

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	平成23年 4 月22日
<b>【発行者名】</b>	中央三井アセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 山本 聡
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都港区芝三丁目23番 1 号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	大供 修二 東京都港区芝三丁目23番 1 号 業務企画部
<b>【電話番号】</b>	03-5440-0170
<b>【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】</b>	中央三井日本債券インデックスファンド
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】</b>	継続募集額 上限 10兆円
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

中央三井日本債券インデックスファンド（以下「当ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

１口当たりの元本は１円です。

委託会社である中央三井アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」といいます。）の依頼により、信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「（１１）振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

「基準価額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上１万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出され、日々の基準価額は、販売会社へお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします（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。）。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.cmam.co.jp/>）でご覧いただけます。

ただし、分配金再投資に関する契約（後記「第二部 ファンド情報 第２ 管理及び運営 １ 申込（販売）手続等（４）その他 」をご参照ください。）に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、後記「第二部 ファンド情報 第２ 管理及び運営 ３ 資産管理等の概要（４）計算期間」に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

### （５）【申込手数料】

お申込受付日の基準価額に、1.05%（税抜 1.0%）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。

「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。

償還乗換えにより当ファンドの受益権をお求めいただく場合には、当該償還金額の範囲内（単位型証券投資信託にあっては、当該償還金額とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数について申込手数料を優遇することがあります。（「償還乗換優遇制度」（ ））

「償還乗換優遇制度」とは、取得申込日の属する月の前３ヶ月以内に償還となった証券投資信託の償還金（信託期間を延長した単位型証券投資信託及び延長前の信託終了日以降、収益分配金の再投

資以外の追加信託を行わない追加型証券投資信託にあっては、延長前の信託終了日以降でかつ取得申込日の属する月の前3ヶ月以内における受益権の買取請求による売却代金及び一部解約金を含みます。)をもって、その支払いを行った販売会社で当ファンドの受益権をお求めいただく場合に申込手数料を優遇する制度のことをいいます。なお、この際に、償還金の支払いを受けたことを証する書類をご提示いただくことがあります。

申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額はお申込金額( )の中から差引きます。

お申込受付日の基準価額に取得口数を乗じて得た額に、申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額を加えた総額をいいます。

収益分配金を再投資する場合のお申込みについては、申込手数料は無手数料とします。

上記及び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。

#### (6)【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

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。

ただし、収益分配金を再投資する場合は、1口単位とします。

#### (7)【申込期間】

平成23年4月23日から平成24年4月23日までとします。

(注)お申込みの取扱いは、営業日の午後2時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

ただし、後記「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針 (4) 分配方針 収益分配金の再投資等」に規定する収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所)で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取消することができます。

なお、継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

#### (8)【申込取扱場所】

申込取扱場所(以下「販売会社」といいます。)の詳細につきましては、以下の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

中央三井アセットマネジメント株式会社

・お問い合わせ窓口

電話：0120-668001(フリーダイヤル)

03-5440-0190

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

・ホームページアドレス：<http://www.cmam.co.jp/>

#### (9)【払込期日】

申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込金額を販売会社に支払うものとします。

継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受付けた販売会社とします。(販売会社の詳細につきましては、上記「(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。)

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。  
株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

申込証拠金

該当事項はありません。

日本以外の地域における発行

該当事項はありません。

振替受益権について

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

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

## 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】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

当ファンドは、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

信託金限度額

上限 3,000億円

基本的性格

当ファンドは、委託会社である中央三井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、中央三井アセット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。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ( )	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### (用語の定義について)

当ファンドが該当する商品分類に係る用語の定義は以下のとおりです。

なお、これ以外の用語の定義につきましては、社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) にてご確認ください。

< 単位型投信・追加型投信 >

- ・追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

< 投資対象地域 >

- ・国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

< 投資対象資産（収益の源泉） >

- ・債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を

源泉とする旨の記載があるものをいいます。

< 補足分類 >

- ・インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

#### 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル ( )		
大型株	年2回			
中小型株	年4回	日本		日経225
債券 一般	年6回	北米	ファミリー ファンド	
公債	(隔月)	欧州		
社債				
その他債券 クレジット属性 ( )	年12回 (毎月)	アジア		TOPIX
	日々	オセアニア		
不動産投信		中南米	ファンド ・オブ・ ファンズ	その他
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))	その他 ( )	アフリカ		(NOMURA - BPI 総合)
		中近東 (中東)		
資産複合 ( )		エマージング		
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(用語の定義について)

当ファンドが該当する属性区分に係る用語の定義は以下のとおりです。

なお、これ以外の用語の定義につきましては、社団法人投資信託協会のホームページ

(<http://www.toushin.or.jp/>)にてご確認いただけます。

< 投資対象資産 >

- ・その他資産（投資信託証券）

...目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投信以外の資産に主として投資する旨の記載があるものをいいます。

- ・債券 一般...公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。

当ファンドでは株式、債券、不動産投信以外の資産である投資信託証券を主要投資対象とし、当該投資信託証券を通じて債券に投資します。

なお、商品分類表の投資対象資産（収益の源泉）が「債券」であるのに対して、属性区分表の投資対象資産では「その他資産（投資信託証券）」と異なる区分になっていますが、これは商

品分類表では収益の源泉となる資産（実質基準）を記載するのに対して、属性区分表では組入れている資産そのもの（形式基準）を記載することとなっているためです。

< 決算頻度 >

- ・年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

< 投資対象地域 >

- ・日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

< 投資形態 >

- ・ファミリーファンド

...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。

< インデックスファンドにおける対象インデックス >

- ・その他（NOMURA - B P I 総合）

...「その他」とは、日経225、TOPIX以外の指数をいいます。

なお、当ファンドの対象インデックスは「NOMURA - B P I 総合」です。

NOMURA - B P I 総合は、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、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。この指数は野村證券株式会社の知的財産であり、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果に関し、一切責任はありせん。

ファンドの特色

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行い、NOMURA - B P I 総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

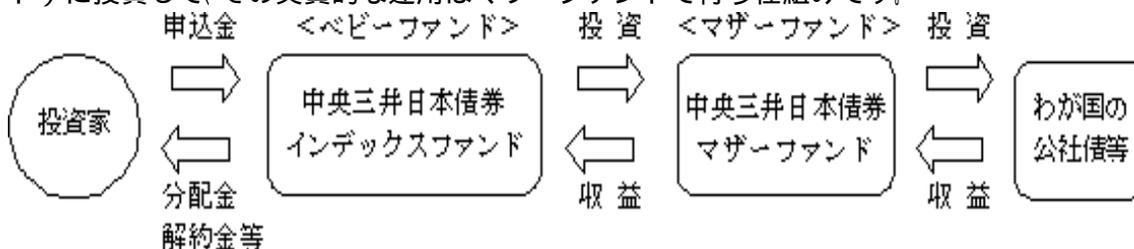
（2）【ファンドの沿革】

平成13年1月23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

（3）【ファンドの仕組み】

ファミリーファンド方式での運用

ファミリーファンド方式とは、投資家から投資された資金をまとめてベビーファンド（中央三井日本債券インデックスファンド）とし、その資金をマザーファンド（中央三井日本債券マザーファンド）に投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



ファンドの関係法人

**委託会社 中央三井アセットマネジメント株式会社**

当ファンドの委託会社として、信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。

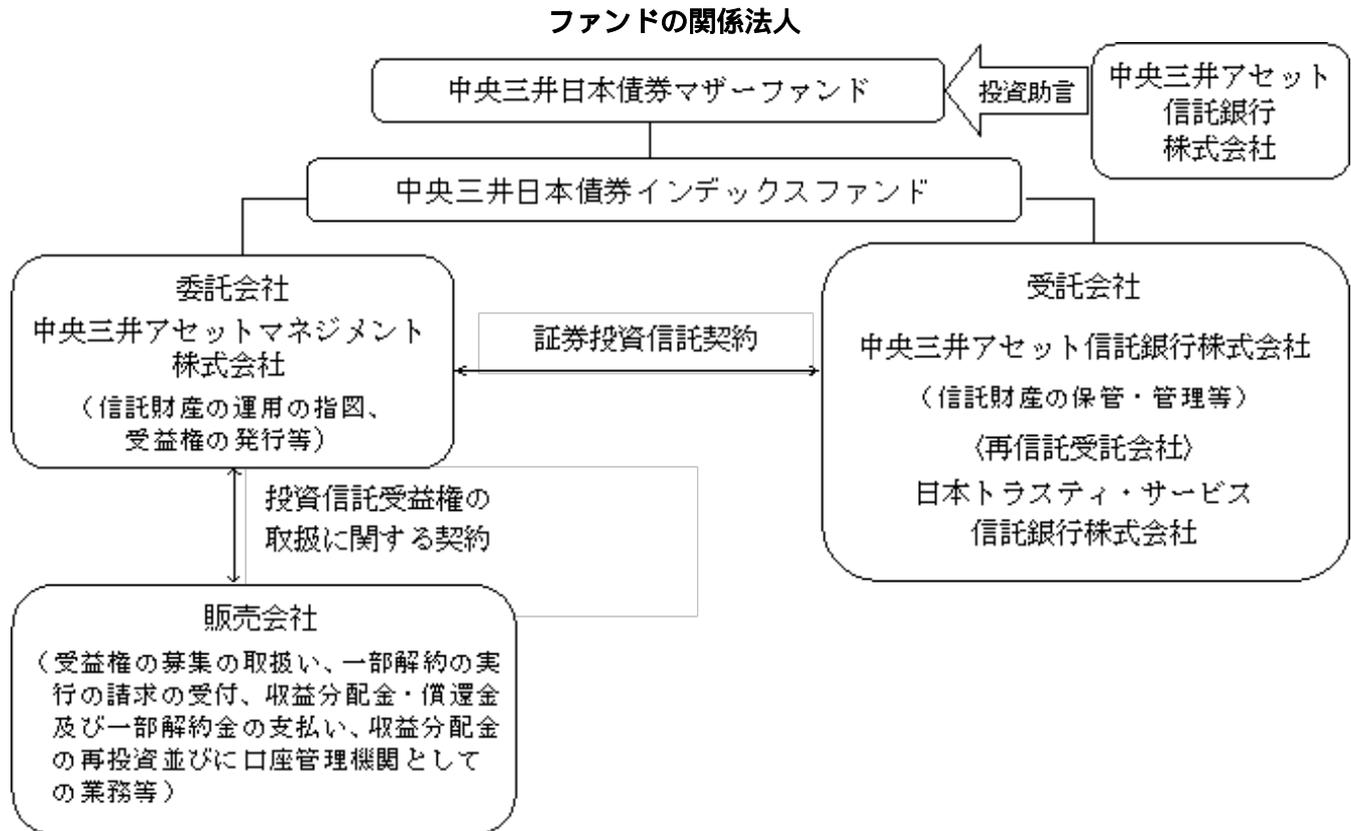
**受託会社 中央三井アセット信託銀行株式会社**

（再信託受託会社 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

## 販売会社

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



## 委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「証券投資信託契約」	運用に関する事項、委託会社及び受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、当該信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づき、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づいています。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資並びに口座管理機関としての業務等に係る事務の内容等が定められています。

## 委託会社の概況

A．資本金の額：3億円（平成23年4月22日現在）

### B．委託会社の沿革

昭和61年9月19日：三信投資顧問株式会社（三井信託銀行グループの投資顧問会社）として設立

昭和62年9月9日：投資一任業務の認可取得

平成11年7月1日：中信投資顧問株式会社（中央信託銀行グループの投資顧問会社）と合併し「中央三井アセットマネジメント株式会社」に社名変更

平成12年3月23日：証券投資信託委託業務認可取得

平成19年9月30日：金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録

## C. 大株主の状況(平成23年4月22日現在)

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目9番2号	5,050株	100%

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 運用方針

当ファンドは、わが国の公社債に投資する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、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

なお、公社債等に直接投資することもあります。

#### 投資態度

- A．公社債への実質投資は、わが国で発行された公社債に分散投資を行い、NOMURA - B P I 総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- B．公社債等への実質投資割合は、原則として高位を保ちます。ただし、当ファンドの設定当初や解約・償還への対応などの事情により変更することもあります。
- C．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引と類似の取引を行うことができます。
- D．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- E．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

### (2)【投資対象】

#### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- A．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - 1．有価証券
  - 2．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記（5）G．、H．及びI．に定めるものに限り、）
  - 3．金銭債権（上記1．、2．及び下記4．に掲げるものに該当するものを除きます。）
  - 4．約束手形（上記1．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- B．次に掲げる特定資産以外の資産
  - 1．為替手形

#### 運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として中央三井アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、中央三井アセット信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託「中央三井日本債券マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）（本邦通貨表示のものに限り、）に投資することを指図します。

- 1．国債証券
- 2．地方債証券
- 3．特別の法律により法人の発行する債券
- 4．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
- 5．資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

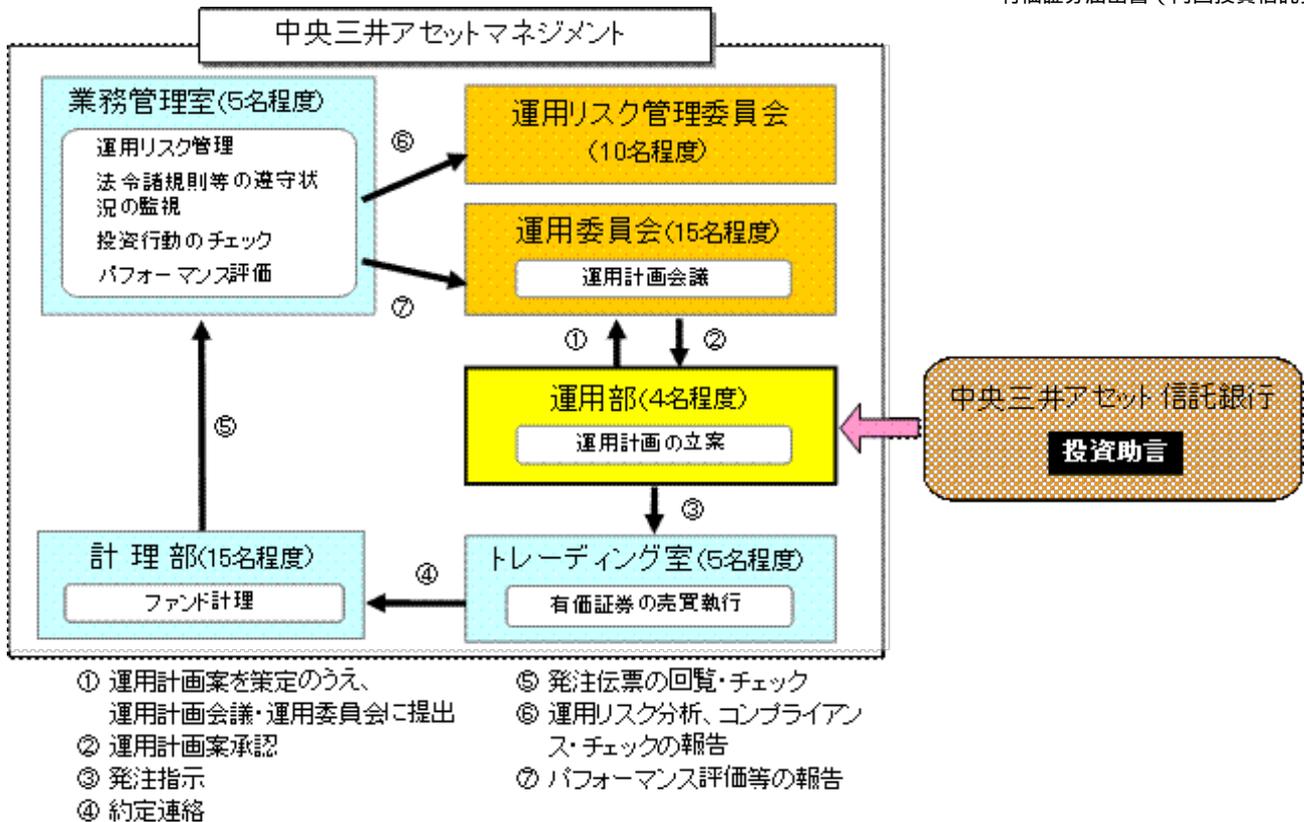
6. 転換社債の転換及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限り、）の行使により取得した株券
  7. コマーシャル・ペーパー
  8. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記1. から7. までの証券又は証書の性質を有するもの
  9. 証券投資信託又は外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）
  10. 投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
  11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  12. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  13. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、）
  14. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  16. 外国の者に対する権利で上記15. の有価証券の性質を有するもの
- なお、上記6. の証券又は証書及び上記8. の証券又は証書のうち上記6. の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記1. から5. までの証券及び上記8. の証券又は証書のうち上記1. から5. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記9. の証券及び上記10. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 運用指図できる金融商品

- A. 委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
  2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  3. コール・ローン
  4. 手形割引市場において売買される手形
  5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  6. 外国の者に対する権利で上記5. の権利の性質を有するもの
- B. 金融商品による運用の特例
- 当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記A. に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

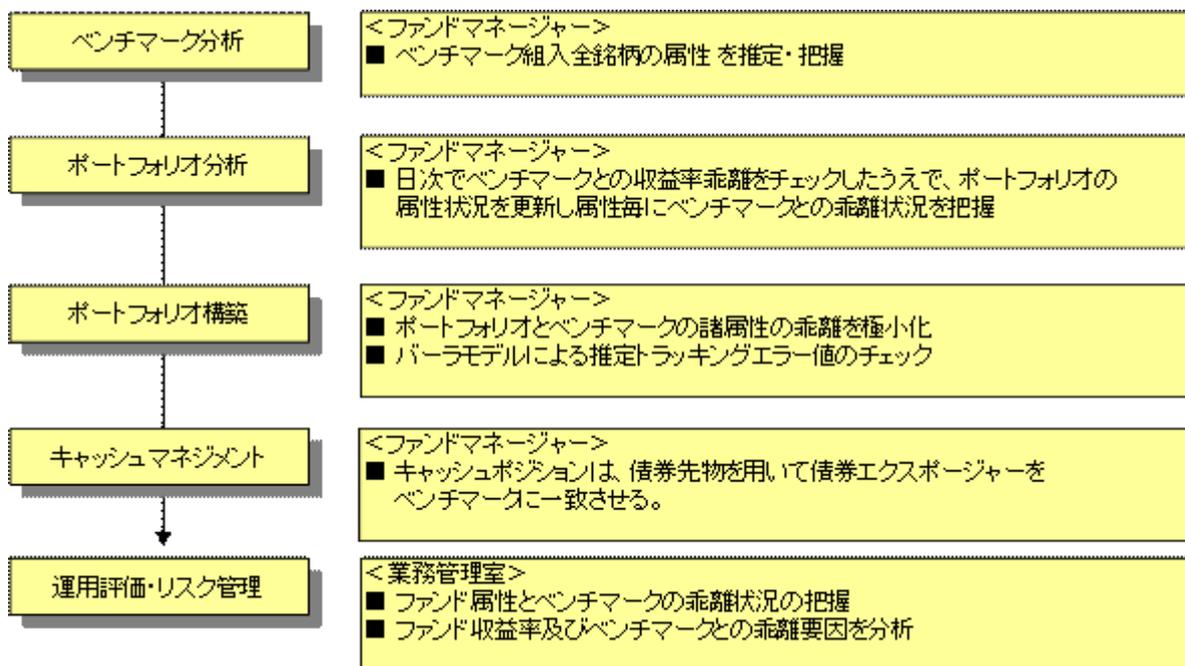
### (3) 【運用体制】

運用部門において中央三井アセット信託銀行からの投資助言を活用して運用計画を立案し、運用委員会による承認を受けて運用を行います。また、運用部門から独立した管理部門が運用リスク管理を行い、運用リスク管理委員会に報告する体制としています。



#### <マザーファンドのポートフォリオ構築プロセス>

- ・ポートフォリオの構築は、ベンチマーク分析、ポートフォリオ分析等の段階を踏んで実施します。
- ・運用に際しては、中央三井アセット信託銀行との投資顧問契約に基づき、中央三井アセット信託銀行の運用部門から投資助言（売買案）の提供を受け活用します。また、運用評価・リスク管理については業務管理室が行います。



上記運用体制における組織名称等は、委託会社の組織変更等により変更となる場合があります。この場合においても、ファンドの基本的な運用方針が変更されるものではありません。

委託会社のファンドの運用に関する社内規定として、運用財産に係る運用管理規程があり、委託会社がファンドの運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を定めています。また、ファンドの運用におけるリスク管理に関する基本的な事項を定めた社内規定として運用リスク管理規程があります。

委託会社は、ファンドの関係法人である再信託受託会社に対する管理・統制としては、モニタリングの一環として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入手し査閲するなど、“外部業務委託の適切性”に関する定期的確認を基本的枠組として運営しています。

#### (4) 【分配方針】

##### 分配方針

年1回の毎決算時（決算日は1月22日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

- A．分配対象額は、経費控除後の利子等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の合計額とします。
- B．分配金額は、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- C．収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

##### 分配収益の計算

- A．信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。
  - イ．配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額は、諸経費（後記「4 手数料等及び税金（4）その他の手数料等」の記載をご参照ください。）、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金に充てるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
  - ロ．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配に充てるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
  - ハ．収益分配金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
  - ニ．「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額（ただし、後記「4 手数料等及び税金（1）申込手数料」に規定する申込手数料及び申込手数料に係る消費税等に相当する金額を除きます。以下本項において同じ。）と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

- B．毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

##### 収益分配金の再投資等

収益分配金は、自動的に当ファンドの受益権に再投資されます。

- A．分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。
- B．販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、毎計算期間終了日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（上記A．の収益分配金に係る計算期間終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、上記A．の収益分配金に係る計算期間終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として扱います。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されません。
- C．信託契約の一部解約が行われた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、上記A．

及びB.の規定にかかわらず、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日から当該受益権に係る受益者に支払います。

#### (5) 【投資制限】

##### 約款に定める投資制限

##### A. 株式への投資割合

委託会社は、株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限り、取得時において実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

##### B. 同一銘柄の株式への投資割合

委託会社は、同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

##### C. 転換社債等への投資割合

委託会社は、転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

##### D. 外貨建資産への投資割合

委託会社は、外貨建資産への投資は行いません。

##### E. 投資信託証券への投資割合

委託会社は、投資信託証券（マザーファンドを除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

##### F. 投資する株式等の範囲

イ. 委託会社が投資することを指図する株式は、わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所での有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

ロ. 上記イ.の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

##### G. 先物取引等の運用指図

イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

ロ. 委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

##### H. スワップ取引の運用指図

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。

ロ. スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ. 委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

##### I. 金利先渡取引の運用指図

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことを指

図することができます。

- ．金利先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の評価は、当該取引の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- Ｊ．有価証券の貸付の指図及び範囲
  - イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。ただし、当該貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
  - ．上記イ．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
  - ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- Ｋ．公社債の空売り
  - イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
  - ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記□．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- Ｌ．公社債の借入れ
  - イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
  - ．上記イ．の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記□．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
  - ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- Ｍ．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
  - 委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
- Ｎ．再投資の指図
  - 委託会社は、上記Ｍ．の規定による一部解約代金及び売却代金、有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等、及びその他の収入金を再投資することを指図することができます。
- Ｏ．資金の借入れ
  - イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

P．受託会社による資金の立替え

イ．信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。

ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

関連法令に基づく投資制限

A．発生し得る危険に対応する額として算出した額が運用財産の純資産額を超える場合におけるデリバティブ取引に関する制限

(金融商品取引法第42条の2第7号、金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)

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

B．同一の法人の発行する株式への投資制限

(投資信託及び投資法人に関する法律第9条、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第20条)

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、次のイ．に掲げる数がロ．に掲げる数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

イ．その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。ロ．において同じ。)の総数

ロ．当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数

(参考) マザーファンドの概要

「中央三井日本債券マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

## （２）投資態度

わが国の公社債に投資を行い、NOMURA - B P I 総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用に際しては、中央三井アセット信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、中央三井アセット信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

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

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことができます。

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

## ３．投資制限

株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

### 3【投資リスク】

(1) 当ファンドは、マザーファンドを通じて主に円建ての公社債を投資対象としています。金利の変動等による組入れ公社債の価格の変動等により基準価額が変動しますので、元本保証はなく、投資元本を割り込むことがあり収益（投資利回り）は未確定です。また、組入れた公社債の発行体の経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化等により、投資元本を割り込むことがあり収益（投資利回り）は未確定です。

なお当ファンドは、NOMURA - BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行いますので、NOMURA - BPI総合の変動により当ファンドの基準価額も変動し、これにより損失が生ずることとなるおそれがあります。

当ファンドの主なリスクは以下のとおりです。

#### 金利変動リスク

金利変動リスクとは、金利変動により債券価格が変動するリスクをいいます。一般に、金利が上昇（低下）した場合には債券価格は下落（上昇）し、基準価額の下落（上昇）要因となります。

#### 信用リスク

信用リスクとは、有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなるリスクをいいます。一般に、このような事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

#### 流動性リスク

流動性リスクとは、短期間に相当金額の解約申込みがあった場合等、当ファンドの保有資産を大量に売却せざるを得ない場合に、市況動向や取引量等の状況により基準価額が大きく変動するリスクをいいます。一般に、売却資産の市場における流動性が低いときには、期待する価格での取引ができないことや、取引に相応の時間を要することがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

#### その他のリスク

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、ベンチマーク（NOMURA - BPI総合）と連動する投資成果を目標として運用を行います。当ファンドの基準価額騰落率とベンチマークの騰落率は必ずしも一致しません。

この主な要因としては債券の売買コスト、信託報酬等の費用を負担すること等によるものです。

また、当ファンドの基準価額騰落率とベンチマークの騰落率が連動することを保証するものではありません。

(2) 当ファンドはファミリーファンド方式（前記「1 ファンドの性格（3）ファンドの仕組みファミリーファンド方式での運用」をご参照ください。）で運用を行います。そのため、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等に伴う資金変動があり、その結果、当該マザーファンドにおいて有価証券の売買等が行われた場合等には、その売買による組入る有価証券等の価格の変化や売買手数料等の負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。この影響が、当ファンドの基準価額の変動要因となる可能性があります。

(3) 投資リスクに対する管理体制

当ファンドの運用制限の遵守状況のチェック、リスク分析、パフォーマンス評価等については運用セクションから組織的に独立したセクションが行い、その分析結果を運用リスク管理委員会、運用委員会に報告する体制としております。

法令諸規則、約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェック、リスクのモニタリングは、業務管理室が日々実施しております。問題が生じた場合は、運用担当者に連絡され速やかに是正を図るとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。

パフォーマンス評価等は、業務管理室において行っております。問題が生じた場合は、運用担当者に連

絡され速やかに是正を図るとともに、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。

( 4 ) 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資家の皆様に帰属します。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

お申込受付日の基準価額に、1.05%（税抜 1.0%）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。

「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。

なお、マザーファンドにおいては、申込手数料はかかりません。

償還乗換えにより当ファンドの受益権をお求めいただく場合には、当該償還金額の範囲内（単位型証券投資信託にあっては、当該償還金額とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数について申込手数料を優遇することがあります。（「償還乗換優遇制度」（ ））

「償還乗換優遇制度」とは、取得申込日の属する月の前3ヶ月以内に償還となった証券投資信託の償還金（信託期間を延長した単位型証券投資信託及び延長前の信託終了日以降、収益分配金の再投資以外の追加信託を行わない追加型証券投資信託にあっては、延長前の信託終了日以降でかつ取得申込日の属する月の前3ヶ月以内における受益権の買取請求による売却代金及び一部解約金を含みます。）をもって、その支払いを行った販売会社で当ファンドの受益権をお求めいただく場合に申込手数料を優遇する制度のことをいいます。なお、この際に、償還金の支払いを受けたことを証する書類をご提示いただくことがあります。

申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額はお申込金額（ ）の中から差引きます。

お申込受付日の基準価額に取得口数を乗じて得た額に、申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額を加えた総額をいいます。

収益分配金を再投資する場合のお申込みについては、申込手数料は無手数料とします。

上記 及び 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、以下の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

中央三井アセットマネジメント株式会社

・お問い合わせ窓口

電 話：0120-668001（フリーダイヤル）

03-5440-0190

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

・ホームページ アドレス：<http://www.cmam.co.jp/>

### (2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はありませんが、下記 の信託財産留保額が控除されます。

一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

受益者の手取額は、当該解約価額から下記「（5）課税上の取扱い」「 個人の受益者に対する課税」もしくは「 法人の受益者に対する課税」に記載の税額を差引いた金額となります。

なお、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券を一部解約する場合には、下表のA欄の金額にB欄の率を乗じて得た信託財産留保額が控除されます。

マザーファンド名	A 欄	B 欄
中央三井日本債券マザーファンド	一部解約を行う日の前営業日の信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額を受益権総口数で除した金額	0.1%

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。

### (3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、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。その配分は以下のとおりです。

委託会社	年率 0.189%	（税抜 0.18%）
販売会社	年率 0.2835%	（税抜 0.27%）
受託会社	年率 0.0525%	（税抜 0.05%）

なお、マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

上記の信託報酬は、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信託財産中から支弁します。

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

#### （４）【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど信託財産中から支弁します。

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、信託財産から収受する信託報酬中より委託会社が支弁します。

なお、マザーファンドにおいては、監査報酬はかかりません。

借入金の利息は、原則として借入金返済時に信託財産中から支弁します。

ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に対する消費税等相当額、先物取引・オプション取引に要する費用等は、取引のつど信託財産中から支弁します。

#### （５）【課税上の取扱い】

個別元本について

- A. 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- B. 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- C. ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には各販売会社毎に、個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」の両コースで取得する場合はコース別に、個別元本の算出が行われる場合があります。
- D. 受益者が特別分配金を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「特別分配金」については、下記の「収益分配金の課税について」をご参照ください。）

一部解約時及び償還時の課税について

一部解約時及び償還時の譲渡益（個人の場合）又は個別元本超過額（法人の場合）が課税対象となります。詳しくは下記 又は をご参照ください。

収益分配金の課税について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

- A. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、
- B. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が特別分配金を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配

金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

#### 個人の受益者に対する課税

- A．収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金の源泉徴収の税率は、平成23年12月31日までは10%（所得税7%及び地方税3%）、平成24年1月1日以降は20%（所得税15%及び地方税5%）となります。
- B．一部解約時及び償還時の譲渡益が譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、平成21年から平成23年までにおいては10%（所得税7%及び地方税3%）、平成24年以降は20%（所得税15%及び地方税5%）となります。
- C．一部解約時及び償還時の損失の金額については、確定申告により、上場株式等の譲渡所得の金額及び申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得の金額から控除することが可能となります。また、一部解約時及び償還時の差益については、上場株式等の譲渡損との通算が可能となります。
- 詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めいたします。

#### 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、7%（所得税のみ）の税率（ ）による源泉徴収が行われます。

平成24年1月1日以降は、上記の7%（所得税のみ）の税率は15%（所得税のみ）となります。

上記は、平成23年4月22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。

## 5【運用状況】

以下の記載事項は、平成23年2月28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	中央三井日本債券マザーファンド	日本	4,549,969,958	100.06
受益証券	親投資信託受益証券合計		4,549,969,958	100.06
その他の資産(負債控除後)			2,769,442	0.06
合計(純資産総額)			4,547,200,516	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。

## &lt;参考&gt;

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。

## (中央三井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	347,054,371,513	98.63
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		4,821,970,418	1.37
合計(純資産総額)		351,876,341,931	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	中央三井日本債券 マザーファンド	3,896,523,044	1.1666	4,545,704,539	1.1677	4,549,969,958	100.06

(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。

## &lt;参考&gt;

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

## (中央三井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(10年)第312回	1.2	2020/12/20	5,800,000,000	99.72	5,784,198,000	99.52	5,772,160,000	1.64
2	利付国庫債券(5年)第88回	0.5	2015/3/20	4,500,000,000	100.30	4,513,725,000	100.09	4,504,455,000	1.28

3	利付国庫債券(10年)第288回	1.7	2017/9/20	3,900,000,000	106.18	4,141,060,000	105.86	4,128,735,000	1.17
4	利付国庫債券(5年)第87回	0.5	2014/12/20	3,800,000,000	100.38	3,814,554,000	100.20	3,807,790,000	1.08
5	利付国庫債券(5年)第90回	0.3	2015/6/20	3,700,000,000	99.35	3,676,061,000	99.13	3,668,069,000	1.04
6	利付国庫債券(5年)第86回	0.6	2014/9/20	3,500,000,000	100.84	3,529,510,000	100.64	3,522,645,000	1.00
7	利付国庫債券(10年)第305回	1.3	2019/12/20	3,300,000,000	101.57	3,352,107,000	101.44	3,347,553,000	0.95
8	利付国庫債券(10年)第289回	1.5	2017/12/20	3,100,000,000	104.74	3,247,095,000	104.48	3,238,880,000	0.92
9	利付国庫債券(10年)第285回	1.7	2017/3/20	2,900,000,000	106.26	3,081,656,000	105.89	3,070,897,000	0.87
10	利付国庫債券(10年)第284回	1.7	2016/12/20	2,750,000,000	106.23	2,921,325,000	105.86	2,911,370,000	0.83
11	利付国庫債券(2年)第296回	0.1	2012/9/15	2,800,000,000	99.87	2,796,556,000	99.83	2,795,492,000	0.79
12	利付国庫債券(2年)第298回	0.1	2012/11/15	2,700,000,000	99.84	2,695,869,000	99.81	2,694,951,000	0.77
13	利付国庫債券(10年)第309回	1.1	2020/6/20	2,700,000,000	99.32	2,681,721,000	99.20	2,678,508,000	0.76
14	利付国庫債券(10年)第296回	1.5	2018/9/20	2,500,000,000	104.25	2,606,375,000	104.02	2,600,525,000	0.74
15	利付国庫債券(10年)第303回	1.4	2019/9/20	2,500,000,000	102.69	2,567,325,000	102.50	2,562,600,000	0.73
16	利付国庫債券(5年)第93回	0.5	2015/12/20	2,500,000,000	100.04	2,501,223,000	99.78	2,494,725,000	0.71
17	利付国庫債券(10年)第306回	1.4	2020/3/20	2,400,000,000	102.23	2,453,688,000	102.04	2,449,152,000	0.70
18	利付国庫債券(5年)第69回	0.9	2012/12/20	2,400,000,000	101.34	2,432,184,000	101.22	2,429,472,000	0.69
19	利付国庫債券(5年)第89回	0.4	2015/6/20	2,400,000,000	99.78	2,394,816,000	99.55	2,389,392,000	0.68
20	利付国庫債券(5年)第79回	0.7	2013/12/20	2,300,000,000	101.16	2,326,888,000	101.06	2,324,564,000	0.66
21	利付国庫債券(2年)第291回	0.2	2012/4/15	2,300,000,000	100.05	2,301,242,000	100.02	2,300,506,000	0.65
22	利付国庫債券(5年)第64回	1.5	2012/6/20	2,200,000,000	101.86	2,241,008,000	101.69	2,237,334,000	0.64
23	利付国庫債券(5年)第71回	1.3	2013/3/20	2,100,000,000	102.35	2,149,497,000	102.15	2,145,318,000	0.61
24	利付国庫債券(5年)第82回	0.9	2014/3/20	2,100,000,000	101.89	2,139,879,000	101.67	2,135,133,000	0.61
25	利付国庫債券(5年)第85回	0.7	2014/9/20	2,100,000,000	101.20	2,125,305,000	100.99	2,120,937,000	0.60
26	利付国庫債券(10年)第282回	1.7	2016/9/20	2,000,000,000	106.08	2,121,690,000	105.79	2,115,900,000	0.60
27	利付国庫債券(5年)第77回	1.0	2013/9/20	2,000,000,000	102.01	2,040,240,000	101.78	2,035,680,000	0.58
28	利付国庫債券(5年)第83回	0.9	2014/6/20	2,000,000,000	101.93	2,038,600,000	101.67	2,033,540,000	0.58
29	利付国庫債券(5年)第81回	0.8	2014/3/20	2,000,000,000	101.57	2,031,440,000	101.37	2,027,420,000	0.58
30	利付国庫債券(5年)第84回	0.7	2014/6/20	2,000,000,000	101.24	2,024,840,000	101.02	2,020,520,000	0.57
合計				83,250,000,000		84,731,677,000		84,564,223,000	24.03

(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	73.87
地方債証券	6.53
特殊債券	10.44
社債券	7.79
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	17	2,369,314,990	2,372,180,000	0.67

(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)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期計算期間(平成14年1月22日現在)	7,471,405,279	7,471,405,279	10,113	10,113
第2期計算期間(平成15年1月22日現在)	7,993,378,276	7,993,378,276	10,478	10,478
第3期計算期間(平成16年1月22日現在)	1,930,899,639	1,930,899,639	10,334	10,334
第4期計算期間(平成17年1月24日現在)	1,660,155,886	1,661,751,526	10,404	10,414
第5期計算期間(平成18年1月23日現在)	2,014,800,094	2,014,800,094	10,407	10,407
第6期計算期間(平成19年1月22日現在)	1,990,412,619	1,990,412,619	10,369	10,369
第7期計算期間(平成20年1月22日現在)	1,790,456,825	1,790,456,825	10,668	10,668
第8期計算期間(平成21年1月22日現在)	2,370,038,531	2,370,038,531	10,835	10,835
第9期計算期間(平成22年1月22日現在)	5,960,872,263	5,960,872,263	10,929	10,929
第10期計算期間(平成23年1月24日現在)	8,633,889,828	8,633,889,828	11,076	11,076
平成22年2月末日	6,118,785,725		10,949	
平成22年3月末日	6,099,600,468		10,923	
平成22年4月末日	6,696,354,901		11,009	
平成22年5月末日	6,602,766,432		11,034	
平成22年6月末日	6,475,447,526		11,154	
平成22年7月末日	6,754,558,202		11,185	
平成22年8月末日	7,128,714,164		11,254	
平成22年9月末日	7,344,437,944		11,259	
平成22年10月末日	7,749,931,857		11,217	
平成22年11月末日	7,904,581,487		11,088	
平成22年12月末日	8,477,695,546		11,152	
平成23年1月末日	8,624,825,209		11,087	
平成23年2月末日	4,547,200,516		11,067	

【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	10円

第5期計算期間	0円
第6期計算期間	0円
第7期計算期間	0円
第8期計算期間	0円
第9期計算期間	0円
第10期計算期間	0円

## 【収益率の推移】

	収益率
第1期計算期間	1.13%
第2期計算期間	3.61%
第3期計算期間	1.37%
第4期計算期間	0.77%
第5期計算期間	0.03%
第6期計算期間	0.37%
第7期計算期間	2.88%
第8期計算期間	1.57%
第9期計算期間	0.87%
第10期計算期間	1.35%

（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日（平成13年1月23日）の基準価額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	7,639,787,031	251,883,327	7,387,903,704
第2期計算期間	1,408,168,496	1,167,530,368	7,628,541,832
第3期計算期間	301,267,286	6,061,265,253	1,868,543,865
第4期計算期間	261,531,278	534,434,628	1,595,640,515
第5期計算期間	757,676,269	417,257,662	1,936,059,122
第6期計算期間	698,977,196	715,476,846	1,919,559,472
第7期計算期間	953,081,513	1,194,289,360	1,678,351,625
第8期計算期間	1,522,780,950	1,013,662,087	2,187,470,488
第9期計算期間	3,677,464,349	410,646,937	5,454,287,900
第10期計算期間	5,301,638,239	2,960,530,227	7,795,395,912

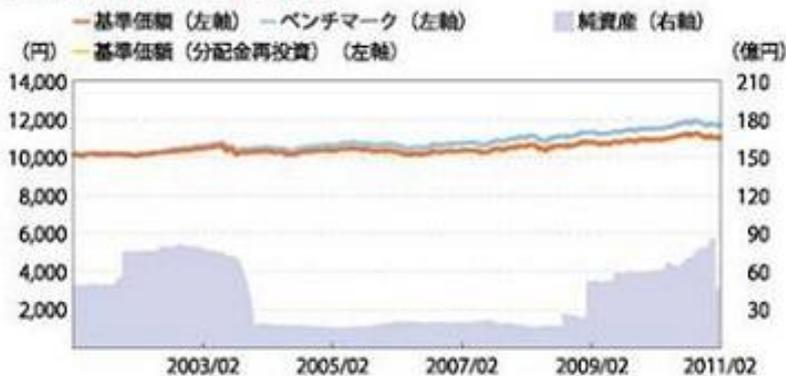
（注1）設定及び解約の実績は、全て本邦内における実績です。

（注2）第1期計算期間の設定口数には、当初募集期間中の募集に係る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

## 〈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(税引前)を分配時に再投資したものとみなして算出した値です。  
 ・ベンチマークは、設定日の基準価額に合わせて指数化しています。

2011年2月28日 現在(基準日)

## 〈分配の推移〉

年月	分配額 (円)
2011年1月	0円
2010年1月	0円
2009年1月	0円
2008年1月	0円
2007年1月	0円
設定来累計	10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	98.69%
その他資産	1.31%
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招入れますので、実質比率を記載しています。

## 種類別投資比率(中央三井日本債券マザーファンド)

種類	比率
国債証券	73.87%
地方債証券	6.53%
特殊債券	10.44%
社債券	7.79%
合計	98.63%

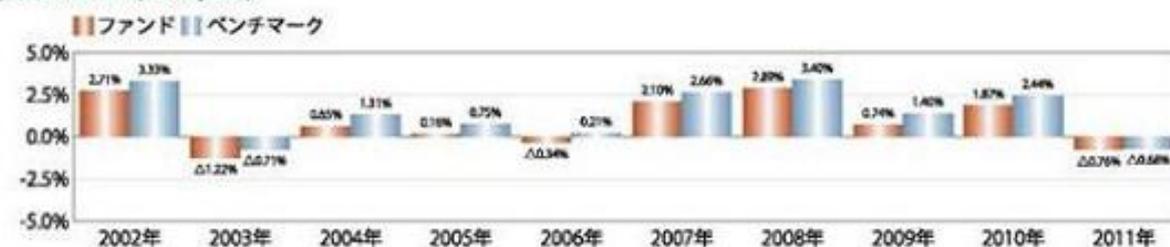
・比率とはマザーファンドの純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率をいいます。

## 組入上位銘柄(中央三井日本債券マザーファンド)

銘柄名	種類	償還日	利率	比率
利付国庫債券(10年)第312回	国債証券	2020/12/20	1.200%	1.64%
利付国庫債券(5年)第88回	国債証券	2015/03/20	0.500%	1.28%
利付国庫債券(10年)第288回	国債証券	2017/09/20	1.700%	1.17%
利付国庫債券(5年)第87回	国債証券	2014/12/20	0.500%	1.08%
利付国庫債券(5年)第90回	国債証券	2015/06/20	0.300%	1.04%
利付国庫債券(5年)第86回	国債証券	2014/09/20	0.600%	1.00%
利付国庫債券(10年)第305回	国債証券	2019/12/20	1.300%	0.95%
利付国庫債券(10年)第289回	国債証券	2017/12/20	1.500%	0.92%
利付国庫債券(10年)第285回	国債証券	2017/03/20	1.700%	0.87%
利付国庫債券(10年)第284回	国債証券	2016/12/20	1.700%	0.83%
	合計			10.79%

・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。  
 ・2011年(直近年)は年初から基準日までの分配金(税引前)を含む基準価額の騰落率を表示しています。ベンチマークの騰落率も同様です。  
 ・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2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### （1）申込みの受付け

申込期間中において、毎営業日お申込みいただけます。

（注）お申込みの取扱いは、営業日の午後2時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

ただし、分配金再投資に関する契約（下記（4））をご参照ください。）に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付けを中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

#### （2）募集取扱いの単位

販売会社が定める単位とします。

ただし、分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。

詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、後記「2 換金（解約）手続等」に記載の照会先までお問い合わせください。

#### （3）販売価額

取得申込受付日の基準価額に、前記「第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金（1）申込手数料」に記載する申込手数料及び当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額とします。

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の販売価額は、原則として、後記「3 資産管理等の概要（4）計算期間」に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

#### （4）その他

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。このため販売会社は総合約款を取得申込者に交付し、取得申込者は総合約款に基づく取引口座の設定を申込む旨の申込書を提出していただきます。

当ファンドは、収益分配がなされた場合、税金を差引いた後自動的に無手数料で再投資がなされる「自動けいぞく投資」専用ファンドです。このため受益権の取得申込者は、申込みの際に販売会社との間で、自動けいぞく約款に従い分配金から税金を差引いた後に自動的に無手数料で再投資される、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

受益権取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

### 2【換金（解約）手続等】

（1）受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し1口単位の整数倍をもって一部解約の実行を請求することができます。

（注）一部解約の実行の請求の受付けは、営業日の午後2時までとさせていただきます。なお、当該時

間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

- (2) 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- (3) 委託会社は、一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。  
なお、一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。
- (4) 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。  
解約価額は委託会社の営業日において日々算出され、日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.cmam.co.jp/>）でご覧いただけます。  
なお、受益者の手取額は、当該解約価額から税額を差引いた金額となります。  
販売会社の詳細につきましては、以下の照会先にお問い合わせください。  
(照会先)  
中央三井アセットマネジメント株式会社  
・お問い合わせ窓口  
電 話：0120-668001（フリーダイヤル）  
03-5440-0190  
受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで  
・ホームページ アドレス：<http://www.cmam.co.jp/>
- (5) 委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、上記(1)による一部解約の実行の請求の受付を中止することができます。
- (6) 上記(5)により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして上記(4)の規定に準じて計算された価額とします。
- (7) 一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払います。
- (8) 解約に係る手数料については、徴収しません。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額

信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出され、日々の基準価額は、販売会社へお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします（販売会社の詳細につきましては、前記「2 換金（解約）手続等」に記載の照会先までお問い合わせください。）。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.cmam.co.jp/>）でご覧いただけます。

当ファンドの主たる投資対象としている資産及び基準価額に与える影響が大きいと想定される資産の評価方法

##### A．親投資信託受益証券（中央三井日本債券マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

##### B．公社債等

計算日における次のイ．からハ．までに掲げるいずれかの価額で評価します。

イ．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ．金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

ハ．価格情報会社の提供する価額

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

当ファンドの信託期間は、信託契約締結日（平成13年1月23日）から無期限とします。ただし、委託会社は、下記（5）の事項に該当することとなった場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

#### (4)【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年1月23日から翌年1月22日までとすることを原則とします。

上記の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、上記（3）に定める信託期間の終了日とします。

#### (5)【その他】

##### 信託の終了

この信託契約を解約し信託を終了させる場合は下記のとおりです。

##### A．委託会社の所定の手続きを経て信託を終了させる場合

イ．受益権の口数が5億口を下回った場合

委託会社は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合は、受託会社と協議のうえ、あらかじめ、監督官庁に届け出ることにより、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

ロ．受益者に有利な場合又はやむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようと

する旨を監督官庁に届け出ます。

#### 八．所定の手続き

- a．委託会社は、上記イ．及びロ．の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- b．上記a．の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- c．上記b．の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記イ．及びロ．の信託契約の解約をしません。
- d．委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- e．上記b．からd．までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b．の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

#### B．監督官庁の命令

- イ．委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。
- ロ．委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款の変更をしようとするときは、下記 の規定に従います。

#### C．委託会社の登録取消等に伴う取扱い

- イ．委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ロ．上記イ．の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、当ファンドは、下記 D．に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

#### D．受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い

- イ．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、下記 の規定に従い、新受託会社を選任します。
- ロ．委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 委託会社の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い

- A．委託会社は、事業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。
- B．委託会社は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

#### 信託約款の変更

- A．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。
- B．委託会社は、上記A．の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- C．上記B．の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を

述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

- D．上記C．の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記A．の信託約款の変更をしません。
- E．委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

#### 反対者の買取り請求権

信託契約の解約又は信託約款の変更を行う場合において、一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、販売会社を経由して受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

#### 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 信託財産の管理

##### A．保管業務の委任

受託会社は、委託会社と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

##### B．有価証券の保管

受託会社は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

##### C．混蔵寄託

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者及び外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下C．において同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

##### D．信託財産の登記等及び記載等の留保等

イ．信託の登記又は登録をすることができる信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

ロ．上記イ．ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは速やかに登記又は登録をするものとします。

ハ．信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載又は記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

ニ．動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

#### 運用報告書

委託会社は、計算期間の終了毎に、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況等を記載した運用報告書を作成のうえ、販売会社を通じて、知っている受益者に対して交付します。

#### 関係法人との契約の更改等に関する手続き、変更した場合の開示方法

- A．委託会社が販売会社と締結している「投資信託受益権の取扱に関する契約」の有効期間は、有効期間満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。
- B．上記A．の契約を変更した場合には、有価証券報告書等においてその内容を開示します。

#### 信託事務処理の再委託

受託会社は、当ファンドに係る信託事務の処理の一部について、日本トラスティ・サービス信託銀行

株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次のとおりです。

##### (1) 収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付されます。

販売会社は分配金再投資に関する契約に基づき、毎計算期間終了日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に対し、遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。ただし、信託契約の一部解約が行われた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日から当該受益権に係る受益者に支払います。

##### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了日（償還日）後1ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日）から起算して5営業日までの日）から、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に対する支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が、信託終了による償還金については、上記に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

##### (3) 一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、1口単位の整数倍をもって一部解約の実行を請求することができます。

一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から当該受益者に支払います。

一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

##### (4) 投資信託約款等重要事項変更時の反対者の買取請求権

前記「3 資産管理等の概要 (5) その他 反対者の買取請求権」をご参照ください。

##### (5) 受益権均等分割

受益者は、自己に帰属する受益権の口数に応じて均等に当ファンドの受益権を保有します。

##### (6) 帳簿閲覧権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧を請求することができます。

### 第3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。

ただし、第9期計算期間（平成21年1月23日から平成22年1月22日まで）の財務諸表については、改正前の財務諸表等規則並びに投資信託財産計算規則に基づき、第10期計算期間（平成22年1月23日から平成23年1月24日まで）の財務諸表については、改正後の財務諸表等規則並びに投資信託財産計算規則に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間（平成21年1月23日から平成22年1月22日まで）及び第10期計算期間（平成22年1月23日から平成23年1月24日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

## 1【財務諸表】

中央三井日本債券インデックスファンド

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (平成22年1月22日現在)	第10期 (平成23年1月24日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	5,976,498,763	8,654,165,316
未収入金	1,626,610	54,593,594
流動資産合計	5,978,125,373	8,708,758,910
資産合計	5,978,125,373	8,708,758,910
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,626,610	54,593,594
未払受託者報酬	1,562,654	2,027,552
未払委託者報酬	14,063,846	18,247,936
流動負債合計	17,253,110	74,869,082
負債合計	17,253,110	74,869,082
純資産の部		
元本等		
元本	5,454,287,900	7,795,395,912
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	506,584,363	838,493,916
純資産合計	5,960,872,263	8,633,889,828
負債純資産合計	5,978,125,373	8,708,758,910

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第9期 (自平成21年1月23日 至平成22年1月22日)	第10期 (自平成22年1月23日 至平成23年1月24日)
営業収益		
有価証券売買等損益	86,376,375	96,276,959
営業収益合計	86,376,375	96,276,959
営業費用		
受託者報酬	2,916,146	3,669,459
委託者報酬	26,245,244	33,025,053
営業費用合計	29,161,390	36,694,512
営業利益	57,214,985	59,582,447
経常利益	57,214,985	59,582,447
当期純利益	57,214,985	59,582,447
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	738,301	35,241,403
期首剰余金又は期首欠損金( )	182,568,043	506,584,363
剰余金増加額又は欠損金減少額	300,979,748	595,591,283
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	300,979,748	595,591,283
剰余金減少額又は欠損金増加額	33,440,112	288,022,774
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	33,440,112	288,022,774
期末剰余金又は期末欠損金( )	506,584,363	838,493,916

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第 9 期 自 平成21年 1月23日 至 平成22年 1月22日	第 10 期 自 平成22年 1月23日 至 平成23年 1月24日
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、法令及び 社団法人投資信託協会規則に従 い、基準価額で評価してありま す。	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 当ファンドの計算期間は、原則 として、毎年 1月23日から翌年 1 月22日までとなっておりますが、 当計算期間末日が休業日のため、 第10期計算期間は平成22年 1月 23日から平成23年 1月24日まで となっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第 9 期 (平成22年 1月22日現在)	第 10 期 (平成23年 1月24日現在)
1. 当該計算期間の末日における 受益権総数	5,454,287,900 口	7,795,395,912 口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0929 円 (10,929 円)	1.1076 円 (11,076 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

## 1. 分配金の計算過程

		第 9 期 自 平成21年 1月23日 至 平成22年 1月22日	第 10 期 自 平成22年 1月23日 至 平成23年 1月24日
費用控除後の配当等収益額	A	53,394,638 円 (80,966,732 円)	60,164,163 円 (96,858,675 円)
費用控除後・繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益額	B	3,082,046 円	円
収益調整金額	C	417,871,799 円	708,272,768 円
分配準備積立金額	D	72,664,132 円	81,919,589 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	547,012,615 円	850,356,520 円
当ファンドの期末残存口数	F	5,454,287,900 口	7,795,395,912 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,002.90 円	1,090.84 円
10,000口当たり分配金額	H	円	円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	円	円

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

	第 9 期 自 平成21年 1月23日 至 平成22年 1月22日	第 10 期 自 平成22年 1月23日 至 平成23年 1月24日
2. 剰余金増加額・減少額	「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期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。	「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期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)

1. 金融商品の状況に関する事項

第 9 期 自 平成21年 1月23日 至 平成22年 1月22日	第 10 期 自 平成22年 1月23日 至 平成23年 1月24日
	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク等に晒されております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、運用セクションから組織的に独立した業務管理室が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。</p> <p>また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

第 9 期 (平成22年 1月22日現在)	第 10 期 (平成23年 1月24日現在)
	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。</p>

## (関連当事者との取引に関する注記)

第 9 期 自 平成21年 1月23日 至 平成22年 1月22日	第 10 期 自 平成22年 1月23日 至 平成23年 1月24日
該当事項はありません。	同左

## (重要な後発事象に関する注記)

第 9 期 自 平成21年 1月23日 至 平成22年 1月22日	第 10 期 自 平成22年 1月23日 至 平成23年 1月24日
該当事項はありません。	同左

## (その他の注記)

## 1. 本書における開示対象ファンドの当該計算期間における元本額の変動

	第 9 期 自 平成21年 1月23日 至 平成22年 1月22日	第 10 期 自 平成22年 1月23日 至 平成23年 1月24日
期首元本額	2,187,470,488 円	5,454,287,900 円

期中追加設定元本額	3,677,464,349 円	5,301,638,239 円
期中一部解約元本額	410,646,937 円	2,960,530,227 円

## 2. 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第 9 期 (平成22年 1月22日現在)	
	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間(自平成21年 1月23日 至平成22年 1月22日)の損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	5,976,498,763	117,782,368
合計	5,976,498,763	117,782,368

種類	第 10 期 (平成23年 1月24日現在)	
	最終の計算期間(自平成22年 1月23日 至平成23年 1月24日)の損益に含まれた 評価差額(円)	
親投資信託受益証券		90,655,215
合計		90,655,215

## 3. デリバティブ取引関係

第 9 期 自平成21年 1月23日 至平成22年 1月22日
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。

第 10 期 (平成23年 1月24日現在)
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。

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## A. 株式

該当事項はありません。

## B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託 受益証券	中央三井日本債券マザーファンド	7,408,753,802	8,654,165,316	
合計		7,408,753,802	8,654,165,316	

## 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

## &lt; 参考 &gt;

「中央三井日本債券インデックスファンド」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、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23年1月24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23年1月24日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,129,593,099
国債証券	260,504,036,300
地方債証券	22,510,646,359
特殊債券	36,673,537,252
社債券	27,277,084,000
未収利息	1,128,837,246
前払金	2,880,000
前払費用	46,765,609
流動資産合計	352,273,379,865
資産合計	352,273,379,865
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,114,990
未払解約金	243,087,479
流動負債合計	248,202,469
負債合計	248,202,469
純資産の部	
元本等	
元本	301,364,840,277
剰余金	
剰余金	50,660,337,119
純資産合計	352,025,177,396
負債・純資産合計	352,273,379,865

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成23年1月24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、最初の利払日までには個別法）に基づき、時価で評価しております。  時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2．デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>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23年 1月24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 52,042,000 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	301,364,840,277 口
3．1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	<p style="text-align: right;">1.1681 円</p> <p style="text-align: right;">( 11,681 円 )</p>

## (金融商品に関する注記)

## 1．金融商品の状況に関する事項

平成23年 1月24日現在	
1．金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>

## 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスク、信用リスク及び流動性リスク等に晒されております。

また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、運用セクションから組織的に独立した業務管理室が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。

また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23年1月24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

「（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。

### 4. 金銭債権の計算日後の償還予定額

金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

平成23年1月24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23年 1月24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23年 1月24日現在	
計算期間の期首元本額	258,903,109,890 円
計算期間中の追加設定元本額	90,839,668,100 円
計算期間中の一部解約元本額	48,377,937,713 円
計算日の元本額	301,364,840,277 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	7,408,753,802 円
中央三井DC日本債券インデックスファンド	1,986,329,955 円
中央三井DC日本債券インデックスファンドL	16,500,576,631 円
中央三井DCバランスファンド30	615,152,440 円
中央三井DCバランスファンド50	646,353,173 円
中央三井DCバランスファンド70	181,665,348 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	227,655,216 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	141,634,659 円
中央三井日本債券インデックスファンド(SMA専用)	3,789,982,488 円
新生・4分散ファンド	165,312,179 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	56,090,444 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	177,328,597 円
日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)	345,251,087 円
CMAAM日本債券インデックスe	145,850,738 円
中央三井インデックスコレクション(国内債券)	844,739 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式30)	506,845 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式50)	337,897 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式70)	211,187 円
中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)	10,925,575,346 円
中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)	35,974,442,961 円
中央三井VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	31,345,499,441 円
中央三井VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	1,668,159,162 円
中央三井VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	8,087,561,293 円
中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)	11,707,195,927 円
中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,748,294,250 円
中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)	28,203,091,292 円
中央三井バランスVA75(適格機関投資家専用)	247,296,482 円
中央三井VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	32,902,934,761 円
中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	7,833,527,459 円
中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	702,131,534 円
中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)	3,575,218,406 円
中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	1,939,580,270 円
CMAAM・バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	5,132,941,552 円
中央三井VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	1,159,040,619 円

CMAM・VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	2,019,366,232 円
中央三井バランスVA20(適格機関投資家専用)	5,090,477,559 円
中央三井VAファンド25(適格機関投資家専用)	4,632,905,775 円
CMAM・バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	6,664,714,142 円
中央三井バランスVA20L(適格機関投資家専用)	645,527,395 円
中央三井バランスVA25L(適格機関投資家専用)	4,472,724,384 円
CMAM・バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	21,344,686,084 円
中央三井世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	1,239,420,714 円
中央三井国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	346,163,996 円
中央三井国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	154,123,537 円
CMAM・VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	528,813,837 円
私募日本債券インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	10,030,761 円
CMAM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)	37,650,273,118 円
中央三井世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	23,284,563 円

## 2. 有価証券関係

### 売買目的有価証券

種類	平成23年1月24日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	128,607,500
地方債証券	23,865,102
特殊債券	54,299,009
社債券	37,374,000
合計	244,145,611

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「中央三井日本債券マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成22年1月23日から平成23年1月24日まで)に対応するものです。

## 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23年1月24日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	2,378,484,990		2,373,370,000	5,114,990
	合計	2,378,484,990		2,373,370,000	5,114,990

### (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23年1月24日現在
該当事項はありません。

[次へ](#)

## (3) 附属明細表（平成23年1月24日現在）

## 有価証券明細表

## A. 株式

該当事項はありません。

## B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債 証券	利付国庫債券（2年）第289回	1,600,000,000	1,600,912,000	
	利付国庫債券（2年）第290回	2,400,000,000	2,401,344,000	
	利付国庫債券（2年）第291回	2,300,000,000	2,301,242,000	
	利付国庫債券（2年）第292回	1,700,000,000	1,700,867,000	
	利付国庫債券（2年）第293回	800,000,000	800,440,000	
	利付国庫債券（2年）第294回	1,600,000,000	1,600,816,000	
	利付国庫債券（2年）第295回	1,200,000,000	1,200,552,000	
	利付国庫債券（2年）第296回	2,800,000,000	2,796,556,000	
	利付国庫債券（2年）第297回	1,300,000,000	1,298,219,000	
	利付国庫債券（2年）第298回	2,700,000,000	2,695,869,000	
	利付国庫債券（2年）第299回	600,000,000	600,168,000	
	利付国庫債券（5年）第63回	2,800,000,000	2,833,516,000	
	利付国庫債券（5年）第64回	2,200,000,000	2,241,008,000	
	利付国庫債券（5年）第65回	1,400,000,000	1,424,052,000	
	利付国庫債券（5年）第66回	1,500,000,000	1,522,770,000	
	利付国庫債券（5年）第67回	1,800,000,000	1,833,246,000	
	利付国庫債券（5年）第68回	1,100,000,000	1,118,909,000	
	利付国庫債券（5年）第69回	2,400,000,000	2,432,184,000	
	利付国庫債券（5年）第70回	1,700,000,000	1,721,930,000	
	利付国庫債券（5年）第71回	2,100,000,000	2,149,497,000	
	利付国庫債券（5年）第72回	1,200,000,000	1,236,732,000	
	利付国庫債券（5年）第73回	1,200,000,000	1,231,008,000	
	利付国庫債券（5年）第74回	2,600,000,000	2,648,620,000	
	利付国庫債券（5年）第75回	600,000,000	613,650,000	
	利付国庫債券（5年）第76回	1,800,000,000	1,845,684,000	
	利付国庫債券（5年）第77回	2,000,000,000	2,040,240,000	
	利付国庫債券（5年）第78回	700,000,000	712,873,000	
	利付国庫債券（5年）第79回	1,100,000,000	1,113,904,000	
	利付国庫債券（5年）第80回	1,300,000,000	1,320,176,000	
	利付国庫債券（5年）第81回	2,000,000,000	2,031,440,000	
	利付国庫債券（5年）第82回	2,100,000,000	2,139,879,000	
	利付国庫債券（5年）第83回	2,000,000,000	2,038,600,000	
	利付国庫債券（5年）第84回	2,000,000,000	2,024,840,000	
	利付国庫債券（5年）第85回	2,100,000,000	2,125,305,000	
	利付国庫債券（5年）第86回	4,400,000,000	4,437,180,000	
	利付国庫債券（5年）第87回	3,800,000,000	3,814,554,000	
	利付国庫債券（5年）第88回	4,500,000,000	4,513,725,000	
	利付国庫債券（5年）第89回	2,400,000,000	2,394,816,000	
	利付国庫債券（5年）第90回	3,700,000,000	3,676,061,000	
	利付国庫債券（5年）第91回	1,800,000,000	1,793,862,000	
	利付国庫債券（5年）第92回	2,000,000,000	1,984,080,000	
	利付国庫債券（5年）第93回	1,600,000,000	1,600,368,000	
利付国庫債券（40年）第1回	400,000,000	420,216,000		
利付国庫債券（40年）第2回	600,000,000	600,000,000		
利付国庫債券（40年）第3回	500,000,000	500,000,000		

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債 証券	利付国庫債券（10年）第237回	1,120,000,000	1,137,304,000	
	利付国庫債券（10年）第238回	1,190,000,000	1,207,028,900	

利付国庫債券(10年)第239回	910,000,000	925,633,800	
利付国庫債券(10年)第240回	1,570,000,000	1,594,790,300	
利付国庫債券(10年)第241回	750,000,000	763,852,500	
利付国庫債券(10年)第242回	730,000,000	742,278,600	
利付国庫債券(10年)第243回	1,020,000,000	1,035,483,600	
利付国庫債券(10年)第244回	930,000,000	944,229,000	
利付国庫債券(10年)第245回	1,030,000,000	1,043,812,300	
利付国庫債券(10年)第246回	680,000,000	687,833,600	
利付国庫債券(10年)第247回	910,000,000	921,739,000	
利付国庫債券(10年)第248回	170,000,000	171,830,900	
利付国庫債券(10年)第249回	760,000,000	766,566,400	
利付国庫債券(10年)第250回	600,000,000	604,068,000	
利付国庫債券(10年)第251回	770,000,000	782,558,700	
利付国庫債券(10年)第252回	730,000,000	743,651,000	
利付国庫債券(10年)第253回	1,350,000,000	1,398,465,000	
利付国庫債券(10年)第254回	520,000,000	535,932,800	
利付国庫債券(10年)第255回	710,000,000	733,621,700	
利付国庫債券(10年)第256回	1,040,000,000	1,074,070,400	
利付国庫債券(10年)第257回	1,100,000,000	1,132,879,000	
利付国庫債券(10年)第258回	480,000,000	495,019,200	
利付国庫債券(10年)第259回	1,180,000,000	1,224,261,800	
利付国庫債券(10年)第260回	860,000,000	896,808,000	
利付国庫債券(10年)第261回	790,000,000	829,120,800	
利付国庫債券(10年)第262回	730,000,000	768,602,400	
利付国庫債券(10年)第263回	750,000,000	783,330,000	
利付国庫債券(10年)第264回	730,000,000	759,813,200	(注)
利付国庫債券(10年)第265回	730,000,000	761,090,700	
利付国庫債券(10年)第266回	560,000,000	581,593,600	
利付国庫債券(10年)第267回	410,000,000	424,317,200	
利付国庫債券(10年)第268回	900,000,000	939,573,000	
利付国庫債券(10年)第269回	1,740,000,000	1,802,344,200	
利付国庫債券(10年)第270回	700,000,000	725,949,000	
利付国庫債券(10年)第271回	1,400,000,000	1,445,864,000	
利付国庫債券(10年)第272回	1,500,000,000	1,563,780,000	
利付国庫債券(10年)第273回	1,000,000,000	1,047,070,000	
利付国庫債券(10年)第274回	900,000,000	943,686,000	
利付国庫債券(10年)第275回	1,200,000,000	1,252,500,000	
利付国庫債券(10年)第276回	800,000,000	842,656,000	
利付国庫債券(10年)第277回	1,600,000,000	1,687,392,000	
利付国庫債券(10年)第278回	700,000,000	745,248,000	
利付国庫債券(10年)第279回	700,000,000	752,451,000	
利付国庫債券(10年)第280回	1,500,000,000	1,607,340,000	
利付国庫債券(10年)第281回	1,000,000,000	1,076,810,000	
利付国庫債券(10年)第282回	1,500,000,000	1,592,715,000	
利付国庫債券(10年)第283回	1,400,000,000	1,494,192,000	
利付国庫債券(10年)第284回	3,150,000,000	3,346,339,500	
利付国庫債券(10年)第285回	2,900,000,000	3,081,656,000	
利付国庫債券(10年)第286回	1,700,000,000	1,816,671,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	利付国庫債券(10年)第287回	1,200,000,000	1,289,712,000	
	利付国庫債券(10年)第288回	4,500,000,000	4,778,190,000	
	利付国庫債券(10年)第289回	3,100,000,000	3,247,095,000	
	利付国庫債券(10年)第290回	1,400,000,000	1,454,782,000	
	利付国庫債券(10年)第291回	1,200,000,000	1,238,856,000	
	利付国庫債券(10年)第292回	600,000,000	636,054,000	

利付国庫債券(10年)第293回	600,000,000	639,654,000	
利付国庫債券(10年)第294回	1,300,000,000	1,376,388,000	
利付国庫債券(10年)第295回	800,000,000	835,592,000	
利付国庫債券(10年)第296回	2,500,000,000	2,606,375,000	
利付国庫債券(10年)第297回	1,200,000,000	1,240,116,000	
利付国庫債券(10年)第298回	1,600,000,000	1,641,120,000	
利付国庫債券(10年)第299回	1,500,000,000	1,535,610,000	
利付国庫債券(10年)第300回	1,500,000,000	1,558,815,000	
利付国庫債券(10年)第301回	900,000,000	933,399,000	
利付国庫債券(10年)第302回	2,400,000,000	2,469,552,000	
利付国庫債券(10年)第303回	2,500,000,000	2,567,325,000	
利付国庫債券(10年)第304回	1,000,000,000	1,018,600,000	
利付国庫債券(10年)第305回	3,300,000,000	3,352,107,000	
利付国庫債券(10年)第306回	2,400,000,000	2,453,688,000	
利付国庫債券(10年)第307回	1,300,000,000	1,317,758,000	
利付国庫債券(10年)第308回	1,000,000,000	1,011,000,000	
利付国庫債券(10年)第309回	2,700,000,000	2,681,721,000	
利付国庫債券(10年)第310回	1,300,000,000	1,275,859,000	
利付国庫債券(10年)第311回	2,000,000,000	1,926,660,000	
利付国庫債券(10年)第312回	2,200,000,000	2,194,170,000	
利付国庫債券(30年)第1回	50,000,000	56,585,000	
利付国庫債券(30年)第2回	100,000,000	106,624,000	
利付国庫債券(30年)第3回	330,000,000	346,688,100	
利付国庫債券(30年)第4回	190,000,000	217,975,600	
利付国庫債券(30年)第5回	180,000,000	185,466,600	
利付国庫債券(30年)第6回	170,000,000	180,523,000	
利付国庫債券(30年)第7回	190,000,000	198,515,800	
利付国庫債券(30年)第8回	270,000,000	257,685,300	
利付国庫債券(30年)第9回	180,000,000	159,071,400	
利付国庫債券(30年)第10回	170,000,000	141,210,500	
利付国庫債券(30年)第11回	210,000,000	196,457,100	
利付国庫債券(30年)第12回	370,000,000	372,282,900	
利付国庫債券(30年)第13回	350,000,000	345,656,500	
利付国庫債券(30年)第14回	350,000,000	370,681,500	
利付国庫債券(30年)第15回	340,000,000	365,925,000	
利付国庫債券(30年)第16回	250,000,000	269,417,500	
利付国庫債券(30年)第17回	230,000,000	243,496,400	
利付国庫債券(30年)第18回	160,000,000	166,190,400	
利付国庫債券(30年)第19回	370,000,000	384,415,200	
利付国庫債券(30年)第20回	140,000,000	150,808,000	
利付国庫債券(30年)第21回	720,000,000	747,820,800	
利付国庫債券(30年)第22回	300,000,000	323,202,000	
利付国庫債券(30年)第23回	200,000,000	215,390,000	
利付国庫債券(30年)第24回	200,000,000	215,490,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債 証券	利付国庫債券(30年)第25回	900,000,000	934,893,000	
	利付国庫債券(30年)第26回	1,000,000,000	1,057,770,000	
	利付国庫債券(30年)第27回	700,000,000	754,929,000	
	利付国庫債券(30年)第28回	900,000,000	970,623,000	
	利付国庫債券(30年)第29回	900,000,000	952,218,000	
	利付国庫債券(30年)第30回	1,100,000,000	1,140,931,000	
	利付国庫債券(30年)第31回	1,300,000,000	1,320,878,000	
	利付国庫債券(30年)第32回	1,300,000,000	1,348,217,000	
	利付国庫債券(30年)第33回	1,200,000,000	1,166,352,000	
	利付国庫債券(20年)第18回	100,000,000	107,026,000	

利付国庫債券(20年)第19回	150,000,000	164,112,000	
利付国庫債券(20年)第20回	70,000,000	76,240,500	
利付国庫債券(20年)第21回	40,000,000	44,702,800	
利付国庫債券(20年)第22回	170,000,000	188,535,100	
利付国庫債券(20年)第23回	130,000,000	148,002,400	
利付国庫債券(20年)第24回	160,000,000	182,000,000	
利付国庫債券(20年)第25回	80,000,000	89,519,200	
利付国庫債券(20年)第26回	50,000,000	57,440,500	
利付国庫債券(20年)第27回	410,000,000	478,486,400	
利付国庫債券(20年)第28回	110,000,000	130,618,400	
利付国庫債券(20年)第29回	100,000,000	117,104,000	
利付国庫債券(20年)第30回	200,000,000	229,600,000	
利付国庫債券(20年)第31回	280,000,000	322,378,000	
利付国庫債券(20年)第32回	80,000,000	92,887,200	
利付国庫債券(20年)第33回	430,000,000	507,228,000	
利付国庫債券(20年)第34回	70,000,000	82,098,800	
利付国庫債券(20年)第35回	270,000,000	313,650,900	
利付国庫債券(20年)第37回	410,000,000	472,192,900	
利付国庫債券(20年)第39回	640,000,000	717,830,400	
利付国庫債券(20年)第40回	450,000,000	496,134,000	
利付国庫債券(20年)第41回	620,000,000	644,552,000	
利付国庫債券(20年)第42回	380,000,000	427,545,600	
利付国庫債券(20年)第43回	340,000,000	390,942,200	
利付国庫債券(20年)第44回	370,000,000	413,371,400	
利付国庫債券(20年)第45回	470,000,000	521,187,700	
利付国庫債券(20年)第46回	290,000,000	316,500,200	
利付国庫債券(20年)第47回	470,000,000	512,638,400	
利付国庫債券(20年)第48回	230,000,000	257,363,100	
利付国庫債券(20年)第49回	280,000,000	302,932,000	
利付国庫債券(20年)第50回	690,000,000	733,690,800	
利付国庫債券(20年)第51回	340,000,000	364,636,400	
利付国庫債券(20年)第52回	430,000,000	465,002,000	
利付国庫債券(20年)第53回	250,000,000	270,117,500	
利付国庫債券(20年)第54回	280,000,000	305,359,600	
利付国庫債券(20年)第55回	590,000,000	630,816,200	
利付国庫債券(20年)第56回	410,000,000	437,830,800	
利付国庫債券(20年)第57回	260,000,000	275,072,200	
利付国庫債券(20年)第58回	550,000,000	580,734,000	
利付国庫債券(20年)第59回	440,000,000	454,383,600	
利付国庫債券(20年)第60回	370,000,000	370,188,700	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	利付国庫債券(20年)第61回	190,000,000	180,984,500	
	利付国庫債券(20年)第62回	250,000,000	231,587,500	
	利付国庫債券(20年)第63回	970,000,000	1,008,315,000	
	利付国庫債券(20年)第64回	310,000,000	325,081,500	
	利付国庫債券(20年)第65回	370,000,000	387,245,700	
	利付国庫債券(20年)第66回	640,000,000	662,176,000	
	利付国庫債券(20年)第67回	460,000,000	480,460,800	
	利付国庫債券(20年)第68回	230,000,000	248,492,000	
	利付国庫債券(20年)第69回	260,000,000	277,734,600	
	利付国庫債券(20年)第70回	400,000,000	440,888,000	
	利付国庫債券(20年)第71回	1,100,000,000	1,186,537,000	
	利付国庫債券(20年)第72回	920,000,000	979,192,800	
	利付国庫債券(20年)第73回	340,000,000	356,677,000	
	利付国庫債券(20年)第74回	310,000,000	329,114,600	

利付国庫債券(20年)第75回	360,000,000	381,416,400	
利付国庫債券(20年)第76回	630,000,000	651,420,000	
利付国庫債券(20年)第77回	310,000,000	324,486,300	
利付国庫債券(20年)第78回	200,000,000	206,174,000	
利付国庫債券(20年)第79回	300,000,000	313,122,000	
利付国庫債券(20年)第80回	550,000,000	581,493,000	
利付国庫債券(20年)第81回	920,000,000	958,548,000	
利付国庫債券(20年)第82回	510,000,000	537,387,000	
利付国庫債券(20年)第83回	530,000,000	557,183,700	
利付国庫債券(20年)第84回	700,000,000	727,118,000	
利付国庫債券(20年)第85回	850,000,000	892,015,500	
利付国庫債券(20年)第86回	270,000,000	290,557,800	
利付国庫債券(20年)第87回	500,000,000	531,385,000	
利付国庫債券(20年)第88回	400,000,000	429,544,000	
利付国庫債券(20年)第89回	900,000,000	954,900,000	
利付国庫債券(20年)第90回	1,100,000,000	1,164,372,000	
利付国庫債券(20年)第91回	600,000,000	643,296,000	
利付国庫債券(20年)第92回	900,000,000	938,007,000	
利付国庫債券(20年)第93回	900,000,000	923,085,000	
利付国庫債券(20年)第94回	700,000,000	727,629,000	
利付国庫債券(20年)第95回	600,000,000	639,186,000	
利付国庫債券(20年)第96回	400,000,000	414,928,000	
利付国庫債券(20年)第97回	700,000,000	734,447,000	
利付国庫債券(20年)第98回	1,000,000,000	1,035,110,000	
利付国庫債券(20年)第99回	1,200,000,000	1,238,616,000	
利付国庫債券(20年)第100回	1,200,000,000	1,253,844,000	
利付国庫債券(20年)第101回	400,000,000	429,468,000	
利付国庫債券(20年)第102回	500,000,000	536,185,000	
利付国庫債券(20年)第103回	400,000,000	423,128,000	
利付国庫債券(20年)第104回	900,000,000	925,344,000	
利付国庫債券(20年)第105回	900,000,000	923,787,000	
利付国庫債券(20年)第106回	300,000,000	312,513,000	
利付国庫債券(20年)第107回	500,000,000	512,670,000	
利付国庫債券(20年)第108回	1,300,000,000	1,293,942,000	
利付国庫債券(20年)第109回	700,000,000	695,303,000	
利付国庫債券(20年)第110回	800,000,000	818,824,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	利付国庫債券(20年)第111回	800,000,000	830,448,000	
	利付国庫債券(20年)第112回	1,100,000,000	1,123,859,000	
	利付国庫債券(20年)第113回	1,600,000,000	1,633,920,000	
	利付国庫債券(20年)第114回	1,100,000,000	1,121,230,000	
	利付国庫債券(20年)第115回	900,000,000	931,707,000	
	利付国庫債券(20年)第116回	600,000,000	620,472,000	
	利付国庫債券(20年)第117回	1,100,000,000	1,119,877,000	
	利付国庫債券(20年)第118回	1,200,000,000	1,200,828,000	
	利付国庫債券(20年)第119回	500,000,000	484,330,000	
	利付国庫債券(20年)第120回	600,000,000	562,140,000	
	利付国庫債券(20年)第121回	800,000,000	787,048,000	
	利付国庫債券(20年)第122回	1,300,000,000	1,258,881,000	
	利付国庫債券(20年)第123回	600,000,000	609,402,000	
国債証券 小計		253,160,000,000	260,504,036,300	
地方債証券	東京都公募公債第582回	100,000,000	101,403,000	
	東京都公募公債第586回	100,000,000	101,659,000	
	東京都公募公債第590回	100,000,000	101,844,000	
	東京都公募公債第598回	103,000,000	103,530,450	

東京都公募公債第602回	200,000,000	205,974,000	
東京都公募公債第605回	100,000,000	103,163,000	
東京都公募公債第608回	100,000,000	103,817,000	
東京都公募公債第609回	200,000,000	207,260,000	
東京都公募公債第613回	100,000,000	104,082,000	
東京都公募公債第616回	100,000,000	103,661,000	
東京都公募公債第617回	100,000,000	103,622,000	
東京都公募公債第619回	100,000,000	104,273,000	
東京都公募公債第624回	100,000,000	104,305,000	
東京都公募公債第626回	100,000,000	104,879,000	
東京都公募公債第627回	100,000,000	104,516,000	
東京都公募公債第628回	100,000,000	105,011,000	
東京都公募公債第637回	180,000,000	191,597,400	
東京都公募公債第642回	100,000,000	106,676,000	
東京都公募公債第646回	100,000,000	107,642,000	
東京都公募公債第647回	100,000,000	107,519,000	
東京都公募公債第656回	100,000,000	104,237,000	
東京都公募公債第657回	100,000,000	106,328,000	
東京都公募公債第659回	100,000,000	104,848,000	
東京都公募公債第668回	100,000,000	103,758,000	
東京都公募公債第681回	100,000,000	101,688,000	
東京都公募公債第682回	100,000,000	100,986,000	
東京都公募公債(20年)第3回	100,000,000	107,461,000	
東京都公募公債(20年)第11回	200,000,000	208,184,000	
東京都公募公債(20年)第18回	200,000,000	205,170,000	
東京都公募公債(20年)第20回	100,000,000	100,338,000	
東京都公募公債(20年)第21回	100,000,000	101,694,000	
北海道平成13年度第4回公募公債	100,000,000	101,279,000	
北海道平成17年度第1回公募公債	100,000,000	103,278,000	
北海道平成19年度第14回公募公債(10年)	100,000,000	104,608,000	
北海道平成20年度第14回公募公債	100,000,000	104,407,000	
北海道平成20年度第15回公募公債(5年)	100,000,000	102,302,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
地方債 証券	北海道平成21年度第6回公募公債	100,000,000	102,871,000	
	北海道平成22年度第1回公募公債	100,000,000	101,236,000	
	北海道平成14年度第1回公募公債	100,000,000	101,331,000	
	宮城県公募公債第28回1号	100,000,000	101,031,000	
	神奈川県第126回公募公債	100,000,000	103,609,000	
	神奈川県第127回公募公債	100,000,000	104,812,000	
	神奈川県第130回公募公債	100,000,000	103,620,000	
	神奈川県第134回公募公債	100,000,000	103,895,000	
	神奈川県第135回公募公債	100,000,000	104,918,000	
	神奈川県第143回公募公債	150,000,000	159,325,500	
	神奈川県第144回公募公債	100,000,000	106,558,000	
	神奈川県第162回公募公債	100,000,000	104,080,000	
	神奈川県第168回公募公債	100,000,000	101,526,000	
	神奈川県第173回公募公債	100,000,000	100,463,000	
	神奈川県第174回公募公債	100,000,000	99,326,000	
	神奈川県第175回公募公債	100,000,000	98,611,000	
	第250回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,613,000	
	第254回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,510,000	
	第267回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,734,000	
	第275回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,895,000	
	第285回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,075,000	
	第286回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,102,000	

第293回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,454,000	
第298回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,436,000	
第305回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,580,000	
第309回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,614,000	
第324回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,736,000	
第331回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,296,000	
第334回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,571,000	
第335回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,583,000	
第339回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,293,000	
第50回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	101,429,000	
京都府平成17年度第3回公募公債	100,000,000	104,541,000	
京都府平成20年度第6回公募公債	100,000,000	103,193,000	
京都府平成21年度第4回公募公債	100,000,000	100,441,000	
京都府平成21年度第5回公募公債	100,000,000	101,406,000	
兵庫県平成14年度第4回公募公債	100,000,000	101,281,000	
兵庫県平成16年度第10回公募公債	100,000,000	103,666,000	
兵庫県平成17年度第3回公募公債	100,000,000	103,065,000	
兵庫県平成18年度第3回公募公債	110,000,000	117,592,200	
兵庫県平成18年度第8回公募公債	100,000,000	107,549,000	
兵庫県平成18年度第10回公募公債	100,000,000	107,136,000	
兵庫県平成21年度第1回公募公債	100,000,000	103,642,000	
兵庫県平成21年度第35回公募公債	100,000,000	101,651,000	
静岡県平成15年度第3回公募公債	100,000,000	102,967,000	
静岡県平成17年度第7回公募公債	100,000,000	105,625,000	
静岡県平成19年度第4回公募公債	100,000,000	107,239,000	
静岡県平成19年度第7回公募公債	100,000,000	106,320,000	
静岡県平成21年度第5回公募公債	100,000,000	101,581,000	
静岡県平成22年度第3回公募公債	100,000,000	101,247,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
地方債 証券	愛知県平成18年度第4回公募公債(10年)	129,000,000	137,194,080	
	愛知県平成20年度第6回公募公債(10年)	100,000,000	105,162,000	
	愛知県平成20年度第10回公募公債(10年)	100,000,000	103,195,000	
	愛知県平成21年度第1回公募公債(10年)	100,000,000	104,122,000	
	愛知県平成22年度第1回公募公債(10年)	100,000,000	101,639,000	
	愛知県平成22年度第5回公募公債(10年)	100,000,000	100,068,000	
	広島県平成14年度第1回公募公債	100,000,000	101,730,000	
	広島県平成16年度第1回公募公債	100,000,000	103,225,000	
	広島県平成20年度第6回公募公債	100,000,000	103,116,000	
	埼玉県平成14年度第1回公募公債	100,000,000	101,458,000	
	埼玉県平成15年度第5回公募公債	100,000,000	103,146,000	
	埼玉県平成19年度第2回公募公債	100,000,000	107,200,000	
	埼玉県平成19年度第5回公募公債	100,000,000	106,322,000	
	埼玉県平成19年度第7回公募公債	100,000,000	105,175,000	
	埼玉県平成20年度第5回公募公債	100,000,000	105,306,000	
	埼玉県平成21年度第1回公募公債	200,000,000	207,020,000	
	埼玉県平成21年度第2回公募公債	100,000,000	103,758,000	
	埼玉県平成22年度第4回公募公債	100,000,000	99,195,000	
	福岡県平成14年度第3回公募公債	100,000,000	101,103,000	
	福岡県平成20年度第5回公募公債	100,000,000	104,901,000	
	福岡県平成21年度第5回公募公債	100,000,000	101,744,000	
	福岡県平成20年度第1回30年公募公債	200,000,000	198,790,000	
	千葉県平成15年度第1回公募公債	100,000,000	100,491,000	
	千葉県平成17年度第7回公募公債	100,000,000	104,524,000	
	千葉県平成18年度第6回公募公債	175,000,000	185,141,250	
	千葉県平成18年度第7回公募公債	100,000,000	106,420,000	

千葉県平成21年度第1回公募公債	100,000,000	103,512,000	
千葉県平成21年度第3回公募公債	100,000,000	104,240,000	
千葉県平成22年度第4回公募公債	100,000,000	99,237,000	
新潟県平成17年度第1回公募公債	100,000,000	103,277,000	
新潟県平成20年度第2回公募公債	100,000,000	103,313,000	
岐阜県平成18年度第1回公募公債	100,000,000	106,245,000	
第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,937,000	
第5回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,535,000	
第6回共同発行市場公募地方債	155,700,000	161,015,598	
第9回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,732,000	
第11回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,870,000	
第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,043,000	
第16回共同発行市場公募地方債	127,000,000	133,088,380	
第17回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,872,000	
第18回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,207,000	
第19回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,258,000	
第20回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,920,000	
第22回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,628,000	
第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,266,000	
第24回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,122,000	
第26回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,370,000	
第27回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,412,000	
第29回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,893,000	
第30回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,461,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
地方債 証券	第31回共同発行市場公募地方債	150,000,000	156,661,500	
	第34回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,062,000	
	第35回共同発行市場公募地方債	160,000,000	168,148,800	
	第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,289,000	
	第41回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,419,000	
	第43回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,346,000	
	第48回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,813,000	
	第53回共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,708,000	
	第54回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,662,000	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,730,000	
	第57回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,226,000	
	第63回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,625,000	
	第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,662,000	
	第67回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,632,000	
	第74回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,756,000	
	第75回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,240,000	
	第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,568,000	
	第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,007,000	
	第79回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,504,000	
	第80回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,081,000	
	第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,906,000	
	第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,005,000	
	第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,400,000	
	第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,869,000	
	第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,380,000	
	第88回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,237,000	
	静岡市平成18年度第1回公募公債	100,000,000	106,883,000	
	大阪市平成14年度第11回公募公債	100,000,000	100,914,000	
	大阪市平成16年度第5回公募公債	100,000,000	103,848,000	
	大阪市平成17年度第1回公募公債	100,000,000	102,919,000	

大阪市平成18年度第3回公募公債	200,000,000	214,614,000	
大阪市平成19年度第1回公募公債(5年)	100,000,000	101,431,000	
大阪市平成21年度第7回公募公債	100,000,000	101,406,000	
名古屋市第12回て号公募公債	100,000,000	101,827,000	
名古屋市第12回し号公募公債	100,000,000	104,116,000	
名古屋市第12回こ号公募公債	100,000,000	101,541,000	
名古屋市第12回ゆ号公募公債	100,000,000	103,219,000	
名古屋市第12回す号公募公債	100,000,000	105,616,000	
名古屋市第455回10年公募公債	186,700,000	199,401,201	
名古屋市第463回10年公募公債	100,000,000	107,344,000	
名古屋市第464回10年公募公債	100,000,000	104,522,000	
名古屋市第1回20年公募公債	100,000,000	104,390,000	
京都市平成19年度第2回公募公債	100,000,000	105,612,000	
京都市平成21年度第5回公募公債	100,000,000	101,836,000	
京都市第2回20年公募公債	100,000,000	104,009,000	
横浜市平成20年度第1回公募公債	100,000,000	106,527,000	
横浜市平成20年度第6回公募公債	100,000,000	103,495,000	
横浜市平成21年度第6回公募公債	100,000,000	101,526,000	
横浜市平成22年度第1回公募公債	100,000,000	101,088,000	
横浜市平成22年度第3回公募公債	100,000,000	99,041,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
地方債証券	横浜市平成15年度第2回公募公債	100,000,000	100,721,000	
	横浜市平成17年度第3回公募公債	100,000,000	104,842,000	
	横浜市第5回20年公募公債	100,000,000	105,133,000	
	横浜市第24回5年公募公債	100,000,000	102,099,000	
	札幌市平成14年度第3回公募公債	100,000,000	101,519,000	
	札幌市平成18年度第4回公募公債	100,000,000	106,273,000	
	第79回川崎市公募公債	100,000,000	106,630,000	
	北九州市平成14年度第2回公募公債	100,000,000	101,344,000	
	福岡市平成19年度第2回公募公債(5年)	100,000,000	101,940,000	
	福岡市平成19年度第3回公募公債	100,000,000	106,531,000	
	福岡市平成19年度第5回公募公債	100,000,000	103,799,000	
	福岡市平成20年度第5回公募公債	100,000,000	103,947,000	
	広島市平成17年度第1回公募公債	100,000,000	104,342,000	
	第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,105,000	
	20年第7回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,397,000	
	第12回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,087,000	
	地方債証券 小計		21,726,400,000	22,510,646,359
特殊債券	政府保証第6回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,193,000	
	政府保証第7回日本政策投資銀行債券	102,000,000	105,029,400	
	政府保証第8回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,935,000	
	政府保証第10回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,988,000	
	政府保証第15回日本政策投資銀行債券	210,000,000	223,391,700	
	政府保証第16回日本政策投資銀行債券	200,000,000	213,112,000	
	政府保証第21回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,967,000	
	第7回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,958,000	
	第13回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,622,000	
	第16回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,677,000	
	第19回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,449,000	
	第24回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,773,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,306,000	
	第41回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,409,000	
	第43回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,640,000	
	第47回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,560,000	
第16回道路債券	200,000,000	202,772,000		

政府保証第3 1 3 回道路債券	100,000,000	101,797,000	
政府保証第3 1 4 回道路債券	100,000,000	101,459,000	
政府保証第3 1 9 回道路債券	100,000,000	101,611,000	
政府保証第3 2 3 回道路債券	100,000,000	103,440,000	
政府保証第3 2 5 回道路債券	101,000,000	103,991,620	
政府保証第3 2 7 回道路債券	100,000,000	103,711,000	
政府保証第3 2 8 回道路債券	100,000,000	103,761,000	
政府保証第3 2 9 回道路債券	150,000,000	156,232,500	
政府保証第3 3 0 回道路債券	100,000,000	104,899,000	
政府保証第3 3 3 回道路債券	100,000,000	104,367,000	
政府保証第3 3 4 回道路債券	100,000,000	104,046,000	
政府保証第3 3 5 回道路債券	100,000,000	103,695,000	
政府保証第3 3 6 回道路債券	131,000,000	135,929,530	
政府保証第3 3 8 回道路債券	100,000,000	104,255,000	
政府保証第3 4 3 回道路債券	100,000,000	103,534,000	
政府保証第3 4 6 回道路債券	115,000,000	119,640,250	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
特殊 債券	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,679,000	
	第3回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,849,000	
	第6回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,897,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	160,837,500	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,186,000	
	第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,976,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,266,000	
	第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,153,000	
	第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,383,000	
	第35回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,651,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,951,000	
	第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,080,000	
	第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,892,000	
	第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,109,000	
	第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,447,000	
	第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,976,000	
	第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,325,000	
	第59回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,569,000	
	第61回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,330,000	
	政府保証第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,674,000	
	政府保証第10回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,729,000	
	政府保証第14回日本高速道路保有・債務返済機構債券	157,000,000	167,911,500	
	政府保証第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	108,625,500	
	政府保証第21回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,541,000	
	政府保証第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	133,211,250	
	政府保証第33回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,987,000	
	政府保証第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,001,000	
	政府保証第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	214,330,000	
	政府保証第43回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,426,000	
	政府保証第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,566,000	
	政府保証第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,374,000	
	政府保証第54回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,640,000	
	政府保証第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,570,000	
	政府保証第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,236,000	
	政府保証第62回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,517,000	
	政府保証第66回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,933,000	
	政府保証第67回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	209,248,000	
	政府保証第69回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,552,000	

政府保証第7 1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,016,000	
政府保証第7 5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,093,000	
政府保証第7 7回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,030,000	
政府保証第7 8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,444,000	
政府保証第8 0回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,423,000	
政府保証第8 6回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,799,000	
政府保証第8 9回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,499,000	
政府保証第9 1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,551,000	
政府保証第9 3回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,166,000	
政府保証第9 5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,398,000	
政府保証第9 8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,138,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
特殊 債券	政府保証第1 0 0回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,930,000	
	政府保証第1 0 3回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,988,000	
	政府保証第1 0 4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,751,000	
	政府保証第1 0 7回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,594,000	
	政府保証第1 1 0回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,720,000	
	政府保証第1 1 1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,241,000	
	第6回道路債券	100,000,000	101,949,000	
	第2 1回道路債券	100,000,000	107,063,000	
	第2 7回道路債券	100,000,000	108,496,000	
	第3 0回道路債券	100,000,000	104,150,000	
	第3 3回道路債券	100,000,000	109,863,000	
	第3 7回道路債券	100,000,000	103,963,000	
	第3 8回道路債券	100,000,000	106,195,000	
	第4 2回道路債券	100,000,000	105,271,000	
	政府保証第8 1 2回公営企業債券	100,000,000	101,441,000	
	政府保証第8 1 5回公営企業債券	100,000,000	101,587,000	
	政府保証第8 1 7回公営企業債券	100,000,000	101,636,000	
	政府保証第8 2 3回公営企業債券	100,000,000	101,141,000	
	政府保証第8 2 4回公営企業債券	100,000,000	101,175,000	
	政府保証第8 2 5回公営企業債券	100,000,000	101,216,000	
	政府保証第8 2 6回公営企業債券	200,000,000	202,006,000	
	政府保証第8 2 9回公営企業債券	100,000,000	102,057,000	
	政府保証第8 3 0回公営企業債券	100,000,000	101,598,000	
	政府保証第8 3 2回公営企業債券	100,000,000	103,040,000	
	政府保証第8 3 3回公営企業債券	100,000,000	103,375,000	
	政府保証第8 3 8回公営企業債券	100,000,000	103,694,000	
	政府保証第8 3 9回公営企業債券	100,000,000	103,755,000	
	政府保証第8 4 1回公営企業債券	100,000,000	104,902,000	
	政府保証第8 4 3回公営企業債券	100,000,000	103,951,000	
	政府保証第8 4 7回公営企業債券	100,000,000	103,761,000	
	政府保証第8 4 8回公営企業債券	100,000,000	103,389,000	
	政府保証第8 5 0回公営企業債券	100,000,000	103,865,000	
	政府保証第8 5 1回公営企業債券	100,000,000	103,501,000	
政府保証第8 5 2回公営企業債券	100,000,000	103,532,000		
政府保証第8 5 5回公営企業債券	100,000,000	103,588,000		
政府保証第8 5 7回公営企業債券	100,000,000	105,125,000		
政府保証第8 5 9回公営企業債券	100,000,000	104,727,000		
政府保証第8 6 0回公営企業債券	100,000,000	105,232,000		

政府保証第862回公営企業債券	100,000,000	106,335,000	
政府保証第864回公営企業債券	100,000,000	106,950,000	
政府保証第871回公営企業債券	100,000,000	106,583,000	
政府保証第874回公営企業債券	100,000,000	106,004,000	
政府保証第876回公営企業債券	200,000,000	214,446,000	
政府保証第877回公営企業債券	200,000,000	214,412,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
特殊 債券	政府保証第879回公営企業債券	200,000,000	211,702,000	
	政府保証第884回公営企業債券	100,000,000	103,566,000	
	政府保証第885回公営企業債券	100,000,000	105,603,000	
	政府保証第886回公営企業債券	100,000,000	106,278,000	
	政府保証15年第2回公営企業債券	100,000,000	107,604,000	
	政府保証第2回地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	209,146,000	
	第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,558,000	
	政府保証第3回地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	206,070,000	
	政府保証第4回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,181,000	
	第2回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,053,000	
	第3回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,264,000	
	20年第2回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,326,000	
	政府保証第8回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,419,000	
	第4回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,737,000	
	政府保証第3回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,247,000	
	政府保証第5回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,589,000	
	政府保証第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,200,000	
	政府保証第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,175,000	
	政府保証第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,027,000	
	政府保証第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,787,000	
	政府保証第13回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,758,000	
	政府保証第14回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,939,000	
	20年第5回公営企業債券	100,000,000	105,871,000	
	20年第9回公営企業債券	100,000,000	107,694,000	
	20年第11回公営企業債券	100,000,000	104,500,000	
	20年第15回公営企業債券	100,000,000	104,483,000	
	20年第17回公営企業債券	200,000,000	214,182,000	
	20年第24回公営企業債券	100,000,000	103,915,000	
	第5回公営企業債券	200,000,000	202,054,000	
	第6回公営企業債券	100,000,000	100,748,000	
	第12回公営企業債券	200,000,000	207,752,000	
	第13回公営企業債券	100,000,000	104,279,000	
	第17回公営企業債券	200,000,000	209,232,000	
	第19回公営企業債券	200,000,000	214,274,000	
	第23回公営企業債券	100,000,000	106,891,000	
	第24回公営企業債券	100,000,000	107,061,000	
	政府保証第187回首都高速道路債券	200,000,000	206,872,000	
	政府保証第189回首都高速道路債券	100,000,000	102,946,000	
	政府保証第190回首都高速道路債券	100,000,000	103,287,000	
	政府保証第197回首都高速道路債券	100,000,000	104,223,000	
	首都高速道路株式会社第5回社債	100,000,000	100,477,000	
	第9回首都高速道路債券	100,000,000	104,399,000	
	政府保証第144回阪神高速道路債券	100,000,000	104,206,000	
	政府保証第148回阪神高速道路債券	100,000,000	103,589,000	
	第6回阪神高速道路債券	100,000,000	103,732,000	
政府保証第165回中小企業債券	100,000,000	101,480,000		
政府保証第176回中小企業債券	100,000,000	103,468,000		
政府保証第178回中小企業債券	100,000,000	103,430,000		

政府保証第184回中小企業債券	100,000,000	103,675,000	
政府保証第187回中小企業債券	100,000,000	104,649,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
特殊 債券	政府保証第191回中小企業債券	200,000,000	211,684,000	
	株式会社日本政策金融公庫第7回社債(一般担保付)	100,000,000	100,355,000	
	政府保証第1回日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,236,000	
	政府保証第4回日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,334,000	
	第23回中小企業債券	100,000,000	102,217,000	
	第6回国際協力銀行債券	100,000,000	101,482,000	
	第8回国際協力銀行債券	100,000,000	100,702,000	
	第12回国際協力銀行債券	100,000,000	103,685,000	
	第15回国際協力銀行債券	100,000,000	104,340,000	
	第16回国際協力銀行債券	100,000,000	107,155,000	
	第19回国際協力銀行債券	100,000,000	103,489,000	
	第21回国際協力銀行債券	100,000,000	104,503,000	
	第25回国際協力銀行債券	100,000,000	107,081,000	
	第27回国際協力銀行債券	100,000,000	105,927,000	
	第29回国際協力銀行債券	100,000,000	105,857,000	
	政府保証第16回都市再生債券	100,000,000	100,730,000	
	第9回都市再生債券	100,000,000	101,168,000	
	第16回都市再生債券	100,000,000	105,267,000	
	第24回都市再生債券	100,000,000	105,645,000	
	第34回都市再生債券	100,000,000	100,928,000	
	第35回都市再生債券	100,000,000	100,242,000	
	第43回都市再生債券	100,000,000	98,941,000	
	第3回都市基盤整備債券	100,000,000	102,353,000	
	政府保証第27回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,023,000	
	第2回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,164,000	
	政府保証第140回預金保険機構債券	100,000,000	100,861,000	
	政府保証第143回預金保険機構債券	100,000,000	101,070,000	
	政府保証第147回預金保険機構債券	100,000,000	101,337,000	
	政府保証第153回預金保険機構債券	100,000,000	101,635,000	
	政府保証第174回預金保険機構債券	100,000,000	100,237,000	
	政府保証第177回預金保険機構債券	100,000,000	99,764,000	
	貸付債権担保第18回住宅金融公庫債券	52,470,000	53,669,464	
	貸付債権担保S種第1回住宅金融支援機構債券	122,594,000	126,699,673	
	貸付債権担保第1回住宅金融支援機構債券	378,645,000	393,737,789	
	貸付債権担保S種第2回住宅金融支援機構債券	62,688,000	65,491,407	
	貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	157,032,000	161,661,303	
	貸付債権担保S種第12回住宅金融支援機構債券	80,152,000	82,999,800	
	貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	87,496,000	92,121,038	
	貸付債権担保第26回住宅金融支援機構債券	87,216,000	90,603,469	
	貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券	254,223,000	261,488,693	
	貸付債権担保S種第18回住宅金融支援機構債券	85,303,000	86,951,053	
	貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	96,180,000	97,807,365	
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	196,346,000	193,689,438		
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	99,452,000	97,328,699		
貸付債権担保S種第1回住宅金融公庫債券	44,971,000	45,212,044		
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	139,782,000	142,969,029		
貸付債権担保S種第5回住宅金融公庫債券	50,541,000	51,376,948		
貸付債権担保S種第6回住宅金融公庫債券	54,627,000	57,132,740		
貸付債権担保S種第7回住宅金融公庫債券	220,956,000	230,616,196		
貸付債権担保S種第8回住宅金融公庫債券	56,515,000	58,710,042		

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
特殊 債券	貸付債権担保S種第9回住宅金融公庫債券	56,865,000	59,194,190	
	貸付債権担保S種第10回住宅金融公庫債券	58,155,000	60,462,008	
	貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券	39,003,000	40,011,227	
	貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券	86,722,000	86,830,402	
	貸付債権担保第11回住宅金融公庫債券	47,355,000	45,862,843	
	貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	49,391,000	50,013,820	
	貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	112,236,000	116,283,230	
	貸付債権担保第25回住宅金融公庫債券	59,031,000	59,682,702	
	貸付債権担保第28回住宅金融公庫債券	63,015,000	63,872,004	
	貸付債権担保第29回住宅金融公庫債券	199,725,000	202,814,745	
	貸付債権担保第31回住宅金融公庫債券	69,544,000	70,008,553	
	貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	211,899,000	213,282,700	
	貸付債権担保第34回住宅金融公庫債券	72,556,000	73,658,851	
	貸付債権担保第36回住宅金融公庫債券	70,817,000	72,294,242	
	貸付債権担保第37回住宅金融公庫債券	71,184,000	72,584,189	
	貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	215,121,000	218,334,907	
	貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	141,098,000	144,519,626	
	貸付債権担保第41回住宅金融公庫債券	73,000,000	75,430,170	
	貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	71,257,000	74,846,927	
	貸付債権担保第47回住宅金融公庫債券	70,981,000	73,639,948	
	貸付債権担保第51回住宅金融公庫債券	222,156,000	230,746,772	
	貸付債権担保第53回住宅金融公庫債券	75,397,000	77,705,656	
	政府保証第8回国民生活債券	200,000,000	202,390,000	
	政府保証第9回国民生活債券	200,000,000	204,088,000	
	政府保証第12回国民生活債券	100,000,000	103,301,000	
	政府保証第15回国民生活債券	100,000,000	104,209,000	
	政府保証第19回国民生活債券	125,000,000	132,460,000	
	政府保証第20回国民生活債券	100,000,000	103,559,000	
	第36回国民生活債券	200,000,000	203,452,000	
	第11回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	105,986,000	
	い第692号商工債	100,000,000	101,791,000	
	い第694号商工債	100,000,000	101,820,000	
	い第704号商工債	200,000,000	205,800,000	
	い第705号商工債	100,000,000	103,087,000	
	い第707号商工債	200,000,000	206,026,000	
	い第710号商工債	200,000,000	203,478,000	
	い第713号商工債	100,000,000	101,180,000	
	い第714号商工債	100,000,000	101,545,000	
	い第715号商工債	100,000,000	100,749,000	
	い第716号商工債	100,000,000	100,726,000	
	い第717号商工債	100,000,000	100,721,000	
	い第681号農林債	200,000,000	202,532,000	
い第685号農林債	100,000,000	101,806,000		
い第686号農林債	100,000,000	102,052,000		
い第687号農林債	200,000,000	204,176,000		
い第689号農林債	100,000,000	102,071,000		
い第695号農林債	100,000,000	101,786,000		
い第697号農林債	100,000,000	102,737,000		
い第701号農林債	100,000,000	102,898,000		
い第704号農林債	100,000,000	102,629,000		

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
特殊 債券	い第708号農林債	100,000,000	102,267,000	
	い第715号農林債	200,000,000	201,188,000	
	い第717号農林債	100,000,000	100,759,000	

い第718号農林債	100,000,000	100,529,000	
い第720号農林債	100,000,000	100,274,000	
い第721号農林債	100,000,000	100,042,000	
第208回信金中金債(5年)	100,000,000	101,243,000	
第212回信金中金債(5年)	200,000,000	204,134,000	
第213回信金中金債(5年)	200,000,000	204,208,000	
第219回信金中金債(5年)	100,000,000	101,849,000	
第222回信金中金債(5年)	100,000,000	102,493,000	
第223回信金中金債(5年)	100,000,000	102,811,000	
第224回信金中金債(5年)	100,000,000	102,766,000	
第225回信金中金債(5年)	100,000,000	102,450,000	
第228回信金中金債(5年)	100,000,000	103,051,000	
第230回信金中金債(5年)	200,000,000	205,144,000	
第231回信金中金債(5年)	100,000,000	102,902,000	
第234回信金中金債(5年)	100,000,000	102,367,000	
第237回信金中金債(5年)	100,000,000	101,870,000	
第238回信金中金債(5年)	100,000,000	101,334,000	
第243回信金中金債(5年)	100,000,000	100,680,000	
第110号商工債(3年)	100,000,000	101,068,000	
第112号商工債(3年)	200,000,000	201,580,000	
第122号商工債(3年)	100,000,000	100,095,000	
第124号商工債(3年)	100,000,000	100,069,000	
政府保証第5回東日本高速道路債券	100,000,000	107,564,000	
政府保証第8回中日本高速道路債券	100,000,000	107,518,000	
政府保証第10回中日本高速道路債券	172,000,000	183,188,600	
政府保証第20回中日本高速道路債券	100,000,000	103,596,000	
中日本高速道路株式会社第2回社債	100,000,000	104,070,000	
中日本高速道路株式会社第5回社債	100,000,000	105,738,000	
中日本高速道路株式会社第6回社債	100,000,000	104,655,000	
中日本高速道路株式会社第14回社債	100,000,000	100,173,000	
政府保証第3回西日本高速道路債券	100,000,000	106,505,000	
政府保証第20回西日本高速道路債券	100,000,000	102,411,000	
特殊債券 小計	35,502,697,000	36,673,537,252	
社債券			
フランス電力第1回円貨社債(2009)	100,000,000	102,892,000	
ジーディーエフ・スエズ第1回円貨社債(2009)	100,000,000	101,203,000	
第1回スウェーデン輸出信用銀行円貨債券(2009)	100,000,000	101,805,000	
第322回東京交通債券	100,000,000	113,400,000	
第323回東京交通債券	100,000,000	116,508,000	
第324回東京交通債券	100,000,000	115,478,000	
第344回東京交通債券	100,000,000	101,381,000	
一般担保第2回住宅金融支援機構債券	200,000,000	211,896,000	
一般担保第6回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,201,000	
一般担保第11回住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,735,000	
一般担保第14回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,022,000	
一般担保第17回住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,547,000	
一般担保第21回住宅金融支援機構債券	200,000,000	212,402,000	
一般担保第23回住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,411,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	一般担保第25回住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,218,000	
	一般担保第29回住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,807,000	
	一般担保第30回住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,319,000	
	一般担保第41回住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,996,000	
	一般担保第43回住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,026,000	
	第7回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	200,000,000	202,744,000	

第9回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	200,000,000	204,322,000	
第14回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	100,000,000	102,089,000	
第11回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	99,313,000	
第15回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	100,342,000	
第17回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	94,421,000	
第22回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	102,357,000	
第6回ザ・ベアー・スターズ・カンパニーズ・インク円貨社債	100,000,000	100,497,000	
第3回ドイツ銀行AGロンドン支店円貨社債	100,000,000	100,753,000	
第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債	100,000,000	101,260,000	
第5回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,921,000	
パークレイズ・バンク・ピーエルシー第2回円貨社債(2007)	200,000,000	203,398,000	
ウエストパック・バンキング・コーポ・第2回円貨社債2009	100,000,000	103,635,000	
ウエストパック・バンキング・コーポ・第5回円貨社債2010	200,000,000	202,464,000	
オーストラリア・ニュージーランド銀行第1回円貨社債2008	100,000,000	102,954,000	
オーストラリア・ニュージーランド銀行第1回円貨社債2009	100,000,000	103,502,000	
オーストラリア・ニュージーランド銀行第2回円貨社債2009	100,000,000	101,374,000	
オーストラリア・ニュージーランド銀行第5回円貨社債2010	100,000,000	100,986,000	
エイチエスピーシー・バンク・ピーエルシー第1回円貨社債(2009)	100,000,000	101,628,000	
キリンホールディングス株式会社第1回無担保社債	100,000,000	101,595,000	
キリンホールディングス株式会社第3回無担保社債	100,000,000	104,671,000	
味の素株式会社第17回無担保社債	100,000,000	100,564,000	
日本たばこ産業株式会社第5回社債	100,000,000	102,291,000	
株式会社セブン&アイ・ホールディングス第5回無担保社債	100,000,000	99,564,000	
住友化学株式会社第43回無担保社債	100,000,000	101,484,000	
三菱化学株式会社第37回無担保社債	100,000,000	106,101,000	
三井化学株式会社第31回無担保社債	100,000,000	100,677,000	
花王株式会社第2回無担保社債	100,000,000	103,662,000	
エーザイ株式会社第6回無担保社債	100,000,000	102,960,000	
エーザイ株式会社第7回無担保社債	100,000,000	105,206,000	
第一三共株式会社第2回無担保社債	100,000,000	104,464,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	新日本石油株式会社第26回無担保社債	100,000,000	107,865,000	
	株式会社ブリヂストン第4回無担保社債	100,000,000	101,186,000	
	新日本製鐵株式会社第52回無担保社債	100,000,000	103,794,000	
	新日本製鐵株式会社第56回無担保社債	100,000,000	103,422,000	
	新日本製鐵株式会社第62回無担保社債	100,000,000	102,273,000	
	ジェイエフイーホールディングス株式会社第13回無担保社債	100,000,000	101,436,000	
	株式会社豊田自動織機第12回無担保社債	200,000,000	201,694,000	
	株式会社豊田自動織機第15回無担保社債	100,000,000	104,581,000	
	三菱電機株式会社第42回無担保社債	100,000,000	102,319,000	
	富士通株式会社第24回無担保社債	100,000,000	101,907,000	

パナソニック株式会社第6回無担保社債	100,000,000	100,966,000	
パナソニック株式会社第7回無担保社債	100,000,000	102,936,000	
シャープ株式会社第22回無担保社債	100,000,000	103,056,000	
シャープ株式会社第24回無担保社債	100,000,000	101,205,000	
ソニー株式会社第16回無担保社債	100,000,000	101,332,000	
ソニー株式会社第17回無担保社債	100,000,000	103,957,000	
ソニー株式会社第25回無担保社債	100,000,000	102,531,000	
ソニー株式会社第26回無担保社債	100,000,000	106,262,000	
松下電工株式会社第3回無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,499,000	
三菱重工業株式会社第17回無担保社債	100,000,000	100,681,000	
三菱重工業株式会社第22回無担保社債	100,000,000	106,672,000	
トヨタ自動車株式会社第7回無担保社債	200,000,000	205,220,000	
トヨタ自動車株式会社第9回無担保社債	100,000,000	101,916,000	
トヨタ自動車株式会社第10回無担保社債	100,000,000	103,969,000	
アイシン精機株式会社第5回無担保社債	100,000,000	102,998,000	
大日本印刷株式会社第1回無担保社債	200,000,000	206,738,000	
三井物産株式会社第12回無担保社債	100,000,000	103,854,000	
三井物産株式会社第58回無担保社債	100,000,000	106,128,000	
住友商事株式会社第29回無担保社債	100,000,000	102,118,000	
三菱商事株式会社第45回無担保社債	100,000,000	101,633,000	
三菱商事株式会社第46回無担保社債	100,000,000	102,493,000	
三菱商事株式会社第53回無担保社債	100,000,000	101,211,000	
三菱商事株式会社第70回無担保社債	100,000,000	105,866,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第9回無担保社債	300,000,000	305,847,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第11回無担保社債	200,000,000	203,096,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第12回無担保社債	100,000,000	102,129,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第13回無担保社債	100,000,000	102,540,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第15回無担保社債	100,000,000	102,752,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第16回無担保社債	300,000,000	307,695,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第17回無担保社債	100,000,000	101,655,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第18回無担保社債	100,000,000	101,154,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第19回無担保社債	200,000,000	201,260,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第23回無担保社債	100,000,000	99,167,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第57回無担保社債	200,000,000	213,866,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第83回無担保社債	200,000,000	214,446,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第87回無担保社債	100,000,000	106,450,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第92回無担保社債	100,000,000	102,087,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第95回無担保社債	100,000,000	101,705,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	株式会社三菱東京UFJ銀行第98回無担保社債	100,000,000	101,907,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第100回無担保社債	100,000,000	102,552,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第104回無担保社債	200,000,000	205,918,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第106回無担保社債	300,000,000	304,722,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第107回無担保社債	100,000,000	103,082,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第109回無担保社債	100,000,000	101,061,000	
	株式会社三菱東京UFJ銀行第3回2号無担保社債	200,000,000	204,092,000	
	株式会社三井住友銀行第44回無担保社債	100,000,000	102,542,000	
	株式会社三井住友銀行第45回無担保社債	200,000,000	205,032,000	
	株式会社三井住友銀行第47回無担保社債	100,000,000	101,597,000	
	株式会社三井住友銀行第48回無担保社債	100,000,000	101,049,000	
	株式会社三井住友銀行第50回無担保社債	100,000,000	99,715,000	
	NTTファイナンス株式会社第32回無担保社債	100,000,000	101,952,000	
	NTTファイナンス株式会社第37回無担保社債	100,000,000	100,901,000	
	トヨタファイナンス株式会社第14回無担保社債	100,000,000	101,193,000	

トヨタファイナンス株式会社第21回無担保社債	100,000,000	107,021,000	
トヨタファイナンス株式会社第25回無担保社債	100,000,000	103,651,000	
トヨタファイナンス株式会社第30回無担保社債	100,000,000	102,081,000	
野村ホールディングス株式会社第9回無担保社債	100,000,000	101,815,000	
野村ホールディングス株式会社第22回無担保社債	100,000,000	100,647,000	
野村ホールディングス株式会社第23回無担保社債	100,000,000	101,461,000	
三菱地所株式会社第30回無担保社債	100,000,000	104,207,000	
三菱地所株式会社第48回無担保社債	100,000,000	110,114,000	
三菱地所株式会社第53回無担保社債	100,000,000	101,612,000	
三菱地所株式会社第70回無担保社債	100,000,000	103,810,000	
三菱地所株式会社第79回無担保社債	100,000,000	105,714,000	
東日本旅客鉄道株式会社第7回社債(一般担保付)	200,000,000	231,348,000	
東日本旅客鉄道株式会社第13回社債(一般担保付)	100,000,000	111,705,000	
東日本旅客鉄道株式会社第15回社債(一般担保付)	100,000,000	112,139,000	
東日本旅客鉄道株式会社第18回無担保社債	100,000,000	101,576,000	
東日本旅客鉄道株式会社第21回無担保社債	100,000,000	105,581,000	
東日本旅客鉄道株式会社第23回無担保普通社債	100,000,000	101,467,000	
東日本旅客鉄道株式会社第27回無担保普通社債	100,000,000	102,960,000	
東日本旅客鉄道株式会社第33回無担保普通社債	100,000,000	104,846,000	
東日本旅客鉄道株式会社第37回無担保普通社債	100,000,000	103,808,000	
東日本旅客鉄道株式会社第43回無担保普通社債	100,000,000	104,915,000	
東日本旅客鉄道株式会社第50回無担保普通社債	100,000,000	106,529,000	
西日本旅客鉄道株式会社第7回社債(一般担保付)	100,000,000	110,104,000	
西日本旅客鉄道株式会社第11回無担保社債	100,000,000	106,626,000	
東海旅客鉄道株式会社第5回普通社債(一般担保付)	100,000,000	111,705,000	
東海旅客鉄道株式会社第10回無担保普通社債	100,000,000	103,655,000	
東海旅客鉄道株式会社第20回無担保普通社債	200,000,000	211,856,000	
東海旅客鉄道株式会社第25回無担保普通社債	100,000,000	107,159,000	
東海旅客鉄道株式会社第51回無担保普通社債	100,000,000	101,534,000	
東京地下鉄株式会社第3回社債(一般担保付)	100,000,000	106,586,000	
東京地下鉄株式会社第8回社債(一般担保付)	100,000,000	104,320,000	
日本郵船株式会社第27回無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	106,937,000	
日本電信電話株式会社第47回電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	101,174,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	日本電信電話株式会社第48回電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	104,037,000	
	日本電信電話株式会社第50回電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	104,551,000	
	日本電信電話株式会社第51回電信電話債券(一般担保付)	200,000,000	214,720,000	
	日本電信電話株式会社第52回電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	105,927,000	
	日本電信電話株式会社第53回電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	104,159,000	
	日本電信電話株式会社第59回電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	104,298,000	
	株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第15回無担保社債	100,000,000	106,649,000	
	株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第16回無担保社債	100,000,000	102,488,000	
	東京電力株式会社第457回社債	100,000,000	107,490,000	
	東京電力株式会社第493回社債	100,000,000	101,535,000	
	東京電力株式会社第496回社債	100,000,000	101,692,000	
	東京電力株式会社第498回社債	100,000,000	101,519,000	
	東京電力株式会社第507回社債	100,000,000	103,074,000	
	東京電力株式会社第511回社債	100,000,000	103,935,000	

東京電力株式会社第513回社債	100,000,000	104,869,000	
東京電力株式会社第514回社債	100,000,000	104,028,000	
東京電力株式会社第515回社債	100,000,000	103,667,000	
東京電力株式会社第516回社債	100,000,000	103,703,000	
東京電力株式会社第518回社債	100,000,000	103,571,000	
東京電力株式会社第519回社債	100,000,000	104,812,000	
東京電力株式会社第521回社債	100,000,000	106,998,000	
東京電力株式会社第522回社債	100,000,000	107,561,000	
東京電力株式会社第539回社債	100,000,000	104,513,000	
東京電力株式会社第541回社債	100,000,000	101,750,000	
東京電力株式会社第542回社債	200,000,000	209,052,000	
東京電力株式会社第544回社債	100,000,000	107,106,000	
中部電力株式会社第405回社債	100,000,000	115,108,000	
中部電力株式会社第406回社債	200,000,000	227,796,000	
中部電力株式会社第426回社債	100,000,000	112,720,000	
中部電力株式会社第466回社債	100,000,000	104,130,000	
中部電力株式会社第472回社債	100,000,000	101,137,000	
中部電力株式会社第478回社債	100,000,000	106,657,000	
中部電力株式会社第480回社債	100,000,000	106,157,000	
中部電力株式会社第484回社債	100,000,000	103,408,000	
関西電力株式会社第432回社債(一般担保付)	100,000,000	101,687,000	
関西電力株式会社第433回社債(一般担保付)	100,000,000	103,049,000	
関西電力株式会社第435回社債(一般担保付)	100,000,000	103,355,000	
関西電力株式会社第443回社債(一般担保付)	100,000,000	103,850,000	
関西電力株式会社第448回社債(一般担保付)	100,000,000	108,404,000	
関西電力株式会社第454回社債(一般担保付)	100,000,000	103,527,000	
関西電力株式会社第463回社債(一般担保付)	100,000,000	104,820,000	
関西電力株式会社第466回社債(一般担保付)	100,000,000	102,766,000	
中国電力株式会社第298回社債(一般担保付)	100,000,000	115,167,000	
中国電力株式会社第306回社債(一般担保付)	100,000,000	116,227,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	中国電力株式会社第311回社債(一般担保付)	100,000,000	113,221,000	
	中国電力株式会社第350回社債(一般担保付)	100,000,000	104,032,000	
	中国電力株式会社第354回社債(一般担保付)	100,000,000	106,617,000	
	北陸電力株式会社第277回社債(一般担保付)	100,000,000	103,747,000	
	北陸電力株式会社第283回社債(一般担保付)	100,000,000	107,838,000	
	北陸電力株式会社第288回社債(一般担保付)	100,000,000	106,661,000	
	東北電力株式会社第383回社債(一般担保付)	100,000,000	113,323,000	
	東北電力株式会社第408回社債(一般担保付)	100,000,000	101,586,000	
	東北電力株式会社第414回社債(一般担保付)	100,000,000	101,307,000	
	東北電力株式会社第416回社債(一般担保付)	100,000,000	98,922,000	
	東北電力株式会社第420回社債(一般担保付)	100,000,000	102,959,000	
	東北電力株式会社第435回社債(一般担保付)	100,000,000	106,641,000	
	四国電力株式会社第249回社債(一般担保付)	100,000,000	101,616,000	
	四国電力株式会社第253回社債(一般担保付)	100,000,000	93,808,000	
	四国電力株式会社第257回社債(一般担保付)	100,000,000	103,503,000	
	九州電力株式会社第366回社債(一般担保付)	100,000,000	101,612,000	
	九州電力株式会社第371回社債(一般担保付)	100,000,000	99,041,000	
	九州電力株式会社第372回社債(一般担保付)	100,000,000	100,958,000	
	九州電力株式会社第376回社債(一般担保付)	100,000,000	103,334,000	
	九州電力株式会社第384回社債(一般担保付)	100,000,000	104,149,000	
	九州電力株式会社第387回社債(一般担保付)	100,000,000	105,434,000	
	九州電力株式会社第391回社債(一般担保付)	100,000,000	106,330,000	
	九州電力株式会社第399回社債(一般担保付)	100,000,000	102,699,000	
	九州電力株式会社第405回社債(一般担保付)	100,000,000	105,556,000	

北海道電力株式会社第257回社債（一般担保付）	100,000,000	116,542,000	
北海道電力株式会社第282回社債（一般担保付）	100,000,000	103,103,000	
北海道電力株式会社第284回社債（一般担保付）	100,000,000	104,344,000	
北海道電力株式会社第285回社債（一般担保付）	100,000,000	105,522,000	
沖縄電力株式会社第9回社債（一般担保付）	100,000,000	99,628,000	
電源開発株式会社第14回無担保社債	100,000,000	104,387,000	
電源開発株式会社第16回無担保社債	100,000,000	106,956,000	
電源開発株式会社第17回無担保社債	200,000,000	214,748,000	
電源開発株式会社第19回無担保社債	200,000,000	213,772,000	
電源開発株式会社第21回無担保社債	100,000,000	105,229,000	
電源開発株式会社第29回無担保社債	100,000,000	101,530,000	
電源開発株式会社第30回無担保社債	100,000,000	100,918,000	
東京瓦斯株式会社第30回無担保社債	100,000,000	104,766,000	
大阪瓦斯株式会社第7回無担保社債	100,000,000	115,719,000	
大阪瓦斯株式会社第9回無担保社債	100,000,000	113,465,000	
大阪瓦斯株式会社第25回無担保社債	100,000,000	102,781,000	
株式会社エヌ・ティ・ティ・データ第20回無担保社債 （社債間限定同順位特約付）	200,000,000	203,670,000	
株式会社エヌ・ティ・ティ・データ第24回無担保社債	100,000,000	100,450,000	
社債券 小計	26,200,000,000	27,277,084,000	
合計	336,589,097,000	346,965,303,911	

（注）代用有価証券で額面 50,000,000円 担保差入

なお、代用有価証券の担保差入券面額には、約定未受渡券面額を含んでおります。

#### 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

#### 不動産等明細表

該当事項はありません。

#### 商品明細表

該当事項はありません。

#### 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

#### 借入金明細表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】平成23年2月28日

資産総額	4,833,233,300 円
負債総額	286,032,784 円
純資産総額（ - ）	4,547,200,516 円
発行済口数	4,108,958,116 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1067 円
1万口当たり純資産額	11,067 円

&lt;参考&gt;

マザーファンドの現況（平成23年2月28日）

純資産額計算書

（中央三井日本債券マザーファンド）

資産総額	364,404,835,819 円
負債総額	12,528,493,888 円
純資産総額（ - ）	351,876,341,931 円
発行済口数	301,339,008,222 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1677 円
1万口当たり純資産額	11,677 円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 投資信託受益証券の名義書換等

委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、該当事項はありません。

### (2) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

### (3) 譲渡制限

該当事項はありません。

### (4) 振替受益権に関する記載

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

#### 受益証券の不発行

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

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

#### 受益権の譲渡

A. 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

B. 上記A.の申請のある場合には、上記A.の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記A.の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

C. 上記A.の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

#### 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取扱われます。



## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

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：16,000株

発行済株式総数：5,050株

平成11年7月1日に中信投資顧問株式会社と合併し、資本金を2億円から2億5,250万円に、発行済株式総数を4,000株から5,050株に変更しています。

また、平成12年6月30日に資本準備金を資本金に繰入れし、資本金を2億5,250万円から3億円に増資いたしました。（新株発行はしない無償増資。）

##### (2) 委託会社の機構

会社取締役3名以上、監査役1名以上をおきます。取締役及び監査役は、株主総会において選任され、又は解任されます。取締役及び監査役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもってこれを行い、取締役の選任決議については、累積投票によらないものとします。また、取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもってこれを行い、監査役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもってこれを行います。

取締役の任期は、選任後1年内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。監査役の任期は、選任後4年内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

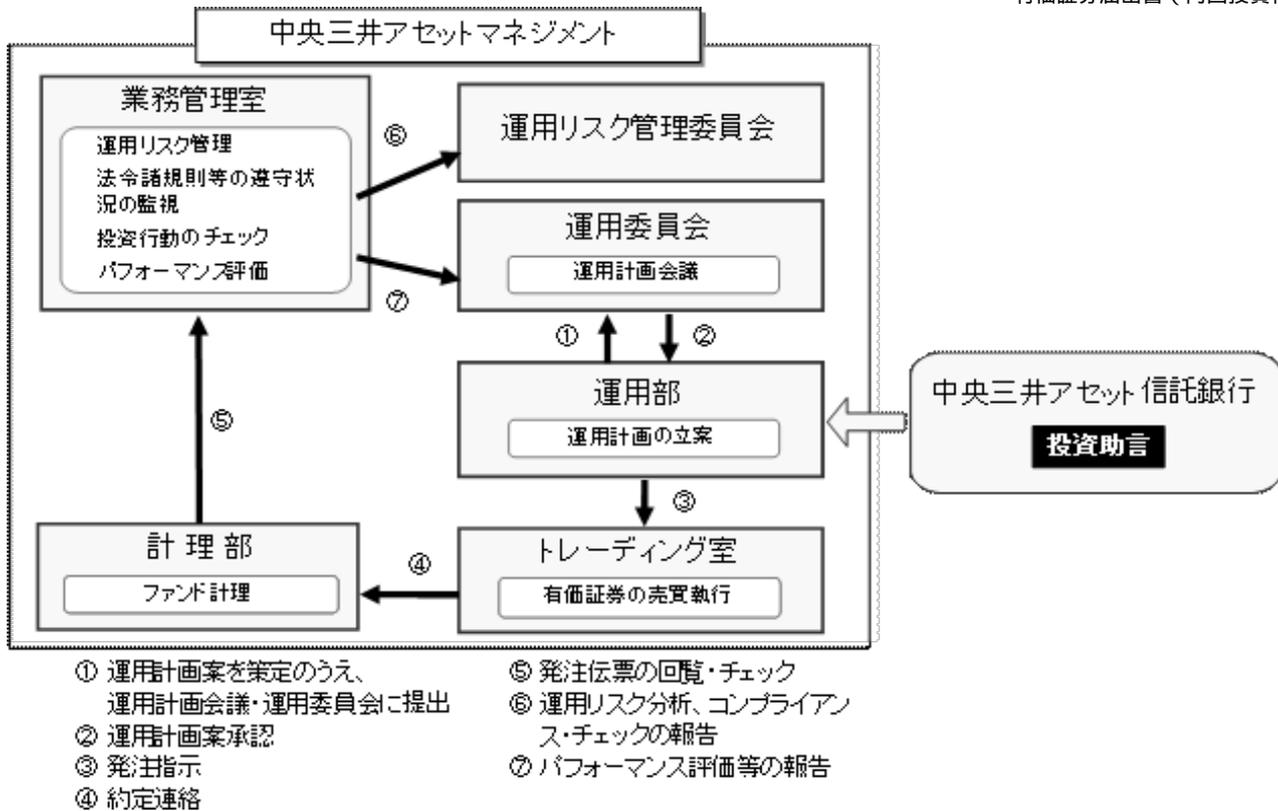
取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

取締役会は、社長が招集し、議長となります。社長にさしつかえがあるときは、副社長、専務取締役、常務取締役、取締役が順位に従い、その職務を代行します。

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

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

なお、委託会社の意思決定機構は以下のとおりです。



上記運用体制における組織名称等は、委託会社の組織変更等により変更となる場合があります。この場合においても、ファンドの基本的な運用方針が変更されるものではありません。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成23年2月28日現在、委託会社が運用の指図を行っている公募の証券投資信託は次のとおりです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	70	543,385
追加型公社債投資信託	-	-
単位型株式投資信託	12	25,672
単位型公社債投資信託	-	-
合計	82	569,057

なお私募を含めた証券投資信託（マザーファンドを除きます。）の純資産総額の合計は、平成23年2月28日現在、2兆3,193億円です。

### 3【委託会社等の経理状況】

(1) 委託会社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」といいます。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年8月6日内閣府令第52号）」（以下「業府令」といいます。）に基づいて作成しております。

ただし、第23期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）は、改正前の財務諸表等規則及び業府令に基づいて作成しており、第24期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）は、改正後の財務諸表等規則及び業府令に基づいて作成しております。

委託会社の中間財務諸表は、「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）」（以下「中間財務諸表等規則」といいます。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び業府令に基づいて作成しております。

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

(2) 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第23期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）の財務諸表については、監査法人トーマツによる監査を受け、第24期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表及び第25期中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）の中間財務諸表については、有限責任監査法人トーマツによる監査及び中間監査を受けております。

なお、監査法人トーマツは、監査法人の種類の変更により平成21年7月1日をもって有限責任監査法人トーマツとなっております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

科目	第23期 平成21年3月31日		第24期 平成22年3月31日	
	金額（千円）	構成比 （％）	金額（千円）	構成比 （％）
(資産の部)				
流動資産				
1. 現金・預金	1,464,505		1,823,012	
2. 前払費用	130,306		92,464	
3. 未収委託者報酬	972,672		1,023,412	
4. 未収収益	170		102	
5. 繰延税金資産	29,168		30,247	
6. その他	5,391		4,463	
流動資産 計	2,602,216	87.5	2,973,703	88.9
固定資産				
1. 有形固定資産 1				
(1) 建物	29,232		24,815	
(2) 器具備品	54,113		36,727	
有形固定資産 計	83,346	2.8	61,543	1.8
2. 無形固定資産				
(1) ソフトウェア	100,593		114,197	
(2) 電話加入権	1,847		1,847	
(3) 電話施設利用権	78		57	
無形固定資産 計	102,518	3.5	116,102	3.5
3. 投資その他の資産				
(1) 投資有価証券	65,000		74,897	
(2) 長期貸付金	42,388		39,988	
(3) 長期差入保証金	87,326		88,736	
(4) 長期前払費用	7,457		4,915	
(5) 会員権	25,000		25,000	
(6) 貸倒引当金	42,388		39,988	
投資その他の資産 計	184,784	6.2	193,549	5.8
固定資産 計	370,648	12.5	371,195	11.1
資産合計	2,972,864	100.0	3,344,898	100.0

科目	第23期 平成21年3月31日		第24期 平成22年3月31日	
	金額(千円)	構成比 (%)	金額(千円)	構成比 (%)
(負債の部)				
流動負債				
1. 預り金		3,008		3,792
2. 未払金				
(1) 未払手数料	316,013		327,341	
(2) その他未払金	71,990	388,004	56,890	384,231
3. 未払費用		246,794		279,266
4. 未払法人税等		103,823		114,387
5. 賞与引当金		45,488		46,407
流動負債計		787,118		828,085
		26.5		24.8
固定負債				
1. 退職給付引当金		16,535		22,905
2. 役員退職慰労引当金		22,100		31,800
固定負債計		38,635		54,705
		1.3		1.6
負債合計		825,754		882,791
		27.8		26.4
(純資産の部)				
株主資本				
1. 資本金		300,000		300,000
2. 資本剰余金				
(1) 資本準備金		50,000		50,000
資本剰余金計		50,000		50,000
		1.7		1.5
3. 利益剰余金				
(1) 利益準備金		25,401		25,401
(2) その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		1,771,709		2,086,808
利益剰余金計		1,797,110		2,112,210
		60.4		63.1
株主資本計		2,147,110		2,462,210
		72.2		73.6
評価・換算差額等				
1. その他有価証券評価差額金		-		103
評価・換算差額等計		-		103
		-		0.0
純資産合計		2,147,110		2,462,107
		72.2		73.6
負債・純資産合計		2,972,864		3,344,898
		100.0		100.0

## （ 2 ） 【 損益計算書 】

科目	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)		第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)	
	金額(千円)	百分比 (%)	金額(千円)	百分比 (%)
営業収益				
1. 委託者報酬		11,250,556		9,668,856
2. その他営業収益				
(1) 投資顧問料	7,937	7,937		-
営業収益 計		11,258,493		9,668,856
営業費用				
1. 支払手数料		4,424,596		3,855,512
2. 広告宣伝費		305,210		89,996
3. 受益証券発行費		250		-
4. 調査費				
(1) 調査費	229,875		234,896	
(2) 委託調査費	3,355,436	3,585,312	2,921,144	3,156,040
5. 営業雑経費				
(1) 通信費	15,143		14,562	
(2) 印刷費	284,199		192,040	
(3) 協会費	13,436		11,699	
(4) 諸会費	317	313,096	389	218,692
営業費用 計		8,628,465		7,320,241
一般管理費				
1. 給料				
(1) 役員報酬	50,723		57,119	
(2) 給料・手当	561,245		609,618	
(3) 賞与	130,680	742,649	132,613	799,351
2. 福利厚生費		191,032		211,448
3. 交際費		2,300		1,056
4. 寄付金		300		-
5. 旅費交通費		27,150		20,394
6. 租税公課		11,916		11,448
7. 不動産賃借料		109,171		112,953
8. 退職給付費用		6,212		6,497
9. 役員退職慰労引当金繰入		16,350		12,900
10. 賞与引当金繰入		45,488		46,407
11. 減価償却費		61,317		56,560
12. 諸経費		507,792		520,606
一般管理費 計		1,721,681		1,799,626
営業利益		908,346		548,988

科目	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)		第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)	
	金額(千円)	百分比 (%)	金額(千円)	百分比 (%)
営業外収益				
1. 受取配当金	7,549		3,000	
2. 受取利息	1,965		1,101	
3. 雑収入	3,884		333	
営業外収益 計	13,398	0.1	4,435	0.0
営業外費用				
1. 雑損失 1	391		5,057	
営業外費用 計	391	0.0	5,057	0.0
經常利益		921,353	8.2	
548,366				5.7
特別利益				
1. 投資有価証券売却益	-		2,918	
2. 貸倒引当金戻入	2,400		2,400	
特別利益 計	2,400	0.0	5,318	0.0
特別損失				
1. 投資有価証券売却損	-		17	
2. 統合関連費用 1	-		9,577	
特別損失 計	-	0.0	9,594	0.1
税引前当期純利益		923,753	8.2	
544,090				5.6
法人税、住民税及び事業税	376,581		230,069	
法人税等調整額	7,972	384,553	3.4	1,078
228,991				2.3
当期純利益		539,200	4.8	
315,099				3.3

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

		第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)	第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)
株主資本		(単位：千円)	(単位：千円)
資本金	前期末残高	300,000	300,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	300,000	300,000
資本剰余金			
資本準備金	前期末残高	50,000	50,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	50,000	50,000
資本剰余金合計	前期末残高	50,000	50,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	50,000	50,000
利益剰余金			
利益準備金	前期末残高	25,401	25,401
	当期変動額	-	-
	当期末残高	25,401	25,401
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金	前期末残高	1,382,999	1,771,709
	当期変動額 剰余金の配当	150,490	-
	当期純利益	539,200	315,099
	当期末残高	1,771,709	2,086,808
利益剰余金合計	前期末残高	1,408,400	1,797,110
	当期変動額	388,710	315,099
	当期末残高	1,797,110	2,112,210
株主資本合計	前期末残高	1,758,400	2,147,110
	当期変動額	388,710	315,099
	当期末残高	2,147,110	2,462,210
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金	前期末残高	-	-
	当期変動額 (純額)	-	103
	当期末残高	-	103
評価・換算差額等合計	前期末残高	-	-
	当期変動額	-	103
	当期末残高	-	103
純資産合計	前期末残高	1,758,400	2,147,110
	当期変動額	388,710	314,996
	当期末残高	2,147,110	2,462,107

## 重要な会計方針

項目	期別 第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)	第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券</p> <p>(1) 時価のないもの 移動平均法に基づく原価法を採用しております。</p>	<p>その他有価証券</p> <p>(1) 時価のないもの 同左</p> <p>(2) 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額については全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。</p>
2. 固定資産の減価償却の方法		
(1) 有形固定資産	<p>定率法を採用しております。</p> <p>なお、耐用年数は、建物については主として15年～18年、器具備品については主として5年～20年であります。</p>	同左
(2) 無形固定資産	<p>定額法を採用しております。</p> <p>なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（5年）を耐用年数としております。</p>	同左
3. 引当金の計上基準		
(1) 貸倒引当金	<p>一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p>	同左
(2) 賞与引当金	<p>従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当期負担分を計上しております。</p>	同左
(3) 退職給付引当金	<p>従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による期末退職給付債務相当額を計上しております。</p>	同左
(4) 役員退職慰労引当金	<p>役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づき期末要支給額を計上しております。</p>	同左
4. その他財務諸表作成の基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理は税抜方式を採用しております。</p>	同左

## 注記事項

## 1. 貸借対照表関係

項目	期別	第23期 (平成21年3月31日)	第24期 (平成22年3月31日)
1. 有形固定資産の減価償却累計額		建物 23,636千円 器具備品 161,247千円	建物 28,053千円 器具備品 177,074千円

## 2. 損益計算書関係

第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)	第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)
-	1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。  雑損失（臨時経営指導料） 4,490千円 統合関連費用 9,577千円

## 3. 株主資本等変動計算書関係

項目	期別	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)												
1. 発行済株式に関する事項		<table border="1"> <thead> <tr> <th>株式の種類</th> <th>前事業年度末</th> <th>増加</th> <th>減少</th> <th>当事業年度末</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>普通株式（株）</td> <td>5,050</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>5,050</td> </tr> </tbody> </table>	株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末	普通株式（株）	5,050	-	-	5,050		
株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末										
普通株式（株）	5,050	-	-	5,050										
2. 自己株式に関する事項		該当事項はありません。												
3. 新株予約権等に関する事項		該当事項はありません。												
4. 配当に関する事項		(1) 配当金支払額  <table border="1"> <thead> <tr> <th>決議</th> <th>株式の種類</th> <th>配当金の総額 (千円)</th> <th>1株当たり 配当額(円)</th> <th>基準日</th> <th>効力発生日</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>平成20年6月26日 定時株主総会</td> <td>普通株式</td> <td>150,490</td> <td>29,800</td> <td>平成20年3月31日</td> <td>平成20年6月27日</td> </tr> </tbody> </table> (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの 該当事項はありません。	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20年6月26日 定時株主総会	普通株式	150,490	29,800	平成20年3月31日	平成20年6月27日
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20年6月26日 定時株主総会	普通株式	150,490	29,800	平成20年3月31日	平成20年6月27日									

項目	期別	第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)										
1. 発行済株式に関する事項		<table border="1"> <thead> <tr> <th>株式の種類</th> <th>前事業年度末</th> <th>増加</th> <th>減少</th> <th>当事業年度末</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>普通株式（株）</td> <td>5,050</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>5,050</td> </tr> </tbody> </table>	株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末	普通株式（株）	5,050	-	-	5,050
株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末								
普通株式（株）	5,050	-	-	5,050								
2. 自己株式に関する事項		該当事項はありません。										
3. 新株予約権等に関する事項		該当事項はありません。										
4. 配当に関する事項		(1) 配当金支払額 該当事項はありません。 (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの 該当事項はありません。										

## 4．リース取引関係

第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)	第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)
リース取引は重要性が乏しく、1件当たりの金額が少額なため、注記を省略しております。	同左

## 5．金融商品関係

第24期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）

## 1．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

## 2．金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、次のとおりであります。

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

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
	千円	千円	千円
(1) 現金・預金	1,823,012	1,823,012	-
(2) 未収委託者報酬	1,023,412	1,023,412	-
(3) 投資有価証券			
その他有価証券	9,897	9,897	-
(4) 未払金	(384,231)	(384,231)	-

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

## （注1）金融商品の時価の算定方法

## (1) 現金・預金

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

## (2) 未収委託者報酬及び(4) 未払金

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

## (3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	65,000

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

（追加情報）

当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

## 6. 有価証券関係

第23期 (平成21年3月31日)	第24期 (平成22年3月31日)																
<p>1. その他有価証券で時価のあるもの 該当事項はありません。</p>	<p>1. その他有価証券 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>区分</th> <th>貸借対照表 計上額</th> <th>取得原価</th> <th>差額</th> </tr> <tr> <td></td> <td>千円</td> <td>千円</td> <td>千円</td> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>その他</td> <td>9,897</td> <td>10,000</td> <td>103</td> </tr> <tr> <td>計</td> <td>9,897</td> <td>10,000</td> <td>103</td> </tr> </tbody> </table>	区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額		千円	千円	千円	その他	9,897	10,000	103	計	9,897	10,000	103
区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額														
	千円	千円	千円														
その他	9,897	10,000	103														
計	9,897	10,000	103														
<p>2. 当事業年度中に売却したその他有価証券</p> <p>該当事項はありません。</p>	<p>2. 当事業年度中に売却したその他有価証券</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>区分</th> <th>売却額</th> <th>売却益の 合計額</th> <th>売却損の 合計額</th> </tr> <tr> <td></td> <td>千円</td> <td>千円</td> <td>千円</td> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>その他</td> <td>64,901</td> <td>2,918</td> <td>17</td> </tr> <tr> <td>計</td> <td>64,901</td> <td>2,918</td> <td>17</td> </tr> </tbody> </table>	区分	売却額	売却益の 合計額	売却損の 合計額		千円	千円	千円	その他	64,901	2,918	17	計	64,901	2,918	17
区分	売却額	売却益の 合計額	売却損の 合計額														
	千円	千円	千円														
その他	64,901	2,918	17														
計	64,901	2,918	17														
<p>3. 時価評価されていない有価証券</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>内容</th> <th>貸借対照表計上額(千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>その他有価証券 非上場株式</td> <td>65,000</td> </tr> </tbody> </table>	内容	貸借対照表計上額(千円)	その他有価証券 非上場株式	65,000	<p>3. 時価評価されていない有価証券</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>内容</th> <th>貸借対照表計上額(千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>その他有価証券 非上場株式</td> <td>65,000</td> </tr> </tbody> </table>	内容	貸借対照表計上額(千円)	その他有価証券 非上場株式	65,000								
内容	貸借対照表計上額(千円)																
その他有価証券 非上場株式	65,000																
内容	貸借対照表計上額(千円)																
その他有価証券 非上場株式	65,000																
<p>4. その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額 該当事項はありません。</p>	<p>4. その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額 該当事項はありません。</p>																

## 7. デリバティブ関係

第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)	第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)
当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、 当事項はありません。	同左

## 8. 退職給付関係

第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)	第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)																
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成21年3月31日現在）</p> <table> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>16,535千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>16,535千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 （平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）</p> <table> <tr> <td>勤務費用</td> <td>6,212千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>6,212千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	16,535千円	退職給付引当金	16,535千円	勤務費用	6,212千円	退職給付費用	6,212千円	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 同左</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成22年3月31日現在）</p> <table> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>22,905千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>22,905千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 （平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）</p> <table> <tr> <td>勤務費用</td> <td>6,497千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>6,497千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	22,905千円	退職給付引当金	22,905千円	勤務費用	6,497千円	退職給付費用	6,497千円
退職給付債務	16,535千円																
退職給付引当金	16,535千円																
勤務費用	6,212千円																
退職給付費用	6,212千円																
退職給付債務	22,905千円																
退職給付引当金	22,905千円																
勤務費用	6,497千円																
退職給付費用	6,497千円																

## 9. 税効果会計関係

第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)	第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)																																
<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <table> <tr> <td>繰延税金資産</td> <td></td> </tr> <tr> <td>貸倒引当金繰入超過額</td> <td>17,247千円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td> <td>18,509千円</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td>8,540千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td>18,609千円</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td>62,906千円</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td>33,738千円</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td>29,168千円</td> </tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳 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、記載を省略しております。</p>	繰延税金資産		貸倒引当金繰入超過額	17,247千円	賞与引当金繰入超過額	18,509千円	未払事業税	8,540千円	その他	18,609千円	繰延税金資産小計	62,906千円	評価性引当額	33,738千円	繰延税金資産合計	29,168千円	<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <table> <tr> <td>繰延税金資産</td> <td></td> </tr> <tr> <td>貸倒引当金繰入超過額</td> <td>16,271千円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td> <td>18,883千円</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td>9,168千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td>25,501千円</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td>69,823千円</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td>39,576千円</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td>30,247千円</td> </tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳 同左</p>	繰延税金資産		貸倒引当金繰入超過額	16,271千円	賞与引当金繰入超過額	18,883千円	未払事業税	9,168千円	その他	25,501千円	繰延税金資産小計	69,823千円	評価性引当額	39,576千円	繰延税金資産合計	30,247千円
繰延税金資産																																	
貸倒引当金繰入超過額	17,247千円																																
賞与引当金繰入超過額	18,509千円																																
未払事業税	8,540千円																																
その他	18,609千円																																
繰延税金資産小計	62,906千円																																
評価性引当額	33,738千円																																
繰延税金資産合計	29,168千円																																
繰延税金資産																																	
貸倒引当金繰入超過額	16,271千円																																
賞与引当金繰入超過額	18,883千円																																
未払事業税	9,168千円																																
その他	25,501千円																																
繰延税金資産小計	69,823千円																																
評価性引当額	39,576千円																																
繰延税金資産合計	30,247千円																																

## 10. 関連当事者との取引関係

第23期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）

（追加情報）

当事業年度より、「関連当事者の開示に関する会計基準」（企業会計基準第11号 平成18年10月17日）及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第13号 平成18年10月17日）を適用しております。

これによる開示対象範囲の変更はありません。

## 1. 関連当事者との取引

## 当社と同一の親会社を持つ会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	中央三井信託銀行株式会社 (注)親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	399,697	銀行業務・信託業務	該当なし	投資信託販売	投資信託に係る営業費用の支払 (注1) 支払代行手数料	4,171,346	未払手数料	295,661
同一の親会社を持つ会社	中央三井アセット信託銀行株式会社 (注)親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	11,000	信託業務	該当なし	投資信託委託 投資顧問	支払投資顧問料 (注1) 調査費(支払投資顧問料)  建物の賃借 (注2)	3,306,819  -	未払費用 前払費用  長期差入保証金	210,392 86,162  70,411
同一の親会社を持つ会社	中央三井インフォメーションテクノロジー株式会社 (注)親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都目黒区	200	情報処理サービス業	該当なし	システムの管理・開発委託	ソフトウェアの購入(注2) ソフトウェア	35,207	-	-

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

第24期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）

## 1. 関連当事者との取引

## 当社と同一の親会社を持つ会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	中央三井信託銀行株式会社 (注)親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	399,697	銀行業務・信託業務	該当なし	投資信託販売	投資信託に係る営業費用の支払(注1) 支払代行手数料	3,600,680	未払手数料	300,655
同一の親会社を持つ会社	中央三井アセット信託銀行株式会社 (注)親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	11,000	信託業務	該当なし	投資信託委託 投資顧問	支払投資顧問料(注1) 調査費(支払投資顧問料) 建物の賃借(注2)	2,778,495 - -	未払費用 前払費用 長期差入保証金	235,031 49,803 71,548
同一の親会社を持つ会社	中央三井インフォメーションテクノロジー株式会社 (注)親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都目黒区	200	情報処理サービス業	該当なし	システムの管理・開発委託	ソフトウェアの購入(注2) ソフトウェア	45,122	-	-

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

## 11. 1株当たり情報

項目	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)	第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)
1. 1株当たり純資産額	425,170円41銭	487,545円94銭
2. 1株当たり当期純利益	106,772円29銭 (注) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため、記載していません。	62,395円92銭 (注) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

1株当たり当期純損益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

項目	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)	第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)
当期純利益(千円)	539,200	315,099
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益 (千円)	539,200	315,099
普通株式の期中平均株式数 (株)	5,050	5,050

## 12. 重要な後発事象

第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)	第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)
該当事項はありません。	同左

[次へ](#)

## (4) 中間貸借対照表

科目	第25期中間会計期間末 平成22年9月30日	
	金額(千円)	構成比 (%)
(資産の部)		
流動資産		
1. 現金・預金	2,092,721	
2. 前払費用	79,040	
3. 未収委託者報酬	937,874	
4. 未収収益	71	
5. 繰延税金資産	30,996	
6. その他	1,005	
流動資産 計	3,141,709	91.4
固定資産		
1. 有形固定資産 1		
(1) 建物	27,226	
(2) 器具備品	31,028	
有形固定資産 計	58,254	1.7
2. 無形固定資産		
(1) ソフトウェア	96,321	
(2) 電話加入権	1,847	
(3) 電話施設利用権	47	
無形固定資産 計	98,216	2.8
3. 投資その他の資産		
(1) 投資有価証券	21,396	
(2) 長期貸付金	38,788	
(3) 長期差入保証金	90,141	
(4) 長期前払費用	3,693	
(5) 会員権	25,000	
(6) 貸倒引当金	38,788	
投資その他の資産 計	140,231	4.1
固定資産 計	296,702	8.6
資産合計	3,438,412	100.0

科目	第25期中間会計期間末 平成22年9月30日	
	金額（千円）	構成比 （％）
（負債の部）		
流動負債		
1．預り金		3,214
2．未払金		
（1）未払手数料	286,519	
（2）その他未払金 2	64,725	351,245
3．未払費用		263,402
4．未払法人税等		85,017
5．賞与引当金		50,173
流動負債 計		753,053
固定負債		
1．退職給付引当金		24,146
2．役員退職慰労引当金		11,200
3．繰延税金負債		1,820
4．資産除去債務		5,845
固定負債 計		43,012
負債合計		796,066
（純資産の部）		
株主資本		
1．資本金		300,000
2．資本剰余金		
（1）資本準備金		50,000
資本剰余金 計		50,000
3．利益剰余金		
（1）利益準備金		25,401
（2）その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		2,266,828
利益剰余金 計		2,292,229
株主資本 計		2,642,229
評価・換算差額等		
1．その他有価証券評価差額金		116
評価・換算差額等 計		116
純資産合計		2,642,345
負債・純資産合計		3,438,412

## ( 5 ) 中間損益計算書

科目	第25期中間会計期間 (平成22年4月1日から 平成22年9月30日まで)		
	金額(千円)		百分比 (%)
営業収益			
1. 委託者報酬		4,537,380	
営業収益計		4,537,380	100.0
営業費用			
1. 支払手数料		1,722,765	
2. 広告宣伝費		33,117	
3. 調査費			
(1) 調査費	113,987		
(2) 委託調査費	1,440,031	1,554,018	
4. 営業雑経費			
(1) 通信費	7,229		
(2) 印刷費	90,988		
(3) 協会費	5,834		
(4) 諸会費	421	104,474	
営業費用計		3,414,375	75.2
一般管理費			
1. 給料			
(1) 役員報酬	30,635		
(2) 給料・手当	313,561		
(3) 賞与	54,599	398,796	
2. 福利厚生費		116,630	
3. 交際費		351	
4. 旅費交通費		10,589	
5. 租税公課		7,645	
6. 不動産賃借料		58,030	
7. 退職給付費用		3,707	
8. 役員退職慰労引当金繰入		5,500	
9. 賞与引当金繰入		50,173	
10. 減価償却費 1		26,064	
11. 諸経費		265,740	
一般管理費計		943,229	20.8
営業利益		179,775	4.0

科目	第25期中間会計期間 (平成22年4月1日から 平成22年9月30日まで)		
	金額(千円)		百分比 (%)
営業外収益			
1. 受取配当金		63,400	
2. 受取利息		471	
3. 雑収入		2,553	
営業外収益 計		66,425	1.4
営業外費用			
1. 雑損失		63	
営業外費用 計		63	0.0
経常利益		246,137	5.4
特別利益			
1. 投資有価証券売却益		67,188	
2. 貸倒引当金戻入		1,200	
特別利益 計		68,388	1.5
特別損失			
1. 投資有価証券売却損		339	
2. 固定資産除却損		980	
3. 資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額		1,449	
4. 統合関連費用		36,460	
特別損失 計		39,230	0.8
税引前中間純利益		275,296	6.1
法人税、住民税及び事業税	94,285		
法人税等調整額	991	95,276	2.1
中間純利益		180,019	4.0

## ( 6 ) 中間株主資本等変動計算書

第25期中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）

（単位：千円）

株主資本		
資本金	前期末残高	300,000
	中間会計期間中の変動額	-
	中間会計期間末残高	300,000
資本剰余金		
資本準備金	前期末残高	50,000
	中間会計期間中の変動額	-
	中間会計期間末残高	50,000
資本剰余金合計	前期末残高	50,000
	中間会計期間中の変動額	-
	中間会計期間末残高	50,000
利益剰余金		
利益準備金	前期末残高	25,401
	中間会計期間中の変動額	-
	中間会計期間末残高	25,401
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	前期末残高	2,086,808
	中間会計期間中の変動額	中間純利益 180,019
	中間会計期間末残高	2,266,828
利益剰余金合計	前期末残高	2,112,210
	中間会計期間中の変動額	180,019
	中間会計期間末残高	2,292,229
株主資本合計	前期末残高	2,462,210
	中間会計期間中の変動額	180,019
	中間会計期間末残高	2,642,229
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	前期末残高	103
	中間会計期間中の変動額（純額）	219
	中間会計期間末残高	116
評価・換算差額等合計	前期末残高	103
	中間会計期間中の変動額	219
	中間会計期間末残高	116
純資産合計	前期末残高	2,462,107
	中間会計期間中の変動額	180,238
	中間会計期間末残高	2,642,345

## 中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

項目	第25期中間会計期間 (平成22年4月1日から 平成22年9月30日まで)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券</p> <p>(1) 時価のあるもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額については全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。</p> <p>(2) 時価のないもの 移動平均法に基づく原価法を採用しております。</p>
2. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産  (2) 無形固定資産	<p>定率法を採用しております。 なお、耐用年数は、建物については主として15年～18年、器具備品については主として5年～20年であります。</p> <p>定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間(5年)を耐用年数としております。</p>
3. 引当金の計上基準 (1) 貸倒引当金  (2) 賞与引当金  (3) 退職給付引当金  (4) 役員退職慰労引当金	<p>一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間負担分を計上しております。</p> <p>従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による中間期末退職給付債務相当額を計上しております。</p> <p>役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づき当中間期末要支給額を計上しております。</p>
4. その他中間財務諸表作成の基本となる重要な事項	消費税等の会計処理は税抜方式を採用しております。

## 会計方針の変更

項目	第25期中間会計期間 (平成22年4月1日から 平成22年9月30日まで)
「資産除去債務に関する会計基準」等の適用	当中間会計期間より、「資産除去債務に関する会計基準」（企業会計基準第18号 平成20年3月31日）及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日）を適用しております。 これにより、営業利益及び経常利益は、それぞれ118千円、税引前中間純利益は1,567千円減少しております。

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

項目	第25期中間会計期間末 (平成22年9月30日)
1.有形固定資産の減価償却 累計額	建物 30,559千円 器具備品 136,425千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうち、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。

## (中間損益計算書関係)

項目	第25期中間会計期間 (平成22年4月1日から 平成22年9月30日まで)
1.減価償却実施額	有形固定資産 8,178千円 無形固定資産 17,886千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

項目	第25期中間会計期間 (平成22年4月1日から 平成22年9月30日まで)										
1.発行済株式に関する事項	<table border="1"> <thead> <tr> <th>株式の種類</th> <th>前事業 年度末</th> <th>増加</th> <th>減少</th> <th>当中間 会計期末</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>普通株式(株)</td> <td>5,050</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>5,050</td> </tr> </tbody> </table>	株式の種類	前事業 年度末	増加	減少	当中間 会計期末	普通株式(株)	5,050	-	-	5,050
株式の種類	前事業 年度末	増加	減少	当中間 会計期末							
普通株式(株)	5,050	-	-	5,050							
2.自己株式に関する事項	該当事項はありません。										
3.新株予約権等に関する事項	該当事項はありません。										
4.配当に関する事項	該当事項はありません。										

## リース取引関係

第25期中間会計期間 (平成22年4月1日から 平成22年9月30日まで)
当社はリース取引を全く行っていないため、該当事項はありません。

## 金融商品関係

第25期中間会計期間  
 (平成22年4月1日から  
 平成22年9月30日まで)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成22年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次表には含めておりません。

	中間貸借対照表計上額 <sup>(*)</sup>	時価 <sup>(*)</sup>	差額
	千円	千円	千円
(1) 現金・預金	2,092,721	2,092,721	-
(2) 未収委託者報酬	937,874	937,874	-
(3) 投資有価証券			
その他有価証券	11,396	11,396	-
(4) 未払金	(351,245)	(351,245)	-

(\*) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

## (1) 現金・預金

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

## (2) 未収委託者報酬及び(4) 未払金

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

## (3) 投資有価証券

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

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

内 容	中間貸借対照表計上額(千円)
非上場株式	10,000

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

## 有価証券関係

第25期中間会計期間末 (平成22年9月30日)			
1. その他有価証券 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
区分	中間貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
投資信託受益証券	11,396	11,200	196
計	11,396	11,200	196
非上場株式（中間貸借対照表計上額 10,000千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。			

## デリバティブ関係

第25期中間会計期間 (平成22年4月1日から 平成22年9月30日まで)
当社はデリバティブ取引を全く行っていないため、該当事項はありません。

## 資産除去債務関係

第25期中間会計期間末 (平成22年9月30日)	
資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの 当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減	
	千円
前事業年度末残高（注）	5,776
時の経過による調整額	69
当中間会計期間末残高	5,845
（注）当中間会計期間より、「資産除去債務に関する会計基準」（企業会計基準第18号 平成20年3月31日）及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日）を適用しているため、前事業年度の末日における残高に代えて、当中間会計期間の期首における残高を記載しております。	

## セグメント情報等

第25期中間会計期間  
(平成22年4月1日から  
平成22年9月30日まで)

## (セグメント情報)

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## (関連情報)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
中央三井高金利ソブリンオープン	721,448千円
中央三井VAバランスファンド (株25/100)	597,316千円

(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。

## (追加情報)

当中間会計期間より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」(企業会計基準第17号 最終改正平成21年3月27日)及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日)を適用しております。

## 1 株当たり情報

第25期中間会計期間 (平成22年4月1日から 平成22年9月30日まで)	
1株当たり純資産額	523,236円82銭
1株当たり中間純利益	35,647円44銭
(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり中間純利益算定上の基礎は以下のとおりであります。

第25期中間会計期間 (平成22年4月1日から 平成22年9月30日まで)	
中間純利益(千円)	180,019
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益(千円)	180,019
普通株式の期中平均株式数(株)	5,050

## 重要な後発事象

第25期中間会計期間 (平成22年4月1日から 平成22年9月30日まで)	
該当事項はありません。	

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1) 自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。（金融商品取引法第42条の2第1号）

##### (2) 運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。（金融商品取引法第42条の2第2号）

##### (3) 通常の実取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の実取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）及び（5）において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）及び（5）において同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。（金融商品取引法第44条の3第1項第1号）

##### (4) 親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。（金融商品取引法第44条の3第1項第3号）

##### (5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記（3）及び（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。（金融商品取引法第44条の3第1項第4号）

#### 5【その他】

##### (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

本書提出日現在、委託会社及びファンドに重要な影響を与えると予想される訴訟事件等は発生してありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称：中央三井アセット信託銀行株式会社

資本金の額：11,000百万円（平成22年9月末日現在）

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

#### <再信託受託会社>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成22年9月末日現在）

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

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成22年9月末日現在）	事業の内容
中央三井信託銀行株式会社	399,697	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。
三井生命保険株式会社	167,280	保険業法に基づき監督官庁の免許を受け、保険業を営んでいます。
ソニー銀行株式会社	31,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
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。
フィデリティ証券株式会社	4,907	「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。
東海東京証券株式会社	6,000	「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。
浜銀 T T 証券株式会社	3,307	「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23年4月1日現在です。

### 2【関係業務の概要】

#### (1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

#### <再信託受託会社>

当ファンドの再信託受託会社として、信託事務の一部を行います。

#### (2) 販売会社

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

### 3【資本関係】

#### (1) 受託会社

該当事項はありません。

<再信託受託会社>

該当事項はありません。

( 2 ) 販売会社

該当事項はありません。

### 第3【その他】

- (1) 金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2) 交付目論見書には約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載していません。
- (3) 目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案及びキャッチコピーを採用すること、また、ファンドの形態、申込みに関する事項などを記載することがあります。
- (4) 目論見書（表紙を含みます。）等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。
- 当ファンドは預貯金や保険契約とは異なり、預金保険機構、貯金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象とはなりません。
- 金融商品取引業者以外でご購入いただいた場合は、投資者保護基金の対象とはなりません。
- 当ファンドは、実質的に国内の公社債を主要投資対象としております。当ファンドの基準価額は、実質的に組入れた有価証券の値動きや実質的に組入れた有価証券の発行体の経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化等により変動しますので、これにより投資元本を割り込むことがあります。従って、当ファンドは元本保証のある商品ではありません。
- 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資家の皆様に帰属します。
- ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認いたします。
- 投資信託の信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
- ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- (5) 目論見書等は電子媒体としてインターネット等に掲載されることがあります。
- (6) 目論見書等に、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示する場合があります。
- (7) 目論見書（表紙を含みます。）等に金融商品取引業者登録番号、目論見書の使用開始日を別途記載することがあります。

# 独立監査人の監査報告書

平成22年3月19日

中央三井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 平木達也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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の平成21年1月23日から平成22年1月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、中央三井日本債券インデックスファンドの平成22年1月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

中央三井アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲には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21年6月12日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

## 監査法人 トーマツ

指定社員  
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

指定社員  
業務執行社員 公認会計士 平木達也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている中央三井アセットマネジメント株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第23期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、中央三井アセットマネジメント株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

# 独立監査人の監査報告書

平成23年3月24日

中央三井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 平木達也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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の平成22年1月23日から平成23年1月24日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、中央三井日本債券インデックスファンドの平成23年1月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

中央三井アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲には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22年6月10日

中央三井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 平木達也

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている中央三井アセットマネジメント株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、中央三井アセットマネジメント株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成22年12月14日

中央三井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 平木達也

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている中央三井アセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第25期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から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、我が国におけ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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、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、中央三井アセットマネジメント株式会社の平成22年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以上

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