【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25年10月21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】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出したこと等に伴い、平成25年4月9日に提出した有価証券届出書（平成25年10月11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。

(5)申込手数料
＜訂正前＞
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.15%（税抜（※）3.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。
申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。
※「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

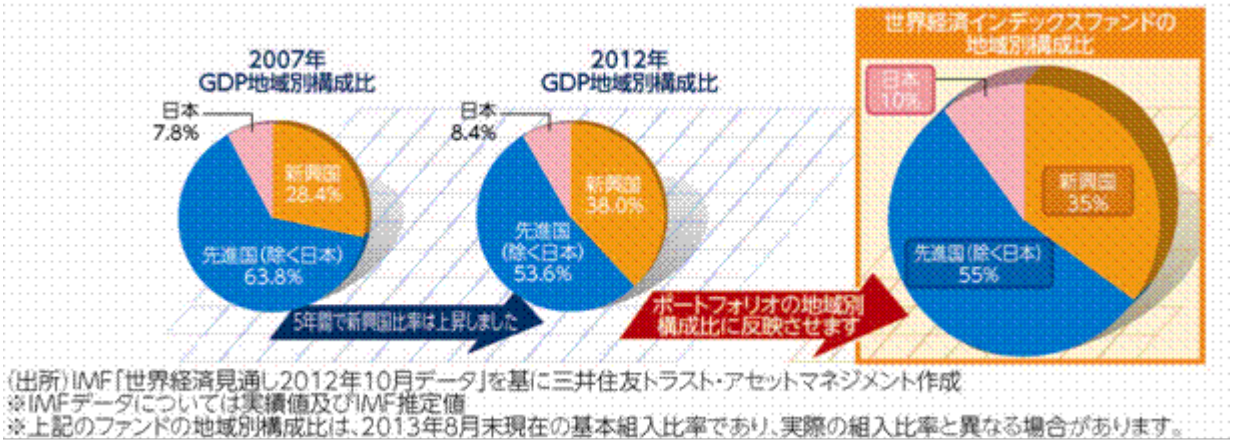
＜訂正後＞
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.15%（税抜3.0%）（※）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。
申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。
※「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。また、消費税率が8%になった場合は、3.24%（税込）となります。

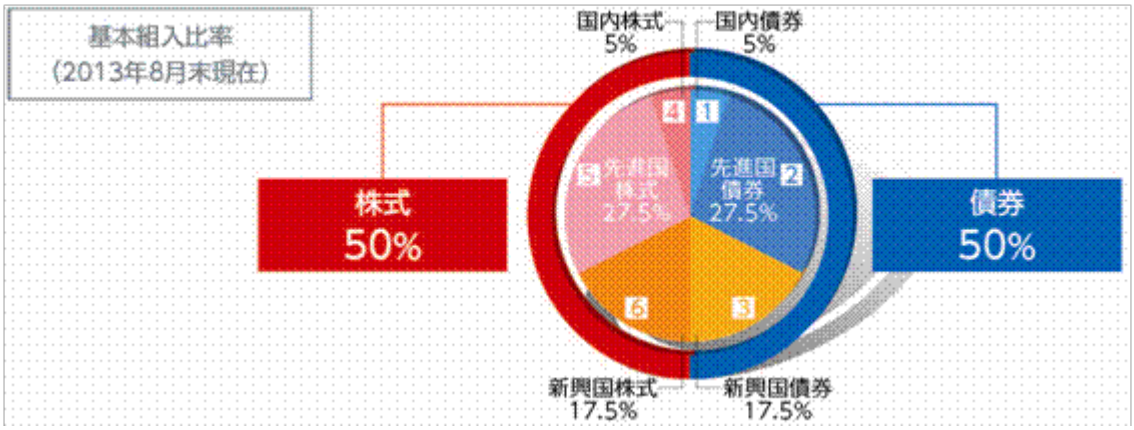
第二部【ファンド情報】
第1【ファンドの状況】
1 ファンドの性格

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」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。

(1)ファンドの目的及び基本的性格
④ファンドの特色
「2.世界経済全体の発展を享受します。」を以下の内容に更新・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。





・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、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

※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（以下「CGMI」）が開発した、世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は、CGMI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すべての権利は、CGMIが有しています。なお、CGMIは、ファンドの設定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（円換算ベース）」とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

※4「東証株価指数（TOPIX）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

①同指数の指数値及び同指数の商標は、東証の知的財産であり、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・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有しています。

②東証は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止又は同指数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東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

④東証は、同指数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、東証は、同指数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当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。

⑥東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。

⑦東証は、当社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数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。

⑧以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動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 Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.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（円換算ベース）」とは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の

知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.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。

「3. 信託報酬を抑えたファンドです。」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＞

・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%）です。
※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。

＜訂正後＞

・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%）です。
（注）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。
※消費税が8%になった場合は、0.54%となります。

「ご参考情報」を以下の内容に更新・訂正します。

＜更新・訂正後＞

新興国は世界経済における存在感を増しています。

・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。世界経済における新興国の人口やGDPの割合は年々増加しています。

(出所)国連World Population Prospects(The 2012 Revision)及びIMF「世界経済見通し2013年4月データ」を基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成
※先進国の名目GDP総額は日本を除く数値です。

(3)ファンドの仕組み

（注）下線部＿＿＿＿は訂正部分を示します。

＜訂正前＞

（前略）

③委託会社の概況

イ．資本金の額：3億円（平成25年2月28日現在）

（中略）

ハ．大株主の状況（平成25年2月28日現在）

（後略）

＜訂正後＞

（前略）

③委託会社の概況

イ．資本金の額：3億円（平成25年8月30日現在）

（中略）

ハ．大株主の状況（平成25年8月30日現在）

（後略）

次へ

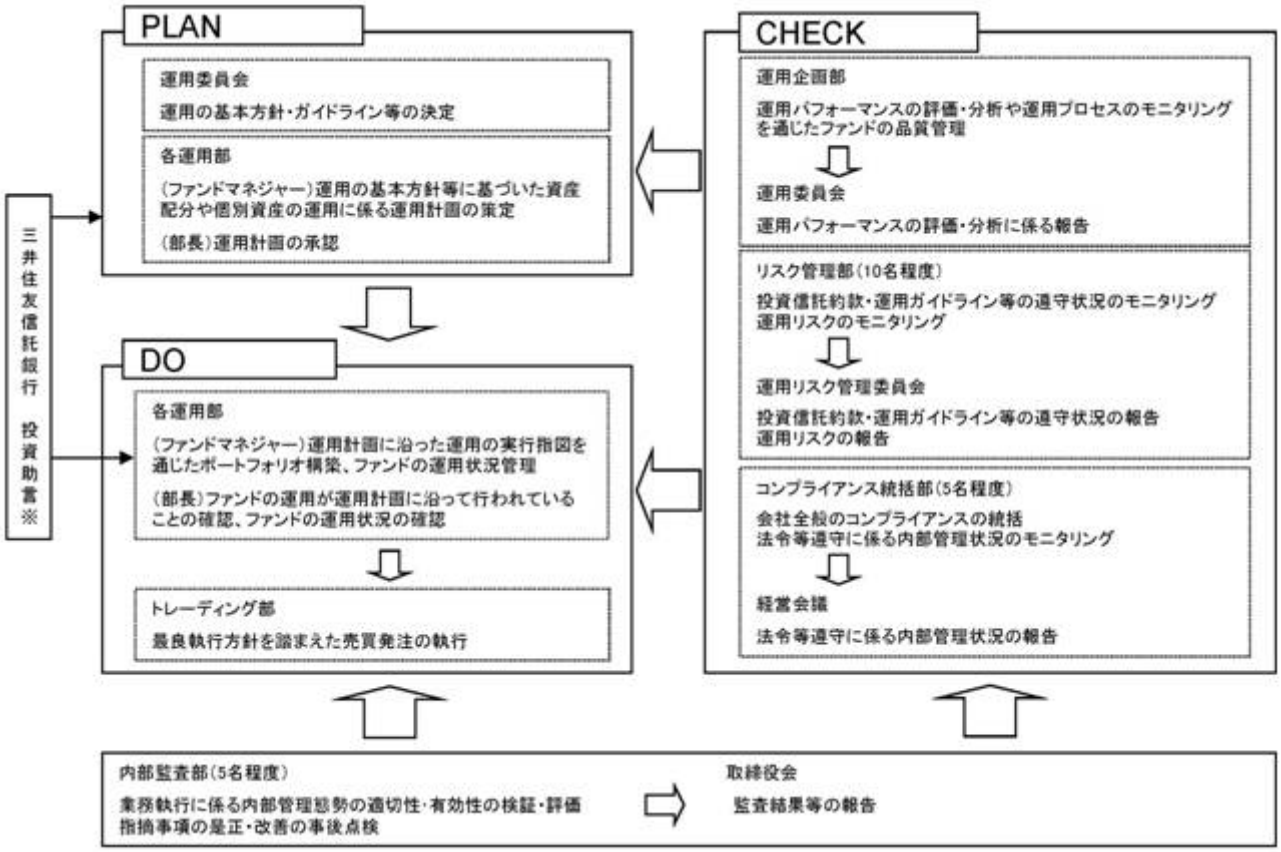
2 投資方針

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25年10月21日現在のものであり、今後変更されることがあります。



※三井住友信託銀行は各マザーファンドに対して投資助言を行います。

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。

次へ

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。

(2)リスクの管理体制
＜訂正前＞

（前略）

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。

（後略）

＜訂正後＞

（前略）

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経営会議に報告します。

（後略）

次へ

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。

(1)申込手数料
＜訂正前＞
①取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.15%（税抜　3.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

（後略）

＜訂正後＞
①取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.15%（※）（税抜　3.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。
※消費税率が8%になった場合は、3.24%となります。

（後略）

(3)信託報酬等
＜訂正前＞

（前略）

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。

（後略）

＜訂正後＞

（前略）

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%）

※消費税率が8%になった場合は、0.54%となります。その配分は下記の通りです。

委託会社	年率　0.216%	（税抜　0.2%）
販売会社	年率　0.27%	（税抜　0.25%）
受託会社	年率　0.054%	（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。

（後略）

(5)課税上の取扱い

＜訂正前＞

（前略）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

（中略）

※上記は、平成25年2月28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。

（後略）

＜訂正後＞

（前略）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

（中略）

⑤少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。（平成26年1月1日以降）
少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、平成26年1月1日以降の非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※上記は、平成25年8月30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。

（後略）

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、以下の内容に更新・訂正します。

＜更新・訂正後＞

以下の記載は、平成25年8月30日現在の状況について記載してあります。

(1)投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	3,681,350,302	98.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		55,453,110	1.48
合計(純資産総額)		3,736,803,412	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

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	789,630,118	1.2032	950,137,598	1.3847	1,093,400,824	29.26
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	459,225,923	2.1486	986,723,924	2.2613	1,038,447,579	27.79
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	309,652,118	2.0448	633,198,609	1.9372	599,858,082	16.05
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	394,809,339	1.5913	628,292,331	1.5071	595,017,154	15.92
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	233,234,142	0.7649	178,414,260	0.8988	209,630,846	5.61
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	114,467,370	1.2563	143,809,354	1.2667	144,995,817	3.88

(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	98.52
合計	98.52

(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
第4期計算期間末 (平成25年 1月21日)	2,751,494,290	2,755,095,142	15,282	15,302
平成24年 8月末日	2,162,964,789	―	12,475	―
9月末日	2,235,590,205	―	12,753	―
10月末日	2,303,677,102	―	13,009	―
11月末日	2,378,082,002	―	13,531	―
12月末日	2,562,364,613	―	14,515	―
平成25年 1月末日	2,800,095,773	―	15,551	―
2月末日	2,952,032,238	―	15,660	―
3月末日	3,173,336,078	―	15,976	―
4月末日	3,446,262,686	―	16,970	―
5月末日	3,660,926,771	―	17,288	―
6月末日	3,456,573,545	―	16,223	―
7月末日	3,638,257,207	―	16,526	―
8月末日	3,736,803,412	―	16,243	―

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
第4期計算期間(平成24年 1月21日～平成25年 1月21日)	20

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

第4期計算期間(平成24年 1月21日～平成25年 1月21日)	27.5
第5期中間計算期間(平成25年 1月22日～平成25年 7月21日)	11.4

(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
第4期計算期間 (平成24年 1月21日～平成25年 1月21日)	907,508,119	554,585,762	1,800,426,112
第5期中間計算期間 (平成25年 1月22日～平成25年 7月21日)	839,277,755	467,764,952	2,171,938,915

(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

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	194,724,440,400	77.27
	ポーランド	101,846,000	0.04
	小計	194,826,286,400	77.31
地方債証券	日本	16,194,305,368	6.43
特殊債券	日本	22,505,677,080	8.93
	アメリカ	207,384,000	0.08
	韓国	199,770,000	0.08
	スウェーデン	100,789,000	0.04
	小計	23,013,620,080	9.13
社債券	日本	14,598,543,010	5.79
	オーストラリア	407,028,000	0.16
	オランダ	405,322,000	0.16
	アメリカ	207,621,000	0.08
	スウェーデン	102,381,000	0.04
	イギリス	100,849,000	0.04
	韓国	99,778,000	0.04
	小計	15,921,522,010	6.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,043,204,263	0.81
合計(純資産総額)		251,998,938,121	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

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３２９回利付国債（１０年）	3,610,000,000	100.29	3,620,665,800	100.73	3,636,389,100	0.8	2023/06/20	1.44
日本	国債証券	第１０５回利付国債（５年）	3,040,000,000	99.48	3,024,201,400	100.03	3,041,124,800	0.2	2017/06/20	1.21
日本	国債証券	第８７回利付国債（５年）	2,820,000,000	100.57	2,836,186,800	100.51	2,834,410,200	0.5	2014/12/20	1.12
日本	国債証券	第３２５回利付国債（１０年）	2,770,000,000	99.19	2,747,829,200	101.10	2,800,691,600	0.8	2022/09/20	1.11
日本	国債証券	第３２７回利付国債（１０年）	2,620,000,000	98.94	2,592,350,000	100.96	2,645,152,000	0.8	2022/12/20	1.05
日本	国債証券	第１０６回利付国債（５年）	2,640,000,000	99.27	2,620,965,600	99.97	2,639,445,600	0.2	2017/09/20	1.05

日本	国債証券	第９９回利付国債（５年）	2,600,000,000	100.49	2,612,766,000	100.78	2,620,488,000	0.4	2016/09/20	1.04
日本	国債証券	第８８回利付国債（５年）	2,570,000,000	100.65	2,586,859,200	100.60	2,585,625,600	0.5	2015/03/20	1.03
日本	国債証券	第２８５回利付国債（１０年）	2,390,000,000	105.26	2,515,717,000	105.38	2,518,749,300	1.7	2017/03/20	1.00
日本	国債証券	第３０５回利付国債（１０年）	2,380,000,000	104.65	2,490,749,300	105.75	2,516,945,200	1.3	2019/12/20	1.00
日本	国債証券	第１１３回利付国債（５年）	2,250,000,000	100.13	2,252,980,000	100.21	2,254,792,500	0.3	2018/06/20	0.89
日本	国債証券	第２９６回利付国債（１０年）	2,100,000,000	105.41	2,213,684,000	106.20	2,230,263,000	1.5	2018/09/20	0.89
日本	国債証券	第２８８回利付国債（１０年）	2,090,000,000	105.68	2,208,774,700	106.02	2,215,838,900	1.7	2017/09/20	0.88
日本	国債証券	第３２８回利付国債（１０年）	2,160,000,000	97.10	2,097,380,900	99.01	2,138,745,600	0.6	2023/03/20	0.85
日本	国債証券	第９７回利付国債（５年）	2,080,000,000	100.58	2,092,108,800	100.75	2,095,620,800	0.4	2016/06/20	0.83
日本	国債証券	第３１２回利付国債（１０年）	1,900,000,000	103.30	1,962,852,500	104.89	1,992,910,000	1.2	2020/12/20	0.79
日本	国債証券	第１０３回利付国債（５年）	1,940,000,000	99.96	1,939,262,800	100.44	1,948,536,000	0.3	2017/03/20	0.77
日本	国債証券	第９３回利付国債（５年）	1,910,000,000	100.84	1,926,201,700	100.88	1,926,827,100	0.5	2015/12/20	0.76
日本	国債証券	第１１０回利付国債（５年）	1,900,000,000	99.43	1,889,240,000	100.29	1,905,548,000	0.3	2018/03/20	0.76
日本	国債証券	第１０２回利付国債（５年）	1,880,000,000	100.10	1,881,931,000	100.47	1,888,930,000	0.3	2016/12/20	0.75
日本	国債証券	第３２２回利付国債（１０年）	1,730,000,000	100.08	1,731,401,300	102.18	1,767,852,400	0.9	2022/03/20	0.70
日本	国債証券	第２９８回利付国債（１０年）	1,660,000,000	104.48	1,734,368,000	105.37	1,749,258,200	1.3	2018/12/20	0.69
日本	国債証券	第３２０回利付国債（１０年）	1,680,000,000	101.03	1,697,388,000	103.12	1,732,416,000	1.0	2021/12/20	0.69
日本	国債証券	第３２９回利付国債（２年）	1,670,000,000	100.13	1,672,208,200	100.15	1,672,655,300	0.2	2015/06/15	0.66
日本	国債証券	第３０１回利付国債（１０年）	1,540,000,000	105.70	1,627,828,200	106.77	1,644,304,200	1.5	2019/06/20	0.65
日本	国債証券	第２７３回利付国債（１０年）	1,590,000,000	103.09	1,639,146,900	102.83	1,635,124,200	1.5	2015/09/20	0.65
日本	国債証券	第１０７回利付国債（５年）	1,620,000,000	99.10	1,605,501,000	99.91	1,618,606,800	0.2	2017/12/20	0.64
日本	国債証券	第８９回利付国債（５年）	1,610,000,000	100.53	1,618,565,200	100.52	1,618,500,800	0.4	2015/06/20	0.64
日本	国債証券	第２８９回利付国債（１０年）	1,530,000,000	104.96	1,606,025,700	105.49	1,614,027,600	1.5	2017/12/20	0.64
日本	国債証券	第１１１回利付国債（５年）	1,600,000,000	100.21	1,603,456,000	100.74	1,611,856,000	0.4	2018/03/20	0.64

(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	77.31
地方債証券	6.43
特殊債券	9.13
社債券	6.32
合計	99.19

(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

資産の種類	資産の名称	取引所	買建／売建	通貨	数量	簿価金額(現地通貨)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
債券先物取引	長期国債先物	東京証券取引所	買建	円	4	576,531,260	577,400,000	577,400,000	0.23

(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。

国内株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	134,804,876,380	98.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,849,425,488	1.35
合計(純資産総額)		136,654,301,868	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

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	1,126,900	6,191.07	6,976,716,783	5,940.00	6,693,786,000	4.90
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	6,556,300	613.57	4,022,748,991	576.00	3,776,428,800	2.76
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	654,700	4,195.22	2,746,610,534	4,350.00	2,847,945,000	2.08
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	740,000	4,000.05	2,960,037,000	3,545.00	2,623,300,000	1.92
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	419,300	5,318.46	2,230,030,278	6,190.00	2,595,467,000	1.90
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	11,199,500	200.88	2,249,755,560	200.00	2,239,900,000	1.64
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	546,200	3,610.20	1,971,891,240	3,335.00	1,821,577,000	1.33
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	364,500	5,196.11	1,893,982,095	4,995.00	1,820,677,500	1.33
日本	株式	三菱地所	不動産業	606,000	2,651.00	1,606,506,000	2,560.00	1,551,360,000	1.14
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	344,100	4,677.54	1,609,541,514	4,470.00	1,538,127,000	1.13
日本	株式	キヤノン	電気機器	508,600	3,659.62	1,861,282,732	2,948.00	1,499,352,800	1.10
日本	株式	ファナック	電気機器	91,300	15,227.00	1,390,225,100	15,010.00	1,370,413,000	1.00
日本	株式	三井不動産	不動産業	408,000	2,980.70	1,216,125,600	3,105.00	1,266,840,000	0.93
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,106,000	700.90	1,476,095,400	593.00	1,248,858,000	0.91
日本	株式	三菱商事	卸売業	675,500	1,847.47	1,247,965,985	1,842.00	1,244,271,000	0.91
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	362,200	3,678.36	1,332,301,992	3,385.00	1,226,047,000	0.90
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	161,200	7,703.92	1,241,871,904	7,540.00	1,215,448,000	0.89
日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	1,770,300	840.29	1,487,565,387	686.00	1,214,425,800	0.89
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	244,300	4,809.77	1,175,026,811	4,695.00	1,146,988,500	0.84
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	7,133	151,866.18	1,083,261,461	157,500.00	1,123,447,500	0.82

日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	3,906,000	274.43	1,071,923,580	280.00	1,093,680,000	0.80
日本	株式	ソニー	電気機器	551,300	2,064.31	1,138,054,103	1,972.00	1,087,163,600	0.80
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,108,100	1,131.98	1,254,347,038	977.00	1,082,613,700	0.79
日本	株式	三井物産	卸売業	747,300	1,366.68	1,021,319,964	1,369.00	1,023,053,700	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	335,300	3,149.06	1,055,879,818	3,035.00	1,017,635,500	0.74
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	199,100	5,420.09	1,079,139,919	5,030.00	1,001,473,000	0.73
日本	株式	信越化学工業	化学	164,800	6,516.77	1,073,963,696	5,930.00	977,264,000	0.72
日本	株式	デンソー	輸送用機器	216,700	4,468.82	968,393,294	4,500.00	975,150,000	0.71
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	287,900	3,468.84	998,679,036	3,230.00	929,917,000	0.68
日本	株式	小松製作所	機械	428,400	2,714.50	1,162,891,800	2,155.00	923,202,000	0.68

(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	98.65
合計	98.65

(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	0.08
		鉱業	0.47
		建設業	2.46
		食料品	4.02
		繊維製品	0.73
		パルプ・紙	0.25
		化学	5.38
		医薬品	4.44
		石油・石炭製品	0.66
		ゴム製品	0.90
		ガラス・土石製品	0.95
		鉄鋼	1.74
		非鉄金属	1.03
		金属製品	0.64
		機械	5.08
		電気機器	11.18
		輸送用機器	11.77
		精密機器	1.28
		その他製品	1.36
		電気・ガス業	2.39
		陸運業	3.90
		海運業	0.35

		空運業	0.63
		倉庫・運輸関連業	0.22
		情報・通信業	6.85
		卸売業	4.54
		小売業	4.26
		銀行業	9.97
		証券、商品先物取引業	1.74
		保険業	2.36
		その他金融業	1.19
		不動産業	3.66
		サービス業	2.17
合計			98.65

(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	165	1,894,664,225	1,819,125,000	1,819,125,000	1.33

(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

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	91,173,517,353	40.13
	フランス	22,500,238,728	9.90
	イタリア	21,814,007,862	9.60
	ドイツ	19,501,743,984	8.58
	イギリス	16,997,726,023	7.48
	スペイン	11,239,899,205	4.95
	オランダ	6,086,840,824	2.68
	ベルギー	6,047,041,954	2.66
	カナダ	5,659,143,127	2.49
	オーストリア	3,822,050,709	1.68
	オーストラリア	3,155,232,497	1.39
	メキシコ	2,177,943,222	0.96
	デンマーク	1,886,595,773	0.83
	アイルランド	1,791,427,363	0.79
	ポーランド	1,676,036,100	0.74
	フィンランド	1,504,091,254	0.66
	スウェーデン	1,207,258,108	0.53
	南アフリカ	1,177,559,163	0.52
	マレーシア	1,105,917,859	0.49
	スイス	838,020,127	0.37
	シンガポール	833,270,975	0.37
	ノルウェー	711,502,360	0.31
	小計	222,907,064,570	98.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,293,862,191	1.89
合計(純資産総額)		227,200,926,761	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

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	33,900,000	10,118.29	3,430,101,394	10,059.61	3,410,209,607	2.625	2014/07/31	1.50
アメリカ	国債証券	T 1.375% 11/30/15	27,800,000	10,075.99	2,801,127,555	10,030.79	2,788,562,102	1.375	2015/11/30	1.23
アメリカ	国債証券	T 2.5% 03/31/15	20,700,000	10,235.58	2,118,766,612	10,177.37	2,106,717,317	2.500	2015/03/31	0.93

アメリカ	国債証券	T 0.875% 02/28/17	20,600,000	9,894.03	2,038,170,674	9,784.70	2,015,649,607	0.875	2017/02/28	0.89
アメリカ	国債証券	T 0.375% 06/15/15	20,200,000	9,844.64	1,988,619,152	9,838.49	1,987,376,486	0.375	2015/06/15	0.87
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	19,200,000	10,197.74	1,957,966,447	10,144.52	1,947,749,313	2.375	2015/02/28	0.86
アメリカ	国債証券	T 0.75% 06/30/17	19,400,000	9,812.17	1,903,562,626	9,678.66	1,877,660,516	0.750	2017/06/30	0.83
アメリカ	国債証券	T 0.25% 04/15/16	18,000,000	9,771.64	1,758,895,802	9,740.52	1,753,293,897	0.250	2016/04/15	0.77
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	15,000,000	10,139.72	1,520,958,743	10,091.31	1,513,697,002	1.750	2015/07/31	0.67
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/30/16	14,000,000	10,556.21	1,477,870,531	10,414.82	1,458,075,581	2.750	2016/11/30	0.64
アメリカ	国債証券	T 0.25% 07/15/15	14,000,000	9,821.39	1,374,995,963	9,812.56	1,373,758,775	0.250	2015/07/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 3.125% 05/15/19	12,800,000	10,895.09	1,394,572,668	10,539.31	1,349,031,993	3.125	2019/05/15	0.59
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	13,100,000	10,156.24	1,330,468,263	10,107.25	1,324,050,861	1.875	2015/06/30	0.58
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	10,683.97	1,335,496,350	10,574.46	1,321,808,560	4.250	2015/08/15	0.58
アメリカ	国債証券	T 0.625% 07/15/16	13,300,000	9,846.81	1,309,627,006	9,803.91	1,303,921,056	0.625	2016/07/15	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.125% 11/30/14	12,600,000	10,115.51	1,274,555,413	10,072.87	1,269,181,725	2.125	2014/11/30	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/31/14	12,500,000	10,106.29	1,263,287,237	10,054.23	1,256,779,531	2.375	2014/08/31	0.55
アメリカ	国債証券	T 0.75% 02/28/18	13,100,000	9,733.79	1,275,127,519	9,543.99	1,250,263,181	0.750	2018/02/28	0.55
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/14	12,000,000	10,322.80	1,238,736,621	10,221.94	1,226,633,726	4.250	2014/08/15	0.54
ドイツ	国債証券	DBR 3.25% 07/04/15	8,300,000	13,865.04	1,150,798,556	13,751.58	1,141,381,618	3.250	2015/07/04	0.50
アメリカ	国債証券	T 0.375% 04/15/15	11,500,000	9,851.75	1,132,951,588	9,845.98	1,132,288,819	0.375	2015/04/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 4.5% 05/15/17	9,800,000	11,275.09	1,104,958,946	11,048.01	1,082,705,771	4.500	2017/05/15	0.48
フランス	国債証券	FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000	13,854.73	1,094,524,131	13,704.24	1,082,635,238	3.500	2015/04/25	0.48
アメリカ	国債証券	T 1.5% 03/31/19	11,000,000	9,977.20	1,097,492,044	9,681.73	1,064,990,982	1.500	2019/03/31	0.47
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	11,500,000	9,730.14	1,118,966,986	9,245.07	1,063,183,235	2.000	2023/02/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 2% 01/31/16	10,300,000	10,245.76	1,055,314,240	10,182.18	1,048,764,649	2.000	2016/01/31	0.46
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 04/25/19	6,700,000	15,419.63	1,033,115,255	15,012.63	1,005,846,515	4.250	2019/04/25	0.44
スペイン	国債証券	SPGB 4.4% 01/31/15	7,400,000	13,628.83	1,008,533,757	13,530.17	1,001,233,154	4.400	2015/01/31	0.44

アメリカ	国債証券	T 3% 02/28/17	9,500,000	10,672.63	1,013,900,447	10,507.42	998,205,116	3.000	2017/02/28	0.44
イギリス	国債証券	UKT 1% 09/07/17	6,550,000	15,334.25	1,004,393,935	15,127.92	990,879,123	1.000	2017/09/07	0.44

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

b．投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.11
合計	98.11

(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

資産の種類	資産の名称	取引所	買建／売建	通貨	数量	簿価金額(現地通貨)	評価金額(現地通貨)	評価金額(円)	投資比率(%)
債券先物取引	US 5YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	12	1,437,735.56	1,436,250	141,269,550	0.06
	US 10YR NOTE	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	6	747,586.50	746,250	73,401,150	0.03
	US LONG BOND	シカゴ商品取引所	買建	アメリカドル	4	526,453.50	526,750	51,811,130	0.02
	EURO-SCHATZ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	8	883,462	882,920	114,991,500	0.05
	EURO-BOBL FU	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	7	878,928	875,280	113,996,467	0.05
	EURO-BUND	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	11	1,559,744	1,546,600	201,429,184	0.09

(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。

外国株式インデックス マザーファンド

(1)投資状況

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	83,327,853,523	53.69
	イギリス	14,489,150,991	9.34
	カナダ	6,992,012,760	4.51
	スイス	6,803,239,941	4.38
	フランス	6,130,001,169	3.95
	ドイツ	5,911,062,593	3.81
	オーストラリア	4,932,523,127	3.18
	オランダ	2,416,576,249	1.56
	スウェーデン	2,211,967,344	1.43
	スペイン	2,036,444,579	1.31
	香港	1,634,012,267	1.05
	イタリア	1,395,096,131	0.90
	アイルランド	1,132,574,225	0.73
	シンガポール	1,011,250,346	0.65
	ベルギー	806,755,574	0.52
	ジャージー	802,058,934	0.52
	デンマーク	788,663,707	0.51
	バミューダ	627,429,594	0.40
	アンティル	621,209,970	0.40
	フィンランド	566,702,244	0.37
	ノルウェー	456,354,964	0.29
	イスラエル	314,679,461	0.20
	ルクセンブルク	251,986,296	0.16
	オーストリア	210,078,285	0.14
	ケイマン	191,552,247	0.12
	ポルトガル	124,262,720	0.08
	ニュージーランド	82,209,019	0.05
	パナマ	81,600,439	0.05
	英ヴァージン諸島	80,821,816	0.05
	ガーンジー	40,950,166	0.03
	マン島	36,720,426	0.02
	リベリア	32,126,067	0.02
	モーリシャス	19,199,980	0.01
	ギリシャ	14,194,727	0.01
	小計	146,573,321,881	94.45
投資信託受益証券	オーストラリア	53,817,244	0.03
	シンガポール	24,053,938	0.02
	香港	12,016,836	0.01

	小計	89,888,018	0.06
投資証券	アメリカ	2,088,041,890	1.35
	オーストラリア	380,715,846	0.25
	フランス	198,488,397	0.13
	イギリス	183,910,261	0.12
	香港	61,046,592	0.04
	シンガポール	51,910,028	0.03
	カナダ	35,633,360	0.02
	オランダ	17,662,147	0.01
	小計	3,017,408,521	1.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,509,410,716	3.55
合計(純資産総額)		155,190,029,136	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

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	54,895	43,420.03	2,383,543,007	48,366.56	2,655,082,464	1.71
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	259,757	9,086.49	2,360,281,149	8,583.87	2,229,722,189	1.44
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	462,980	3,443.58	1,594,310,335	3,299.97	1,527,823,814	0.98
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	163,898	8,617.31	1,412,361,447	8,515.02	1,395,595,600	0.90
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	601,984	2,321.29	1,397,383,051	2,273.09	1,368,369,589	0.88
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	112,856	12,435.65	1,403,438,258	11,839.59	1,336,169,130	0.86
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	15,784	86,681.71	1,368,184,224	84,110.58	1,327,601,502	0.86
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	159,563	7,953.38	1,269,066,704	7,604.21	1,213,350,815	0.78
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	187,742	6,925.31	1,300,172,488	6,407.23	1,202,907,676	0.78
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	292,929	3,985.54	1,167,482,355	4,057.34	1,188,515,478	0.77
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,098,167	1,133.66	1,244,958,323	1,048.68	1,151,628,339	0.74
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	61,324	20,437.24	1,253,293,354	17,964.47	1,101,653,182	0.71

アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	220,046	5,370.45	1,181,747,360	4,986.85	1,097,336,835	0.71
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	382,194	2,848.50	1,088,681,749	2,763.91	1,056,352,111	0.68
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	315,878	3,558.66	1,124,103,919	3,309.81	1,045,497,426	0.67
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	40,902	26,707.39	1,092,385,992	24,751.39	1,012,381,476	0.65
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	133,917	7,549.12	1,010,955,770	7,157.92	958,567,306	0.62
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	2,848,571	300.58	856,230,877	312.40	889,915,086	0.57
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	627,615	1,313.10	824,125,022	1,393.76	874,745,435	0.56
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	233,361	4,185.21	976,666,657	3,747.51	874,524,081	0.56
アメリカ	株式	CITIGROUP	各種金融	177,151	5,094.06	902,418,602	4,767.50	844,569,022	0.54
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	175,797	4,683.90	823,416,130	4,632.75	814,424,606	0.52
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	167,979	4,998.65	839,669,101	4,703.57	790,101,858	0.51
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	95,216	9,182.88	874,358,016	8,250.43	785,573,590	0.51
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,105,443	735.43	812,982,135	687.98	760,526,233	0.49
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	286,775	2,718.97	779,734,227	2,553.42	732,258,826	0.47
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	311,138	2,349.82	731,118,419	2,306.54	717,652,864	0.46
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	221,111	3,439.15	760,434,603	3,229.35	714,046,067	0.46
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	90,030	8,107.81	729,946,566	7,802.89	702,494,978	0.45
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	124,532	5,218.71	649,897,240	5,536.50	689,471,716	0.44

(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	94.45
投資信託受益証券	0.06
投資証券	1.94

合計	96.45

(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	10.29
		素材	5.53
		資本財	7.27
		商業・専門サービス	0.90
		運輸	1.75
		自動車・自動車部品	1.61
		耐久消費財・アパレル	1.61
		消費者サービス	1.65
		メディア	2.83
		小売	3.03
		食品・生活必需品小売り	2.20
		食品・飲料・タバコ	6.24
		家庭用品・パーソナル用品	1.83
		ヘルスケア機器・サービス	2.91
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.47
		銀行	7.56
		各種金融	5.32
		保険	4.53
		不動産	0.67
		ソフトウェア・サービス	6.17
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.02
		電気通信サービス	3.40
		公益事業	3.22
		半導体・半導体製造装置	1.41
合計			94.45

(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	84	34,192,803	34,370,700	3,380,702,052	2.18
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	24	3,446,904	3,509,760	327,706,291	0.21
	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	39	3,019,943	3,028,350	320,187,445	0.21
	DJ EURO STOX	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	170	4,587,375	4,688,600	610,643,264	0.39
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	32	3,959,399	4,060,800	356,619,456	0.23
	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	71	4,526,821.25	4,604,705	702,585,888	0.45

(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

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	ブラジル	2,250,691,231	10.11
	マレーシア	2,219,525,801	9.97
	メキシコ	2,188,864,553	9.84
	南アフリカ	2,188,571,846	9.83
	ロシア	2,178,097,584	9.79
	ポーランド	2,127,906,375	9.56
	トルコ	2,080,527,051	9.35
	インドネシア	1,834,140,429	8.24
	タイ	1,631,294,776	7.33
	ハンガリー	1,186,174,906	5.33
	コロンビア	751,759,663	3.38
	ナイジェリア	418,250,085	1.88
	ペルー	394,856,026	1.77
	フィリピン	121,515,530	0.55
	チリ	29,593,909	0.13
	小計	21,601,769,765	97.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		651,701,440	2.93
合計(純資産総額)		22,253,471,205	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

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	230,000,000	318.84	733,352,400	306.63	705,256,348	7.850	2018/03/10	3.17
ロシア	国債証券	RFLB 7% 06/03/15	222,450,000	302.29	672,446,387	301.03	669,655,093	7.000	2015/06/03	3.01
ロシア	国債証券	RFLB 7.6% 04/14/21	155,000,000	309.65	479,958,237	303.46	470,374,121	7.600	2021/04/14	2.11
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 01/01/16	14,000,000	3,228.41	451,978,314	3,176.28	444,680,030	0.000	2016/01/01	2.00
コロンビア	国債証券	COLOM 12% 10/22/15	7,500,000,000	6.20	465,463,041	5.78	433,589,568	12.000	2015/10/22	1.95
南アフリカ	国債証券	SAGB 10.5% 12/21/26	39,000,000	1,178.67	459,683,235	1,096.46	427,623,188	10.500	2026/12/21	1.92
ブラジル	国債証券	BRAZIL 12.5% 01/05/16	9,500,000	5,123.29	486,712,683	4,459.06	423,611,177	12.500	2016/01/05	1.90

ブラジル	国債証券	BNTNF 10% 01/01/17	9,500,000	4,208.27	399,785,929	3,977.66	377,878,509	10.000	2017/01/01	1.70
ブラジル	国債証券	BLTN 0% 04/01/15	10,250,000	3,528.10	361,631,113	3,486.04	357,319,343	0.000	2015/04/01	1.61
ロシア	国債証券	RFLB 8.15% 02/03/27	109,500,000	319.35	349,698,195	303.93	332,812,022	8.150	2027/02/03	1.50
ポーランド	国債証券	POLGB 5.5% 04/25/15	9,900,000	3,179.34	314,755,377	3,165.95	313,429,802	5.500	2015/04/25	1.41
ナイジェリア	国債証券	NIGB 7% 10/23/19	675,000,000	49.24	332,429,500	44.20	298,357,425	7.000	2019/10/23	1.34
タイ	国債証券	THAIGB 3.25% 06/16/17	95,000,000	307.83	292,447,269	303.47	288,303,178	3.250	2017/06/16	1.30
トルコ	国債証券	TURKGB 7.1% 03/08/23	7,100,000	4,134.90	293,577,943	3,990.29	283,310,785	7.100	2023/03/08	1.27
マレーシア	国債証券	MGS 3.314% 10/31/17	9,600,000	2,992.57	287,286,808	2,940.92	282,328,779	3.314	2017/10/31	1.27
ポーランド	国債証券	POLGB 4.75% 10/25/16	8,850,000	3,162.23	279,858,155	3,166.41	280,227,709	4.750	2016/10/25	1.26
トルコ	国債証券	TURKGB 9% 03/08/17	5,500,000	5,072.38	278,981,202	4,743.75	260,906,739	9.000	2017/03/08	1.17
マレーシア	国債証券	MGS 3.172% 07/15/16	8,700,000	2,984.69	259,668,807	2,958.67	257,404,606	3.172	2016/07/15	1.16
ポーランド	国債証券	POLGB 5.75% 09/23/22	7,550,000	3,464.68	261,583,352	3,334.49	251,754,505	5.750	2022/09/23	1.13
インドネシア	国債証券	INDOGB 8.25% 06/15/32	27,700,000,000	1.10	305,458,426	0.84	234,425,100	8.250	2032/06/15	1.05
トルコ	国債証券	TURKGB 6.5% 01/07/15	5,000,000	4,708.37	235,418,790	4,685.40	234,270,051	6.500	2015/01/07	1.05
南アフリカ	国債証券	SAGB 8.25% 09/15/17	23,500,000	1,038.56	244,061,631	977.11	229,623,015	8.250	2017/09/15	1.03
トルコ	国債証券	TURKGB 10% 06/17/15	4,670,000	5,231.64	244,318,041	4,885.04	228,131,785	10.000	2015/06/17	1.03
南アフリカ	国債証券	SAGB 8% 12/21/18	23,600,000	1,021.31	241,031,271	964.76	227,683,588	8.000	2018/12/21	1.02
ハンガリー	国債証券	HGB 8% 02/12/15	500,000,000	45.42	227,145,497	45.52	227,642,765	8.000	2015/02/12	1.02
マレーシア	国債証券	MGS 3.741% 02/27/15	7,500,000	3,030.63	227,297,530	3,007.72	225,579,680	3.741	2015/02/27	1.01
南アフリカ	国債証券	SAGB 13.5% 09/15/15	21,000,000	1,138.51	239,088,545	1,073.81	225,501,547	13.500	2015/09/15	1.01
南アフリカ	国債証券	SAGB 7.25% 01/15/20	23,850,000	988.55	235,769,995	918.25	219,004,311	7.250	2020/01/15	0.98
トルコ	国債証券	TURKGB 9.5% 01/12/22	4,550,000	5,569.12	253,395,004	4,711.25	214,362,319	9.500	2022/01/12	0.96
インドネシア	国債証券	INDOGB 7% 05/15/27	26,200,000,000	0.95	251,087,564	0.77	203,104,037	7.000	2027/05/15	0.91

(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	97.07
合計	97.07

(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

資産の種類	国／地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	韓国	2,916,872,605	15.39
	台湾	2,137,140,031	11.27
	ブラジル	2,005,683,868	10.58
	中国	1,925,001,474	10.16
	南アフリカ	1,344,734,059	7.09
	ロシア	1,106,363,371	5.84
	インド	1,031,006,795	5.44
	メキシコ	974,369,193	5.14
	香港	870,546,574	4.59
	ケイマン	738,706,502	3.90
	マレーシア	695,833,903	3.67
	インドネシア	475,450,823	2.51
	タイ	445,383,159	2.35
	ポーランド	315,357,870	1.66
	チリ	315,163,282	1.66
	トルコ	299,882,425	1.58
	コロンビア	187,614,498	0.99
	フィリピン	172,912,249	0.91
	バミューダ	148,372,409	0.78
	チェコ	51,675,740	0.27
	エジプト	47,060,881	0.25
	ハンガリー	40,989,089	0.22
	ペルー	20,782,130	0.11
	アメリカ	17,302,310	0.09
	モロッコ	12,184,545	0.06
	ルクセンブルク	4,577,860	0.02
	小計	18,300,967,645	96.55
投資信託受益証券	ブラジル	40,871,297	0.22
	南アフリカ	14,404,316	0.08
	メキシコ	6,946,103	0.04
	小計	62,221,716	0.33
投資証券	メキシコ	19,337,619	0.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		573,269,821	3.02
合計(純資産総額)		18,955,796,801	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

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	5,977	119,852.93	716,361,015	119,481.59	714,141,523	3.77
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	1,331,389	303.63	404,262,526	324.72	432,332,630	2.28
香港	株式	CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	電気通信サービス	324,000	1,090.44	353,303,576	1,053.70	341,401,392	1.80
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,840,620	72.97	280,283,810	72.27	277,584,651	1.46
中国	株式	IND&COMM BK OF CHINA-H	銀行	3,928,515	64.67	254,075,855	64.16	252,056,665	1.33
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	ソフトウェア・サービス	54,900	3,451.89	189,508,765	4,587.62	251,860,557	1.33
ロシア	株式	GAZPROM OAO-SPON ADR	エネルギー	324,429	871.57	282,765,023	773.10	250,819,174	1.32
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	電気通信サービス	2,010,940	114.89	231,051,935	94.28	189,594,640	1.00
香港	株式	CNOOC LTD-R	エネルギー	944,000	201.54	190,259,918	196.79	185,773,158	0.98
韓国	株式	HYUNDAI MOTOR CO	自動車・自動車部品	8,433	19,190.13	161,830,392	21,291.54	179,551,641	0.95
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	21,030	5,344.68	112,398,714	8,064.47	169,596,014	0.89
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	4,051,200	40.15	162,670,688	41.59	168,491,028	0.89
ロシア	株式	SBERBANK-SPONSORED ADR	銀行	156,738	1,090.23	170,882,006	1,060.32	166,192,561	0.88
ロシア	株式	LUKOIL-SPON ADR	エネルギー	28,083	5,870.31	164,855,994	5,773.73	162,143,715	0.86
南アフリカ	株式	MTN GROUP LTD	電気通信サービス	90,402	1,611.65	145,697,029	1,778.56	160,785,399	0.85
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	銀行	134,990	1,141.52	154,093,935	1,185.51	160,032,197	0.84
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	223,840	846.77	189,542,707	704.22	157,633,276	0.83
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	543,048	297.50	161,557,505	262.54	142,572,908	0.75
ブラジル	株式	VALE SA-PREF A	素材	105,215	1,503.95	158,238,623	1,283.43	135,036,718	0.71
南アフリカ	株式	SASOL LTD	エネルギー	29,026	3,578.62	103,873,054	4,639.73	134,673,058	0.71
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA-PREF	銀行	115,600	1,224.54	141,557,004	1,131.34	130,782,961	0.69
ブラジル	株式	CIA DE BEBIDAS DAS AME-PREF	食品・飲料・タバコ	37,200	3,381.89	125,806,425	3,454.44	128,505,279	0.68
中国	株式	PETROCHINA CO LTD-H	エネルギー	1,142,000	128.95	147,262,101	106.76	121,926,315	0.64
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	24,881	3,599.20	89,551,778	4,625.85	115,095,873	0.61
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	エネルギー	163,500	860.40	140,675,648	665.46	108,804,328	0.57
コロンビア	株式	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	エネルギー	23,594	4,583.96	108,154,076	4,464.56	105,336,838	0.56
韓国	株式	POSCO	素材	3,482	29,161.24	101,539,460	28,581.34	99,520,260	0.53

中国	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	エネルギー	1,359,400	79.67	108,308,992	72.14	98,079,622	0.52
ブラジル	株式	VALE SA	素材	68,800	1,538.35	105,839,028	1,416.78	97,474,464	0.51
中国	株式	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	保険	400,000	290.63	116,254,803	242.44	96,976,640	0.51

(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	96.55
投資信託受益証券	0.33
投資証券	0.10
合計	96.98

(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	11.59
		素材	9.47
		資本財	4.44
		商業・専門サービス	0.11
		運輸	1.64
		自動車・自動車部品	3.65
		耐久消費財・アパレル	0.96
		消費者サービス	0.62
		メディア	1.53
		小売	1.70
		食品・生活必需品小売り	2.17
		食品・飲料・タバコ	5.36
		家庭用品・パーソナル用品	1.04
		ヘルスケア機器・サービス	0.59
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.98
		銀行	17.80
		各種金融	2.32
		保険	3.18
		不動産	2.02
		ソフトウェア・サービス	3.35
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.24
		電気通信サービス	7.61
		公益事業	3.02
		半導体・半導体製造装置	8.14
合計			96.55

(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	130	6,130,955	5,912,400	581,543,664	3.07

(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：2013年8月30日

基準価額・純資産の推移

基準価額	16,243円
純資産総額	37億円

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

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:20円

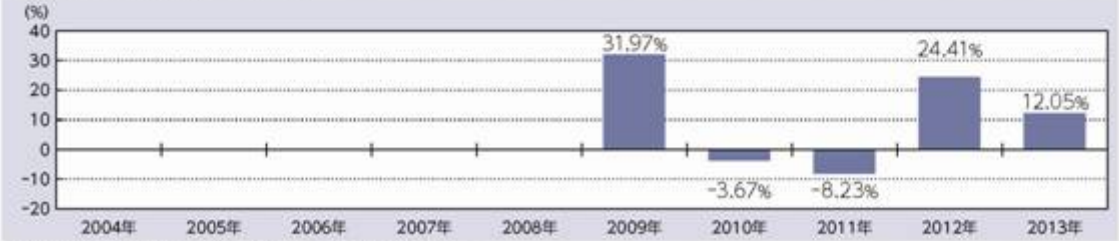
決算期	2010年1月	2011年1月	2012年1月	2013年1月	－
分配金	0円	0円	0円	20円	－

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

主要な資産の状況

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	29.3%	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	－	－	0.5%
		EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	－	－	0.4%
外国債券インデックスマザーファンド	27.8%	T 2.625% 07/31/14	アメリカ	国債証券	－	2.625%	2014/07/31	0.4%
		T 1.375% 11/30/15	アメリカ	国債証券	－	1.375%	2015/11/30	0.3%
新興国株式インデックスマザーファンド	16.1%	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	半導体・半導体製造装置	－	－	0.6%
		TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	半導体・半導体製造装置	－	－	0.4%
新興国債券インデックスマザーファンド	15.9%	RUSSIA 7.85% 03/10/18	ロシア	国債証券	－	7.850%	2018/03/10	0.5%
		RFLB 7% 06/03/15	ロシア	国債証券	－	7.000%	2015/06/03	0.5%
国内株式インデックスマザーファンド	5.6%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	－	－	0.3%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	－	－	0.2%
国内債券インデックスマザーファンド	3.9%	第329回利付国債(10年)	日本	国債証券	－	0.8%	2023/06/20	0.1%
		第105回利付国債(5年)	日本	国債証券	－	0.2%	2017/06/20	0.0%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
※2009年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2013年は年初から作成基準日までの収益率です。
※ファンドには、ベンチマークはありません。

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

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

第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、第5期中間計算期間(平成25年1月22日から平成25年7月21日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

世界経済インデックスファンド　中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

項目	第5期中間計算期間 (平成25年 7月21日現在) 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	77,974,928
親投資信託受益証券	3,645,182,814
未収入金	7,695,312
未収利息	348
流動資産合計	3,730,853,402
資産合計	3,730,853,402
負債の部	
流動負債	
未払解約金	24,469,390
未払受託者報酬	859,962
未払委託者報酬	7,739,588
その他未払費用	85,931
流動負債合計	33,154,871
負債合計	33,154,871
純資産の部	
元本等	
元本	2,171,938,915
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,525,759,616
(分配準備積立金)	(356,268,588)
元本等合計	3,697,698,531
純資産合計	3,697,698,531
負債純資産合計	3,730,853,402

(2)中間損益及び剰余金計算書

項目	第5期中間計算期間 自 平成25年 1月22日 至 平成25年 7月21日 金額(円)
営業収益	
受取利息	14,907
有価証券売買等損益	341,943,631
営業収益合計	341,958,538
営業費用	
受託者報酬	859,962
委託者報酬	7,739,588
その他費用	85,931
営業費用合計	8,685,481
営業利益又は営業損失（△）	333,273,057
経常利益又は経常損失（△）	333,273,057
中間純利益又は中間純損失（△）	333,273,057
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（△）	44,532,700
期首剰余金又は期首欠損金（△）	951,068,178
剰余金増加額又は欠損金減少額	541,297,651
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	541,297,651
剰余金減少額又は欠損金増加額	255,346,570
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	255,346,570
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,525,759,616

(3)中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2.　その他	ファンドの計算期間 第5期中間計算期間(自　平成25年 1月22日　至　平成25年 7月21日) 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年1月21日から翌年1月20日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第5期中間計算期間は平成25年 1月22日から平成25年 7月21日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第5期中間計算期間 (平成25年 7月21日現在)
1.　期首元本額	1,800,426,112円
期中追加設定元本額	839,277,755円
期中一部解約元本額	467,764,952円
2.　当該中間計算期間の末日における受益権総数	2,171,938,915口
3.　1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7025円 (17,025円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

1.　中間貸借対照表計上額、時価及び差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　時価の算定方法	(1)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。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

3．　金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

＜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」の受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。
各マザーファンドの平成25年7月21日現在(以下、「計算日」といいます。)の状況は次のとおりであります。
なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

「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

項目	平成25年 7月21日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,511,009,804
国債証券	191,927,279,950
地方債証券	15,748,944,112
特殊債券	22,906,496,658
社債券	15,522,976,460
派生商品評価勘定	459,370
未収入金	2,998,110
未収利息	683,972,117
前払費用	23,099,449
流動資産合計	248,327,236,030
資産合計	248,327,236,030
負債の部	
流動負債	
前受金	3,520,000
未払金	596,735,700
未払解約金	343,043,822
流動負債合計	943,299,522
負債合計	943,299,522
純資産の部	
元本等	
元本	196,330,941,620
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	51,052,994,888
元本等合計	247,383,936,508
純資産合計	247,383,936,508

負債純資産合計	**248,327,236,030**

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 7月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月21日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	180,543,384,070円
中間計算期間中の追加設定元本額	39,195,900,179円
中間計算期間中の一部解約元本額	23,408,342,629円
計算日の元本額	196,330,941,620円
計算日の元本額の内訳	
エマージング株式オープン	3,779,674円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	882,646,992円
SBI資産設計オープン(分配型)	16,530,617円
SMT 国内債券インデックス・オープン	3,031,919,796円
世界経済インデックスファンド	106,918,826円
マイセレクション25	163,924,768円
マイセレクション50	133,222,463円
マイセレクション75	44,636,860円
DCマイセレクション25	10,834,612,631円
DCマイセレクション50	13,713,040,465円
DCマイセレクション75	3,744,753,898円
DC日本債券インデックス・オープン	371,841,800円

DC日本債券インデックス・オープンS	42,720,760,449円
DC日本債券インデックス・オープンP	13,748,800,697円
DCマイセレクションS25	3,551,700,573円
DCマイセレクションS50	4,285,037,519円
DCマイセレクションS75	776,040,671円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	36,504,370円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	725,352,275円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	380,463,834円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	85,674,627円
DC世界経済インデックスファンド	64,592,160円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	21,411,025,534円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	55,837,758円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	501,369,923円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	66,676,507円
国内バランス30VA2(適格機関投資家専用)	1,573,510円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	6,895,498円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	2,107,855,138円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	3,347,449,147円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	8,404,966,209円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	852,292,195円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	17,729,998,381円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,858,248,359円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	6,599,232,109円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	3,863,491,900円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	5,305,627,807円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,635,952,575円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,444,325,466円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,899,025,310円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,912,578,967円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	300,925,979円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,292,478,615円
日本債券ファンド・シリーズ1	6,621,817,141円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,800,116,246円
コア投資戦略ファンド(成長型)	835,174,746円
分散投資コア戦略ファンドA	47,030,240円
分散投資コア戦略ファンドS	6,142,555円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	19,063円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	58,777円

2.　担保に供している資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。 国債証券　104,331,000円 なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおります。
3.　計算日における受益権総数	196,330,941,620口
4.　1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2600円 (12,600円)

(金融商品に関する注記)
金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月21日現在
1.　貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　時価の算定方法	(1)国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「(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。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.　金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

平成25年 7月21日現在
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

Ⅰ．ヘッジ会計が適用されていないもの

債券関連

区分	種類	平成25年 7月21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	債券先物取引				
	買　建	286,420,630	－	286,880,000	459,370
合計		286,420,630	－	286,880,000	459,370

(注)1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月21日現在
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」の状況
(1)貸借対照表

項目	平成25年 7月21日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	941,245,713
株式	150,578,133,370
派生商品評価勘定	56,923,175
未収入金	1,868,385,965
未収配当金	120,679,700
未収利息	1,405
差入委託証拠金	67,650,000
流動資産合計	153,633,019,328
資産合計	153,633,019,328
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	993,000
前受金	90,782,000
未払解約金	1,352,341,162
流動負債合計	1,444,116,162
負債合計	1,444,116,162
純資産の部	
元本等	
元本	154,586,153,272
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△2,397,250,106
元本等合計	152,188,903,166
純資産合計	152,188,903,166
負債純資産合計	153,633,019,328

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 7月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(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. デリバティブの評価基準及び評価方法	株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)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。 (2)派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月21日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	182,835,918,854円
中間計算期間中の追加設定元本額	14,199,713,433円
中間計算期間中の一部解約元本額	42,449,479,015円
計算日の元本額	154,586,153,272円
計算日の元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	2,451,982,881円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,526,169,669円
SBI資産設計オープン(分配型)	29,777,152円
SMT TOPIXインデックス・オープン	6,345,905,559円
世界経済インデックスファンド	220,652,345円
マイセレクション25	77,117,919円
マイセレクション50	151,609,058円
マイセレクション75	177,356,412円
日本株式インデックス・オープン	17,302,659,396円

DCマイセレクション25	4,624,566,174円
DCマイセレクション50	15,498,144,456円
DCマイセレクション75	14,927,838,177円
DC日本株式インデックス・オープン	3,825,327,611円
DCマイセレクションS25	1,538,454,783円
DCマイセレクションS50	4,875,125,859円
DCマイセレクションS75	3,188,837,913円
DC日本株式インデックス・オープンS	1,270,907,631円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	19,477,824円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	373,078,628円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	383,744,458円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	173,563,213円
DC世界経済インデックスファンド	126,476,784円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	368,521,166円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	241,014,275円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	578,105,565円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	267,525,664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)	2,488,242,444円
国内バランス30VA2(適格機関投資家専用)	1,541,631円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	29,084,912円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,372,498,240円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	5,294,338,970円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	12,370,865,050円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	4,298,785,754円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	9,609,382,379円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	2,026,429,730円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	10,920,060,607円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	4,541,755,274円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	3,401,339,100円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,247,178,063円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	4,641,289,885円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,363,871,275円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,861,992,888円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	137,713,695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)	4,126,381,094円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,449,181,875円
日本株式ファンド・シリーズ2	840,177,406円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	76,821円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	25,607円

2.　計算日における受益権総数	154,586,153,272口
3.　「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 2,397,250,106円
4.　1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9845円 (9,845円)

(金融商品に関する注記)
金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)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。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

平成25年 7月21日現在
該当事項はありません。

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

区分	種類	平成25年 7月21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	1,245,724,825	―	1,301,655,000	55,930,175
合計		1,245,724,825	―	1,301,655,000	55,930,175

(注)1. 時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

II．ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月21日現在
該当事項はありません。

「外国債券インデックス マザーファンド」の状況
(1)貸借対照表

項目	平成25年 7月21日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	536,422,720
コール・ローン	1,877,027,162
国債証券	232,270,012,188
派生商品評価勘定	12,507,554
未収入金	6,526,470
未収利息	2,442,513,539
前払費用	102,361,066
差入委託証拠金	45,249,523
流動資産合計	237,292,620,222
資産合計	237,292,620,222
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,139,561
未払金	9,409,998
未払解約金	1,125,879,030
流動負債合計	1,136,428,589
負債合計	1,136,428,589
純資産の部	
元本等	
元本	101,574,757,286
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	134,581,434,347
元本等合計	236,156,191,633
純資産合計	236,156,191,633
負債純資産合計	237,292,620,222

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 7月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3. 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、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の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、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月21日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	108,288,582,697円
中間計算期間中の追加設定元本額	9,132,136,883円
中間計算期間中の一部解約元本額	15,845,962,294円
計算日の元本額	101,574,757,286円
計算日の元本額の内訳	

外国債券オープン(毎月決算型)	5,385,317,492円
外国債券オープン(3ケ月決算型)	269,562,305円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	2,213,071,438円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	1,711,023,594円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	555,788,809円
SBI資産設計オープン(分配型)	10,700,167円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	3,331,902,310円
世界経済インデックスファンド	430,405,534円
マイセレクション25	14,776,864円
マイセレクション50	9,135,833円
マイセレクション75	7,022,206円
DCマイセレクション25	989,574,539円
DCマイセレクション50	939,281,856円
DCマイセレクション75	596,787,599円
DC外国債券インデックス・オープン	1,153,001,618円
DCマイセレクションS25	324,859,851円
DCマイセレクションS50	293,934,180円
DCマイセレクションS75	124,967,167円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	1,770,655円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	34,031,073円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	24,334,298円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	8,605,675円
DC世界経済インデックスファンド	256,068,777円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	8,857,531,750円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	5,864,037,052円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	34,385,643円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	10,950,405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)	406,743,487円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,297,350,081円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	2,209,260,100円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	23,777,563,499円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	2,754,630,868円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	9,204,935,804円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,263,220,411円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,250,461,979円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	4,551,440,572円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,772,560,609円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,382,811,856円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	3,408,611,092円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	534,528,728円

バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	720,953,321円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	3,827,499,237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)	864,156,309円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	339,963,574円
外国債券ファンド・シリーズ1	266,206,660円
コア投資戦略ファンド(安定型)	633,038,407円
コア投資戦略ファンド(成長型)	616,280,020円
分散投資コア戦略ファンドA	10,610,287円
分散投資コア戦略ファンドS	4,579,683円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	57,992円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	178,807円
FOFs用外国債券インデックス 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	1,024,285,213円
2. 計算日における受益権総数	101,574,757,286口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3249円 (23,249円)

(金融商品に関する注記)
金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)国債証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

	また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

平成25年 7月21日現在
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

Ⅰ．ヘッジ会計が適用されていないもの

債券関連

区分	種類	平成25年 7月21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	債券先物取引				
	買　建	488,575,431	―	492,000,589	3,425,158
合計		488,575,431	―	492,000,589	3,425,158

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

区分	種類	平成25年 7月21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	287,187,900	―	286,328,800	△859,100
	カナダドル	23,981,750	―	24,255,000	273,250
	イギリスポンド	45,037,800	―	45,969,000	931,200
	ユーロ	344,895,915	―	352,493,400	7,597,485
	計	701,103,365	―	709,046,200	7,942,835
合計		701,103,365	―	709,046,200	7,942,835

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月21日現在
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」の状況
(1)貸借対照表

項目	平成25年 7月21日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,118,636,552
コール・ローン	544,164,444
株式	155,329,628,276
投資信託受益証券	102,153,865
投資証券	3,385,464,310
派生商品評価勘定	212,896,059
未収入金	570,106
未収配当金	190,933,933
未収利息	812
差入委託証拠金	1,531,767,866
流動資産合計	165,416,216,223
資産合計	165,416,216,223
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	652,064
未払解約金	581,113,178
流動負債合計	581,765,242
負債合計	581,765,242
純資産の部	
元本等	
元本	114,721,666,057
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	50,112,784,924
元本等合計	164,834,450,981
純資産合計	164,834,450,981
負債純資産合計	165,416,216,223

(2)注記表
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 7月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(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)投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3. 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、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の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、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 原則として、株式、投資信託受益証券及び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、未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。

	(2)派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月21日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	130,579,100,449円
中間計算期間中の追加設定元本額	8,640,659,358円
中間計算期間中の一部解約元本額	24,498,093,750円
計算日の元本額	114,721,666,057円
計算日の元本額の内訳	
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,061,306,696円
SBI資産設計オープン(分配型)	20,114,400円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	17,922,594,042円
世界経済インデックスファンド	762,861,583円
マイセレクション25	12,299,914円
マイセレクション50	45,878,244円
マイセレクション75	58,003,788円
外国株式インデックス・オープン	1,139,090,999円
DCマイセレクション25	802,631,568円
DCマイセレクション50	4,648,559,473円
DCマイセレクション75	5,070,464,959円
DC外国株式インデックス・オープン	5,400,971,399円
DCマイセレクションS25	271,791,396円
DCマイセレクションS50	1,474,804,749円
DCマイセレクションS75	1,077,601,548円
DCターゲット・イヤー ファンド2015	6,294,988円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	128,999,983円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	132,685,111円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	60,436,781円
DC世界経済インデックスファンド	448,849,461円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	10,524,685,541円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	173,750,782円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	90,592,025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)	415,375,527円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	939,984,236円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	3,748,712,090円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	8,370,815,308円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	2,908,663,297円

バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	4,438,627,520円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,155,182,580円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	7,090,267,781円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	15,152,044,163円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	6,808,939,623円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,166,928,637円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,275,336,760円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	389,783,904円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,145,093,640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)	6,033,379,826円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,031,823,453円
コア投資戦略ファンド(安定型)	574,173,370円
コア投資戦略ファンド(成長型)	726,147,527円
分散投資コア戦略ファンドA	9,494,788円
分散投資コア戦略ファンドS	5,229,458円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	294,854円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	98,285円
2.　計算日における受益権総数	114,721,666,057口
3.　1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4368円 (14,368円)

(金融商品に関する注記)
金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月21日現在
1.　貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　時価の算定方法	(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「(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。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

平成25年 7月21日現在
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

Ⅰ．ヘッジ会計が適用されていないもの

株式関連

区分	種類	平成25年 7月21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	5,725,256,568	―	5,938,078,173	212,821,605
合計		5,725,256,568	―	5,938,078,173	212,821,605

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

区分	種類	平成25年 7月21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				
	売　建				
	アメリカドル	71,321,970	－	71,589,300	△267,330
	イギリスポンド	15,328,800	－	15,328,000	800
	シンガポールドル	9,528,840	－	9,528,000	840
	スウェーデンクローナ	10,732,400	－	10,731,000	1,400
	デンマーククローネ	10,516,200	－	10,626,000	△109,800
	ユーロ	20,921,280	－	21,124,800	△203,520
	計	138,349,490	－	138,927,100	△577,610
合計		138,349,490	－	138,927,100	△577,610

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月21日現在
該当事項はありません。

「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

項目	平成25年 7月21日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	126,066,320
コール・ローン	293,670,847
国債証券	21,689,341,066
派生商品評価勘定	6,684,638
未収入金	544,242,318
未収利息	315,537,228
前払費用	53,584,330
流動資産合計	23,029,126,747
資産合計	23,029,126,747
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,761,092
未払金	1,158,711,877
未払解約金	1,895,850
流動負債合計	1,162,368,819
負債合計	1,162,368,819
純資産の部	
元本等	
元本	13,366,725,496
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	8,500,032,432
元本等合計	21,866,757,928
純資産合計	21,866,757,928
負債純資産合計	23,029,126,747

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 7月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該為替予約取引に係るものであります。
3. 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、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の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、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月21日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	11,568,259,032円
中間計算期間中の追加設定元本額	4,525,498,151円
中間計算期間中の一部解約元本額	2,727,031,687円
計算日の元本額	13,366,725,496円
計算日の元本額の内訳	
SMT 新興国債券インデックス・オープン	2,645,284,161円
世界経済インデックスファンド	368,218,663円
DC新興国債券インデックス・オープン	1,541,300,141円
DC世界経済インデックスファンド	221,719,983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)	577,878,421円
コア投資戦略ファンド(安定型)	910,222,350円

コア投資戦略ファンド(成長型)	881,524,329円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	6,198,703,467円
分散投資コア戦略ファンドA	15,135,122円
分散投資コア戦略ファンドS	6,523,216円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	52,811円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	162,832円
2.　計算日における受益権総数	13,366,725,496口
3.　1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6359円 (16,359円)

(金融商品に関する注記)
金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月21日現在
1.　貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　時価の算定方法	(1)国債証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.　金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

平成25年 7月21日現在
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

Ⅰ．ヘッジ会計が適用されていないもの

通貨関連

区分	種類	平成25年 7月21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	329,940,614	－	331,730,700	1,790,086
	マレーシアリンギット	119,745,509	－	120,052,733	307,224
	タイバーツ	32,329,737	－	32,495,358	165,621
	フィリピンペソ	4,313,439	－	4,353,173	39,734
	インドネシアルピア	113,272,272	－	117,606,500	4,334,228
	ハンガリーフォリント	30,002,600	－	30,002,600	－
	ポーランドズロチ	24,920,000	－	24,920,000	－
	南アフリカランド	3,556,000	－	3,552,500	△3,500
	トルコリラ	23,421,244	－	23,410,540	△10,704
	計	681,501,415	－	688,124,104	6,622,689
	売　建				
	アメリカドル	149,915,448	－	151,614,591	△1,699,143
	計	149,915,448	－	151,614,591	△1,699,143
合計		831,416,863	－	839,738,695	4,923,546

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月21日現在
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」の状況
(1)貸借対照表

項目	平成25年 7月21日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	573,053,929
コール・ローン	59,169,663
株式	18,404,607,852
投資信託受益証券	92,678,572
投資証券	25,023,020
派生商品評価勘定	20,416,549
未収入金	2,964,120
未収配当金	85,274,443
未収利息	88
差入委託証拠金	91,765,233
流動資産合計	19,354,953,469
資産合計	19,354,953,469
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	179,404
未払金	114,211
未払解約金	8,678,055
流動負債合計	8,971,670
負債合計	8,971,670
純資産の部	
元本等	
元本	9,400,607,524
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	9,945,374,275
元本等合計	19,345,981,799
純資産合計	19,345,981,799
負債純資産合計	19,354,953,469

(2)注記表
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成25年 7月21日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(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)投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3. 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、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の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、外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。
4. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 原則として、株式、投資信託受益証券及び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、未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。

	(2)派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成25年 7月21日現在
1. 中間計算期間の期首元本額	8,859,252,989円
中間計算期間中の追加設定元本額	1,458,198,028円
中間計算期間中の一部解約元本額	916,843,493円
計算日の元本額	9,400,607,524円
計算日の元本額の内訳	
SMT 新興国株式インデックス・オープン	5,108,700,171円
世界経済インデックスファンド	288,695,143円
DC新興国株式インデックス・オープン	1,486,397,219円
DC世界経済インデックスファンド	176,344,587円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,509,131,181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)	442,972,010円
コア投資戦略ファンド(安定型)	167,486,541円
コア投資戦略ファンド(成長型)	216,319,735円
分散投資コア戦略ファンドA	2,805,398円
分散投資コア戦略ファンドS	1,580,187円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	131,514円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	43,838円
2. 計算日における受益権総数	9,400,607,524口
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0580円 (20,580円)

(金融商品に関する注記)
金融商品の時価等に関する事項

	平成25年 7月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)株式、投資信託受益証券及び投資証券 「(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。

	(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.　金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

平成25年 7月21日現在
該当事項はありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

Ⅰ．ヘッジ会計が適用されていないもの

株式関連

区分	種類	平成25年 7月21日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買　建	820,115,586	―	839,820,730	19,705,144
合計		820,115,586	―	839,820,730	19,705,144

(注)1. 時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

区分	種類	平成25年 7月21日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買　建				
	アメリカドル	75,090,499	－	75,622,500	532,001
	計	75,090,499	－	75,622,500	532,001
合計		75,090,499	－	75,622,500	532,001

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

①計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

②計算日又は計算日に知りうる直近の日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成25年 7月21日現在
該当事項はありません。

2 ファンドの現況

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」「2 ファンドの現況」につきましては、以下の内容に更新・訂正します。

＜更新・訂正後＞
純資産額計算書(平成25年8月30日現在)

Ⅰ 資産総額	3,741,930,521 円
Ⅱ 負債総額	5,127,109 円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	3,736,803,412 円
Ⅳ 発行済口数	2,300,565,405 口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.6243 円
1万口当たり純資産額	16,243 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	259,655,795,322 円
Ⅱ 負債総額	7,656,857,201 円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	251,998,938,121 円
Ⅳ 発行済口数	198,937,203,415 口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.2667 円
1万口当たり純資産額	12,667 円

国内株式インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	137,214,609,746 円
Ⅱ 負債総額	560,307,878 円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	136,654,301,868 円
Ⅳ 発行済口数	152,042,129,036 口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	0.8988 円
1万口当たり純資産額	8,988 円

外国債券インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	227,788,163,257 円
Ⅱ 負債総額	587,236,496 円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	227,200,926,761 円
Ⅳ 発行済口数	100,472,835,465 口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	2.2613 円

1万口当たり純資産額	22,613　円

外国株式インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	155,747,307,178　円
Ⅱ 負債総額	557,278,042　円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	155,190,029,136　円
Ⅳ 発行済口数	112,071,262,338　口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.3847　円
1万口当たり純資産額	13,847　円

新興国債券インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	22,596,354,941　円
Ⅱ 負債総額	342,883,736　円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	22,253,471,205　円
Ⅳ 発行済口数	14,765,840,893　口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.5071　円
1万口当たり純資産額	15,071　円

新興国株式インデックス マザーファンド

Ⅰ 資産総額	19,233,260,806　円
Ⅱ 負債総額	277,464,005　円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	18,955,796,801　円
Ⅳ 発行済口数	9,784,976,052　口
Ⅴ 1口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.9372　円
1万口当たり純資産額	19,372　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」「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訂正します。
（注）下線部＿＿＿＿は訂正部分を示します。

＜訂正前＞
(1)資本金の額（平成25年2月28日現在）

（中略）

(2)委託会社の機構
①会社の意思決定機構

（中略）

②投資運用の意思決定機構

（中略）

［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25年4月9日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜訂正後＞

(1)資本金の額（平成25年8月30日現在）

（中略）

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

（中略）

②投資運用の意思決定機構

（中略）

［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）に運用パフォーマンスの評価・分析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）及び経営会議（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25年10月21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」「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＞

（前略）

平成25年2月28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	4,042,545
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	778
単位型公社債投資信託	0	0
合計	304	4,043,323

＜訂正後＞

（前略）

平成25年8月30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	323	4,270,410
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	323	4,270,410

次へ

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」「3　委託会社等の経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正します。

＜更新・訂正後＞

(1)　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（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。

(2)　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24年4月1日　至　平成25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24年3月31日現在）		当事業年度 （平成25年3月31日現在）
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		4,826,115		8,192,444
前払費用		30,184		81,751
未収委託者報酬		944,716		2,210,605
未収運用受託報酬		26,998		31,051
未収入金		75,514		676
一年以内返還予定保証金		187,128		―
繰延税金資産		69,857		61,743
その他		31,325		19,263
流動資産合計		6,191,840		10,597,535
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	3,525	※1	79,281
器具備品	※1	14,970	※1	103,209
建設仮勘定		62,454		―
有形固定資産合計		80,949		182,491
無形固定資産				
ソフトウェア		60,130		168,561
ソフトウェア仮勘定		12,151		―
その他無形固定資産		928		1,770
無形固定資産合計		73,209		170,332
投資その他の資産				
投資有価証券		43,194		47,112
長期前払費用		357		―
長期貸付金		―		31,838
会員権		―		25,000
その他の投資		165		633
貸倒引当金		―		△31,838
投資その他の資産合計		43,717		72,746
固定資産合計		197,876		425,570
資産合計		6,389,717		11,023,105

（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日現在）	当事業年度 （平成25年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
預り金	22,794	19,992
未払金	644,600	1,459,757
未払収益分配金	30	―
未払手数料	438,778	942,503
その他未払金	205,791	517,254
未払費用	112,121	82,209
未払法人税等	20,166	204,363
未払消費税等	5,683	11,940
賞与引当金	71,044	92,832
移転関連費用引当金	41,450	―
その他流動負債	―	21,231
流動負債合計	917,862	1,892,326
固定負債		
資産除去債務	―	12,281
退職給付引当金	199,976	268,531
繰延税金負債	308,964	303,555
固定負債合計	508,940	584,368
負債合計	1,426,803	2,476,694
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	―	350,000
資本剰余金合計	―	350,000
利益剰余金		
利益準備金	56,500	59,500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計	4,672,773	7,891,412
株主資本合計	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△ 9,859	4,998
評価・換算差額等合計	△9,859	4,998
純資産合計	4,962,913	8,546,410

負債・純資産合計	6,389,717	11,023,105

(2)損益計算書

（単位：千円）

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)		当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業収益			
委託者報酬	7,821,113		19,128,296
運用受託報酬	98,179		94,659
営業収益合計	7,919,292		19,222,955
営業費用			
支払手数料	3,715,816		9,030,246
広告宣伝費	61,165		73,287
公告費	2,451		2,244
調査費	1,023,870		4,132,154
調査費	86,225		207,030
委託調査費	936,024		3,922,394
図書費	1,620		2,729
営業雑経費	610,455		1,294,879
通信費	10,764		21,905
印刷費	121,287		330,735
協会費	10,136		21,939
諸会費	803		757
情報機器関連費	436,328		874,151
その他営業雑経費	31,135		45,391
営業費用合計	5,413,759		14,532,812
一般管理費			
給料	1,276,685		2,259,238
役員報酬	35,160		78,205
給料・手当	1,048,061		1,967,177
賞与	193,464		213,855
退職給付費用	66,790		64,787
福利費	152,149		190,716
交際費	1,012		879
旅費交通費	25,687		45,160
租税公課	16,148		25,420
不動産賃借料	238,033		129,096
寄付金	2,832		―
減価償却費	55,540		129,966
敷金償却	2,804		―
諸経費	81,858	※1	257,947
一般管理費合計	1,919,541		3,103,213
営業利益	585,991		1,586,929

（単位：千円）

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	2,795	1,919
受取利息	13,889	6,475
投資有価証券売却益	149	924
貸倒引当金戻入	―	3,000
その他	2,125	2,552
営業外収益合計	18,961	14,873
営業外費用		
支払手数料	800	―
投資有価証券売却損	12	14,182
その他	74	361
営業外費用合計	887	14,544
経常利益	604,065	1,587,257
特別利益		
投資有価証券売却益	1,277,804	30,000
特別利益合計	1,277,804	30,000
特別損失		
統合関連損失	123,726	484,725
特別損失合計	123,726	484,725
税引前当期純利益	1,758,142	1,132,532
法人税、住民税及び事業税	241,760	369,828
法人税等調整額	368,903	56,358
法人税等合計	610,664	426,187
当期純利益	1,147,477	706,344

(3)株主資本等変動計算書

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25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	―
合併による増加	―	350,000
当期変動額合計	―	350,000
当期末残高	―	350,000
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	53,500	56,500
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	56,500	59,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	5,100,000	2,100,000
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	2,100,000	2,100,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	1,421,205	2,516,273
当期変動額		
剰余金の配当	△ 33,000	△ 33,000
当期純利益	1,147,477	706,344
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	―
合併による増加	―	2,542,294
当期変動額合計	1,095,067	3,215,638
当期末残高	2,516,273	5,731,912
利益剰余金合計		
当期首残高	6,574,705	4,672,773
当期変動額		
剰余金の配当	△ 30,000	△ 30,000
当期純利益	1,147,477	706,344

その他資本剰余金へ振替	△ 3,019,410	―
合併による増加	―	2,542,294
当期変動額合計	△ 1,901,932	3,218,638
当期末残高	4,672,773	7,891,412

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25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	6,874,705	4,972,773
当期変動額		
剰余金の配当	△ 30,000	△ 30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	△ 3,019,410	―
合併による増加	―	2,892,294
当期変動額合計	△ 1,901,932	3,568,638
当期末残高	4,972,773	8,541,412
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	△ 8,501	△ 9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 1,357	14,857
当期変動額合計	△ 1,357	14,857
当期末残高	△ 9,859	4,998
評価・換算差額等合計		
当期首残高	△ 8,501	△ 9,859
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 1,357	14,857
当期変動額合計	△ 1,357	14,857
当期末残高	△ 9,859	4,998
純資産合計		
当期首残高	6,866,203	4,962,913
当期変動額		
剰余金の配当	△ 30,000	△ 30,000
当期純利益	1,147,477	706,344
その他資本剰余金へ振替	△ 3,019,410	―
合併による増加	―	2,892,294
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 1,357	14,857
当期変動額合計	△ 1,903,289	3,583,496
当期末残高	4,962,913	8,546,410

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。）

２．固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

定率法によっております。

(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更)

当社は、法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。

これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ11,534千円増加しております。

(2)無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

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

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当事業年度の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

従業員の退職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。

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。

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24年3月31日）		当事業年度 （平成25年3月31日）	
建　物	84,592	千円	23,594	千円
器具備品	127,549	〃	235,212	〃
計	212,142	〃	258,807	〃

（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23年4月1日 至 平成24年3月31日)		当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
諸経費	―	千円	97,199	千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	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に関する事項

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

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24年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成24年3月31日	平成24年6月29日

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

１. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２. 自己株式の種類及び株式数に関する事項
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24年6月29日定時株主総会	普通株式	30,000	10,000	平成24年3月31日	平成24年6月29日

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25年6月28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。

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25年6月28日定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	10,000	平成25年3月31日	平成25年6月28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。

当事業年度（平成25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	8,192,444	8,192,444	―
(2)未収委託者報酬	2,210,605	2,210,605	―
(3)投資有価証券 その他有価証券	47,112	47,112	―
(4)未払金	(1,459,757)	(1,459,757)	―

(*)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

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。

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（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	―	―	―

当事業年度（平成25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	8,192,444	―	―	―
未収委託者報酬	2,210,605	―	―	―

（有価証券関係）

１．その他有価証券

前事業年度（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
合計	58,513	43,194	△ 15,318

当事業年度（平成25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	37,315	45,159	7,843
小計	37,315	45,159	7,843
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,030	1,952	△ 77
小計	2,030	1,952	△ 77
合計	39,345	47,112	7,766

２．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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
114,040	30,924	14,182

（デリバティブ取引関係）

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．退職給付債務に関する事項　（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
（1）退職給付債務	199,976	268,531
（2）退職給付引当金	199,976	268,531

(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24年3月31日）	当事業年度 （平成25年3月31日）
（1）退職給付費用	66,790	64,787

(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12,680千円、当事業年度で13,971千円であります。

４．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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24年3月31日）		当事業年度 （平成25年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	4,898	千円	16,142	千円
貸倒引当金繰入限度超過額	―	〃	11,347	〃
賞与引当金損金算入限度超過額	27,004	〃	35,285	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	71,271	〃	95,704	〃
その他有価証券評価差額金	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	〃	1,067	〃
敷金償却超過額	19,348	〃	―	〃
その他	3,334	〃	11,680	〃
繰延税金資産 小計	159,817	〃	171,228	〃
評価性引当額	―	〃	△11,347	〃
繰延税金資産 合計	159,817	〃	159,881	〃
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	―	〃	△2,767	〃
投資有価証券売却益益金不算入額	△398,925	〃	△398,925	〃
繰延税金負債 合計	△398,925	〃	△401,693	〃
繰延税金資産(負債)の純額	△239,107	〃	△241,812	〃

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24年3月31日）		当事業年度 （平成25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	〃	―	〃

当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。

（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

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）	2,429,898千円

（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）
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	（直接）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。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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	（直接）100%	役員の兼任	経営指導料の支払	97,199	―	―

(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経営指導料
取引条件については、一般取引条件を勘案して決定しております。

（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等の支払	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	住信ｶｰﾄﾞ㈱	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	住信情報ｻｰﾋﾞｽ㈱	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。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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	三井住友信託銀行㈱	東京都千代田区	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等の支払	6,006,973	未払手数料	613,819
							投資助言費用の支払	2,226,006	その他未払金	221,229

(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．平成24年4月1日付で以下の兄弟会社は合併し、商号及び所在地の変更を行っております。

旧商号	新商号	所在地
住友信託銀行(株)	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区
すみしん不動産(株)	三井住友ﾄﾗｽﾄ不動産(株)	東京都中央区
住信ｶｰﾄﾞ(株)	三井住友ﾄﾗｽﾄ・ｶｰﾄﾞ(株)	東京都港区
住信情報ｻｰﾋﾞｽ(株)	三井住友ﾄﾗｽﾄ・ｼｽﾃﾑ＆ｻｰﾋﾞｽ(株)	東京都府中市

（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）

当事業年度（平成25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）

（企業結合等関係）

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
該当事項はありません。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25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　　当社

事業の内容　投資運用業、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業

被結合企業

名称　　中央三井アセットマネジメント株式会社

事業の内容　投資運用業、第二種金融商品取引業

(2)企業結合日

平成24年4月1日

(3)企業結合の法的形式

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

合併による新株の発行、金銭の交付および資本金の増加はありません。

(4)結合後企業の名称

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

(5)その他取引の概要に関する事項

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

２．実施した会計処理の概要

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

（１株当たり情報）

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
1株当たり純資産額	1,654,304円66銭	2,848,803円51銭
1株当たり当期純利益	197,729円22銭	235,448円31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23年4月1日 至　平成24年3月31日)	当事業年度 (自　平成24年4月1日 至　平成25年3月31日)
当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	1,147,477千円	706,344千円
期中平均株式数	5,803株	3,000株

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＞

（前略）

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成25年4月9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＞

（前略）

(2)訴訟事件その他の重要事項

平成25年10月21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】

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」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 名称、資本金の額及び事業の内容
(1)受託会社
（中略）
②資本金の額：342,037百万円（平成24年9月末日現在）
（中略）
(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成25年3月末日現在）	事業の内容
（中略）		
立花証券株式会社※	6,695	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。

※立花証券株式会社は、平成25年10月15日より募集・販売等の取扱いを行います。
（中略）
3 資本関係
（中略）
（参考）再信託受託会社
（中略）
③資本金の額　：51,000百万円（平成24年9月末日現在）
（後略）

＜訂正後＞
1 名称、資本金の額及び事業の内容
(1)受託会社
（中略）
②資本金の額：342,037百万円（平成25年3月末日現在）
（中略）
(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成25年3月末日現在）	事業の内容
（中略）		
立花証券株式会社	6,695	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。

（中略）
3 資本関係
（中略）
（参考）再信託受託会社
（中略）

③資本金の額　：51,000百万円（平成25年3月末日現在）

（後略）

独立監査人の中間監査報告書

平成２５年９月２０日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　　御中

有限責任監査法人　ト　ー　マ　ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山　田　信　之　　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界経済インデックスファンドの平成２５年１月２２日から平成２５年７月２１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２５年７月２１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２５年１月２２日から平成２５年７月２１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。

その他の事項

ファンドの平成２４年７月２０日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表は、前任監査人によって中間監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して平成２４年８月３１日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明している。

利害関係

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

以　上

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

次へ

独立監査人の監査報告書

平成25年６月７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	髙　波　博　之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	白　川　芳　樹	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊　藤　浩　之	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の平成24年４月１日から平成25年３月31日までの第27期事業年度の財務諸表、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25年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

※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。