

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成23年5月20日
【計算期間】	第10期（自 平成22年2月23日 至 平成23年2月21日）
【ファンド名】	中央三井外国債券インデックスファンド
【発行者名】	中央三井アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 山本 聡
【本店の所在の場所】	東京都港区芝三丁目23番1号
【事務連絡者氏名】	山口 知樹
【連絡場所】	東京都港区芝三丁目23番1号 業務企画部
【電話番号】	03-5440-0170
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

① 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。

② 信託金限度額

上限：3,000億円

③ 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 追加型	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
	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>

- ・海外…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海外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。

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	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を除く)			
	年2回	日本			
	年4回				日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	北米	ファミリー ファンド	あり ()	
	年12回 (毎月)	欧州			
	日々	アジア			TOPIX
		オセアニア			
不動産投信	日々	中南米	ファンド ・オブ・ ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (債券 公債))	その他 ()	アフリカ			その他 (シティグループ世界国債 インデックス(除く日本、 ヘッジなし・円ベース))
		中近東 (中東)			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(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 公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。

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>

- ・グローバル（日本を除く）

…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世界の資産（日本を除きます。）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。

<為替ヘッジ>

- ・なし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

<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（シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））

…「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「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」です。

※シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同インデックスに関する著作権・知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。

④ 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、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に採用されている国の国債等に分散投資を行い、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

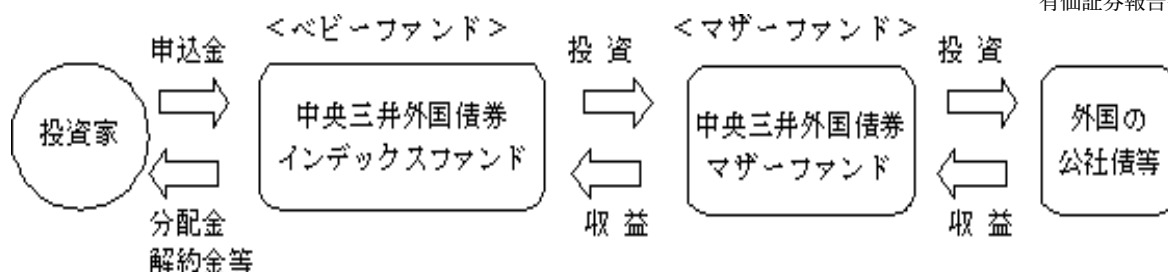
（2）【ファンドの沿革】

平成13年2月22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】

① 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（中央三井外国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（中央三井外国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。



② 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。

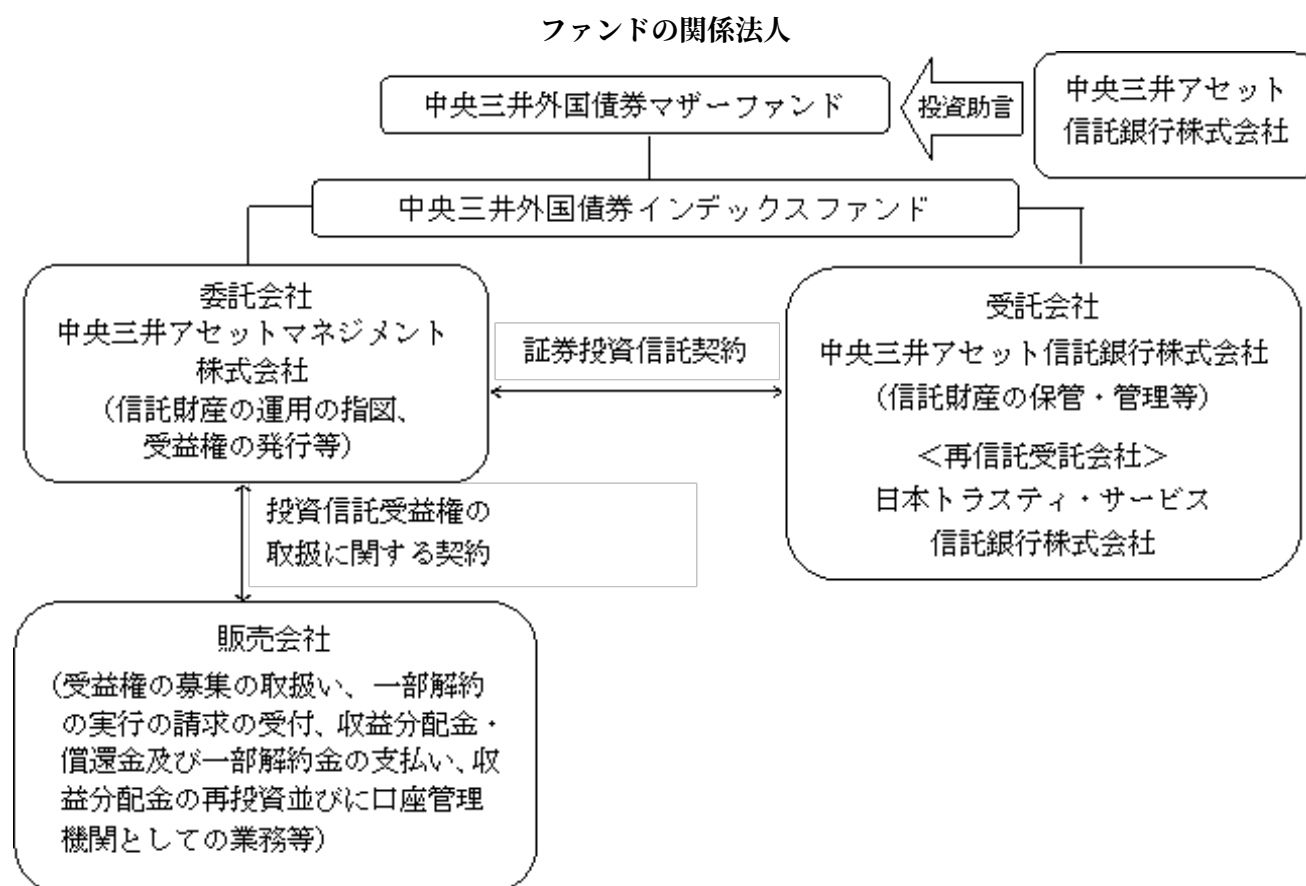
受託会社 中央三井アセット信託銀行株式会社

（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、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。
--------------------------------------	---

③ 委託会社の概況

A. 資本金の額：3億円（平成23年5月20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5月20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】

① 運用方針

当ファンドは、日本を除く世界の主要国の公社債に投資する中央三井外国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。

② 投資態度

- A. 公社債への実質投資は、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。
- B. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。
- C. 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。
- D. 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。
- E. 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。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、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、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- F. 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、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。
- G. 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

（2）【投資対象】

① 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）①F.、G.及びH.に定めるものに限ります。）
 - 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

② 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者とし、中央三井アセット信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「中央三井外国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。）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ます。）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. 投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、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ます。）
 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。

③ 運用指図できる金融商品

A. 委託会社は、信託金を、上記②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。

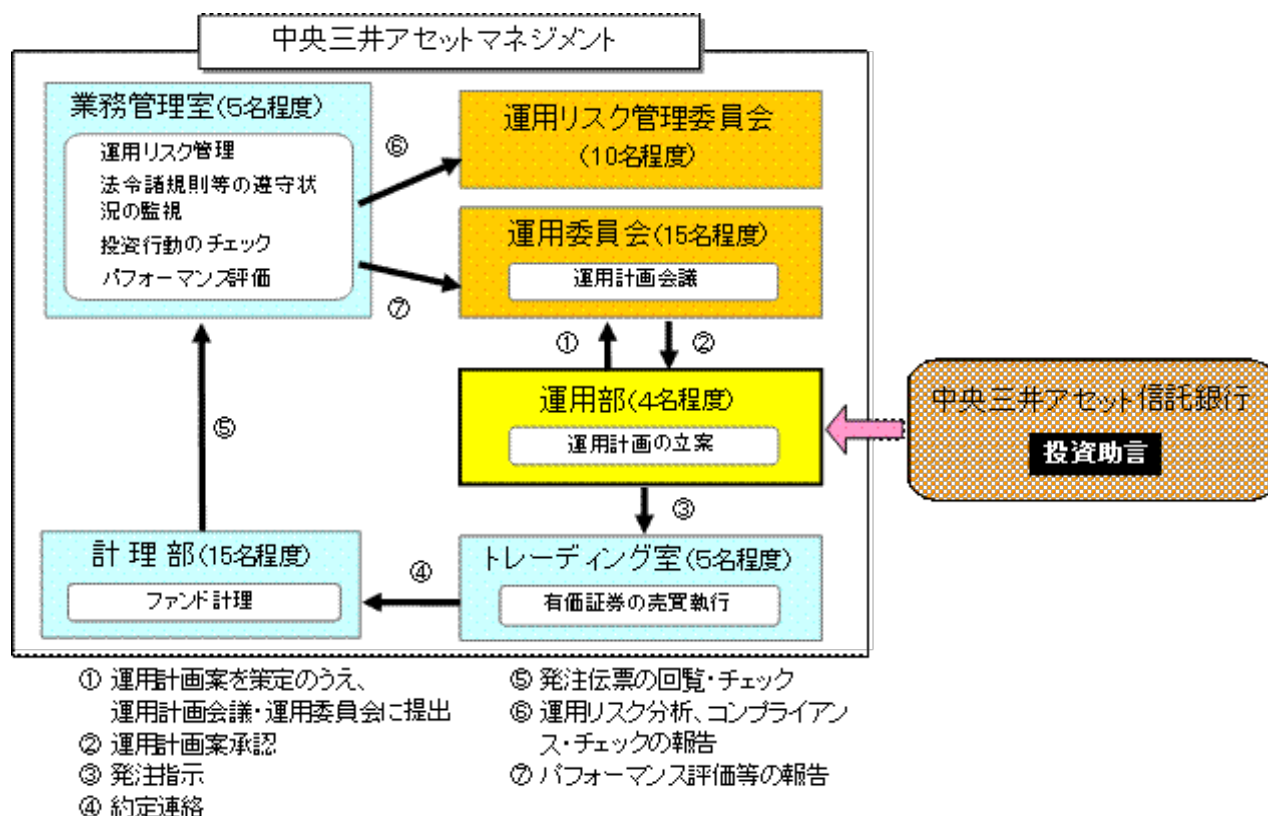
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で上記5. の権利の性質を有するもの

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。

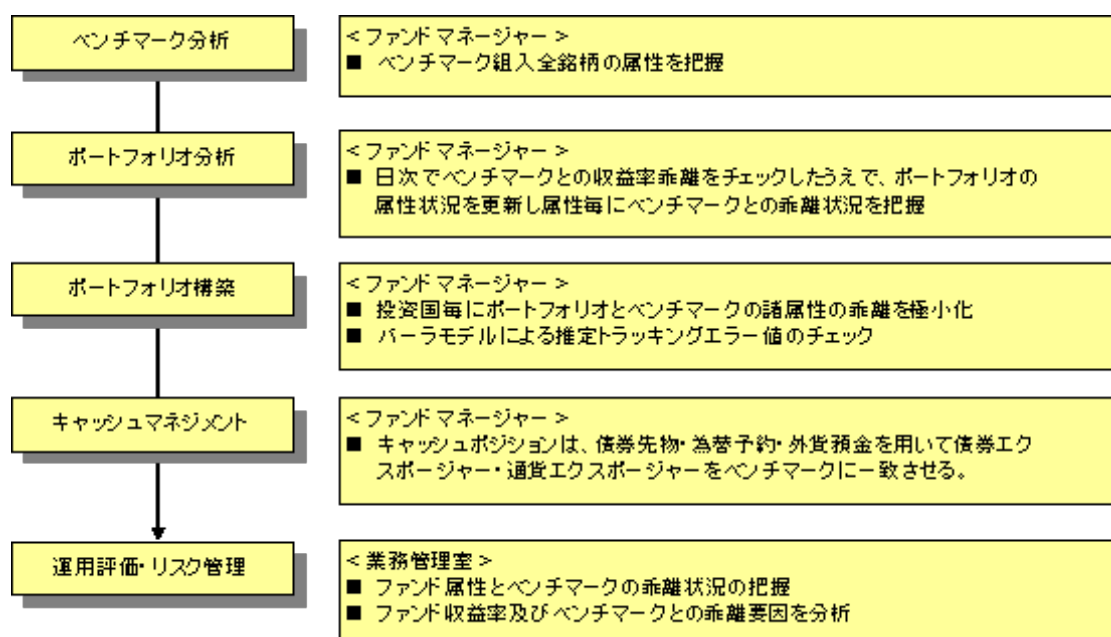
（３）【運用体制】

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を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】

① 分配方針

年１回の毎決算時（決算日は２月２１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. 分配対象額の範囲は、経費控除後の利子等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

B. 分配金額は、原則として利子等収益の範囲内で行うものとします。ただし、基準価額の水準や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. 収益分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

② 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 ①」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相当額を除きます。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。

③ 収益分配金の再投資等

収益分配金は、税引後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込むことにより、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。

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します。）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す。

- 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】

① 約款に定める投資制限

A. 株式への投資制限

委託会社は、株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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制限

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. 外貨建資産への投資制限

委託会社は、外貨建資産への投資には制限を設けません。

D. 投資信託証券への投資制限

委託会社は、投資信託証券（親投資信託を除く。）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。

E. 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、金融商品取引所等（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中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。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場中有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）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、金融商品取引所等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。

F. 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の指図を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通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。

ハ. 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。

G. 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あたっては、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ます。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。

- 二、委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、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。

H. 金利先渡し取引及び為替先渡し取引の運用指図

- 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、金利先渡し取引及び為替先渡し取引を行うことを指図することができます。
- ロ、金利先渡し取引及び為替先渡し取引の指図にあたっては、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、金利先渡し取引及び為替先渡し取引の評価は、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。
- 二、委託会社は、金利先渡し取引及び為替先渡し取引を行うにあたり、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。

I. 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。
- ロ、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、有価証券の貸付にあ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。

J. 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。
- ロ、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、上記ロ、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。

K. 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あたり、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。
- ロ、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、上記ロ、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。
- 二、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。

L. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

M. 外国為替予約取引の指図

- イ、委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

ロ. 上記イ. の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ハ. 上記ロ. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

N. 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並びに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

O. 再投資の指図

委託会社は、上記N. 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。

P. 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。

二. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

Q. 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も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。

② 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

「中央三井外国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

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

（2）投資態度

- ① シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ② 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。
- ③ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。
- ④ 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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。
- ⑦ 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、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を行うことができます。
- ⑧ 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

- ① 株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

- ② 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。
- ③ 外貨建資産への投資には、制限を設けません。
- ④ 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外国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た公社債の値動きや為替レート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、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いますので、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）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。

① 為替変動リスク

為替変動リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に、投資している国の通貨が円に対して弱く（円高に）なれば基準価額の下落要因となり、強く（円安に）なれば基準価額の上昇要因となります。

② 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。

③ 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。

④ カントリーリスク

カントリーリスクとは、投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等による影響を受け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、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

⑤ 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。

⑥ 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（シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、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 ①

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。

- ① 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。
- ② 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】

- ① お申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.1%（税抜※ 2.0%）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。

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。

※「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます（以下同じ。）。

- ② 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。

- ③ 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。

※お申込受付日の翌営業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。

- ④ 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。
- ⑤ 上記①及び②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】**

- ① 解約手数料はありませんが、下記②の信託財産留保額が控除されます。
- ② 一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、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」「④ 個人の受益者に対する課税」もしくは「⑤ 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
中央三井外国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

- ① 信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率 0.735%（税抜 0.7%）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 0.3465%	（税抜 0.33%）
販売会社	年率 0.336%	（税抜 0.32%）
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。

- ② 上記①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。
- ③ 信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

（４）【その他の手数料等】

- ① 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。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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】**① 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「③ 収益分配金の課税について」をご参照ください。）

② 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④又は⑤をご参照ください。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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5月20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3月31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	中央三井外国債券マザーファンド	日本	10,543,234,526	100.08
受益証券	親投資信託受益証券合計		10,543,234,526	100.08
その他の資産（負債控除後）			△7,920,918	△0.08
合計（純資産総額）			10,535,313,608	100.00

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

<参考>

当ファンドが主要投資対象としている親投資信託の状況は次のとおりです。

（中央三井外国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（％）
国債証券	アメリカ	163,306,634,408	37.98
	イタリア	43,184,908,290	10.04
	フランス	41,001,041,989	9.54
	ドイツ	40,495,746,928	9.42
	イギリス	33,507,502,965	7.79
	その他	97,120,523,146	22.59
	小計	418,616,357,726	97.35
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		11,383,831,781	2.65
合計（純資産総額）		430,000,189,507	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】

① 【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	中央三井外国債券 マザーファンド	6,940,447,980	1.4891	10,335,021,665	1.5191	10,543,234,526	100.08

（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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

<参考>

当ファンドが主要投資対象としている親投資信託の状況

（中央三井外国債券マザーファンド）

① 投資有価証券の主要銘柄

A. 主要銘柄の明細

順位	国／ 地域	銘柄名	利率 （％）	償還日	額面金額	簿価（円）		評価額（円）		投資 比率 （％）
						単価	金額	単価	金額	
1	アメリカ	US TREASURY N/B	3.125	2019/5/15	46,920,000	8,213.66	3,853,849,711	8,309.80	3,898,959,626	0.91

2	アメリカ	US TREASURY N/B	1.750	2012/8/15	40,000,000	8,457.26	3,382,905,797	8,457.91	3,383,165,625	0.79
3	アメリカ	US TREASURY N/B	1.500	2013/12/31	40,120,000	8,380.61	3,362,300,967	8,391.65	3,366,731,547	0.78
4	アメリカ	US TREASURY N/B	2.625	2014/7/31	32,650,000	8,627.46	2,816,866,391	8,642.40	2,821,744,620	0.66
5	アメリカ	US TREASURY N/B	3.375	2019/11/15	31,570,000	8,287.71	2,616,432,068	8,404.64	2,653,346,771	0.62
6	アメリカ	US TREASURY N/B	1.875	2012/6/15	30,000,000	8,465.70	2,539,712,812	8,461.81	2,538,543,515	0.59
7	アメリカ	US TREASURY N/B	2.625	2018/1/31	30,250,000	8,233.14	2,490,527,638	8,207.16	2,482,667,365	0.58
8	フランス	BTAN-5YR ISSUE	3.750	2013/1/12	20,310,000	12,246.30	2,487,224,976	12,159.08	2,469,511,057	0.57
9	アメリカ	US TREASURY N/B	2.625	2016/2/29	27,900,000	8,441.02	2,355,045,756	8,487.79	2,368,095,109	0.55
10	アメリカ	US TREASURY N/B	3.625	2020/2/15	27,430,000	8,418.93	2,309,314,556	8,539.76	2,342,457,496	0.54
11	アメリカ	US TREASURY N/B	0.625	2013/2/28	27,450,000	8,302.00	2,278,901,144	8,291.61	2,276,048,059	0.53
12	アメリカ	US TREASURY N/B	3.500	2020/5/15	26,650,000	8,372.43	2,231,254,245	8,425.43	2,245,378,051	0.52
13	アメリカ	US TREASURY N/B	2.375	2014/8/31	26,000,000	8,546.26	2,222,027,843	8,565.74	2,227,094,796	0.52
14	アメリカ	US TREASURY N/B	4.625	2017/2/15	23,500,000	9,225.75	2,168,051,800	9,272.52	2,179,043,190	0.51
15	イギリス	TREASURY	5.000	2012/3/7	15,270,000	13,967.00	2,132,761,377	13,897.78	2,122,191,311	0.49
16	アメリカ	US TREASURY N/B	2.750	2019/2/15	26,000,000	8,022.67	2,085,895,703	8,122.71	2,111,906,062	0.49
17	アメリカ	US TREASURY N/B	5.125	2016/5/15	22,000,000	9,458.31	2,080,828,750	9,477.80	2,085,116,171	0.48
18	アメリカ	US TREASURY N/B	1.750	2013/4/15	24,000,000	8,467.00	2,032,082,062	8,468.95	2,032,549,791	0.47
19	アメリカ	US TREASURY N/B	1.375	2015/11/30	25,000,000	7,994.09	1,998,523,242	8,055.80	2,013,951,475	0.47
20	イギリス	TREASURY	3.750	2019/9/7	14,590,000	13,372.93	1,951,110,953	13,634.15	1,989,222,862	0.46
21	イギリス	TREASURY	2.750	2015/1/22	14,500,000	13,559.46	1,966,122,406	13,624.51	1,975,554,313	0.46
22	イタリア	BTPS	4.250	2019/9/1	16,760,000	11,709.97	1,962,591,307	11,585.34	1,941,704,291	0.45
23	アメリカ	US TREASURY N/B	2.750	2013/10/31	21,600,000	8,674.88	1,873,774,856	8,670.33	1,872,792,655	0.44
24	イタリア	BTPS	4.500	2020/2/1	15,820,000	11,853.40	1,875,209,050	11,739.36	1,857,167,463	0.43
25	フランス	FRANCE O.A.T.	3.750	2019/10/25	15,150,000	12,014.47	1,820,193,462	11,931.00	1,807,547,045	0.42
26	フランス	FRANCE O.A.T.	4.000	2018/4/25	14,670,000	12,349.55	1,811,679,395	12,257.84	1,798,226,330	0.42
27	イタリア	BTPS	3.750	2015/8/1	15,140,000	11,876.92	1,798,165,899	11,804.02	1,787,129,839	0.42
28	アメリカ	US TREASURY N/B	2.250	2015/1/31	20,900,000	8,461.81	1,768,518,648	8,492.99	1,775,035,530	0.41
29	イタリア	BTPS	4.250	2015/2/1	14,730,000	12,127.34	1,786,357,992	12,046.22	1,774,408,530	0.41
30	アメリカ	US TREASURY N/B	1.250	2015/9/30	21,980,000	7,983.69	1,754,817,087	8,045.41	1,768,381,590	0.41
合計							67,813,047,893		67,965,672,085	15.81

（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）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	97.35
合計	97.35

（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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

取引名	国／地域	資産名	種類	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	US 5YR NOTE	買建	57	555,092,002	553,749,779	0.13
	アメリカ	US 10YR NOTE	買建	47	466,731,401	465,546,456	0.11
	アメリカ	US LONG BOND	買建	28	281,048,517	279,820,537	0.07
	ドイツ	EURO-SCHATZ	買建	37	466,840,254	466,481,901	0.11
	ドイツ	EURO-BOBL FU	買建	42	568,250,845	566,282,959	0.13
	ドイツ	EURO-BUND FU	買建	71	1,018,055,560	1,013,633,282	0.24

（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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの基準価額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間（平成14年2月21日現在）	2,906,431,411	2,908,909,764	11,727	11,737
第2期計算期間（平成15年2月21日現在）	3,335,410,581	3,337,968,274	13,041	13,051
第3期計算期間（平成16年2月23日現在）	426,160,461	426,160,461	13,565	13,565
第4期計算期間（平成17年2月21日現在）	822,353,704	822,917,972	14,203	14,213
第5期計算期間（平成18年2月21日現在）	2,161,246,457	2,164,002,991	15,464	15,483
第6期計算期間（平成19年2月21日現在）	4,267,392,175	4,267,392,175	16,847	16,847
第7期計算期間（平成20年2月21日現在）	7,934,973,812	7,934,973,812	17,099	17,099
第8期計算期間（平成21年2月23日現在）	8,409,000,574	8,409,000,574	14,069	14,069
第9期計算期間（平成22年2月22日現在）	11,436,045,051	11,436,045,051	14,924	14,924
第10期計算期間（平成23年2月21日現在）	10,386,871,612	10,386,871,612	13,810	13,810
平成22年3月末日	11,719,637,337	—	15,105	—
平成22年4月末日	11,144,653,577	—	15,192	—
平成22年5月末日	10,505,981,098	—	14,379	—
平成22年6月末日	10,281,863,666	—	13,998	—
平成22年7月末日	10,775,957,359	—	14,269	—
平成22年8月末日	10,598,205,067	—	14,056	—
平成22年9月末日	10,956,953,623	—	14,412	—
平成22年10月末日	10,591,054,434	—	13,961	—
平成22年11月末日	11,361,899,897	—	13,912	—
平成22年12月末日	11,044,106,858	—	13,376	—
平成23年1月末日	11,225,444,295	—	13,632	—
平成23年2月末日	10,239,105,352	—	13,647	—
平成23年3月末日	10,535,313,608	—	14,064	—

② 【分配の推移】

	1万口当たりの収益分配金
第1期計算期間	10 円
第2期計算期間	10 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	20 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

③【収益率の推移】

	収益率
第1期計算期間	17.37 %
第2期計算期間	11.29 %
第3期計算期間	4.02 %
第4期計算期間	4.78 %
第5期計算期間	9.01 %
第6期計算期間	8.94 %
第7期計算期間	1.50 %
第8期計算期間	△17.72 %
第9期計算期間	6.08 %
第10期計算期間	△7.46 %

（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2月22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	2,478,491,374	138,160	2,478,353,214
第2期計算期間	93,770,291	14,430,380	2,557,693,125
第3期計算期間	250,199,004	2,493,723,570	314,168,559
第4期計算期間	400,570,307	135,741,537	578,997,329
第5期計算期間	1,083,934,188	265,303,112	1,397,628,405
第6期計算期間	1,514,798,118	379,338,044	2,533,088,479
第7期計算期間	3,204,854,104	1,097,280,678	4,640,661,905
第8期計算期間	2,276,796,857	940,375,785	5,977,082,977
第9期計算期間	2,465,789,743	779,932,599	7,662,940,121
第10期計算期間	2,003,488,345	2,145,001,486	7,521,426,980

（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

2011年3月31日 現在（基準日）

〈基準価額・純資産の推移〉



- ・基準価額及び基準価額（分配金再投資）は、信託報酬控除後の値です。
- ・基準価額（分配金再投資）は、分配金（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。

〈分配の推移〉

2011年2月	0円
2010年2月	0円
2009年2月	0円
2008年2月	0円
2007年2月	0円
設定来累計	50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	97.43%
その他資産	2.57%
合計	100.00%

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

種類別投資比率

（中央三井外国債券マザーファンド）

種類	比率
国債証券	97.35%
-	-
合計	97.35%

- ・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。

国／地域別投資比率（上位）

（中央三井外国債券マザーファンド）

国／地域	比率
アメリカ	37.98%
イタリア	10.04%
フランス	9.54%
ドイツ	9.42%
イギリス	7.79%

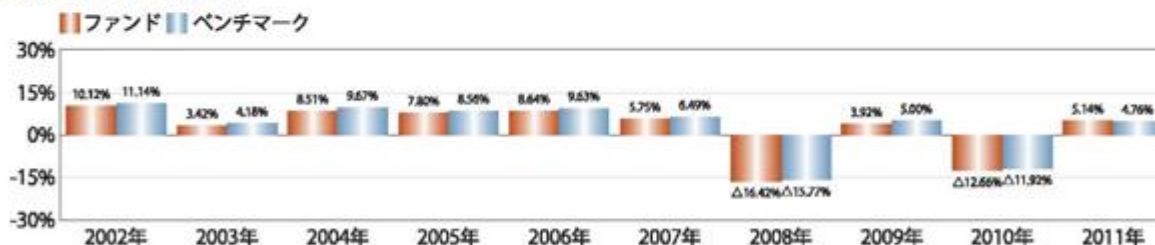
- ・比率とはマザーファンドの純資産総額に対する当該国／地域の評価金額の比率をいいます。

組入上位銘柄（中央三井外国債券マザーファンド）

銘柄名	種類	償還日	利率	通貨	比率
US TREASURY N/B	国債証券	2019/05/15	3.125%	米ドル	0.91%
US TREASURY N/B	国債証券	2012/08/15	1.750%	米ドル	0.79%
US TREASURY N/B	国債証券	2013/12/31	1.500%	米ドル	0.78%
US TREASURY N/B	国債証券	2014/07/31	2.625%	米ドル	0.66%
US TREASURY N/B	国債証券	2019/11/15	3.375%	米ドル	0.62%
US TREASURY N/B	国債証券	2012/06/15	1.875%	米ドル	0.59%
US TREASURY N/B	国債証券	2018/01/31	2.625%	米ドル	0.58%
BTAN-5YR ISSUE	国債証券	2013/01/12	3.750%	ユーロ	0.57%
US TREASURY N/B	国債証券	2016/02/29	2.625%	米ドル	0.55%
US TREASURY N/B	国債証券	2020/02/15	3.625%	米ドル	0.54%
合計					6.59%

- ・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）申込みの受け付け

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、営業日の午後3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）②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、ニューヨーク証券取引所又はロンドン証券取引所が休業日の場合は、受益権の取得申込みを受け付けないものとし、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、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け付けを中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取り消すことができます。

（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

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、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

- ① 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み旨の申込書を提出していただきます。
- ② 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。
- ③ 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口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

ただし、ニューヨーク証券取引所又はロンドン証券取引所が休業日の場合には、一部解約の実行の請求を受付けないものとします。

（注）一部解約の実行の請求の受付は、営業日の午後3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、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、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、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替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】

① 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1万口当たりには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。

② 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（中央三井外国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

※外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

（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2月22日）から無期限とします。ただし、委託会社は、下記（5）①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】

① 当ファンドの計算期間は、毎年2月22日から翌年2月21日までとすることを原則とします。

② 上記①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】

① 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。

ハ. 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③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③ 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。受託会社が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③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。

② 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。

③ 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。

④ 反対者の買取請求権

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。

⑤ 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。

⑥ 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。

⑦ 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、知れている受益者に対して交付します。

⑧ 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。

⑨ 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

- ① 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。
- ② 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します。）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

- ① 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。
- ② 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します。）に対する支払いを開始します。
- ③ 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します。
- ④ 受益者が、信託終了による償還金については、上記②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

- 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口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。
- ② 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。
- ③ 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 ④ 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2月24日から平成22年2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2月23日から平成23年2月21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2月24日から平成22年2月22日まで）及び第10期計算期間（平成22年2月23日から平成23年2月21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】

中央三井外国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2月22日現在)	第10期 (平成23年2月21日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	11,476,261,588	10,427,220,603
未収入金	7,459,782	8,502,824
流動資産合計	11,483,721,370	10,435,723,427
資産合計	11,483,721,370	10,435,723,427
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,459,782	8,502,824
未払受託者報酬	2,872,615	2,882,075
未払委託者報酬	37,343,922	37,466,916
流動負債合計	47,676,319	48,851,815
負債合計	47,676,319	48,851,815
純資産の部		
元本等		
元本	7,662,940,121	7,521,426,980
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,773,104,930	2,865,444,632
純資産合計	11,436,045,051	10,386,871,612
負債純資産合計	11,483,721,370	10,435,723,427

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第9期 (自 平成21年 2月24日 至 平成22年 2月22日)	第10期 (自 平成22年 2月23日 至 平成23年 2月21日)
営業収益		
有価証券売買等損益	510,478,263	△768,947,233
営業収益合計	510,478,263	△768,947,233
営業費用		
受託者報酬	5,419,981	5,730,884
委託者報酬	70,459,628	74,501,330
営業費用合計	75,879,609	80,232,214
営業利益又は営業損失（△）	434,598,654	△849,179,447
経常利益又は経常損失（△）	434,598,654	△849,179,447
当期純利益又は当期純損失（△）	434,598,654	△849,179,447
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	75,369,590	△133,590,953
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,431,917,597	3,773,104,930
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,316,316,546	843,845,378
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,316,316,546	843,845,378
剰余金減少額又は欠損金増加額	334,358,277	1,035,917,182
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	334,358,277	1,035,917,182
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,773,104,930	2,865,444,632

(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 2 月24日 至 平成22年 2 月22日	第 10 期 自 平成22年 2 月23日 至 平成23年 2 月21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おりま 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 2 月22日から翌年 2 月21日までとなっておりますが、 前計算期間末日及び当計算期間 末日が休業日のため、第 9 期計算 期間は平成21年 2 月24日から平 成22年 2 月22日までになってお ります。	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 2 月22日から翌年 2 月21日までとなっておりますが、 前計算期間末日が休業日のため、 第10期計算期間は平成22年 2 月 23日から平成23年 2 月21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 2 月22日現在)	第 10 期 (平成23年 2 月21日現在)
1. 当該計算期間の末日におけ る受益権総数	7,662,940,121 口	7,521,426,980 口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4924 円 (14,924 円)	1.3810 円 (13,810 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 2 月24日 至 平成22年 2 月22日	第 10 期 自 平成22年 2 月23日 至 平成23年 2 月21日
費用控除後の配当等収益額	A	333,747,541 円 (404,247,286 円)	300,917,113 円 (381,149,327 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	－ 円	－ 円
収益調整金額	C	4,516,239,276 円	4,665,764,864 円
分配準備積立金額	D	663,992,607 円	758,329,698 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,513,979,424 円	5,725,011,675 円
当ファンドの期末残存口数	F	7,662,940,121 口	7,521,426,980 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	7,195.64 円	7,611.60 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 2 月24日 至 平成22年 2 月22日	第 10 期 自 平成22年 2 月23日 至 平成23年 2 月21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。	同左

（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 2 月24日 至 平成22年 2 月22日	第 10 期 自 平成22年 2 月23日 至 平成23年 2 月21日
_____ _____ _____	1. 金融商品に対する取組方針 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。 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、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。 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

第 9 期 (平成22年 2 月22日現在)	第 10 期 (平成23年 2 月21日現在)
	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 (1) 親投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 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。

(関連当事者との取引に関する注記)

第 9 期 自 平成21年 2 月24日 至 平成22年 2 月22日	第 10 期 自 平成22年 2 月23日 至 平成23年 2 月21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 2 月24日 至 平成22年 2 月22日	第 10 期 自 平成22年 2 月23日 至 平成23年 2 月21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 2 月24日 至 平成22年 2 月22日	第 10 期 自 平成22年 2 月23日 至 平成23年 2 月21日

期首元本額	5,977,082,977 円	7,662,940,121 円
期中追加設定元本額	2,465,789,743 円	2,003,488,345 円
期中一部解約元本額	779,932,599 円	2,145,001,486 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 2 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 2 月24日 至 平成22年 2 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	11,476,261,588	475,183,991
合計	11,476,261,588	475,183,991

種類	第 10 期 (平成23年 2 月21日現在)	
	最終の計算期間（自 平成22年 2 月23日 至 平成23年 2 月21日）の損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	△543,359,262	
合計	△543,359,262	

3. デリバティブ取引関係

第 9 期 自 平成21年 2 月24日 至 平成22年 2 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 2 月21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】

① 有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
親投資信託 受益証券	中央三井外国債券マザーファンド	6,995,787,054	10,427,220,603	
合計		6,995,787,054	10,427,220,603	

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ 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。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 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。

⑦ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

<参考>

「中央三井外国債券インデックスファンド」は、「中央三井外国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2月21日現在（以下、「計算日」といいます。）の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

「中央三井外国債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成23年2月21日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,270,667,401
コール・ローン	4,805,105,030
国債証券	413,326,896,383
派生商品評価勘定	41,925,771
未収利息	4,769,161,964
前払費用	259,751,581
差入委託証拠金	152,178,813
流動資産合計	424,625,686,943
資産合計	424,625,686,943
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,045,689
未払解約金	210,476,383
流動負債合計	231,522,072
負債合計	231,522,072
純資産の部	
元本等	
元本	284,725,633,144
剰余金	
剰余金	139,668,531,727
純資産合計	424,394,164,871
負債・純資産合計	424,625,686,943

(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2月21日現在
--	--------------

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

（貸借対照表に関する注記）

	平成23年 2 月21日現在
1. 計算日における受益権総数	284,725,633,144 口
2. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4905 円 (14,905 円)

（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 2 月21日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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。

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、為替変動リスク、金利変動リスク、信用リスク、カントリー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及び為替予約取引を行っております。債券先物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。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

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2月21日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法

(1) 国債証券

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

(2) デリバティブ取引

「（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2月21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2月21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2月21日現在

計算期間の期首元本額	289,906,380,074 円
計算期間中の追加設定元本額	33,533,861,013 円
計算期間中の一部解約元本額	38,714,607,943 円
計算日の元本額	284,725,633,144 円

計算日の元本額の内訳

中央三井外国債券インデックスファンド	6,995,787,054 円
中央三井DC外国債券インデックスファンド	1,786,230,222 円
中央三井DC外国債券インデックスファンドL	7,955,057,459 円
物価連動債組入世界債券ファンド	153,308,157 円
中央三井DCバランスファンド30	82,656,772 円
中央三井DCバランスファンド50	129,056,086 円
中央三井DCバランスファンド70	29,020,049 円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	175,379,587 円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	111,293,831 円
新生・4分散ファンド	128,949,929 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	432,266,934 円
4資産インデックスバランスオープン（分配型）	67,745,360 円
4資産インデックスバランスオープン（成長型）	136,426,770 円
CMAM外国債券インデックスe	211,065,702 円
中央三井インデックスコレクション（外国債券）	661,728 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式30）	69,653 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式50）	71,422 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式70）	36,617 円
中央三井外国債券インデックスファンドF（一般投資家私募）	619,967,859 円
中央三井外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	19,569,951,139 円
中央三井バランスVA30（適格機関投資家専用）	8,319,221,669 円
中央三井バランスVA50（適格機関投資家専用）	26,865,833,787 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）	98,876,328,980 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）	5,296,486,973 円
中央三井VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	116,501,059 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）	10,608,450,188 円

中央三井バランスVA25（適格機関投資家専用）	7,864,165,991 円
中央三井バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	2,303,032,704 円
中央三井バランスVA50L（適格機関投資家専用）	21,263,338,342 円
中央三井バランスVA75（適格機関投資家専用）	823,124,089 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）	36,311,698,930 円
中央三井VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	6,195,259,252 円
中央三井VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	550,021,149 円
中央三井バランスVA40（適格機関投資家専用）	2,745,414,940 円
中央三井VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	2,858,391,728 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）	455,841,230 円
CMAM・VAバランス50－50（適格機関投資家専用）	174,731,711 円
中央三井バランスVA20（適格機関投資家専用）	3,877,545,127 円
中央三井VAファンド25（適格機関投資家専用）	7,289,979,692 円
中央三井バランスVA20L（適格機関投資家専用）	49,882,518 円
中央三井バランスVA25L（適格機関投資家専用）	1,045,441,604 円
中央三井世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	305,879,207 円
CMAM・VAバランス20－80（適格機関投資家専用）	1,887,822,465 円
私募外国債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	54,387,818 円
中央三井世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	1,849,661 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成23年2月21日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△515,320,998
合計	△515,320,998

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「中央三井外国債券マザーファンド」の期首から計算日までの期間（平成23年2月8日から平成23年2月21日まで）に対応するものです。

3. デリバティブ取引関係

I. ヘッジ会計が適用されていないもの

債券関連

区分	種類	平成23年2月21日現在			
		契約額等（円）		時価 （円）	評価損益 （円）
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買 建	3,272,185,075	—	3,254,041,797	△18,143,278
	合計	3,272,185,075	—	3,254,041,797	△18,143,278

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

区分	種類	平成23年2月21日現在		
		契約額等（円）	時価	評価損益

			うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買 建				
	米ドル	2,055,005,097	—	2,070,257,199	15,252,102
	カナダドル	198,750,000	—	202,152,000	3,402,000
	ユーロ	2,373,525,000	—	2,387,490,000	13,965,000
	英ポンド	397,845,000	—	404,760,000	6,915,000
	計	5,025,125,097	—	5,064,659,199	39,534,102
	売 建				
	米ドル	291,834,350	—	290,780,000	1,054,350
	カナダドル	33,785,450	—	33,692,000	93,450
	ユーロ	305,472,150	—	306,963,000	△1,490,850
	英ポンド	53,790,550	—	53,968,000	△177,450
	マレーシアリングット	1,576,797	—	1,567,039	9,758
	計	686,459,297	—	686,970,039	△510,742
合計		5,711,584,394	—	5,751,629,238	39,023,360

(注) 時価の算定方法

わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

- ① 計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。
- ② 計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートをを用いております。

Ⅱ. ヘッジ会計が適用されているもの

平成23年2月21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2月21日現在）

① 有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B 0.875% 2012/01/31	20,000,000	20,107,812.60	
		US TREASURY N/B 4.750% 2012/01/31	1,760,000	1,833,012.50	
		US TREASURY N/B 1.375% 2012/02/15	8,600,000	8,688,015.66	
		US TREASURY N/B 4.875% 2012/02/15	1,930,000	2,016,548.43	
		US TREASURY N/B 0.875% 2012/02/29	20,000,000	20,109,375.00	
		US TREASURY N/B 1.375% 2012/03/15	20,000,000	20,214,062.60	
		US TREASURY N/B 1.000% 2012/03/31	20,000,000	20,139,062.60	
		US TREASURY N/B 4.500% 2012/03/31	1,000,000	1,045,312.50	
		US TREASURY N/B 1.375% 2012/04/15	16,100,000	16,282,382.89	
		US TREASURY N/B 1.000% 2012/04/30	13,430,000	13,525,478.97	
		US TREASURY N/B 4.500% 2012/04/30	13,270,000	13,923,132.81	
		US TREASURY N/B 0.750% 2012/05/31	9,000,000	9,042,890.67	
		US TREASURY N/B 4.750% 2012/05/31	8,120,000	8,565,965.66	
		US TREASURY N/B 1.875% 2012/06/15	30,000,000	30,576,562.50	
		US TREASURY N/B 0.625% 2012/06/30	16,050,000	16,095,140.62	
		US TREASURY N/B 1.500% 2012/07/15	13,000,000	13,191,953.19	
		US TREASURY N/B 0.625% 2012/07/31	5,000,000	5,011,718.75	
		US TREASURY N/B 4.625% 2012/07/31	2,910,000	3,081,871.87	
		US TREASURY N/B 1.750% 2012/08/15	40,000,000	40,734,375.20	
		US TREASURY N/B 4.375% 2012/08/15	7,100,000	7,502,703.12	
		US TREASURY N/B 0.375% 2012/08/31	5,000,000	4,989,062.50	
		US TREASURY N/B 4.125% 2012/08/31	7,200,000	7,593,187.53	
		US TREASURY N/B 1.375% 2012/09/15	12,700,000	12,858,750.00	
		US TREASURY N/B 0.375% 2012/09/30	18,600,000	18,541,875.00	
		US TREASURY N/B 4.250% 2012/09/30	9,140,000	9,680,545.35	
		US TREASURY N/B 1.375% 2012/10/15	2,000,000	2,024,843.76	
		US TREASURY N/B 0.375% 2012/10/31	10,000,000	9,957,031.30	
		US TREASURY N/B 3.875% 2012/10/31	18,200,000	19,209,531.25	
		US TREASURY N/B 1.375% 2012/11/15	4,000,000	4,048,750.00	
		US TREASURY N/B 4.000% 2012/11/15	17,000,000	17,980,156.25	
		US TREASURY N/B 0.500% 2012/11/30	15,000,000	14,954,296.95	
		US TREASURY N/B 1.125% 2012/12/15	9,000,000	9,066,093.75	
		US TREASURY N/B 2.875% 2013/01/31	17,740,000	18,481,476.65	
		US TREASURY N/B 1.375% 2013/02/15	1,000,000	1,011,406.25	
		US TREASURY N/B 3.875% 2013/02/15	11,200,000	11,896,500.00	
		US TREASURY N/B 2.750% 2013/02/28	15,630,000	16,245,431.25	
		US TREASURY N/B 1.375% 2013/03/15	9,880,000	9,990,378.17	
		US TREASURY N/B 1.750% 2013/04/15	24,000,000	24,466,875.12	
		US TREASURY N/B 3.125% 2013/04/30	12,700,000	13,336,984.37	
		US TREASURY N/B 1.375% 2013/05/15	10,000,000	10,110,156.30	
		US TREASURY N/B 3.625% 2013/05/15	10,000,000	10,609,375.00	
		US TREASURY N/B 1.125% 2013/06/15	11,410,000	11,461,701.56	
		US TREASURY N/B 1.000% 2013/07/15	17,030,000	17,041,974.30	
		US TREASURY N/B 3.375% 2013/07/31	17,810,000	18,857,728.99	
		US TREASURY N/B 0.750% 2013/08/15	15,000,000	14,903,906.25	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B 4.250% 2013/08/15	6,930,000	7,482,234.37	
		US TREASURY N/B 3.125% 2013/08/31	3,210,000	3,379,778.92	

		US TREASURY N/B	0.750%	2013/09/15	15,000,000	14,880,468.75	
		US TREASURY N/B	0.500%	2013/10/15	13,700,000	13,480,586.00	
		US TREASURY N/B	2.750%	2013/10/31	21,600,000	22,521,375.00	
		US TREASURY N/B	0.500%	2013/11/15	15,000,000	14,733,984.45	
		US TREASURY N/B	4.250%	2013/11/15	11,250,000	12,209,765.62	
		US TREASURY N/B	2.000%	2013/11/30	6,500,000	6,644,218.75	
		US TREASURY N/B	1.500%	2013/12/31	40,120,000	40,427,168.75	
		US TREASURY N/B	1.750%	2014/01/31	18,900,000	19,167,257.90	
		US TREASURY N/B	4.000%	2014/02/15	4,000,000	4,324,375.00	
		US TREASURY N/B	1.875%	2014/02/28	2,000,000	2,033,125.00	
		US TREASURY N/B	1.750%	2014/03/31	13,000,000	13,154,375.00	
		US TREASURY N/B	1.875%	2014/04/30	6,880,000	6,981,050.00	
		US TREASURY N/B	4.750%	2014/05/15	9,300,000	10,292,484.37	
		US TREASURY N/B	2.250%	2014/05/31	5,000,000	5,130,468.75	
		US TREASURY N/B	2.625%	2014/06/30	13,000,000	13,493,593.75	
		US TREASURY N/B	2.625%	2014/07/31	32,650,000	33,859,070.31	
		US TREASURY N/B	4.250%	2014/08/15	12,550,000	13,716,757.81	
		US TREASURY N/B	2.375%	2014/08/31	26,000,000	26,702,812.50	
		US TREASURY N/B	2.375%	2014/09/30	12,150,000	12,467,988.34	
		US TREASURY N/B	2.375%	2014/10/31	15,950,000	16,351,242.18	
		US TREASURY N/B	4.250%	2014/11/15	9,230,000	10,115,503.12	
		US TREASURY N/B	2.125%	2014/11/30	11,400,000	11,574,562.50	
		US TREASURY N/B	2.625%	2014/12/31	24,980,000	25,823,075.00	
		US TREASURY N/B	2.250%	2015/01/31	20,900,000	21,283,711.04	
		US TREASURY N/B	11.250%	2015/02/15	2,550,000	3,483,140.62	
		US TREASURY N/B	4.000%	2015/02/15	10,020,000	10,884,225.00	
		US TREASURY N/B	2.375%	2015/02/28	14,000,000	14,306,250.00	
		US TREASURY N/B	2.500%	2015/03/31	10,000,000	10,258,593.80	
		US TREASURY N/B	2.500%	2015/04/30	8,930,000	9,146,971.13	
		US TREASURY N/B	4.125%	2015/05/15	7,040,000	7,680,200.00	
		US TREASURY N/B	2.125%	2015/05/31	6,950,000	7,002,125.00	
		US TREASURY N/B	1.875%	2015/06/30	17,900,000	17,817,492.27	
		US TREASURY N/B	1.750%	2015/07/31	2,000,000	1,976,406.26	
		US TREASURY N/B	4.250%	2015/08/15	6,000,000	6,575,625.00	
		US TREASURY N/B	1.250%	2015/08/31	9,690,000	9,342,522.70	
		US TREASURY N/B	1.250%	2015/09/30	21,980,000	21,145,446.87	
		US TREASURY N/B	1.250%	2015/10/31	10,000,000	9,593,750.00	
		US TREASURY N/B	4.500%	2015/11/15	19,000,000	21,018,750.00	
		US TREASURY N/B	1.375%	2015/11/30	25,000,000	24,066,406.25	
		US TREASURY N/B	2.125%	2015/12/31	11,000,000	10,944,140.68	
		US TREASURY N/B	4.500%	2016/02/15	7,700,000	8,516,921.87	
		US TREASURY N/B	2.625%	2016/02/29	27,900,000	28,327,218.75	
		US TREASURY N/B	2.375%	2016/03/31	7,900,000	7,907,406.25	
		US TREASURY N/B	5.125%	2016/05/15	22,000,000	25,007,812.50	
		US TREASURY N/B	7.250%	2016/05/15	1,670,000	2,074,714.06	
		US TREASURY N/B	3.250%	2016/07/31	3,560,000	3,702,400.00	
		US TREASURY N/B	4.875%	2016/08/15	6,750,000	7,593,750.00	
		US TREASURY N/B	3.000%	2016/08/31	20,000,000	20,509,375.00	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B	3.000%	2016/09/30	4,000,000	4,098,125.00	
		US TREASURY N/B	3.125%	2016/10/31	5,400,000	5,558,625.00	
		US TREASURY N/B	4.625%	2016/11/15	7,450,000	8,276,484.37	
		US TREASURY N/B	7.500%	2016/11/15	8,250,000	10,441,406.25	
		US TREASURY N/B	2.750%	2016/11/30	15,500,000	15,613,828.12	
		US TREASURY N/B	3.250%	2016/12/31	9,800,000	10,126,156.25	

		US TREASURY N/B	3.125%	2017/01/31	5,000,000	5,127,343.75	
		US TREASURY N/B	4.625%	2017/02/15	23,500,000	26,099,687.50	
		US TREASURY N/B	3.000%	2017/02/28	10,000,000	10,178,125.00	
		US TREASURY N/B	3.250%	2017/03/31	15,300,000	15,763,781.25	
		US TREASURY N/B	3.125%	2017/04/30	4,900,000	5,005,656.25	
		US TREASURY N/B	4.500%	2017/05/15	15,530,000	17,116,971.87	
		US TREASURY N/B	8.750%	2017/05/15	5,200,000	7,016,750.00	
		US TREASURY N/B	2.750%	2017/05/31	9,900,000	9,879,890.62	
		US TREASURY N/B	2.500%	2017/06/30	11,900,000	11,682,453.12	
		US TREASURY N/B	2.375%	2017/07/31	10,000,000	9,732,812.50	
		US TREASURY N/B	1.875%	2017/08/31	2,000,000	1,880,937.50	
		US TREASURY N/B	1.875%	2017/09/30	5,010,000	4,698,440.62	
		US TREASURY N/B	1.875%	2017/10/31	4,900,000	4,588,390.62	
		US TREASURY N/B	4.250%	2017/11/15	4,350,000	4,717,710.93	
		US TREASURY N/B	2.250%	2017/11/30	2,000,000	1,916,250.00	
		US TREASURY N/B	2.750%	2017/12/31	11,000,000	10,864,218.75	
		US TREASURY N/B	3.500%	2018/02/15	4,000,000	4,137,500.00	
		US TREASURY N/B	3.875%	2018/05/15	24,760,000	26,164,356.25	
		US TREASURY N/B	4.000%	2018/08/15	3,100,000	3,292,781.25	
		US TREASURY N/B	3.750%	2018/11/15	16,840,000	17,553,068.75	
		US TREASURY N/B	2.750%	2019/02/15	26,000,000	25,146,875.00	
		US TREASURY N/B	3.125%	2019/05/15	46,920,000	46,443,468.75	
		US TREASURY N/B	3.625%	2019/08/15	18,400,000	18,842,750.00	
		US TREASURY N/B	8.125%	2019/08/15	9,600,000	13,108,500.00	
		US TREASURY N/B	3.375%	2019/11/15	31,570,000	31,599,596.87	
		US TREASURY N/B	3.625%	2020/02/15	27,430,000	27,880,023.43	
		US TREASURY N/B	3.500%	2020/05/15	14,550,000	14,586,375.00	
		US TREASURY N/B	2.625%	2020/08/15	11,000,000	10,192,187.50	
		US TREASURY N/B	8.750%	2020/08/15	6,800,000	9,739,937.50	
		US TREASURY N/B	2.625%	2020/11/15	15,000,000	13,825,781.25	
		US TREASURY N/B	7.875%	2021/02/15	2,030,000	2,776,976.56	
		US TREASURY N/B	8.125%	2021/05/15	1,000,000	1,392,343.75	
		US TREASURY N/B	8.125%	2021/08/15	1,750,000	2,442,617.18	
		US TREASURY N/B	8.000%	2021/11/15	8,400,000	11,649,750.00	
		US TREASURY N/B	7.250%	2022/08/15	7,000,000	9,275,000.00	
		US TREASURY N/B	7.125%	2023/02/15	2,850,000	3,745,078.12	
		US TREASURY N/B	6.250%	2023/08/15	6,860,000	8,426,009.37	
		US TREASURY N/B	7.500%	2024/11/15	4,690,000	6,397,453.12	
		US TREASURY N/B	7.625%	2025/02/15	1,200,000	1,656,187.50	
		US TREASURY N/B	6.875%	2025/08/15	3,850,000	5,000,789.06	
		US TREASURY N/B	6.000%	2026/02/15	1,940,000	2,326,484.37	
		US TREASURY N/B	6.750%	2026/08/15	1,000,000	1,287,812.50	
		US TREASURY N/B	6.500%	2026/11/15	5,150,000	6,482,562.50	
		US TREASURY N/B	6.625%	2027/02/15	2,500,000	3,186,718.75	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B 6.375% 2027/08/15	1,640,000	2,043,337.50	
		US TREASURY N/B 6.125% 2027/11/15	6,700,000	8,143,640.62	
		US TREASURY N/B 5.500% 2028/08/15	9,660,000	10,983,721.87	
		US TREASURY N/B 5.250% 2028/11/15	5,160,000	5,700,187.50	
		US TREASURY N/B 5.250% 2029/02/15	2,000,000	2,209,062.50	
		US TREASURY N/B 6.125% 2029/08/15	2,200,000	2,678,843.75	
		US TREASURY N/B 6.250% 2030/05/15	3,520,000	4,351,600.00	
		US TREASURY N/B 5.375% 2031/02/15	6,780,000	7,584,065.62	
		US TREASURY N/B 4.500% 2036/02/15	7,840,000	7,689,325.00	
		US TREASURY N/B 4.750% 2037/02/15	6,150,000	6,250,898.43	

		US TREASURY N/B	5.000%	2037/05/15	7,230,000	7,625,390.62	
		US TREASURY N/B	4.375%	2038/02/15	6,100,000	5,821,687.50	
		US TREASURY N/B	4.500%	2038/05/15	9,500,000	9,247,656.25	
		US TREASURY N/B	3.500%	2039/02/15	17,420,000	14,134,696.87	
		US TREASURY N/B	4.250%	2039/05/15	8,710,000	8,092,134.37	
		US TREASURY N/B	4.500%	2039/08/15	19,450,000	18,845,226.56	
		US TREASURY N/B	4.375%	2039/11/15	14,800,000	14,029,937.50	
		US TREASURY N/B	4.625%	2040/02/15	14,900,000	14,725,390.62	
		US TREASURY N/B	4.375%	2040/05/15	11,800,000	11,169,437.50	
		US TREASURY N/B	3.875%	2040/08/15	20,330,000	17,614,039.06	
		US TREASURY N/B	4.250%	2040/11/15	14,820,000	13,720,078.12	
		米ドル 小計			1,913,040,000	1,973,721,460.54 (163,996,516,156)	
カナダドル	国債証券	CANADA-GOV'T	1.500%	2012/03/01	3,700,000	3,701,998.00	
		CANADA-GOV'T	1.500%	2012/06/01	1,940,000	1,938,389.80	
		CANADA-GOV'T	3.750%	2012/06/01	1,090,000	1,119,855.10	
		CANADA-GOV'T	5.250%	2012/06/01	8,030,000	8,401,146.60	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2012/09/01	6,320,000	6,350,146.40	
		CANADA-GOV'T	1.500%	2012/12/01	6,300,000	6,267,744.00	
		CANADA-GOV'T	1.750%	2013/03/01	3,850,000	3,839,605.00	
		CANADA-GOV'T	3.500%	2013/06/01	2,590,000	2,677,049.90	
		CANADA-GOV'T	5.250%	2013/06/01	7,160,000	7,678,598.80	
		CANADA-GOV'T	2.500%	2013/09/01	3,810,000	3,849,319.20	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2014/03/01	1,000,000	992,320.00	
		CANADA-GOV'T	3.000%	2014/06/01	8,100,000	8,264,754.00	
		CANADA-GOV'T	5.000%	2014/06/01	3,740,000	4,051,990.80	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2014/12/01	8,010,000	7,871,026.50	
		CANADA-GOV'T	2.500%	2015/06/01	1,900,000	1,890,975.00	
		CANADA-GOV'T	4.500%	2015/06/01	4,490,000	4,832,272.70	
		CANADA-GOV'T	3.000%	2015/12/01	2,210,000	2,234,089.00	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2016/06/01	5,570,000	5,881,028.80	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2017/06/01	4,950,000	5,218,834.50	
		CANADA-GOV'T	4.250%	2018/06/01	3,200,000	3,413,408.00	
		CANADA-GOV'T	3.750%	2019/06/01	9,440,000	9,697,712.00	
		CANADA-GOV'T	3.500%	2020/06/01	4,310,000	4,320,344.00	
		CANADA-GOV'T	3.250%	2021/06/01	2,380,000	2,316,120.80	
		CANADA-GOV'T	8.000%	2023/06/01	2,200,000	3,136,892.00	
		CANADA-GOV'T	9.000%	2025/06/01	600,000	948,282.00	
		CANADA-GOV'T	8.000%	2027/06/01	3,190,000	4,807,744.70	
		CANADA-GOV'T	5.750%	2029/06/01	5,160,000	6,442,672.80	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
カナダドル	国債証券	CANADA-GOV'T	5.750%	2033/06/01	5,660,000	7,214,292.60	
		CANADA-GOV'T	5.000%	2037/06/01	5,910,000	6,960,266.10	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2041/06/01	6,180,000	6,334,500.00	
	カナダドル 小計				132,990,000	142,653,379.10 (12,022,826,790)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEXICAN BONOS	7.500%	2012/06/21	42,230,000	43,708,894.60	
		MEXICAN BONOS	9.000%	2012/12/20	41,510,000	44,262,943.20	
		MEXICAN BONOS	9.000%	2013/06/20	41,350,000	44,518,237.00	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2013/12/19	34,010,000	35,962,854.20	
		MEXICAN BONOS	7.000%	2014/06/19	16,970,000	17,431,074.90	
		MEXICAN BONOS	9.500%	2014/12/18	41,220,000	45,621,883.80	
		MEXICAN BONOS	6.000%	2015/06/18	19,390,000	18,978,350.30	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2015/12/17	17,840,000	18,803,003.20	
		MEXICAN BONOS	7.250%	2016/12/15	22,890,000	23,287,828.20	

		MEXICAN BONOS	7.750%	2017/12/14	28,250,000	29,291,295.00	
		MEXICAN BONOS	8.500%	2018/12/13	16,620,000	17,873,646.60	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2020/06/11	37,660,000	38,987,891.60	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2023/12/07	10,140,000	10,343,205.60	
		MEXICAN BONOS	10.000%	2024/12/05	33,460,000	39,785,947.60	
		MEXICAN BONOS	7.500%	2027/06/03	37,480,000	35,753,671.20	
		MEXICAN BONOS	8.500%	2029/05/31	27,900,000	28,827,954.00	
		MEXICAN BONOS	10.000%	2036/11/20	26,350,000	31,005,518.00	
		MEXICAN BONOS	8.500%	2038/11/18	22,970,000	23,259,422.00	
		メキシコペソ 小計			518,240,000	547,703,621.00 (3,790,109,057)	
ユーロ	国債証券 (ベルギー)	BELGIAN 0262	8.000%	2012/12/24	3,120,000	3,437,304.00	
		BELGIAN 0282	8.000%	2015/03/28	2,160,000	2,552,472.00	
		BELGIAN 0291	5.500%	2028/03/28	5,990,000	6,663,276.00	
		BELGIAN 0298	5.000%	2012/09/28	5,510,000	5,761,256.00	
		BELGIAN 0300	5.500%	2017/09/28	2,550,000	2,798,115.00	
		BELGIAN 0301	4.250%	2013/09/28	5,840,000	6,080,608.00	
		BELGIAN 0303	4.250%	2014/09/28	3,400,000	3,542,800.00	
		BELGIAN 0304	5.000%	2035/03/28	5,680,000	5,991,264.00	
		BELGIAN 0306	3.750%	2015/09/28	5,840,000	5,933,440.00	
		BELGIAN 0307	3.250%	2016/09/28	5,820,000	5,711,166.00	
		BELGIAN 0308	4.000%	2022/03/28	4,970,000	4,853,702.00	
		BELGIAN 0309	4.000%	2017/03/28	5,640,000	5,717,268.00	
		BELGIAN 0310	4.000%	2013/03/28	5,320,000	5,493,964.00	
		BELGIAN 0312	4.000%	2018/03/28	4,620,000	4,657,422.00	
		BELGIAN 0314	4.000%	2014/03/28	5,220,000	5,398,524.00	
		BELGIAN 0315	4.000%	2019/03/28	3,360,000	3,363,696.00	
		BELGIAN 0316	3.500%	2015/03/28	5,020,000	5,074,216.00	
		BELGIAN 0317	2.000%	2012/03/28	2,570,000	2,580,280.00	
		BELGIAN 0318	3.750%	2020/09/28	7,610,000	7,365,719.00	
		BELGIAN 0319	2.750%	2016/03/28	2,600,000	2,508,740.00	
		BELGIAN 0320	4.250%	2041/03/28	1,960,000	1,830,640.00	
		BELGIAN 0321	4.250%	2021/09/28	1,200,000	1,202,160.00	
	国債証券 (イタリア)	BTPS	5.000%	2012/02/01	4,350,000	4,479,543.00	
		BTPS	3.000%	2012/03/01	8,900,000	8,999,235.00	
		BTPS	4.000%	2012/04/15	12,350,000	12,621,823.50	

通貨	種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券 (イタリア)	BTPS	2.500% 2012/07/01	6,260,000	6,288,858.60	
		BTPS	4.250% 2012/10/15	9,900,000	10,200,465.00	
		BTPS	2.000% 2012/12/15	7,550,000	7,495,640.00	
		BTPS	4.750% 2013/02/01	10,240,000	10,650,521.60	
		BTPS	4.250% 2013/04/15	4,760,000	4,906,132.00	
		BTPS	2.000% 2013/06/01	4,460,000	4,377,490.00	
		BTPS	4.250% 2013/08/01	13,970,000	14,401,673.00	
		BTPS	2.250% 2013/11/01	590,000	577,551.00	
		BTPS	3.750% 2013/12/15	8,210,000	8,357,780.00	
		BTPS	3.500% 2014/06/01	12,020,000	12,100,534.00	
		BTPS	4.250% 2014/08/01	4,170,000	4,291,347.00	
		BTPS	4.250% 2015/02/01	14,730,000	15,123,291.00	
		BTPS	3.000% 2015/04/15	7,750,000	7,584,150.00	
		BTPS	3.000% 2015/06/15	1,880,000	1,833,188.00	
		BTPS	3.750% 2015/08/01	15,140,000	15,214,186.00	
		BTPS	3.000% 2015/11/01	1,800,000	1,741,500.00	
		BTPS	3.750% 2016/08/01	7,750,000	7,736,050.00	
		BTPS	4.000% 2017/02/01	11,380,000	11,405,036.00	

		BTPS	5.250%	2017/08/01	13,570,000	14,443,908.00	
		BTPS	4.500%	2018/02/01	7,060,000	7,176,490.00	
		BTPS	4.500%	2018/08/01	6,760,000	6,830,304.00	
		BTPS	4.250%	2019/02/01	5,520,000	5,469,216.00	
		BTPS	4.500%	2019/03/01	11,620,000	11,686,234.00	
		BTPS	4.250%	2019/09/01	16,760,000	16,488,488.00	
		BTPS	4.500%	2020/02/01	15,820,000	15,753,556.00	
		BTPS	4.250%	2020/03/01	6,310,000	6,143,416.00	
		BTPS	4.000%	2020/09/01	1,420,000	1,350,704.00	
		BTPS	3.750%	2021/03/01	5,780,000	5,334,940.00	
		BTPS	3.750%	2021/08/01	14,100,000	13,025,580.00	
		BTPS	4.750%	2023/08/01	3,830,000	3,773,699.00	
		BTPS	9.000%	2023/11/01	6,170,000	8,440,560.00	
		BTPS	5.000%	2025/03/01	9,370,000	9,277,237.00	
		BTPS	4.500%	2026/03/01	3,000,000	2,805,900.00	
		BTPS	7.250%	2026/11/01	4,000,000	4,844,000.00	
		BTPS	6.500%	2027/11/01	11,920,000	13,463,640.00	
		BTPS	5.250%	2029/11/01	11,380,000	11,329,928.00	
		BTPS	6.000%	2031/05/01	12,330,000	13,193,100.00	
		BTPS	5.750%	2033/02/01	6,980,000	7,277,348.00	
		BTPS	5.000%	2034/08/01	8,250,000	7,841,625.00	
		BTPS	4.000%	2037/02/01	9,960,000	8,161,224.00	
		BTPS	5.000%	2039/08/01	8,320,000	7,808,320.00	
		BTPS	5.000%	2040/09/01	6,140,000	5,747,040.00	
	国債証券 (ドイツ)	BUNDESUBL-150	4.000%	2012/04/13	8,210,000	8,478,467.00	
		BUNDESUBL-151	4.250%	2012/10/12	6,530,000	6,839,456.70	
		BUNDESUBL-152	3.500%	2013/04/12	8,050,000	8,387,697.50	
		BUNDESUBL-153	4.000%	2013/10/11	10,750,000	11,416,500.00	
		BUNDESUBL-154	2.250%	2014/04/11	9,740,000	9,894,866.00	
		BUNDESUBL-155	2.500%	2014/10/10	4,000,000	4,086,400.00	
		BUNDESUBL-156	2.500%	2015/02/27	9,270,000	9,434,079.00	
		BUNDESUBL-157	2.250%	2015/04/10	6,190,000	6,231,163.50	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券 (ドイツ)	BUNDESUBL-158	1.750%	2015/10/09	7,930,000	7,753,954.00	
		BUNDESUBL-159	2.000%	2016/02/26	1,280,000	1,259,392.00	
		BUNDESSCHATZANW	1.000%	2012/03/16	8,780,000	8,776,136.80	
		BUNDESSCHATZANW	0.500%	2012/06/15	8,230,000	8,154,284.00	
		BUNDESSCHATZANW	0.750%	2012/09/14	2,020,000	2,005,132.80	
		BUNDESSCHATZANW	1.000%	2012/12/14	1,950,000	1,937,890.50	
		DEUTSCHLAND REP	5.000%	2012/07/04	9,700,000	10,193,730.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.500%	2013/01/04	8,460,000	8,939,682.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.750%	2013/07/04	10,450,000	10,991,310.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.250%	2014/01/04	13,440,000	14,400,960.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.250%	2014/07/04	7,250,000	7,813,687.50	
		DEUTSCHLAND REP	3.750%	2015/01/04	13,360,000	14,213,704.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.250%	2015/07/04	5,660,000	5,920,643.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.500%	2016/01/04	11,440,000	12,049,180.00	
		DEUTSCHLAND REP	6.000%	2016/06/20	1,050,000	1,228,552.50	
		DEUTSCHLAND REP	4.000%	2016/07/04	7,300,000	7,861,370.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.750%	2017/01/04	6,250,000	6,645,937.50	
		DEUTSCHLAND REP	4.250%	2017/07/04	10,010,000	10,917,907.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.000%	2018/01/04	11,460,000	12,314,343.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.250%	2018/07/04	8,170,000	8,906,934.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.750%	2019/01/04	8,730,000	9,193,563.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.500%	2019/07/04	12,390,000	12,746,832.00	

		DEUTSCHLAND REP	3.250%	2020/01/04	11,010,000	11,096,979.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.000%	2020/07/04	6,720,000	6,631,296.00	
		DEUTSCHLAND REP	2.250%	2020/09/04	7,650,000	7,091,550.00	
		DEUTSCHLAND REP	2.500%	2021/01/04	1,800,000	1,689,480.00	
		DEUTSCHLAND REP	6.250%	2024/01/04	4,480,000	5,762,624.00	
		DEUTSCHLAND REP	6.500%	2027/07/04	5,360,000	7,204,376.00	
		DEUTSCHLAND REP	5.625%	2028/01/04	2,870,000	3,543,589.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.750%	2028/07/04	7,940,000	8,942,822.00	
		DEUTSCHLAND REP	6.250%	2030/01/04	2,750,000	3,687,750.00	
		DEUTSCHLAND REP	5.500%	2031/01/04	6,530,000	8,082,834.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.750%	2034/07/04	8,520,000	9,832,080.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.000%	2037/01/04	8,200,000	8,498,480.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.250%	2039/07/04	6,320,000	6,923,560.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.750%	2040/07/04	7,040,000	8,355,072.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.250%	2042/07/04	1,300,000	1,196,650.00	
	国債証券 (フィンランド)	FINNISH GOV'T	4.250%	2012/09/15	2,290,000	2,389,844.00	
		FINNISH GOV'T	5.375%	2013/07/04	2,610,000	2,831,589.00	
		FINNISH GOV'T	3.125%	2014/09/15	2,560,000	2,657,792.00	
		FINNISH GOV'T	4.250%	2015/07/04	2,180,000	2,347,860.00	
		FINNISH GOV'T	1.750%	2016/04/15	1,960,000	1,885,716.00	
		FINNISH GOV'T	3.875%	2017/09/15	2,830,000	2,983,386.00	
		FINNISH GOV'T	4.375%	2019/07/04	2,030,000	2,185,701.00	
		FINNISH GOV'T	3.375%	2020/04/15	2,680,000	2,668,744.00	
		FINNISH GOV'T	4.000%	2025/07/04	2,160,000	2,212,272.00	
	国債証券 (フランス)	BTAN-2YR ISSUE	0.750%	2012/09/20	2,810,000	2,781,338.00	
		BTAN-5YR ISSUE	4.500%	2012/07/12	9,120,000	9,517,632.00	
		BTAN-5YR ISSUE	3.750%	2013/01/12	18,140,000	18,876,484.00	
		BTAN-5YR ISSUE	4.500%	2013/07/12	8,680,000	9,236,388.00	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券 (フランス)	BTAN-5YR ISSUE	2.500%	2014/01/12	5,990,000	6,093,028.00	
		BTAN-5YR ISSUE	3.000%	2014/07/12	8,180,000	8,418,038.00	
		BTAN-5YR ISSUE	2.500%	2015/01/15	8,600,000	8,666,220.00	
		BTAN-5YR ISSUE	2.000%	2015/07/12	4,250,000	4,170,100.00	
		BTAN-5YR ISSUE	2.250%	2016/02/25	1,320,000	1,293,864.00	
		FRANCE O.A.T.	5.000%	2012/04/25	1,290,000	1,347,276.00	
		FRANCE O.A.T.	4.750%	2012/10/25	7,750,000	8,164,625.00	
		FRANCE O.A.T.	8.500%	2012/12/26	2,180,000	2,454,462.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2013/04/25	11,720,000	12,294,280.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2013/10/25	10,700,000	11,295,990.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2014/04/25	13,560,000	14,383,092.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2014/10/25	3,170,000	3,369,710.00	
		FRANCE O.A.T.	3.500%	2015/04/25	11,430,000	11,929,491.00	
		FRANCE O.A.T.	3.000%	2015/10/25	13,300,000	13,543,390.00	
		FRANCE O.A.T.	3.250%	2016/04/25	9,300,000	9,538,080.00	
		FRANCE O.A.T.	5.000%	2016/10/25	10,860,000	12,082,836.00	
		FRANCE O.A.T.	3.750%	2017/04/25	10,340,000	10,789,790.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250%	2017/10/25	8,260,000	8,844,808.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2018/04/25	14,670,000	15,422,571.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250%	2018/10/25	3,470,000	3,703,184.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250%	2019/04/25	11,300,000	12,042,410.00	
		FRANCE O.A.T.	3.750%	2019/10/25	15,150,000	15,524,205.00	
		FRANCE O.A.T.	8.500%	2019/10/25	4,010,000	5,539,815.00	
		FRANCE O.A.T.	3.500%	2020/04/25	4,590,000	4,579,902.00	
		FRANCE O.A.T.	2.500%	2020/10/25	5,500,000	5,019,300.00	
		FRANCE O.A.T.	3.750%	2021/04/25	10,360,000	10,499,860.00	

		FRANCE O.A.T.	8.500%	2023/04/25	5,390,000	7,906,591.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250%	2023/10/25	10,870,000	11,379,803.00	
		FRANCE O.A.T.	6.000%	2025/10/25	5,240,000	6,459,348.00	
		FRANCE O.A.T.	3.500%	2026/04/25	7,480,000	7,089,544.00	
		FRANCE O.A.T.	5.500%	2029/04/25	8,880,000	10,511,256.00	
		FRANCE O.A.T.	5.750%	2032/10/25	8,320,000	10,273,536.00	
		FRANCE O.A.T.	4.750%	2035/04/25	7,330,000	8,084,990.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2038/10/25	10,190,000	10,040,207.00	
		FRANCE O.A.T.	4.500%	2041/04/25	5,190,000	5,519,046.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2055/04/25	6,860,000	6,752,298.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2060/04/25	2,530,000	2,477,123.00	
	国債証券 (アイルランド)	IRISH GOVT	3.900%	2012/03/05	2,010,000	1,980,654.00	
		IRISH GOVT	5.000%	2013/04/18	2,890,000	2,764,718.50	
		IRISH GOVT	4.000%	2014/01/15	4,720,000	4,240,212.00	
		IRISH GOVT	4.600%	2016/04/18	4,120,000	3,434,020.00	
		IRISH GOVT	4.500%	2018/10/18	3,550,000	2,728,530.00	
		IRISH GOVT	4.400%	2019/06/18	3,540,000	2,629,866.00	
		IRISH GOVT	5.900%	2019/10/18	3,440,000	2,824,584.00	
		IRISH GOVT	4.500%	2020/04/18	4,530,000	3,272,925.00	
		IRISH GOVT	5.000%	2020/10/18	2,600,000	1,920,100.00	
		IRISH GOVT	5.400%	2025/03/13	3,330,000	2,375,788.50	
	国債証券 (オランダ)	NETHERLANDS GOVT	5.000%	2012/07/15	6,690,000	7,027,176.00	
		NETHERLANDS GOVT	1.750%	2013/01/15	5,230,000	5,255,104.00	
		NETHERLANDS GOVT	4.250%	2013/07/15	5,420,000	5,745,742.00	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券 (オランダ)	NETHERLANDS GOVT	1.000%	2014/01/15	2,440,000	2,383,392.00	
		NETHERLANDS GOVT	3.750%	2014/07/15	6,890,000	7,273,084.00	
		NETHERLANDS GOVT	2.750%	2015/01/15	5,460,000	5,563,740.00	
		NETHERLANDS GOVT	3.250%	2015/07/15	4,460,000	4,621,006.00	
		NETHERLANDS GOVT	4.000%	2016/07/15	5,350,000	5,704,170.00	
		NETHERLANDS GOVT	4.500%	2017/07/15	5,320,000	5,795,608.00	
		NETHERLANDS GOVT	4.000%	2018/07/15	4,320,000	4,563,648.00	
		NETHERLANDS GOVT	4.000%	2019/07/15	7,900,000	8,311,590.00	
		NETHERLANDS GOVT	3.500%	2020/07/15	4,650,000	4,680,225.00	
		NETHERLANDS GOVT	3.750%	2023/01/15	4,420,000	4,475,250.00	
		NETHERLANDS GOVT	7.500%	2023/01/15	1,660,000	2,284,658.00	
		NETHERLANDS GOVT	5.500%	2028/01/15	4,590,000	5,546,097.00	
		NETHERLANDS GOVT	4.000%	2037/01/15	4,870,000	5,000,516.00	
		NETHERLANDS GOVT	3.750%	2042/01/15	2,940,000	2,919,714.00	
	国債証券 (ポルトガル)	PORTUGUESE OT'S	5.000%	2012/06/15	3,650,000	3,662,227.50	
		PORTUGUESE OT'S	5.450%	2013/09/23	3,240,000	3,226,878.00	
		PORTUGUESE OT'S	4.375%	2014/06/16	3,080,000	2,897,510.00	
		PORTUGUESE OT'S	3.600%	2014/10/15	2,520,000	2,283,246.00	
		PORTUGUESE OT'S	3.350%	2015/10/15	4,040,000	3,504,296.00	
		PORTUGUESE OT'S	4.200%	2016/10/15	2,660,000	2,321,116.00	
		PORTUGUESE OT'S	4.350%	2017/10/16	2,490,000	2,118,865.50	
		PORTUGUESE OT'S	4.450%	2018/06/15	2,740,000	2,299,134.00	
		PORTUGUESE OT'S	4.750%	2019/06/14	3,830,000	3,221,796.00	
		PORTUGUESE OT'S	4.800%	2020/06/15	3,030,000	2,495,053.50	
		PORTUGUESE OT'S	3.850%	2021/04/15	2,970,000	2,236,113.00	
		PORTUGUESE OT'S	4.950%	2023/10/25	2,970,000	2,361,892.50	
		PORTUGUESE OT'S	4.100%	2037/04/15	2,890,000	1,997,712.50	
	国債証券 (オーストリア)	REP OF AUSTRIA	5.000%	2012/07/15	3,830,000	4,023,032.00	
		REP OF AUSTRIA	3.800%	2013/10/20	5,340,000	5,605,932.00	
		REP OF AUSTRIA	4.300%	2014/07/15	4,180,000	4,464,658.00	

		REP OF AUSTRIA	3.400%	2014/10/20	4,110,000	4,270,290.00	
		REP OF AUSTRIA	3.500%	2015/07/15	4,890,000	5,080,221.00	
		REP OF AUSTRIA	4.000%	2016/09/15	4,360,000	4,607,212.00	
		REP OF AUSTRIA	3.200%	2017/02/20	2,550,000	2,577,795.00	
		REP OF AUSTRIA	4.300%	2017/09/15	2,310,000	2,466,156.00	
		REP OF AUSTRIA	4.650%	2018/01/15	4,580,000	4,987,620.00	
		REP OF AUSTRIA	4.350%	2019/03/15	5,310,000	5,660,991.00	
		REP OF AUSTRIA	3.900%	2020/07/15	4,560,000	4,679,016.00	
		REP OF AUSTRIA	3.500%	2021/09/15	5,490,000	5,403,807.00	
		REP OF AUSTRIA	3.650%	2022/04/20	1,920,000	1,905,984.00	
		REP OF AUSTRIA	4.850%	2026/03/15	2,300,000	2,518,270.00	
		REP OF AUSTRIA	6.250%	2027/07/15	3,470,000	4,395,102.00	
		REP OF AUSTRIA	4.150%	2037/03/15	3,660,000	3,669,150.00	
	国債証券 (スペイン)	SPANISH GOV'T	2.750%	2012/04/30	4,920,000	4,948,536.00	
		SPANISH GOV'T	5.000%	2012/07/30	7,070,000	7,313,915.00	
		SPANISH GOV'T	3.900%	2012/10/31	9,790,000	9,966,220.00	
		SPANISH GOV'T	6.150%	2013/01/31	6,550,000	6,933,830.00	
		SPANISH GOV'T	2.300%	2013/04/30	6,610,000	6,497,630.00	
		SPANISH GOV'T	4.200%	2013/07/30	2,210,000	2,258,178.00	
		SPANISH GOV'T	2.500%	2013/10/31	2,630,000	2,568,458.00	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券 (スペイン)	SPANISH GOV'T	4.250%	2014/01/31	4,840,000	4,942,124.00	
		SPANISH GOV'T	4.750%	2014/07/30	4,260,000	4,407,396.00	
		SPANISH GOV'T	3.300%	2014/10/31	8,840,000	8,702,980.00	
		SPANISH GOV'T	4.400%	2015/01/31	6,640,000	6,755,536.00	
		SPANISH GOV'T	3.000%	2015/04/30	4,240,000	4,064,888.00	
		SPANISH GOV'T	3.150%	2016/01/31	6,420,000	6,093,222.00	
		SPANISH GOV'T	3.250%	2016/04/30	2,200,000	2,079,110.00	
		SPANISH GOV'T	3.800%	2017/01/31	3,620,000	3,467,236.00	
		SPANISH GOV'T	5.500%	2017/07/30	7,840,000	8,173,984.00	
		SPANISH GOV'T	4.100%	2018/07/30	5,580,000	5,297,652.00	
		SPANISH GOV'T	4.600%	2019/07/30	5,950,000	5,750,675.00	
		SPANISH GOV'T	4.300%	2019/10/31	5,850,000	5,526,495.00	
		SPANISH GOV'T	4.000%	2020/04/30	8,910,000	8,188,290.00	
		SPANISH GOV'T	4.850%	2020/10/31	2,900,000	2,819,960.00	
		SPANISH GOV'T	5.500%	2021/04/30	3,190,000	3,221,262.00	
		SPANISH GOV'T	4.800%	2024/01/31	5,930,000	5,515,493.00	
		SPANISH GOV'T	4.650%	2025/07/30	6,250,000	5,589,375.00	
		SPANISH GOV'T	6.000%	2029/01/31	7,160,000	7,249,500.00	
		SPANISH GOV'T	5.750%	2032/07/30	5,680,000	5,552,200.00	
		SPANISH GOV'T	4.200%	2037/01/31	6,210,000	4,776,732.00	
		SPANISH GOV'T	4.900%	2040/07/30	4,980,000	4,247,940.00	
		SPANISH GOV'T	4.700%	2041/07/30	3,840,000	3,144,192.00	
	ユーロ 小計				1,528,070,000	1,566,498,399.50 (178,157,862,975)	
英ポンド	国債証券	TREASURY	5.000%	2012/03/07	15,270,000	15,902,636.10	
		TREASURY	5.250%	2012/06/07	5,450,000	5,737,760.00	
		TREASURY	4.500%	2013/03/07	10,040,000	10,631,757.60	
		TREASURY	8.000%	2013/09/27	4,370,000	5,080,037.60	
		TREASURY	2.250%	2014/03/07	11,270,000	11,342,128.00	
		TREASURY	5.000%	2014/09/07	7,730,000	8,441,933.00	
		TREASURY	2.750%	2015/01/22	9,490,000	9,582,622.40	
		TREASURY	4.750%	2015/09/07	10,460,000	11,382,990.40	
		TREASURY	8.000%	2015/12/07	1,730,000	2,141,740.00	
		TREASURY	2.000%	2016/01/22	2,770,000	2,661,970.00	

	TREASURY	4.000%	2016/09/07	8,610,000	9,054,448.20	
	TREASURY	8.750%	2017/08/25	3,870,000	5,150,350.80	
	TREASURY	5.000%	2018/03/07	8,620,000	9,486,310.00	
	TREASURY	4.500%	2019/03/07	5,210,000	5,514,264.00	
	TREASURY	3.750%	2019/09/07	14,590,000	14,590,000.00	
	TREASURY	4.750%	2020/03/07	6,070,000	6,501,995.83	
	TREASURY	3.750%	2020/09/07	5,160,000	5,103,394.80	
	TREASURY	8.000%	2021/06/07	4,670,000	6,270,507.07	
	TREASURY	4.000%	2022/03/07	5,930,000	5,907,525.30	
	TREASURY	5.000%	2025/03/07	6,090,000	6,597,906.00	
	TREASURY	4.250%	2027/12/07	6,190,000	6,109,653.80	
	TREASURY	6.000%	2028/12/07	4,730,000	5,694,636.20	
	TREASURY	4.750%	2030/12/07	6,850,000	7,115,506.00	
	TREASURY	4.250%	2032/06/07	9,630,000	9,350,248.50	
	TREASURY	4.500%	2034/09/07	2,970,000	2,968,218.00	
	TREASURY	4.250%	2036/03/07	7,210,000	6,944,672.00	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
英ポンド	国債証券	TREASURY	4.750%	2038/12/07	10,570,000	11,036,137.00	
		TREASURY	4.250%	2039/09/07	5,630,000	5,439,480.80	
		TREASURY	4.250%	2040/12/07	3,050,000	2,935,686.00	
		TREASURY	4.500%	2042/12/07	5,980,000	6,015,939.80	
		TREASURY	4.250%	2046/12/07	8,010,000	7,753,680.00	
		TREASURY	4.250%	2049/12/07	7,700,000	7,469,231.00	
		TREASURY	4.250%	2055/12/07	8,420,000	8,244,358.80	
		TREASURY	4.000%	2060/01/22	1,870,000	1,737,510.50	
	英ポンド 小計				236,210,000	245,897,235.50 (33,186,290,903)	
スイスフラン	国債証券	SWISS (GOVT)	2.750%	2012/06/10	3,270,000	3,368,427.00	
		SWISS (GOVT)	4.000%	2013/02/11	2,970,000	3,168,396.00	
		SWISS (GOVT)	4.250%	2014/01/06	1,910,000	2,095,461.00	
		SWISS (GOVT)	2.500%	2016/03/12	2,650,000	2,814,300.00	
		SWISS (GOVT)	4.250%	2017/06/05	2,450,000	2,859,150.00	
		SWISS (GOVT)	3.000%	2018/01/08	2,750,000	3,010,425.00	
		SWISS (GOVT)	3.000%	2019/05/12	2,250,000	2,475,225.00	
		SWISS (GOVT)	4.000%	2023/02/11	1,810,000	2,186,480.00	
		SWISS (GOVT)	4.000%	2028/04/08	2,250,000	2,837,250.00	
	スイスフラン 小計				22,310,000	24,815,114.00 (2,181,992,974)	
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDEN GOVT	5.500%	2012/10/08	25,960,000	27,351,456.00	
		SWEDEN GOVT	6.750%	2014/05/05	33,380,000	37,422,318.00	
		SWEDEN GOVT	4.500%	2015/08/12	24,350,000	25,806,130.00	
		SWEDEN GOVT	3.000%	2016/07/12	18,050,000	17,912,820.00	
		SWEDEN GOVT	3.750%	2017/08/12	20,450,000	21,036,915.00	
		SWEDEN GOVT	4.250%	2019/03/12	35,190,000	37,473,831.00	
		SWEDEN GOVT	5.000%	2020/12/01	36,160,000	41,019,904.00	
		SWEDEN GOVT	3.500%	2039/03/30	16,470,000	15,638,265.00	
	スウェーデンクローナ 小計				210,010,000	223,661,639.00 (2,907,601,307)	
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOV'T	6.500%	2013/05/15	24,300,000	26,336,340.00	
		NORWEGIAN GOV'T	5.000%	2015/05/15	20,040,000	21,543,000.00	
		NORWEGIAN GOV'T	4.250%	2017/05/19	15,240,000	15,902,940.00	
		NORWEGIAN GOV'T	4.500%	2019/05/22	10,250,000	10,834,250.00	
	ノルウェークローネ 小計				69,830,000	74,616,530.00 (1,092,385,999)	
デンマーク	国債証券	DENMARK - BULLET	4.000%	2012/11/15	32,020,000	33,396,860.00	

クローネ		DENMARK - BULLET	5.000%	2013/11/15	34,500,000	37,294,500.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2015/11/15	34,560,000	36,785,664.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2017/11/15	21,930,000	23,337,906.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2019/11/15	35,340,000	37,283,700.00	
		DENMARK - BULLET	7.000%	2024/11/10	11,030,000	15,149,705.00	
		DENMARK - BULLET	4.500%	2039/11/15	40,410,000	46,693,755.00	
	デンマーククローネ 小計				209,790,000	229,942,090.00 (3,508,916,293)	
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVT BOND	4.750%	2012/04/25	15,100,000	15,105,285.00	
		POLAND GOVT BOND	0.000%	2012/07/25	10,310,000	9,627,478.00	
		POLAND GOVT BOND	0.000%	2012/10/25	6,020,000	5,543,216.00	
		POLAND GOVT BOND	0.000%	2013/01/25	5,610,000	5,092,477.50	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVT BOND	5.250%	2013/04/25	8,480,000	8,495,688.00	
		POLAND GOVT BOND	5.000%	2013/10/24	11,430,000	11,353,990.50	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2014/04/25	12,190,000	12,307,633.50	
		POLAND GOVT BOND	5.500%	2015/04/25	9,150,000	9,074,970.00	
		POLAND GOVT BOND	6.250%	2015/10/24	13,470,000	13,743,441.00	
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2017/10/25	11,230,000	10,758,340.00	
		POLAND GOVT BOND	5.500%	2019/10/25	10,190,000	9,688,142.50	
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2020/10/25	8,080,000	7,481,272.00	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2022/09/23	10,830,000	10,259,800.50	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2029/04/25	2,600,000	2,392,390.00	
	ポーランドズロチ 小計				134,690,000	130,924,124.50 (3,811,201,264)	
オーストラリ アドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVT.	5.750%	2012/04/15	6,210,000	6,269,429.70	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.750%	2012/11/15	3,300,000	3,285,084.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.500%	2013/05/15	6,660,000	6,855,537.60	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2013/12/15	2,330,000	2,348,476.90	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.250%	2014/06/15	4,700,000	4,841,282.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.500%	2014/10/21	1,570,000	1,528,520.60	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.250%	2015/04/15	5,710,000	5,906,595.30	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.750%	2016/06/15	2,090,000	2,024,645.70	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.000%	2017/02/15	5,850,000	6,002,275.50	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2018/01/21	1,110,000	1,106,103.90	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.250%	2019/03/15	5,180,000	5,066,972.40	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.500%	2020/04/15	4,610,000	4,246,732.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.750%	2021/05/15	4,240,000	4,274,132.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.750%	2022/07/15	2,070,000	2,079,832.50	
	オーストラリアドル 小計				55,630,000	55,835,620.10 (4,701,359,212)	
シンガポール ドル	国債証券	SPR GOV'T	2.625%	2012/04/01	600,000	614,622.00	
		SPR GOV'T	3.500%	2012/07/01	2,540,000	2,647,010.20	
		SPR GOV'T	2.500%	2012/10/01	1,130,000	1,167,278.70	
		SPR GOV'T	1.625%	2013/04/01	2,510,000	2,570,340.40	
		SPR GOV'T	2.250%	2013/07/01	700,000	729,491.00	
		SPR GOV'T	3.625%	2014/07/01	2,110,000	2,311,272.90	
		SPR GOV'T	1.375%	2014/10/01	700,000	716,513.00	
		SPR GOV'T	2.875%	2015/07/01	1,720,000	1,843,255.20	
		SPR GOV'T	3.750%	2016/09/01	2,210,000	2,454,647.00	
		SPR GOV'T	2.375%	2017/04/01	710,000	732,698.70	
		SPR GOV'T	4.000%	2018/09/01	1,560,000	1,739,618.40	
		SPR GOV'T	2.500%	2019/06/01	1,250,000	1,246,087.50	
		SPR GOV'T	3.250%	2020/09/01	1,920,000	2,010,048.00	
		SPR GOV'T	3.125%	2022/09/01	1,270,000	1,293,431.50	

		SPR GOV'T	3.000%	2024/09/01	710,000	703,042.00	
		SPR GOV'T	3.500%	2027/03/01	1,650,000	1,706,133.00	
		SPR GOV'T	2.875%	2030/09/01	660,000	616,209.00	
	シンガポールドル 小計				23,950,000	25,101,698.50 (1,637,132,776)	
マレーシア リンギット	国債証券	MALAYSIAN GOV'T	2.711%	2012/02/14	190,000	189,746.16	
		MALAYSIAN GOV'T	3.718%	2012/06/15	5,960,000	6,023,390.56	
		MALAYSIAN GOV'T	2.509%	2012/08/27	5,330,000	5,297,396.39	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
マレーシア リンギット	国債証券	MALAYSIAN GOV'T	3.702%	2013/02/25	7,380,000	7,448,331.42	
		MALAYSIAN GOV'T	3.210%	2013/05/31	2,290,000	2,286,569.58	
		MALAYSIAN GOV'T	3.461%	2013/07/31	4,820,000	4,838,075.00	
		MALAYSIAN GOV'T	5.094%	2014/04/30	11,280,000	11,861,021.52	
		MALAYSIAN GOV'T	3.741%	2015/02/27	5,130,000	5,165,397.00	
		MALAYSIAN GOV'T	3.835%	2015/08/12	5,200,000	5,288,244.00	
		MALAYSIAN GOV'T	4.262%	2016/09/15	9,560,000	9,889,227.28	
		MALAYSIAN GOV'T	3.814%	2017/02/15	3,010,000	3,022,238.66	
		MALAYSIAN GOV'T	4.240%	2018/02/07	8,760,000	8,948,620.32	
		MALAYSIAN GOV'T	4.378%	2019/11/29	8,220,000	8,411,032.80	
		MALAYSIAN GOV'T	4.160%	2021/07/15	2,830,000	2,854,643.64	
		MALAYSIAN GOV'T	3.502%	2027/05/31	2,090,000	1,844,249.44	
	MALAYSIAN GOV'T	5.248%	2028/09/15	1,910,000	2,078,727.49		
	マレーシアリンギット 小計				83,960,000	85,446,911.26 (2,332,700,677)	
国債証券 合計						413,326,896,383 (413,326,896,383)	
合計						413,326,896,383 (413,326,896,383)	

（注）有価証券明細表注記

1. 通貨ごとの小計の欄における（ ）内は、邦貨換算額であります。
2. 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
4. 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率（注）	有価証券の合計金額 に対する比率
米ドル	166	100.0%	39.7%
カナダドル	30	100.0%	2.9%
メキシコペソ	18	100.0%	0.9%
ユーロ	247	100.0%	43.1%
英ポンド	34	100.0%	8.0%
スイスフラン	9	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	8	100.0%	0.7%
ノルウェークローネ	4	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	7	100.0%	0.8%
ポーランドズロチ	14	100.0%	0.9%
オーストラリアドル	14	100.0%	1.1%
シンガポールドル	17	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	16	100.0%	0.6%
合計	584	100.0%	100.0%

（注）組入債券時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する債券の比率であります。

- ② 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。
- ③ 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。
- ④ 不動産等明細表
該当事項はありません。
- ⑤ 商品明細表
該当事項はありません。
- ⑥ 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。
- ⑦ その他特定資産の明細表
該当事項はありません。
- ⑧ 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3月31日

I 資産総額	10,567,157,802 円
II 負債総額	31,844,194 円
III 純資産総額（I－II）	10,535,313,608 円
IV 発行済口数	7,490,931,964 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.4064 円
1万口当たり純資産額	14,064 円

<参考>

マザーファンドの現況（平成23年3月31日）

純資産額計算書

（中央三井外国債券マザーファンド）

I 資産総額	430,456,178,054 円
II 負債総額	455,988,547 円
III 純資産総額（I－II）	430,000,189,507 円
IV 発行済口数	283,058,857,341 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.5191 円
1万口当たり純資産額	15,191 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。

① 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。

② 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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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します。）に支払います。

⑥ 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け、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。

第二部【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

会社に取り締役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。

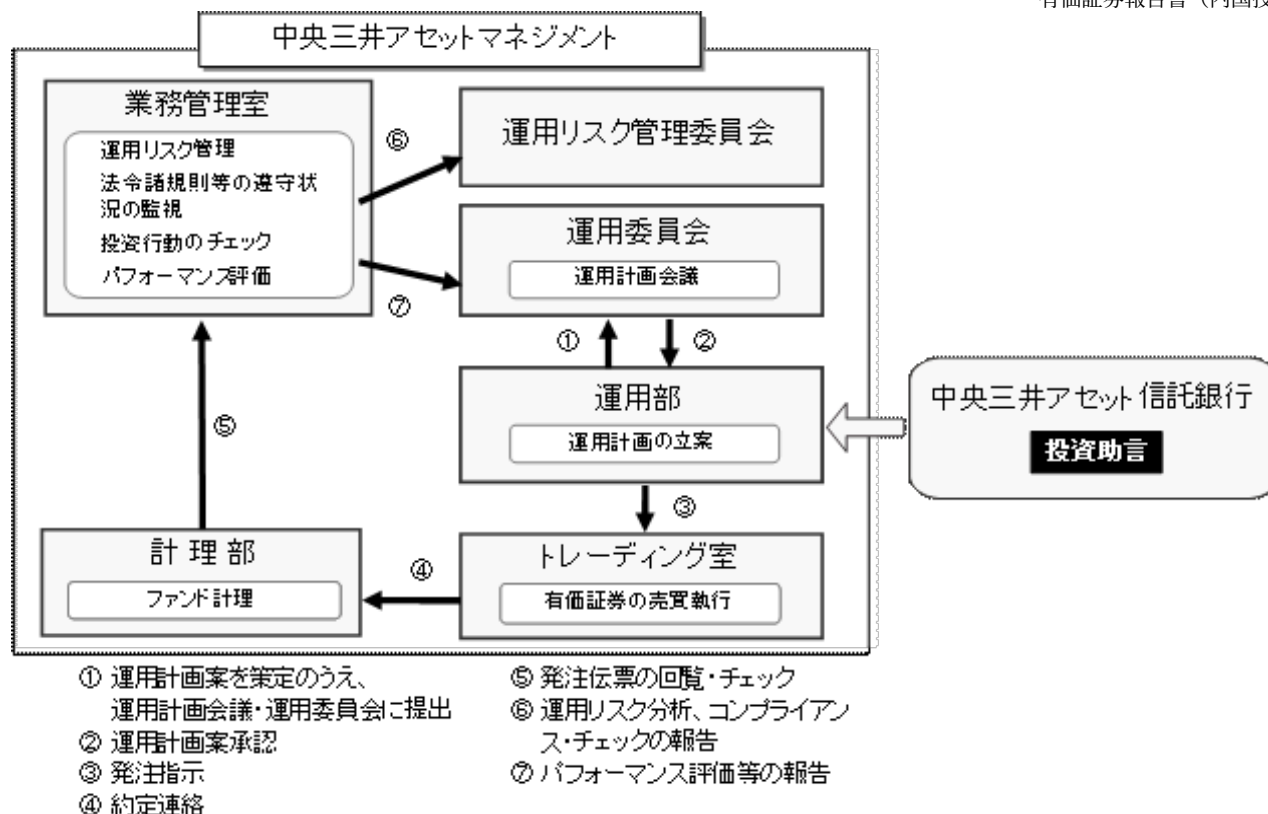
取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

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3月31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	575,850
追加型公社債投資信託	—	—
単位型株式投資信託	10	16,206
単位型公社債投資信託	—	—
合計	80	592,057

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3月31日現在、2兆3,411億円です。

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)				
I 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
II 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）						
I 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	26.5		828,085	24.8
II 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	1.3		54,705	1.6
負債合計		825,754	27.8		882,791	26.4
（純資産の部）						
I 株主資本						
1. 資本金		300,000	10.1		300,000	9.0
2. 資本剰余金						
(1) 資本準備金		50,000			50,000	
資本剰余金 計		50,000	1.7		50,000	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	60.4		2,112,210	63.1
株主資本計		2,147,110	72.2		2,462,210	73.6
II 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	72.2		2,462,107	73.6
負債・純資産合計		2,972,864	100.0		3,344,898	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 （%）
I 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	100.0		9,668,856	100.0
II 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	76.6		7,320,241	75.7
III 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	15.3		1,799,626	18.6
営業利益		908,346	8.1		548,988	5.7

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 (%)
IV 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
V 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
経常利益		921,353	8.2		548,366	5.7
VI 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
VII 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
繰越利益剰余金合計	当期末残高	1,771,709	2,086,808
	前期末残高	1,408,400	1,797,110
	当期変動額	388,710	315,099
繰越利益剰余金合計	当期末残高	1,797,110	2,112,210
	前期末残高	1,758,400	2,147,110
	当期変動額	388,710	315,099
繰越利益剰余金合計	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	その他有価証券 (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。	その他有価証券 (1) 時価のないもの 同左 (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。
2. 固定資産の減価償却の方法		
(1) 有形固定資産	定率法を採用しております。 なお、耐用年数は、建物については主として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。	同左
(2) 無形固定資産	定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（5年）を耐用年数としております。	同左
3. 引当金の計上基準		
(1) 貸倒引当金	一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。	同左
(2) 賞与引当金	従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当期負担分を計上しております。	同左
(3) 退職給付引当金	従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による期末退職給付債務相当額を計上しております。	同左
(4) 役員退職慰労引当金	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。	同左
4. その他財務諸表作成の基本となる重要な事項	消費税等の会計処理は税抜方式を採用しております。	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 器具備品	23,636千円 161,247千円	建物 器具備品 28,053千円 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

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)																
項目																	
1. 発行済株式に関する事項	<table><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><tr><td>普通株式（株）</td><td>5,050</td><td>－</td><td>－</td><td>5,050</td></tr></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><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><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></table>					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												
	(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。																

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)														
項目															
1. 発行済株式に関する事項	<table><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><tr><td>普通株式（株）</td><td>5,050</td><td>—</td><td>—</td><td>5,050</td></tr></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)												
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。	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 <table><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>その他</td><td>千円 9,897</td><td>千円 10,000</td><td>千円 △103</td></tr><tr><td>計</td><td>9,897</td><td>10,000</td><td>△103</td></tr></table>	区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額	その他	千円 9,897	千円 10,000	千円 △103	計	9,897	10,000	△103
区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額										
その他	千円 9,897	千円 10,000	千円 △103										
計	9,897	10,000	△103										
2. 当事業年度中に売却したその他有価証券 該当事項はありません。	2. 当事業年度中に売却したその他有価証券 <table><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>その他</td><td>千円 64,901</td><td>千円 2,918</td><td>千円 17</td></tr><tr><td>計</td><td>64,901</td><td>2,918</td><td>17</td></tr></table>	区分	売却額	売却益の 合計額	売却損の 合計額	その他	千円 64,901	千円 2,918	千円 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										
その他	千円 64,901	千円 2,918	千円 17										
計	64,901	2,918	17										
3. 時価評価されていない有価証券 <table><tr><th>内容</th><th>貸借対照表計上額（千円）</th></tr><tr><td>その他有価証券 非上場株式</td><td>65,000</td></tr></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	3. 時価評価されていない有価証券 <table><tr><th>内容</th><th>貸借対照表計上額（千円）</th></tr><tr><td>その他有価証券 非上場株式</td><td>65,000</td></tr></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												
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。	4. その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額 該当事項はありません。												

7. デリバティブ関係

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

I 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。

Ⅱ 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)			
I 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
II 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）			
I 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	21.9
II 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	1.3
負債合計		796,066	23.2
（純資産の部）			
I 株主資本			
1. 資本金		300,000	8.7
2. 資本剰余金			
（1）資本準備金		50,000	
資本剰余金 計		50,000	1.5
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	66.6
株主資本 計		2,642,229	76.8
II 評価・換算差額等			
1. その他有価証券評価差額金		116	0.0
評価・換算差額等 計		116	0.0
純資産合計		2,642,345	76.8
負債・純資産合計		3,438,412	100.0

(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 (%)
I 営業収益			
1. 委託者報酬		4,537,380	
営業収益 計		4,537,380	100.0
II 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
III 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 (%)
IV 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
V 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
VI 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
VII 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	その他有価証券 (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。 (2) 時価のないもの 移動平均法に基づく原価法を採用しております。
2. 固定資産の減価償却の方法	
(1) 有形固定資産	定率法を採用しております。 なお、耐用年数は、建物については主として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。
(2) 無形固定資産	定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（5年）を耐用年数としております。
3. 引当金の計上基準	
(1) 貸倒引当金	一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。
(2) 賞与引当金	従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間負担分を計上しております。
(3) 退職給付引当金	従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による中間期末退職給付債務相当額を計上しております。
(4) 役員退職慰労引当金	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。
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）

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)											
項目											
1. 発行済株式に関する事項	<table><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><tr><td>普通株式（株）</td><td>5,050</td><td>—</td><td>—</td><td>5,050</td></tr></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 ^(*)	時価 ^(*)	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いません。

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

- ① 名称：中央三井アセット信託銀行株式会社
- ② 資本金の額：11,000百万円（平成22年9月末日現在）
- ③ 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>

- ① 名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ② 資本金の額：51,000百万円（平成22年9月末日現在）
- ③ 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。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社※１	10,000※１	「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。
三井住友海上火災保険株式会社※２	139,595	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。
浜銀ＴＴ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。
楽天銀行株式会社	23,485	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	「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。
株式会社ＳＢＩ証券	47,937	「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。

※１：資本金の額は平成23年４月１日現在です。

※２：三井住友海上火災保険株式会社は、平成23年３月31日をもって、定時定額購入及び収益分配金の再投資を除く、新たな一括購入の受付を終了しました。平成23年６月１日以降は、定時定額購入の受付も終了します。

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。

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【参考情報】

当ファンドについては、当計算期間中に、金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる次の書類を提出しています。

提出日	書類名
平成22年3月30日	有価証券届出書の訂正届出書
平成22年5月21日	有価証券報告書
平成22年5月21日	有価証券届出書
平成22年11月22日	半期報告書
平成22年11月22日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成22年4月22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外国債券インデックスファンドの平成21年2月24日から平成22年2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、中央三井外国債券インデックスファンドの平成22年2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4月21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外国債券インデックスファンドの平成22年2月23日から平成23年2月21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、中央三井外国債券インデックスファンドの平成23年2月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。