

【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6月26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・レポートイング部長 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】 | 日本債券インデックスファンド（SMA専用） |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】 | 継続募集額 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、半期報告書を提出いたしましたので、平成24年3月16日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、また、「第二部 ファンド情報」及び「第三部 委託会社等の情報」に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

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訂正します。

（注）下線部____は訂正部分を示します。

（1）ファンドの目的及び基本的性格

<訂正前>

（前略）

基本的性格

当ファンドは、委託会社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が投資家のために、利殖の目的をもって設定する証券投資信託で、三井住友信託銀行株式会社（____）がその受託会社となることを引受けたものです。

当ファンドは、委託者が受託者に投資信託財産の運用を指図する委託者指図型の追加型証券投資信託で、その商品分類及び属性区分は以下のとおりです。

当ファンドの受託会社である中央三井アセット信託銀行株式会社は、平成24年4月1日に中央三井信託銀行株式会社及び住友信託銀行株式会社と合併し、権利義務の一切を住友信託銀行株式会社に承継して解散します。住友信託銀行株式会社は同日付にて三井住友信託銀行株式会社に商号変更します。

（後略）

<訂正後>

（前略）

基本的性格

当ファンドは、委託会社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が投資家のために、利殖の目的をもって設定する証券投資信託で、三井住友信託銀行株式会社（____）がその受託会社となることを引受けたものです。

当ファンドは、委託者が受託者に投資信託財産の運用を指図する委託者指図型の追加型証券投資信託で、その商品分類及び属性区分は以下のとおりです。

（後略）

（2）ファンドの沿革

<訂正前>

平成19年10月19日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

平成24年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継（予定）

当ファンドの名称を中央三井日本債券インデックスファンド（SMA専用）から日本債券インデックスファンド（SMA専用）に変更（予定）

当ファンドの主要投資対象である中央三井日本債券マザーファンドの名称を日本債券マザーファンドに変更（予定）

<訂正後>

平成19年10月19日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

平成24年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継

当ファンドの名称を中央三井日本債券インデックスファンド（SMA専用）から日本債券インデックスファンド（SMA専用）に変更

当ファンドの主要投資対象である中央三井日本債券マザーファンドの名称を日本債券マザーファンドに変更

（3）ファンドの仕組み

<訂正前>

（前略）

委託会社の概況

A．資本金の額：3億円（平成24年4月1日現在（予定））

B．委託会社の沿革

（中略）

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

C．大株主の状況（平成24年4月1日現在（予定））

（後略）

<訂正後>

（前略）

委託会社の概況

A．資本金の額：3億円（平成24年4月27日現在）

B．委託会社の沿革

（中略）

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

C．大株主の状況（平成24年4月27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訂正します。

（注）下線部___は訂正部分を示します。

（3）運用体制

<訂正前>

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4月1日現在（予定）のものであり、今後変更されることがあります。

（後略）

<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、本書提出日現在のものであり、今後変更されることがあります。

（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、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）課税上の取扱い

< 訂正前 >

（前略）

法人の受益者に対する課税

（中略）

上記は、平成24年1月31日現在のものですので、税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になることがあります。

< 訂正後 >

（前略）

法人の受益者に対する課税

（中略）

上記は、平成24年4月27日現在のものですので、税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になることがあります。

[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、以下の内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

以下の記載事項は、平成24年4月27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 | 日本債券マザーファンド | 日本 | 6,763,517,843 | 100.03 |
| 受益証券 | 親投資信託受益証券合計 | | 6,763,517,843 | 100.03 |
| その他の資産(負債控除後) | | | 2,344,885 | 0.03 |
| 合計(純資産総額) | | | 6,761,172,958 | 100.00 |

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

<参考>

当ファンドが主要投資対象としている親投資信託の状況は次のとおりです。

(日本債券マザーファンド)

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|------|-----------------|---------|
| 公社債 | 日本 | 362,286,167,208 | 98.63 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | | 5,043,820,331 | 1.37 |
| 合計(純資産総額) | | 367,329,987,539 | 100.00 |

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

| 種類 | 銘柄 | 口数 | 簿価(円) | | 評価額(円) | | 投資比率(%) |
|---------------|-----------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|---------|
| | | | 単価 | 金額 | 単価 | 金額 | |
| 親投資信託 受益証券 | 日本債券マザー ファンド | 5,594,770,323 | 1.1949 | 6,685,240,870 | 1.2089 | 6,763,517,843 | 100.03 |

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

<参考>

当ファンドが主要投資対象としている親投資信託の状況

(日本債券マザーファンド)

投資有価証券の主要銘柄

A. 主要銘柄の明細

| 順位 | 銘柄名 | 利率 (%) | 償還日 | 額面金額 (円) | 簿価(円) | | 評価額(円) | | 投資 比率 (%) |
|----|------------------|-----------|------------|----------------|--------|----------------|--------|----------------|-----------------|
| | | | | | 単価 | 金額 | 単価 | 金額 | |
| 1 | 利付国庫債券(5年)第87回 | 0.5 | 2014/12/20 | 5,000,000,000 | 100.91 | 5,045,726,000 | 101.01 | 5,050,550,000 | 1.37 |
| 2 | 利付国庫債券(10年)第285回 | 1.7 | 2017/3/20 | 3,400,000,000 | 106.76 | 3,630,146,000 | 107.01 | 3,638,646,000 | 0.99 |
| 3 | 利付国庫債券(5年)第88回 | 0.5 | 2015/3/20 | 3,500,000,000 | 100.91 | 3,531,927,000 | 101.07 | 3,537,660,000 | 0.96 |
| 4 | 利付国庫債券(2年)第313回 | 0.1 | 2014/2/15 | 3,500,000,000 | 99.98 | 3,499,580,000 | 99.99 | 3,499,685,000 | 0.95 |
| 5 | 利付国庫債券(10年)第312回 | 1.2 | 2020/12/20 | 3,200,000,000 | 102.85 | 3,291,200,000 | 103.94 | 3,326,208,000 | 0.91 |
| 6 | 利付国庫債券(10年)第288回 | 1.7 | 2017/9/20 | 3,000,000,000 | 107.09 | 3,212,790,000 | 107.44 | 3,223,470,000 | 0.88 |
| 7 | 利付国庫債券(10年)第284回 | 1.7 | 2016/12/20 | 2,950,000,000 | 106.55 | 3,143,284,000 | 106.74 | 3,148,889,000 | 0.86 |
| 8 | 利付国庫債券(10年)第305回 | 1.3 | 2019/12/20 | 2,900,000,000 | 104.49 | 3,030,312,000 | 105.38 | 3,056,020,000 | 0.83 |
| 9 | 利付国庫債券(10年)第321回 | 1.0 | 2022/3/20 | 3,000,000,000 | 100.45 | 3,013,798,000 | 101.04 | 3,031,350,000 | 0.83 |
| 10 | 利付国庫債券(10年)第289回 | 1.5 | 2017/12/20 | 2,800,000,000 | 106.13 | 2,971,799,000 | 106.53 | 2,982,896,000 | 0.81 |
| 11 | 利付国庫債券(5年)第103回 | 0.3 | 2017/3/20 | 2,900,000,000 | 100.03 | 2,900,996,000 | 100.21 | 2,906,264,000 | 0.79 |
| 12 | 利付国庫債券(10年)第313回 | 1.3 | 2021/3/20 | 2,700,000,000 | 103.46 | 2,793,420,000 | 104.62 | 2,824,821,000 | 0.77 |
| 13 | 利付国庫債券(5年)第100回 | 0.3 | 2016/9/20 | 2,800,000,000 | 99.92 | 2,797,760,000 | 100.34 | 2,809,716,000 | 0.76 |
| 14 | 利付国庫債券(10年)第315回 | 1.2 | 2021/6/20 | 2,600,000,000 | 102.33 | 2,660,658,000 | 103.58 | 2,693,106,000 | 0.73 |
| 15 | 利付国庫債券(2年)第309回 | 0.1 | 2013/10/15 | 2,600,000,000 | 99.96 | 2,598,960,000 | 99.99 | 2,599,792,000 | 0.71 |
| 16 | 利付国庫債券(10年)第317回 | 1.1 | 2021/9/20 | 2,500,000,000 | 101.28 | 2,532,022,000 | 102.48 | 2,562,100,000 | 0.70 |
| 17 | 利付国庫債券(10年)第318回 | 1.0 | 2021/9/20 | 2,500,000,000 | 100.26 | 2,506,500,000 | 101.56 | 2,539,200,000 | 0.69 |
| 18 | 利付国庫債券(5年)第89回 | 0.4 | 2015/6/20 | 2,400,000,000 | 100.53 | 2,412,936,000 | 100.82 | 2,419,848,000 | 0.66 |
| 19 | 利付国庫債券(5年)第99回 | 0.4 | 2016/9/20 | 2,400,000,000 | 100.29 | 2,407,128,000 | 100.80 | 2,419,272,000 | 0.66 |
| 20 | 利付国庫債券(5年)第92回 | 0.3 | 2015/9/20 | 2,400,000,000 | 100.18 | 2,404,392,000 | 100.50 | 2,412,120,000 | 0.66 |
| 21 | 利付国庫債券(2年)第307回 | 0.2 | 2013/8/15 | 2,400,000,000 | 100.12 | 2,402,952,000 | 100.12 | 2,402,928,000 | 0.65 |
| 22 | 利付国庫債券(5年)第96回 | 0.5 | 2016/3/20 | 2,200,000,000 | 100.81 | 2,217,820,000 | 101.23 | 2,227,126,000 | 0.61 |
| 23 | 利付国庫債券(5年)第102回 | 0.3 | 2016/12/20 | 2,200,000,000 | 99.92 | 2,198,442,000 | 100.29 | 2,206,556,000 | 0.60 |
| 24 | 利付国庫債券(2年)第314回 | 0.1 | 2014/3/15 | 2,200,000,000 | 99.97 | 2,199,470,000 | 99.99 | 2,199,780,000 | 0.60 |
| 25 | 利付国庫債券(5年)第82回 | 0.9 | 2014/3/20 | 2,100,000,000 | 101.63 | 2,134,356,000 | 101.49 | 2,131,353,000 | 0.58 |
| 26 | 利付国庫債券(5年)第85回 | 0.7 | 2014/9/20 | 2,100,000,000 | 101.39 | 2,129,337,000 | 101.39 | 2,129,232,000 | 0.58 |
| 27 | 利付国庫債券(5年)第86回 | 0.6 | 2014/9/20 | 2,100,000,000 | 101.13 | 2,123,734,000 | 101.15 | 2,124,234,000 | 0.58 |
| 28 | 利付国庫債券(10年)第311回 | 0.8 | 2020/9/20 | 2,100,000,000 | 99.76 | 2,095,159,000 | 100.91 | 2,119,152,000 | 0.58 |
| 29 | 利付国庫債券(5年)第83回 | 0.9 | 2014/6/20 | 2,000,000,000 | 101.79 | 2,035,820,000 | 101.68 | 2,033,640,000 | 0.55 |
| 30 | 利付国庫債券(5年)第94回 | 0.6 | 2015/12/20 | 2,000,000,000 | 101.23 | 2,024,680,000 | 101.57 | 2,031,440,000 | 0.55 |
| 合計 | | | | 80,450,000,000 | | 81,947,104,000 | | 82,287,054,000 | 22.40 |

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

(注2) 国/地域は全て日本、種類は全て国債証券です。

B. 種類別の投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 国債証券 | 75.72 |
| 地方債証券 | 6.48 |
| 特殊債券 | 9.64 |
| 社債券 | 6.79 |
| 合計 | 98.63 |

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率をいいます。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 銘柄名 | 国/地域 | 数量 (枚) | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資比率 (%) |
|------------------------|------|-----------|---------------|---------------|-------------|
| 債券先物取引 買建 長期国債先物 | 日本 | 15 | 2,143,412,050 | 2,146,800,000 | 0.58 |

（注1）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（注2）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の清算値段で評価しております。

（3）運用実績

純資産の推移

| | 純資産総額（円） | 1万口当たりの 基準価額（円） |
|-----------------------|---------------|--------------------|
| 第1期計算期間（平成20年9月24日現在） | 817,624,539 | 10,161 |
| 第2期計算期間（平成21年9月24日現在） | 2,755,935,916 | 10,446 |
| 第3期計算期間（平成22年9月24日現在） | 4,667,647,161 | 10,775 |
| 第4期計算期間（平成23年9月26日現在） | 5,397,590,140 | 10,863 |
| 平成23年4月末日 | 5,067,124,019 | 10,660 |
| 平成23年5月末日 | 5,171,548,647 | 10,701 |
| 平成23年6月末日 | 5,308,786,179 | 10,730 |
| 平成23年7月末日 | 5,387,899,296 | 10,766 |
| 平成23年8月末日 | 5,572,044,537 | 10,795 |
| 平成23年9月末日 | 5,393,573,492 | 10,832 |
| 平成23年10月末日 | 5,429,954,789 | 10,809 |
| 平成23年11月末日 | 5,391,351,467 | 10,804 |
| 平成23年12月末日 | 5,555,886,512 | 10,867 |
| 平成24年1月末日 | 5,814,127,456 | 10,883 |
| 平成24年2月末日 | 5,864,258,747 | 10,892 |
| 平成24年3月末日 | 6,113,271,845 | 10,893 |
| 平成24年4月末日 | 6,761,172,958 | 10,947 |

（注）決算日における基準価額は、分配付、分配落とも同一です。

分配の推移

| | 1万口当たりの収益分配金 |
|---------|--------------|
| 第1期計算期間 | 0円 |
| 第2期計算期間 | 0円 |
| 第3期計算期間 | 0円 |
| 第4期計算期間 | 0円 |

収益率の推移

| | 収益率 |
|--|-----|
| | |

| | |
|------------------------------------|-------|
| 第1期計算期間 | 1.6 % |
| 第2期計算期間 | 2.8 % |
| 第3期計算期間 | 3.1 % |
| 第4期計算期間 | 0.8 % |
| 第5期中間計算期間（自平成23年9月27日 至平成24年3月26日） | 0.1 % |

（注）収益率とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ちの額、以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数とします。なお、第1期計算期間については、前期末基準価額の代わりに当初設定時の発行価額（1万口当たり10,000円）を使用しております。

（4）設定及び解約の実績

| | 設定口数 | 解約口数 | 発行済み口数 |
|---|---------------|---------------|---------------|
| 第1期計算期間 | 813,601,823 | 8,898,105 | 804,703,718 |
| 第2期計算期間 | 2,260,187,494 | 426,568,885 | 2,638,322,327 |
| 第3期計算期間 | 3,318,834,206 | 1,625,170,207 | 4,331,986,326 |
| 第4期計算期間 | 2,464,511,792 | 1,827,600,785 | 4,968,897,333 |
| 第5期中間計算期間 （自平成23年9月27日 至平成24年3月26日） | 1,325,405,927 | 769,574,290 | 5,524,728,970 |

（注1）設定及び解約の実績は、全て本邦内における実績です。

（注2）第1期計算期間の設定口数には、当初自己設定の設定口数を含みます。

（参考情報）交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

2012年4月27日 現在（基準日）

〈基準価額・純資産の推移〉



- ・基準価額及び基準価額（分配金再投資）は、信託報酬控除後の値です。
- ・基準価額（分配金再投資）は、分配金（配当金）を分配時に再投資したものとみなして算出した値です。
- ・ベンチマーク（NOMURA-BI総合）は、設定日の基準価額に合わせて換算されています。

〈分配の推移〉

| | |
|---------|----|
| 2011年9月 | 0円 |
| 2010年9月 | 0円 |
| 2009年9月 | 0円 |
| 2008年9月 | 0円 |
| - | - |
| 設定来累計 | 0円 |

- ・分配金は1万口当たり、税引前の値です。
- ・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。

〈主な資産の状況〉

資産別投資比率

| 資産 | 比率 |
|-------|---------|
| 債券 | 98.66% |
| その他資産 | 1.34% |
| 合計 | 100.00% |

- ・比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の評価金額の比率をいいます。
- ・ファンドはマザーファンドを組入れますので、実質比率を記載しています。

種類別投資比率（日本債券マザーファンド）

| 種類 | 比率 |
|-------|--------|
| 国債証券 | 75.72% |
| 地方債証券 | 6.48% |
| 特殊債券 | 9.64% |
| 社債券 | 6.79% |
| 合計 | 98.63% |

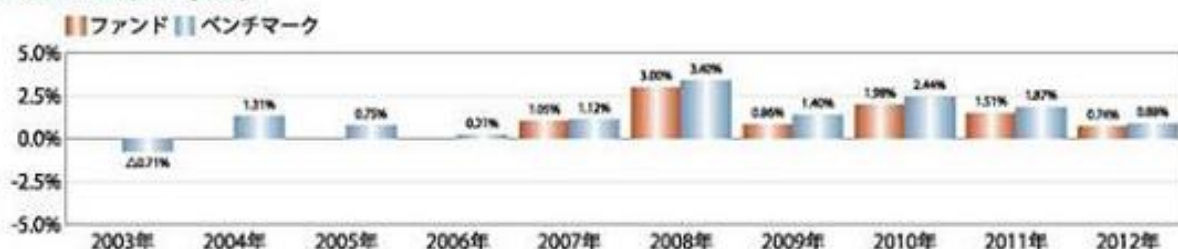
- ・比率とはマザーファンドの純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率をいいます。

組入上位銘柄（日本債券マザーファンド）

| 銘柄名 | 種類 | 償還日 | 利率 | 比率 |
|------------------|------|------------|--------|-------|
| 利付国債証券（5年）第87回 | 国債証券 | 2014/12/20 | 0.500% | 1.37% |
| 利付国債証券（10年）第285回 | 国債証券 | 2017/03/20 | 1.700% | 0.99% |
| 利付国債証券（5年）第88回 | 国債証券 | 2015/03/20 | 0.500% | 0.96% |
| 利付国債証券（2年）第313回 | 国債証券 | 2014/02/15 | 0.100% | 0.95% |
| 利付国債証券（10年）第312回 | 国債証券 | 2020/12/20 | 1.200% | 0.91% |
| 利付国債証券（10年）第288回 | 国債証券 | 2017/09/20 | 1.700% | 0.88% |
| 利付国債証券（10年）第284回 | 国債証券 | 2016/12/20 | 1.700% | 0.86% |
| 利付国債証券（10年）第305回 | 国債証券 | 2019/12/20 | 1.300% | 0.83% |
| 利付国債証券（10年）第321回 | 国債証券 | 2022/03/20 | 1.000% | 0.83% |
| 利付国債証券（10年）第289回 | 国債証券 | 2017/12/20 | 1.500% | 0.81% |
| 合計 | | | | 9.39% |

- ・上記は、ファンドが主要投資対象としているマザーファンドの組入上位銘柄です。
- ・比率とはマザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

〈年間収益率の推移〉



- ・年間収益率は【期間中の基準価額増減÷分配金（税引前）】/前年末の基準価額で算出しています。
- ・2007年はファンドの設定日から年々までの分配金（税引前）を含む基準価額の増減率を表示しています。ベンチマークの増減率も同様です。
- ・2012年（償還年）は年初から基準日までの分配金（税引前）を含む基準価額の増減率を表示しています。ベンチマークの増減率も同様です。
- ・ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しているものであり、ファンドの運用実績ではありません。

- ・運用実績は、ファンドの過去の実績を示したものであり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
- ・最新の運用実績は、表紙に記載の委託会社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。

<更新・訂正後>

(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23年9月27日から平成24年3月26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。

(3) 当ファンドは、平成24年4月1日付にてファンドの名称を「中央三井日本債券インデックスファンド（SMA専用）」から「日本債券インデックスファンド（SMA専用）」に変更しました。また、当ファンドの主要投資対象である「中央三井日本債券マザーファンド」については、平成24年4月1日付にて「日本債券マザーファンド」に名称を変更しました。以下では、変更前の名称で表示しています。

[次へ](#)

中央三井日本債券インデックスファンド（SMA専用） 中間財務諸表
（1）中間貸借対照表

（単位：円）

| | | 第5期中間計算期間 (平成24年3月26日現在) |
|-----------------|--|-----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | | 6,022,108,042 |
| 未収入金 | | 42,797,804 |
| 流動資産合計 | | 6,064,905,846 |
| 資産合計 | | 6,064,905,846 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | | 42,797,804 |
| 未払受託者報酬 | | 1,464,376 |
| 未払委託者報酬 | | 9,957,726 |
| その他未払費用 | | 146,376 |
| 流動負債合計 | | 54,366,282 |
| 負債合計 | | 54,366,282 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | | 5,524,728,970 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | | 485,810,594 |
| 純資産合計 | | 6,010,539,564 |
| 負債純資産合計 | | 6,064,905,846 |

[次へ](#)

(2) 中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

| | 第 5 期中間計算期間 (自 平成23年 9月27日 至 平成24年 3月26日) |
|--|---|
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | 19,499,250 |
| 営業収益合計 | 19,499,250 |
| 営業費用 | |
| 受託者報酬 | 1,464,376 |
| 委託者報酬 | 9,957,726 |
| その他費用 | 146,376 |
| 営業費用合計 | 11,568,478 |
| 営業利益又は営業損失 () | 7,930,772 |
| 経常利益又は経常損失 () | 7,930,772 |
| 中間純利益又は中間純損失 () | 7,930,772 |
| 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 () | 80,820 |
| 期首剰余金又は期首欠損金 () | 428,692,807 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 114,837,794 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 114,837,794 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 65,731,599 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 65,731,599 |
| 中間剰余金又は中間欠損金 () | 485,810,594 |

[次へ](#)

(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23年9月27日 至 平成24年3月26日） 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年9月25日から翌年9月24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23年9月27日から平成24年3月26日までとなっております。 |

(追加情報)

当該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。

(中間貸借対照表に関する注記)

| | 第5期中間計算期間 (平成24年3月26日現在) |
|------------------------------|-----------------------------|
| 1. 当該中間計算期間の末日における受益権総数 | 5,524,728,970 口 |
| 2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.0879 円 (10,879 円) |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

| | 第5期中間計算期間 自平成23年9月27日 至平成24年3月26日 |
|------------------------|--|
| 剰余金増加額・減少額又は欠損金減少額・増加額 | 「中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ剰余金減少額と増加額との純額を表示しております。 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| | 第5期中間計算期間 (平成24年3月26日現在) |
|----------------------|---|
| 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 | <p>(1) 親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> |
| 3．金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> |

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1．本書における開示対象ファンドの当該中間計算期間における元本額の変動

| | 第 5 期中間計算期間 自 平成23年 9 月27日 至 平成24年 3 月26日 |
|-----------|---|
| 期首元本額 | 4,968,897,333 円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,325,405,927 円 |
| 期中一部解約元本額 | 769,574,290 円 |

2．有価証券関係

該当事項はありません。

3．デリバティブ取引関係

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。

[次へ](#)

< 参考 >

「中央三井日本債券インデックスファンド（SMA専用）」は、「中央三井日本債券マザーファンド」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、全て同マザーファンドの受益証券であります。

同マザーファンドの平成24年3月26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。

「中央三井日本債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 項目 | 平成24年3月26日現在 金額（円） |
|----------|-----------------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 2,666,327,353 |
| 国債証券 | 274,139,094,600 |
| 地方債証券 | 23,767,505,151 |
| 特殊債券 | 35,022,096,616 |
| 社債券 | 25,159,530,000 |
| 派生商品評価勘定 | 1,766,770 |
| 未収入金 | 2,460,908,000 |
| 未収利息 | 701,876,891 |
| 前払金 | 660,000 |
| 前払費用 | 35,304,704 |
| 流動資産合計 | 363,955,070,085 |
| 資産合計 | 363,955,070,085 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 621,470 |
| 未払金 | 399,920,000 |
| 未払解約金 | 1,311,163,497 |
| 流動負債合計 | 1,711,704,967 |
| 負債合計 | 1,711,704,967 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 301,625,320,317 |
| 剰余金 | |
| 剰余金 | 60,618,044,801 |
| 純資産合計 | 362,243,365,118 |
| 負債・純資産合計 | 363,955,070,085 |

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|--|--------------|
| | 平成24年3月26日現在 |
|--|--------------|

| | |
|---------------------|---|
| 1．有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> |
| 2．デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p> |
| 3．収益及び費用の計上基準 | <p>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。</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 平成24年 3月26日現在 | |
|-----------------------------|---|
| 1．担保に供している資産 | <p>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。</p> <p style="text-align: right;">国債証券 51,680,000 円</p> <p>なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおりません。</p> |
| 2．計算日における受益権総数 | 301,625,320,317 口 |
| 3．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額） | 1.2010 円 （ 12,010 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24年 3月26日現在 | |
|-------------------|--|
| 1．貸借対照表計上額、時価及び差額 | <p>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ぬ。</p> |

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

「（その他の注記）」の「3．デリバティブ取引関係」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。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成24年3月26日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

平成24年3月26日現在

該当事項はありません。

(その他の注記)

1．元本の変動

平成24年3月26日現在

| | |
|---------------------------|-------------------|
| 中間計算期間の期首元本額 | 294,857,698,998 円 |
| 中間計算期間中の追加設定元本額 | 47,382,467,273 円 |
| 中間計算期間中の一部解約元本額 | 40,614,845,954 円 |
| 計算日の元本額 | 301,625,320,317 円 |
| 計算日の元本額の内訳 | |
| 中央三井日本債券インデックスファンド | 8,510,390,057 円 |
| 中央三井DC日本債券インデックスファンド | 2,009,241,974 円 |
| 中央三井DC日本債券インデックスファンドL | 21,869,007,042 円 |
| 中央三井DCバランスファンド30 | 858,146,744 円 |
| 中央三井DCバランスファンド50 | 874,147,448 円 |
| 中央三井DCバランスファンド70 | 219,508,715 円 |
| ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型） | 158,207,372 円 |
| ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型） | 96,554,747 円 |
| 中央三井日本債券インデックスファンド（SMA専用） | 5,014,244,831 円 |
| 新生・4分散ファンド | 128,763,961 円 |
| 4資産インデックスバランスオープン（分配型） | 39,512,755 円 |
| 4資産インデックスバランスオープン（成長型） | 123,760,534 円 |
| 日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型） | 211,294,254 円 |

| | |
|--|------------------|
| C M A M日本債券インデックス e | 438,230,013 円 |
| 中央三井インデックスコレクション（国内債券） | 1,770,243,008 円 |
| 中央三井インデックスコレクション（バランス株式30） | 840,336,716 円 |
| 中央三井インデックスコレクション（バランス株式50） | 805,930,084 円 |
| 中央三井インデックスコレクション（バランス株式70） | 315,043,775 円 |
| 中央三井バランスV A 3 0（適格機関投資家専用） | 9,729,934,660 円 |
| 中央三井バランスV A 5 0（適格機関投資家専用） | 30,834,663,300 円 |
| 中央三井V Aバランスファンド（株25 / 100）（適格機関投資家専用） | 28,952,366,222 円 |
| 中央三井V Aバランスファンド（株50 / 100）（適格機関投資家専用） | 1,554,233,333 円 |
| 中央三井V Aバランスファンド（株60 / 100）（適格機関投資家専用） | 7,269,859,326 円 |
| 中央三井バランスV A 2 5（適格機関投資家専用） | 10,616,919,856 円 |
| 中央三井バランスV A 3 7 . 5（適格機関投資家専用） | 2,421,561,670 円 |
| 中央三井バランスV A 5 0 L（適格機関投資家専用） | 23,985,823,961 円 |
| 中央三井バランスV A 7 5（適格機関投資家専用） | 241,863,898 円 |
| 中央三井V Aバランスファンド（株40 / 100）（適格機関投資家専用） | 30,400,182,946 円 |
| 中央三井V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用） | 7,270,088,704 円 |
| 中央三井V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用） | 651,764,000 円 |
| 中央三井バランスV A 4 0（適格機関投資家専用） | 3,332,183,451 円 |
| 中央三井V Aバランス株式40（適格機関投資家専用） | 1,716,539,699 円 |
| C M A M・バランスファンドV A（適格機関投資家専用） | 5,066,700,788 円 |
| 中央三井V Aバランスファンド2（株40 / 100）（適格機関投資家専用） | 1,026,439,531 円 |
| C M A M・V Aバランス50 - 50（適格機関投資家専用） | 1,858,796,129 円 |
| 中央三井バランスV A 2 0（適格機関投資家専用） | 4,678,996,576 円 |
| 中央三井V Aファンド25（適格機関投資家専用） | 4,355,853,555 円 |
| C M A M・バランスファンドV A 2（適格機関投資家専用） | 6,567,577,551 円 |
| 中央三井バランスV A 2 0 L（適格機関投資家専用） | 619,452,563 円 |
| 中央三井バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用） | 4,075,213,232 円 |
| C M A M・バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用） | 48,848,184,863 円 |
| 中央三井世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用） | 1,268,360,237 円 |
| 中央三井国内バランスV A 3 0（適格機関投資家専用） | 336,466,913 円 |
| 中央三井国内バランスV A 2 5（適格機関投資家専用） | 140,454,295 円 |
| C M A M・V Aバランス20 - 80（適格機関投資家専用） | 1,087,029,165 円 |
| 私募日本債券インデックスファンドA L（適格機関投資家専用） | 9,461,748 円 |
| C M A M私募日本債券インデックスファンド（適格機関投資家専用） | 18,403,680,036 円 |
| 中央三井世界バランスV A 2 0（適格機関投資家専用） | 22,104,079 円 |

2．有価証券関係

平成24年3月26日現在

該当事項はありません。

3．デリバティブ取引関係

．ヘッジ会計が適用されていないもの

債券関連

| 区分 | 種類 | 平成24年3月26日現在 | | |
|----|----|--------------|--|-------------|
| | | 契約額等（円） | | 時価 （円） |
| | | うち1年超 | | |
| | | | | 評価損益 （円） |

| | | | | | |
|------|---------------|---------------|--|---------------|-----------|
| 市場取引 | 債券先物取引 買 建 | 1,416,954,700 | | 1,418,100,000 | 1,145,300 |
| | 合計 | 1,416,954,700 | | 1,418,100,000 | 1,145,300 |

(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。

. ヘッジ会計が適用されているもの

| |
|---------------|
| 平成24年 3月26日現在 |
| 該当事項はありません。 |

[次へ](#)

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、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24年4月27日

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 6,805,815,850 円 |
| 負債総額 | 44,642,892 円 |
| 純資産総額（ - ） | 6,761,172,958 円 |
| 発行済口数 | 6,176,340,823 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0947 円 |
| 1万口当たり純資産額 | 10,947 円 |

<参考>

マザーファンドの現況（平成24年4月27日）

純資産額計算書

（日本債券マザーファンド）

| | |
|----------------|-------------------|
| 資産総額 | 371,274,838,378 円 |
| 負債総額 | 3,944,850,839 円 |
| 純資産総額（ - ） | 367,329,987,539 円 |
| 発行済口数 | 303,860,360,508 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.2089 円 |
| 1万口当たり純資産額 | 12,089 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

本書提出日現在の資本金の額：3億円

会社の発行可能株式総数：24,000株

発行済株式総数：6,000株

最近5年間における資本金の額の増減：なし

（2）委託会社の機構

（中略）

投資運用の意思決定機構

（中略）

委託会社の機構は平成24年4月1日現在（予定）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

本書提出日現在の資本金の額：3億円

会社の発行可能株式総数：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：なし

（2）委託会社の機構

（中略）

投資運用の意思決定機構

（中略）

委託会社の機構は本書提出日現在ののものであり、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24年1月31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とおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

| | 本数（本） | 純資産総額（百万円） |
|------------|------------|------------------|
| 追加型株式投資信託 | <u>165</u> | <u>1,266,156</u> |
| 追加型公社債投資信託 | 0 | 0 |

| | | |
|------------|------------|------------------|
| 単位型株式投資信託 | <u>0</u> | <u>0</u> |
| 単位型公社債投資信託 | <u>0</u> | <u>0</u> |
| 合計 | <u>165</u> | <u>1,266,156</u> |

（ご参考）平成24年1月31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とおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

| | 本数（本） | 純資産総額（百万円） |
|------------|------------|------------------|
| 追加型株式投資信託 | <u>138</u> | <u>2,407,981</u> |
| 追加型公社債投資信託 | <u>0</u> | <u>0</u> |
| 単位型株式投資信託 | <u>5</u> | <u>639</u> |
| 単位型公社債投資信託 | <u>0</u> | <u>0</u> |
| 合計 | <u>143</u> | <u>2,408,580</u> |

< 訂正後 >

（前略）

平成24年4月27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は次のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

| | 本数（本） | 純資産総額（百万円） |
|------------|------------|------------------|
| 追加型株式投資信託 | <u>298</u> | <u>3,745,320</u> |
| 追加型公社債投資信託 | <u>0</u> | <u>0</u> |
| 単位型株式投資信託 | <u>5</u> | <u>675</u> |
| 単位型公社債投資信託 | <u>0</u> | <u>0</u> |
| 合計 | <u>303</u> | <u>3,745,995</u> |

[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）定款の変更

当会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

（2）訴訟事件その他の重要事項

当社は平成24年4月1日に中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、商号を三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に変更する予定です。

< 訂正後 >

（1）定款の変更

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

（2）訴訟事件その他の重要事項

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。

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。

<訂正前>

(1) 受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円（平成24年4月1日現在（予定））

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

(2) 販売会社

| 名称 | 資本金の額（百万円） （平成23年9月末日現在） | 事業の内容 |
|------------------|-----------------------------|---|
| 三井住友信託銀行株式会社 | 342,037 | 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、「金融機関の信託業務の兼営等に関する法律」に基づき信託業務を営んでいます。 |
| S M B C 日興証券株式会社 | 10,000 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |

資本金の額は平成24年4月1日現在（予定）です。

<訂正後>

(1) 受託会社

名称 : 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 : 342,037百万円（平成24年4月1日現在）

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

(2) 販売会社

| 名称 | 資本金の額（百万円） （平成23年9月末日現在） | 事業の内容 |
|------------------|-----------------------------|---|
| 三井住友信託銀行株式会社 | 342,037 | 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、「金融機関の信託業務の兼営等に関する法律」に基づき信託業務を営んでいます。 |
| S M B C 日興証券株式会社 | 10,000 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |

資本金の額は平成24年4月1日現在です。

独立監査人の中間監査報告書

平成24年5月25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 松崎雅則 印

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」に掲げられている中央三井日本債券インデックスファンド（SMA専用）の平成23年9月27日から平成24年3月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な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、中央三井日本債券インデックスファンド（SMA専用）の平成24年3月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年9月27日から平成24年3月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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XBR Lデータ自体は含まれておりません。