【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成24年10月19日
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目33番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポーティング部長 橋詰 廣志
【電話番号】	03-6737-0521
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	世界経済インデックスファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	上限10兆円
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

1. 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出したこと等に伴い、平成24年4月9日に提出した有価証券届出書（平成24年8月16日付で提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済。以下「原届出書」といいます。）の内容に訂正すべき事項が生じましたので、本訂正届出書を提出するものです。

2. 【訂正の内容】
第一部【証券情報】

原届出書の「第一部 証券情報」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。
（注）下線部＿＿は訂正部分を示します。

(12)その他
＜訂正前＞

（前略）

②受益権の取得申込みの受付の中止等
分配金再投資コースの収益分配金の再投資の場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所<u>および</u>金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場<u>および</u>当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）<u>及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）</u>における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取り消すことができます。

（後略）

＜訂正後＞

（前略）

②受益権の取得申込みの受付の中止等
分配金再投資コースの収益分配金の再投資の場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所<u>及び</u>金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場<u>及び</u>当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、投資対象国における非常事態による市場閉鎖その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取り消すことができます。

（後略）

第二部【ファンド情報】
第1【ファンドの状況】
1 ファンドの性格
(1) ファンドの目的及び基本的性格

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「1 ファンドの性格」「(1) ファンドの目的及び基本的性格」につきましては、該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

③基本的性格

該当情報を以下の内容に訂正します。
（注）下線部＿＿は訂正部分を示します。

＜訂正前＞

（前略）

属性区分表

（中略）

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

（中略）

「資産複合（株式、債券）資産配分固定型」…目論見書又は投資信託約款において、複数資産（株式、債券）を投資対象とし、投資割合については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

（後略）

＜訂正後＞

（前略）

属性区分表

（中略）

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（中略）

「資産複合（株式、債券）資産配分固定型」…目論見書又は投資信託約款において、複数資産（株式、債券）を投資対象とし、投資割合については固定的とする旨の記載があるものをいいます。
当ファンドでは主要投資対象の投資信託証券を通じて複数資産（株式、債券）に投資します。このため、収益の源泉となる資産を記載する商品分類表の投資対象資産が「資産複合」であるのに対して、組み入れている資産そのものを記載する属性区分表の投資対象資産は「その他資産（投資信託証券）」となっています。

（後略）

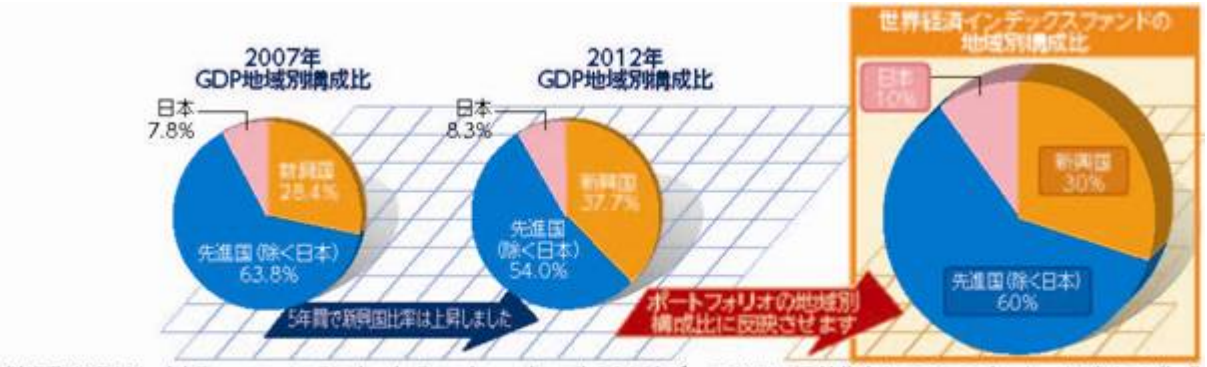
④ファンドの特色

＜2.世界経済全体の発展を享受します。＞、＜3. 魅力的な低コストファンドです。＞及びご参考情報の＜世界経済は新興国の経済成長を下支えとして中長期的な成長が期待されています。＞の説明を以下の情報に更新・訂正します。

＜更新・訂正後＞

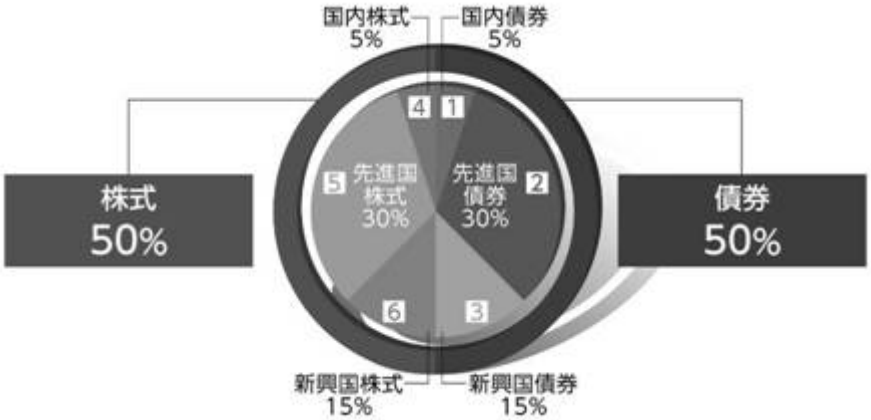
2.世界経済全体の発展を享受します。

・基本組入比率は、地域別（日本、先進国、新興国）のGDP（国内総生産）総額の比率を参考に決定します。
※世界経済に占める各地域のGDPシェアの変化に応じて、原則として年1回地域別構成比の見直しを行う場合があります。



(出所)IMF World Economic Outlook Database(April 2012)データを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※IMFデータについては実績値及びIMF推定値
※上記のファンドの地域別構成比は、2012年8月末現在の基本組入比率であり、実際の組入比率と異なる場合があります。

基本組入比率
（2012年8月末現在）



・基本組入比率には一定の変動幅を設けます。
・基本組入比率は原則として年1回見直しを行う場合があります。また、市場動向等に応じて必要と認める場合には、一定の乖離幅の範囲内で組入比率を調整する場合もあります。

資産	インデックス
1 国内債券	ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス(総合)(NOMURA-BPI 総合)※1
2 先進国債券	シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)※2
3 新興国債券	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)※3
4 国内株式	東証株価指数(TOPIX)※4
5 先進国株式	MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)※5
6 新興国株式	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)※6

＊資産ごとの運用においては、十分な銘柄分散を行い、上記のインデックスに連動する運用収益の獲得を目指します。

※1「ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス（総合）（NOMURA-BPI 総合）」とは、野村證券株式会社（野村證券㈱）が、国内で発行された公募利付債券の流通市場全体の動向を的確に表すために開発した経過利子込時価総額加重型の投資収益指数です。
NOMURA-BPI 総合は、野村證券㈱の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、野村證券㈱が有しています。なお、野村證券㈱は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

※2「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」とは、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インク（CGMI社）が開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場

の時価総額で加重平均した債券インデックス（円ベースの指数）です。
シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）は、CGMI社の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、CGMI社が有しています。なお、CGMI社は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

※3「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド」とは、世界の新興国の債券動向を測るためにJPモルガン社が開発した債券指数で、新興国の現地通貨建て債券で構成されている時価総額を加重平均し、指数化したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン社に帰属します。
「円換算ベース」とは、米ドルベースのインデックスをもとに、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が独自に円換算したものです。

※4「東証株価指数（TOPIX）」とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、株式会社東京証券取引所（以下㈱東京証券取引所といいます。）が公表する株価指数で、東京証券取引所第一部に上場されている全ての銘柄の時価総額で加重平均し、指数化したものです。具体的には、1968年1月4日の東京証券取引所第一部上場全銘柄の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化しています。当該指数は、㈱東京証券取引所の知的財産であり、下記の点をご認識ください。

①TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、㈱東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関する全ての権利及びTOPIXの商標に関する全ての権利は㈱東京証券取引所が有しています。

②㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

③㈱東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

④㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

⑤当ファンドが主要投資対象とする「国内株式インデックス マザーファンド」は、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、当該ファンドの基準価額とTOPIXの指数値が著しく乖離することがあります。

⑥当ファンド及び「国内株式インデックス マザーファンド」は、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

⑦㈱東京証券取引所は、「国内株式インデックス マザーファンド」を投資対象とする当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンド及び「国内株式インデックス マザーファンド」の説明、投資のアドバイスをする義務はありません。

⑧㈱東京証券取引所は、委託会社又は「国内株式インデックス マザーファンド」を投資対象とする当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

⑨前記の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当ファンド及び「国内株式インデックス マザーファンド」の発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

※5「MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）」とは、MSCI社が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要国の株式指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。またMSCI社は、同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

※6「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」とは、世界の新興国の株価動向を測るために、MSCI社が開発した株価指数で、各国の株式市場の時価総額等をベースに算出されます。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、数値の算出、利用その他一切の権利はMSCI社に帰属します。「円換算

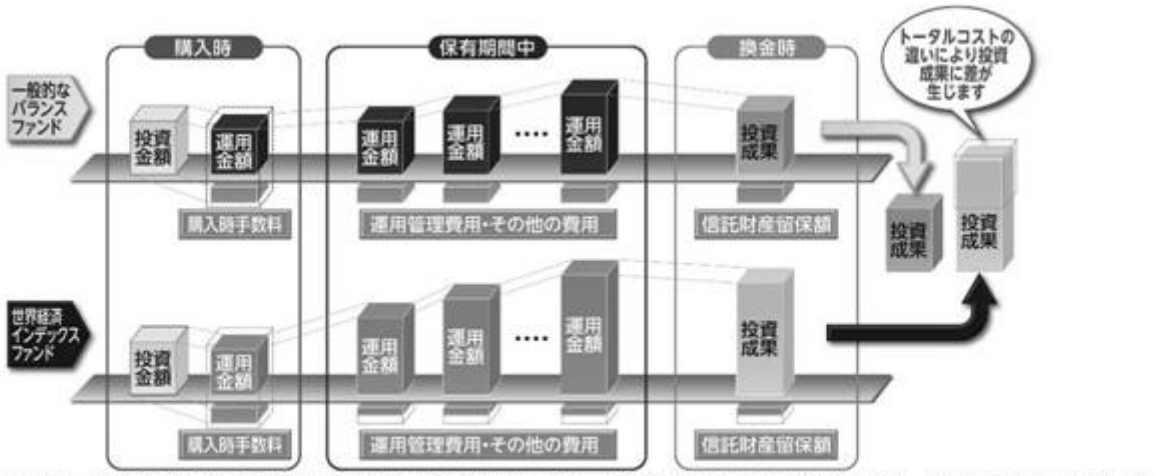
ベース」とは、米ドルベースのインデックスをもとに、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が独自に円換算したものです。

3. 魅力的な低コストファンドです。

・運用管理費用（信託報酬）は純資産総額に対して**年率0.525%（税抜0.5%）**と、魅力的な低コストでご提供します。

※ご換金時には信託財産留保額として換金申込受付日の翌営業日の基準価額の**0.1%**がかかります。なお、一部のマザーファンドの換金に伴う信託財産留保額をファンドが負担します。詳しくは後記「4手数料等及び税金（4)その他の手数料等」をご覧ください。

コストが収益に与える影響（イメージ図）



※上記はコストがファンドの収益に与える影響を分かりやすく説明するために一定の仮定に基づいて作成したイメージ図であり、ファンドに係る全てのコストを網羅したものではありません。また、将来の運用成果を示唆あるいは保証するものではありません。

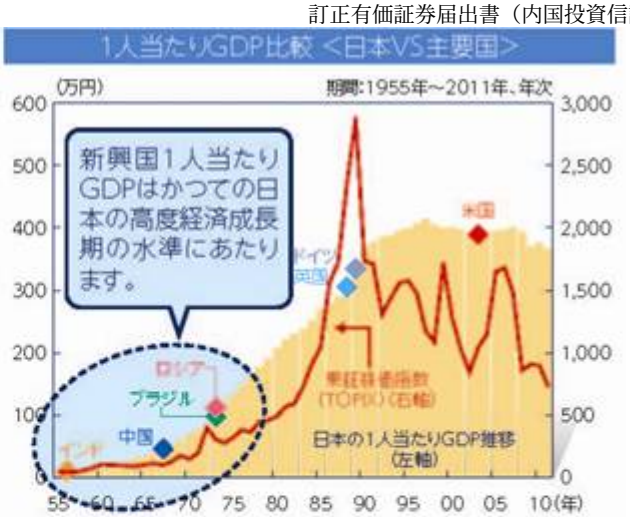
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

+i ご参考情報

世界経済は新興国の経済成長を下支えとして中長期的な成長が期待されています。

・世界人口が増加し人々が生活水準の向上を目指し生産と消費を拡大することで、世界経済は長期にわたり持続的な成長を実現しました。新興国は経済のグローバル化進展による経済発展の恩恵を享受しつつ、今後は世界経済の成長を支えるものと期待されています。

(出所)国連World Population Prospects(The 2010 Revision)及びIMF World Economic Outlook Database(April 2012)データを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※2050年の人口は国連推定、IMFデータについては実績値及びIMF推定値
※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。



(出所)総務省、内閣府、IMF World Economic Outlook Database (April 2012)及びBloombergデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※IMFデータについては実績値及びIMF推定値
※上記新興国が日本と同じ軌跡をたどるとは限りません。
※1人当たりGDPは米ドル建てデータを2012年8月末の三菱東京UFJ銀行の為替データを基に三井住友トラスト・アセットマネジメントが円換算しています。
※指数に関する著作権等の知的財産権、その他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

(3) ファンドの仕組み

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「1 ファンドの性格」「(3) ファンドの仕組み」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。
（注）下線部＿＿は訂正部分を示します。

＜訂正前＞

（前略）

②委託会社の概況

イ．資本金の額：3億円（平成24年4月1日現在）

ロ．（省略）

ハ．大株主の状況（平成24年4月1日現在）

（後略）

＜訂正後＞

（前略）

②委託会社の概況

イ．資本金の額：3億円（平成24年8月31日現在）

ロ．（省略）

ハ．大株主の状況（平成24年8月31日現在）

（後略）

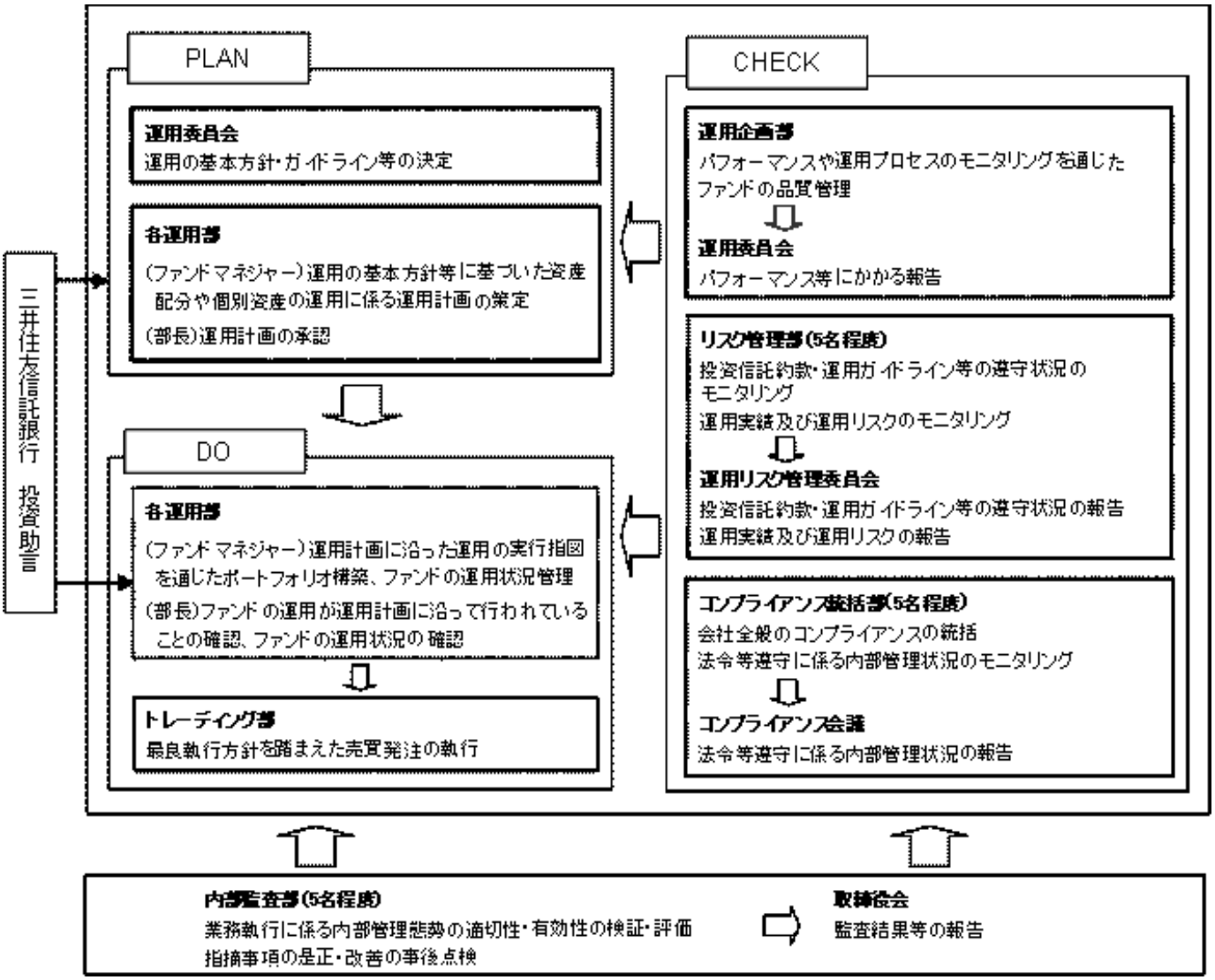
2 投資方針

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」につきましては、該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

(3) 運用体制

＜更新・訂正後＞

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、平成24年10月19日現在のものであり、今後変更されることがあります。



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

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

3 投資リスク

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「3 投資リスク」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部＿＿は訂正部分を示します。

＜訂正前＞

(1)ファンドのリスク

（中略）

＜その他の留意点＞

（中略）

(2)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

①委託会社では、運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行います（運用を外部委託しているファンドも含みます。）。

②モニタリング結果は、原則月1回（必要に応じ随時）開催される運用リスクの管理、コンプライアンスに関する委員会等に報告され、委員会等は適切な運用リスク管理・法令遵守に必要な措置を講じます。

③内部監査部門は、独立した立場でリスク管理体制の適切性・有効性を検証し、評価を行います。

＜訂正後＞

(1)ファンドのリスク

（中略）

※当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

（中略）

(2)リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

①運用部門から独立したリスク管理部及びコンプライアンス統括部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及びコンプライアンス会議に報告します。

②内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

4 手数料等及び税金

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「4 手数料等及び税金」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部＿＿は訂正部分を示します。

(3) 信託報酬等

＜訂正前＞

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.63%（税抜 0.6%）を乗じて得た額とします。その配分は下記の通りです。

委託会社	年率 0.2625%	（税抜 0.25%）
販売会社	年率 0.315%	（税抜 0.3%）
受託会社	年率 0.0525%	（税抜 0.05%）

②信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

平成24年4月20日以降、以下の内容となります。

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.525%（税抜 0.5%）を乗じて得た額とします。その配分は下記の通りです。

委託会社	年率 0.21%	（税抜 0.2%）
販売会社	年率 0.2625%	（税抜 0.25%）
受託会社	年率 0.0525%	（税抜 0.05%）

②信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

＜訂正後＞

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.525%（税抜 0.5%）を乗じて得た額とします。その配分は下記の通りです。

委託会社	年率 0.21%	（税抜 0.2%）
販売会社	年率 0.2625%	（税抜 0.25%）
受託会社	年率 0.0525%	（税抜 0.05%）

②信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

③信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

(5) 課税上の取扱い

＜訂正前＞

①個人の受益者に対する課税

（中略）

※上記は、平成24年2月29日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

＜訂正後＞

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

（中略）

※上記は、平成24年8月31日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

次へ

5 運用状況

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第1 ファンドの状況」「5 運用状況」につきましては、該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

＜更新・訂正後＞

(1)投資状況

（平成24年8月31日現在）

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,156,203,618	99.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,761,171	0.31
合計(純資産総額)		2,162,964,789	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

（平成24年8月31日現在）

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス マザーファンド	733,935,767	0.8731	640,841,031	0.9294	682,119,901	31.54
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックス マザーファンド	368,452,868	1.7105	630,267,330	1.7742	653,709,078	30.22
日本	親投資信託受益証券	新興国債券インデックス マザーファンド	258,336,324	1.2255	316,598,841	1.2792	330,463,825	15.28
日本	親投資信託受益証券	新興国株式インデックス マザーファンド	194,753,656	1.5739	306,534,542	1.5512	302,101,871	13.97
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	167,657,211	0.5952	99,802,038	0.5814	97,475,902	4.51
日本	親投資信託受益証券	国内債券インデックス マザーファンド	72,364,849	1.2302	89,030,329	1.2483	90,333,041	4.18

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.69
合計	99.69

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

c．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末 (平成22年 1月20日)	473,632,486	473,632,486	13,329	13,329
第2期計算期間末 (平成23年 1月20日)	1,022,019,787	1,022,019,787	12,972	12,972
第3期計算期間末 (平成24年 1月20日)	1,737,011,301	1,737,011,301	12,000	12,000
平成23年 8月末日	1,507,455,913	―	12,066	―
9月末日	1,476,967,095	―	11,347	―
10月末日	1,624,445,985	―	12,223	―
11月末日	1,575,944,390	―	11,537	―
12月末日	1,675,265,555	―	11,667	―
平成24年 1月末日	1,760,980,337	―	12,032	―
2月末日	1,975,829,015	―	13,149	―
3月末日	2,013,662,586	―	13,259	―
4月末日	2,010,847,922	―	13,038	―
5月末日	1,890,941,115	―	11,914	―
6月末日	2,024,535,954	―	12,133	―
7月末日	2,129,513,160	―	12,333	―
8月末日	2,162,964,789	―	12,475	―

②分配の推移

期　間	1万口当たりの分配金(円)
第1期計算期間(平成21年 1月16日～平成22年 1月20日)	0
第2期計算期間(平成22年 1月21日～平成23年 1月20日)	0
第3期計算期間(平成23年 1月21日～平成24年 1月20日)	0

③収益率の推移

期　間	収益率(%)
第1期計算期間(平成21年 1月16日～平成22年 1月20日)	33.3
第2期計算期間(平成22年 1月21日～平成23年 1月20日)	△2.7
第3期計算期間(平成23年 1月21日～平成24年 1月20日)	△7.5
当中間計算期間(平成24年 1月21日～平成24年 7月20日)	3.2

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額（分配付）から前計算期間末の基準価額（分配落）を控除した額を前計算期間末の基準価額（分配落）で除して得た数に100を乗じて得た数字です。
(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4)設定及び解約の実績

期　間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期計算期間 (平成21年 1月16日～平成22年 1月20日)	440,530,128	85,183,261	355,346,867
第2期計算期間 (平成22年 1月21日～平成23年 1月20日)	627,431,255	194,904,418	787,873,704
第3期計算期間 (平成23年 1月21日～平成24年 1月20日)	911,791,372	252,161,321	1,447,503,755
当中間計算期間 (平成24年 1月21日～平成24年 7月20日)	439,955,764	174,971,361	1,712,488,158

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

(参考情報)

国内債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

（平成24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	日本	152,580,540,900	76.95
	ポーランド	101,569,000	0.05
	小計	152,682,109,900	77.00
地方債証券	日本	13,157,131,808	6.64
特殊債券	日本	18,276,684,771	9.22
	アメリカ	103,327,000	0.05
	韓国	100,284,000	0.05
	スウェーデン	99,079,000	0.05
	小計	18,579,374,771	9.37
社債券	日本	12,611,945,040	6.36
	オーストラリア	304,083,000	0.15
	アメリカ	201,738,000	0.10
	オランダ	200,466,000	0.10
	スウェーデン	100,255,000	0.05
	イギリス	98,982,000	0.05
	小計	13,517,469,040	6.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		361,225,223	0.18
合計(純資産総額)		198,297,310,742	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

（平成24年8月31日現在）

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

日本	国債証券	第２８５回利付国債（１０年）	2,490,000,000	107.05	2,665,630,500	106.84	2,660,415,600	1.7	2017/03/20	1.34
日本	国債証券	第１０５回利付国債（５年）	2,210,000,000	99.98	2,209,626,600	99.97	2,209,469,600	0.2	2017/06/20	1.11
日本	国債証券	第８７回利付国債（５年）	2,140,000,000	101.00	2,161,568,000	100.92	2,159,816,400	0.5	2014/12/20	1.09
日本	国債証券	第９９回利付国債（５年）	2,020,000,000	100.94	2,038,988,000	101.02	2,040,705,000	0.4	2016/09/20	1.03
日本	国債証券	第３２０回利付国債（１０年）	1,980,000,000	101.64	2,012,472,000	102.39	2,027,401,200	1.0	2021/12/20	1.02
日本	国債証券	第２９６回利付国債（１０年）	1,830,000,000	106.93	1,956,837,300	107.05	1,959,179,700	1.5	2018/09/20	0.99
日本	国債証券	第２８８回利付国債（１０年）	1,740,000,000	107.53	1,871,143,800	107.38	1,868,446,800	1.7	2017/09/20	0.94
日本	国債証券	第１０１回利付国債（５年）	1,820,000,000	100.90	1,836,434,600	101.00	1,838,218,200	0.4	2016/12/20	0.93
日本	国債証券	第２８９回利付国債（１０年）	1,710,000,000	106.61	1,823,133,600	106.58	1,822,603,500	1.5	2017/12/20	0.92
日本	国債証券	第２６４回利付国債（１０年）	1,750,000,000	103.22	1,806,350,000	102.86	1,800,155,000	1.5	2014/09/20	0.91
日本	国債証券	第３０５回利付国債（１０年）	1,660,000,000	105.59	1,752,860,400	105.92	1,758,388,200	1.3	2019/12/20	0.89
日本	国債証券	第２５６回利付国債（１０年）	1,720,000,000	102.01	1,754,630,500	101.68	1,748,982,000	1.4	2013/12/20	0.88
日本	国債証券	第３１８回利付国債（１０年）	1,650,000,000	101.86	1,680,756,000	102.59	1,692,817,500	1.0	2021/09/20	0.85
日本	国債証券	第８４回利付国債（５年）	1,650,000,000	101.23	1,670,295,000	101.08	1,667,853,000	0.7	2014/06/20	0.84
日本	国債証券	第８８回利付国債（５年）	1,640,000,000	101.11	1,658,308,300	101.02	1,656,826,400	0.5	2015/03/20	0.84
日本	国債証券	第３２４回利付国債（１０年）	1,650,000,000	100.05	1,650,914,800	100.04	1,650,742,500	0.8	2022/06/20	0.83
日本	国債証券	第８２回利付国債（５年）	1,590,000,000	101.43	1,612,872,100	101.23	1,609,668,300	0.9	2014/03/20	0.81
日本	国債証券	第１０３回利付国債（５年）	1,600,000,000	100.39	1,606,356,000	100.51	1,608,272,000	0.3	2017/03/20	0.81
日本	国債証券	第３０６回利付国債（１０年）	1,480,000,000	106.27	1,572,929,200	106.61	1,577,916,800	1.4	2020/03/20	0.80
日本	国債証券	第３２１回利付国債（１０年）	1,500,000,000	101.40	1,521,045,000	102.13	1,532,010,000	1.0	2022/03/20	0.77
日本	国債証券	第３１２回利付国債（１０年）	1,410,000,000	104.24	1,469,784,000	104.82	1,477,990,200	1.2	2020/12/20	0.75
日本	国債証券	第２８４回利付国債（１０年）	1,360,000,000	106.79	1,452,425,600	106.56	1,449,297,600	1.7	2016/12/20	0.73
日本	国債証券	第８９回利付国債（５年）	1,410,000,000	100.90	1,422,792,300	100.84	1,421,970,900	0.4	2015/06/20	0.72
日本	国債証券	第８５回利付国債（５年）	1,380,000,000	101.38	1,399,044,000	101.23	1,397,029,200	0.7	2014/09/20	0.70
日本	国債証券	第２６９回利付国債（１０年）	1,350,000,000	103.35	1,395,265,500	103.05	1,391,215,500	1.3	2015/03/20	0.70
日本	国債証券	第３１０回利付国債（１０年）	1,330,000,000	102.79	1,367,107,000	103.38	1,375,033,800	1.0	2020/09/20	0.69
日本	国債証券	第２８２回利付国債（１０年）	1,260,000,000	106.51	1,342,110,800	106.27	1,339,027,200	1.7	2016/09/20	0.68
日本	国債証券	第３１３回利付国債（１０年）	1,250,000,000	104.88	1,311,100,000	105.51	1,318,937,500	1.3	2021/03/20	0.67
日本	国債証券	第３０９回利付国債（１０年）	1,250,000,000	103.88	1,298,598,500	104.26	1,303,312,500	1.1	2020/06/20	0.66
日本	国債証券	第８１回利付国債（５年）	1,270,000,000	101.25	1,285,989,300	101.08	1,283,754,100	0.8	2014/03/20	0.65

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	77.00
地方債証券	6.64
特殊債券	9.37
社債券	6.82
合計	99.82

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

c．投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

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。

国内株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

（平成24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	115,592,702,700	98.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,303,839,104	1.95
合計(純資産総額)		117,896,541,804	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

（平成24年8月31日現在）

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
					単価	金額	単価	金額	
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,499,400	3,078.56	4,615,992,864	3,095.00	4,640,643,000	3.94
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	8,640,600	349.12	3,016,606,272	356.00	3,076,053,600	2.61
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	975,600	2,554.19	2,491,867,764	2,472.00	2,411,683,200	2.05
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	866,500	2,332.67	2,021,258,555	2,424.00	2,100,396,000	1.78
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	525,600	3,421.20	1,798,182,720	3,615.00	1,900,044,000	1.61
日本	株式	キヤノン	電気機器	718,300	3,271.16	2,349,674,228	2,595.00	1,863,988,500	1.58
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	14,680,000	118.08	1,733,414,400	126.00	1,849,680,000	1.57
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	453,600	3,269.84	1,483,199,424	3,670.00	1,664,712,000	1.41
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	517,000	2,350.60	1,215,260,200	3,190.00	1,649,230,000	1.40
日本	株式	ファナック	電気機器	120,400	13,851.15	1,667,678,460	12,790.00	1,539,916,000	1.31
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	574,500	2,237.78	1,285,604,610	2,361.00	1,356,394,500	1.15
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	9,403	125,192.97	1,177,189,496	133,200.00	1,252,479,600	1.06
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,664,000	458.86	1,222,403,040	449.00	1,196,136,000	1.01
日本	株式	三菱商事	卸売業	831,100	1,568.86	1,303,879,546	1,439.00	1,195,952,900	1.01
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	477,400	2,373.03	1,132,884,522	2,375.00	1,133,825,000	0.96
日本	株式	三菱地所	不動産業	799,000	1,253.47	1,001,522,530	1,373.00	1,097,027,000	0.93
日本	株式	三井物産	卸売業	985,100	1,125.81	1,109,035,431	1,093.00	1,076,714,300	0.91
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,471,200	756.78	1,113,374,736	730.00	1,073,976,000	0.91
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	201,100	4,600.53	925,166,583	5,240.00	1,053,764,000	0.89

日本	株式	アステラス製薬	医薬品	268,800	3,086.02	829,522,176	3,820.00	1,026,816,000	0.87
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,771	493,740.57	874,414,549	560,000.00	991,760,000	0.84
日本	株式	信越化学工業	化学	217,200	4,074.86	885,059,592	4,185.00	908,982,000	0.77
日本	株式	小松製作所	機械	564,800	1,947.85	1,100,145,680	1,540.00	869,792,000	0.74
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	414,400	1,771.22	733,993,568	1,874.00	776,585,600	0.66
日本	株式	花王	化学	321,200	2,039.98	655,241,576	2,364.00	759,316,800	0.64
日本	株式	デンソー	輸送用機器	285,700	2,385.05	681,408,785	2,610.00	745,677,000	0.63
日本	株式	三井不動産	不動産業	507,000	1,340.70	679,734,900	1,453.00	736,671,000	0.62
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,156,000	625.82	723,447,920	636.00	735,216,000	0.62
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	910,500	880.26	801,476,730	794.00	722,937,000	0.61
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,321,200	536.34	708,612,408	532.00	702,878,400	0.60

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	98.05
合計	98.05

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

c．投資株式の業種別投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.67
		建設業	2.50
		食料品	4.23
		繊維製品	0.84
		パルプ・紙	0.28
		化学	5.68
		医薬品	5.47
		石油・石炭製品	0.75
		ゴム製品	0.81
		ガラス・土石製品	0.94
		鉄鋼	1.39
		非鉄金属	1.03
		金属製品	0.70
		機械	4.60
		電気機器	11.93
		輸送用機器	10.26
		精密機器	1.49
		その他製品	1.46
		電気・ガス業	2.39
		陸運業	4.44

		海運業	0.29
		空運業	0.31
		倉庫・運輸関連業	0.23
		情報・通信業	7.00
		卸売業	5.37
		小売業	4.50
		銀行業	9.65
		証券、商品先物取引業	1.02
		保険業	2.11
		その他金融業	0.88
		不動産業	2.66
		サービス業	2.09
合計			98.05

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

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

資産の種類	資産の名称	取引所	買建／売建	通貨	数量	簿価金額（現地通貨）	評価金額（現地通貨）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	TOPIX先物	東京証券取引所	買建	円	317	2,219,939,100	2,303,005,000	2,303,005,000	1.95

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

外国債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

（平成24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	83,610,296,485	42.30
	フランス	18,899,137,291	9.56
	ドイツ	17,288,959,796	8.75
	イタリア	16,761,874,565	8.48
	イギリス	16,467,740,063	8.33
	スペイン	7,406,328,056	3.75
	カナダ	5,777,280,649	2.92
	オランダ	5,125,133,159	2.59
	ベルギー	5,018,695,598	2.54
	オーストリア	3,427,419,381	1.73
	メキシコ	1,846,820,879	0.93
	オーストラリア	1,786,510,571	0.90
	デンマーク	1,707,814,342	0.86

	ポーランド	1,407,106,478	0.71
	アイルランド	1,315,844,069	0.67
	スウェーデン	1,219,384,107	0.62
	フィンランド	1,101,615,001	0.56
	マレーシア	1,037,198,710	0.52
	スイス	774,741,844	0.39
	シンガポール	742,431,043	0.38
	ノルウェー	476,926,098	0.24
	小計	193,199,258,185	97.74
特殊債券	オーストラリア	1,187,709,643	0.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,282,176,931	1.66
合計(純資産総額)		197,669,144,759	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

（平成24年8月31日現在）

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率	償還期限	投資比率
				単価	金額	単価	金額	(%)		(%)
アメリカ	国債証券	T 2.625% 07/31/14	37,400,000	8,251.46	3,086,048,770	8,214.92	3,072,382,383	2.625	2014/07/31	1.55
アメリカ	国債証券	T 1.875% 04/30/14	25,100,000	8,096.10	2,032,122,741	8,072.46	2,026,188,378	1.875	2014/04/30	1.03
アメリカ	国債証券	T 0.875% 02/28/17	22,900,000	7,917.11	1,813,018,364	7,965.92	1,824,197,791	0.875	2017/02/28	0.92
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/14	22,600,000	8,051.28	1,819,589,496	8,028.86	1,814,523,318	1.750	2014/01/31	0.92
アメリカ	国債証券	T 1.75% 03/31/14	22,000,000	8,070.62	1,775,537,372	8,046.36	1,770,201,061	1.750	2014/03/31	0.90
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	18,000,000	9,221.37	1,659,847,604	9,301.20	1,674,216,313	3.625	2021/02/15	0.85
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	19,200,000	8,281.55	1,590,058,632	8,266.20	1,587,111,321	2.375	2015/02/28	0.80
アメリカ	国債証券	T 0.75% 06/30/17	19,400,000	7,921.07	1,536,688,006	7,900.83	1,532,761,543	0.750	2017/06/30	0.78
アメリカ	国債証券	T 2.625% 06/30/14	16,000,000	8,235.48	1,317,677,224	8,200.18	1,312,030,185	2.625	2014/06/30	0.66
アメリカ	国債証券	T 0.5% 10/15/13	16,200,000	7,885.17	1,277,398,443	7,885.48	1,277,448,103	0.500	2013/10/15	0.65
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	8,178.33	1,226,749,500	8,180.84	1,227,126,780	1.750	2015/07/31	0.62
アメリカ	国債証券	T 2% 11/30/13	15,000,000	8,062.63	1,209,395,799	8,034.39	1,205,159,652	2.000	2013/11/30	0.61
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/30/16	14,000,000	8,574.77	1,200,468,175	8,590.12	1,202,617,256	2.750	2016/11/30	0.61
アメリカ	国債証券	T 0.75% 12/15/13	15,000,000	7,916.80	1,187,520,633	7,912.81	1,186,921,701	0.750	2013/12/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	13,500,000	8,580.29	1,158,340,265	8,668.72	1,170,277,640	2.625	2020/11/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.125% 02/29/16	14,000,000	8,318.08	1,164,532,412	8,328.83	1,166,036,659	2.125	2016/02/29	0.59
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	12,800,000	8,940.19	1,144,345,181	8,949.34	1,145,516,651	3.125	2019/05/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 0.75% 09/15/13	14,200,000	7,909.73	1,123,182,807	7,905.74	1,122,615,818	0.750	2013/09/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	7,852.53	1,099,354,620	7,841.88	1,097,863,908	0.250	2015/07/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	8,807.19	1,100,899,110	8,760.21	1,095,026,707	4.250	2015/08/15	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	13,100,000	8,203.48	1,074,656,142	8,203.56	1,074,667,468	1.875	2015/06/30	0.54
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/40	10,900,000	9,546.82	1,040,604,114	9,753.15	1,063,093,539	3.875	2040/08/15	0.54

アメリカ	国債証券	T 4.375% 11/15/39	10,000,000	10,341.42	1,034,142,558	10,545.91	1,054,591,134	4.375	2039/11/15	0.53
アメリカ	国債証券	T 4.25% 11/15/40	10,000,000	10,150.40	1,015,040,400	10,362.30	1,036,230,174	4.250	2040/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.125% 11/30/14	12,600,000	8,209.53	1,034,401,309	8,184.83	1,031,289,598	2.125	2014/11/30	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/31/14	12,500,000	8,217.99	1,027,249,927	8,190.97	1,023,872,092	2.375	2014/08/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/14	12,000,000	8,537.00	1,024,440,645	8,470.68	1,016,481,924	4.250	2014/08/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 2.625% 08/15/20	11,700,000	8,592.55	1,005,328,584	8,674.86	1,014,958,844	2.625	2020/08/15	0.51
アメリカ	国債証券	T 1.75% 05/15/22	12,500,000	7,957.97	994,746,304	7,973.60	996,700,072	1.750	2022/05/15	0.50
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 08/01/14	9,800,000	9,841.37	964,454,799	10,058.21	985,705,089	4.250	2014/08/01	0.50

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.74
特殊債券	0.60
合計	98.34

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

c．投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

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。

外国株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

（平成24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	アメリカ	69,801,318,172	53.07
	イギリス	12,707,183,706	9.66
	カナダ	6,800,626,828	5.17
	スイス	5,316,479,318	4.04
	フランス	4,787,031,414	3.64
	ドイツ	4,618,280,701	3.51
	オーストラリア	4,600,867,476	3.50
	スウェーデン	1,759,396,445	1.34
	オランダ	1,710,786,210	1.30
	スペイン	1,487,074,287	1.13
	香港	1,386,822,405	1.05
	イタリア	1,152,944,436	0.88
	シンガポール	1,005,551,138	0.76

	アイルランド	844,176,240	0.64
	デンマーク	670,330,066	0.51
	ベルギー	638,021,780	0.49
	バミューダ	547,355,793	0.42
	アンティル	539,893,527	0.41
	ジャージー	510,024,231	0.39
	ノルウェー	433,456,165	0.33
	フィンランド	410,866,290	0.31
	イスラエル	333,571,483	0.25
	ルクセンブルク	243,635,125	0.19
	オーストリア	140,194,094	0.11
	ケイマン	130,977,437	0.10
	パナマ	89,624,556	0.07
	ポルトガル	80,162,054	0.06
	ニュージーランド	68,147,495	0.05
	マン島	37,323,104	0.03
	ガーンジー	26,891,958	0.02
	ギリシャ	25,206,292	0.02
	リベリア	21,718,500	0.02
	モーリシャス	21,418,182	0.02
	小計	122,947,356,908	93.48
投資信託受益証券	オーストラリア	51,487,690	0.04
	シンガポール	21,001,527	0.02
	小計	72,489,217	0.06
投資証券	アメリカ	2,012,763,538	1.53
	オーストラリア	373,411,418	0.28
	イギリス	157,487,249	0.12
	フランス	155,777,546	0.12
	香港	57,573,601	0.04
	シンガポール	39,860,337	0.03
	カナダ	33,028,766	0.03
	オランダ	15,119,210	0.01
	小計	2,845,021,665	2.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,653,239,052	4.30
合計(純資産総額)		131,518,106,842	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

ａ．投資有価証券の主要銘柄

（平成24年8月31日現在）

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
					単価	金額	単価	金額	
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	67,300	44,352.40	2,984,917,058	52,195.11	3,512,731,306	2.67
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	336,371	6,449.91	2,169,564,694	6,853.91	2,305,459,924	1.75
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	543,891	2,284.90	1,242,737,633	2,383.15	1,296,174,924	0.99
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	141,850	7,782.18	1,103,903,084	8,719.09	1,236,804,051	0.94
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	762,159	1,509.90	1,150,788,447	1,622.30	1,236,453,594	0.94
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	424,819	2,650.39	1,125,936,879	2,883.83	1,225,107,476	0.93
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	78,802	15,263.33	1,202,781,245	15,198.88	1,197,702,299	0.91
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	237,375	4,496.84	1,067,439,673	4,884.14	1,159,373,207	0.88
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	197,498	4,924.28	972,537,426	5,282.70	1,043,323,869	0.79
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	197,052	4,914.07	968,327,715	5,256.76	1,035,856,647	0.79
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	538,647	1,741.77	938,202,417	1,873.82	1,009,329,676	0.77
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	18,716	46,513.15	870,540,124	53,580.04	1,002,804,178	0.76
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	363,156	2,506.55	910,270,124	2,662.18	966,787,366	0.74
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,315,273	633.40	833,106,437	680.05	894,455,979	0.68
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	122,734	6,714.01	824,037,548	7,117.22	873,526,106	0.66
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	292,136	2,957.71	864,055,905	2,919.20	852,804,579	0.65
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	3,549,749	213.48	757,823,134	227.26	806,729,161	0.61
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	273,850	2,633.10	721,074,435	2,900.34	794,258,109	0.60
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	165,462	4,103.00	678,891,711	4,622.12	764,786,212	0.58
アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	133,842	5,148.29	689,058,768	5,678.84	760,068,641	0.58
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,368,628	496.47	679,496,429	548.67	750,928,491	0.57
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	218,783	2,961.64	647,958,234	3,389.23	741,506,344	0.56
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	265,864	2,499.77	664,600,659	2,741.81	728,948,786	0.55
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	50,537	12,510.44	632,240,369	14,124.29	713,799,749	0.54
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	286,324	2,061.67	590,307,891	2,450.74	701,707,970	0.53
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	205,901	3,262.68	671,790,310	3,361.72	692,181,921	0.53
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	361,849	2,022.37	731,795,456	1,907.62	690,271,113	0.52
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	360,823	1,776.15	640,878,369	1,787.32	644,909,050	0.49
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	112,529	5,393.53	606,928,762	5,673.34	638,416,177	0.49

オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	231,943	2,590.41	600,829,322	2,587.99	600,266,396	0.46

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	93.48
投資信託受益証券	0.06
投資証券	2.16
合計	95.70

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

c．投資株式の業種別投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	11.23
		素材	6.39
		資本財	6.92
		商業・専門サービス	0.80
		運輸	1.67
		自動車・自動車部品	1.18
		耐久消費財・アパレル	1.23
		消費者サービス	1.59
		メディア	2.64
		小売	2.93
		食品・生活必需品小売り	2.30
		食品・飲料・タバコ	6.86
		家庭用品・パーソナル用品	1.76
		ヘルスケア機器・サービス	2.57
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.87
		銀行	7.11
		各種金融	4.14
		保険	3.86
		不動産	0.71
		ソフトウェア・サービス	5.94
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.91
		電気通信サービス	3.90
		公益事業	3.48
		半導体・半導体製造装置	1.50
合計			93.48

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

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

資産の種類	資産の名称	取引所	買建／売建	通貨	数量	簿価金額（現地通貨）	評価金額（現地通貨）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	S&P 500 FUTU	シカゴ商業取引所	買建	アメリカドル	107	35,648,069	37,372,425	2,937,472,605	2.23
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	22	2,892,727	2,993,760	236,956,104	0.18
	SWISS MKT IX	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	スイスフラン	68	4,197,266	4,339,760	355,339,548	0.27
	DJ EURO STOX	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	252	5,511,614	6,065,640	596,495,037	0.45
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	40	4,084,105	4,305,000	348,274,500	0.26
	FTSE 100	ロンドン国際金融先物オプション取引所	買建	イギリスポンド	104	5,737,670	5,949,320	738,429,598	0.56

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

新興国債券インデックス マザーファンド

(1)投資状況

（平成24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	マレーシア	742,252,300	9.94
	ブラジル	738,595,103	9.89
	インドネシア	736,723,123	9.87
	南アフリカ	735,000,216	9.84
	トルコ	734,457,664	9.84
	メキシコ	730,738,088	9.79
	ポーランド	709,445,021	9.50
	タイ	531,338,104	7.12
	ハンガリー	447,599,372	5.99
	ロシア	375,171,753	5.02
	コロンビア	295,281,003	3.95
	ペルー	178,284,988	2.39
	フィリピン	37,715,327	0.51
	小計	6,992,602,062	93.65
特殊債券	国際機関	270,621,387	3.62
	ドイツ	24,395,052	0.33
	小計	295,016,439	3.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		178,799,575	2.39
合計(純資産総額)		7,466,418,076	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

（平成24年8月31日現在）

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		利率	償還期限	投資比率
				単価	金額	単価	金額	(%)		(%)
ロシア	国債証券	RUSSIA 7.85% 03/10/18	145,000,000	253.53	367,628,734	258.73	375,171,753	7.850	2018/03/10	5.02
ブラジル	国債証券	BRAZIL 12.5% 01/05/16	6,150,000	4,661.43	286,678,385	4,734.01	291,141,852	12.500	2016/01/05	3.90
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/14	5,180,000	3,822.82	198,022,130	3,931.56	203,655,155	10.000	2014/01/01	2.73
コロンビア	国債証券	COLOM 12% 10/22/15	3,380,000,000	5.44	183,887,645	5.29	179,037,304	12.000	2015/10/22	2.40
トルコ	国債証券	TURKGB 10% 06/17/15	3,570,000	4,421.15	157,835,330	4,534.88	161,895,525	10.000	2015/06/17	2.17
トルコ	国債証券	TURKGB 11% 08/06/14	3,200,000	4,423.59	141,555,042	4,559.84	145,915,074	11.000	2014/08/06	1.95
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	11,800,000	1,112.19	131,239,077	1,175.25	138,679,667	10.500	2026/12/21	1.86
トルコ	国債証券	TURKGB 9% 01/27/16	2,650,000	4,400.94	116,624,962	4,440.48	117,672,742	9.000	2016/01/27	1.58
コロンビア	国債証券	COLOM 7.75% 04/14/21	2,050,000,000	5.23	107,373,485	5.34	109,648,682	7.750	2021/04/14	1.47
マレーシア	国債証券	MGS 5.094% 04/30/14	4,100,000	2,628.66	107,775,384	2,596.12	106,441,038	5.094	2014/04/30	1.43
ポーランド	国債証券	POLGB 5.75% 04/25/14	4,300,000	2,400.88	103,238,017	2,407.23	103,510,915	5.750	2014/04/25	1.39
マレーシア	国債証券	MGS 4.24% 02/07/18	3,900,000	2,621.87	102,253,280	2,621.78	102,249,627	4.240	2018/02/07	1.37
トルコ	国債証券	TURKGB 8% 06/04/14	2,350,000	4,223.03	99,241,379	4,334.75	101,866,769	8.000	2014/06/04	1.36
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.25% 06/15/32	10,800,000,000	0.97	105,116,180	0.94	101,837,314	8.250	2032/06/15	1.36
ハンガリー	国債証券	HGB 5.5% 02/12/16	300,000,000	31.91	95,733,750	33.37	100,127,758	5.500	2016/02/12	1.34
南アフリカ	国債証券	SAGB 13.5% 09/15/15	7,800,000	1,129.73	88,119,546	1,131.34	88,244,559	13.500	2015/09/15	1.18
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 09/15/17	8,600,000	971.73	83,569,382	1,017.92	87,541,465	8.250	2017/09/15	1.17
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.25% 07/15/21	9,200,000,000	0.96	88,619,100	0.94	86,876,299	8.250	2021/07/15	1.16
ポーランド	国債証券	POLGB 5.5% 10/25/19	3,500,000	2,382.08	83,372,804	2,469.70	86,439,660	5.500	2019/10/25	1.16
ハンガリー	国債証券	HGB 5.5% 02/12/14	251,000,000	32.89	82,567,801	34.10	85,596,480	5.500	2014/02/12	1.15
ポーランド	国債証券	POLGB 5% 04/25/16	3,500,000	2,350.23	82,258,149	2,404.06	84,142,222	5.000	2016/04/25	1.13
ポーランド	国債証券	POLGB 5.25% 10/25/17	3,450,000	2,365.27	81,602,091	2,435.26	84,016,652	5.250	2017/10/25	1.13
タイ	国債証券	THAIGB 3.625% 05/22/15	32,600,000	253.04	82,493,757	253.34	82,588,840	3.625	2015/05/22	1.11
ハンガリー	国債証券	HGB 8% 02/12/15	229,000,000	34.58	79,196,313	35.65	81,642,465	8.000	2015/02/12	1.09
マレーシア	国債証券	MGS 4.16% 07/15/21	3,100,000	2,622.84	81,308,314	2,630.09	81,532,998	4.160	2021/07/15	1.09
ハンガリー	国債証券	HGB 6.5% 06/24/19	237,000,000	32.05	75,968,485	33.36	79,080,399	6.500	2019/06/24	1.06
国際機関	特殊債券	IBRD 6.25% 12/11/13	32,900,000	244.12	80,316,436	240.35	79,076,597	6.250	2013/12/11	1.06
南アフリカ	国債証券	SAGB 7.25% 01/15/20	8,200,000	911.65	74,755,852	963.91	79,041,415	7.250	2020/01/15	1.06
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 12/21/18	7,700,000	963.99	74,227,621	1,009.93	77,764,813	8.000	2018/12/21	1.04
ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/13	2,000,000	3,834.87	76,697,542	3,867.46	77,349,238	10.000	2013/01/01	1.04

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	93.65
特殊債券	3.95
合計	97.61

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

c．投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

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。

新興国株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

（平成24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	韓国	1,985,452,412	14.75
	ブラジル	1,664,946,253	12.37
	台湾	1,380,836,590	10.26
	中国	1,202,759,494	8.94
	南アフリカ	983,997,088	7.31
	インド	841,707,376	6.25
	ロシア	776,750,728	5.77
	メキシコ	642,535,803	4.77
	香港	577,601,938	4.29
	マレーシア	478,595,433	3.56
	ケイマン	407,203,424	3.03
	インドネシア	358,889,051	2.67
	タイ	282,163,257	2.10
	チリ	252,809,349	1.88
	トルコ	225,635,501	1.68
	ポーランド	173,577,142	1.29
	コロンビア	133,696,328	0.99
	フィリピン	118,118,893	0.88
	バミューダ	91,051,127	0.68
	エジプト	49,164,554	0.37
	チェコ	48,406,964	0.36
	ハンガリー	34,588,534	0.26

	ペルー	21,941,212	0.16
	アメリカ	16,162,722	0.12
	モロッコ	11,381,635	0.08
	ルクセンブルク	5,077,255	0.04
	小計	12,765,050,063	94.86
投資信託受益証券	南アフリカ	40,782,723	0.30
	ブラジル	25,020,111	0.19
	小計	65,802,834	0.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		625,993,127	4.65
合計(純資産総額)		13,456,846,024	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

a．投資有価証券の主要銘柄

（平成24年8月31日現在）

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)		評価額(円)		投資比率(%)
					単価	金額	単価	金額	
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	半導体・半導体製造装置	5,303	71,068.42	376,875,871	84,321.00	447,154,263	3.32
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,176,389	196.86	231,592,481	216.67	254,892,910	1.89
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	286,500	781.94	224,026,526	842.30	241,321,671	1.79
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	256,065	902.26	231,038,225	749.84	192,008,803	1.43
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	1,885,940	100.78	190,068,823	99.18	187,061,862	1.39
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,436,620	56.72	194,933,816	51.96	178,590,487	1.33
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	201,240	830.45	167,120,718	807.30	162,462,017	1.21
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	109,300	1,249.64	136,586,561	1,247.02	136,299,832	1.01
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	3,106,515	51.72	160,685,489	42.44	131,855,097	0.98
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	855,000	158.85	135,819,760	149.31	127,665,351	0.95
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	7,456	16,261.38	121,244,912	17,072.39	127,291,814	0.95
ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	素材	95,915	1,504.56	144,309,954	1,240.11	118,945,956	0.88
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	142,200	922.56	131,188,787	833.01	118,454,405	0.88
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	91,000	1,230.25	111,953,458	1,293.06	117,669,279	0.87
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	48,500	1,766.05	85,653,786	2,410.94	116,930,590	0.87
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	80,244	1,269.67	101,883,888	1,444.55	115,917,272	0.86
ロシア	株式	LUKOIL-SPON ADR	エネルギー	24,378	4,526.89	110,356,724	4,527.35	110,367,982	0.82

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	477,048	203.34	97,007,535	224.00	106,863,522	0.79
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	3,572,200	29.49	105,375,173	28.87	103,131,200	0.77
ブラジル	株式	CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	食品・飲料・タバコ	35,600	2,429.54	86,491,859	2,883.50	102,652,795	0.76
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	111,107	808.68	89,850,326	903.89	100,429,617	0.75
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	998,000	106.92	106,710,734	95.62	95,435,945	0.71
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	25,399	3,466.86	88,055,000	3,324.33	84,434,911	0.63
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	18,508	3,516.75	65,088,134	4,470.17	82,733,950	0.61
コロンビア	株式	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	エネルギー	17,964	4,142.41	74,414,377	4,534.43	81,456,572	0.61
韓国	株式	POSCO	素材	3,116	26,579.18	82,820,751	25,469.79	79,363,896	0.59
ブラジル	株式	VALE SA	素材	62,200	1,771.94	110,215,045	1,258.53	78,280,939	0.58
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	357,000	231.74	82,734,049	211.71	75,582,969	0.56
韓国	株式	HYUNDAI MOBIS	自動車・自動車部品	3,253	22,298.86	72,538,210	21,375.19	69,533,525	0.52
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	20,258	3,831.09	77,610,356	3,421.56	69,313,982	0.52

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	94.86
投資信託受益証券	0.49
合計	95.35

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

c．投資株式の業種別投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	12.38
		素材	10.82
		資本財	4.85
		商業・専門サービス	0.06
		運輸	1.58
		自動車・自動車部品	3.71
		耐久消費財・アパレル	0.82
		消費者サービス	0.47
		メディア	1.09
		小売	1.84
		食品・生活必需品小売り	2.08
		食品・飲料・タバコ	4.90
		家庭用品・パーソナル用品	1.19
		ヘルスケア機器・サービス	0.48
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.71

		銀行	16.87
		各種金融	2.27
		保険	2.55
		不動産	1.55
		ソフトウェア・サービス	2.80
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.27
		電気通信サービス	8.03
		公益事業	3.58
		半導体・半導体製造装置	6.97
合計			94.86

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

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

資産の種類	資産の名称	取引所	買建／売建	通貨	数量	簿価金額（現地通貨）	評価金額（現地通貨）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	MSCI EMERG M	ニューヨーク証券取引所	買建	アメリカドル	174	8,265,923	8,164,080	641,696,688	4.77

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

（参考情報）交付目論見書に記載するファンドの運用実績

世界経済インデックスファンド

運用実績

当初設定日：2009年1月16日
作成基準日：2012年8月31日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額	12,475円
純資産総額	22億円

〈基準価額の騰落率〉

1ヶ月	1.15%
3ヶ月	4.71%
6ヶ月	-5.13%
1年	3.39%
3年	-0.88%
5年	－
設定来	24.75%

※上記は作成基準日からの期間です。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

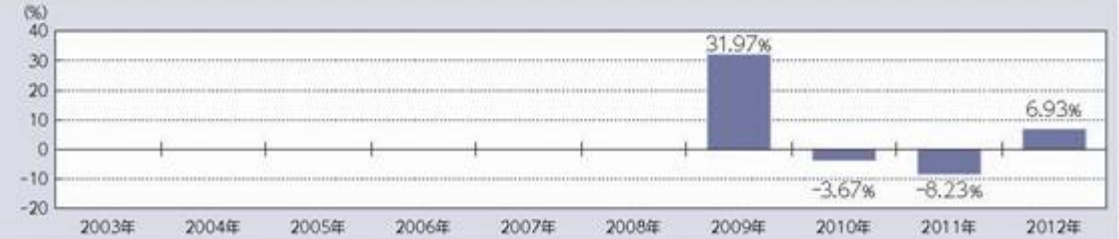
決算期	2010年1月	2011年1月	2012年1月	－	－
分配金	0円	0円	0円	－	－

※分配金額は株価、金利、為替などの変動の影響を受けて変動し、分配対象額が少額の場合、分配を行わないことがあります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式インデックスマザーファンド	31.5%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	－	－	0.8%
		EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	－	－	0.6%
外国債券インデックスマザーファンド	30.2%	T 2.625% 07/31/14	アメリカ	国債証券	－	2.625%	2014/7/31	0.5%
		T 1.875% 04/30/14	アメリカ	国債証券	－	1.875%	2014/4/30	0.3%
新興国債券インデックスマザーファンド	15.3%	RUSSIA 7.85% 03/10/18	ロシア	国債証券	－	7.850%	2018/3/10	0.8%
		BRAZIL 12.5% 01/05/16	ブラジル	国債証券	－	12.500%	2016/1/5	0.6%
新興国株式インデックスマザーファンド	14.0%	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	半導体・半導体製造装置	－	－	0.5%
		TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	－	－	0.3%
国内株式インデックスマザーファンド	4.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	－	－	0.2%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	－	－	0.1%
国内債券インデックスマザーファンド	4.2%	第285回利付国債(10年)	日本	国債証券	－	1.7%	2017/3/20	0.1%
		第105回利付国債(5年)	日本	国債証券	－	0.2%	2017/6/20	0.0%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2009年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2012年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第2【管理及び運営】
3資産管理等の概要

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第2 管理及び運営」「3 資産管理等の概要」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。
（注）下線部＿＿は訂正部分を示します。

(3)信託期間

＜訂正前＞
無期限とします（平成21年1月16日設定）。
ただし、下記「(5)計算期間 ①信託の終了」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。
＜訂正後＞
無期限とします（平成21年1月16日設定）。
ただし、下記「(5)その他 ①信託の終了」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

第3【ファンドの経理状況】

1 財務諸表

原届出書の「第二部 ファンド情報」「第3 ファンドの経理状況」「1 財務諸表」につきましては、以下の中間財務諸表を追加します。

（1）当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（2）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成24年1月21日から平成24年7月20日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（3）住信アセットマネジメント株式会社は平成24年4月1日をもって中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、商号を三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に変更しております。

中間財務諸表

世界経済インデックスファンド

(1)中間貸借対照表

（単位：円）

	当中間計算期間末 （平成24年 7月20日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	17,416,805
親投資信託受益証券	2,110,751,031
未収利息	33
流動資産合計	2,128,167,869
資産合計	2,128,167,869
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,617,154
未払受託者報酬	510,883
未払委託者報酬	5,095,110
その他未払費用	51,027
流動負債合計	8,274,174
負債合計	8,274,174
純資産の部	
元本等	
元本	1,712,488,158
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	407,405,537

（分配準備積立金）	(61,901,645)
元本等合計	2,119,893,695
純資産合計	2,119,893,695
負債純資産合計	2,128,167,869

(2)中間損益及び剰余金計算書

（単位：円）

	当中間計算期間 （自 平成24年 1月21日 至 平成24年 7月20日）
営業収益	
受取利息	5,304
有価証券売買等損益	58,261,608
営業収益合計	58,266,912
営業費用	
受託者報酬	510,883
委託者報酬	5,095,110
その他費用	51,027
営業費用合計	5,657,020
営業利益又は営業損失（△）	52,609,892
経常利益又は経常損失（△）	52,609,892
中間純利益又は中間純損失（△）	52,609,892
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	12,959,493
期首剰余金又は期首欠損金（△）	289,507,546
剰余金増加額又は欠損金減少額	114,527,654
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	114,527,654
剰余金減少額又は欠損金増加額	36,280,062
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	36,280,062
分配金	―
中間剰余金又は中間欠損金（△）	407,405,537

(3)中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	当中間計算期間 （自 平成24年 1月21日 至 平成24年 7月20日）
資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法により親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。

(追加情報)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	当中間計算期間末 （平成24年 7月20日現在）
1．期首元本額	1,447,503,755円
期中追加設定元本額	439,955,764円
期中一部解約元本額	174,971,361円
2．中間計算期間末日における受益権の総数	1,712,488,158口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

当中間計算期間 （自 平成24年 1月21日 至 平成24年 7月20日）
該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)
金融商品の時価に関する事項

項目	当中間計算期間末 （平成24年 7月20日現在）
1．中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	a.親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 b.コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 （平成24年 7月20日現在）
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

当中間計算期間末 （平成24年 7月20日現在）
1口当たり純資産額 ＝ 1.2379円 （1万口当たり純資産額 ＝ 12,379円）

(参考)
「世界経済インデックスファンド」は、「国内債券インデックス マザーファンド」、「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国債券インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」、「新興国債券インデックス マザーファンド」、「新興国株式インデックス マザーファンド」を投資対象として

おり、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、これらマザーファンドの受益証券です。

これらマザーファンドの状況は次の通りです。
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。

「国内債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

（単位：円）

	（平成24年 7月20日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	332,021,131
国債証券	149,357,966,000
地方債証券	12,894,291,072
特殊債券	18,419,352,321
社債券	13,845,726,061
未収入金	107,943,000
未収利息	598,438,434
前払費用	16,373,157
流動資産合計	195,572,111,176
資産合計	195,572,111,176
負債の部	
流動負債	
未払金	100,000,000
未払解約金	14,753,013
流動負債合計	114,753,013
負債合計	114,753,013
純資産の部	
元本等	
元本	155,989,523,985
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	39,467,834,178
元本等合計	195,457,358,163
純資産合計	195,457,358,163
負債純資産合計	195,572,111,176

（注）「国内債券インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年5月30日から翌年5月29日までであり、「世界経済インデックスファンド」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成24年7月20日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

(2)注記表
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	（自 平成24年 1月21日 至 平成24年 7月20日）
資産の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、原則として時価評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価格、価格情報会社の提供する価格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。

(追加情報)
本報告書における開示対象ファンドの計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

	（平成24年7月20日現在）
1．期首元本額	152,711,768,197円
期中追加設定元本額	19,842,927,684円
期中一部解約元本額	16,565,171,896円
期末元本額	155,989,523,985円
元本額の内訳	
エマージング株式オープン	10,940,920円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	549,022,649円
SBI資産設計オープン（分配型）	15,805,196円
SMT 国内債券インデックス・オープン	2,137,372,583円
世界経済インデックスファンド	71,143,355円
マイセレクション25	180,813,142円
マイセレクション50	152,455,014円
マイセレクション75	44,404,221円
DCマイセレクション25	8,793,874,415円
DCマイセレクション50	10,318,100,193円
DCマイセレクション75	2,662,791,901円
DC日本債券インデックス・オープン	366,441,486円
DC日本債券インデックス・オープンS	37,941,111,900円
DC日本債券インデックス・オープンP	12,211,153,253円
DCマイセレクションS25	2,381,580,256円
DCマイセレクションS50	2,749,882,801円
DCマイセレクションS75	494,037,923円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	43,498,243円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	473,429,949円

DCターゲット・イヤー ファンド2035	218,947,999円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	40,225,473円
DC世界経済インデックスファンド	10,534,143円
日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	9,804,056,219円
国内バランス６０VA１（適格機関投資家専用）	64,779,251円
マイセレクション50ＶA1（適格機関投資家専用）	499,905,531円
マイセレクション75ＶA1（適格機関投資家専用）	64,248,060円
国内バランス３０VA2（適格機関投資家専用）	12,040,806円
国内バランス６０VA2（適格機関投資家専用）	12,842,608円
マイセレクション50ＶＡ２（適格機関投資家専用）	2,442,714円
バランス30ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,965,863,758円
バランス50ＶＡ１（適格機関投資家専用）	3,003,504,462円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	8,932,105,058円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	795,149,339円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	14,824,915,399円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,565,142,774円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	5,336,864,645円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	3,525,481,361円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	4,944,756,446円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	2,268,073,238円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,997,474,151円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,770,685,954円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	3,635,762,884円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	292,061,037円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,570,904,455円
日本債券ファンド・シリーズ1	6,232,896,820円
2．計算期間末日における受益権の総数	155,989,523,985口

(金融商品に関する注記)
金融商品の時価に関する事項

項目	（平成24年 7月20日現在）
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	a.国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 b.コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（平成24年 7月20日現在）

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

（平成24年 7月20日現在）
1口当たり純資産額 ＝ 1.2530円 （1万口当たり純資産額 ＝ 12,530円）

「国内株式インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

（単位：円）

	（平成24年 7月20日現在）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,585,817,813
株式	115,475,711,015
派生商品評価勘定	147,708,000
未収入金	2,582,850
未収配当金	121,264,575
未収利息	4,956
差入委託証拠金	77,910,000
流動資産合計	118,410,999,209
資産合計	118,410,999,209
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,114,200
前受金	195,559,000
未払金	1,380,000
未払解約金	50,040,768
流動負債合計	248,093,968
負債合計	248,093,968
純資産の部	
元本等	
元本	202,671,481,868
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△84,508,576,627
元本等合計	118,162,905,241
純資産合計	118,162,905,241

負債純資産合計	118,410,999,209

（注）「国内株式インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年5月30日から翌年5月29日までであり、「世界経済インデックスファンド」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成24年7月20日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	（自 平成24年 1月21日 至 平成24年 7月20日）
1．資産の評価基準及び評価方法	（1）株式 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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又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。 （2）先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。
2．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の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。

(追加情報)

本報告書における開示対象ファンドの計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

	（平成24年 7月20日現在）
1．期首元本額	200,419,822,981円
期中追加設定元本額	22,038,955,285円
期中一部解約元本額	19,787,296,398円
期末元本額	202,671,481,868円
元本額の内訳	
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	3,770,250,164円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	1,224,182,422円
SBI資産設計オープン（分配型）	33,535,399円
SMT TOPIXインデックス・オープン	6,589,438,423円
世界経済インデックスファンド	164,340,777円
マイセレクション25	122,589,848円
マイセレクション50	281,798,131円
マイセレクション75	260,365,882円
日本株式インデックス・オープン	17,618,954,698円
DCマイセレクション25	6,307,171,097円
DCマイセレクション50	19,105,936,264円

DCマイセレクション75	15,861,108,359円
DC日本株式インデックス・オープン	3,510,942,330円
DCマイセレクションS25	1,720,088,981円
DCマイセレクションS50	5,043,377,139円
DCマイセレクションS75	2,896,880,541円
DC日本株式インデックス・オープンS	1,086,634,937円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	28,012,465円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	401,288,128円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	364,083,017円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	138,689,421円
DC世界経済インデックスファンド	27,786,668円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	6,732,418,723円
国内バランス６０VA１（適格機関投資家専用）	401,525,027円
マイセレクション50ＶＡ1（適格機関投資家専用）	917,863,674円
マイセレクション75ＶＡ1（適格機関投資家専用）	382,880,211円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	3,299,078,513円
国内バランス３０VA2（適格機関投資家専用）	20,034,220円
国内バランス６０VA2（適格機関投資家専用）	80,965,291円
マイセレクション50ＶＡ２（適格機関投資家専用）	4,344,825円
バランス30ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,076,149,329円
バランス50ＶＡ１（適格機関投資家専用）	7,735,466,811円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	19,248,182,167円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	5,879,676,917円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	13,487,777,786円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	2,597,119,124円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	13,704,820,441円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	6,078,619,704円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	4,649,971,022円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	3,158,167,587円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	5,740,628,692円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	1,958,997,261円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	2,656,602,210円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	208,062,173円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	10,639,168,677円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,741,706,855円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,713,799,537円
2．元本の欠損	純資産額は、元本を84,508,576,627円下回っております。
3．計算期間末日における受益権の総数	202,671,481,868口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価に関する事項

項目	（平成24年 7月20日現在）
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	a.株式 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 b.先物取引 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。 c.コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
株式関連

区分	種 類	（平成24年 7月20日現在）			
		契 約 額 等（円）		時 価	評価損益
			うち1年超	（円）	（円）
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX先物	2,530,677,000	―	2,677,275,000	146,598,000
合 計		2,530,677,000	―	2,677,275,000	146,598,000

（注）時価の算定方法
前述の（金融商品の時価に関する事項）に記載していますのでここでは省略しております。

(1口当たり情報)

（平成24年 7月20日現在）
1口当たり純資産額 ＝ 0.5830円 （1万口当たり純資産額 ＝ 5,830円）

「外国債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

（単位：円）

	（平成24年 7月20日現在）
資産の部	
流動資産	
預金	459,316,925
コール・ローン	663,317,660

国債証券	190,336,630,793
特殊債券	1,212,638,674
未収利息	2,087,585,479
前払費用	82,415,189
流動資産合計	194,841,904,720
資産合計	194,841,904,720
負債の部	
流動負債	
未払解約金	106,967,804
流動負債合計	106,967,804
負債合計	106,967,804
純資産の部	
元本等	
元本	110,781,876,338
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	83,953,060,578
元本等合計	194,734,936,916
純資産合計	194,734,936,916
負債純資産合計	194,841,904,720

（注）「外国債券インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年5月30日から翌年5月29日までであり、「世界経済インデックスファンド」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成24年7月20日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

(2)注記表
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	（自 平成24年 1月21日 至 平成24年 7月20日）
1．資産の評価基準及び評価方法	（1）国債証券、特殊債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、原則として時価評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価格、価格情報会社の提供する価格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。
2．外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として我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。 なお、外貨建資産等の会計処理は「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条及び第61条に基づいております。

(追加情報)
本報告書における開示対象ファンドの計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用

しております。

(貸借対照表に関する注記)

	（平成24年7月20日現在）
1．期首元本額	115,838,047,298円
期中追加設定元本額	3,944,846,933円
期中一部解約元本額	9,001,017,893円
期末元本額	110,781,876,338円
元本額の内訳	
外国債券オープン（毎月決算型）	8,252,076,682円
外国債券オープン（3ケ月決算型）	349,825,025円
グローバル・インカム＆プラス（毎月決算型）	2,903,284,983円
財産四分法ファンド（毎月決算型）	1,883,285,067円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	435,401,282円
SBI資産設計オープン（分配型）	12,561,910円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	3,015,222,444円
世界経済インデックスファンド	361,960,742円
マイセレクション25	20,971,685円
マイセレクション50	13,453,246円
マイセレクション75	9,475,061円
DCマイセレクション25	1,032,940,779円
DCマイセレクション50	899,753,047円
DCマイセレクション75	520,359,350円
DC外国債券インデックス・オープン	1,103,266,973円
DCマイセレクションS25	284,183,291円
DCマイセレクションS50	238,923,244円
DCマイセレクションS75	99,095,767円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	2,530,544円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	29,992,504円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	19,116,734円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	5,355,168円
DC世界経済インデックスファンド	55,914,653円
外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	5,364,298,441円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり（SMA専用）	2,288,408,887円
マイセレクション50ＶＡ1（適格機関投資家専用）	43,832,948円
マイセレクション75ＶＡ1（適格機関投資家専用）	13,196,637円
外国債券インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	572,091,094円
マイセレクション50ＶＡ２（適格機関投資家専用）	215,662円
バランス30ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,586,675,833円
バランス50ＶＡ１（適格機関投資家専用）	2,521,046,588円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	31,657,005,725円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	3,223,099,175円

バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	10,301,630,331円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,375,654,810円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	4,467,772,438円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	5,206,944,949円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	5,575,755,628円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,543,335,767円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	3,540,017,816円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	638,269,611円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	849,789,211円
FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）	5,884,968,350円
グローバル債券ファンド・シリーズ1（適格機関投資家専用）	1,009,249,137円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	297,942,392円
外国債券ファンド・シリーズ1	1,271,724,727円
2．計算期間末日における受益権の総数	110,781,876,338口

(金融商品に関する注記)
金融商品の時価に関する事項

項目	（平成24年 7月20日現在）
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	a.国債証券、特殊債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 b.コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（平成24年 7月20日現在）
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

（平成24年 7月20日現在）
1口当たり純資産額 ＝ 1.7578円 （1万口当たり純資産額 ＝ 17,578円）

「外国株式インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

（単位：円）

	（平成24年 7月20日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	5,892,859,600
コール・ローン	71,256,204
株式	117,816,000,462
投資信託受益証券	72,801,951
投資証券	2,673,802,237
派生商品評価勘定	316,096,578
未収配当金	159,614,363
未収利息	136
差入委託証拠金	1,313,441,766
流動資産合計	128,315,873,297
資産合計	128,315,873,297
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	107,693
未払金	24,066,173
未払解約金	8,533,166
流動負債合計	32,707,032
負債合計	32,707,032
純資産の部	
元本等	
元本	141,141,268,117
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△12,858,101,852
元本等合計	128,283,166,265
純資産合計	128,283,166,265
負債純資産合計	128,315,873,297

（注）「外国株式インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年5月30日から翌年5月29日までであり、「世界経済インデックスファンド」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成24年7月20日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

(2)注記表
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	（自 平成24年 1月21日 至 平成24年 7月20日）

1．資産の評価基準及び評価方法	（1）株式 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、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、又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。 （2）投資信託受益証券 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、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、又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。 （3）投資証券 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、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、又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。 （4）先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。 （5）外国為替予約 個別法に基づき、時価評価しております。
2．外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として我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。 なお、外貨建資産等の会計処理は「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条及び第61条に基づいております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式・投資信託受益証券・投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、まだ確定していない場合には、入金日基準で計上しております。

(追加情報)

本報告書における開示対象ファンドの計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

	（平成24年 7月20日現在）
1．期首元本額	143,247,104,068円
期中追加設定元本額	12,814,352,981円
期中一部解約元本額	14,920,188,932円
期末元本額	141,141,268,117円

元本額の内訳	
SBI資産設計オープン（資産成長型）	963,731,807円
SBI資産設計オープン（分配型）	27,078,299円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	17,847,577,860円
世界経済インデックスファンド	732,794,377円
マイセレクション25	20,413,866円
マイセレクション50	78,688,023円
マイセレクション75	89,678,001円
外国株式インデックス・オープン	1,370,925,590円
DCマイセレクション25	1,052,094,106円
DCマイセレクション50	5,385,688,788円
DCマイセレクション75	5,381,271,284円
DC外国株式インデックス・オープン	5,245,379,242円
DCマイセレクションS25	289,535,958円
DCマイセレクションS50	1,426,806,197円
DCマイセレクションS75	1,013,506,040円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	9,569,505円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	138,855,905円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	125,897,010円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	47,635,531円
DC世界経済インデックスファンド	112,417,415円
外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	8,963,445,611円
マイセレクション50ＶＡ1（適格機関投資家専用）	259,339,736円
マイセレクション75ＶＡ1（適格機関投資家専用）	131,036,325円
外国株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	562,002,637円
マイセレクション50ＶＡ２（適格機関投資家専用）	1,306,106円
バランス30ＶＡ１（適格機関投資家専用）	1,382,658,136円
バランス50ＶＡ１（適格機関投資家専用）	5,138,986,555円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	13,144,081,485円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	4,014,781,089円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	5,987,961,523円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	1,524,959,222円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	9,198,895,455円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	20,631,452,206円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	9,468,974,926円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	1,588,351,053円
グローバルバランスファンドVA35（適格機関投資家専用）	1,567,546,932円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	557,530,674円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,209,349,605円
FOFs用外国株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	7,767,538,459円
外国株式ファンド・シリーズ1	6,681,525,578円

2．元本の欠損	純資産額は、元本を12,858,101,852円下回っております。
3．計算期間末日における受益権の総数	141,141,268,117口

(金融商品に関する注記)
金融商品の時価に関する事項

項目	（平成24年 7月20日現在）
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	a.株式、投資信託受益証券、投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 b.先物取引 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。 外貨建て先物取引の時価の邦貨換算額は計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。換算において円未満の端数は切り捨てております。 c.外国為替予約 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該当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、該当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電信売買相場の仲値で評価しております。 d.コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
株式関連

区分	種 類	（平成24年 7月20日現在）		
		契 約 額 等（円）	時 価	評価損益

			うち1年超	（円）	（円）
市場取引	株価指数先物取引				
	買建				
	S&P 500 FUTU	4,426,058,004	―	4,592,160,870	166,102,866
	S&P/TSE 60	407,944,571	―	415,554,480	7,609,909
	SPI 200 FUTU	471,161,839	―	486,214,560	15,052,721
	FTSE 100	781,448,153	―	812,738,688	31,290,535
	SWISS MKT IX	277,241,246	―	294,810,578	17,569,332
	DJ EURO STOX	1,036,494,920	―	1,114,952,315	78,457,395
合　計		7,400,348,733	―	7,716,431,491	316,082,758

（注）時価の算定方法
前述の（金融商品の時価に関する事項）に記載していますのでここでは省略しております。

通貨関連

区分	種 類	（平成24年 7月20日現在）			
		契 約 額 等（円）		時 価	評価損益
			うち1年超	（円）	（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	22,841,505	―	22,837,500	△4,005
	イギリスポンド	22,293,000	―	22,264,200	△28,800
	ユーロ	7,781,728	―	7,719,200	△62,528
	売建				
	アメリカドル	7,875,500	―	7,875,000	500
	ユーロ	11,579,760	―	11,578,800	960
合　計		72,371,493	―	72,274,700	△93,873

（注）時価の算定方法
前述の（金融商品の時価に関する事項）に記載していますのでここでは省略しております。

(1口当たり情報)

（平成24年 7月20日現在）
1口当たり純資産額 ＝ 0.9089円 （1万口当たり純資産額 ＝ 9,089円）

「新興国債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

（単位：円）

	（平成24年 7月20日現在）
資産の部	

流動資産	
預金	138,841,580
コール・ローン	28,150,403
国債証券	6,139,257,176
特殊債券	301,806,895
派生商品評価勘定	62,733
未収利息	91,519,022
前払費用	22,743,049
流動資産合計	6,722,380,858
資産合計	6,722,380,858
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,957
未払金	216,446,312
未払解約金	599,522
流動負債合計	217,078,791
負債合計	217,078,791
純資産の部	
元本等	
元本	5,030,160,124
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,475,141,943
元本等合計	6,505,302,067
純資産合計	6,505,302,067
負債純資産合計	6,722,380,858

（注）「新興国債券インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年11月11日から翌年11月10日までであり、「世界経済インデックスファンド」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成24年7月20日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

(2)注記表
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	（自 平成24年 1月21日 至 平成24年 7月20日）
1．資産の評価基準及び評価方法	(1)国債証券、特殊債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、原則として時価評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価格、価格情報会社の提供する価格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。 (2)外国為替予約 個別法に基づき、時価評価しております。

2．外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として我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。 なお、外貨建資産等の会計処理は「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条及び第61条に基づいております。

(追加情報)
本報告書における開示対象ファンドの計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

	（平成24年7月20日現在）
1．期首元本額	4,321,191,098円
期中追加設定元本額	2,338,521,993円
期中一部解約元本額	1,629,552,967円
期末元本額	5,030,160,124円
元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	2,444,253,233円
世界経済インデックスファンド	253,915,725円
DC新興国債券インデックス・オープン	1,063,148,610円
DC世界経済インデックスファンド	39,354,872円
新興国債券ファンド（米ドル売り円買い為替予約付）（適格機関投資家専用）	847,036,231円
新興国債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	382,451,453円
2．計算期間末日における受益権の総数	5,030,160,124口

(金融商品に関する注記)
金融商品の時価に関する事項

項目	（平成24年 7月20日現在）
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	a.国債証券、特殊債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

	b.外国為替予約 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該当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、該当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電信売買相場の仲値で評価しております。 c.コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

区分	種 類	（平成24年 7月20日現在）			
		契 約 額	等（円） うち1年超	時 価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	46,462,500	―	46,462,500	0
	マレーシアリンギット	12,843,380	―	12,847,491	4,111
	メキシコペソ	7,169,880	―	7,157,850	△12,030
	ポーランドズロチ	8,447,010	―	8,443,380	△3,630
	南アフリカランド	6,106,160	―	6,102,350	△3,810
	ロシアルーブル	12,727,899	―	12,786,521	58,622
	トルコリラ	11,769,539	―	11,764,139	△5,400
	売建				
	アメリカドル	12,727,899	―	12,735,986	△8,087
合 計		118,254,267	―	118,300,217	29,776

（注）時価の算定方法

前述の（金融商品の時価に関する事項）に記載していますのでここでは省略しております。

(1口当たり情報)

（平成24年 7月20日現在）
1口当たり純資産額 ＝ 1.2933円 （1万口当たり純資産額 ＝ 12,933円）

「新興国株式インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

（単位：円）

	（平成24年 7月20日現在）
資産の部	
流動資産	
預金	331,666,454
コール・ローン	63,937,376
株式	12,203,900,643
投資信託受益証券	61,068,398
派生商品評価勘定	11,335,138
未収配当金	48,749,776
未収利息	122
差入委託証拠金	96,201,816
流動資産合計	12,816,859,723
資産合計	12,816,859,723
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,298,824
未払金	41,622
流動負債合計	2,340,446
負債合計	2,340,446
純資産の部	
元本等	
元本	8,296,245,505
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,518,273,772
元本等合計	12,814,519,277
純資産合計	12,814,519,277
負債純資産合計	12,816,859,723

（注）「新興国株式インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年11月11日から翌年11月10日までであり、「世界経済インデックスファンド」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成24年7月20日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	（自 平成24年 1月21日 至 平成24年 7月20日）
1．資産の評価基準及び評価方法	（1）株式 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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又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。 （2）投資信託受益証券 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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、又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。 （3）先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。 （4）外国為替予約 個別法に基づき、時価評価しております。
2．外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として我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。 なお、外貨建資産等の会計処理は「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条及び第61条に基づいております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式・投資信託受益証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、まだ確定していない場合には、入金日基準で計上しております。

(追加情報)
本報告書における開示対象ファンドの計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

	（平成24年 7月20日現在）
1．期首元本額	7,250,432,676円
期中追加設定元本額	1,351,914,322円
期中一部解約元本額	306,101,493円
期末元本額	8,296,245,505円
元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	5,464,194,075円
世界経済インデックスファンド	191,063,789円
DC新興国株式インデックス・オープン	1,070,195,347円
DC世界経済インデックスファンド	32,724,599円

新興国株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,155,027,926円
新興国株式インデックスファンド（適格機関投資家専用）	383,039,769円
2．計算期間末日における受益権の総数	8,296,245,505口

(金融商品に関する注記)
金融商品の時価に関する事項

項目	（平成24年 7月20日現在）
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	a.株式、投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 b.先物取引 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。 外貨建て先物取引の時価の邦貨換算額は計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。換算において円未満の端数は切り捨てております。 c.外国為替予約 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該当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、該当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電信売買相場の仲値で評価しております。 d.コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
株式関連

区分	種 類	（平成24年 7月20日現在）		
		契 約 額 等（円）	時 価	評価損益

			うち1年超	（円）	（円）
市場取引	株価指数先物取引 買建 MSCI EMERG M	541,326,514	―	550,710,374	9,383,860
合　計		541,326,514	―	550,710,374	9,383,860

（注）時価の算定方法
前述の（金融商品の時価に関する事項）に記載していますのでここでは省略しております。

通貨関連

区分	種 類	（平成24年 7月20日現在）			
		契 約 額 等（円）		時 価	評価損益
			うち1年超	（円）	（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカドル	69,827,763	―	69,483,704	△344,059
	売建 アメリカドル	5,906,625	―	5,906,250	375
	ブラジルレアル	577,612	―	581,474	△3,862
合　計		76,312,000	―	75,971,428	△347,546

（注）時価の算定方法
前述の（金融商品の時価に関する事項）に記載していますのでここでは省略しております。

(1口当たり情報)

（平成24年 7月20日現在）
1口当たり純資産額 ＝ 1.5446円 （1万口当たり純資産額 ＝ 15,446円）

2 ファンドの現況
純資産額計算書(平成24年8月31日現在)

Ⅰ 資産総額	2,166,193,286 円
Ⅱ 負債総額	3,228,497 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,162,964,789 円
Ⅳ 発行済口数	1,733,894,045 口
Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2475 円
1万口当たり純資産額	12,475 円

(参考情報)

国内債券インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	203,878,935,284 円
Ⅱ 負債総額	5,581,624,542 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	198,297,310,742 円

Ⅳ 発行済口数	158,849,194,569 口
Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2483 円
1万口当たり純資産額	12,483 円

国内株式インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	117,961,360,474 円
Ⅱ 負債総額	64,818,670 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	117,896,541,804 円
Ⅳ 発行済口数	202,767,278,863 口
Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.5814 円
1万口当たり純資産額	5,814 円

外国債券インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	198,565,104,545 円
Ⅱ 負債総額	895,959,786 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	197,669,144,759 円
Ⅳ 発行済口数	111,412,217,596 口
Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7742 円
1万口当たり純資産額	17,742 円

外国株式インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	132,019,121,828 円
Ⅱ 負債総額	501,014,986 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	131,518,106,842 円
Ⅳ 発行済口数	141,509,415,071 口
Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9294 円
1万口当たり純資産額	9,294 円

新興国債券インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	7,712,593,497 円
Ⅱ 負債総額	246,175,421 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	7,466,418,076 円
Ⅳ 発行済口数	5,836,906,602 口
Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2792 円
1万口当たり純資産額	12,792 円

新興国株式インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	13,471,153,878 円
Ⅱ 負債総額	14,307,854 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	13,456,846,024 円
Ⅳ 発行済口数	8,675,385,662 口
Ⅴ 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5512 円
1万口当たり純資産額	15,512 円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」の「1 委託会社等の概況」につきましては、該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

＜更新・訂正後＞

(1)資本金の額（平成24年8月31日現在）

資本金の額	： 3億円
発行可能株式総数	： 12,000株
発行済株式総数	： 3,000株
最近5年間における資本金の額の増減	： 該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

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

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

②投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

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

［DO（実行）］

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

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

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

［CHECK（検証・評価）］

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

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

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

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

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

委託会社の機構は平成24年10月19日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2 事業の内容及び営業の概況

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」の「2 事業の内容及び営業の概況」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。

（注）下線部＿＿は訂正部分を示します。

＜訂正前＞

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

平成24年2月29日現在、住信アセットマネジメント株式会社が運用の指図を行っている証券投資信託は次の通りです（ただし、親投資信託を除きます。）。

	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
追加型株式投資信託	167	1,334,466
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	167	1,334,466

（ご参考）平成24年2月29日現在、中央三井アセットマネジメント株式会社が運用の指図を行っている証券投資信託は次の通りです（ただし、親投資信託を除きます。）。

	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
追加型株式投資信託	133	2,511,956
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	701
単位型公社債投資信託	0	0
合計	138	2,512,657

＜訂正後＞

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

平成24年8月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	299	3,545,272
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	620
単位型公社債投資信託	0	0
合計	304	3,545,891

3 委託会社等の経理状況

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」の「3 委託会社等の経理状況」につきましては、該当情報を以下の内容に更新・訂正します。

＜更新・訂正後＞

（イ）委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（旧社名 住信アセットマネジメント株式会社、以下「委託者」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）第2条に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
なお、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

（ロ）委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

次へ

(1)貸借対照表

（単位：千円）

	前事業年度 （平成23年3月31日現在）		当事業年度 （平成24年3月31日現在）	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金	※2	6,223,302		4,826,115
前払費用		34,720		30,184
未収委託者報酬		953,916		944,716
未収運用受託報酬		42,516		26,998
未収入金		―		75,514
一年以内返還予定保証金		―		187,128
繰延税金資産		50,152		69,857
その他		34		31,325
流動資産合計		7,304,641		6,191,840
固定資産				
有形固定資産				
建物		38,802		3,525
器具備品		27,919		14,970
建設仮勘定		―		62,454
有形固定資産合計	※1	66,721	※1	80,949
無形固定資産				
ソフトウェア		91,774		60,130
ソフトウェア仮勘定		―		12,151
その他無形固定資産		1,415		928
無形固定資産合計		93,189		73,209
投資その他の資産				
投資有価証券		239,090		43,194
敷金・保証金		228,451		―
長期前払費用		409		357
繰延税金資産		80,017		―
その他の投資		195		165
投資その他の資産合計		548,164		43,717
固定資産合計		708,076		197,876
資産合計		8,012,717		6,389,717

（単位：千円）

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

(2)損益計算書

（単位：千円）

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

一般管理費合計	1,985,197	1,919,541
営業利益	848,907	585,991

（単位：千円）

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

(3)株主資本等変動計算書

（単位：千円）

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

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

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

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

１．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

２．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定率法によっております。

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

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

３．引当金の計上基準

(1)賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2)退職給付引当金

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

(3)移転関連費用引当金

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

４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

会計上の見積りの変更

１．耐用年数の変更

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

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

２．資産除去債務の見積りの変更

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

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

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

追加情報

会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

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

注記事項

（貸借対照表関係）

※1有形固定資産の減価償却累計額

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

※2関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

（損益計算書関係）

※1関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末

普通株式（株）	6,000	－	－	6,000

２．自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

３.剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

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

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

２．自己株式の種類及び株式数

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

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

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

３.剰余金の配当に関する事項

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

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

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

(1)配当金の総額　　30,000千円

(2)配当金の原資　　利益剰余金

(3)１株当たり配当額　　10,000円

(4)基準日　　平成24年3月31日

(5)効力発生日　　平成24年6月29日

（リース取引関係）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

２．金融商品の時価に関する事項

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

前事業年度（平成23年3月31日）　　（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額

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

(*)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

当事業年度（平成24年3月31日）　　（単位:千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

（注2）前事業年度（平成23年3月31日）において保有する非上場株式（貸借対照表計上額199,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（注3）金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成23年3月31日）　　（単位:千円）

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

当事業年度（平成24年3月31日）　　（単位:千円）

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

未収委託者報酬	944,716	－	－	－

（有価証券関係）

１．その他有価証券

前事業年度（平成23年3月31日現在）　（単位:千円）

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

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

当事業年度（平成24年3月31日現在）　（単位:千円）

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

２．売却したその他有価証券

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

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
7,639	756	480

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

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

（デリバティブ取引関係）

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務及びその他に関する事項　（単位：千円）

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

(注) 1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

(注) 2．当社の退職給付債務は退職一時金のみです。

3．退職給付費用に関する事項　（単位：千円）

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

(注) 1．当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。

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

4．退職給付債務等の計算基礎

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

（税効果会計関係）

1．　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

繰延税金資産 合計	130,169	〃	159,817	〃
繰延税金負債				
投資有価証券売却益益金不算入額	―		△398,925	〃
繰延税金負債 合計	―		△398,925	〃
繰延税金資産(負債)の純額	130,169	〃	△239,107	〃

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

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

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

3． 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（持分法損益等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

セグメント情報

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

関連情報

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1)営業収益

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

(2)有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 投信販売代行手数料

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

② 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	三井住友トラスト・ホールディングス㈱	東京都千代田区	261,608	持株会社	100%	役員の兼任	投資有価証券の譲渡	67,316	－	－

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

①投資有価証券の譲渡

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

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 投信販売代行手数料

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

② 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

③ 投資有価証券の譲渡及び自己株式の取得

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

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1)親会社情報

前事業年度（平成23年3月31日）

住友信託銀行株式会社（非上場）

当事業年度（平成24年3月31日）

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

（１株当たり情報）

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

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

２．1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

（重要な後発事象）

前事業年度（自　平成22年4月1日　至　平成23年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　平成23年4月1日　至　平成24年3月31日）

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

１．企業結合の概要

(1)結合当事企業の名称及び当該事業の内容

結合企業

名称　　住信アセットマネジメント株式会社

事業の内容　投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称　　中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容　投資運用業、第二種金融商品取引業

(2)企業結合日

平成24年4月1日

(3)企業結合の法的形式

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

合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

(4)結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5)その他取引の概要に関する事項

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

２．実施した会計処理の概要

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

次へ

＜参考＞中央三井アセットマネジメント株式会社の経理状況

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

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

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

次へ

独立監査人の監査報告書

平成２４年６月１１日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御中

有限責任監査法人 ト ー マ ツ

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　木 村 充 男　印

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　松 崎 雅 則　印

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以 上

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

次へ

（１）貸借対照表

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

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

（２）損益計算書

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

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

（３）株主資本等変動計算書

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

重要な会計方針

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

追加情報

第26期 (平成23年４月１日から 平成24年３月31日まで)
１．会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用 当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月４日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月４日）を適用しております。 ２．役員賞与引当金 役員賞与制度新設に伴い、「役員賞与に関する会計基準」（企業会計基準第４号 平成17年11月29日）を適用し、当事業年度より役員賞与引当金を計上しております。

注記事項

１．貸借対照表関係

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

２．損益計算書関係

第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)	第26期 (平成23年４月１日から 平成24年３月31日まで)
※１　関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。 統合関連費用　51,394千円 ※２　当事業年度において、以下の資産グループについて減損損失を計上しました。	※１　関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。 統合関連費用　12,011千円

用途	場所	種類	金額
処分予定資産	本社事務所 (東京都港区)	建物 器具備品	17,622千円

(経緯)

上記の資産グループについては、当社グループの経営統合に伴い、将来の使用見込みがなく除却される可能性が高い資産について、除去予定時の帳簿価額を減損損失として特別損失に計上しました。

(減損損失の金額)

建物	15,615千円
器具備品	2,007千円
合計	17,622千円

(グルーピングの方法)

当社は、基本的に全ての資産が一体となってキャッシュ・フローを生成しておりますが、将来使用見込みがなく処分される可能性が高いものについては、処分予定資産としてグルーピングしております。

３．株主資本等変動計算書関係

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

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

４．リース取引関係

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

５．金融商品関係

第25期（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）

１．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（＊）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び (4) 未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

第26期（平成23年４月１日から平成24年３月31日まで）

１．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（＊）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び (4) 未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

６．有価証券関係

第25期（平成23年３月31日）

１．その他有価証券

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円
その他	58,149	56,200	1,949
計	58,149	56,200	1,949

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円
その他	986	1,000	△13
計	986	1,000	△13

２．当事業年度中に売却したその他有価証券

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
	千円	千円	千円
その他	128,650	67,194	344
計	128,650	67,194	344

３．時価評価されていない有価証券

内容	貸借対照表計上額（千円）
その他有価証券	
非上場株式	10,000

４．その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

該当事項はありません。

第26期（平成24年３月31日）

１．その他有価証券

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円
その他	52,728	50,200	2,528
計	52,728	50,200	2,528

２．当事業年度中に売却したその他有価証券

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
	千円	千円	千円
その他	7,151	153	2
計	7,151	153	2

３．時価評価されていない有価証券

内容	貸借対照表計上額（千円）
その他有価証券	
非上場株式	10,000

４．その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

該当事項はありません。

７．デリバティブ関係

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

８．退職給付関係

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

９．税効果会計関係

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

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

10. 資産除去債務関係

第25期 平成23年３月31日
資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの １．当該資産除去債務の概要 事業用に賃借している事務所等の不動産賃貸借契約に基づく原状回復義務であります。 ２．当該資産除去債務の金額の算定方法 物件の耐用年数等を参考に使用期間を見積り、対応する期間の割引率を使用して、金額を算定しております。 ３．当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減 期首残高　5,776千円 時の経過による調整額　79千円 見積りの変更による増加額※　10,489千円 期末残高　16,345千円 ※当社グループの経営統合に伴い、当事業年度末において見積りの見直しを行ったもの

第26期 平成24年３月31日
資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの １．当該資産除去債務の概要 事業用に賃借している事務所等の不動産賃貸借契約に基づく原状回復義務であります。 ２．当該資産除去債務の金額の算定方法 物件の耐用年数等を参考に使用期間を見積り、対応する期間の割引率を使用して、金額を算定しております。 ３．当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減 期首残高　16,345千円 時の経過による調整額　80千円 見積りの変更による増加額※　3,574千円 期末残高　20,000千円 ※当社グループの経営統合に伴い、平成24年５月にオフィス移転することを決定したことから、当事業年度末において見積りの見直しを行ったもの

11. セグメント情報等

第25期
(平成22年４月１日から
平成23年３月31日まで)

（セグメント情報）

第25期（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

（関連情報）

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

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

第26期
(平成23年４月１日から
平成24年３月31日まで)

（セグメント情報）

第26期（平成23年４月１日から平成24年３月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

（関連情報）

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

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

12. 関連当事者との取引関係

Ⅰ 第25期（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）

１．関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

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

(2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注１）報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

（注２）取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

Ⅱ 第26期（平成23年４月１日から平成24年３月31日まで）

１．関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

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

(2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注１）報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

（注２）取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

13. １株当たり情報

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

１株当たり当期純損益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

14. 重要な後発事象

第26期 (平成23年４月１日から 平成24年３月31日まで)
（企業結合） 当社は、平成24年１月31日開催の取締役会における決議に基づき、住信アセットマネジメント株式会社と平成24年４月１日を効力発生日として合併する旨の「合併契約書」を平成24年１月31日付で締結いたしました。上記契約に基づき、当社及び住信アセットマネジメント株式会社は、平成24年４月１日付で合併いたしました。 (1) 企業結合の概要 ①結合当事企業の名称及び当該事業の内容 結合企業 名称　　住信アセットマネジメント株式会社 事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業 被結合企業 名称　　中央三井アセットマネジメント株式会社 事業の内容 投資運用業、第二種金融商品取引業 ②企業結合日 平成24年４月１日 ③企業結合の法的形式 住信アセットマネジメント株式会社を吸収合併存続会社、当社を吸収合併消滅会社とする吸収合併 合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。 ④結合後の企業の名称 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社 ⑤その他取引の概要に関する事項 旧中央三井トラスト・グループと旧住友信託銀行グループは、平成23年４月１日に経営統合を行い、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（平成23年４月１日付で中央三井トラスト・ホールディングス株式会社が商号変更しております。）が誕生しました。今般、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社のグループ会社として、経営統合の目的に鑑み、統合効果を最大化する一環として、当社及び住信アセットマネジメント株式会社が合併し「三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社」として発足するものです。 (2) 実施した会計処理の概要 「企業結合に関する会計基準」（企業会計基準第21号 平成20年12月26日）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成20年12月26日）に基づき、共通支配下の取引として処理いたします。

次へ

5 その他

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第1 委託会社等の概況」「5 その他」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。
（注）下線部＿＿は訂正部分を示します。

＜訂正前＞
(1)（省略）
(2)訴訟事件その他の重要事項
本書提出日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。
＜訂正後＞
(1)（省略）
(2)訴訟事件その他の重要事項
平成24年10月19日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1 名称、資本金の額及び事業の内容

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第2 その他の関係法人の概況」「1 名称、資本金の額及び事業の内容」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。
（注）下線部＿＿は訂正部分を示します。

(2)販売会社

＜訂正前＞

名称	資本金の額（百万円） （平成24年3月末日現在）	事業の内容
（中略）	（中略）	（中略）
マネックス証券株式会社※	7,425	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

※マネックス証券株式会社は、平成24年8月17日より募集・販売等の取扱いを行います。

＜訂正後＞

名称	資本金の額（百万円） （平成24年3月末日現在）	事業の内容
（中略）	（中略）	（中略）
マネックス証券株式会社	7,425	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

3 資本関係

原届出書の「第三部 委託会社等の情報」「第2 その他の関係法人の概況」「3 資本関係」につきましては、該当情報を以下の内容に訂正します。
（注）下線部＿＿は訂正部分を示します。

＜訂正前＞

（前略）

（参考）再信託受託会社
①名称　　：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
②設立年月日　：（省略）
③資本金の額　：51,000百万円（平成23年9月末日現在）
④事業の内容　：（省略）
⑤再信託の目的：（省略）

＜訂正後＞

（前略）

（参考）再信託受託会社
①名称　　：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
②設立年月日　：（省略）
③資本金の額　：51,000百万円（平成24年3月末日現在）
④事業の内容　：（省略）
⑤再信託の目的：（省略）

独立監査人の中間監査報告書

平成24年8月31日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人
指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　石 井 勝 也 ㊞

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」に掲げられている世界経済インデックスファンドの平成24年1月21日から平成24年7月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、世界経済インデックスファンドの平成24年7月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成24年1月21日から平成24年7月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以 上

※ 1. 上記は、当社が、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
※ 2. 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

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24年６月11日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以 上

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