

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成22年 4 月22日
【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 渡辺 輝夫
【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】	大供 修二 東京都港区芝三丁目23番 1 号 業務企画部
【電話番号】	03-5440-0181
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	中央三井 D C 日本株式インデックスファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続募集額 上限 10兆円
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

中央三井DC日本株式インデックスファンド（以下「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

1口当たりの元本は1円です。

格付は取得していません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、下記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である中央三井アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出され、日々の基準価額は、販売会社へお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします（販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。）。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.cmam.co.jp/>）でご覧いただけるほか、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に（[中央三井AM]の[DC日株]の略号にて）掲載されております。

ただし、分配金再投資に関する契約（後記「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 6 手続等の概要（１）申込（販売）手続等 その他 C.」をご参照ください。）に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、後記「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 7 管理及び運営の概要 計算期間」に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

平成22年4月23日から平成23年4月22日までとします。

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

ただし、後記「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針 (4) 分配方針 収益分配金の再投資等」に規定する収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

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

(8) 【申込取扱場所】

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

(照会先)

中央三井アセットマネジメント株式会社

・お問い合わせ窓口

電 話：03 - 5440 - 0190

受付時間：営業日の9時～17時

・ホームページ アドレス：<http://www.cmam.co.jp/>

なお、販売会社が販売会社以外の第一種金融商品取引業者又は登録金融機関と取次契約を結ぶことにより、当該第一種金融商品取引業者又は当該登録金融機関においても募集等の取次ぎを行う場合があります。

(9) 【払込期日】

申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込金額(申込受付日の基準価額×取得口数)を販売会社に支払うものとします。

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

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受付けた販売会社とします。(販売会社の詳細につきましては、上記「(8) 申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。)

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

申込証拠金

該当事項はありません。

日本以外の地域における発行

該当事項はありません。

振替受益権について

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

当ファンドは、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、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。

信託金限度額

上限：3,000億円

基本的性格

当ファンドは、委託会社である中央三井アセットマネジメント株式会社が投資家のために、利殖の目的をもって設定する証券投資信託で、中央三井アセット信託銀行株式会社がその受託会社となることを引受けたものです。

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

(用語の定義について)

当ファンドが該当する商品分類に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

< 単位型投信・追加型投信 >

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

< 投資対象地域 >

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

< 投資対象資産（収益の源泉） >

- ・株式...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株式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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル () 日本		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) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	TOPIX
不動産投信 その他資産 (投資信託証券(株式一般))	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド ・オブ ファンズ	その他 ()
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(用語の定義について)

当ファンドが該当する属性区分に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

< 投資対象資産 >

- ・その他資産(投資信託証券)

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

- ・株式一般...大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。

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

なお、商品分類表の投資対象資産(収益の源泉)が「株式」であるのに対して、属性区分表の投資対象資産では「その他資産(投資信託証券)」と異なる区分になっていますが、これは商品分類表では収益の源泉となる資産(実質基準)を記載するのに対して、属性区分表では組入れている資産

そのもの（形式基準）を記載することとなっているためです。

< 決算頻度 >

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

< 投資対象地域 >

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

< 投資形態 >

・ファミリーファンド

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

< インデックスファンドにおける対象インデックス >

・ T O P I X

...当ファンドの対象インデックスである T O P I X（東証株価指数、配当込み）は、株式会社東京証券取引所が算出、公表する、東証市場第一部の全銘柄を対象とした時価総額方式の株価指数です。

「 T O P I X」（東証株価指数）の著作権等について

1. T O P I Xの指数値及び T O P I Xの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用など T O P I Xに関する全ての権利及び T O P I Xの商標に関する全ての権利は東証が有しています。
2. 東証は、 T O P I Xの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、 T O P I Xの指数値の算出もしくは公表の停止又は T O P I Xの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
3. 東証は、 T O P I Xの商標の使用もしくは T O P I Xの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及するものではありません。
4. 東証は、 T O P I Xの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また東証は、 T O P I Xの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
5. 当ファンドは、 T O P I Xの指数値に連動した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と T O P I Xの指数値が著しく乖離することがあります。
6. 当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。
7. 東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
8. 東証は、委託会社又は当ファンドの購入者のニーズを、 T O P I Xの指数値を算出する構成銘柄、計算に考慮するものではありません。
9. 以上に限らず、東証は当ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

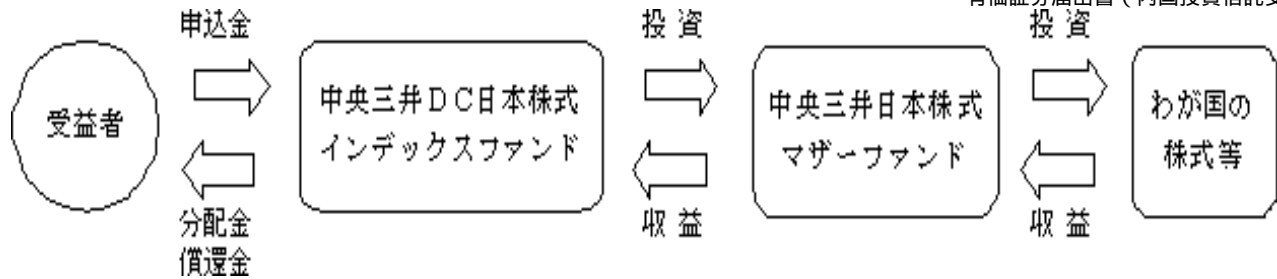
ファンドの特色

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行い、 T O P I X（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

（ 2 ）【ファンドの仕組み】

ファミリーファンド方式での運用

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



ファンドの関係法人

委託会社 中央三井アセットマネジメント株式会社

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

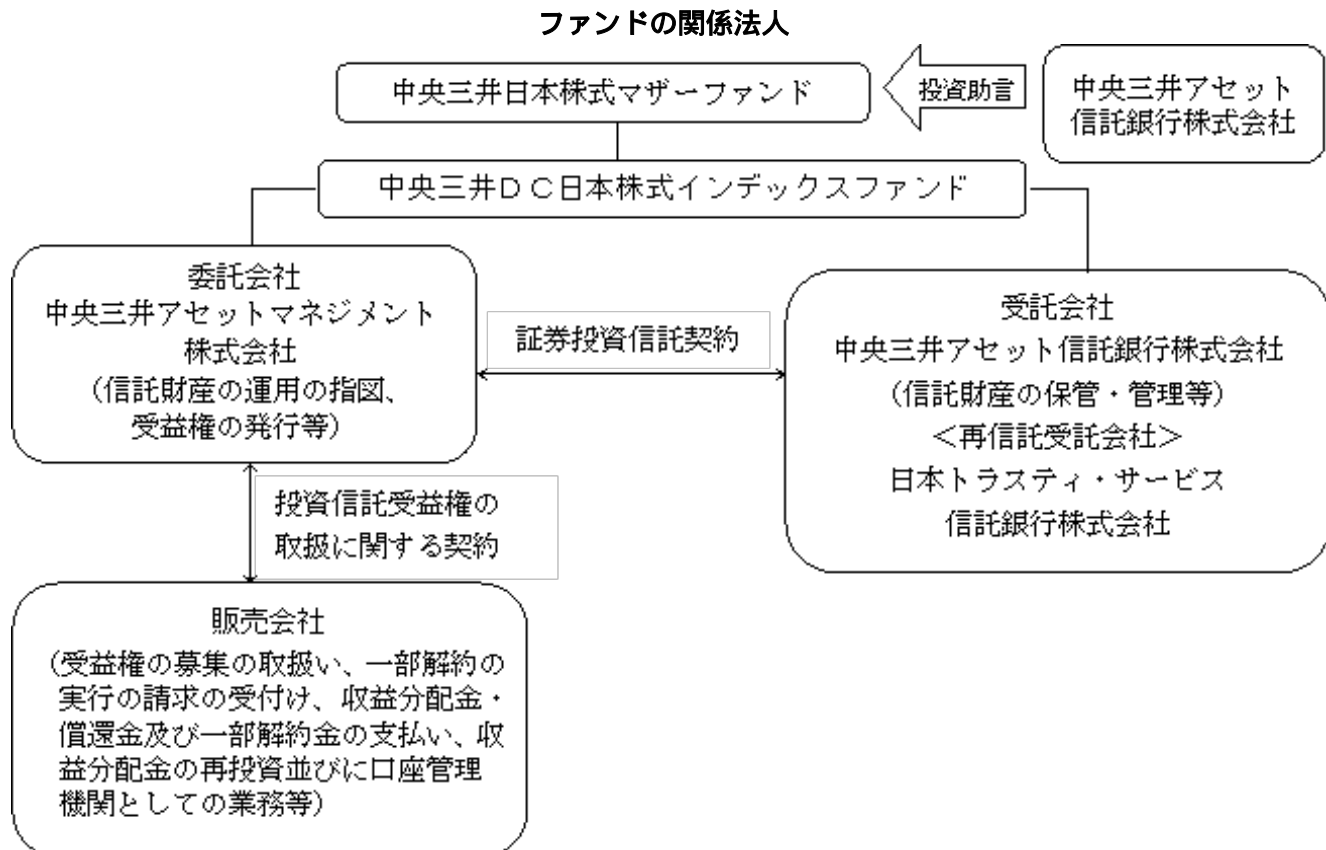
受託会社 中央三井アセット信託銀行株式会社

（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

販売会社

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



委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「証券投資信託契約」	運用に関する事項、委託会社及び受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、当該信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づき、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づいて締結されています。

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け付け、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資並びに口座管理機関としての業務等に係る事務の内容等が定められています。
--------------------------------------	---

委託会社の概況

A．資本金の額：3億円（平成22年4月22日現在）

B．委託会社の沿革

昭和61年9月：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：投資一任業務の認可取得

平成11年7月：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：証券投資信託委託業務認可取得

平成19年9月：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22年4月22日現在）

株主名	住所	持株数	持株比率
中央三井トラスト・ホールディングス株式会社	東京都港区芝三丁目33番1号	5,050株	100%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

運用方針

当ファンドは、主としてわが国の株式に投資する中央三井日本株式マザーファンド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、株式等に直接投資することもあります。

投資態度

- A．株式への実質投資は、東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、「TOPIX」（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- B．株式の実質投資割合は、原則として高位（90%以上）とします。
- C．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数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．資金動向、市況動向に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。）、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。
- 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、金利先渡取引を行うことができます。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として中央三井アセットマネジメント株式会社を委託者とし、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「中央三井日本株式マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券及び次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）（本邦通貨表示のものに限りません。）に投資することを指図します。

- 1．株券又は新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券

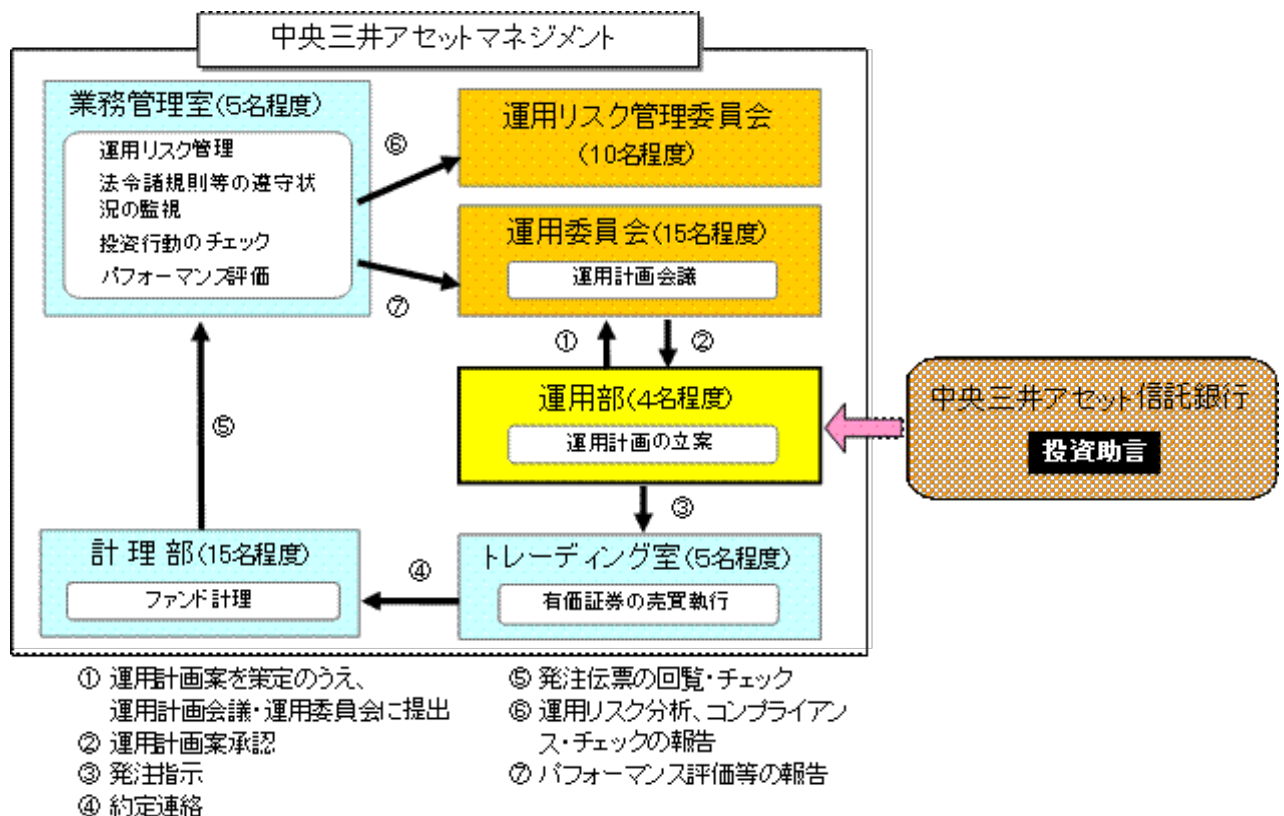
4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証書
 9. 資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
 12. 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11. までの証券又は証書の性質を有するもの
 13. 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。）
 14. 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。）
 15. 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。）
 16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、）
 17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 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、）
 20. 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。）
 21. 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
 22. 外国の者に対する権利で上記21. の有価証券の性質を有するもの
- なお、上記1. の証券又は証書並びに上記12. 及び17. の証券又は証書のうち上記1. 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2. から6. までの証券並びに上記12. 及び17. の証券又は証書のうち上記2. から6. 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13. の証券及び上記14. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用指図できる金融商品

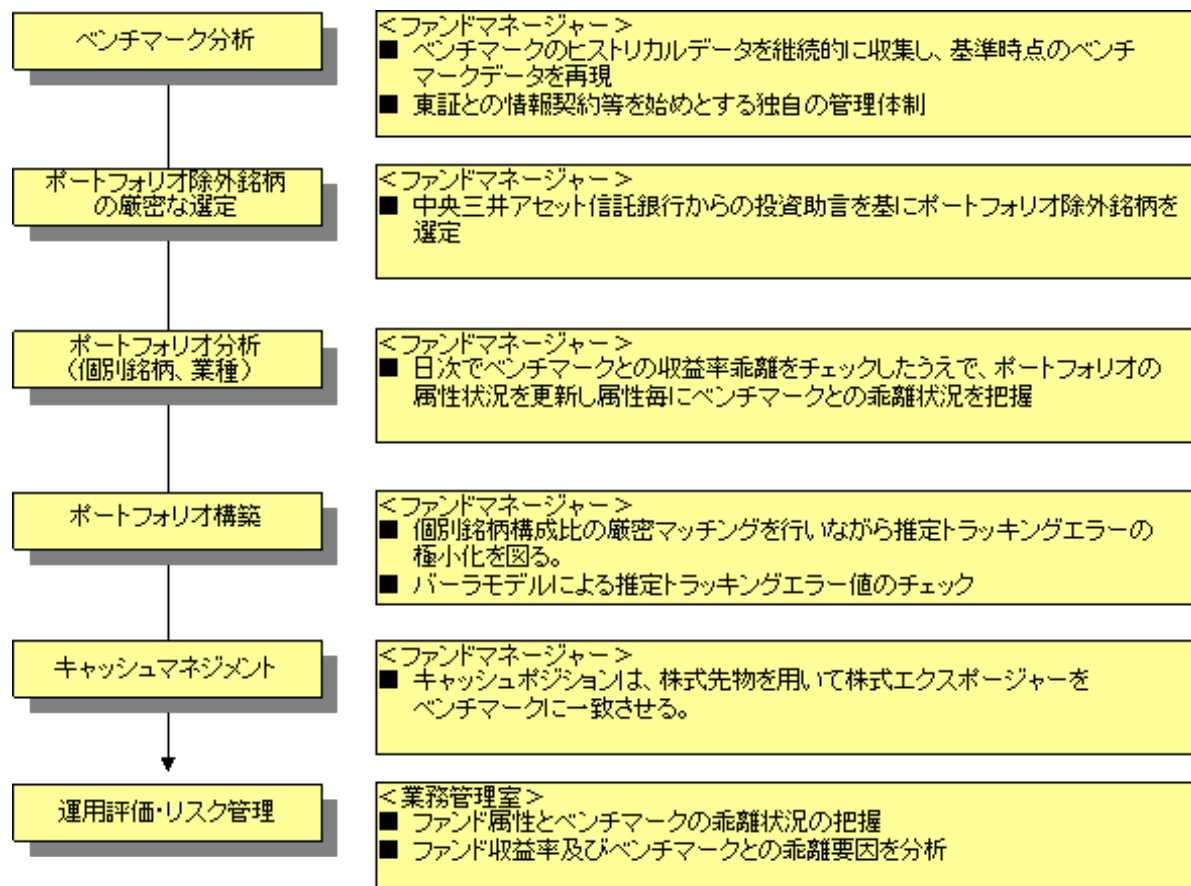
- A. 委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で上記5. の権利の性質を有するもの
- B. 金融商品による運用の特例
- 当ファンドの設定、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

(3) 【運用体制】

当ファンドの運用体制は以下のとおりです。



具体的なポートフォリオ構築プロセスは、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。

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】

分配方針

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

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

分配収益の計算

A．信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

イ．配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費（後記「４ 手数料等及び税金（４）その他の手数料等」の記載をご参照ください。）、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金に充てるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

ロ．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配に充てるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

ハ．収益分配金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

ニ．「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

B．毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の再投資等

収益分配金は、自動的に当ファンドの受益権に再投資されます。

A．別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。

B．販売会社は、別に定める契約に基づき、毎計算期間の末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の末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の末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

については原則として取得申込者とします。) 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】

約款に定める投資制限

A. 株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

B. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

C. 新株引受権証券等への投資割合

新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

D. 投資信託証券への投資割合

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

E. 同一銘柄の株式への投資割合

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20%以下とします。

F. 同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券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。

G. 同一銘柄の転換社債等への投資割合

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の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。)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。

H. 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、新株引受権証券及び新株予約権証券は、わが国の金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所での有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、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、新株引受権証券及び新株予約権証券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。

I. 信用取引の指図範囲

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券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、株券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. の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉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当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額が、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．の売付けに係る建玉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。
- Ｊ．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。
- Ｋ．スワップ取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。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。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- Ｌ．金利先渡取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- Ｍ．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、信託財産に属する株式及び公社債を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
- a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- b．公社債の貸付は、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．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ． a．及び b．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- Ｎ．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算において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。
- 〇．公社債の借入れの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ．上記イ．の借入れの指図は、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。
- ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- Ｐ．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
- 委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
- Ｑ．再投資の指図
- 委託会社は、上記Ｐ．の規定による一部解約代金、売却代金、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収入金を再投資することの指図ができます。
- Ｒ．資金の借入れ
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。
- Ｓ．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、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。
- ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ハ．上記イ．及びロ．の立替え金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。
- 関連法令に基づく投資制限
- Ａ．発生し得る危険に対応する額として算出した額が運用財産の純資産額を超える場合におけるデリバティブ取引に関する制限
（金融商品取引法第42条の2第7号、金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

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

B. 同一の法人の発行する株式への投資制限

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

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

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

ロ. 当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数

（参考）マザーファンドの概要

「中央三井日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

（1）投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

（2）投資態度

株式への投資は、原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、「TOPIX」（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

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

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

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下と

します。

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20%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち転換社債型新株予約権付社債への投資は、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。

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、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。

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国内株式を投資対象としています。組入れた株式の株価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、組入れた株式の発行体の経営・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、「TOPIX」（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行いますので、「TOPIX」（東証株価指数、配当込み）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。

株価変動リスク

株価変動リスクとは、経済情勢の変化等により株価が変動するリスクをいいます。一般に、企業業績、国内外の景気、経済、社会情勢の変化等の影響を受け、株価が下落（上昇）した場合には基準価額の下落（上昇）要因となります。

信用リスク

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

流動性リスク

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

その他のリスク

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、ベンチマーク（TOPIX（東証株価指数、配当込み））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株式の売買コスト、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もありません。

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

(3) 投資リスクに対する管理体制

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

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

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

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

- (4) 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資家の皆様に帰属します。確定拠出年金制度の加入者等は当ファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等が当ファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はありませんが、下記 の信託財産留保額が控除されます。

一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の基準価額から、当該基準価額に0.2%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とします。

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

マザーファンド名	A 欄	B 欄
中央三井日本株式マザーファンド	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	0.2%

(3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率10,000分の57.75（税抜 10,000分の55）の率を乗じて得た額とします。その配分は、委託会社10,000分の23.1（税抜 10,000分の22）、受託会社10,000分の7.35（税抜 10,000分の7）及び販売会社10,000分の27.3（税抜 10,000分の26）です。

なお、マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

上記 の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに信託財産中から支弁するものとします。

上記 の信託報酬に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(4)【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど信託財産中から支弁します。なお、信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、信託財産から収受する信託報酬中より委託会社が支弁します。

なお、マザーファンドにおいては、監査報酬はかかりません。

借入金の利息は、原則として借入金返済時に信託財産中から支弁します。

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

(5)【課税上の取扱い】

確定拠出年金の運用段階における課税上の取扱いは、次のとおりとなります。

企業型年金

事業主は、企業型年金の年金資産を管理する資産管理機関と資産管理契約を締結しなければなりません。資産管理契約として信託契約を締結した場合には、当該信託財産について受領する利子等又は配当等には所得税及び地方税を課さないこととされています。従って、当ファンドが資産管理契約としての信託契約の信託財産に組入れられた場合、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について、所得税及び地方税が課されることはありません。

個人型年金

個人型年金の年金資産は国民年金基金連合会のものとされていますので、当ファンドの毎決算時の

収益分配金、一部解約金及び償還金について所得税及び地方税が課されることはありません。

（注）企業型年金及び個人型年金の確定拠出年金資産は、特別法人税の課税対象とされていますが、平成23年3月までは課税が凍結されています。

税法及び確定拠出年金法等が改正された場合等は、上記の内容が変更されることがあります。

5【運用状況】

以下の記載事項は、平成22年2月26日現在の状況について記載してあります。

(1)【投資状況】

資産の種類		国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託 受益証券	中央三井日本株式マザーファンド	日本	223,271,547	100.06
	親投資信託受益証券合計		223,271,547	100.06
その他の資産(負債控除後)			124,364	0.06
合計(純資産総額)			223,147,183	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。

(中央三井日本株式マザーファンド)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	252,835,018,890	97.55
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		6,360,619,033	2.45
合計(純資産総額)		259,195,637,923	100.00

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

種類	銘柄	口数	簿価(円)		評価額(円)		投資比率(%)
			単価	金額	単価	金額	
親投資信託 受益証券	中央三井日本株式 マザーファンド	287,646,931	0.8159	234,691,132	0.7762	223,271,547	100.06

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

<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

(中央三井日本株式マザーファンド)

投資有価証券の主要銘柄

A. 主要銘柄の明細

順位	銘柄名	業種	株数	簿価(円)		評価額(円)		投資比率(%)
				単価	金額	単価	金額	
1	トヨタ自動車	輸送用機器	2,924,200	4,055.00	11,857,631,000	3,330.00	9,737,586,000	3.76
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	15,999,000	493.00	7,887,507,000	449.00	7,183,551,000	2.77
3	本田技研工業	輸送用機器	1,815,500	3,230.00	5,864,065,000	3,080.00	5,591,740,000	2.16

4	キヤノン	電気機器	1,319,700	3,770.00	4,975,269,000	3,695.00	4,876,291,500	1.88
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,599,000	2,986.06	4,774,710,566	2,856.00	4,566,744,000	1.76
6	三菱商事	卸売業	1,678,500	2,292.00	3,847,122,000	2,220.00	3,726,270,000	1.44
7	ソニー	電気機器	1,135,900	3,145.00	3,572,405,500	3,050.00	3,464,495,000	1.34
8	日本電信電話	情報・通信業	885,200	3,965.00	3,509,818,000	3,870.00	3,425,724,000	1.32
9	武田薬品工業	医薬品	837,100	4,000.00	3,348,400,000	4,025.00	3,369,327,500	1.30
10	東京電力	電気・ガス業	1,338,600	2,488.00	3,330,436,800	2,439.00	3,264,845,400	1.26
11	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	18,430,700	189.95	3,500,911,465	172.00	3,170,080,400	1.22
12	任天堂	その他製品	120,100	25,530.00	3,066,153,000	24,170.00	2,902,817,000	1.12
13	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	4,205,600	707.00	2,973,359,200	656.00	2,758,873,600	1.06
14	パナソニック	電気機器	2,080,400	1,506.00	3,133,082,400	1,235.00	2,569,294,000	0.99
15	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	18,637	137,800.00	2,568,178,600	137,400.00	2,560,723,800	0.99
16	三井物産	卸売業	1,809,900	1,394.00	2,523,000,600	1,379.00	2,495,852,100	0.96
17	東日本旅客鉄道	陸運業	395,800	6,180.00	2,446,044,000	6,120.00	2,422,296,000	0.93
18	東京海上ホールディングス	保険業	854,200	2,615.00	2,233,733,000	2,505.00	2,139,771,000	0.83
19	ソフトバンク	情報・通信業	918,100	2,435.00	2,235,573,500	2,327.00	2,136,418,700	0.82
20	東芝	電気機器	4,792,000	520.00	2,491,840,000	445.00	2,132,440,000	0.82
21	新日本製鐵	鉄鋼	6,254,000	364.00	2,276,456,000	332.00	2,076,328,000	0.80
22	三菱地所	不動産業	1,474,000	1,543.00	2,274,382,000	1,395.00	2,056,230,000	0.79
23	ファナック	電気機器	220,100	8,460.00	1,862,046,000	8,680.00	1,910,468,000	0.74
24	関西電力	電気・ガス業	869,500	2,121.00	1,844,209,500	2,104.00	1,829,428,000	0.71
25	日産自動車	輸送用機器	2,556,000	750.00	1,917,000,000	705.00	1,801,980,000	0.70
26	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	896,900	1,948.00	1,747,161,200	2,004.00	1,797,387,600	0.69
27	小松製作所	機械	988,200	1,937.00	1,914,143,400	1,784.00	1,762,948,800	0.68
28	信越化学工業	化学	366,500	4,945.00	1,812,342,500	4,780.00	1,751,870,000	0.68
29	日本たばこ産業	食料品	5,301	323,000.00	1,712,223,000	322,500.00	1,709,572,500	0.66
30	中部電力	電気・ガス業	715,700	2,326.00	1,664,718,200	2,355.00	1,685,473,500	0.65
	合計		77,504,338		99,163,922,431		92,876,827,400	35.83

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

(注2) 国/地域は全て日本、種類は全て株式です。

B. 種類別及び業種別の投資比率

種類	業種	投資比率(%)
----	----	---------

株式	水産・農林業	0.09
	鉱業	0.39
	建設業	1.87
	食料品	3.29
	繊維製品	0.86
	パルプ・紙	0.37
	化学	5.73
	医薬品	4.23
	石油・石炭製品	0.67
	ゴム製品	0.58
	ガラス・土石製品	1.20
	鉄鋼	2.51
	非鉄金属	1.17
	金属製品	0.68
	機械	4.44
	電気機器	14.24
	輸送用機器	9.52
	精密機器	1.54
	その他製品	2.19
	電気・ガス業	5.16
	陸運業	3.81
	海運業	0.54
	空運業	0.32
	倉庫・運輸関連業	0.23
	情報・通信業	5.47
	卸売業	5.00
	小売業	3.47
	銀行業	9.59
	証券、商品先物取引業	1.81
	保険業	2.13
	その他金融業	0.67
	不動産業	2.24
	サービス業	1.55
合計	97.55	

（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及び業種の評価金額の比率をいいます。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

銘柄名	国/地域	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引 買建 TOPIX先物取引	日本	735	6,703,023,575	6,548,850,000	2.53

（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。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）	1万口当たりの 基準価額（円）
第1期計算期間（平成15年1月22日現在）	1,355,058	8,714
第2期計算期間（平成16年1月22日現在）	102,732,866	11,008
第3期計算期間（平成17年1月24日現在）	136,578,230	11,728
第4期計算期間（平成18年1月23日現在）	239,985,362	16,500
第5期計算期間（平成19年1月22日現在）	313,798,120	18,124
第6期計算期間（平成20年1月22日現在）	241,863,780	12,875
第7期計算期間（平成21年1月22日現在）	174,629,327	8,519
第8期計算期間（平成22年1月22日現在）	231,943,332	10,219
平成21年2月末日	180,450,356	8,109
平成21年3月末日	189,601,995	8,375
平成21年4月末日	205,538,789	9,057
平成21年5月末日	220,646,223	9,694
平成21年6月末日	231,215,587	10,032
平成21年7月末日	225,944,049	10,260
平成21年8月末日	230,532,176	10,416
平成21年9月末日	221,321,950	9,882
平成21年10月末日	219,578,761	9,709
平成21年11月末日	208,296,031	9,109
平成21年12月末日	226,172,828	9,852
平成22年1月末日	223,857,147	9,784
平成22年2月末日	223,147,183	9,708

（注）決算日における基準価額は、分配付、分配落とも同一です。

【分配の推移】

	1万口当たりの収益分配金
第1期計算期間	0円
第2期計算期間	0円
第3期計算期間	0円
第4期計算期間	0円
第5期計算期間	0円
第6期計算期間	0円
第7期計算期間	0円
第8期計算期間	0円

【収益率の推移】

	収益率
第1期計算期間	12.9%
第2期計算期間	26.3%
第3期計算期間	6.5%
第4期計算期間	40.7%
第5期計算期間	9.8%
第6期計算期間	29.0%
第7期計算期間	33.8%
第8期計算期間	20.0%

(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14年1月25日)の基準価額を使用しております。

6【手続等の概要】

(1) 申込（販売）手続等

申込に係る手続きの概要は以下のとおりです。

項目	内容
申込手続き	<p>A．申込みの受付け 申込期間中において、毎営業日お申込みいただけます。</p> <p>B．申込単位 1円以上1円単位</p>
申込時限と当該申込に適用される価額	<p>A．申込時限 申込取扱期間中の営業日の午後2時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。</p> <p>B．当該申込に適用される価額 取得申込受付日の基準価額とします。</p> <p>(注) 分配金再投資に関する契約（下記 C．をご参照ください。）に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の販売価額は、原則として、後記「7 管理及び運営の概要 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。</p>
申込に係る制限	<p>A．取得申込者の制限 当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、継続募集期間中は、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）第8条（資産管理契約の締結）第1項に規定する事業主による資産管理契約締結の相手方（ ）及び同法第55条（規約の承認）に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）（以下「資産管理機関等」といいます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1．信託会社、信託業務を営む金融機関、厚生年金基金、企業年金基金 2．生命保険会社 3．農業協同組合連合会 4．損害保険会社 <p>B．申込みの受付中止等について 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を除き、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付けを中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。</p>
申込の際に負担するコストの有無	申込手数料はありません。
特定の条件の場合に投資家に課される申込に係る制限	該当事項はありません。

その他	<p>A．確定拠出年金制度の加入者等は、当ファンドの受益者に該当しておらず、確定拠出年金制度の運営管理機関（記録関連業務を行う事業主を含みます。）に対して資産配分の指図を行い、その指図の通知を受けた資産管理機関等が当ファンドの取得申込み及び後記「（２）換金（解約）手続等」に記載する一部解約の実行の請求を行うこととなります。</p> <p>B．受益権の取得申込者は、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。</p> <p>このため販売会社は有価証券取引に係る「総合取引約款」その他の約款（以下「総合約款」といいます。）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。</p> <p>C．当ファンドは、収益の分配がなされた場合、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、「自動けいぞく投資約款」（別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含みます。以下「自動けいぞく約款」といいます。）に従い分配金を自動的に無手数料で再投資する、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。</p> <p>D．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当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、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。</p>
-----	--

（２）換金（解約）手続等

一部解約の実行の請求に係る手続きの概要は以下のとおりです。

項目	内容
一部解約手続き	<p>A．受付時期等 毎営業日受付いたします。</p> <p>B．解約単位 1口単位</p> <p>C．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、</p>

<p>解約受付時限と当該一部解約に適用される価額</p>	<p>A．解約受付時限 営業日の午後2時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎての受け付けは翌営業日の取扱いとさせていただきます。</p> <p>B．当該一部解約に適用される価額 一部解約の実行の請求日の基準価額から、当該基準価額に0.2%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、委託会社のホームページ（http://www.cmam.co.jp/）に掲載しております。 販売会社の詳細につきましては、前記「第一部 証券情報（8）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。</p>
<p>一部解約に係る制限</p>	<p>委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。</p>
<p>一部解約の際に負担するコストの有無</p>	<p>一部解約手数料はありませんが、上記 B．に記載する信託財産留保額が控除されます。</p>
<p>特定の条件の場合に投資家に課される一部解約に係る制限</p>	<p>該当事項はありません。</p>
<p>その他</p>	<p>A．委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。</p> <p>B．上記により一部解約の実行の請求の受け付け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け付けたものとして上記 B．の記載に準じて計算された価額とします。</p> <p>C．一部解約金は、受益者の請求を受け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。 なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより拠ることとなります。</p> <p>D．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。</p>

7【管理及び運営の概要】

項目	内容
当ファンドの主たる投資対象としている資産及び基準価額に与える影響が大きいと想定される資産の評価方法	A．親投資信託受益証券（中央三井日本株式マザーファンド） 計算日の基準価額で評価します。 B．国内上場株式 原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。
保管	該当事項はありません。
信託期間	A．当ファンドの信託期間は、信託契約締結日（平成14年1月25日）から無期限とします。 B．委託会社は、下記 の事項に該当する場合は、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。
計算期間	A．当ファンドの計算期間は、毎年1月23日から翌年1月22日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成14年1月25日から平成15年1月22日までとし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。 B．上記A．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。

繰上げ償還に係る
条件並びに手続き

- 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．委託会社は、次のいずれかの事由に該当する場合、受託会社と合意のうえ、下記ロ．の所定の手続きを経て、当ファンド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。
- a．信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が5億口を下回るようになった場合
 - b．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
 - c．やむを得ない事情が発生したとき
- ロ．所定の手続き
- a．委託会社は、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。
 - 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．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．委託会社は、次のいずれかの事由に該当する場合、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- イ．監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたとき
- ロ．監督官庁より投資信託委託会社の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
- ただし、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継ぐことを命じたときは、当ファンドは、下記 B．八．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。
- ハ．受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合又は裁判所が受託会社を解任した場合において委託会社が新受託会社を選任できないとき

約款の変更に係る条件並びに手続き	<p>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。</p> <p>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は以下の手続きにより行います。</p> <p>イ．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。</p> <p>ロ．上記イ．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。</p> <p>ハ．上記ロ．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、信託約款の変更をしません。</p> <p>ニ．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。</p>
反対者の買取請求権	<p>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、販売会社を經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。</p>
公告	<p>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。</p>
運用報告書	<p>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、知られたる受益者に対して交付します。</p>

第2【財務ハイライト情報】

(1) 当ファンドの財務ハイライト情報は、「第三部 ファンドの詳細情報」の「第4 ファンドの経理状況」の「財務諸表」に記載している「(1) 貸借対照表」、「(2) 損益及び剰余金計算書」及び「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第55条の5の規定により注記される事項を抜粋して記載しております。

なお、財務ハイライト情報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7期計算期間（平成20年1月23日から平成21年1月22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8期計算期間（平成21年1月23日から平成22年1月22日まで）の財務諸表については、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。

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。

その監査報告書は、「第三部 ファンドの詳細情報」の「第4 ファンドの経理状況」の「財務諸表」の該当箇所に添付しております。

中央三井DC日本株式インデックスファンド
1【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 (平成21年1月22日現在)	第8期 (平成22年1月22日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	175,247,922	232,590,429
未収入金	67,860	510,878
流動資産合計	175,315,782	233,101,307
資産合計	175,315,782	233,101,307
負債の部		
流動負債		
未払解約金	67,860	510,878
未払受託者報酬	78,733	82,365
未払委託者報酬	539,862	564,732
流動負債合計	686,455	1,157,975
負債合計	686,455	1,157,975
純資産の部		
元本等		
元本	204,996,312	226,966,584
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	30,366,985	4,976,748
純資産合計	174,629,327	231,943,332
負債純資産合計	175,315,782	233,101,307

2【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期	第8期
	自平成20年1月23日 至平成21年1月22日	自平成21年1月23日 至平成22年1月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	85,220,079	40,518,363
営業収益合計	85,220,079	40,518,363
営業費用		
受託者報酬	177,431	155,879
委託者報酬	1,216,605	1,068,756
営業費用合計	1,394,036	1,224,635
営業利益又は営業損失（ ）	86,614,115	39,293,728
経常利益又は経常損失（ ）	86,614,115	39,293,728
当期純利益又は当期純損失（ ）	86,614,115	39,293,728
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（ ）	6,904,656	4,163,858
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	54,003,386	30,366,985
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,282,601	6,654,022
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	6,654,022
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,282,601	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	11,943,513	6,440,159
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	11,943,513	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	6,440,159
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	30,366,985	4,976,748

[次へ](#)

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	第 7 期 自 平成20年 1 月23日 至 平成21年 1 月22日	第 8 期 自 平成21年 1 月23日 至 平成22年 1 月22日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、法令及び 社団法人投資信託協会規則に従 い、基準価額で評価してありま す。	親投資信託受益証券 同左

< 参考 >

「中央三井DC日本株式インデックスファンド」は、「中央三井日本株式マザーファンド」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22年1月22日現在（以下、「計算日」といいます。）の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

「中央三井日本株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成22年 1 月22日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,130,343,585
株式	268,448,268,490
新株予約権証券	3,796,000
派生商品評価勘定	183,937,550
未収配当金	210,136,750
未収利息	16,199
流動資産合計	274,976,498,574
資産合計	274,976,498,574
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	633,150
前受金	281,830,000
未払解約金	441,620,402
流動負債合計	724,083,552
負債合計	724,083,552
純資産の部	
元本等	
元本	335,855,124,304
剰余金	
欠損金	61,602,709,282
純資産合計	274,252,415,022

負債・純資産合計	274,976,498,574
----------	-----------------

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成22年1月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 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、時価で評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、原則として時価で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

第3【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

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ています。

受益証券の不発行

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

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、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4【ファンドの詳細情報の項目】

「第三部 ファンドの詳細情報」に記載すべき事項の項目名は以下のとおりです。

第1 ファンドの沿革

第2 手続等

- 1 申込（販売）手続等
- 2 換金（解約）手続等

第3 管理及び運営

- 1 資産管理等の概要
 - (1) 資産の評価
 - (2) 保管
 - (3) 信託期間
 - (4) 計算期間
 - (5) その他
- 2 受益者の権利等

第4 ファンドの経理状況

- 1 財務諸表
 - (1) 貸借対照表
 - (2) 損益及び剰余金計算書
 - (3) 注記表
 - (4) 附属明細表
- 2 ファンドの現況
純資産額計算書

第5 設定及び解約の実績

第三部【ファンドの詳細情報】

第1【ファンドの沿革】

平成14年1月25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

なお、当ファンドの主要投資対象である「中央三井日本株式マザーファンド」は、平成13年1月23日に設定され、運用が開始されています。

第2【手続等】

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

上記の規定にかかわらず、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を除き、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受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）取得申込者

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、継続募集期間中は、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）第8条（資産管理契約の締結）第1項に規定する事業主による資産管理契約締結の相手方（ ）及び同法第55条（規約の承認）に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）（以下「資産管理機関等」といいます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

- 1．信託会社、信託業務を営む金融機関、厚生年金基金、企業年金基金
- 2．生命保険会社
- 3．農業協同組合連合会
- 4．損害保険会社

（3）募集取扱いの単位

取得申込者は、販売会社において、1円以上1円単位をもって、受益権を購入することができます。

（4）販売価額

継続募集期間における受益権の販売価額は、取得申込受付日の基準価額とします。

（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「第3 管理及び運営 1 資産管理等の概要（4）計算期間」に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

（5）申込の際に負担するコストの有無

申込手数料はありません。

（6）その他

確定拠出年金制度の加入者等は、当ファンドの受益者に該当しておらず、確定拠出年金制度の運営管理機関（記録関連業務を行う事業主を含みます。）に対して資産配分の指図を行い、その指図の通知を受けた資産管理機関等が当ファンドの取得申込み及び後記「2 換金（解約）手続等」に記載する一部解約の実行の請求を行うこととなります。

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

込む旨の申込書を提出していただきます。

当ファンドは、収益の分配がなされた場合、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自動的に無手数料で再投資する、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

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

2【換金（解約）手続等】

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

(注) 一部解約の実行の請求の受け付けは、営業日の午後2時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎての受け付け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け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

(4) 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の基準価額から、当該基準価額に0.2%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、委託会社のホームページ（<http://www.cmam.co.jp/>）に掲載しております。

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：03-5440-0190

受付時間：営業日の9時～17時

・ホームページ アドレス：<http://www.cmam.co.jp/>

(5) 委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、上記(1)による一部解約の実行の請求の受け付け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け付け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け付けたものとして上記(4)の記載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。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。

(8) 解約に係る手数料については、徴収しません。

(9) 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。

第3【管理及び運営】

1【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額

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

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出され、日々の基準価額は、販売会社へお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします（販売会社の詳細につきましては、前記「第2 手続等 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、委託会社のホームページ（<http://www.cmam.co.jp/>）でご覧いただけるほか、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に（〔中央三井AM〕の〔DC日株〕の略号にて）掲載されております。

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

A．親投資信託受益証券（中央三井日本株式マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

B．国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

(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14年1月25日）から無期限とします。ただし、委託会社は、下記（5）に該当する場合は、この信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年1月23日から翌年1月22日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成14年1月25日から平成15年1月22日までとし、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。

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

(5)【その他】

信託の終了

この信託契約を解約し信託を終了させる場合は下記のとおりです。

A．委託会社の所定の手続きを経て信託を終了させる場合

イ．受益権の口数が5億口を下回った場合

委託会社は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合は、受託会社と協議のうえ、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。

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

する旨を監督官庁に届け出ます。

八．所定の手続き

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

B．監督官庁の命令

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

C．委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

D．受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い

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

委託会社の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い

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

信託約款の変更

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

述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

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

反対者の買取請求権

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すべき旨を請求することができます。

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

信託財産の管理

A．保管業務の委任

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

B．有価証券の保管

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

C．混蔵寄託

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

D．信託財産の登記等及び記載等の留保等

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

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

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

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

運用報告書

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き、変更した場合の開示方法

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

信託事務処理の再委託

受託会社は、当ファンドに係る信託事務の処理の一部について、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

2【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次のとおりです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3) 一部解約請求権

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

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

一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

(4) 投資信託約款等重要事項変更時の反対者の買取請求権

前記「1 資産管理等の概要 (5) その他 反対者の買取請求権」をご参照ください。

(5) 受益権均等分割

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

(6) 帳簿閲覧権

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

（参考）

確定拠出年金制度における当ファンドの受益者は、確定拠出年金法第8条（資産管理契約の締結）第1項に規定する事業主による資産管理契約締結の相手方又は同法第55条（規約の承認）に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）となります。従って確定拠出年金の加入者等は上記の権利を直接には保有していません。また、加入者等が収益分配金、償還金及び一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めにより拠出することとなります。

第4【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）」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）」に基づいて作成しております。

ただし、第7期計算期間（平成20年1月23日から平成21年1月22日まで）については改正前の「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」に基づき作成しております。

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7期計算期間（平成20年1月23日から平成21年1月22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8期計算期間（平成21年1月23日から平成22年1月22日まで）の財務諸表については、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。

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【財務諸表】

中央三井DC日本株式インデックスファンド
(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 (平成21年1月22日現在)	第8期 (平成22年1月22日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	175,247,922	232,590,429
未収入金	67,860	510,878
流動資産合計	175,315,782	233,101,307
資産合計	175,315,782	233,101,307
負債の部		
流動負債		
未払解約金	67,860	510,878
未払受託者報酬	78,733	82,365
未払委託者報酬	539,862	564,732
流動負債合計	686,455	1,157,975
負債合計	686,455	1,157,975
純資産の部		
元本等		
元本	204,996,312	226,966,584
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	30,366,985	4,976,748
純資産合計	174,629,327	231,943,332
負債純資産合計	175,315,782	233,101,307

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第7期	第8期
	自平成20年1月23日 至平成21年1月22日	自平成21年1月23日 至平成22年1月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	85,220,079	40,518,363
営業収益合計	85,220,079	40,518,363
営業費用		
受託者報酬	177,431	155,879
委託者報酬	1,216,605	1,068,756
営業費用合計	1,394,036	1,224,635
営業利益又は営業損失()	86,614,115	39,293,728
経常利益又は経常損失()	86,614,115	39,293,728
当期純利益又は当期純損失()	86,614,115	39,293,728
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()	6,904,656	4,163,858
期首剰余金又は期首欠損金()	54,003,386	30,366,985
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,282,601	6,654,022
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	6,654,022
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,282,601	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	11,943,513	6,440,159
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	11,943,513	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	6,440,159
期末剰余金又は期末欠損金()	30,366,985	4,976,748

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第 7 期 自 平成20年 1月23日 至 平成21年 1月22日	第 8 期 自 平成21年 1月23日 至 平成22年 1月22日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、法令及び 社団法人投資信託協会規則に従 い、基準価額で評価してありま す。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

	第 7 期 (平成21年 1月22日現在)	第 8 期 (平成22年 1月22日現在)
1. 当該計算期間の末日における 受益権総数	204,996,312 口	226,966,584 口
2. 「投資信託財産の計算に関 する規則（平成12年総理府令 第133号）」第55条の6第10号 に規定する額	元本の欠損 30,366,985 円	
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8519 円 (8,519 円)	1.0219 円 (10,219 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 7 期 自 平成20年 1月23日 至 平成21年 1月22日	第 8 期 自 平成21年 1月23日 至 平成22年 1月22日
費用控除後の配当等収益額	A	3,334,477 円 (4,728,513 円)	3,659,015 円 (3,786,622 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	98,803,489 円	129,491,141 円
分配準備積立金額	D	65,223,843 円	56,006,561 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	167,361,809 円	189,156,717 円
当ファンドの期末残存口数	F	204,996,312 口	226,966,584 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	8,164.13 円	8,334.12 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 7 期 自 平成20年 1 月23日 至 平成21年 1 月22日	第 8 期 自 平成21年 1 月23日 至 平成22年 1 月22日
2. 剰余金増加額・減少額及び 欠損金減少額・増加額	「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ剰余金減少額と増加額との純額を表示しております。	「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ欠損金増加額と減少額との純額を表示しております。

(関連当事者との取引に関する注記)

第 7 期 自 平成20年 1 月23日 至 平成21年 1 月22日	第 8 期 自 平成21年 1 月23日 至 平成22年 1 月22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 7 期 自 平成20年 1 月23日 至 平成21年 1 月22日	第 8 期 自 平成21年 1 月23日 至 平成22年 1 月22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 7 期 自 平成20年 1 月23日 至 平成21年 1 月22日	第 8 期 自 平成21年 1 月23日 至 平成22年 1 月22日
期首元本額	187,860,394 円	204,996,312 円
期中追加設定元本額	60,022,780 円	67,618,005 円
期中一部解約元本額	42,886,862 円	45,647,733 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 7 期 (平成21年 1 月22日現在)		第 8 期 (平成22年 1 月22日現在)	
	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間(自平成20年 1 月23日 至 平成21年 1 月22日)の損益に含まれた評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間(自平成21年 1 月23日 至 平成22年 1 月22日)の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託 受益証券	175,247,922	77,635,151	232,590,429	36,933,815
合計	175,247,922	77,635,151	232,590,429	36,933,815

3. デリバティブ取引関係

第 7 期 (自 平成20年 1 月23日 至 平成21年 1 月22日)

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

第8期（自平成21年1月23日 至 平成22年1月22日）

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	中央三井日本株式マザーファンド	284,827,859	232,590,429	
合計		284,827,859	232,590,429	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

< 参考 >

「中央三井DC日本株式インデックスファンド」は、「中央三井日本株式マザーファンド」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22年1月22日現在（以下、「計算日」といいます。）の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

「中央三井日本株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成22年1月22日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,130,343,585
株式	268,448,268,490
新株予約権証券	3,796,000
派生商品評価勘定	183,937,550
未収配当金	210,136,750
未収利息	16,199
流動資産合計	274,976,498,574
資産合計	274,976,498,574
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	633,150
前受金	281,830,000
未払解約金	441,620,402
流動負債合計	724,083,552
負債合計	724,083,552
純資産の部	
元本等	
元本	335,855,124,304
剰余金	
欠損金	61,602,709,282
純資産合計	274,252,415,022
負債・純資産合計	274,976,498,574

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成22年1月22日現在
--	--------------

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 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、時価で評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、原則として時価で評価しております。</p>
2．デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3．収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成22年 1月22日現在	
1．担保に供している資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。</p> <p style="text-align: right;">株式 3,573,900,000 円</p> <p>なお、上記の金額には、約定未受渡株式を含んでおりません。</p>
2．計算日における受益権総数	335,855,124,304 口
3．「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第55条の6第10号に規定する額	<p>元本の欠損</p> <p>61,602,709,282 円</p>
4．1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	<p>0.8166 円</p> <p>(8,166 円)</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

平成22年 1月22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22年 1月22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22年 1月22日現在	
計算期間の期首元本額	301,299,270,900 円
計算期間中の追加設定元本額	78,111,549,838 円
計算期間中の一部解約元本額	43,555,696,434 円
計算日の元本額	335,855,124,304 円
計算日の元本額の内訳	
中央三井日本株式インデックスファンド	2,483,245,933 円
中央三井DC日本株式インデックスファンド	284,827,859 円
中央三井DC日本株式インデックスファンドL	36,494,081,183 円
中央三井DC日本株式インデックスファンドA	1,550,784,183 円
中央三井DCバランスファンド30	191,424,670 円
中央三井DCバランスファンド50	496,949,760 円
中央三井DCバランスファンド70	311,625,819 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	433,814,382 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	251,689,154 円
新生・4分散ファンド	284,831,603 円
ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド	655,565,052 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	138,636,204 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	339,736,017 円
日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)	118,844,435 円
中央三井日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	42,083,686,284 円
中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)	8,126,548,796 円
中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)	59,369,189,130 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)	45,627,188,985 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)	6,913,129,670 円
中央三井VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	1,005,342,269 円
中央三井VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	8,528,267,233 円
中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)	7,190,419,258 円
中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	3,008,738,333 円
中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)	45,506,359,787 円
中央三井バランスVA75(適格機関投資家専用)	2,929,904,738 円
中央三井VL株式30(適格機関投資家専用)	13,819,785 円
中央三井VL株式50(適格機関投資家専用)	21,657,195 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)	20,933,487,561 円
中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	8,169,454,958 円
中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	274,902,415 円
中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)	3,852,283,879 円
中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	2,953,117,261 円
CMAA・バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	7,692,128,927 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)	445,545,128 円
CMAA私募日本株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	4,944,102,003 円
CMAA・VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	346,621,161 円
中央三井バランスVA20(適格機関投資家専用)	2,039,012,064 円
中央三井VAファンド25(適格機関投資家専用)	3,565,631,189 円
CMAA・バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	2,950,432,168 円
中央三井バランスVA20L(適格機関投資家専用)	150,401,562 円
中央三井バランスVA25L(適格機関投資家専用)	2,184,771,886 円
CMAA・バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	774,031,446 円
中央三井世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	159,610,749 円
中央三井国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	42,669,041 円
中央三井国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	16,613,189 円

2．有価証券関係

売買目的有価証券

平成22年1月22日現在		
種類	貸借対照表計上額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	268,448,268,490	39,859,933,947
新株予約権証券	3,796,000	3,796,000
合計	268,452,064,490	39,863,729,947

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「中央三井日本株式マザーファンド」の期首から計算日まで
の期間（平成21年1月23日から平成22年1月22日まで）に対応するものです。

3．デリバティブ取引関係

．取引の状況に関する事項

平成22年1月22日現在	
1．取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株式関連の株価指数先物取引であります。
2．取引に対する取組方針	株価指数先物取引は、ファンド運用の効率化を図ること及び将来の株価の変動によるリスク回避を目的としており、投機的な取引は行わない方針であります。
3．取引の利用目的	株価指数先物取引は、ファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、キャッシュ運用の効率化、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用しております。
4．取引に係るリスクの内容	株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
5．取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々のポジション、評価金額及び評価損益の管理を行っております。また、リスク管理は、デリバティブ取引に限定することなく、デリバティブ取引と現物資産等を総合的に勘案し、各ファンド全体でのリスク管理を、リスクの種類ごとに実施しております。
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、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。

．取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益
株式関連

区分	種類	平成22年1月22日現在			
		契約額等（円）		時価 （円）	評価損益 （円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,579,085,600		5,762,390,000	183,304,400

合計	5,579,085,600		5,762,390,000	183,304,400
----	---------------	--	---------------	-------------

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は証拠金算定基準値段で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

(3) 附属明細表（平成22年1月22日現在）

有価証券明細表

A. 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
極洋	103,000	189	19,467,000	
日本水産	258,000	271	69,918,000	
マルハニチロホールディングス	511,000	128	65,408,000	
サカタのタネ	47,500	1,263	59,992,500	
ホクト	26,300	1,982	52,126,600	
日鉄鉱業	66,000	435	28,710,000	
三井松島産業	114,000	150	17,100,000	
国際石油開発帝石	1,182	677,000	800,214,000	
関東天然瓦斯開発	29,000	486	14,094,000	
石油資源開発	40,900	4,390	179,551,000	
ショーボンドホールディングス	24,200	1,538	37,219,600	
ダイセキ環境ソリューション	26	121,000	3,146,000	
東急建設	104,370	241	25,153,170	
コムシスホールディングス	106,600	907	96,686,200	
高松コンストラクショングループ	23,400	1,160	27,144,000	
東建コーポレーション	11,620	2,087	24,250,940	
大成建設	1,093,000	178	194,554,000	
大林組	672,000	338	227,136,000	
清水建設	677,000	360	243,720,000	
松井建設	41,000	357	14,637,000	
鹿島建設	1,060,000	194	205,640,000	
太平工業	39,000	385	15,015,000	
前田建設工業	192,000	249	47,808,000	
奥村組	244,000	344	83,936,000	
大和小田急建設	32,500	296	9,620,000	
東鉄工業	35,000	537	18,795,000	
戸田建設	294,000	319	93,786,000	
青木あすなろ建設	27,000	474	12,798,000	
北野建設	77,000	223	17,171,000	
三井ホーム	39,000	466	18,174,000	
矢作建設工業	41,000	561	23,001,000	
ピーエス三菱	22,900	330	7,557,000	
大東建託	103,600	4,545	470,862,000	
N I P P O	54,000	649	35,046,000	
前田道路	70,000	689	48,230,000	
日本道路	81,000	191	15,471,000	
五洋建設	286,000	100	28,600,000	
大林道路	44,000	149	6,556,000	
住友林業	177,800	718	127,660,400	
日本基礎技術	41,500	196	8,134,000	
巴コーポレーション	45,200	218	9,853,600	
パナホーム	93,000	608	56,544,000	
大和ハウス工業	601,000	1,002	602,202,000	
ライト工業	64,300	202	12,988,600	
積水ハウス	727,000	899	653,573,000	

北陸電気工事	21,000	262	5,502,000	
コミュニチュア	26,000	550	14,300,000	
ユアテック	45,000	477	21,465,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
西部電気工業	27,000	364	9,828,000	
四電工	26,000	463	12,038,000	
中電工	34,300	1,198	41,091,400	
関電工	106,000	600	63,600,000	
大明	32,300	691	22,319,300	
きんでん	152,000	831	126,312,000	
東京エネシス	30,000	598	17,940,000	
トーエネック	40,000	518	20,720,000	
住友電設	22,100	479	10,585,900	
日本電設工業	49,000	729	35,721,000	
協和エクシオ	86,900	806	70,041,400	
新日本空調	21,500	640	13,760,000	
東電通	49,000	160	7,840,000	
日本電話施設	45,000	281	12,645,000	
九電工	51,000	552	28,152,000	
三機工業	56,000	652	36,512,000	
日揮	241,000	1,742	419,822,000	
中外炉工業	83,000	250	20,750,000	
ヤマト	29,000	325	9,425,000	
太平電業	31,000	810	25,110,000	
高砂熱学工業	70,100	793	55,589,300	
三晃金属工業	37,000	247	9,139,000	
NEC ネットエスアイ	19,700	1,052	20,724,400	
朝日工業社	35,000	379	13,265,000	
大気社	35,800	1,322	47,327,600	
ダイダン	36,000	504	18,144,000	
日比谷総合設備	36,500	833	30,404,500	
東芝プラントシステム	35,000	1,135	39,725,000	
東洋エンジニアリング	153,000	297	45,441,000	
千代田化工建設	186,000	830	154,380,000	
新興プランテック	43,600	1,037	45,213,200	
日本製粉	150,000	455	68,250,000	
日清製粉グループ本社	234,000	1,212	283,608,000	
日東富士製粉	21,000	346	7,266,000	
昭和産業	107,000	300	32,100,000	
鳥越製粉	22,500	792	17,820,000	
協同飼料	91,000	115	10,465,000	
中部飼料	25,000	865	21,625,000	
日本配合飼料	73,000	103	7,519,000	
ユニ・チャーム ペットケア	14,800	2,941	43,526,800	
東洋精糖	40,000	125	5,000,000	
日本甜菜製糖	132,000	244	32,208,000	
三井製糖	92,000	299	27,508,000	
森永製菓	253,000	200	50,600,000	
中村屋	60,000	489	29,340,000	
江崎グリコ	93,000	1,019	94,767,000	
名糖産業	11,700	1,260	14,742,000	
不二家	149,000	175	26,075,000	
山崎製パン	189,000	1,071	202,419,000	
第一屋製パン	36,000	120	4,320,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
モロゾフ	40,000	308	12,320,000	
森永乳業	219,000	377	82,563,000	
ヤクルト本社	138,500	2,565	355,252,500	
明治ホールディングス	76,500	3,475	265,837,500	
雪印メグミルク	50,800	1,380	70,104,000	
プリマハム	130,000	96	12,480,000	
日本ハム	180,000	1,123	202,140,000	
伊藤ハム	160,000	336	53,760,000	
丸大食品	105,000	286	30,030,000	
米久	21,000	858	18,018,000	
S Foods	14,000	810	11,340,000	
サッポロホールディングス	367,000	493	180,931,000	
アサヒビール	450,100	1,732	779,573,200	
麒麟ホールディングス	1,057,000	1,427	1,508,339,000	
宝ホールディングス	203,000	506	102,718,000	
オエノンホールディングス	67,000	171	11,457,000	
メルシャン	77,000	191	14,707,000	
養命酒製造	20,000	841	16,820,000	
三国コカ・コーラボトリング	30,900	717	22,155,300	
コカ・コーラウエスト	63,700	1,596	101,665,200	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	29,100	1,140	33,174,000	
ダイドードリンコ	10,700	2,966	31,736,200	
伊藤園	71,900	1,371	98,574,900	
キーコーヒー	21,000	1,590	33,390,000	
ユニカフェ	6,200	584	3,620,800	
ジャパンフーズ	3,500	846	2,961,000	
日清オイリオグループ	100,000	496	49,600,000	
不二製油	62,800	1,290	81,012,000	
J - オイルミルズ	96,000	290	27,840,000	
キッコーマン	196,000	1,090	213,640,000	
味の素	652,000	903	588,756,000	
キューピー	133,600	1,013	135,336,800	
ハウス食品	95,300	1,358	129,417,400	
カゴメ	92,700	1,642	152,213,400	
焼津水産化学工業	12,200	1,077	13,139,400	
アリアケジャパン	21,200	1,382	29,298,400	
ニチレイ	267,000	333	88,911,000	
東洋水産	111,000	2,328	258,408,000	
日清食品ホールディングス	91,300	2,915	266,139,500	
永谷園	23,000	865	19,895,000	
フジッコ	25,000	1,106	27,650,000	
ロック・フィールド	12,600	1,229	15,485,400	
日本たばこ産業	5,370	323,000	1,734,510,000	
わらべや日洋	13,200	1,114	14,704,800	
なとり	11,300	827	9,345,100	
ミヨシ油脂	84,000	138	11,592,000	
片倉工業	27,700	817	22,630,900	
ゲンゼ	168,000	354	59,472,000	
川島織物セルコン	87,000	71	6,177,000	
東洋紡績	806,000	149	120,094,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ユニチカ	523,000	72	37,656,000	
富士紡ホールディングス	113,000	153	17,289,000	
日清紡ホールディングス	158,000	845	133,510,000	
倉敷紡績	236,000	150	35,400,000	
シキボウ	153,000	141	21,573,000	
日本毛織	92,000	676	62,192,000	
トーア紡コーポレーション	103,000	57	5,871,000	
ダイドーリミテッド	31,000	675	20,925,000	
帝国繊維	27,000	453	12,231,000	
帝人	846,000	294	248,724,000	
東レ	1,505,000	518	779,590,000	
三菱レイヨン	558,000	374	208,692,000	
サカイオーベックス	74,000	81	5,994,000	
住江織物	61,000	130	7,930,000	
日本フェルト	15,300	397	6,074,100	
イチカワ	21,000	179	3,759,000	
日本バイリーン	28,000	439	12,292,000	
日東製網	38,000	113	4,294,000	
芦森工業	57,000	122	6,954,000	
アツギ	231,000	116	26,796,000	
ダイニック	47,000	149	7,003,000	
セーレン	55,600	595	33,082,000	
東海染工	42,000	90	3,780,000	
小松精練	42,000	377	15,834,000	
ワコールホールディングス	133,000	1,082	143,906,000	
ホギメディカル	10,600	4,500	47,700,000	
サンエー・インターナショナル	12,400	1,106	13,714,400	
クラウドディア	3,400	1,247	4,239,800	
三陽商会	111,000	301	33,411,000	
オンワードホールディングス	149,000	613	91,337,000	
ルック	48,000	81	3,888,000	
ゴールドウイン	59,000	207	12,213,000	
東京スタイル	82,000	687	56,334,000	
デサント	68,000	490	33,320,000	
ヤマトインターナショナル	17,000	344	5,848,000	
特種東海ホールディングス	155,000	235	36,425,000	
王子製紙	991,000	391	387,481,000	
三菱製紙	325,000	110	35,750,000	
北越紀州製紙	151,500	454	68,781,000	
中越パルプ工業	96,000	160	15,360,000	
大王製紙	103,000	768	79,104,000	
日本製紙グループ本社	99,900	2,394	239,160,600	
レンゴー	179,000	553	98,987,000	
トーモク	80,000	210	16,800,000	
ザ・バック	16,200	1,249	20,233,800	
クラレ	329,000	1,107	364,203,000	
旭化成	1,306,000	478	624,268,000	
共和レザー	14,200	323	4,586,600	
コープケミカル	40,000	144	5,760,000	
昭和電工	1,498,000	188	281,624,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
住友化学	1,541,000	422	650,302,000	

日本化成	48,000	182	8,736,000	
住友精化	47,000	355	16,685,000	
日産化学工業	149,000	1,295	192,955,000	
ラサ工業	98,000	96	9,408,000	
クレハ	144,000	462	66,528,000	
テイカ	39,000	248	9,672,000	
片倉チッカリン	17,000	284	4,828,000	
日本曹達	145,000	325	47,125,000	
東ソー	560,000	255	142,800,000	
トクヤマ	376,000	514	193,264,000	
セントラル硝子	231,000	390	90,090,000	
東亜合成	266,000	340	90,440,000	
ダイソー	98,000	233	22,834,000	
関東電化工業	54,000	642	34,668,000	
電気化学工業	471,000	393	185,103,000	
信越化学工業	371,300	4,945	1,836,078,500	
日本カーバイド工業	58,000	110	6,380,000	
堺化学工業	84,000	431	36,204,000	
エア・ウォーター	178,000	1,068	190,104,000	
大陽日酸	317,000	953	302,101,000	
日本化学工業	92,000	225	20,700,000	
日本パーカライジング	53,000	1,132	59,996,000	
高压ガス工業	37,000	564	20,868,000	
チタン工業	31,000	194	6,014,000	
四国化成工業	36,000	516	18,576,000	
戸田工業	39,000	665	25,935,000	
ステラ ケミファ	11,600	4,645	53,882,000	
保土谷化学工業	56,000	309	17,304,000	
日本触媒	134,000	824	110,416,000	
大日精化工業	88,000	355	31,240,000	
カネカ	301,000	629	189,329,000	
三菱瓦斯化学	381,000	514	195,834,000	
三井化学	871,000	262	228,202,000	
J S R	219,800	1,898	417,180,400	
東京応化工業	40,000	1,713	68,520,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,294,000	402	520,188,000	
日本合成化学工業	57,000	670	38,190,000	
ダイセル化学工業	287,000	571	163,877,000	
住友ベークライト	207,000	499	103,293,000	
積水化学工業	464,000	588	272,832,000	
日本ゼオン	208,000	447	92,976,000	
アイカ工業	65,000	950	61,750,000	
宇部興産	1,012,000	256	259,072,000	
積水樹脂	33,000	755	24,915,000	
タキロン	76,000	242	18,392,000	
旭有機材工業	78,000	216	16,848,000	
日立化成工業	104,400	1,989	207,651,600	
ニチバン	27,000	292	7,884,000	
リケンテクノス	45,000	239	10,755,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
大倉工業	58,000	268	15,544,000	
積水化成品工業	63,000	454	28,602,000	
群栄化学工業	67,000	216	14,472,000	
タイガースポリマー	12,100	306	3,702,600	

日本カーリット	20,500	400	8,200,000	
日本化薬	170,000	800	136,000,000	
日本精化	20,800	715	14,872,000	
A D E K A	97,100	887	86,127,700	
日油	199,000	398	79,202,000	
ハリマ化成	22,000	465	10,230,000	
花王	618,800	2,218	1,372,498,400	
第一工業製薬	42,000	248	10,416,000	
三洋化成工業	68,000	497	33,796,000	
大日本塗料	144,000	97	13,968,000	
日本ペイント	210,000	590	123,900,000	
関西ペイント	273,000	763	208,299,000	
中国塗料	65,000	644	41,860,000	
日本特殊塗料	18,700	385	7,199,500	
藤倉化成	29,400	474	13,935,600	
太陽インキ製造	17,900	2,416	43,246,400	
D I C	738,000	160	118,080,000	
サカティンクス	51,000	384	19,584,000	
東洋インキ製造	219,000	358	78,402,000	
富士フイルムホールディングス	479,000	2,960	1,417,840,000	
資生堂	411,000	1,944	798,984,000	
ライオン	278,000	455	126,490,000	
高砂香料工業	73,000	442	32,266,000	
マンダム	22,500	2,603	58,567,500	
ミルボン	10,800	2,080	22,464,000	
ファンケル	46,700	1,823	85,134,100	
コーセー	34,700	1,890	65,583,000	
ドクターシーラボ	161	191,800	30,879,800	
エステー	14,800	1,032	15,273,600	
コニシ	19,500	895	17,452,500	
長谷川香料	31,000	1,272	39,432,000	
小林製薬	33,500	3,700	123,950,000	
荒川化学工業	19,300	1,084	20,921,200	
メック	18,400	605	11,132,000	
日本高純度化学	65	320,000	20,800,000	
荏原ユーザライト	3,100	1,640	5,084,000	
アース製薬	17,300	2,772	47,955,600	
イハラケミカル工業	47,000	269	12,643,000	
北興化学工業	26,000	285	7,410,000	
大成ラミック	6,600	2,175	14,355,000	
クミアイ化学工業	52,000	305	15,860,000	
日本農薬	51,000	526	26,826,000	
アキレス	187,000	137	25,619,000	
有沢製作所	32,600	621	20,244,600	
日東電工	186,600	3,740	697,884,000	
レック	6,900	1,700	11,730,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
アロン化成	30,000	378	11,340,000	
きもと	20,800	976	20,300,800	
藤森工業	16,100	1,332	21,445,200	
前澤化成工業	22,100	894	19,757,400	
J S P	16,400	1,123	18,417,200	
エフピコ	10,800	4,475	48,330,000	
天馬	17,200	1,078	18,541,600	

信越ポリマー	41,400	590	24,426,000	
東リ	86,000	172	14,792,000	
ニフコ	50,000	1,942	97,100,000	
日本バルカー工業	94,000	177	16,638,000	
ユニ・チャーム	44,500	9,010	400,945,000	
協和発酵キリン	289,000	962	278,018,000	
武田薬品工業	848,100	4,000	3,392,400,000	代用有価証券で 200,000株 担保差入
アステラス製薬	477,100	3,450	1,645,995,000	
大日本住友製薬	170,900	970	165,773,000	
塩野義製薬	326,800	1,921	627,782,800	
田辺三菱製薬	201,000	1,280	257,280,000	
わかもと製薬	25,000	322	8,050,000	
あすか製薬	26,000	633	16,458,000	
日本新薬	55,000	1,048	57,640,000	
中外製薬	240,400	1,657	398,342,800	
科研製薬	102,000	786	80,172,000	
エーザイ	276,000	3,375	931,500,000	
ロート製薬	101,000	1,092	110,292,000	
小野薬品工業	112,500	4,105	461,812,500	
久光製薬	68,100	3,240	220,644,000	
有機合成薬品工業	20,000	247	4,940,000	
持田製薬	90,000	905	81,450,000	
大正製薬	194,000	1,592	308,848,000	
参天製薬	68,500	2,899	198,581,500	
エスエス製薬	50,000	511	25,550,000	
扶桑薬品工業	81,000	281	22,761,000	
日本ケミファ	36,000	252	9,072,000	
ツムラ	65,900	2,895	190,780,500	
キッセイ薬品工業	45,000	1,884	84,780,000	
生化学工業	41,900	946	39,637,400	
栄研化学	17,400	857	14,911,800	
日水製薬	8,400	668	5,611,200	
鳥居薬品	14,400	1,699	24,465,600	
東和薬品	11,100	4,555	50,560,500	
沢井製薬	14,600	5,930	86,578,000	
ゼリア新薬工業	35,000	872	30,520,000	
第一三共	710,700	1,957	1,390,839,900	
キョーリン	59,000	1,353	79,827,000	
新日本石油	1,363,000	429	584,727,000	
昭和シェル石油	215,900	723	156,095,700	
コスモ石油	607,000	207	125,649,000	
ニチレキ	35,000	341	11,935,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
東燃ゼネラル石油	324,000	767	248,508,000	
ユシロ化学工業	13,000	1,236	16,068,000	
ビービー・カストロール	13,200	333	4,395,600	
新日鉱ホールディングス	864,000	398	343,872,000	
AOCホールディングス	58,200	548	31,893,600	
出光興産	25,800	6,030	155,574,000	
横浜ゴム	245,000	366	89,670,000	
東洋ゴム工業	219,000	170	37,230,000	
ブリヂストン	698,600	1,514	1,057,680,400	
住友ゴム工業	169,500	757	128,311,500	

藤倉ゴム工業	15,400	322	4,958,800	
オカモト	92,000	364	33,488,000	
フコク	10,200	666	6,793,200	
ニッタ	21,700	1,400	30,380,000	
東海ゴム工業	37,300	951	35,472,300	
三ツ星ベルト	63,000	386	24,318,000	
バンドー化学	87,000	289	25,143,000	
日東紡績	196,000	187	36,652,000	
旭硝子	1,105,000	940	1,038,700,000	
日本板硝子	671,000	257	172,447,000	
石塚硝子	32,000	194	6,208,000	
日本山村硝子	96,000	301	28,896,000	
日本電気硝子	392,000	1,313	514,696,000	
オハラ	9,300	1,560	14,508,000	
住友大阪セメント	399,000	148	59,052,000	
太平洋セメント	885,000	111	98,235,000	
デイ・シイ	25,800	212	5,469,600	
日本ヒューム	25,000	265	6,625,000	
日本コンクリート工業	50,000	140	7,000,000	
東海カーボン	225,000	454	102,150,000	
日本カーボン	119,000	269	32,011,000	
東洋炭素	10,400	4,720	49,088,000	
ノリタケカンパニーリミテド	126,000	250	31,500,000	
ＴＯＴＯ	346,000	570	197,220,000	
日本碍子	266,000	2,043	543,438,000	
日本特殊陶業	197,000	1,130	222,610,000	
MARUWA	6,300	1,971	12,417,300	
品川リフラクトリーズ	62,000	201	12,462,000	
黒崎播磨	54,000	179	9,666,000	
東京窯業	30,000	203	6,090,000	
ニッカトー	9,100	402	3,658,200	
フジインコーポレーテッド	22,100	1,670	36,907,000	
ニチアス	129,000	350	45,150,000	
ニチハ	34,800	652	22,689,600	
新日本製鐵	6,336,000	364	2,306,304,000	
住友金属工業	4,129,000	266	1,098,314,000	
神戸製鋼所	3,122,000	173	540,106,000	
日新製鋼	854,000	163	139,202,000	
中山製鋼所	116,000	127	14,732,000	
合同製鐵	124,000	202	25,048,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ジェイ エフ イー ホールディングス	483,900	3,340	1,616,226,000	
東京製鐵	111,000	1,009	111,999,000	
共英製鋼	22,700	1,746	39,634,200	
大和工業	56,700	2,976	168,739,200	
東京鐵鋼	48,000	278	13,344,000	
大阪製鐵	15,300	1,525	23,332,500	
淀川製鋼所	172,000	409	70,348,000	
東洋鋼鈑	51,000	470	23,970,000	
住友鋼管	14,800	490	7,252,000	
丸一鋼管	67,300	1,723	115,957,900	
モリ工業	42,000	201	8,442,000	
大同特殊鋼	373,000	344	128,312,000	
日本高周波鋼業	99,000	90	8,910,000	

日本金属工業	167,000	152	25,384,000	
日本冶金工業	134,000	376	50,384,000	
山陽特殊製鋼	120,000	400	48,000,000	
愛知製鋼	129,000	403	51,987,000	
日立金属	131,000	957	125,367,000	
日本金属	65,000	158	10,270,000	
大平洋金属	168,000	656	110,208,000	
日本電工	103,000	585	60,255,000	
日本鑄鉄管	26,000	128	3,328,000	
三菱製鋼	148,000	168	24,864,000	
日亜鋼業	35,000	252	8,820,000	
日本精線	20,000	246	4,920,000	
シンニッタン	21,200	251	5,321,200	
新家工業	88,000	125	11,000,000	
日本軽金属	550,000	85	46,750,000	
大紀アルミニウム工業所	39,000	200	7,800,000	
三井金属鉱業	656,000	255	167,280,000	
東邦亜鉛	117,000	439	51,363,000	
三菱マテリアル	1,282,000	245	314,090,000	
住友金属鉱山	583,000	1,345	784,135,000	
DOWAホールディングス	261,000	532	138,852,000	
古河機械金属	408,000	110	44,880,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,700	2,830	67,071,000	
東邦チタニウム	39,400	1,701	67,019,400	
住友軽金属工業	345,000	79	27,255,000	
古河スカイ	100,000	159	15,900,000	
古河電気工業	708,000	444	314,352,000	
住友電気工業	739,000	1,181	872,759,000	
フジクラ	336,000	509	171,024,000	
三菱電線工業	156,000	77	12,012,000	
東京特殊電線	33,000	95	3,135,000	
タツタ電線	54,000	230	12,420,000	
日立電線	195,000	276	53,820,000	
沖電線	25,000	116	2,900,000	
カナレ電気	2,600	1,088	2,828,800	
平河ヒューテック	5,000	671	3,355,000	
リョービ	135,000	250	33,750,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
アサヒホールディングス	34,000	1,446	49,164,000	
稲葉製作所	12,300	939	11,549,700	
トーカロ	12,700	1,565	19,875,500	
アルファC o	8,100	796	6,447,600	
SUMCO	129,200	1,743	225,195,600	
川田テクノロジーズ	6,700	1,488	9,969,600	
東洋製罐	170,600	1,323	225,703,800	
ホッカンホールディングス	58,000	223	12,934,000	
コロナ	11,500	1,296	14,904,000	
横河ブリッジホールディングス	49,000	709	34,741,000	
駒井鉄工	46,000	182	8,372,000	
ハルテック	41,000	130	5,330,000	
高田機工	32,000	163	5,216,000	
三和ホールディングス	241,000	260	62,660,000	
文化シャッター	77,000	306	23,562,000	
東洋シャッター	12,700	596	7,569,200	

住生活グループ	291,400	1,592	463,908,800	
日本ファイルコン	17,600	471	8,289,600	
ノーリツ	40,200	1,161	46,672,200	
長府製作所	26,400	2,100	55,440,000	
リンナイ	38,800	4,370	169,556,000	
ダイニチ工業	13,400	610	8,174,000	
日東精工	32,000	234	7,488,000	
三洋工業	69,000	127	8,763,000	
岡部	62,100	307	19,064,700	
中国工業	89,000	91	8,099,000	
東プレ	46,500	843	39,199,500	
高周波熱錬	35,400	595	21,063,000	
東京製綱	159,000	248	39,432,000	
パイオラックス	10,300	1,658	17,077,400	
日本発條	157,000	813	127,641,000	
中央発條	31,000	283	8,773,000	
三益半導体工業	17,800	1,179	20,986,200	
アタカ大機	18,000	232	4,176,000	
日本製鋼所	346,000	1,182	408,972,000	
日立ツール	14,300	876	12,526,800	
三浦工業	33,100	2,380	78,778,000	
タクマ	90,000	238	21,420,000	
ツガミ	70,000	338	23,660,000	
オークマ	157,000	553	86,821,000	
東芝機械	121,000	376	45,496,000	
アマダ	369,000	647	238,743,000	
アイダエンジニアリング	58,200	319	18,565,800	
牧野フライス製作所	113,000	424	47,912,000	
オーエスジー	99,600	996	99,201,600	
ダイジェット工業	31,000	125	3,875,000	
旭ダイヤモンド工業	59,000	674	39,766,000	
森精機製作所	91,300	981	89,565,300	
ディスコ	21,900	5,450	119,355,000	
日東工器	14,300	2,010	28,743,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
豊和工業	135,000	50	6,750,000	
大阪機工	80,000	79	6,320,000	
東洋機械金属	19,400	168	3,259,200	
オーエム製作所	20,000	328	6,560,000	
津田駒工業	62,000	138	8,556,000	
島精機製作所	29,100	1,874	54,533,400	
日本スピンドル製造	35,000	133	4,655,000	
日阪製作所	26,000	907	23,582,000	
やまびこ	9,500	921	8,749,500	
ベガサスミシン製造	24,800	165	4,092,000	
ナブテスコ	91,000	1,141	103,831,000	
三井海洋開発	16,300	1,850	30,155,000	
レオン自動機	26,000	244	6,344,000	
S M C	72,000	11,110	799,920,000	
新川	18,700	1,486	27,788,200	
ホソカワミクロン	38,000	323	12,274,000	
ユニオンツール	15,000	2,763	41,445,000	
オイレス工業	26,800	1,291	34,598,800	
サトー	26,400	1,075	28,380,000	

日本エアーテック	7,900	480	3,792,000	
日精樹脂工業	19,500	251	4,894,500	
ワイエイシイ	10,400	696	7,238,400	
小松製作所	1,001,100	1,937	1,939,130,700	
住友重機械工業	477,000	489	233,253,000	
日立建機	98,600	2,378	234,470,800	
日工	33,000	252	8,316,000	
巴工業	9,100	1,221	11,111,100	
井関農機	230,000	288	66,240,000	
TOWA	25,100	799	20,054,900	
丸山製作所	54,000	169	9,126,000	
北川鉄工所	108,000	97	10,476,000	
クボタ	921,000	886	816,006,000	
荏原実業	5,600	1,227	6,871,200	
三菱化工機	70,000	240	16,800,000	
月島機械	40,000	560	22,400,000	
帝国電機製作所	8,400	1,789	15,027,600	
東京機械製作所	75,000	102	7,650,000	
新東工業	45,200	725	32,770,000	
澁谷工業	13,900	761	10,577,900	
アイチ コーポレーション	39,800	361	14,367,800	
小森コーポレーション	63,600	1,106	70,341,600	
鶴見製作所	19,000	660	12,540,000	
住友精密工業	36,000	266	9,576,000	
酒井重工業	43,000	133	5,719,000	
荏原製作所	454,000	404	183,416,000	
石井鐵工所	38,000	157	5,966,000	
西島製作所	21,600	2,033	43,912,800	
ダイキン工業	251,800	3,470	873,746,000	
オルガノ	42,000	627	26,334,000	
トヨーカネツ	122,000	167	20,374,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
栗田工業	123,600	2,859	353,372,400	
椿本チエイン	124,000	412	51,088,000	
大同工業	47,000	148	6,956,000	
日本コンベヤ	74,000	76	5,624,000	
木村化工機	21,200	812	17,214,400	
アネスト岩田	44,000	315	13,860,000	
ダイフク	89,500	608	54,416,000	
加藤製作所	50,000	162	8,100,000	
油研工業	42,000	143	6,006,000	
タダノ	102,000	453	46,206,000	
フジテック	60,000	546	32,760,000	
シーケーディ	59,800	651	38,929,800	
キトー	73	80,600	5,883,800	
平和	43,500	1,000	43,500,000	
理想科学工業	20,300	760	15,428,000	
SANKYO	62,900	4,835	304,121,500	
日本金銭機械	22,700	825	18,727,500	
マースエンジニアリング	10,000	2,308	23,080,000	
福島工業	6,300	812	5,115,600	
キャノンファインテック	19,300	1,180	22,774,000	
オーイズミ	11,300	201	2,271,300	
ダイコク電機	7,800	1,731	13,501,800	

アマノ	65,600	809	53,070,400	
サンデン	131,000	267	34,977,000	
マックス	40,000	950	38,000,000	
グローリー	65,000	2,094	136,110,000	
大和冷機工業	30,000	417	12,510,000	
セガサミーホールディングス	243,300	1,083	263,493,900	
日本ピストンリング	85,000	95	8,075,000	
リケン	92,000	332	30,544,000	
帝国ピストンリング	28,200	351	9,898,200	
ホシザキ電機	46,400	1,314	60,969,600	
大豊工業	16,200	637	10,319,400	
日本精工	434,000	718	311,612,000	
NTN	496,000	437	216,752,000	
ジェイテクト	207,100	1,132	234,437,200	
不二越	234,000	275	64,350,000	
日本トムソン	74,000	553	40,922,000	
THK	143,800	1,872	269,193,600	
ユースン精機	10,500	1,408	14,784,000	
前澤給装工業	12,200	1,338	16,323,600	
イーグル工業	25,000	469	11,725,000	
前澤工業	21,100	187	3,945,700	
日本ピラー工業	25,000	483	12,075,000	
キッツ	104,000	441	45,864,000	
日立工機	62,100	1,069	66,384,900	
マキタ	140,300	3,230	453,169,000	
日立造船	969,000	133	128,877,000	
三菱重工業	3,623,000	333	1,206,459,000	
IHI	1,576,000	150	236,400,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
イビデン	151,200	3,230	488,376,000	
コニカミノルタホールディングス	495,000	959	474,705,000	
ブラザー工業	298,100	1,053	313,899,300	
ミネベア	314,000	490	153,860,000	
日立製作所	4,788,000	316	1,513,008,000	
東芝	4,854,000	520	2,524,080,000	
三菱電機	1,999,000	720	1,439,280,000	
富士電機ホールディングス	588,000	167	98,196,000	
東洋電機製造	47,000	760	35,720,000	
安川電機	253,000	814	205,942,000	
シンフォニアテクノロジー	128,000	199	25,472,000	
明電舎	212,000	442	93,704,000	
オリジン電気	31,000	412	12,772,000	
デンヨー	21,800	751	16,371,800	
東芝テック	148,000	363	53,724,000	
芝浦メカトロニクス	33,000	336	11,088,000	
マブチモーター	31,400	5,070	159,198,000	
日本電産	103,900	8,850	919,515,000	
高岳製作所	91,000	312	28,392,000	
ダイヘン	116,000	351	40,716,000	
JVC・ケンウッド・ホールディングス	886,700	41	36,354,700	
日新電機	39,000	487	18,993,000	
大崎電気工業	33,000	939	30,987,000	
オムロン	256,800	1,819	467,119,200	
日東工業	34,700	957	33,207,900	

I D E C	30,300	637	19,301,100	
エルピーダメモリ	225,200	1,710	385,092,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	415,000	618	256,470,000	
サクサホールディングス	59,000	145	8,555,000	
メルコホールディングス	11,200	1,867	20,910,400	
テクノメディカ	17	294,000	4,998,000	
日本電気	2,757,000	249	686,493,000	
富士通	2,223,000	578	1,284,894,000	
沖電気工業	735,000	79	58,065,000	
岩崎通信機	97,000	74	7,178,000	
電気興業	61,000	428	26,108,000	
サンケン電気	126,000	284	35,784,000	
ナカヨ通信機	23,000	168	3,864,000	
アイホン	15,600	1,538	23,992,800	
NECエレクトロニクス	53,100	731	38,816,100	
セイコーエプソン	171,700	1,670	286,739,000	
ワコム	424	193,300	81,959,200	
アルバック	36,900	2,418	89,224,200	
ナナオ	17,900	2,275	40,722,500	
日本信号	53,700	916	49,189,200	
京三製作所	49,000	449	22,001,000	
能美防災	26,000	586	15,236,000	
ホーチキ	23,000	514	11,822,000	
マスプロ電工	16,200	850	13,770,000	
日本無線	80,000	183	14,640,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
パナソニック	2,107,600	1,506	3,174,045,600	
シャープ	1,034,000	1,145	1,183,930,000	
アンリツ	111,000	324	35,964,000	
富士通ゼネラル	59,000	310	18,290,000	
日立国際電気	53,000	862	45,686,000	
ソニー	1,150,800	3,145	3,619,266,000	
T D K	111,300	5,870	653,331,000	
帝国通信工業	51,000	213	10,863,000	
三洋電機	2,271,000	160	363,360,000	
ミツミ電機	68,900	1,661	114,442,900	
タムラ製作所	59,000	298	17,582,000	
アルプス電気	182,000	560	101,920,000	
池上通信機	70,000	73	5,110,000	
パイオニア	180,500	311	56,135,500	
日本電波工業	14,900	1,913	28,503,700	
日本トリム	3,350	1,892	6,338,200	
ローランド ディー・ジー	9,100	1,238	11,265,800	
フォスター電機	19,000	2,675	50,825,000	
クラリオン	135,000	113	15,255,000	
S M K	68,000	564	38,352,000	
ヨコオ	18,000	550	9,900,000	
東光	98,000	127	12,446,000	
ティアック	141,000	34	4,794,000	
ホンデン	57,300	1,108	63,488,400	
ヒロセ電機	37,300	9,950	371,135,000	
日本航空電子工業	46,000	722	33,212,000	
T O A	28,000	497	13,916,000	
ユニデン	69,000	222	15,318,000	

アルパイン	46,200	1,094	50,542,800	
スミダコーポレーション	15,700	740	11,618,000	
アイコム	11,800	2,210	26,078,000	
船井電機	18,400	4,790	88,136,000	
横河電機	230,800	773	178,408,400	
新電元工業	74,000	251	18,574,000	
山武	59,200	2,110	124,912,000	
日本光電工業	39,500	1,478	58,381,000	
チノー	42,000	226	9,492,000	
共和電業	23,000	256	5,888,000	
日本電子材料	8,400	601	5,048,400	
堀場製作所	36,600	2,239	81,947,400	
アドバンテスト	157,200	2,510	394,572,000	
小野測器	29,000	403	11,687,000	
エスベック	22,700	522	11,849,400	
サンクス	20,200	338	6,827,600	
キーエンス	43,500	20,960	911,760,000	
日置電機	11,200	1,594	17,852,800	
シスメックス	40,400	5,010	202,404,000	
メガチップス	17,400	1,407	24,481,800	
O B A R A	17,000	848	14,416,000	
日本電産コパル電子	23,800	614	14,613,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ミヤチテクノス	11,900	689	8,199,100	
東京電波	6,700	605	4,053,500	
澤藤電機	12,000	154	1,848,000	
コーセル	30,700	1,206	37,024,200	
日立メディコ	14,000	828	11,592,000	
新日本無線	14,000	190	2,660,000	
オブテックス	15,800	915	14,457,000	
千代田インテグレ	12,100	984	11,906,400	
東光電気	15,000	643	9,645,000	
スタンレー電気	148,300	1,860	275,838,000	
岩崎電気	78,000	172	13,416,000	
ウシオ電機	130,000	1,653	214,890,000	
岡谷電機産業	12,500	277	3,462,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	18,300	295	5,398,500	
日本セラミック	15,100	1,114	16,821,400	
新神戸電機	18,000	917	16,506,000	
日本デジタル研究所	20,000	1,108	22,160,000	
古河電池	14,000	707	9,898,000	
双信電機	11,200	388	4,345,600	
山一電機	19,100	332	6,341,200	
図研	16,300	672	10,953,600	
日本電子	86,000	352	30,272,000	
カシオ計算機	239,700	695	166,591,500	
ファナック	222,900	8,460	1,885,734,000	
日本シイエムケイ	45,100	775	34,952,500	
エンプラス	12,000	1,730	20,760,000	
ローム	107,300	6,450	692,085,000	
浜松ホトニクス	84,000	2,194	184,296,000	
三井ハイテック	30,400	804	24,441,600	
新光電気工業	58,100	1,282	74,484,200	
京セラ	178,100	8,020	1,428,362,000	

日本インター	24,900	253	6,299,700	
太陽誘電	86,000	1,409	121,174,000	
村田製作所	241,900	4,950	1,197,405,000	
ユーシン	25,300	575	14,547,500	
双葉電子工業	39,700	1,676	66,537,200	
北陸電気工業	86,000	159	13,674,000	
パナソニック電工	376,000	1,064	400,064,000	
ニチコン	72,600	1,103	80,077,800	
日本ケミコン	109,000	359	39,131,000	
K O A	29,000	986	28,594,000	
市光工業	55,000	150	8,250,000	
小糸製作所	104,000	1,619	168,376,000	
ミツバ	39,000	419	16,341,000	
アロカ	12,500	678	8,475,000	
スター精密	44,400	901	40,004,400	
大日本スクリーン製造	236,000	430	101,480,000	
キャノン電子	20,800	1,990	41,392,000	
キャノン	1,336,900	3,770	5,040,113,000	
リコー	640,000	1,326	848,640,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日本電産サンキョー	55,000	788	43,340,000	
MUTOHホールディングス	36,000	149	5,364,000	
東京エレクトロン	181,000	5,770	1,044,370,000	
トヨタ紡織	67,200	2,164	145,420,800	
鬼怒川ゴム工業	48,000	260	12,480,000	
ユニプレス	32,000	1,436	45,952,000	
豊田自動織機	186,600	2,910	543,006,000	
モリタホールディングス	34,000	424	14,416,000	
三櫻工業	26,700	556	14,845,200	
デンソー	506,400	2,904	1,470,585,600	
東海理化電機製作所	54,000	2,047	110,538,000	
三井造船	892,000	231	206,052,000	
佐世保重工業	151,000	208	31,408,000	
川崎重工業	1,674,000	248	415,152,000	
日本車輛製造	84,000	580	48,720,000	
日本輸送機	27,000	188	5,076,000	
近畿車輛	35,000	669	23,415,000	
日産自動車	2,589,400	750	1,942,050,000	
いすゞ自動車	1,458,000	205	298,890,000	
トヨタ自動車	2,962,400	4,055	12,012,532,000	代用有価証券で 500,000株 担保差入
日野自動車	288,000	345	99,360,000	
三菱自動車工業	4,758,000	134	637,572,000	
エフテック	8,000	1,214	9,712,000	
武蔵精密工業	22,400	2,012	45,068,800	
トヨタ車体	41,900	1,704	71,397,600	
日産車体	90,000	797	71,730,000	
関東自動車工業	35,100	835	29,308,500	
新明和工業	94,000	299	28,106,000	
極東開発工業	39,800	327	13,014,600	
日信工業	37,500	1,404	52,650,000	
トピー工業	190,000	166	31,540,000	
ティラド	70,000	210	14,700,000	
曙ブレーキ工業	87,700	520	45,604,000	

タチエス	30,200	835	25,217,000	
NOK	111,600	1,383	154,342,800	
フタバ産業	70,200	921	64,654,200	
カヤバ工業	144,000	311	44,784,000	
シロキ工業	45,000	235	10,575,000	
大同メタル工業	32,000	236	7,552,000	
プレス工業	106,000	177	18,762,000	
カルソニックカンセイ	157,000	267	41,919,000	
太平洋工業	47,000	536	25,192,000	
ケーヒン	42,400	1,511	64,066,400	
河西工業	29,000	260	7,540,000	
アイシン精機	189,900	2,675	507,982,500	
富士機工	27,000	106	2,862,000	
マツダ	1,402,000	241	337,882,000	
ダイハツ工業	214,000	929	198,806,000	
愛知機械工業	52,000	371	19,292,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
今仙電機製作所	16,600	1,213	20,135,800	
本田技研工業	1,839,200	3,230	5,940,616,000	
スズキ	427,400	2,157	921,901,800	
富士重工業	729,000	436	317,844,000	
ヤマハ発動機	266,700	1,284	342,442,800	
ショーワ	49,100	558	27,397,800	
T B K	24,000	191	4,584,000	
エクセディ	27,900	1,909	53,261,100	
豊田合成	65,200	2,728	177,865,600	
愛三工業	23,900	892	21,318,800	
ヨロズ	13,900	1,231	17,110,900	
エフ・シー・シー	30,200	1,711	51,672,200	
シマノ	89,400	3,745	334,803,000	
タカタ	35,200	2,135	75,152,000	
テイ・エス テック	43,800	1,781	78,007,800	
日本電産トーソク	6,900	1,141	7,872,900	
テルモ	166,100	5,090	845,449,000	
クリエートメディック	7,200	886	6,379,200	
日機装	68,000	547	37,196,000	
島津製作所	254,000	613	155,702,000	
J M S	35,000	355	12,425,000	
クボテック	59	24,790	1,462,610	
モリテックス	5,800	280	1,624,000	
東京計器	81,000	129	10,449,000	
愛知時計電機	43,000	264	11,352,000	
東京精密	44,200	1,268	56,045,600	
ニコン	401,800	1,974	793,153,200	
トプコン	47,000	516	24,252,000	
オリンパス	252,500	2,899	731,997,500	
理研計器	19,000	588	11,172,000	
タムロン	20,500	1,013	20,766,500	
HOYA	498,300	2,609	1,300,064,700	
ノーリツ鋼機	20,200	634	12,806,800	
エー・アンド・デイ	18,400	340	6,256,000	
日本電産コバル	22,700	1,310	29,737,000	
シチズンホールディングス	250,800	563	141,200,400	
リズム時計工業	112,000	143	16,016,000	

セイコーホールディングス	84,000	165	13,860,000	
ニプロ	45,900	1,944	89,229,600	
S R I スポーツ	132	87,100	11,497,200	
パンダイナムコホールディングス	250,600	899	225,289,400	
共立印刷	25,100	122	3,062,200	
フランスベッドホールディングス	159,000	137	21,783,000	
パイロットコーポレーション	201	99,200	19,939,200	
トッパン・フォームズ	41,700	1,024	42,700,800	
フジシールインターナショナル	21,500	1,886	40,549,000	
タカラトミー	69,800	735	51,303,000	
廣済堂	20,700	197	4,077,900	
タカノ	9,600	485	4,656,000	
プロネクサス	26,400	575	15,180,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ウッドワン	64,000	235	15,040,000	
大建工業	115,000	232	26,680,000	
凸版印刷	651,000	779	507,129,000	
大日本印刷	652,000	1,215	792,180,000	
図書印刷	41,000	160	6,560,000	
共同印刷	73,000	251	18,323,000	
日本写真印刷	35,500	4,425	157,087,500	
光村印刷	24,000	310	7,440,000	
宝印刷	11,900	726	8,639,400	
コンビ	14,000	628	8,792,000	
アシックス	200,000	944	188,800,000	
ツツミ	10,400	1,823	18,959,200	
ローランド	17,300	841	14,549,300	
小松ウオール工業	8,400	1,037	8,710,800	
ヤマハ	155,400	1,135	176,379,000	
河合楽器製作所	92,000	113	10,396,000	
クリナップ	31,300	731	22,880,300	
ビジョン	13,100	3,690	48,339,000	
パラマウントベッド	23,000	1,895	43,585,000	
キングジム	19,500	682	13,299,000	
リンテック	49,400	1,813	89,562,200	
イトーキ	52,100	189	9,846,900	
任天堂	121,700	25,530	3,107,001,000	
三菱鉛筆	19,500	1,167	22,756,500	
タカラスタンダード	115,000	532	61,180,000	
コクヨ	119,800	732	87,693,600	
ナカバヤシ	49,000	194	9,506,000	
グローブライド	121,000	105	12,705,000	
サンウエーブ工業	47,000	297	13,959,000	
岡村製作所	90,000	460	41,400,000	
美津濃	116,000	453	52,548,000	
アデランスホールディングス	27,000	1,105	29,835,000	
東京電力	1,356,100	2,488	3,373,976,800	代用有価証券で 300,000株 担保差入
中部電力	725,100	2,326	1,686,582,600	
関西電力	888,600	2,121	1,884,720,600	
中国電力	318,800	1,833	584,360,400	
北陸電力	220,900	2,086	460,797,400	
東北電力	540,100	1,918	1,035,911,800	
四国電力	238,600	2,553	609,145,800	

九州電力	475,300	1,999	950,124,700	
北海道電力	200,400	1,778	356,311,200	
沖縄電力	15,100	5,050	76,255,000	
電源開発	143,100	2,706	387,228,600	
東京瓦斯	2,724,000	371	1,010,604,000	
大阪瓦斯	2,318,000	325	753,350,000	
東邦瓦斯	601,000	515	309,515,000	
北海道瓦斯	41,000	245	10,045,000	
西部瓦斯	261,000	256	66,816,000	
静岡瓦斯	65,500	611	40,020,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
東武鉄道	922,000	501	461,922,000	
相鉄ホールディングス	338,000	390	131,820,000	
東京急行電鉄	1,176,000	378	444,528,000	
京浜急行電鉄	592,000	708	419,136,000	
小田急電鉄	686,000	744	510,384,000	
京王電鉄	598,000	579	346,242,000	
京成電鉄	321,000	511	164,031,000	
富士急行	63,000	485	30,555,000	
新京成電鉄	30,000	374	11,220,000	
東日本旅客鉄道	400,900	6,180	2,477,562,000	
西日本旅客鉄道	1,862	318,500	593,047,000	
東海旅客鉄道	1,847	674,000	1,244,878,000	
アートコーポレーション	5,500	1,417	7,793,500	
西日本鉄道	301,000	355	106,855,000	
ハマキョウレックス	6,600	2,030	13,398,000	
サカイ引越センター	4,200	2,080	8,736,000	
近畿日本鉄道	1,960,000	314	615,440,000	
阪急阪神ホールディングス	1,456,000	434	631,904,000	
南海電気鉄道	452,000	370	167,240,000	
京阪電気鉄道	486,000	378	183,708,000	
名糖運輸	8,700	781	6,794,700	
名古屋鉄道	757,000	271	205,147,000	
日本通運	913,000	399	364,287,000	
ヤマトホールディングス	435,600	1,299	565,844,400	
山九	257,000	482	123,874,000	
丸運	12,400	220	2,728,000	
丸全昭和運輸	70,000	310	21,700,000	
センコー	72,000	340	24,480,000	
トナミホールディングス	53,000	190	10,070,000	
日本梱包運輸倉庫	64,000	1,000	64,000,000	
日本石油輸送	26,000	195	5,070,000	
福山通運	160,000	444	71,040,000	
セイノーホールディングス	164,000	648	106,272,000	
神奈川中央交通	27,000	512	13,824,000	
日立物流	40,000	1,224	48,960,000	
日本郵船	1,552,000	343	532,336,000	
商船三井	1,036,000	608	629,888,000	
川崎汽船	549,000	347	190,503,000	
新和海運	81,000	295	23,895,000	
乾汽船	25,300	719	18,190,700	
明治海運	20,600	458	9,434,800	
飯野海運	103,400	485	50,149,000	
共栄タンカー	16,000	228	3,648,000	

第一中央汽船	151,000	253	38,203,000	
全日本空輸	3,073,000	270	829,710,000	
パスコ	30,000	170	5,100,000	
国際航業ホールディングス	34,000	221	7,514,000	
日新	87,000	196	17,052,000	
三菱倉庫	160,000	1,027	164,320,000	
三井倉庫	90,000	334	30,060,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
住友倉庫	154,000	424	65,296,000	
澁澤倉庫	60,000	292	17,520,000	
東陽倉庫	37,000	188	6,956,000	
日本トランスシティ	48,000	267	12,816,000	
ケイヒン	42,000	100	4,200,000	
安田倉庫	17,800	578	10,288,400	
東洋埠頭	66,000	169	11,154,000	
宇徳	14,600	242	3,533,200	
上組	255,000	691	176,205,000	
サンリツ	6,000	556	3,336,000	
キムラユニティー	5,200	725	3,770,000	
キューソー流通システム	6,400	926	5,926,400	
郵船航空サービス	18,100	1,276	23,095,600	
近鉄エクスプレス	18,000	2,515	45,270,000	
東海運	14,500	226	3,277,000	
バンテック	106	133,700	14,172,200	
システムプロ	164	42,000	6,888,000	
新日鉄ソリューションズ	19,400	1,463	28,382,200	
コア	9,400	690	6,486,000	
ITホールディングス	73,600	1,062	78,163,200	
コーエーテクモホールディングス	45,900	720	33,048,000	
ドワンゴ	128	168,000	21,504,000	
ベリサーブ	16	207,100	3,313,600	
マクロミル	129	131,400	16,950,600	
ティーガイア	184	158,100	29,090,400	
GMOペイメントゲートウェイ	54	112,000	6,048,000	
ザッパラス	72	149,900	10,792,800	
インターネットイニシアティブ	133	166,400	22,131,200	
ソネットエンタテインメント	110	211,900	23,309,000	
SRAホールディングス	11,700	820	9,594,000	
JBI Sホールディングス	25,400	347	8,813,800	
朝日ネット	16,000	275	4,400,000	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	4,800	2,327	11,169,600	
フェイス	771	10,050	7,748,550	
野村総合研究所	132,000	1,934	255,288,000	
サイバネットシステム	202	37,450	7,564,900	
インテージ	7,100	1,585	11,253,500	
シンプレクス・テクノロジー	310	43,050	13,345,500	
クレスコ	7,000	447	3,129,000	
フジ・メディア・ホールディングス	2,370	135,300	320,661,000	
オービック	7,530	15,480	116,564,400	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	5,700	784	4,468,800	
ヤフー	12,482	31,550	393,807,100	
トレンドマイクロ	92,100	3,450	317,745,000	

日本オラクル	38,000	3,900	148,200,000	
アルファシステムズ	6,600	1,701	11,226,600	
フューチャーアーキテクト	255	36,350	9,269,250	
シーエーシー	14,800	648	9,590,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ソフトバンク・テクノロジー	5,300	715	3,789,500	
トーセ	6,600	626	4,131,600	
オービックビジネスコンサルタント	5,950	3,810	22,669,500	
日立ビジネスソリューション	8,100	641	5,192,100	
伊藤忠テクノソリューションズ	32,600	2,844	92,714,400	
アイティフォー	27,200	321	8,731,200	
東計電算	4,500	1,132	5,094,000	
エクスネット	22	130,500	2,871,000	
大塚商会	19,400	5,050	97,970,000	
サイボウズ	319	33,300	10,622,700	
アグレックス	5,300	779	4,128,700	
電通国際情報サービス	15,200	545	8,284,000	
ウェザーニューズ	6,500	1,155	7,507,500	
C I J	24,700	299	7,385,300	
ネットワンシステムズ	436	104,700	45,649,200	
アルゴグラフィックス	8,400	954	8,013,600	
エイベックス・グループ・ホールディングス	34,700	762	26,441,400	
日本ユニシス	55,900	706	39,465,400	
兼松エレクトロニクス	12,500	836	10,450,000	
東京放送ホールディングス	122,700	1,378	169,080,600	
日本テレビ放送網	19,980	12,360	246,952,800	
テレビ朝日	576	142,100	81,849,600	
テレビ東京	8,900	1,877	16,705,300	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,727	40,100	69,252,700	
アイ・ティ・シーネットワーク	48	203,000	9,744,000	
イー・アクセス	1,140	59,500	67,830,000	
N E C モバイルリング	7,300	2,396	17,490,800	
日本電信電話	896,700	3,965	3,555,415,500	
K D D I	3,532	539,000	1,903,748,000	
光通信	29,200	1,648	48,121,600	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	18,880	137,800	2,601,664,000	
G M O インターネット	64,400	378	24,343,200	
学研ホールディングス	99,000	228	22,572,000	
ゼンリン	30,100	1,071	32,237,100	
昭文社	12,400	582	7,216,800	
角川グループホールディングス	19,500	2,246	43,797,000	
インプレスホールディングス	18,700	213	3,983,100	
アイネット	12,100	510	6,171,000	
松竹	127,000	852	108,204,000	
東宝	162,400	1,524	247,497,600	
東映	87,000	502	43,674,000	
葵プロモーション	9,500	492	4,674,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,406	277,000	389,462,000	
D T S	22,400	877	19,644,800	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	57,800	1,945	112,421,000	
シーエーシー	13,500	524	7,074,000	
カプコン	48,500	1,612	78,182,000	
ジャステック	14,400	493	7,099,200	
住商情報システム	23,800	1,342	31,939,600	

日本システムウエア	10,600	300	3,180,000	
-----------	--------	-----	-----------	--

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
アイネス	28,400	722	20,504,800	
T K C	21,400	1,720	36,808,000	
富士ソフト	28,600	1,505	43,043,000	
日本システムディベロップメント	48,300	954	46,078,200	
コナミ	92,500	1,570	145,225,000	
福井コンピュータ	7,000	311	2,177,000	
J B C Cホールディングス	18,500	588	10,878,000	
ソフトバンク	930,000	2,435	2,264,550,000	
ハウスイ	19,000	109	2,071,000	
インターニックス	8,500	328	2,788,000	
高千穂交易	8,700	950	8,265,000	
伊藤忠食品	5,600	3,100	17,360,000	
エレマテック	15,100	1,044	15,764,400	
J A L U X	7,300	807	5,891,100	
トーメンデバイス	2,900	1,745	5,060,500	
双日	1,523,300	174	265,054,200	
アルフレッサ ホールディングス	54,100	3,840	207,744,000	
横浜冷凍	49,000	629	30,821,000	
神栄	29,000	132	3,828,000	
山下医科器械	1,800	1,145	2,061,000	
ラサ商事	12,700	325	4,127,500	
あい ホールディングス	56,800	283	16,074,400	
ダイワボウホールディングス	169,000	199	33,631,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	29,800	572	17,045,600	
U K Cホールディングス	12,400	1,165	14,446,000	
日本コークス工業	206,000	106	21,836,000	
ミタチ産業	4,700	506	2,378,200	
J F E 商事ホールディングス	155,000	345	53,475,000	
シップヘルスケアホールディングス	270	51,300	13,851,000	
協栄産業	25,000	186	4,650,000	
小野建	18,800	715	13,442,000	
佐鳥電機	16,700	545	9,101,500	
エコトレーディング	5,200	942	4,898,400	
伯東	13,800	812	11,205,600	
中山福	14,200	586	8,321,200	
ナガイレーベン	14,100	1,909	26,916,900	
菱食	22,100	2,415	53,371,500	
松田産業	15,000	1,689	25,335,000	
メディバルホールディングス	227,600	1,148	261,284,800	
アドヴァン	22,100	600	13,260,000	
S P K	5,000	1,281	6,405,000	
アズワン	13,700	1,631	22,344,700	
スズデン	8,300	470	3,901,000	
尾家産業	7,500	831	6,232,500	
シモジマ	15,600	1,255	19,578,000	
ドウシシャ	11,100	1,980	21,978,000	
高速	13,500	663	8,950,500	
黒田電気	30,400	1,341	40,766,400	
丸文	18,100	550	9,955,000	
ハピネット	6,500	1,145	7,442,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
トーメンエレクトロニクス	6,900	947	6,534,300	
エクセル	9,800	1,044	10,231,200	
マルカキカイ	8,000	601	4,808,000	
ガリバーインターナショナル	5,360	5,530	29,640,800	
日本エム・ディ・エム	20,100	255	5,125,500	
進和	12,700	1,192	15,138,400	
エスケイジャパン	7,000	365	2,555,000	
ダイトエレクトロン	9,600	416	3,993,600	
シークス	14,400	1,030	14,832,000	
田中商事	20,400	354	7,221,600	
オーハシテクニカ	13,300	530	7,049,000	
マクニカ	9,100	1,376	12,521,600	
白銅	8,000	561	4,488,000	
伊藤忠商事	1,475,000	747	1,101,825,000	
丸紅	1,742,000	525	914,550,000	
高島	77,000	132	10,164,000	
F & A アクアホールディングス	18,800	999	18,781,200	
長瀬産業	119,000	1,072	127,568,000	
蝶理	162,000	100	16,200,000	
豊田通商	202,800	1,447	293,451,600	
三共生興	42,100	285	11,998,500	
ツカモトコーポレーション	49,000	74	3,626,000	
三井物産	1,833,500	1,394	2,555,899,000	
日本紙パルプ商事	120,000	318	38,160,000	
日立ハイテクノロジーズ	69,000	1,882	129,858,000	
カメイ	30,000	453	13,590,000	
東都水産	38,000	144	5,472,000	
スターゼン	76,000	246	18,696,000	
山善	90,200	321	28,954,200	
椿本興業	26,000	188	4,888,000	
住友商事	1,164,000	1,037	1,207,068,000	
内田洋行	53,000	239	12,667,000	
三菱商事	1,700,300	2,292	3,897,087,600	
第一実業	53,000	242	12,826,000	
キャノンマーケティングジャパン	75,700	1,335	101,059,500	
西華産業	88,000	200	17,600,000	
佐藤商事	21,000	486	10,206,000	
菱洋エレクトロ	25,300	782	19,784,600	
東京産業	20,500	252	5,166,000	
神鋼商事	63,000	157	9,891,000	
阪和興業	227,000	360	81,720,000	
カナデン	24,000	482	11,568,000	
菱電商事	35,000	456	15,960,000	
フルサト工業	13,700	518	7,096,600	
岩谷産業	237,000	265	62,805,000	
すてきナイスグループ	126,000	199	25,074,000	
昭光通商	89,000	110	9,790,000	
二チモウ	39,000	140	5,460,000	
極東貿易	34,000	125	4,250,000	
イワキ	24,000	246	5,904,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
三愛石油	58,000	357	20,706,000	

稲畑産業	58,800	371	21,814,800	
明和産業	23,500	184	4,324,000	
東邦ホールディングス	58,700	1,207	70,850,900	
サンゲツ	39,300	2,048	80,486,400	
ミツウロコ	38,900	657	25,557,300	
シナネン	57,000	402	22,914,000	
伊藤忠エネクス	50,200	409	20,531,800	
ザ・トーカイ	54,000	494	26,676,000	
サンリオ	64,000	715	45,760,000	
サンワテクノス	11,100	433	4,806,300	
リョーサン	34,600	2,254	77,988,400	
新光商事	21,400	782	16,734,800	
トーホー	44,000	349	15,356,000	
三信電気	23,800	703	16,731,400	
東陽テクニカ	35,400	766	27,116,400	
モスフードサービス	29,800	1,511	45,027,800	
加賀電子	22,600	947	21,402,200	
ソーダニッカ	25,000	338	8,450,000	
立花エレテック	14,400	682	9,820,800	
ヤマタネ	107,000	127	13,589,000	
丸紅建材リース	27,000	118	3,186,000	
トラスコ中山	26,700	1,309	34,950,300	
オートボックスセブン	26,800	2,892	77,505,600	
加藤産業	32,900	1,608	52,903,200	
イエローハット	21,500	707	15,200,500	
富士エレクトロニクス	12,900	872	11,248,800	
J Kホールディングス	31,500	374	11,781,000	
ユニダックス	13,000	451	5,863,000	
日伝	9,400	2,443	22,964,200	
北沢産業	42,500	193	8,202,500	
杉本商事	12,000	807	9,684,000	
因幡電機産業	23,500	2,159	50,736,500	
住金物産	111,000	187	20,757,000	
ミスミグループ本社	76,500	1,608	123,012,000	
江守商事	5,300	713	3,778,900	
タキヒヨー	39,000	480	18,720,000	
スズケン	80,700	3,160	255,012,000	
ジェコス	27,600	384	10,598,400	
ローソン	64,200	4,110	263,862,000	
サンエー	7,800	3,225	25,155,000	
キリン堂	9,200	418	3,845,600	
ダイユーエイト	3,300	609	2,009,700	
カワチ薬品	14,100	1,765	24,886,500	
エービーシー・マート	24,000	2,671	64,104,000	
ハードオフコーポレーション	9,200	460	4,232,000	
アスクル	19,200	1,655	31,776,000	
ゲオ	378	98,200	37,119,600	
ポイント	20,480	5,000	102,400,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	15,000	127	1,905,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
くらコーポレーション	60	272,000	16,320,000	
キャンドウ	104	94,100	9,786,400	
パル	5,850	1,895	11,085,750	
エディオン	90,900	914	83,082,600	

サーラコーポレーション	22,000	569	12,518,000	
パルス	95	72,400	6,878,000	
あみやき亭	40	209,900	8,396,000	
ハニーズ	16,120	569	9,172,280	
アルペン	17,400	1,386	24,116,400	
ビックカメラ	554	31,500	17,451,000	
D C M J a p a nホールディングス	114,300	580	66,294,000	
ユニバース	3,000	1,240	3,720,000	
J . フロント リテイリング	538,000	443	238,334,000	
ドトール・日レスホールディングス	36,400	1,168	42,515,200	
マツモトキヨシホールディングス	38,400	2,090	80,256,000	
ココカラファイン ホールディングス	17,200	1,646	28,311,200	
三越伊勢丹ホールディングス	395,500	867	342,898,500	
クリエイトS Dホールディングス	8,000	1,742	13,936,000	
ブックオフコーポレーション	9,800	895	8,771,000	
あさひ	9,400	1,434	13,479,600	
サークルKサンクス	43,300	1,211	52,436,300	
日本調剤	3,550	2,042	7,249,100	
コスモス薬品	8,600	2,200	18,920,000	
セブン&アイ・ホールディングス	908,600	1,948	1,769,952,800	
ツルハホールディングス	17,000	3,460	58,820,000	
サンマルクホールディングス	6,600	2,690	17,754,000	
フェリシモ	5,800	1,282	7,435,600	
トリドール	57	170,600	9,724,200	
総合メディカル	5,000	2,097	10,485,000	
はるやま商事	10,800	373	4,028,400	
カッパ・クリエイト	15,050	1,988	29,919,400	
ライトオン	17,100	715	12,226,500	
ジーンズメイト	7,400	457	3,381,800	
良品計画	24,100	3,830	92,303,000	
三城ホールディングス	28,200	787	22,193,400	
コナカ	27,000	328	8,856,000	
ハウス オブ ローゼ	2,300	1,308	3,008,400	
G - 7ホールディングス	6,800	531	3,610,800	
イオン北海道	14,700	270	3,969,000	
コジマ	30,800	547	16,847,600	
コーナン商事	20,000	1,036	20,720,000	
エコス	7,800	642	5,007,600	
ワタミ	23,900	1,693	40,462,700	
マルシェ	5,600	720	4,032,000	
ドン・キホーテ	41,300	2,050	84,665,000	
メガネトップ	19,600	935	18,326,000	
西松屋チェーン	49,900	820	40,918,000	
ゼンショー	85,200	668	56,913,600	
幸楽苑	12,900	1,220	15,738,000	
ユニマットライフ	9,500	894	8,493,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ハークスレイ	5,600	655	3,668,000	
サイゼリヤ	33,700	1,663	56,043,100	
ポプラ	6,700	575	3,852,500	
ユナイテッドアローズ	24,600	882	21,697,200	
ハイデイ日高	9,200	1,020	9,384,000	
京都きもの友禅	13,300	891	11,850,300	
コロワイド	51,500	614	31,621,000	

壱番屋	8,000	2,170	17,360,000	
トップカルチャー	7,500	355	2,662,500	
スギホールディングス	31,800	2,156	68,560,800	
スクロール	22,700	319	7,241,300	
ファミリーマート	69,900	2,927	204,597,300	
木曽路	24,200	1,960	47,432,000	
千趣会	41,100	494	20,303,400	
タカキュー	18,000	158	2,844,000	
ケーヨー	42,800	406	17,376,800	
上新電機	50,000	746	37,300,000	
日本瓦斯	24,500	1,464	35,868,000	
マルエツ	46,000	400	18,400,000	
ロイヤルホールディングス	35,100	938	32,923,800	
東天紅	17,000	151	2,567,000	
いなげや	26,000	951	24,726,000	
島忠	51,500	1,849	95,223,500	
チヨダ	29,900	1,205	36,029,500	
鈴丹	5,900	223	1,315,700	
ライフコーポレーション	14,600	1,639	23,929,400	
カスミ	46,800	471	22,042,800	
リンガーハット	15,800	1,279	20,208,200	
さが美	18,000	136	2,448,000	
MrMax	22,900	429	9,824,100	
テンアライド	15,500	323	5,006,500	
AOKIホールディングス	21,200	953	20,203,600	
オークワ	29,000	899	26,071,000	
コメリ	27,300	2,453	66,966,900	
青山商事	53,100	1,307	69,401,700	
しまむら	23,800	8,390	199,682,000	
CFSコーポレーション	19,000	483	9,177,000	
高島屋	284,000	672	190,848,000	
丸善	115,000	67	7,705,000	
松屋	42,100	866	36,458,600	
エイチ・ツー・オー リテイリング	118,000	567	66,906,000	
丸栄	33,000	121	3,993,000	
ニッセンホールディングス	45,700	298	13,618,600	
パルコ	59,200	744	44,044,800	
丸井グループ	251,000	591	148,341,000	
原信ナルスホールディングス	12,700	1,075	13,652,500	
ダイエー	96,900	329	31,880,100	
イズミヤ	74,000	409	30,266,000	
イオン	745,000	881	656,345,000	
ユニー	170,600	676	115,325,600	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
イズミ	61,800	1,166	72,058,800	
東武ストア	31,000	280	8,680,000	
平和堂	42,000	1,205	50,610,000	
フジ	28,200	1,796	50,647,200	
ヤオコー	10,100	2,799	28,269,900	
ゼビオ	24,100	1,752	42,223,200	
ケーズホールディングス	36,400	2,996	109,054,400	
Olympic	15,200	637	9,682,400	
東日カーライフグループ	34,000	110	3,740,000	
元気寿司	6,400	1,194	7,641,600	

ヤマダ電機	103,800	6,070	630,066,000	
アークランドサカモト	13,400	990	13,266,000	
ニトリ	40,950	6,820	279,279,000	
グルメ杵屋	15,000	549	8,235,000	
愛眼	16,700	506	8,450,200	
吉野家ホールディングス	617	103,300	63,736,100	
松屋フーズ	11,000	1,372	15,092,000	
サガミチェーン	25,000	758	18,950,000	
プレナス	25,500	1,315	33,532,500	
ミニストップ	16,900	1,107	18,708,300	
アークス	27,000	1,284	34,668,000	
パロー	41,600	741	30,825,600	
ベルク	9,100	858	7,807,800	
大庄	13,700	1,250	17,125,000	
ファーストリテイリング	45,600	15,180	692,208,000	
サンドラッグ	43,300	2,115	91,579,500	
ヤマザワ	6,000	1,300	7,800,000	
やまや	4,300	698	3,001,400	
ペルーナ	28,550	370	10,563,500	
新生銀行	1,033,000	114	117,762,000	
あおぞら銀行	709,000	113	80,117,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	16,180,500	493	7,976,986,500	
りそなホールディングス	608,900	1,133	689,883,700	
中央三井トラスト・ホールディングス	1,206,000	340	410,040,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,238,500	3,000	3,715,500,000	
第四銀行	297,000	311	92,367,000	
北越銀行	239,000	151	36,089,000	
西日本シティ銀行	742,000	246	182,532,000	
札幌北洋ホールディングス	314,600	374	117,660,400	
千葉銀行	834,000	560	467,040,000	
横浜銀行	1,462,000	447	653,514,000	
常陽銀行	824,000	385	317,240,000	
群馬銀行	531,000	498	264,438,000	
武蔵野銀行	34,500	2,485	85,732,500	
千葉興業銀行	43,600	686	29,909,600	
関東つくば銀行	68,900	278	19,154,200	
東京都民銀行	40,100	1,256	50,365,600	
七十七銀行	357,000	506	180,642,000	
青森銀行	160,000	224	35,840,000	
秋田銀行	156,000	380	59,280,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
山形銀行	131,000	455	59,605,000	
岩手銀行	15,300	5,260	80,478,000	
東邦銀行	194,000	293	56,842,000	
東北銀行	116,000	142	16,472,000	
みちのく銀行	115,000	188	21,620,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	862,000	347	299,114,000	
静岡銀行	661,000	810	535,410,000	
十六銀行	278,000	366	101,748,000	
スルガ銀行	222,000	848	188,256,000	
八十二銀行	430,000	545	234,350,000	
山梨中央銀行	144,000	399	57,456,000	
大垣共立銀行	304,000	314	95,456,000	
福井銀行	195,000	304	59,280,000	

北國銀行	243,000	337	81,891,000	
清水銀行	7,700	3,900	30,030,000	
滋賀銀行	213,000	555	118,215,000	
南都銀行	214,000	515	110,210,000	
百五銀行	209,000	428	89,452,000	
京都銀行	380,000	789	299,820,000	
三重銀行	95,000	263	24,985,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,495,000	198	296,010,000	
広島銀行	627,000	370	231,990,000	
山陰合同銀行	138,000	735	101,430,000	
中国銀行	187,000	1,197	223,839,000	
鳥取銀行	73,000	251	18,323,000	
伊予銀行	260,000	792	205,920,000	
百十四銀行	249,000	355	88,395,000	
四国銀行	166,000	298	49,468,000	
阿波銀行	189,000	515	97,335,000	
鹿児島銀行	148,000	669	99,012,000	
大分銀行	147,000	335	49,245,000	
宮崎銀行	120,000	300	36,000,000	
肥後銀行	180,000	528	95,040,000	
佐賀銀行	132,000	268	35,376,000	
十八銀行	145,000	278	40,310,000	
沖縄銀行	17,500	3,510	61,425,000	
琉球銀行	45,000	1,050	47,250,000	
住友信託銀行	1,919,000	513	984,447,000	
みずほ信託銀行	1,799,000	96	172,704,000	
八千代銀行	12,000	2,029	24,348,000	
みずほフィナンシャルグループ	18,528,200	190	3,520,358,000	
紀陽ホールディングス	848,000	115	97,520,000	
山口フィナンシャルグループ	212,000	966	204,792,000	
長野銀行	79,000	186	14,694,000	
名古屋銀行	206,000	372	76,632,000	
愛知銀行	8,300	6,770	56,191,000	
第三銀行	140,000	277	38,780,000	
中京銀行	93,000	280	26,040,000	
東日本銀行	119,000	186	22,134,000	
愛媛銀行	143,000	266	38,038,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
トマト銀行	89,000	195	17,355,000	
みなと銀行	235,000	115	27,025,000	
京葉銀行	187,000	445	83,215,000	
関西アーバン銀行	227,000	138	31,326,000	
栃木銀行	114,000	402	45,828,000	
北日本銀行	7,100	2,712	19,255,200	
香川銀行	76,000	338	25,688,000	
東和銀行	230,000	64	14,720,000	
徳島銀行	62,000	339	21,018,000	
福島銀行	280,000	53	14,840,000	
大東銀行	145,000	67	9,715,000	
フィデアホールディングス	108,900	160	17,424,000	
池田泉州ホールディングス	728,200	315	229,383,000	
SBIホールディングス	21,006	17,880	375,587,280	
ジャフコ	38,200	2,420	92,444,000	
大和証券グループ本社	2,004,000	492	985,968,000	

野村ホールディングス	4,260,500	707	3,012,173,500	
みずほ証券	582,000	288	167,616,000	
みずほインベスターズ証券	531,000	97	51,507,000	
岡三証券グループ	194,000	464	90,016,000	
丸三証券	70,300	521	36,626,300	
東洋証券	86,000	182	15,652,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	246,000	367	90,282,000	
光世証券	56,000	102	5,712,000	
水戸証券	61,000	207	12,627,000	
いちよし証券	47,900	585	28,021,500	
松井証券	135,100	640	86,464,000	
だいこう証券ビジネス	11,300	378	4,271,400	
マネックスグループ	1,332	40,100	53,413,200	
カブドットコム証券	351	95,900	33,660,900	
極東証券	28,300	861	24,366,300	
岩井証券	19,900	609	12,119,100	
三井住友海上グループホールディングス	484,000	2,492	1,206,128,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	729	268,700	195,882,300	
日本興亜損害保険	766,000	551	422,066,000	
損害保険ジャパン	995,000	620	616,900,000	
ニッセイ同和損害保険	258,000	476	122,808,000	
あいおい損害保険	549,000	476	261,324,000	
東京海上ホールディングス	865,300	2,615	2,262,759,500	
T & Dホールディングス	382,000	2,041	779,662,000	
クレディセゾン	159,300	1,226	195,301,800	
セディナ	180,200	179	32,255,800	
芙蓉総合リース	20,000	2,093	41,860,000	
興銀リース	32,200	1,721	55,416,200	
東京センチュリーリース	54,400	1,133	61,635,200	
日本証券金融	95,400	765	72,981,000	
大阪証券金融	31,400	195	6,123,000	
ポケットカード	25,600	258	6,604,800	
リコーリース	16,200	1,963	31,800,600	
イオンクレジットサービス	118,500	983	116,485,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
アコム	68,860	1,671	115,065,060	
プロミス	118,800	935	111,078,000	
ジャックス	143,000	219	31,317,000	
日立キャピタル	54,500	1,285	70,032,500	
オリックス	110,480	7,060	779,988,800	
三菱UFJリース	63,320	3,205	202,940,600	
アサックス	45	77,700	3,496,500	
NECキャピタルソリューション	8,500	1,281	10,888,500	
昭栄	45,900	720	33,048,000	
東京建物不動産販売	28,200	282	7,952,400	
野村不動産ホールディングス	116,400	1,417	164,938,800	
ヒューリック	71,500	596	42,614,000	
パーク24	128,500	962	123,617,000	
三井不動産	947,000	1,627	1,540,769,000	
三菱地所	1,493,000	1,543	2,303,699,000	
平和不動産	179,000	288	51,552,000	
東京建物	451,000	378	170,478,000	
ダイビル	66,900	708	47,365,200	
サンケイビル	47,700	576	27,475,200	

東急不動産	449,000	355	159,395,000	
京阪神不動産	39,700	445	17,666,500	
住友不動産	511,000	1,714	875,854,000	
東宝不動産	34,400	528	18,163,200	
有楽土地	48,000	332	15,936,000	
テーオーシー	103,900	363	37,715,700	
東京楽天地	52,000	378	19,656,000	
レオパレス 2 1	178,300	374	66,684,200	
フジ住宅	42,500	345	14,662,500	
空港施設	34,800	498	17,330,400	
住友不動産販売	9,580	3,730	35,733,400	
ゴールドクレスト	17,450	2,698	47,080,100	
東栄住宅	19,200	775	14,880,000	
東急リバブル	27,300	778	21,239,400	
飯田産業	14,700	1,646	24,196,200	
アーネストワン	43,200	889	38,404,800	
サンヨーハウジング名古屋	176	81,200	14,291,200	
イオンモール	109,300	1,862	203,516,600	
タクトホーム	187	78,500	14,679,500	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,576	70,600	111,265,600	
日本空港ビルデング	62,600	1,229	76,935,400	
日本工営	83,000	293	24,319,000	
日本M & A センター	44	375,000	16,500,000	
アコーディア・ゴルフ	615	91,200	56,088,000	
パソナグループ	248	60,800	15,078,400	
リンクアンドモチベーション	61	43,000	2,623,000	
テンプホールディングス	33,600	743	24,964,800	
学情	9,600	293	2,812,800	
スタジオアリス	12,600	780	9,828,000	
シミック	420	18,660	7,837,200	
NECフィールドディング	20,000	1,295	25,900,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
総合警備保障	80,900	1,068	86,401,200	
カクコム	144	359,500	51,768,000	
ルネサンス	14,800	323	4,780,400	
新日本科学	13,300	590	7,847,000	
エムスリー	94	291,400	27,391,600	
ディー・エヌ・エー	278	564,000	156,792,000	
博報堂DYホールディングス	30,600	4,620	141,372,000	
ぐるなび	133	188,700	25,097,100	
一休	149	41,000	6,109,000	
ジャパンベストレスキューシステム	53	68,500	3,630,500	
ジェイコムホールディングス	27	87,200	2,354,400	
パシフィックゴルフグループインターナショナルホールディングス	526	65,500	34,453,000	
イーピーエス	66	342,000	22,572,000	
アミューズ	7,300	953	6,956,900	
ドリームインキュベータ	84	61,900	5,199,600	
TAC	15,300	366	5,599,800	
電通	219,100	2,229	488,373,900	
イオンファンタジー	9,100	1,032	9,391,200	
みらかホールディングス	46,000	2,818	129,628,000	
アルプス技研	10,600	573	6,073,800	
ダイオース	5,600	471	2,637,600	

日本空調サービス	6,200	728	4,513,600	
オリエンタルランド	58,600	6,210	363,906,000	
ダスキン	67,600	1,615	109,174,000	
明光ネットワークジャパン	22,000	566	12,452,000	
ファルコバイオシステムズ	13,000	950	12,350,000	
秀英予備校	6,800	520	3,536,000	
田谷	5,000	686	3,430,000	
ラウンドワン	33,600	631	21,201,600	
リゾートトラスト	38,400	1,184	45,465,600	
ビー・エム・エル	12,800	2,453	31,398,400	
ワタベウェディング	7,700	1,012	7,792,400	
もしもしホットライン	15,250	1,720	26,230,000	
東急コミュニティー	5,800	2,060	11,948,000	
リソー教育	2,670	5,390	14,391,300	
ウェアハウス	8,200	399	3,271,800	
ユー・エス・エス	30,430	5,820	177,102,600	
東京個別指導学院	21,800	159	3,466,200	
カルチュア・コンビニエンス・クラブ	85,700	460	39,422,000	
テー・オー・ダブリュー	6,300	500	3,150,000	
セントラルスポーツ	8,000	870	6,960,000	
リゾートソリューション	28,000	156	4,368,000	
エイチ・アイ・エス	22,800	1,760	40,128,000	
共立メンテナンス	10,700	1,379	14,755,300	
イチネンホールディングス	25,000	370	9,250,000	
建設技術研究所	13,300	461	6,131,300	
燦ホールディングス	5,600	1,548	8,668,800	
スバル興業	25,000	278	6,950,000	
東京テアトル	118,000	144	16,992,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ホリプロ	9,100	710	6,461,000	
よみうりランド	52,000	306	15,912,000	
東京都競馬	174,000	135	23,490,000	
カナモト	28,000	436	12,208,000	
東京ドーム	169,000	283	47,827,000	
トランス・コスモス	28,800	863	24,854,400	
乃村工藝社	49,000	243	11,907,000	
藤田観光	64,000	357	22,848,000	
日本管財	9,200	1,458	13,413,600	
白洋舎	29,000	261	7,569,000	
セコム	217,100	4,215	915,076,500	
セントラル警備保障	10,100	937	9,463,700	
丹青社	46,000	185	8,510,000	
メイテック	33,100	1,598	52,893,800	
アサツー ディ・ケイ	42,000	1,901	79,842,000	
応用地質	25,600	726	18,585,600	
船井総合研究所	24,400	515	12,566,000	
進学会	17,000	309	5,253,000	
ベネッセホールディングス	76,100	3,820	290,702,000	
イオンディライト	18,200	1,241	22,586,200	
ナック	11,600	875	10,150,000	
ニチイ学館	48,600	860	41,796,000	
ダイセキ	39,100	2,066	80,780,600	
合計	316,102,960		268,448,268,490	

（注）代用有価証券の担保差入株数には、約定未受渡株数を含んでおります。

B．株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額（円）	備考
新株予約権証券	DOWAホールディングス	146,000	3,796,000	
合計		146,000	3,796,000	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】平成22年2月26日

資産総額	223,526,041 円
負債総額	378,858 円
純資産総額（ - ）	223,147,183 円
発行済口数	229,853,937 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9708 円
1万口当たり純資産額	9,708 円

<参考>

マザーファンドの現況（平成22年2月26日）

純資産額計算書

（中央三井日本株式マザーファンド）

資産総額	259,682,056,589 円
負債総額	486,418,666 円
純資産総額（ - ）	259,195,637,923 円
発行済口数	333,929,066,003 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7762 円
1万口当たり純資産額	7,762 円

第5【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	1,555,017	0	1,555,017
第2期計算期間	93,999,407	2,228,267	93,326,157
第3期計算期間	28,932,267	5,800,703	116,457,721
第4期計算期間	41,664,444	12,672,388	145,449,777
第5期計算期間	56,467,574	28,778,080	173,139,271
第6期計算期間	46,335,543	31,614,420	187,860,394
第7期計算期間	60,022,780	42,886,862	204,996,312
第8期計算期間	67,618,005	45,647,733	226,966,584

（注1）設定及び解約の実績は、全て本邦内における実績です。

（注2）第1期計算期間の設定口数には、当初自己設定の設定口数を含みます。

第四部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

本書提出日現在の資本金の額：3億円

会社の発行可能株式総数：16,000株

発行済株式総数：5,050株

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

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

(2) 委託会社の機構

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

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

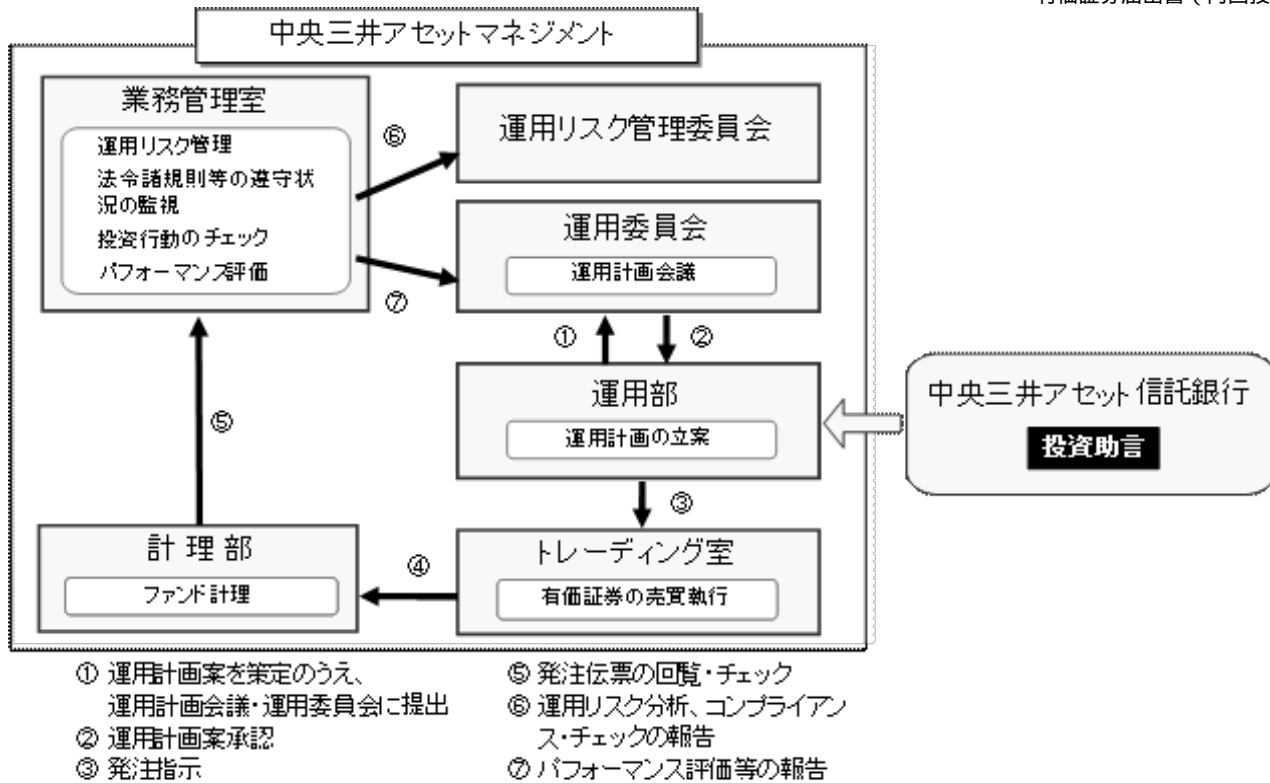
取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

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

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

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

委託会社は運用に当たり、中央三井トラスト・グループの運用会社として、クオリティの高い資産運用、スキル、ノウハウを結集し、分析力、運用力の向上を図っています。なお、そ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22年2月26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	55	415,231
追加型公社債投資信託	-	-
単位型株式投資信託	26	150,385
単位型公社債投資信託	-	-
合計	81	565,616

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）」に基づいて作成しております。

ただし、第22期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）は、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しており、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、改正後の財務諸表等規則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「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）」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22期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）及び第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期中間会計期間（平成21年4月1日から平成21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22期 平成20年3月31日		第23期 平成21年3月31日	
	金額(千円)	構成比 (%)	金額(千円)	構成比 (%)
(資産の部)				
流動資産				
1. 現金・預金		615,636	1,464,505	
2. 前払費用		397,534	130,306	
3. 未収委託者報酬		1,587,133	972,672	
4. 未収収益				
(1) 投資顧問報酬	493		-	
(2) その他	320	814	170	170
5. 繰延税金資産		37,141	29,168	
6. その他 2		36,684	5,391	
流動資産 計		2,674,945	2,602,216	87.5
固定資産				
1. 有形固定資産 1				
(1) 建物		28,036	29,232	
(2) 器具備品		78,121	54,113	
有形固定資産 計		106,157	83,346	2.8
2. 無形固定資産				
(1) ソフトウェア		88,137	100,593	
(2) 電話加入権		1,847	1,847	
(3) 電話施設利用権		98	78	
無形固定資産 計		90,083	102,518	3.5
3. 投資その他の資産				
(1) 投資有価証券		65,000	65,000	
(2) 長期貸付金		44,788	42,388	
(3) 長期差入保証金		84,348	87,326	
(4) 長期前払費用		5,510	7,457	
(5) 会員権		25,000	25,000	
(6) 貸倒引当金		44,788	42,388	
投資その他の資産 計		179,859	184,784	6.2
固定資産 計		376,100	370,648	12.5
資産 合計		3,051,045	2,972,864	100.0

科目	第22期 平成20年3月31日		第23期 平成21年3月31日		
	金額（千円）	構成比 （％）	金額（千円）	構成比 （％）	
（負債の部）					
流動負債					
1．預り金		32,286	3,008		
2．未払金					
（1）未払手数料	497,835		316,013		
（2）その他未払金	105,201	603,037	71,990	388,004	
3．未払費用		312,034		246,794	
4．未払法人税等		259,393		103,823	
5．未払消費税等		31,383		-	
6．賞与引当金		35,351		45,488	
流動負債計		1,273,487	41.8	787,118	26.5
固定負債					
1．退職給付引当金		11,007		16,535	
2．役員退職慰労引当金		8,150		22,100	
固定負債計		19,157	0.6	38,635	1.3
負債合計		1,292,645	42.4	825,754	27.8
（純資産の部）					
株主資本					
1．資本金		300,000	9.8	300,000	10.1
2．資本剰余金					
（1）資本準備金		50,000		50,000	
資本剰余金計		50,000	1.6	50,000	1.7
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		1,382,999		1,771,709	
利益剰余金計		1,408,400	46.2	1,797,110	60.4
株主資本計		1,758,400	57.6	2,147,110	72.2
純資産合計		1,758,400	57.6	2,147,110	72.2
負債・純資産合計		3,051,045	100.0	2,972,864	100.0

(2) 【損益計算書】

科目	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)		第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)	
	金額(千円)	百分比 (%)	金額(千円)	百分比 (%)
営業収益				
1. 委託者報酬		13,110,388		11,250,556
2. その他営業収益				
(1) 投資顧問料	14,182	14,182	7,937	7,937
営業収益計		13,124,570		11,258,493
100.0				100.0
営業費用				
1. 支払手数料		4,971,955		4,424,596
2. 広告宣伝費		771,725		305,210
3. 公告費		24,864		-
4. 受益証券発行費		414		250
5. 調査費				
(1) 調査費	226,207		229,875	
(2) 委託調査費	3,992,966	4,219,174	3,355,436	3,585,312
6. 委託計算費		471		-
7. 営業雑経費				
(1) 通信費	12,633		15,143	
(2) 印刷費	265,300		284,199	
(3) 協会費	13,076		13,436	
(4) 諸会費	57	291,066	317	313,096
営業費用計		10,279,674		8,628,465
78.3				76.6
一般管理費				
1. 給料				
(1) 役員報酬	48,578		50,723	
(2) 給料・手当	461,290		561,245	
(3) 賞与	103,468	613,337	130,680	742,649
2. 役員退職金		800		-
3. 福利厚生費		156,327		191,032
4. 交際費		1,596		2,300
5. 寄付金		-		300
6. 旅費交通費		25,255		27,150
7. 租税公課		11,419		11,916
8. 不動産賃借料		82,419		109,171
9. 退職給付費用		3,950		6,212
10. 役員退職慰労引当金繰入		6,950		16,350
11. 賞与引当金繰入		35,351		45,488
12. 減価償却費		46,548		61,317
13. 諸経費		483,651		507,792
一般管理費計		1,467,609	11.2	1,721,681
15.3				
営業利益		1,377,286	10.5	908,346
8.1				

科目	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)		第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)	
	金額(千円)	百分比 (%)	金額(千円)	百分比 (%)
営業外収益				
1. 受取配当金	2,738		7,549	
2. 有価証券利息	64		-	
3. 受取利息	1,513		1,965	
4. 雑収入	3,796		3,884	
営業外収益 計	8,113	0.0	13,398	0.1
営業外費用				
1. 雑損失	16,240		391	
営業外費用 計	16,240	0.1	391	0.0
経常利益	1,369,159	10.4	921,353	8.2
特別利益				
1. 貸倒引当金戻入	2,400		2,400	
特別利益 計	2,400	0.0	2,400	0.0
特別損失				
1. 固定資産除却損 1	814		-	
2. 役員退職慰労引当金繰入	13,600		-	
特別損失 計	14,414	0.1	-	0.0
税引前当期純利益	1,357,144	10.3	923,753	8.2
法人税、住民税及び事業税	551,986		376,581	
法人税等調整額	8,340	560,326	7,972	384,553
当期純利益		796,817		539,200
		6.1		4.8

（ 3 ） 【 株主資本等変動計算書 】

		第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21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	1,088,152	1,382,999
	当期変動額 剰余金の配当	501,970	150,490
	当期純利益	796,817	539,200
	当期末残高	1,382,999	1,771,709
利益剰余金合計	前期末残高	1,113,553	1,408,400
	当期変動額	294,847	388,710
	当期末残高	1,408,400	1,797,110
株主資本合計	前期末残高	1,463,553	1,758,400
	当期変動額	294,847	388,710
	当期末残高	1,758,400	2,147,110
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金	前期末残高	48	-
	当期変動額 (純額)	48	-
	当期末残高	-	-
評価・換算差額等合計	前期末残高	48	-
	当期変動額	48	-
	当期末残高	-	-
純資産合計	前期末残高	1,463,505	1,758,400
	当期変動額	294,895	388,710
	当期末残高	1,758,400	2,147,110

重要な会計方針

期別 項目	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券</p> <p>(1) 時価のないもの 移動平均法に基づく原価法を採用しております。</p>	<p>その他有価証券</p> <p>(1) 時価のないもの 同左</p>
2. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産	<p>定率法を採用しております。</p> <p>なお、耐用年数は、建物については主として15年～18年、器具備品については主として5年～20年であります。</p>	<p>同左</p>
(2) 無形固定資産	<p>定額法を採用しております。</p> <p>なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（5年）を耐用年数としております。</p>	<p>同左</p>
3. 引当金の計上基準 (1) 貸倒引当金	<p>一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p>	<p>同左</p>
(2) 賞与引当金	<p>従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当期負担分を計上しております。</p>	<p>同左</p>
(3) 退職給付引当金	<p>従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による期末退職給付債務相当額を計上しております。</p>	<p>同左</p>
(4) 役員退職慰労引当金	<p>役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づき期末要支給額を計上しております。</p>	<p>同左</p>
4. リース取引の処理方法	<p>リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引にかかる方法に準じた会計処理によって処理しております。</p>	<p>-</p>
5. 消費税等の会計処理	<p>税抜方式を採用しております。</p>	<p>同左</p>

会計方針の変更

第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)
<p>1. 役員に対する退職慰労金は、従来、支出時の費用として処理しておりましたが、「役員賞与に関する会計基準」（企業会計基準第4号）及び「租税特別措置法上の準備金及び特別法上の引当金又は準備金並びに役員退職慰労引当金等に関する監査上の取扱い」（日本公認会計士協会監査・保証実務委員会報告第42号）の公表を踏まえ、当事業年度から引当金を計上する方法を適用し、内規に基づく期末要支給額を役員退職慰労引当金として計上しております。これにより、従来の方法に比べ経常利益が6,950千円、税引前当期純利益が20,550千円減少しております。</p> <p>2. 法人税法の改正により、当事業年度より、平成19年4月1日以降に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。 当該変更による損益に与える影響は軽微であります。</p>	-

追加情報

第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)
<p>法人税法の改正により、平成19年3月31日以前に取得した資産については、改正前の法人税法に基づく減価償却の方法の適用により取得価額の5%に到達した事業年度の翌事業年度より、取得価額の5%相当額と備忘価額との差額を5年間にわたり均等償却し、減価償却費に含めて計上しております。 当該変更による損益に与える影響は軽微であります。</p>	-

注記事項

1. 貸借対照表関係

項目	期別 第22期 (平成20年3月31日)	第23期 (平成21年3月31日)
1. 有形固定資産の減価償却 累計額	建物 18,588千円 器具備品 141,460千円	建物 23,636千円 器具備品 161,247千円
2. 担保資産	その他のうち、次のものを供託しており ます。 取戻し手続中の投資顧問業の営業保証金 (25,000千円) 預け金 26,000千円	-

2. 損益計算書関係

項目	期別 第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)
1. 固定資産除却損の内容	建物附属設備 814千円	-

3. 株主資本等変動計算書関係

項目	期別 第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)																																												
1. 発行済株式に関する事項	<table border="1"> <thead> <tr> <th>株式の種類</th> <th>前事業年度末</th> <th>増加</th> <th>減少</th> <th>当事業年度末</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>普通株式(株)</td> <td>5,050</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>5,050</td> </tr> </tbody> </table>	株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末	普通株式(株)	5,050	-	-	5,050																																		
株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末																																									
普通株式(株)	5,050	-	-	5,050																																									
2. 自己株式に関する事項	該当事項はありません。																																												
3. 新株予約権等に関する事項	該当事項はありません。																																												
4. 配当に関する事項	<p>(1) 配当金支払額</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>決議</th> <th>株式の種類</th> <th>配当金の総額 (千円)</th> <th>1株当たり 配当額(円)</th> <th>基準日</th> <th>効力発生日</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>平成19年6月29日 定時株主総会</td> <td>普通株式</td> <td>100,495</td> <td>19,900</td> <td>平成19年3月31日</td> <td>平成19年6月29日</td> </tr> <tr> <td>平成19年9月20日 臨時株主総会</td> <td>普通株式</td> <td>150,490</td> <td>29,800</td> <td>平成19年9月19日</td> <td>平成19年9月21日</td> </tr> <tr> <td>平成19年11月15日 取締役会</td> <td>普通株式</td> <td>100,495</td> <td>19,900</td> <td>平成19年9月30日</td> <td>平成19年11月29日</td> </tr> <tr> <td>平成20年3月26日 臨時株主総会</td> <td>普通株式</td> <td>150,490</td> <td>29,800</td> <td>平成19年12月31日</td> <td>平成20年3月27日</td> </tr> </tbody> </table> <p>(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</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>決議</th> <th>株式の種類</th> <th>配当金の総額 (千円)</th> <th>配当の 原資</th> <th>1株当たり 配当額 (円)</th> <th>基準日</th> <th>効力発生日</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>平成20年6月26日 定時株主総会</td> <td>普通株式</td> <td>150,490</td> <td>利益 剰余金</td> <td>29,800</td> <td>平成20年3月31日</td> <td>平成20年6月27日</td> </tr> </tbody> </table>	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19年6月29日 定時株主総会	普通株式	100,495	19,900	平成19年3月31日	平成19年6月29日	平成19年9月20日 臨時株主総会	普通株式	150,490	29,800	平成19年9月19日	平成19年9月21日	平成19年11月15日 取締役会	普通株式	100,495	19,900	平成19年9月30日	平成19年11月29日	平成20年3月26日 臨時株主総会	普通株式	150,490	29,800	平成19年12月31日	平成20年3月27日	決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	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	利益 剰余金	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19年6月29日 定時株主総会	普通株式	100,495	19,900	平成19年3月31日	平成19年6月29日																																								
平成19年9月20日 臨時株主総会	普通株式	150,490	29,800	平成19年9月19日	平成19年9月21日																																								
平成19年11月15日 取締役会	普通株式	100,495	19,900	平成19年9月30日	平成19年11月29日																																								
平成20年3月26日 臨時株主総会	普通株式	150,490	29,800	平成19年12月31日	平成20年3月27日																																								
決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	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	利益 剰余金	29,800	平成20年3月31日	平成20年6月27日																																							

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)					
		株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末	
1. 発行済株式に関する事項		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					
		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。					

4. リース取引関係

第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21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. 有価証券関係

第22期 (平成20年3月31日)	第23期 (平成21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. その他有価証券で時価のあるもの 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 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 該当事項はありません。								
3. 時価評価されていない有価証券	3. 時価評価されていない有価証券								
<table border="1"> <thead> <tr> <th>内容</th> <th>貸借対照表計上額(千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>その他有価証券 非上場株式</td> <td>65,000</td> </tr> </tbody> </table>	内容	貸借対照表計上額(千円)	その他有価証券 非上場株式	65,000	<table border="1"> <thead> <tr> <th>内容</th> <th>貸借対照表計上額(千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>その他有価証券 非上場株式</td> <td>65,000</td> </tr> </tbody> </table>	内容	貸借対照表計上額(千円)	その他有価証券 非上場株式	65,000
内容	貸借対照表計上額(千円)								
その他有価証券 非上場株式	65,000								
内容	貸借対照表計上額(千円)								
その他有価証券 非上場株式	65,000								
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。								

6. デリバティブ関係

第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21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

7. 退職給付関係

第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)																
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成20年3月31日現在）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">11,007千円</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">退職給付引当金</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">11,007千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 （平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">3,950千円</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">退職給付費用</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">3,950千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	11,007千円	退職給付引当金	11,007千円	勤務費用	3,950千円	退職給付費用	3,950千円	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 同左</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成21年3月31日現在）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">16,535千円</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">退職給付引当金</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">16,535千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 （平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">6,212千円</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">退職給付費用</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">6,212千円</td> </tr> </table> <p>（注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	16,535千円	退職給付引当金	16,535千円	勤務費用	6,212千円	退職給付費用	6,212千円
退職給付債務	11,007千円																
退職給付引当金	11,007千円																
勤務費用	3,950千円																
退職給付費用	3,950千円																
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																

8. 税効果会計関係

第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)																																
<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td colspan="2">繰延税金資産</td> </tr> <tr> <td>貸倒引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">18,224千円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">14,384千円</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">19,725千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">11,578千円</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">63,912千円</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td style="text-align: right;">26,771千円</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">37,141千円</td> </tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、記載を省略しております。</p>	繰延税金資産		貸倒引当金繰入超過額	18,224千円	賞与引当金繰入超過額	14,384千円	未払事業税	19,725千円	その他	11,578千円	繰延税金資産小計	63,912千円	評価性引当額	26,771千円	繰延税金資産合計	37,141千円	<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td colspan="2">繰延税金資産</td> </tr> <tr> <td>貸倒引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">17,247千円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">18,509千円</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">8,540千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">18,609千円</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">62,906千円</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td style="text-align: right;">33,738千円</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">29,168千円</td> </tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、記載を省略しております。</p>	繰延税金資産		貸倒引当金繰入超過額	17,247千円	賞与引当金繰入超過額	18,509千円	未払事業税	8,540千円	その他	18,609千円	繰延税金資産小計	62,906千円	評価性引当額	33,738千円	繰延税金資産合計	29,168千円
繰延税金資産																																	
貸倒引当金繰入超過額	18,224千円																																
賞与引当金繰入超過額	14,384千円																																
未払事業税	19,725千円																																
その他	11,578千円																																
繰延税金資産小計	63,912千円																																
評価性引当額	26,771千円																																
繰延税金資産合計	37,141千円																																
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																																

9. 関連当事者情報

第22期（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）

兄弟会社

項目	第22期 （平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで）
1. 会社等の名称	親会社の子会社 中央三井信託銀行株式会社（注5） （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
2. 住所	東京都港区
3. 資本金	379,197百万円
4. 事業の内容又は職業	銀行業務・信託業務
5. 議決権等の所有（被所有） 割合	該当なし
6. 関係内容	役員の兼任等 なし
7. 取引の内容	事業上の関係 投資信託販売 投資信託に係る営業費用の支払（注1） 取引金額 4,752,651千円 未払手数料 475,539千円
1. 会社等の名称	親会社の子会社 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
2. 住所	東京都港区
3. 資本金	11,000百万円
4. 事業の内容又は職業	信託業務
5. 議決権等の所有（被所有） 割合	該当なし
6. 関係内容	役員の兼任等 なし
7. 取引の内容	事業上の関係 投資信託委託 投資顧問 支払投資顧問料（注2） 取引金額 3,926,590千円 未払費用 265,697千円 前払費用 360,595千円

項目	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)
1. 会社等の名称	親会社の子会社 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
2. 住所	東京都目黒区
3. 資本金	200百万円
4. 事業の内容又は職業	情報処理サービス業
5. 議決権等の所有(被所有)割合	該当なし
6. 関係内容	役員の兼任等 なし 事業上の関係 システムの管理・開発委託
7. 取引の内容	器具・備品の購入(注3) 取引金額 37,152千円 ソフトウェアの購入(注4) 取引金額 42,670千円

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) 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3) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。
- (注4) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。
- (注5) 平成19年10月1日付で親会社が中央三井信託銀行株式会社から中央三井トラスト・ホールディングス株式会社に
変更となっており、第22期の中央三井信託銀行株式会社との取引はすべて兄弟会社として集計し記載しております。

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。

10. 1株当たり情報

項目	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)
1. 1株当たり純資産額	348,198円11銭	425,170円41銭
2. 1株当たり当期純利益	157,785円55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。	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。

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22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)
当期純利益(千円)	796,817	539,200
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株主に係る当期純利益 (千円)	796,817	539,200
普通株式の期中平均株式数 (株)	5,050	5,050

11. 重要な後発事象

第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21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24期中間会計期間末 平成21年9月30日	
	金額(千円)	構成比 (%)
(資産の部)		%
流動資産		
1. 現金・預金	1,649,232	
2. 前払費用	129,335	
3. 未収委託者報酬	1,005,792	
4. 未収収益	101	
5. 繰延税金資産	29,945	
6. その他	423	
流動資産 計	2,814,830	88.1
固定資産		
1. 有形固定資産 ¹		
(1) 建物	27,020	
(2) 器具備品	44,758	
有形固定資産 計	71,778	2.3
2. 無形固定資産		
(1) ソフトウェア	107,738	
(2) 電話加入権	1,847	
(3) 電話施設利用権	68	
無形固定資産 計	109,653	3.4
3. 投資その他の資産		
(1) 投資有価証券	76,069	
(2) 長期貸付金	41,188	
(3) 長期差入保証金	88,736	
(4) 長期前払費用	7,182	
(5) 会員権	25,000	
(6) 貸倒引当金	41,188	
投資その他の資産 計	196,988	6.2
固定資産 計	378,421	11.9
資産合計	3,193,251	100.0

科目	第24期中間会計期間末 平成21年9月30日	
	金額（千円）	構成比 （％）
（負債の部）		
流動負債		
1．預り金		2,935
2．未払金		
（1）未払手数料	343,905	
（2）その他未払金 ²	59,402	403,308
3．未払費用		263,209
4．未払法人税等		121,363
5．賞与引当金		44,581
流動負債計		835,398
固定負債		
1．退職給付引当金		19,630
2．役員退職慰労引当金		25,550
固定負債計		45,180
負債合計		880,579
（純資産の部）		
株主資本		
1．資本金		300,000
2．資本剰余金		
（1）資本準備金		50,000
資本剰余金計		50,000
3．利益剰余金		
（1）利益準備金		25,401
（2）その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		1,937,202
利益剰余金計		1,962,603
株主資本計		2,312,603
評価・換算差額等		
1．その他有価証券評価差額金		69
評価・換算差額等計		69
純資産合計		2,312,672
負債・純資産合計		3,193,251

(5) 中間損益計算書

科目	第24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21年9月30日まで)		
	金額(千円)		百分比 (%)
営業収益			
1. 委託者報酬		4,862,432	
営業収益 計		4,862,432	100.0
営業費用			
1. 支払手数料		1,959,988	
2. 広告宣伝費		44,517	
3. 調査費			
(1) 調査費	115,422		
(2) 委託調査費	1,455,464	1,570,886	
4. 営業雑経費			
(1) 通信費	7,330		
(2) 印刷費	108,490		
(3) 協会費	6,049		
(4) 諸会費	339	122,209	
営業費用 計		3,697,602	76.0
一般管理費			
1. 給料			
(1) 役員報酬	27,727		
(2) 給料・手当	302,254		
(3) 賞与	41,820	371,802	
2. 福利厚生費		105,272	
3. 交際費		625	
4. 旅費交通費		11,280	
5. 租税公課		7,634	
6. 不動産賃借料		56,307	
7. 退職給付費用		3,095	
8. 役員退職慰労引当金繰入		6,650	
9. 賞与引当金繰入		44,581	
10. 減価償却費 ¹		25,670	
11. 諸経費		255,433	
一般管理費 計		888,356	18.3
営業利益		276,473	5.7

科目	第24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21年9月30日まで)		
	金額(千円)		百分比 (%)
営業外収益			
1. 受取配当金		3,000	
2. 受取利息		588	
3. 雑収入		300	
営業外収益 計		3,889	0.1
営業外費用			
1. 雑損失		561	
営業外費用 計		561	0.0
経常利益		279,801	5.8
特別利益			
1. 投資有価証券売却益		2,800	
2. 貸倒引当金戻入		1,200	
特別利益 計		4,000	0.0
特別損失			
1. 投資有価証券売却損		17	
特別損失 計		17	0.0
税引前中間純利益		283,784	5.8
法人税、住民税及び事業税	119,067		
法人税等調整額	776	118,291	2.4
中間純利益		165,493	3.4

(6) 中間株主資本等変動計算書

第24期中間会計期間（平成21年4月1日から平成21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	1,771,709
	中間会計期間中の変動額	中間純利益 165,493
	中間会計期間末残高	1,937,202
利益剰余金合計	前期末残高	1,797,110
	中間会計期間中の変動額	165,493
	中間会計期間末残高	1,962,603
株主資本合計	前期末残高	2,147,110
	中間会計期間中の変動額	165,493
	中間会計期間末残高	2,312,603
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	前期末残高	-
	中間会計期間中の変動額（純額）	69
	中間会計期間末残高	69
評価・換算差額等合計	前期末残高	-
	中間会計期間中の変動額	69
	中間会計期間末残高	69
純資産合計	前期末残高	2,147,110
	中間会計期間中の変動額	165,562
	中間会計期間末残高	2,312,672

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

項目	第24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21年9月30日まで)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券</p> <p>(1) 時価のあるもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額については全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。</p> <p>(2) 時価のないもの 移動平均法に基づく原価法を採用しております。</p>
2. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 (2) 無形固定資産	<p>定率法を採用しております。 なお、耐用年数は、建物については主として15年～18年、器具備品については主として5年～20年であります。</p> <p>定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間(5年)を耐用年数としております。</p>
3. 引当金の計上基準 (1) 貸倒引当金 (2) 賞与引当金 (3) 退職給付引当金 (4) 役員退職慰労引当金	<p>一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間負担分を計上しております。</p> <p>従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による中間期末退職給付債務相当額を計上しております。</p> <p>役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づき当中間期末要支給額を計上しております。</p>
4. その他中間財務諸表作成の基本となる重要な事項	消費税等の会計処理は税抜方式を採用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第24期中間会計期間末 (平成21年9月30日)
1.有形固定資産の減価償却 累計額	建物 25,848千円 器具備品 166,512千円
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 うえ、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24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21年9月30日まで)
1.減価償却実施額	有形固定資産 12,254千円 無形固定資産 13,416千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

項目	第24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21年9月30日まで)				
	株式の種類	前事業 年度末	増加	減少	当中間 会計期末
1.発行済株式に関する事項	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24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21年9月30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。

有価証券関係

第24期中間会計期間末 (平成21年9月30日)			
1. その他有価証券で時価のあるもの			
区分	取得原価 (千円)	中間貸借対 照表計上額 (千円)	差額 (千円)
その他	11,000	11,069	69
計	11,000	11,069	69
2. 時価評価されていない有価証券			
区分	中間貸借対照表計上額(千円)		
その他有価証券 非上場株式	65,000		
計	65,000		

デリバティブ関係

第24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21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。

1 株当たり情報

第24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21年9月30日まで)	
1株当たり純資産額	457,954円99銭
1株当たり中間純利益	32,770円92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24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21年9月30日まで)	
中間純利益(千円)	165,493
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)	165,493
普通株式の期中平均株式数(株)	5,050

重要な後発事象

第24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21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) 通常の見取条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4) 親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1) 定款の変更

当会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：中央三井アセット信託銀行株式会社

資本金の額：11,000百万円（平成21年9月末日現在）

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

<再信託受託会社>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成21年9月末日現在）

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

(2) 販売会社

名称：中央三井信託銀行株式会社

資本金の額：399,697百万円（平成21年9月末日現在）

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

2【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け、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

<再信託受託会社>

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

- (1) 金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。なお、両者を総称して「投資信託説明書（目論見書）」と記載することがあります。
- (2) 交付目論見書に、当ファンドの約款を掲載し、有価証券届出書本文「第一部 証券情報」及び「第二部 ファンド情報」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (3) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」及び「第二部 ファンド情報」の主要内容を要約し、「ファンドの概要」として、交付目論見書の冒頭に記載することがあります。
- (4) 目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案及びキャッチコピーを採用すること、また、ファンドの形態、申込みに関する事項などを記載することがあります。
- (5) 交付目論見書の巻末に用語解説等を記載することがあります。
- (6) 目論見書（表紙を含みます。）等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

当ファンドは預貯金や保険契約とは異なり、預金保険機構、貯金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象とはなりません。

金融商品取引業者以外でご購入いただいた場合は、投資者保護基金の対象とはなりません。

当ファンドは、実質的に国内の株式を主要投資対象としております。当ファンドの基準価額は、実質的に組入れた有価証券の値動きや実質的に組入れた有価証券の発行体の経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化等により変動しますので、これにより投資元本を割り込むことがあります。従って、当ファンドは元本保証のある商品ではありません。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資家の皆様に帰属します。
- (7) 目論見書等は電子媒体としてインターネット等に掲載されることがあります。
- (8) 目論見書等に、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示する場合があります。

独立監査人の監査報告書

平成20年 6月16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 浅子 正明 印

指定社員 業
務執行社員 公認会計士 木村 充男 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19年4月1日から平成20年3月31日までの第22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であり、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20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。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成21年12月9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期事業年度の中間会計期間（平成21年4月1日から平成21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に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21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21年4月1日から平成21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。

独立監査人の監査報告書

平成21年3月19日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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、「ファンドの経理状況」に掲げられている中央三井DC日本株式インデックスファンドの平成20年1月23日から平成21年1月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、中央三井DC日本株式インデックスファンドの平成21年1月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年3月19日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 松崎雅則 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 平木達也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている中央三井DC日本株式インデックスファンドの平成21年1月23日から平成22年1月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

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

以上

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

[次へ](#)