグローバル・リート・マザーファンドの運用指図に関する権限の一部の委託を受け、信託財産の運用を行います。

3【資本関係】

該当ありません。

第3【参考情報】

当計算期間において書類が以下の通り提出されております。

提出年月日	書類名
平成21年 1 月21日	臨時報告書
平成21年 1 月30日	臨時報告書
平成21年 3 月18日	臨時報告書
平成21年 4 月 9 日	有価証券報告書
平成21年 4 月 9 日	有価証券届出書
平成21年 5 月20日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成21年9月8日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員 公認会計士 鈴木 敏夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニュー・グローバル・バランス・ファンドの平成21年1月10日から平成21年7月9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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、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、ニュー・グローバル・バランス・ファンドの平成21年7月9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。

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

以 上

※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。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年3月9日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニュー・グローバル・バランス・ファンドの平成20年7月10日から平成21年1月9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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、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、ニュー・グローバル・バランス・ファンドの平成21年1月9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。

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

以 上

※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。

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月26日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員 公認会計士 鈴木 敏 夫 印
業務執行社員

指 定 社 員 公認会計士 辰 巳 幸 久 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成21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。

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。

独立監査人の監査報告書

平成20年6月23日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員 公認会計士 三 浦 孝 昭 印
業務執行社員

指 定 社 員 公認会計士 橋 本 克 己 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成19年4月1日から平成20年3月31日までの第23期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成20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。

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。