

**【表紙】**

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

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

中央三井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。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出され、日々の基準価額は、販売会社へお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします（販売会社の詳細につきましては、下記「（8）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。）。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.cmam.co.jp/>）でご覧いただけます。

ただし、分配金再投資に関する契約（後記「第二部 ファンド情報 第2 管理及び運営 1 申込（販売）手続等（5）その他 」をご参照ください。）に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、後記「第二部 ファンド情報 第2 管理及び運営 3 資産管理等の概要（4）計算期間」に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

### （５）【申込手数料】

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23年4月23日から平成24年4月23日までとします。

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

過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

ただし、後記「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針（4）分配方針 収益分配金の再投資等」に規定する収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所で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：0120-668001（フリーダイヤル）

03-5440-0190

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

・ホームページ アドレス：<http://www.cmam.co.jp/>

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（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をいいます。以下同じ。）又は登録金融機関（金融商品取引法第33条の2の登録を受けた銀行、協同組織金融機関その他政令で定める金融機関をいいます。以下同じ。）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、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取扱われるものとします。

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### ファンドの目的

当ファンドは、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。

## &lt; 補足分類 &gt;

- ・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)  日々	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 ( )	中南米  アフリカ	ファンド ・オブ ファンズ	その他 ( )
その他資産 (投資信託証券(株式一般))		中近東 (中東)		
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## (用語の定義について)

当ファンドが該当する属性区分に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

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

## &lt; 投資対象資産 &gt;

- ・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。

## &lt; 決算頻度 &gt;

- ・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。

## &lt; 投資対象地域 &gt;

- ・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。

## &lt; 投資形態 &gt;

## ・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。

## &lt; インデックスファンドにおける対象インデックス &gt;

## ・ 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加重型の株価指数です。

## 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・ノウハウ及び 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の指数値及び T O P I Xの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の T O P I Xの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
4. 東証は、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、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。
6. 東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
7. 東証は、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銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
8. 以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

## 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。

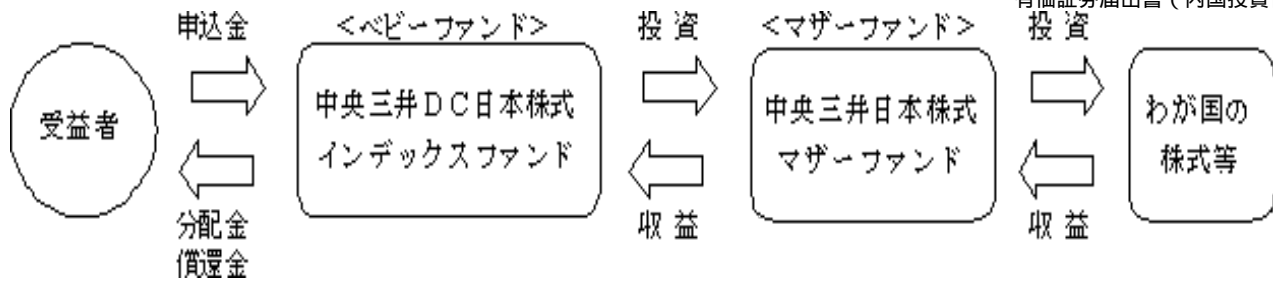
## (2) 【ファンドの沿革】

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

## (3) 【ファンドの仕組み】

## ファミリーファンド方式での運用

ファミリーファンド方式とは、投資家から投資された資金をまとめてベビーファンド（中央三井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。

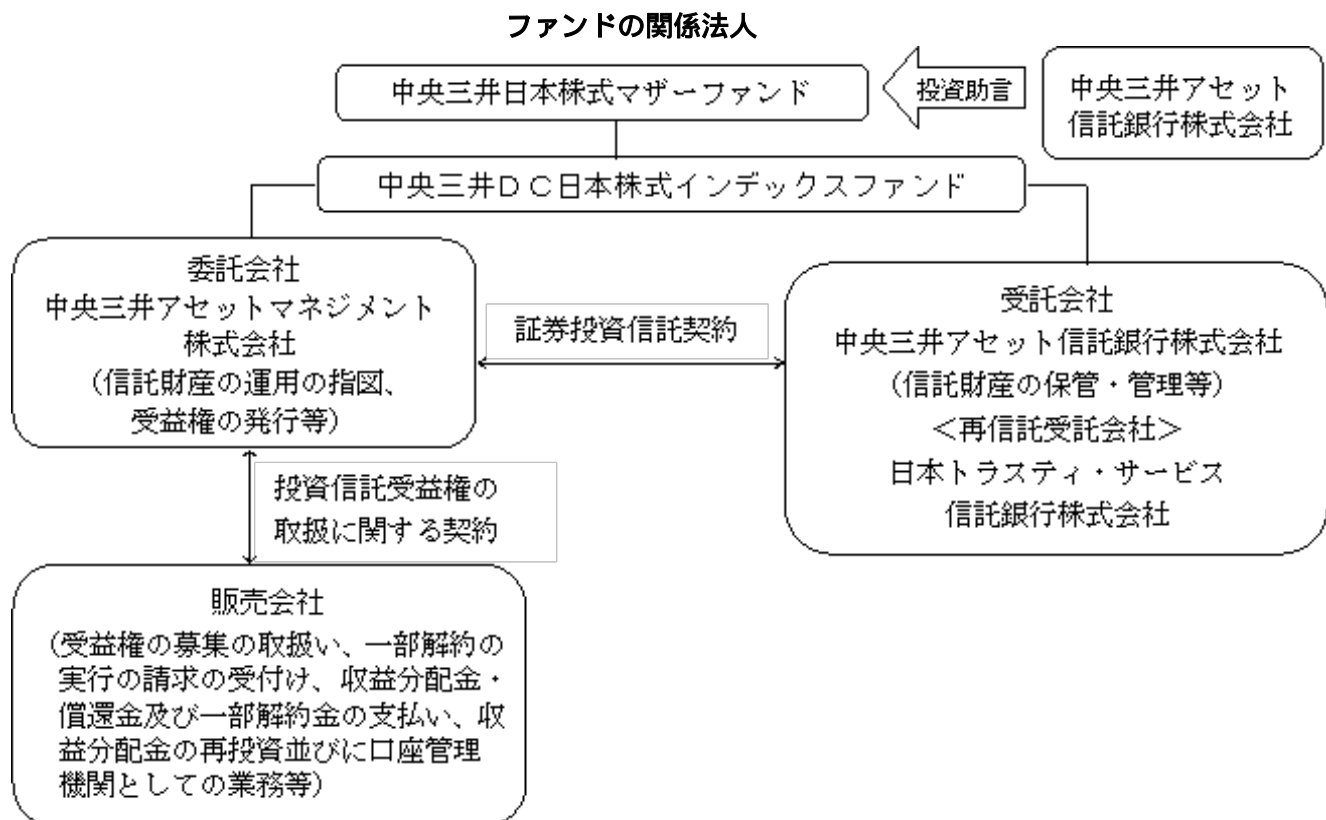
受託会社 中央三井アセット信託銀行株式会社

（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23年4月22日現在）

## B．委託会社の沿革

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

昭和62年9月9日：投資一任業務の認可取得

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

平成12年3月23日：証券投資信託委託業務認可取得

平成19年9月30日：金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録

## C．大株主の状況（平成23年4月22日現在）

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 運用方針

当ファンドは、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、）
  - 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、）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

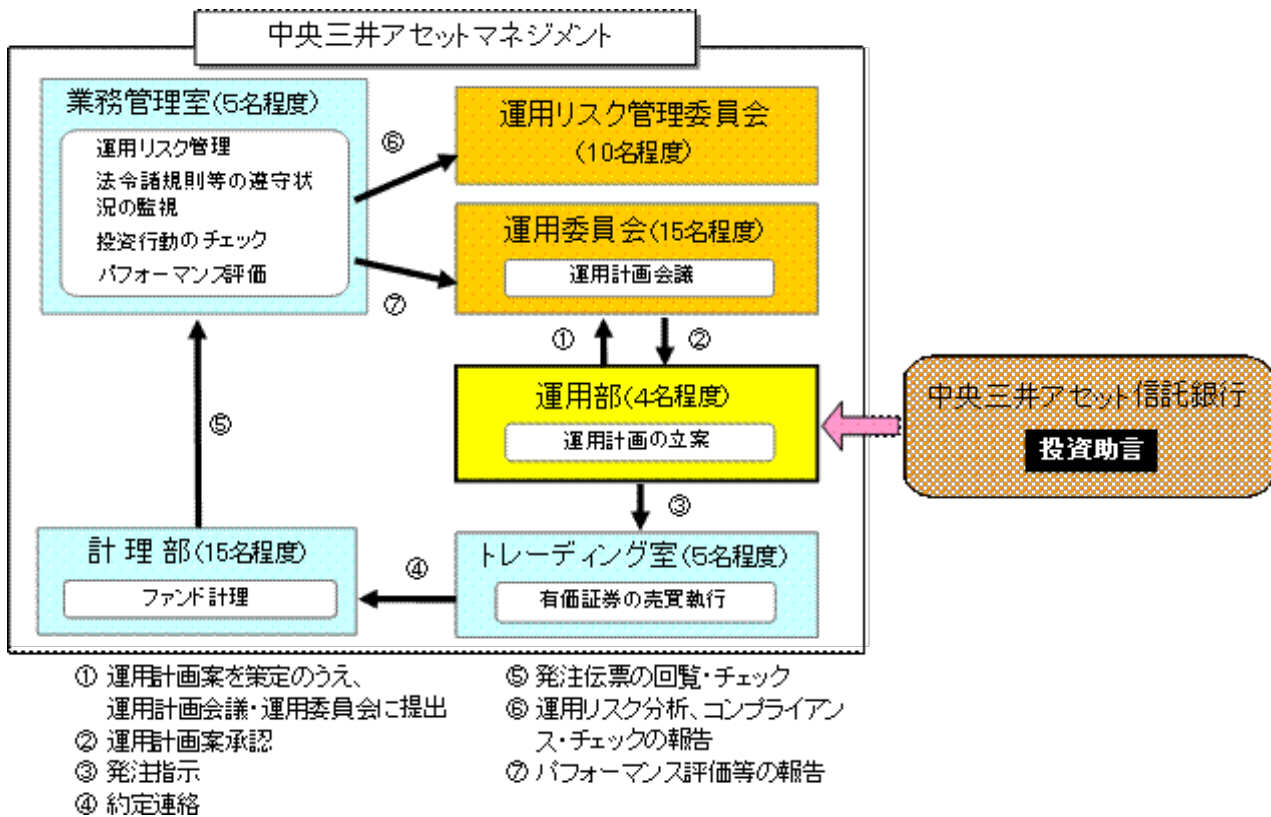
3. 地方債証券
  4. 特別の法律により法人の発行する債券
  5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  6. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
  8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証書
  9. 資産の流動化に関する法律に定める優先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ます。）
  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ます。）
  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。

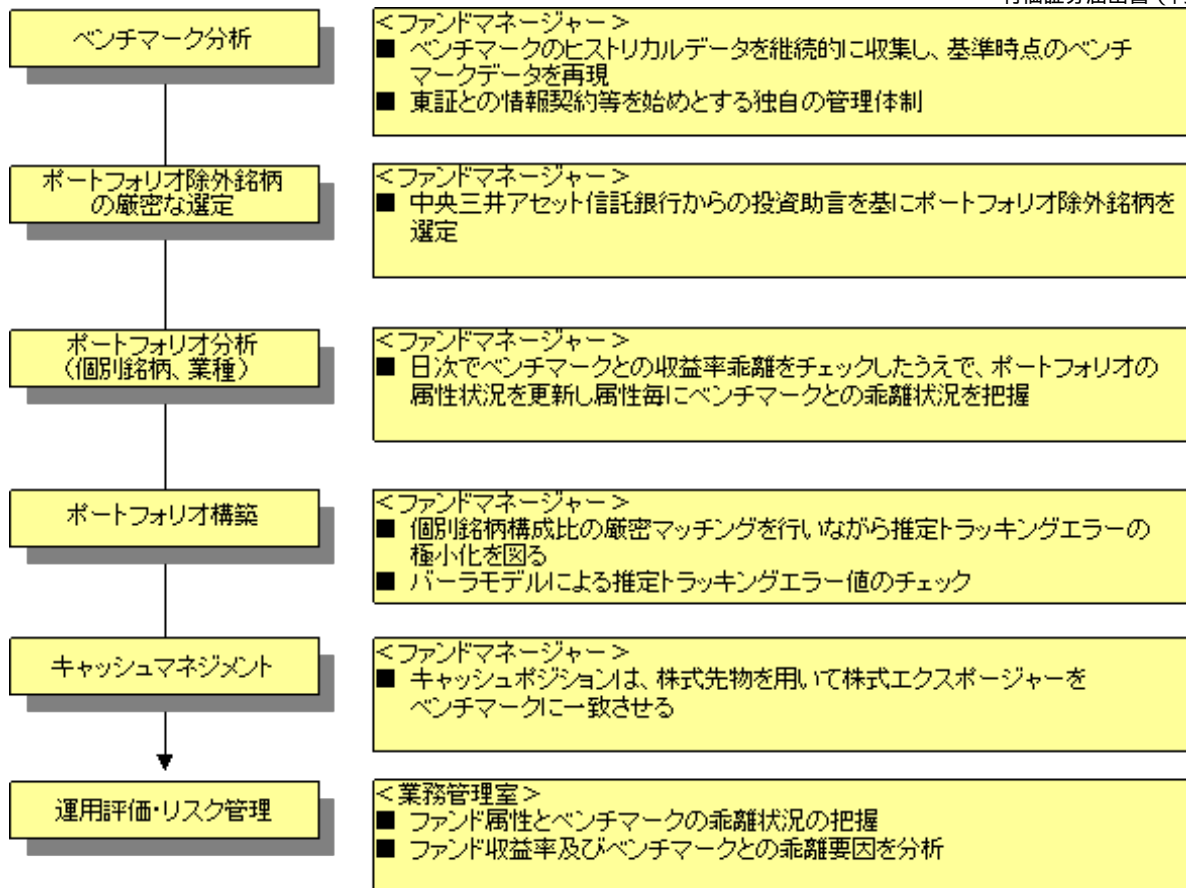
### （3）【運用体制】

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



#### < マザーファンドのポートフォリオ構築プロセス >

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



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

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

委託会社は、ファンドの関係法人である再信託受託会社に対する管理・統制としては、モニタリングの一環として外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を入手し査閲するなど、「外部業務委託の適切性」に関する定期的確認を基本的枠組として運営しています。

#### (4) 【分配方針】

##### 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。

二．「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ついては原則として取得申込者としてします。)に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

C．信託契約の一部解約が行われた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、上記A．及びB．の規定にかかわらず、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日から当該受益権に係る受益者に支払います。

### (5)【投資制限】

#### 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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 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たときは、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。
- O．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たときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ．上記イ．の借入れの指図は、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．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

## 関連法令に基づく投資制限

- A．発生し得る危険に対応する額として算出した額が運用財産の純資産額を超える場合におけるデリバティブ取引に関する制限  
（金融商品取引法第42条の2第7号、金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）  
委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社等が定めた合理的な方法により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）を行い、又は継続することを内容とした運用を行わないものとします。
- B．同一の法人の発行する株式への投資制限  
（投資信託及び投資法人に関する法律第9条、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第20条）  
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、次のイ．に掲げる数がロ．に掲げる数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。
- イ．その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。ロ．において同じ。）の総数
- ロ．当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数

## （参考）マザーファンドの概要

### 「中央三井日本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。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（3）ファンドの仕組みファミリーファンド方式での運用」をご参照ください。）で運用を行います。そのため、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等に伴う資金変動があり、その結果、当該マザーファンドにおいて有価証券の売買等が行われた場合等には、その売買による組入る有価証券等の価格の変化や売買手数料等の負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。この影響が、当ファンドの基準価額の変動要因となる可能性があります。

(3) 投資リスクに対する管理体制

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

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

パフォーマンス評価等は、業務管理室において行っております。問題が生じた場合は、運用担当者に連絡され速やかに是正を図るとともに、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。

- ( 4 ) 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資家の皆様に帰属します。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（以下「解約価額」といいます。）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0.5775%（税抜 0.55%）を乗じて得た額とします。その配分は以下のとおりです。

委託会社	年率 0.231%	（税抜 0.22%）
販売会社	年率 0.273%	（税抜 0.26%）
受託会社	年率 0.0735%	（税抜 0.07%）

「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税をいいます。

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します。

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

##### (4)【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど信託財産中から支弁します。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6月までは課税が凍結されています。

上記は、平成23年3月末日現在のものですので、税法及び確定拠出年金法等が改正された場合等は、上記の内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

以下の記載事項は、平成23年2月28日現在の状況について記載してあります。

## (1)【投資状況】

資産の種類		国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託	中央三井日本株式マザーファンド	日本	266,774,652	100.06
受益証券	親投資信託受益証券合計		266,774,652	100.06
その他の資産(負債控除後)			147,162	0.06
合計(純資産総額)			266,627,490	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	256,063,165,975	97.74
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		5,922,879,688	2.26
合計(純資産総額)		261,986,045,663	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	316,496,206	0.8124	257,121,518	0.8429	266,774,652	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	2,582,400	3,415.00	8,818,896,000	3,820.00	9,864,768,000	3.77
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	15,014,300	441.00	6,621,306,300	453.00	6,801,477,900	2.60
3	本田技研工業	輸送用機器	1,695,800	3,400.00	5,765,720,000	3,545.00	6,011,611,000	2.29

4	キヤノン	電気機器	1,248,700	4,090.00	5,107,183,000	3,940.00	4,919,878,000	1.88
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,500,300	2,893.00	4,340,367,900	3,085.00	4,628,425,500	1.77
6	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	24,260,500	164.00	3,978,722,000	168.00	4,075,764,000	1.56
7	三菱商事	卸売業	1,588,700	2,317.00	3,681,017,900	2,261.00	3,592,050,700	1.37
8	ソニー	電気機器	1,128,600	2,853.00	3,219,895,800	2,993.00	3,377,899,800	1.29
9	武田薬品工業	医薬品	788,600	3,990.00	3,146,514,000	4,065.00	3,205,659,000	1.22
10	東京電力	電気・ガス業	1,479,600	2,016.00	2,982,873,600	2,114.00	3,127,874,400	1.19
11	日本電信電話	情報・通信業	745,000	3,780.00	2,816,100,000	3,990.00	2,972,550,000	1.13
12	ソフトバンク	情報・通信業	878,300	2,752.00	2,417,081,600	3,355.00	2,946,696,500	1.12
13	任天堂	その他製品	114,900	22,630.00	2,600,187,000	23,970.00	2,754,153,000	1.05
14	ファナック	電気機器	209,300	12,320.00	2,578,576,000	12,680.00	2,653,924,000	1.01
15	三井物産	卸売業	1,712,400	1,398.00	2,393,935,200	1,486.00	2,544,626,400	0.97
16	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	16,398	147,400.00	2,417,065,200	153,500.00	2,517,093,000	0.96
17	小松製作所	機械	997,300	2,383.00	2,376,565,900	2,495.00	2,488,263,500	0.95
18	三菱地所	不動産業	1,388,000	1,619.00	2,247,172,000	1,668.00	2,315,184,000	0.88
19	日立製作所	電気機器	4,512,000	447.00	2,016,864,000	495.00	2,233,440,000	0.85
20	パナソニック	電気機器	1,990,300	1,146.00	2,280,883,800	1,101.00	2,191,320,300	0.84
21	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	4,178,200	514.00	2,147,594,800	518.00	2,164,307,600	0.83
22	東芝	電気機器	3,967,000	487.00	1,931,929,000	535.00	2,122,345,000	0.81
23	日産自動車	輸送用機器	2,539,300	830.00	2,107,619,000	835.00	2,120,315,500	0.81
24	東京海上ホールディングス	保険業	754,800	2,488.00	1,877,942,400	2,679.00	2,022,109,200	0.77
25	東日本旅客鉄道	陸運業	349,500	5,350.00	1,869,825,000	5,690.00	1,988,655,000	0.76
26	三菱電機	電気機器	2,010,000	902.00	1,813,020,000	967.00	1,943,670,000	0.74
27	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	829,900	2,157.00	1,790,094,300	2,277.00	1,889,682,300	0.72
28	関西電力	電気・ガス業	820,200	2,039.00	1,672,387,800	2,146.00	1,760,149,200	0.67
29	信越化学工業	化学	350,600	4,710.00	1,651,326,000	4,695.00	1,646,067,000	0.63
30	新日本製鐵	鉄鋼	5,523,000	284.00	1,568,532,000	296.00	1,634,808,000	0.62
合計			85,173,898		90,237,197,500		94,514,767,800	36.08

(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	0.58
	建設業	1.87
	食料品	2.83
	繊維製品	0.91
	パルプ・紙	0.35
	化学	5.75
	医薬品	4.21
	石油・石炭製品	0.86
	ゴム製品	0.59
	ガラス・土石製品	1.32
	鉄鋼	2.24
	非鉄金属	1.35
	金属製品	0.66
	機械	4.87
	電気機器	14.14
	輸送用機器	10.14
	精密機器	1.34
	その他製品	2.03
	電気・ガス業	4.58
	陸運業	3.40
	海運業	0.56
	空運業	0.31
	倉庫・運輸関連業	0.22
	情報・通信業	5.48
	卸売業	5.15
	小売業	3.41
	銀行業	9.47
	証券、商品先物取引業	1.52
	保険業	2.56
	その他金融業	0.79
	不動産業	2.51
サービス業	1.66	
合計	97.74	

（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	662	6,128,742,175	6,295,620,000	2.40

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

（注2）株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段で評価しております。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額（円）	1万口当たりの 基準価額（円）
第1期計算期間（平成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
第9期計算期間（平成23年1月24日現在）	257,033,176	10,107
平成22年2月末日	223,147,183	9,708
平成22年3月末日	253,088,008	10,715
平成22年4月末日	255,479,701	10,804
平成22年5月末日	233,180,653	9,628
平成22年6月末日	237,170,815	9,209
平成22年7月末日	230,935,445	9,291
平成22年8月末日	223,913,351	8,802
平成22年9月末日	233,141,582	9,143
平成22年10月末日	229,490,413	8,936
平成22年11月末日	241,509,023	9,479
平成22年12月末日	251,678,464	9,904
平成23年1月末日	257,608,836	10,026
平成23年2月末日	266,627,490	10,481

（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
第9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 %
第9期計算期間	1.1 %

(注) 収益率とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ちの額、以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数とします。なお、第1期計算期間については、前期末基準価額の代わりに当初設定日（平成14年1月25日）の基準価額を使用しております。

#### (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1期計算期間	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
第9期計算期間	69,510,842	42,163,700	254,313,726

(注1) 設定及び解約の実績は、全て本邦内における実績です。

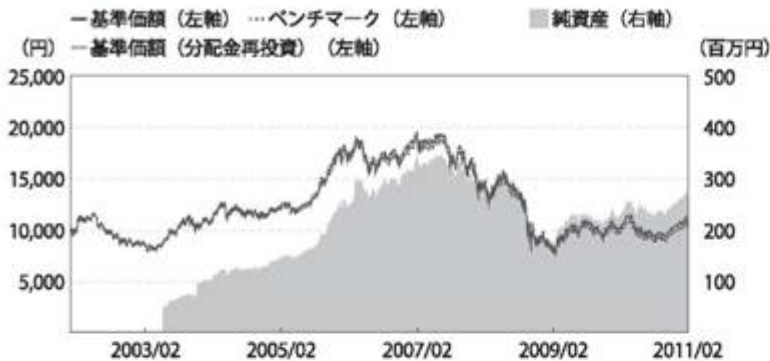
(注2) 第1期計算期間の設定口数には、当初自己設定の設定口数を含みます。

(参考情報) 交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

2011年2月28日 現在（基準日）

## 〈基準価額・純資産の推移〉



・基準価額及び基準価額（分配金再投資）は、徴収報酬控除後の値です。  
 ・基準価額（分配金再投資）は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして算出した値です。  
 ・ベンチマークは、設定日の基準価額に合わせて指数化しています。

## 〈分配の推移〉

2011年1月	0円
2010年1月	0円
2009年1月	0円
2008年1月	0円
2007年1月	0円
設定来累計	0円

・分配金は1万口当たり、税引前の値です。  
 ・運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

## 〈主な資産の状況〉

## 資産別投資比率

資産	比率
株式	97.79%
その他資産	2.21%
合計	100.00%

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

## 業種別投資比率（中央三井日本株式マザーファンド）

業種	比率
電気機器	14.14%
輸送用機器	10.14%
銀行業	9.47%
化学	5.75%
情報・通信業	5.48%
その他	52.75%
合計	97.74%

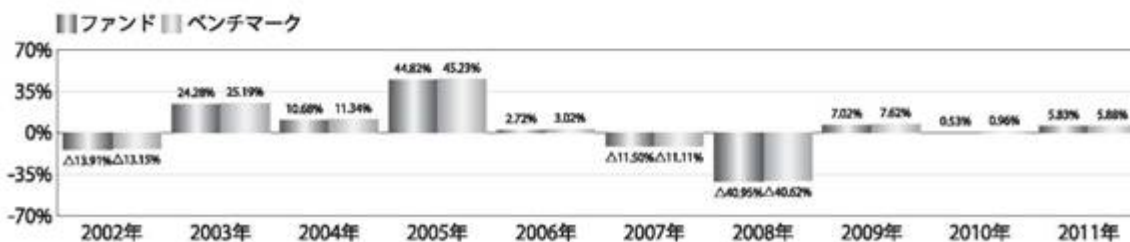
・比率とはマザーファンドの純資産総額に対する当該業種の評価金額の比率をいいます。

## 組入上位銘柄（中央三井日本株式マザーファンド）

銘柄名	業種	比率
トヨタ自動車	輸送用機器	3.77%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.60%
本田技研工業	輸送用機器	2.29%
キヤノン	電気機器	1.88%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.77%
みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.56%
三菱商事	卸売業	1.37%
ソニー	電気機器	1.29%
武田薬品工業	医薬品	1.22%
東京電力	電気・ガス業	1.19%
	合計	18.93%

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

## 〈年間収益率の推移〉



・年間収益率は「期末中の基準価額増減+分配金（税引前）/前年末の基準価額」で算出しています。  
 ・2002年はファンドの設定日から年末までの分配金（税引前）を含む基準価額の騰落率を表示しています。ベンチマークの騰落率も同様です。  
 ・2011年（直近年）は年初から基準日までの分配金（税引前）を含む基準価額の騰落率を表示しています。ベンチマークの騰落率も同様です。  
 ・ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しているものであり、ファンドの運用実績ではありません。

- ・運用実績は、ファンドの過去の実績を示したものであり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
- ・最新の運用実績は、表紙に記載の委託会社ホームページでご確認いただけます。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### （1）申込みの受付

申込期間中において、毎営業日お申込みいただけます。

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

ただし、分配金再投資に関する契約（下記（5））をご参照ください。）に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

#### （2）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みず。）（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

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

#### （5）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、

(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。

なお、一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

(4) 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の基準価額から、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。

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/>）でご覧いただけます。

販売会社の詳細につきましては、以下の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

中央三井アセットマネジメント株式会社

・お問い合わせ窓口

電 話：0120-668001（フリーダイヤル）

03-5440-0190

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

・ホームページ アドレス：<http://www.cmam.co.jp/>

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額

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

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

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

A．親投資信託受益証券（中央三井日本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なります。

#### (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、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

ハ．所定の手続き

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

B．監督官庁の命令

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

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。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、下記 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るべき旨を請求することができます。

#### 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 信託財産の管理

##### A．保管業務の委任

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

##### B．有価証券の保管

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

##### C．混蔵寄託

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

##### D．信託財産の登記等及び記載等の留保等

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

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できます。

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

#### 運用報告書

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

関係法人との契約の更改等に関する手続き、変更した場合の開示方法

- A．委託会社が販売会社と締結している「投資信託受益権の取扱に関する契約」の有効期間は、有効期間満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、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。

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次のとおりです。

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

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

(5) 受益権均等分割

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

(6) 帳簿閲覧権

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

(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ときは確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。

### 第3【ファンドの経理状況】

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

## 1【財務諸表】

中央三井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8期 (平成22年1月22日現在)	第9期 (平成23年1月24日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	232,590,429	257,735,238
未収入金	510,878	-
流動資産合計	233,101,307	257,735,238
資産合計	233,101,307	257,735,238
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	510,878	-
未払受託者報酬	82,365	89,358
未払委託者報酬	564,732	612,704
流動負債合計	1,157,975	702,062
負債合計	1,157,975	702,062
純資産の部		
元本等		
元本	226,966,584	254,313,726
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,976,748	2,719,450
純資産合計	231,943,332	257,033,176
負債純資産合計	233,101,307	257,735,238

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第8期	第9期
	自平成21年1月23日 至平成22年1月22日	自平成22年1月23日 至平成23年1月24日
営業収益		
有価証券売買等損益	40,518,363	232,740
営業収益合計	40,518,363	232,740
営業費用		
受託者報酬	155,879	176,245
委託者報酬	1,068,756	1,208,437
営業費用合計	1,224,635	1,384,682
営業利益又は営業損失( )	39,293,728	1,151,942
経常利益又は経常損失( )	39,293,728	1,151,942
当期純利益又は当期純損失( )	39,293,728	1,151,942
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( )	4,163,858	1,870,287
期首剰余金又は期首欠損金( )	30,366,985	4,976,748
剰余金増加額又は欠損金減少額	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	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,440,159	2,975,643
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	530,931
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	2,444,712
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,976,748	2,719,450

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第 8 期 自 平成21年 1月23日 至 平成22年 1月22日	第 9 期 自 平成22年 1月23日 至 平成23年 1月24日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、法令及び 社団法人投資信託協会規則に従 い、基準価額で評価してありま す。	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額 で評価しております。
2. その他		ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則 として、毎年 1月23日から翌年 1 月22日までとなっておりますが、 当計算期間末日が休業日のため、 第 9 期計算期間は平成22年 1月 23日から平成23年 1月24日まで となっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第 8 期 (平成22年 1月22日現在)	第 9 期 (平成23年 1月24日現在)
1. 当該計算期間の末日における受益権総数	226,966,584 口	254,313,726 口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0219 円 (10,219 円)	1.0107 円 (10,107 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 8 期 自 平成21年 1月23日 至 平成22年 1月22日	第 9 期 自 平成22年 1月23日 至 平成23年 1月24日
費用控除後の配当等収益額	A	3,659,015 円 (3,786,622 円)	3,292,525 円 (4,677,207 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	129,491,141 円	161,729,732 円
分配準備積立金額	D	56,006,561 円	50,423,285 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	189,156,717 円	215,445,542 円
当ファンドの期末残存口数	F	226,966,584 口	254,313,726 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	8,334.12 円	8,471.64 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 8 期 自 平成21年 1 月23日 至 平成22年 1 月22日	第 9 期 自 平成22年 1 月23日 至 平成23年 1 月24日
2. 剰余金増加額・減少額及び 欠損金減少額・増加額	「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。	「当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」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、それぞれ剰余金増加額との純額を表示しております。

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

第 8 期 自 平成21年 1 月23日 至 平成22年 1 月22日	第 9 期 自 平成22年 1 月23日 至 平成23年 1 月24日
	<p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク等に晒されております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、運用セクションから組織的に独立した業務管理室が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。 また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項



第 8 期 (平成22年 1月22日現在)	第 9 期 (平成23年 1月24日現在)
	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法 (1) 親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

第 8 期 自 平成21年 1月23日 至 平成22年 1月22日	第 9 期 自 平成22年 1月23日 至 平成23年 1月24日
該当事項はありません。	同左

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

第 8 期 自 平成21年 1月23日 至 平成22年 1月22日	第 9 期 自 平成22年 1月23日 至 平成23年 1月24日
該当事項はありません。	同左

## ( その他の注記 )

## 1. 本書における開示対象ファンドの当該計算期間における元本額の変動

	第 8 期 自 平成21年 1月23日 至 平成22年 1月22日	第 9 期 自 平成22年 1月23日 至 平成23年 1月24日
期首元本額	204,996,312 円	226,966,584 円
期中追加設定元本額	67,618,005 円	69,510,842 円
期中一部解約元本額	45,647,733 円	42,163,700 円

## 2. 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	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	232,590,429	36,933,815
合計	232,590,429	36,933,815

種類	第 9 期 (平成23年 1月24日現在)	
	最終の計算期間(自平成22年 1月23日 至平成23年 1月24日)の損益に含まれた 評価差額(円)	
親投資信託受益証券		2,857,603
合計		2,857,603

## 3. デリバティブ取引関係

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。

第 9 期 (平成23年 1月24日現在)
当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## A. 株式

該当事項はありません。

## B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	中央三井日本株式マザーファンド	317,251,647	257,735,238	
合計		317,251,647	257,735,238	

## 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 商品明細表

該当事項はありません。

## 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

## &lt; 参考 &gt;

「中央三井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23年1月24日現在（以下、「計算日」といいます。）の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 「中央三井日本株式マザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

項目	平成23年1月24日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	616,883
コール・ローン	5,602,006,953
株式	254,920,676,635
派生商品評価勘定	105,656,975
未収入金	4,147,705
未収配当金	230,459,150
未収利息	11,914
流動資産合計	260,863,576,215
資産合計	260,863,576,215
負債の部	
流動負債	
前受金	63,762,000
未払解約金	179,766,091
流動負債合計	243,528,091
負債合計	243,528,091
純資産の部	
元本等	
元本	320,819,161,488
剰余金	
欠損金	60,199,113,364
純資産合計	260,620,048,124
負債・純資産合計	260,863,576,215

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成23年1月24日現在
--	--------------

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</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</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3．収益及び費用の計上基準	<p>（1）受取配当金</p> <p>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</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

平成23年 1月24日現在	
1．担保に供している資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。</p> <p>株式 3,110,300,000 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	320,819,161,488 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>60,199,113,364 円</p>
4．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	<p>0.8124 円</p> <p>（ 8,124 円）</p>

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

平成23年 1月24日現在

### 1. 金融商品に対する取組方針

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

### 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

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

### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成23年1月24日現在

### 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

### 2. 時価の算定方法

#### (1) 株式

「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

#### (2) デリバティブ取引

「(その他の注記)」の「3. デリバティブ取引関係」に記載しております。

#### (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

### 4. 金銭債権の計算日後の償還予定額

金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

平成23年 1月24日現在
該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

平成23年 1月24日現在
該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1．元本の変動

平成23年 1月24日現在	
計算期間の期首元本額	335,855,124,304 円
計算期間中の追加設定元本額	36,233,705,795 円
計算期間中の一部解約元本額	51,269,668,611 円
計算日の元本額	320,819,161,488 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	2,503,495,691 円
中央三井DC日本株式インデックスファンド	317,251,647 円
中央三井DC日本株式インデックスファンドL	41,225,070,960 円
中央三井DC日本株式インデックスファンドA	1,536,729,900 円
中央三井DCバランスファンド30	301,017,351 円
中央三井DCバランスファンド50	708,648,937 円
中央三井DCバランスファンド70	419,384,374 円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	351,009,499 円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	215,399,783 円
新生・4分散ファンド	257,597,876 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	779,673,873 円
4資産インデックスバランスオープン（分配型）	87,437,063 円
4資産インデックスバランスオープン（成長型）	278,460,387 円
日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）	121,474,440 円
C M A M日本株式インデックスe	169,289,893 円
中央三井インデックスコレクション（国内株式）	1,372,310 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式30）	274,462 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式50）	411,693 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式70）	548,923 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）	35,742,600,869 円
中央三井バランスVA30（適格機関投資家専用）	7,101,215,553 円
中央三井バランスVA50（適格機関投資家専用）	53,140,234,129 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）	38,194,908,378 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）	6,098,303,879 円
中央三井VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	1,000,736,786 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）	7,883,588,678 円
中央三井バランスVA25（適格機関投資家専用）	6,718,863,782 円
中央三井バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	2,779,862,934 円
中央三井バランスVA50L（適格機関投資家専用）	41,926,694,435 円

中央三井バランスVA75(適格機関投資家専用)	2,712,233,545 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)	19,244,455,309 円
中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	7,636,944,502 円
中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	256,676,128 円
中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)	3,651,090,103 円
中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	2,804,886,424 円
CMAM・バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	7,712,426,022 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)	423,734,420 円
CMAM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)	5,135,940,281 円
CMAM・VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	328,199,267 円
中央三井バランスVA20(適格機関投資家専用)	1,938,486,409 円
中央三井VAファンド25(適格機関投資家専用)	3,386,619,223 円
CMAM・バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	3,155,412,822 円
中央三井バランスVA20L(適格機関投資家専用)	142,157,660 円
中央三井バランスVA25L(適格機関投資家専用)	2,154,907,722 円
CMAM・バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	9,122,919,365 円
中央三井世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	582,446,471 円
中央三井国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	217,729,794 円
中央三井国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	74,924,802 円
CMAM・VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	257,626,855 円
私募日本株式インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	12,769,240 円
中央三井世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	5,016,639 円

## 2. 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	平成23年1月24日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,939,356,266
合計	4,939,356,266

(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22年1月23日から平成23年1月24日まで)に対応するものです。

## 3. デリバティブ取引関係

## . ヘッジ会計が適用されていないもの

## 株式関連

区分	種類	平成23年1月24日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,530,863,025		5,636,520,000	105,656,975
	合計	5,530,863,025		5,636,520,000	105,656,975

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段で評価して  
おります。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

## . ヘッジ会計が適用されているもの



平成23年 1月24日現在

該当事項はありません。

[次へ](#)

## (3) 附属明細表(平成23年1月24日現在)

## 有価証券明細表

## A. 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	93,000	184	17,112,000	
日本水産	269,500	262	70,609,000	
マルハニチロホールディングス	462,000	140	64,680,000	
サカタのタネ	31,400	1,214	38,119,600	
ホクト	23,800	1,902	45,267,600	
日鉄鉱業	60,000	430	25,800,000	
三井松島産業	136,000	180	24,480,000	
国際石油開発帝石	2,366	509,000	1,204,294,000	
日本海洋掘削	6,200	3,035	18,817,000	
関東天然瓦斯開発	26,000	463	12,038,000	
石油資源開発	37,000	3,360	124,320,000	
ショーボンドホールディングス	22,000	1,769	38,918,000	
ミライト・ホールディングス	64,700	659	42,637,300	
ダイセキ環境ソリューション	28	73,900	2,069,200	
東急建設	102,580	248	25,439,840	
コムシスホールディングス	113,400	861	97,637,400	
ミサワホーム	34,600	383	13,251,800	
高松コンストラクショングループ	22,100	1,080	23,868,000	
東建コーポレーション	8,810	3,235	28,500,350	
大成建設	1,107,000	203	224,721,000	
大林組	700,000	409	286,300,000	
清水建設	663,000	363	240,669,000	
松井建設	40,000	316	12,640,000	
鹿島建設	1,026,000	228	233,928,000	
太平工業	51,000	374	19,074,000	
前田建設工業	163,000	282	45,966,000	
奥村組	222,000	319	70,818,000	
大和小田急建設	34,000	226	7,684,000	
東鉄工業	34,000	614	20,876,000	
戸田建設	251,000	322	80,822,000	
青木あすなる建設	29,000	371	10,759,000	
北野建設	75,000	207	15,525,000	
三井ホーム	37,000	436	16,132,000	
矢作建設工業	35,000	500	17,500,000	
ピーエス三菱	24,200	247	5,977,400	
大東建託	91,300	5,710	521,323,000	
新日本建設	40,700	240	9,768,000	
NIPPO	58,000	607	35,206,000	
前田道路	70,000	699	48,930,000	
日本道路	81,000	204	16,524,000	
五洋建設	270,000	129	34,830,000	
大林道路	41,000	162	6,642,000	
住友林業	160,700	745	119,721,500	
日本基礎技術	41,900	229	9,595,100	
巴コーポレーション	39,900	254	10,134,600	
パナホーム	82,000	531	43,542,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
大和ハウス工業	582,000	1,004	584,328,000	

ライト工業	59,800	216	12,916,800	
積水ハウス	701,000	814	570,614,000	
北陸電気工事	21,000	220	4,620,000	
ユアテック	44,000	360	15,840,000	
西部電気工業	26,000	350	9,100,000	
四電工	26,000	363	9,438,000	
中電工	36,000	1,009	36,324,000	
関電工	110,000	529	58,190,000	
きんでん	155,000	745	115,475,000	
東京エネシス	27,000	527	14,229,000	
トーエネック	38,000	450	17,100,000	
住友電設	22,500	343	7,717,500	
日本電設工業	45,000	787	35,415,000	
協和エクシオ	83,900	806	67,623,400	
新日本空調	20,800	517	10,753,600	
日本電話施設	44,000	269	11,836,000	
九電工	47,000	544	25,568,000	
三機工業	57,000	552	31,464,000	
日揮	235,000	2,035	478,225,000	
中外炉工業	75,000	330	24,750,000	
ヤマト	29,000	305	8,845,000	
太平電業	30,000	643	19,290,000	
高砂熱学工業	69,900	681	47,601,900	
三晃金属工業	37,000	180	6,660,000	
NEC ネットエスアイ	21,400	1,055	22,577,000	
朝日工業社	32,000	358	11,456,000	
大気社	37,300	1,460	54,458,000	
ダイダン	37,000	447	16,539,000	
日比谷総合設備	33,600	769	25,838,400	
東芝プラントシステム	38,000	1,118	42,484,000	
東洋エンジニアリング	137,000	308	42,196,000	
千代田化工建設	152,000	734	111,568,000	
新興プランテック	45,000	828	37,260,000	
日本製粉	136,000	404	54,944,000	
日清製粉グループ本社	211,500	1,045	221,017,500	
日東富士製粉	19,000	316	6,004,000	
昭和産業	97,000	247	23,959,000	
鳥越製粉	20,400	737	15,034,800	
協同飼料	82,000	105	8,610,000	
中部飼料	20,800	591	12,292,800	
日本配合飼料	72,000	110	7,920,000	
東洋精糖	36,000	111	3,996,000	
日本甜菜製糖	130,000	205	26,650,000	
三井製糖	92,000	323	29,716,000	
森永製菓	229,000	197	45,113,000	
中村屋	54,000	404	21,816,000	
江崎グリコ	84,000	956	80,304,000	
名糖産業	10,400	1,156	12,022,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
不二家	134,000	156	20,904,000	
山崎製パン	171,000	971	166,041,000	
第一屋製パン	33,000	93	3,069,000	
モロゾフ	36,000	279	10,044,000	
森永乳業	197,000	340	66,980,000	

ヤクルト本社	125,200	2,420	302,984,000	
明治ホールディングス	69,200	3,815	263,998,000	
雪印メグミルク	45,800	1,466	67,142,800	
プリマハム	132,000	98	12,936,000	
日本ハム	163,000	1,131	184,353,000	
伊藤ハム	129,000	305	39,345,000	
丸大食品	103,000	268	27,604,000	
米久	20,500	670	13,735,000	
S Foods	15,000	733	10,995,000	
サッポロホールディングス	331,000	369	122,139,000	
アサヒビール	438,100	1,568	686,940,800	
キリンホールディングス	965,000	1,107	1,068,255,000	
宝ホールディングス	197,000	492	96,924,000	
オエノンホールディングス	64,000	202	12,928,000	
養命酒製造	18,000	801	14,418,000	
三国コカ・コーラボトリング	27,900	735	20,506,500	
コカ・コーラウエスト	71,900	1,507	108,353,300	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	26,300	1,075	28,272,500	
ダイドードリンコ	9,700	3,095	30,021,500	
伊藤園	59,000	1,410	83,190,000	
キーコーヒー	20,400	1,485	30,294,000	
ユニカフェ	5,700	404	2,302,800	
ジャパンフーズ	3,100	826	2,560,600	
日清オイリオグループ	101,000	396	39,996,000	
不二製油	56,700	1,141	64,694,700	
J・オイルミルズ	87,000	256	22,272,000	
キッコーマン	191,000	898	171,518,000	
味の素	634,000	902	571,868,000	
キュービー	120,700	1,010	121,907,000	
ハウス食品	86,100	1,326	114,168,600	
カゴメ	83,800	1,533	128,465,400	
焼津水産化学工業	11,000	866	9,526,000	
アリアケジャパン	19,200	1,402	26,918,400	
ニチレイ	261,000	386	100,746,000	
東洋水産	100,000	1,810	181,000,000	
日清食品ホールディングス	83,600	2,960	247,456,000	
永谷園	21,000	869	18,249,000	
フジッコ	25,000	1,008	25,200,000	
ロック・フィールド	11,400	1,324	15,093,600	
日本たばこ産業	4,853	305,000	1,480,165,000	
わらべや日洋	13,000	1,022	13,286,000	
なとり	11,200	840	9,408,000	
ミヨシ油脂	74,000	140	10,360,000	
片倉工業	25,100	807	20,255,700	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
グンゼ	150,000	354	53,100,000	
川島織物セルコン	79,000	69	5,451,000	
東洋紡績	777,000	153	118,881,000	
ユニチカ	495,000	79	39,105,000	
富士紡ホールディングス	99,000	158	15,642,000	
日清紡ホールディングス	139,000	936	130,104,000	
倉敷紡績	209,000	156	32,604,000	
シキボウ	135,000	122	16,470,000	
日本毛織	75,000	739	55,425,000	

トーア紡コーポレーション	77,000	74	5,698,000	
ダイドーリミテッド	27,100	731	19,810,100	
帝国繊維	24,000	517	12,408,000	
帝人	828,000	394	326,232,000	
東レ	1,689,000	553	934,017,000	
サカイオーベックス	63,000	131	8,253,000	
住江織物	55,000	177	9,735,000	
日本フェルト	12,100	415	5,021,500	
イチカワ	14,000	170	2,380,000	
日本バイリーン	24,000	444	10,656,000	
日東製網	27,000	96	2,592,000	
芦森工業	52,000	134	6,968,000	
アツギ	190,000	111	21,090,000	
ダイニック	46,000	170	7,820,000	
セーレン	54,500	632	34,444,000	
東海染工	33,000	84	2,772,000	
小松精練	37,000	343	12,691,000	
ワコールホールディングス	130,000	1,132	147,160,000	
ホギメディカル	11,600	3,920	45,472,000	
サンエー・インターナショナル	9,400	1,038	9,757,200	
レナウン	42,900	227	9,738,300	
クラウドシア	2,800	1,320	3,696,000	
三陽商会	107,000	312	33,384,000	
オンワードホールディングス	145,000	721	104,545,000	
ルック	38,000	139	5,282,000	
ゴールドウイン	53,000	218	11,554,000	
東京スタイル	80,000	645	51,600,000	
デサント	55,000	435	23,925,000	
ヤマトインターナショナル	13,600	388	5,276,800	
特種東海製紙	137,000	190	26,030,000	
王子製紙	964,000	391	376,924,000	
三菱製紙	310,000	98	30,380,000	
北越紀州製紙	135,500	470	63,685,000	
中越パルプ工業	83,000	148	12,284,000	
巴川製紙所	37,000	277	10,249,000	
大王製紙	92,000	573	52,716,000	
日本製紙グループ本社	105,300	2,149	226,289,700	
レンゴー	175,000	550	96,250,000	
トーモク	69,000	241	16,629,000	
ザ・バック	15,500	1,441	22,335,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
クラレ	322,100	1,140	367,194,000	
旭化成	1,271,000	560	711,760,000	
共和レザー	13,000	329	4,277,000	
コープケミカル	38,000	117	4,446,000	
昭和電工	1,453,000	185	268,805,000	
住友化学	1,500,000	433	649,500,000	
日本化成	44,000	212	9,328,000	
住友精化	47,000	370	17,390,000	
日産化学工業	157,600	1,058	166,740,800	
ラサ工業	89,000	99	8,811,000	
クレハ	141,000	486	68,526,000	
テイカ	39,000	352	13,728,000	
片倉チッカリン	17,000	277	4,709,000	

日本曹達	132,000	395	52,140,000	
東ソー	545,000	274	149,330,000	
トクヤマ	339,000	442	149,838,000	
セントラル硝子	209,000	411	85,899,000	
東亜合成	222,000	390	86,580,000	
ダイソー	89,000	270	24,030,000	
関東電化工業	49,000	709	34,741,000	
電気化学工業	458,000	395	180,910,000	
信越化学工業	363,500	4,710	1,712,085,000	
日本カーバイド工業	55,000	236	12,980,000	
堺化学工業	70,000	439	30,730,000	
エア・ウォーター	176,000	1,070	188,320,000	
大陽日酸	287,000	714	204,918,000	
日本化学工業	84,000	233	19,572,000	
日本パーカライジング	52,000	1,185	61,620,000	
高压ガス工業	34,000	510	17,340,000	
チタン工業	28,000	474	13,272,000	
四国化成工業	33,000	473	15,609,000	
戸田工業	32,000	886	28,352,000	
ステラ ケミファ	9,700	3,745	36,326,500	
保土谷化学工業	51,000	348	17,748,000	
日本触媒	178,000	920	163,760,000	
大日精化工業	80,000	464	37,120,000	
カネカ	272,000	585	159,120,000	
三菱瓦斯化学	344,000	567	195,048,000	
三井化学	992,000	309	306,528,000	
J S R	182,100	1,672	304,471,200	
東京応化工業	39,200	1,834	71,892,800	
三菱ケミカルホールディングス	1,267,000	580	734,860,000	
日本合成化学工業	52,000	543	28,236,000	
ダイセル化学工業	283,000	610	172,630,000	
住友ベークライト	204,000	495	100,980,000	
積水化学工業	454,000	615	279,210,000	
日本ゼオン	204,000	735	149,940,000	
アイカ工業	64,000	998	63,872,000	
宇部興産	914,000	253	231,242,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
積水樹脂	33,000	841	27,753,000	
タキロン	51,000	295	15,045,000	
旭有機材工業	78,000	231	18,018,000	
日立化成工業	94,400	1,740	164,256,000	
ニチバン	21,000	308	6,468,000	
リケンテクノス	41,000	297	12,177,000	
大倉工業	52,000	266	13,832,000	
積水化成品工業	50,000	374	18,700,000	
群栄化学工業	61,000	243	14,823,000	
タイガースポリマー	11,100	389	4,317,900	
日本カーリット	18,700	470	8,789,000	
日本化薬	154,000	880	135,520,000	
日本精化	19,300	555	10,711,500	
A D E K A	87,200	968	84,409,600	
日油	191,000	430	82,130,000	
ハリマ化成	19,900	595	11,840,500	
花王	594,200	2,199	1,306,645,800	

第一工業製薬	39,000	324	12,636,000	
三洋化成工業	62,000	688	42,656,000	
大日本塗料	131,000	122	15,982,000	
日本ペイント	189,000	638	120,582,000	
関西ペイント	247,000	814	201,058,000	
中国塗料	59,000	756	44,604,000	
日本特殊塗料	17,100	375	6,412,500	
藤倉化成	28,700	579	16,617,300	
太陽ホールディングス	16,300	2,710	44,173,000	
D I C	833,000	182	151,606,000	
サカタインクス	46,000	421	19,366,000	
東洋インキ製造	198,000	418	82,764,000	
富士フイルムホールディングス	466,200	3,040	1,417,248,000	
資生堂	362,400	1,677	607,744,800	
ライオン	252,000	439	110,628,000	
高砂香料工業	73,000	528	38,544,000	
マンダム	21,900	2,203	48,245,700	
ミルボン	11,500	2,170	24,955,000	
ファンケル	42,200	1,218	51,399,600	
コーセー	39,200	2,084	81,692,800	
ドクターシーラボ	145	315,000	45,675,000	
エステー	10,400	989	10,285,600	
コニシ	17,800	1,036	18,440,800	
長谷川香料	28,100	1,350	37,935,000	
小林製薬	30,300	3,860	116,958,000	
荒川化学工業	17,700	886	15,682,200	
メック	16,000	375	6,000,000	
日本高純度化学	64	266,100	17,030,400	
荏原ユーザライト	3,400	1,905	6,477,000	
アース製薬	15,700	2,749	43,159,300	
イハラケミカル工業	43,000	293	12,599,000	
北興化学工業	24,000	292	7,008,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
大成ラミック	6,400	2,383	15,251,200	
クミアイ化学工業	47,000	298	14,006,000	
日本農薬	47,000	465	21,855,000	
アキレス	183,000	123	22,509,000	
有沢製作所	34,000	462	15,708,000	
日東電工	179,900	3,990	717,801,000	
レック	5,700	1,529	8,715,300	
アロン化成	17,000	401	6,817,000	
きもと	19,600	787	15,425,200	
藤森工業	15,700	1,350	21,195,000	
前澤化成工業	22,000	776	17,072,000	
J S P	14,800	1,339	19,817,200	
エフピコ	10,700	4,865	52,055,500	
天馬	20,100	892	17,929,200	
信越ポリマー	42,800	555	23,754,000	
東リ	91,000	151	13,741,000	
ニフコ	41,700	2,133	88,946,100	
日本バルカー工業	91,000	264	24,024,000	
ユニ・チャーム	120,500	3,120	375,960,000	
協和発酵キリン	261,000	857	223,677,000	

武田薬品工業	817,600	3,990	3,262,224,000	代用有価証券で 200,000株 担保差入
アステラス製薬	484,500	3,160	1,531,020,000	
大日本住友製薬	154,500	760	117,420,000	
塩野義製薬	318,100	1,571	499,735,100	
田辺三菱製薬	181,600	1,379	250,426,400	
わかもと製薬	23,000	253	5,819,000	
あすか製薬	26,000	607	15,782,000	
日本新薬	50,000	1,158	57,900,000	
中外製薬	217,300	1,521	330,513,300	
科研製薬	92,000	1,039	95,588,000	
エーザイ	268,700	2,948	792,127,600	
ロート製薬	99,000	942	93,258,000	
小野薬品工業	109,500	3,945	431,977,500	
久光製薬	61,600	3,375	207,900,000	
有機合成薬品工業	18,000	241	4,338,000	
持田製薬	88,000	928	81,664,000	
大正製薬	175,000	1,879	328,825,000	
参天製薬	67,600	3,040	205,504,000	
扶桑薬品工業	73,000	248	18,104,000	
日本ケミファ	33,000	285	9,405,000	
ツムラ	59,500	2,629	156,425,500	
キッセイ薬品工業	44,200	1,685	74,477,000	
生化学工業	41,700	907	37,821,900	
栄研化学	16,900	1,019	17,221,100	
日水製薬	8,800	703	6,186,400	
鳥居薬品	14,900	1,780	26,522,000	
東和薬品	11,100	4,555	50,560,500	
沢井製薬	14,300	6,980	99,814,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ゼリア新薬工業	31,000	995	30,845,000	
第一三共	734,100	1,767	1,297,154,700	
キョーリン製薬ホールディングス	58,000	1,487	86,246,000	
大幸薬品	7,500	1,179	8,842,500	
大塚ホールディングス	43,000	2,066	88,838,000	
昭和シェル石油	195,100	727	141,837,700	
コスモ石油	603,000	263	158,589,000	
ニチレキ	33,000	336	11,088,000	
東燃ゼネラル石油	329,000	925	304,325,000	
ユシロ化学工業	11,800	1,343	15,847,400	
ビービー・カストロール	12,100	333	4,029,300	
AOCホールディングス	57,900	489	28,313,100	
出光興産	25,900	8,890	230,251,000	
JXホールディングス	2,422,200	554	1,341,898,800	
横浜ゴム	244,000	409	99,796,000	
東洋ゴム工業	181,000	192	34,752,000	
ブリヂストン	684,000	1,539	1,052,676,000	
住友ゴム工業	153,200	831	127,309,200	
藤倉ゴム工業	14,000	390	5,460,000	
オカモト	83,000	332	27,556,000	
フコク	9,200	906	8,335,200	
ニッタ	19,700	1,597	31,460,900	
東海ゴム工業	33,800	1,096	37,044,800	
三ツ星ベルト	57,000	478	27,246,000	



バンドー化学	79,000	345	27,255,000	
日東紡績	177,000	214	37,878,000	
旭硝子	1,075,000	990	1,064,250,000	
日本板硝子	935,000	209	195,415,000	
石塚硝子	29,000	170	4,930,000	
日本山村硝子	94,000	241	22,654,000	
日本電気硝子	451,000	1,180	532,180,000	
オハラ	8,400	1,089	9,147,600	
住友大阪セメント	416,000	184	76,544,000	
太平洋セメント	922,000	108	99,576,000	
デイ・シイ	23,400	164	3,837,600	
日本ヒューム	25,000	280	7,000,000	
日本コンクリート工業	49,000	151	7,399,000	
東海カーボン	204,000	493	100,572,000	
日本カーボン	108,000	251	27,108,000	
東洋炭素	10,800	4,765	51,462,000	
ノリタケカンパニーリミテド	113,000	318	35,934,000	
TOTO	313,000	587	183,731,000	
日本碍子	262,000	1,398	366,276,000	
日本特殊陶業	193,000	1,280	247,040,000	
MARUWA	5,000	2,546	12,730,000	
品川リフラクトリーズ	56,000	255	14,280,000	
黒崎播磨	48,000	333	15,984,000	
東京窯業	27,000	209	5,643,000	
ニッカトー	8,100	423	3,426,300	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
フジインコーポレーテッド	20,000	1,260	25,200,000	
ニチアス	117,000	461	53,937,000	
ニチハ	29,100	769	22,377,900	
新日本製鐵	5,726,000	284	1,626,184,000	
住友金属工業	4,043,000	194	784,342,000	
神戸製鋼所	3,024,000	203	613,872,000	
日新製鋼	837,000	167	139,779,000	
中山製鋼所	114,000	112	12,768,000	
合同製鐵	124,000	170	21,080,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	516,900	2,667	1,378,572,300	
東京製鐵	120,400	909	109,443,600	
共英製鋼	23,500	1,200	28,200,000	
大和工業	49,900	2,376	118,562,400	
東京製鋼	47,000	232	10,904,000	
大阪製鐵	13,900	1,332	18,514,800	
淀川製鋼所	168,000	373	62,664,000	
東洋鋼板	53,000	523	27,719,000	
住友鋼管	15,400	605	9,317,000	
丸一鋼管	73,000	1,813	132,349,000	
モリ工業	37,000	349	12,913,000	
大同特殊鋼	365,000	515	187,975,000	
日本高周波鋼業	89,000	103	9,167,000	
日本金属工業	164,000	108	17,712,000	
日本冶金工業	113,500	251	28,488,500	
山陽特殊製鋼	109,000	525	57,225,000	
愛知製鋼	116,000	590	68,440,000	
日立金属	142,000	951	135,042,000	
日本金属	58,000	168	9,744,000	

大平洋金属	152,000	706	107,312,000	
日本電工	86,000	640	55,040,000	
日本鑄鉄管	26,000	126	3,276,000	
三菱製鋼	133,000	255	33,915,000	
日亜鋼業	32,000	225	7,200,000	
日本精線	18,000	463	8,334,000	
シンニッタン	21,000	405	8,505,000	
新家工業	84,000	133	11,172,000	
日本軽金属	496,000	172	85,312,000	
大紀アルミニウム工業所	35,000	256	8,960,000	
三井金属鉱業	630,000	286	180,180,000	
東邦亜鉛	124,000	425	52,700,000	
三菱マテリアル	1,361,000	258	351,138,000	
住友金属鉱山	602,000	1,381	831,362,000	
DOWAホールディングス	261,000	589	153,729,000	
古河機械金属	370,000	101	37,370,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,900	4,470	106,833,000	
東邦チタニウム	35,600	2,239	79,708,400	
住友軽金属工業	367,000	106	38,902,000	
古河スカイ	90,000	250	22,500,000	
古河電気工業	686,000	372	255,192,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
住友電気工業	770,600	1,178	907,766,800	
フジクラ	327,000	412	134,724,000	
タツタ電線	51,000	272	13,872,000	
日立電線	179,000	229	40,991,000	
沖電線	23,000	160	3,680,000	
カナレ電気	2,400	1,183	2,839,200	
平河ヒューテック	4,200	725	3,045,000	
リョービ	122,000	356	43,432,000	
アサヒホールディングス	30,700	1,721	52,834,700	
稲葉製作所	11,300	885	10,000,500	
トーカロ	11,500	1,516	17,434,000	
アルファC o	6,700	920	6,164,000	
SUMCO	133,400	1,274	169,951,600	
川田テクノロジーズ	6,300	1,559	9,821,700	
東洋製罐	154,200	1,585	244,407,000	
ホッカンホールディングス	53,000	261	13,833,000	
コロナ	10,900	809	8,818,100	
横河ブリッジホールディングス	43,000	542	23,306,000	
駒井ハルテック	53,000	218	11,554,000	
高田機工	32,000	184	5,888,000	
三和ホールディングス	236,000	259	61,124,000	
文化シャッター	80,000	216	17,280,000	
東洋シャッター	20,000	377	7,540,000	
住生活グループ	263,300	1,866	491,317,800	
日本ファイルコン	16,100	420	6,762,000	
ノーリツ	43,000	1,410	60,630,000	
長府製作所	21,000	1,906	40,026,000	
リンナイ	35,100	5,150	180,765,000	
ダイニチ工業	12,400	575	7,130,000	
日東精工	32,000	277	8,864,000	
三洋工業	72,000	110	7,920,000	
岡部	59,600	392	23,363,200	

中国工業	33,000	94	3,102,000	
東プレ	42,100	668	28,122,800	
高周波熱錬	29,100	729	21,213,900	
東京製綱	156,000	281	43,836,000	
パイオラックス	9,400	1,852	17,408,800	
日本発條	158,000	912	144,096,000	
中央発條	28,000	344	9,632,000	
三益半導体工業	16,100	989	15,922,900	
アタカ大機	16,000	244	3,904,000	
日本製鋼所	337,000	867	292,179,000	
日立ツール	13,000	921	11,973,000	
三浦工業	35,100	2,283	80,133,300	
タクマ	80,000	261	20,880,000	
ツガミ	63,000	582	36,666,000	
オークマ	143,000	644	92,092,000	
東芝機械	131,000	410	53,710,000	
アマダ	308,000	666	205,128,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
アイダエンジニアリング	57,800	389	22,484,200	
牧野フライス製作所	102,000	668	68,136,000	
オーエスジー	96,000	1,022	98,112,000	
ダイジェット工業	30,000	122	3,660,000	
旭ダイヤモンド工業	46,000	1,591	73,186,000	
森精機製作所	115,000	918	105,570,000	
ディスコ	22,000	5,400	118,800,000	
日東工器	12,900	2,100	27,090,000	
豊和工業	120,000	78	9,360,000	
大阪機工	78,000	133	10,374,000	
東洋機械金属	19,500	250	4,875,000	
オーエム製作所	21,000	340	7,140,000	
津田駒工業	56,000	174	9,744,000	
島精機製作所	28,700	2,083	59,782,100	
日阪製作所	28,000	1,131	31,668,000	
やまびこ	8,600	931	8,006,600	
ベガサスミシン製造	23,800	269	6,402,200	
ナプテスコ	82,300	1,809	148,880,700	
三井海洋開発	18,000	1,495	26,910,000	
レオン自動機	23,000	213	4,899,000	
S M C	65,100	13,510	879,501,000	
新川	15,600	886	13,821,600	
ホソカワミクロン	38,000	359	13,642,000	
ユニオンツール	13,700	2,068	28,331,600	
オイレス工業	22,000	1,625	35,750,000	
サトー	20,800	1,063	22,110,400	
日本エアーテック	7,700	398	3,064,600	
日精樹脂工業	19,300	296	5,712,800	
ワイエイシイ	9,400	686	6,448,400	
小松製作所	1,034,000	2,383	2,464,022,000	
住友重機械工業	557,000	504	280,728,000	
日立建機	97,400	1,949	189,832,600	
日工	30,000	284	8,520,000	
巴工業	8,300	1,246	10,341,800	
井関農機	223,000	230	51,290,000	
T O W A	21,000	666	13,986,000	

丸山製作所	49,000	175	8,575,000	
北川鉄工所	102,000	154	15,708,000	
クボタ	915,000	847	775,005,000	
荏原実業	5,200	1,205	6,266,000	
三菱化工機	67,000	179	11,993,000	
月島機械	35,000	643	22,505,000	
帝国電機製作所	7,600	1,901	14,447,600	
東京機械製作所	71,000	78	5,538,000	
新東工業	44,600	829	36,973,400	
澁谷工業	13,000	820	10,660,000	
アイチ コーポレーション	36,000	353	12,708,000	
小森コーポレーション	58,000	893	51,794,000	
鶴見製作所	17,000	605	10,285,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
住友精密工業	39,000	418	16,302,000	
酒井重工業	41,000	153	6,273,000	
荏原製作所	383,000	401	153,583,000	
石井鐵工所	32,000	169	5,408,000	
西島製作所	25,400	1,603	40,716,200	
ダイキン工業	227,600	2,888	657,308,800	
オルガノ	37,000	610	22,570,000	
トヨーカネツ	117,000	152	17,784,000	
栗田工業	120,300	2,575	309,772,500	
椿本チエイン	112,000	474	53,088,000	
大同工業	46,000	184	8,464,000	
日本コンベヤ	67,000	88	5,896,000	
木村化工機	20,000	649	12,980,000	
アネスト岩田	40,000	394	15,760,000	
ダイフク	88,500	552	48,852,000	
加藤製作所	49,000	193	9,457,000	
油研工業	41,000	171	7,011,000	
タダノ	92,000	445	40,940,000	
フジテック	61,000	424	25,864,000	
シーケーディ	58,600	773	45,297,800	
キトー	68	79,600	5,412,800	
平和	45,200	1,229	55,550,800	
理想科学工業	16,300	1,391	22,673,300	
SANKYO	63,200	4,615	291,668,000	
日本金銭機械	19,300	646	12,467,800	
マースエンジニアリング	10,300	1,444	14,873,200	
福島工業	6,400	939	6,009,600	
オーイズミ	7,300	329	2,401,700	
ダイコク電機	8,600	1,042	8,961,200	
アマノ	58,000	801	46,458,000	
サンデン	118,000	384	45,312,000	
マックス	37,000	1,029	38,073,000	
グローリー	57,700	2,030	117,131,000	
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	219,900	1,645	361,735,500	
日本ピストンリング	82,000	213	17,466,000	
リケン	83,000	374	31,042,000	
帝国ピストンリング	25,400	877	22,275,800	
ホシザキ電機	42,000	1,552	65,184,000	
大豊工業	14,700	862	12,671,400	

日本精工	464,000	760	352,640,000	
NTN	482,000	449	216,418,000	
ジェイテクト	221,400	1,033	228,706,200	
不二越	212,000	353	74,836,000	
日本トムソン	72,000	693	49,896,000	
THK	138,600	1,960	271,656,000	
ユーシン精機	10,700	1,550	16,585,000	
前澤給装工業	12,700	1,043	13,246,100	
イーグル工業	26,000	874	22,724,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
前澤工業	13,900	239	3,322,100	
日本ビラー工業	23,000	672	15,456,000	
キッツ	86,100	391	33,665,100	
日立工機	56,400	815	45,966,000	
マキタ	135,900	3,370	457,983,000	
日立造船	875,500	123	107,686,500	
三菱重工業	3,493,000	322	1,124,746,000	
IHI	1,424,000	189	269,136,000	
イビデン	126,900	2,704	343,137,600	
コニカミノルタホールディングス	550,500	841	462,970,500	
ブラザー工業	269,400	1,228	330,823,200	
ミネベア	310,000	496	153,760,000	
日立製作所	4,678,000	447	2,091,066,000	
東芝	4,113,000	487	2,003,031,000	
三菱電機	2,084,000	902	1,879,768,000	
富士電機ホールディングス	628,000	249	156,372,000	
東洋電機製造	33,000	522	17,226,000	
安川電機	229,000	867	198,543,000	
シンフォニアテクノロジー	125,000	278	34,750,000	
明電舎	206,000	393	80,958,000	
オリジン電気	28,000	506	14,168,000	
デンヨー	19,700	689	13,573,300	
東芝テック	131,000	397	52,007,000	
芝浦メカトロニクス	37,000	322	11,914,000	
マブチモーター	29,800	4,100	122,180,000	
日本電産	103,300	7,950	821,235,000	
高岳製作所	82,000	477	39,114,000	
ダイヘン	114,000	376	42,864,000	
JVC・ケンウッド・ホールディングス	78,000	357	27,846,000	
日新電機	35,000	516	18,060,000	
大崎電気工業	30,000	759	22,770,000	
オムロン	232,100	2,144	497,622,400	
日東工業	31,300	946	29,609,800	
IDEC	24,900	772	19,222,800	
エルピーダメモリ	184,000	1,134	208,656,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	401,000	582	233,382,000	
サクサホールディングス	53,000	165	8,745,000	
メルコホールディングス	11,600	2,847	33,025,200	
テクノメディカ	16	290,000	4,640,000	
日本電気	2,697,000	238	641,886,000	
富士通	2,009,000	545	1,094,905,000	
沖電気工業	759,000	69	52,371,000	
岩崎通信機	91,000	71	6,461,000	
電気興業	64,000	428	27,392,000	

サンケン電気	122,000	439	53,558,000	
ナカヨ通信機	21,000	214	4,494,000	
アイホン	13,500	1,293	17,455,500	
ルネサスエレクトロニクス	54,000	910	49,140,000	
セイコーエプソン	142,200	1,469	208,891,800	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ワコム	409	135,900	55,583,100	
アルバック	38,300	2,103	80,544,900	
アクセル	7,200	2,300	16,560,000	
ナナオ	17,700	1,945	34,426,500	
日本信号	48,500	672	32,592,000	
京三製作所	45,000	406	18,270,000	
能美防災	28,000	520	14,560,000	
ホーチキ	19,000	424	8,056,000	
マスプロ電工	14,700	740	10,878,000	
日本無線	81,000	245	19,845,000	
パナソニック	2,063,600	1,146	2,364,885,600	
シャープ	934,000	863	806,042,000	
アンリツ	91,000	650	59,150,000	
富士通ゼネラル	50,000	500	25,000,000	
日立国際電気	48,000	865	41,520,000	
ソニー	1,170,100	2,853	3,338,295,300	
T D K	117,400	5,660	664,484,000	
帝国通信工業	49,000	197	9,653,000	
ミツミ電機	73,600	1,405	103,408,000	
タムラ製作所	63,000	247	15,561,000	
アルプス電気	164,500	959	157,755,500	
池上通信機	68,000	65	4,420,000	
パイオニア	295,700	360	106,452,000	
日本電波工業	16,100	1,633	26,291,300	
日本トリム	2,750	1,807	4,969,250	
ローランド ディー . ジー .	9,300	1,431	13,308,300	
フォスター電機	19,800	2,402	47,559,600	
クラリオン	110,000	158	17,380,000	
S M K	61,000	461	28,121,000	
ヨコオ	17,700	644	11,398,800	
東光	88,000	195	17,160,000	
ティアック	115,000	45	5,175,000	
ホシデン	51,800	911	47,189,800	
ヒロセ電機	33,700	8,790	296,223,000	
日本航空電子工業	48,000	634	30,432,000	
T O A	25,000	462	11,550,000	
ユニデン	62,000	271	16,802,000	
アルパイン	40,700	1,174	47,781,800	
スミダコーポレーション	12,900	933	12,035,700	
アイコム	11,600	2,269	26,320,400	
船井電機	18,700	2,764	51,686,800	
横河電機	208,600	675	140,805,000	
新電元工業	74,000	422	31,228,000	
山武	58,300	1,915	111,644,500	
日本光電工業	38,500	1,743	67,105,500	
チノー	40,000	216	8,640,000	
共和電業	22,000	269	5,918,000	
日本電子材料	8,900	575	5,117,500	

堀場製作所	35,800	2,235	80,013,000	
-------	--------	-------	------------	--

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
アドバンテスト	142,100	1,811	257,343,100	
小野測器	23,000	267	6,141,000	
エスベック	21,500	651	13,996,500	
パナソニック電工SUNX	18,400	482	8,868,800	
キーエンス	46,500	21,710	1,009,515,000	
日置電機	10,000	1,683	16,830,000	
シスメックス	36,600	5,490	200,934,000	
メガチップス	18,700	1,726	32,276,200	
OBARA	15,500	914	14,167,000	
日本電産コバル電子	21,500	675	14,512,500	
ミヤチテクノス	11,700	686	8,026,200	
東京電波	6,100	744	4,538,400	
澤藤電機	13,000	304	3,952,000	
コーセル	27,800	1,284	35,695,200	
日立メディコ	15,000	777	11,655,000	
新日本無線	15,000	254	3,810,000	
オプテックス	14,300	1,218	17,417,400	
千代田インテグレ	8,200	1,329	10,897,800	
東光電気	13,000	500	6,500,000	
スタンレー電気	140,800	1,513	213,030,400	
岩崎電気	76,000	165	12,540,000	
ウシオ電機	126,500	1,630	206,195,000	
岡谷電機産業	11,100	384	4,262,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	19,800	238	4,712,400	
日本セラミック	13,600	1,443	19,624,800	
新神戸電機	16,000	995	15,920,000	
日本デジタル研究所	18,400	900	16,560,000	
古河電池	15,000	564	8,460,000	
双信電機	10,100	519	5,241,900	
山一電機	21,100	418	8,819,800	
図研	14,600	656	9,577,600	
日本電子	77,000	287	22,099,000	
カシオ計算機	198,600	641	127,302,600	
ファナック	217,000	12,320	2,673,440,000	
日本シイエムケイ	40,800	436	17,788,800	
エンプラス	10,600	1,177	12,476,200	
ローム	104,500	5,290	552,805,000	
浜松ホトニクス	81,300	3,015	245,119,500	
三井ハイテック	24,700	478	11,806,600	
新光電気工業	52,500	927	48,667,500	
京セラ	173,300	8,340	1,445,322,000	
太陽誘電	94,000	1,276	119,944,000	
村田製作所	218,600	5,930	1,296,298,000	
ユーシン	25,000	653	16,325,000	
双葉電子工業	36,000	1,653	59,508,000	
北陸電気工業	84,000	173	14,532,000	
ニチコン	65,600	1,139	74,718,400	
日本ケミコン	129,000	406	52,374,000	
KOA	26,200	983	25,754,600	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
市光工業	50,000	236	11,800,000	
小糸製作所	104,000	1,341	139,464,000	
ミツバ	38,000	738	28,044,000	
スター精密	40,200	881	35,416,200	
大日本スクリーン製造	230,000	703	161,690,000	
キヤノン電子	19,100	2,240	42,784,000	
キヤノン	1,294,600	4,090	5,294,914,000	
リコー	627,000	1,204	754,908,000	
日本電産サンキョー	49,000	687	33,663,000	
MUTOHホールディングス	25,000	197	4,925,000	
東京エレクトロン	163,600	5,400	883,440,000	
トヨタ紡織	72,900	1,435	104,611,500	
鬼怒川ゴム工業	52,000	441	22,932,000	
ユニプレス	26,600	1,605	42,693,000	
豊田自動織機	189,800	2,624	498,035,200	
モリタホールディングス	36,000	504	18,144,000	
三櫻工業	24,100	750	18,075,000	
デンソー	457,700	2,969	1,358,911,300	
東海理化電機製作所	48,800	1,628	79,446,400	
三井造船	807,000	225	181,575,000	
佐世保重工業	136,000	178	24,208,000	
川崎重工業	1,621,000	283	458,743,000	
日本車輛製造	76,000	441	33,516,000	
日本輸送機	24,000	227	5,448,000	
近畿車輛	31,000	438	13,578,000	
日産自動車	2,632,800	830	2,185,224,000	
いすゞ自動車	1,208,000	385	465,080,000	
トヨタ自動車	2,677,400	3,415	9,143,321,000	代用有価証券で 500,000株 担保差入
日野自動車	260,000	456	118,560,000	
三菱自動車工業	4,300,000	116	498,800,000	
エフテック	7,300	1,574	11,490,200	
武蔵精密工業	20,200	2,027	40,945,400	
トヨタ車体	37,900	1,538	58,290,200	
日産車体	82,000	707	57,974,000	
関東自動車工業	31,800	744	23,659,200	
新明和工業	93,000	360	33,480,000	
極東開発工業	38,700	370	14,319,000	
日信工業	42,400	1,433	60,759,200	
トピー工業	172,000	218	37,496,000	
ティラド	68,000	364	24,752,000	
曙ブレーキ工業	97,000	520	50,440,000	
タチエス	27,300	1,376	37,564,800	
NOK	100,800	1,651	166,420,800	
フタバ産業	59,100	625	36,937,500	
カヤバ工業	130,000	616	80,080,000	
シロキ工業	46,000	302	13,892,000	
大同メタル工業	32,000	697	22,304,000	
プレス工業	96,000	398	38,208,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
カルソニックカンセイ	106,000	330	34,980,000	
太平洋工業	43,000	475	20,425,000	



ケーヒン	43,100	1,864	80,338,400	
河西工業	26,000	524	13,624,000	
アイシン精機	171,600	3,100	531,960,000	
富士機工	24,000	305	7,320,000	
マツダ	1,613,000	244	393,572,000	
ダイハツ工業	221,000	1,319	291,499,000	
愛知機械工業	47,000	363	17,061,000	
今仙電機製作所	14,200	1,216	17,267,200	
本田技研工業	1,758,200	3,400	5,977,880,000	
スズキ	435,700	1,991	867,478,700	
富士重工業	659,000	690	454,710,000	
ヤマハ発動機	316,900	1,420	449,998,000	
ショーワ	44,400	585	25,974,000	
T B K	21,000	443	9,303,000	
エクセディ	25,200	2,631	66,301,200	
豊田合成	58,900	1,920	113,088,000	
愛三工業	25,300	776	19,632,800	
ヨロズ	12,600	1,496	18,849,600	
エフ・シー・シー	30,700	1,853	56,887,100	
シマノ	86,000	4,095	352,170,000	
タカタ	32,300	2,588	83,592,400	
テイ・エス テック	39,700	1,592	63,202,400	
日本電産トーソク	12,500	867	10,837,500	
テルモ	163,700	4,480	733,376,000	
クリエートメディック	6,300	853	5,373,900	
日機装	73,000	678	49,494,000	
島津製作所	249,000	652	162,348,000	
J M S	31,000	288	8,928,000	
クボテック	45	28,140	1,266,300	
モリテックス	4,500	461	2,074,500	
長野計器	13,700	774	10,603,800	
東京計器	72,000	124	8,928,000	
愛知時計電機	43,000	216	9,288,000	
東京精密	40,000	1,323	52,920,000	
ニコン	363,200	1,871	679,547,200	
トプコン	48,000	466	22,368,000	
オリンパス	245,800	2,371	582,791,800	
理研計器	16,800	733	12,314,400	
タムロン	20,100	1,702	34,210,200	
H O Y A	478,500	1,911	914,413,500	
ノーリツ鋼機	18,900	507	9,582,300	
エー・アンド・デイ	20,200	362	7,312,400	
日本電産コバル	16,300	1,387	22,608,100	
シチズンホールディングス	226,700	551	124,911,700	
リズム時計工業	103,000	137	14,111,000	
大研医器	2,300	880	2,024,000	
セイコーホールディングス	111,000	278	30,858,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ニプロ	41,300	1,634	67,484,200	
S R I スポーツ	139	91,500	12,718,500	
バンダイナムコホールディングス	242,700	889	215,760,300	
共立印刷	22,700	133	3,019,100	
フランスベッドホールディングス	146,000	111	16,206,000	
パイロットコーポレーション	197	149,700	29,490,900	

トッパン・フォームズ	45,500	841	38,265,500	
フジシールインターナショナル	21,400	1,931	41,323,400	
タカラトミー	63,400	672	42,604,800	
廣済堂	20,200	128	2,585,600	
タカノ	8,100	496	4,017,600	
プロネクサス	24,500	429	10,510,500	
ウッドワン	53,000	276	14,628,000	
大建工業	108,000	222	23,976,000	
凸版印刷	588,000	752	442,176,000	
大日本印刷	635,000	1,140	723,900,000	
図書印刷	38,000	145	5,510,000	
共同印刷	68,000	195	13,260,000	
日本写真印刷	37,900	2,075	78,642,500	
光村印刷	22,000	290	6,380,000	
宝印刷	9,300	682	6,342,600	
アシックス	194,000	1,082	209,908,000	
ツツミ	9,400	2,231	20,971,400	
ローランド	20,600	1,092	22,495,200	
小松ウオール工業	8,700	802	6,977,400	
ヤマハ	165,900	1,046	173,531,400	
河合楽器製作所	81,000	183	14,823,000	
クリナップ	30,400	588	17,875,200	
ピジョン	14,400	2,524	36,345,600	
パラマウントベッド	16,700	2,199	36,723,300	
キングジム	15,900	610	9,699,000	
リンテック	44,600	2,254	100,528,400	
イトーキ	47,000	222	10,434,000	
任天堂	119,200	22,630	2,697,496,000	
三菱鉛筆	17,700	1,364	24,142,800	
タカラスタンダード	105,000	541	56,805,000	
コクヨ	108,300	698	75,593,400	
ナカバヤシ	44,000	181	7,964,000	
グローブライド	101,000	107	10,807,000	
岡村製作所	81,000	508	41,148,000	
美津濃	105,000	417	43,785,000	
ユニヘアー	24,100	881	21,232,100	
東京電力	1,534,000	2,016	3,092,544,000	代用有価証券で 300,000株 担保差入
中部電力	641,900	2,012	1,291,502,800	
関西電力	850,400	2,039	1,733,965,600	
中国電力	288,100	1,708	492,074,800	
北陸電力	213,900	2,024	432,933,600	
東北電力	520,700	1,841	958,608,700	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
四国電力	211,200	2,445	516,384,000	
九州電力	460,300	1,873	862,141,900	
北海道電力	195,000	1,726	336,570,000	
沖縄電力	12,500	3,800	47,500,000	
電源開発	129,300	2,559	330,878,700	
東京瓦斯	2,605,000	360	937,800,000	
大阪瓦斯	2,095,000	313	655,735,000	
東邦瓦斯	537,000	412	221,244,000	
北海道瓦斯	41,000	250	10,250,000	
西部瓦斯	235,000	211	49,585,000	

静岡瓦斯	54,000	490	26,460,000	
東武鉄道	889,000	458	407,162,000	
相鉄ホールディングス	386,000	266	102,676,000	
東京急行電鉄	1,145,000	379	433,955,000	
京浜急行電鉄	535,000	713	381,455,000	
小田急電鉄	668,000	777	519,036,000	
京王電鉄	541,000	562	304,042,000	
京成電鉄	335,000	575	192,625,000	
富士急行	57,000	426	24,282,000	
新京成電鉄	27,000	346	9,342,000	
東日本旅客鉄道	362,400	5,350	1,938,840,000	
西日本旅客鉄道	1,941	313,500	608,503,500	
東海旅客鉄道	1,809	685,000	1,239,165,000	
アートコーポレーション	4,200	1,299	5,455,800	
西日本鉄道	270,000	345	93,150,000	
ハマキョウレックス	5,900	2,529	14,921,100	
サカイ引越センター	3,800	1,801	6,843,800	
近畿日本鉄道	1,882,000	259	487,438,000	
阪急阪神ホールディングス	1,399,000	384	537,216,000	
南海電気鉄道	434,000	331	143,654,000	
京阪電気鉄道	467,000	338	157,846,000	
名糖運輸	7,800	690	5,382,000	
名古屋鉄道	727,000	222	161,394,000	
日本通運	825,000	346	285,450,000	
ヤマトホールディングス	424,000	1,230	521,520,000	
山九	253,000	384	97,152,000	
丸運	11,200	222	2,486,400	
丸全昭和運輸	70,000	274	19,180,000	
センコー	83,000	274	22,742,000	
トナミホールディングス	43,000	165	7,095,000	
日本梱包運輸倉庫	62,000	981	60,822,000	
日本石油輸送	24,000	202	4,848,000	
福山通運	144,000	427	61,488,000	
セイノーホールディングス	161,000	571	91,931,000	
神奈川中央交通	24,000	422	10,128,000	
日立物流	36,200	1,268	45,901,600	
日本郵船	1,761,000	370	651,570,000	
商船三井	1,015,000	552	560,280,000	
川崎汽船	644,000	359	231,196,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
NSユナイテッド海運	75,000	202	15,150,000	
乾汽船	24,800	504	12,499,200	
明治海運	18,600	323	6,007,800	
飯野海運	100,600	374	37,624,400	
共栄タンカー	17,000	153	2,601,000	
第一中央汽船	136,000	201	27,336,000	
全日本空輸	2,778,000	302	838,956,000	
パスコ	27,000	234	6,318,000	
国際航業ホールディングス	26,000	196	5,096,000	
日新	79,000	227	17,933,000	
三菱倉庫	162,000	1,159	187,758,000	
三井倉庫	97,000	362	35,114,000	
住友倉庫	152,000	459	69,768,000	
澁澤倉庫	54,000	286	15,444,000	

東陽倉庫	33,000	192	6,336,000	
日本トランスシティ	43,000	304	13,072,000	
ケイヒン	38,000	100	3,800,000	
安田倉庫	17,700	516	9,133,200	
東洋埠頭	60,000	137	8,220,000	
宇徳	15,100	265	4,001,500	
上組	231,000	689	159,159,000	
サンリツ	5,400	617	3,331,800	
キムラユニティー	4,700	685	3,219,500	
キューソー流通システム	6,600	857	5,656,200	
郵船ロジスティクス	16,400	1,184	19,417,600	
近鉄エクスプレス	18,600	2,334	43,412,400	
東海運	11,200	206	2,307,200	
バンテック	96	117,300	11,260,800	
システナ	214	94,300	20,180,200	
新日鉄ソリューションズ	17,600	1,687	29,691,200	
コア	8,800	701	6,168,800	
ITホールディングス	68,200	1,026	69,973,200	
グリー	33,200	1,176	39,043,200	
コーエーテクモホールディングス	40,700	621	25,274,700	
三菱総合研究所	8,400	1,893	15,901,200	
ダウンゴ	103	208,300	21,454,900	
ベリサーブ	17	132,000	2,244,000	
マクロミル	20,400	1,019	20,787,600	
ティーガイア	167	149,200	24,916,400	
GMOペイメントゲートウェイ	48	229,000	10,992,000	
ザッパラス	113	127,300	14,384,900	
インターネットイニシアティブ	121	245,500	29,705,500	
ソネットエンタテインメント	116	260,200	30,183,200	
SRAホールディングス	11,700	935	10,939,500	
JBIホールディングス	23,500	334	7,849,000	
朝日ネット	17,000	335	5,695,000	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	4,500	2,174	9,783,000	
フェイス	707	9,430	6,667,010	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
野村総合研究所	116,500	1,863	217,039,500	
サイバネットシステム	199	22,950	4,567,050	
インテージ	6,500	1,793	11,654,500	
シンプレクス・ホールディングス	363	35,450	12,868,350	
クレスコ	7,400	577	4,269,800	
フジ・メディア・ホールディングス	2,142	130,300	279,102,600	
オービック	7,090	17,210	122,018,900	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	5,400	748	4,039,200	
ヤフー	15,050	31,300	471,065,000	
トレンドマイクロ	90,800	2,554	231,903,200	
日本オラクル	32,900	3,850	126,665,000	
アルファシステムズ	6,100	1,536	9,369,600	
フューチャーアーキテクト	268	38,100	10,210,800	
シーエーシー	13,700	629	8,617,300	
ソフトバンク・テクノロジー	5,000	662	3,310,000	
トーセ	5,000	557	2,785,000	
オービックビジネスコンサルタント	5,400	4,700	25,380,000	

日立ビジネスソリューション	7,400	789	5,838,600	
伊藤忠テクノソリューションズ	29,200	2,977	86,928,400	
アイティフォー	25,600	295	7,552,000	
東計電算	4,200	1,165	4,893,000	
エクスネット	23	136,000	3,128,000	
大塚商会	16,400	5,430	89,052,000	
サイボウズ	305	24,910	7,597,550	
アグレックス	5,600	838	4,692,800	
電通国際情報サービス	13,900	566	7,867,400	
ウェザーニューズ	5,100	1,777	9,062,700	
C I J	21,700	273	5,924,100	
ネットワンシステムズ	501	132,800	66,532,800	
アルゴグラフィックス	7,600	1,104	8,390,400	
エイベックス・グループ・ホールディングス	39,500	1,198	47,321,000	
日本ユニシス	57,900	642	37,171,800	
兼松エレクトロニクス	13,100	859	11,252,900	
東京放送ホールディングス	110,900	1,172	129,974,800	
日本テレビ放送網	18,050	13,210	238,440,500	
テレビ朝日	521	138,400	72,106,400	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,564	31,750	49,657,000	
テレビ東京ホールディングス	9,400	1,207	11,345,800	
アイ・ティー・シーネットワーク	17,300	494	8,546,200	
イー・アクセス	1,122	50,100	56,212,200	
N E C モバイルリング	7,600	2,380	18,088,000	
日本電信電話	772,500	3,780	2,920,050,000	
K D D I	3,192	473,000	1,509,816,000	
光通信	26,500	1,843	48,839,500	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	17,002	147,400	2,506,094,800	
G M O インターネット	58,500	448	26,208,000	
学研ホールディングス	90,000	183	16,470,000	
ゼンリン	29,800	925	27,565,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
昭文社	12,500	657	8,212,500	
角川グループホールディングス	19,500	2,141	41,749,500	
インプレスホールディングス	17,600	150	2,640,000	
アイネット	11,400	492	5,608,800	
松竹	126,000	589	74,214,000	
東宝	146,700	1,350	198,045,000	
東映	88,000	405	35,640,000	
葵プロモーション	9,500	464	4,408,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,452	280,000	406,560,000	
D T S	20,300	1,005	20,401,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	67,200	1,489	100,060,800	
シーイーシー	15,200	439	6,672,800	
カブコン	43,800	1,382	60,531,600	
ジャステック	13,300	501	6,663,300	
住商情報システム	21,600	1,351	29,181,600	
日本システムウエア	9,700	376	3,647,200	
アイネス	29,200	648	18,921,600	
T K C	16,000	1,664	26,624,000	
富士ソフト	28,300	1,423	40,270,900	
N S D	40,500	879	35,599,500	
コナミ	93,800	1,701	159,553,800	
福井コンピュータ	6,100	425	2,592,500	

J B C Cホールディングス	18,400	565	10,396,000	
ソフトバンク	910,600	2,752	2,505,971,200	
ハウスイ	17,000	110	1,870,000	
インターニックス	8,300	394	3,270,200	
高千穂交易	8,500	945	8,032,500	
伊藤忠食品	5,100	2,888	14,728,800	
エレマテック	16,400	1,210	19,844,000	
J A L U X	9,700	765	7,420,500	
トーメンデバイス	2,600	2,150	5,590,000	
双日	1,376,700	184	253,312,800	
アルフレッサ ホールディングス	53,800	3,420	183,996,000	
横浜冷凍	44,300	577	25,561,100	
神栄	26,000	157	4,082,000	
山下医科器械	1,500	1,126	1,689,000	
ラサ商事	17,400	375	6,525,000	
あい ホールディングス	44,300	320	14,176,000	
ダイワボウホールディングス	190,000	221	41,990,000	
パイタルケーエスケー・ホールディングス	38,600	654	25,244,400	
U K Cホールディングス	12,200	1,038	12,663,600	
日本コークス工業	183,000	170	31,110,000	
ミタチ産業	4,800	459	2,203,200	
J F E 商事ホールディングス	146,000	401	58,546,000	
シップヘルスケアホールディングス	26,700	972	25,952,400	
協栄産業	23,000	178	4,094,000	
小野建	18,300	732	13,395,600	
佐鳥電機	13,900	612	8,506,800	
エコートレーディング	5,100	829	4,227,900	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
伯東	12,500	846	10,575,000	
中山福	13,000	605	7,865,000	
ナガイレーベン	11,200	2,164	24,236,800	
菱食	20,000	1,805	36,100,000	
松田産業	17,000	1,418	24,106,000	
メディバルホールディングス	189,900	892	169,390,800	
アドヴァン	20,100	648	13,024,800	
S P K	4,500	1,229	5,530,500	
アズワン	13,800	1,742	24,039,600	
スズデン	7,600	525	3,990,000	
尾家産業	6,700	869	5,822,300	
シモジマ	14,100	1,052	14,833,200	
ドウシシャ	11,200	1,880	21,056,000	
高速	12,200	750	9,150,000	
黒田電気	27,500	1,170	32,175,000	
丸文	16,300	480	7,824,000	
ハビネット	5,400	1,115	6,021,000	
トーメンエレクトロニクス	8,400	1,345	11,298,000	
エクセル	10,000	1,088	10,880,000	
マルカキカイ	7,500	630	4,725,000	
ガリバーインターナショナル	5,560	3,600	20,016,000	
日本エム・ディ・エム	17,100	205	3,505,500	
進和	11,700	1,006	11,770,200	
エスケイジャパン	7,300	279	2,036,700	
ダイトエレクトロン	8,700	633	5,507,100	
シークス	13,000	989	12,857,000	

田中商事	22,100	325	7,182,500	
オーハシテクニカ	11,600	625	7,250,000	
マクニカ	9,400	2,166	20,360,400	
白銅	7,000	930	6,510,000	
伊藤忠商事	1,435,800	881	1,264,939,800	
丸紅	1,799,000	610	1,097,390,000	
高島	72,000	137	9,864,000	
F & A アクアホールディングス	16,400	859	14,087,600	
長瀬産業	116,000	1,091	126,556,000	
蝶理	141,000	109	15,369,000	
豊田通商	229,100	1,486	340,442,600	
三共生興	35,600	307	10,929,200	
ツカモトコーポレーション	39,000	92	3,588,000	
三井物産	1,775,400	1,398	2,482,009,200	
日本紙パルプ商事	117,000	304	35,568,000	
日立ハイテクノロジーズ	62,400	2,039	127,233,600	
カメイ	27,000	409	11,043,000	
東都水産	35,000	148	5,180,000	
スターゼン	69,000	247	17,043,000	
山善	85,500	448	38,304,000	
椿本興業	23,000	233	5,359,000	
住友商事	1,133,000	1,206	1,366,398,000	
内田洋行	44,000	291	12,804,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
三菱商事	1,647,100	2,317	3,816,330,700	
第一実業	53,000	335	17,755,000	
キヤノンマーケティングジャパン	68,400	1,193	81,601,200	
西華産業	80,000	210	16,800,000	
佐藤商事	19,000	535	10,165,000	
菱洋エレクトロ	27,000	975	26,325,000	
東京産業	20,500	269	5,514,500	
神鋼商事	66,000	199	13,134,000	
阪和興業	199,000	383	76,217,000	
カナデン	26,000	515	13,390,000	
菱電商事	38,000	567	21,546,000	
フルサト工業	13,100	519	6,798,900	
岩谷産業	239,000	258	61,662,000	
すてきなイスグループ	106,000	184	19,504,000	
昭光通商	94,000	133	12,502,000	
ニチモウ	47,000	186	8,742,000	
極東貿易	44,000	161	7,084,000	
イワキ	22,000	212	4,664,000	
三愛石油	52,000	410	21,320,000	
稲畑産業	60,700	533	32,353,100	
G S I クレオス	56,000	127	7,112,000	
明和産業	27,600	287	7,921,200	
東邦ホールディングス	62,700	1,117	70,035,900	
サンゲツ	36,400	1,929	70,215,600	
ミツウロコ	35,300	509	17,967,700	
シナネン	47,000	381	17,907,000	
伊藤忠エネクス	45,400	453	20,566,200	
ザ・トーカイ	49,000	334	16,366,000	
サンリオ	58,000	1,960	113,680,000	
サンワテクノス	10,000	681	6,810,000	

リョーサン	33,500	2,251	75,408,500	
新光商事	19,300	711	13,722,300	
トーホー	43,000	315	13,545,000	
三信電気	25,500	712	18,156,000	
東陽テクニカ	27,800	883	24,547,400	
モスフードサービス	27,100	1,543	41,815,300	
加賀電子	20,400	1,095	22,338,000	
ソーダニッカ	23,000	370	8,510,000	
立花エレテック	13,200	725	9,570,000	
P a l t a c	12,600	1,517	19,114,200	
ヤマタネ	104,000	119	12,376,000	
丸紅建材リース	25,000	98	2,450,000	
日鐵商事	47,000	262	12,314,000	
トラスコ中山	27,700	1,381	38,253,700	
オートバックスセブン	26,700	3,315	88,510,500	
加藤産業	29,700	1,331	39,530,700	
イエローハット	19,700	897	17,670,900	
富士エレクトロニクス	11,600	1,591	18,455,600	
J Kホールディングス	31,100	390	12,129,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日伝	8,600	2,377	20,442,200	
北沢産業	45,500	179	8,144,500	
杉本商事	11,800	755	8,909,000	
因幡電機産業	24,200	2,371	57,378,200	
住金物産	110,000	197	21,670,000	
ミスミグループ本社	69,500	2,099	145,880,500	
江守商事	4,800	852	4,089,600	
アルテック	10,500	305	3,202,500	
タキヒヨー	32,000	424	13,568,000	
スズケン	85,100	2,444	207,984,400	
ジェコス	29,700	317	9,414,900	
ローソン	71,400	4,030	287,742,000	
サンエー	7,000	3,300	23,100,000	
キリン堂	9,300	421	3,915,300	
ダイユーエイト	3,200	560	1,792,000	
カワチ薬品	14,400	1,724	24,825,600	
エービーシー・マート	24,400	3,050	74,420,000	
ハードオフコーポレーション	10,500	443	4,651,500	
アスクル	15,000	1,628	24,420,000	
ゲオ	343	96,500	33,099,500	
ポイント	17,370	3,895	67,656,150	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	15,000	120	1,800,000	
くらコーポレーション	10,900	1,268	13,821,200	
キャンドゥ	86	71,400	6,140,400	
パル	6,050	3,155	19,087,750	
エディオン	75,500	742	56,021,000	
サーラコーポレーション	19,500	464	9,048,000	
パルス	98	81,100	7,947,800	
あみやき亭	36	278,900	10,040,400	
ひらまつ	41	105,000	4,305,000	
ハニーズ	18,280	1,070	19,559,600	
アルペン	15,900	1,437	22,848,300	
ビックカメラ	509	33,700	17,153,300	
D C Mホールディングス	98,600	477	47,032,200	



MonotaRO	4,500	810	3,645,000	
ユニバース	3,200	1,221	3,907,200	
J・フロントリテイリング	486,000	430	208,980,000	
ドトール・日レスホールディングス	36,200	1,090	39,458,000	
マツモトキヨシホールディングス	38,100	1,745	66,484,500	
ココカラファイン	19,900	1,747	34,765,300	
三越伊勢丹ホールディングス	408,600	934	381,632,400	
クリエイトSDホールディングス	7,300	1,880	13,724,000	
CHIグループ	12,500	294	3,675,000	
ブックオフコーポレーション	12,900	676	8,720,400	
あさひ	8,700	1,228	10,683,600	
サークルKサンクス	44,800	1,334	59,763,200	
日本調剤	2,830	3,385	9,579,550	
コスモス薬品	9,100	3,120	28,392,000	
セブン&アイ・ホールディングス	860,400	2,157	1,855,882,800	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ツルハホールディングス	15,400	3,855	59,367,000	
サンマルクホールディングス	6,700	3,540	23,718,000	
フェリシモ	6,100	1,040	6,344,000	
トリドール	78	121,300	9,461,400	
メディカルシステムネットワーク	4,000	667	2,668,000	
総合メディカル	4,600	2,391	10,998,600	
はるやま商事	10,100	424	4,282,400	
カッパ・クリエイト	15,200	1,997	30,354,400	
ライトオン	15,800	437	6,904,600	
ジーンズメイト	7,200	280	2,016,000	
良品計画	23,600	3,720	87,792,000	
三城ホールディングス	25,700	854	21,947,800	
コナカ	24,800	368	9,126,400	
ハウスオブローゼ	2,200	1,251	2,752,200	
G-7ホールディングス	5,600	540	3,024,000	
イオン北海道	15,700	311	4,882,700	
コジマ	25,600	499	12,774,400	
コーナン商事	20,300	1,164	23,629,200	
エコス	7,400	458	3,389,200	
ワタミ	24,400	1,667	40,674,800	
マルシェ	5,700	701	3,995,700	
ドン・キホーテ	33,600	2,561	86,049,600	
メガネトップ	21,800	828	18,050,400	
西松屋チェーン	45,300	759	34,382,700	
ゼンショー	78,600	838	65,866,800	
幸楽苑	12,800	1,248	15,974,400	
ハークスレイ	6,200	514	3,186,800	
サイゼリヤ	27,200	1,689	45,940,800	
ポブラ	6,200	482	2,988,400	
ユナイテッドアローズ	19,600	1,238	24,264,800	
ハイデイ日高	9,200	1,381	12,705,200	
京都きもの友禅	13,400	931	12,475,400	
コロワイド	68,500	473	32,400,500	
壱番屋	7,300	2,365	17,264,500	
トップカルチャー	8,000	366	2,928,000	
スギホールディングス	32,900	1,988	65,405,200	
スクロール	29,500	358	10,561,000	
ファミリーマート	69,500	3,055	212,322,500	

木曽路	23,600	1,707	40,285,200	
千趣会	37,400	499	18,662,600	
タカキュー	17,500	162	2,835,000	
ケーヨー	39,000	431	16,809,000	
上新電機	45,000	805	36,225,000	
日本瓦斯	19,600	1,189	23,304,400	
マルエツ	42,000	323	13,566,000	
ロイヤルホールディングス	31,900	849	27,083,100	
東天紅	17,000	142	2,414,000	
いなげや	23,000	885	20,355,000	
島忠	39,900	1,903	75,929,700	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
チヨダ	27,100	1,160	31,436,000	
鈴丹	6,400	168	1,075,200	
ライフコーポレーション	13,100	1,262	16,532,200	
カスミ	42,500	462	19,635,000	
リンガーハット	15,900	1,095	17,410,500	
さが美	18,000	122	2,196,000	
MrMax	21,300	294	6,262,200	
テンアライド	14,600	294	4,292,400	
AOKIホールディングス	19,200	1,354	25,996,800	
オークワ	29,000	894	25,926,000	
コメリ	28,300	1,922	54,392,600	
青山商事	52,300	1,445	75,573,500	
しまむら	21,500	7,500	161,250,000	
CFSCORPORATION	20,500	453	9,286,500	
高島屋	278,000	682	189,596,000	
松屋	38,300	649	24,856,700	
エイチ・ツー・オー リテイリング	121,000	590	71,390,000	
丸栄	35,000	106	3,710,000	
ニッセンホールディングス	41,600	417	17,347,200	
パルコ	53,600	786	42,129,600	
丸井グループ	268,100	720	193,032,000	
原信ナルスホールディングス	12,400	1,240	15,376,000	
ダイエー	95,750	294	28,150,500	
イズミヤ	72,000	339	24,408,000	
イオン	725,100	1,057	766,430,700	
ユニー	167,000	813	135,771,000	
イズミ	56,500	1,250	70,625,000	
東武ストア	28,000	262	7,336,000	
平和堂	41,800	1,100	45,980,000	
フジ	24,600	1,739	42,779,400	
ヤオコー	9,100	2,496	22,713,600	
ゼビオ	24,900	1,897	47,235,300	
ケーズホールディングス	47,400	2,308	109,399,200	
Olympic	13,900	627	8,715,300	
東日カーライフグループ	31,000	96	2,976,000	
アインファーマシーズ	6,800	3,125	21,250,000	
元氣寿司	6,600	974	6,428,400	
ヤマダ電機	93,810	5,430	509,388,300	
アークランドサカモト	12,300	986	12,127,800	
ニトリホールディングス	40,750	7,070	288,102,500	
グルメ杵屋	15,000	478	7,170,000	
愛眼	16,900	477	8,061,300	

吉野家ホールディングス	559	108,000	60,372,000	
松屋フーズ	10,000	1,412	14,120,000	
サガミチェーン	25,000	462	11,550,000	
プレナス	26,000	1,341	34,866,000	
ミニストップ	15,300	1,462	22,368,600	
イマージュホールディングス	9,300	313	2,910,900	
アークス	26,500	1,301	34,476,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
パロー	41,200	711	29,293,200	
ベルク	10,300	994	10,238,200	
大庄	11,200	1,134	12,700,800	
ファーストリテイリング	48,000	12,270	588,960,000	
サンドラッグ	39,100	2,428	94,934,800	
ヤマザワ	5,500	1,171	6,440,500	
やまや	3,500	760	2,660,000	
ベルーナ	26,150	485	12,682,750	
新生銀行	1,067,000	96	102,432,000	
あおぞら銀行	747,000	174	129,978,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	15,566,600	441	6,864,870,600	
りそなホールディングス	629,000	467	293,743,000	
中央三井トラスト・ホールディングス	1,180,000	344	405,920,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,555,500	2,893	4,500,061,500	
第四銀行	269,000	277	74,513,000	
北越銀行	230,000	169	38,870,000	
西日本シティ銀行	722,000	252	181,944,000	
札幌北洋ホールディングス	310,100	406	125,900,600	
千葉銀行	811,000	524	424,964,000	
横浜銀行	1,409,000	427	601,643,000	
常陽銀行	798,000	371	296,058,000	
群馬銀行	480,000	475	228,000,000	
武蔵野銀行	33,400	2,505	83,667,000	
千葉興業銀行	39,400	511	20,133,400	
筑波銀行	90,800	291	26,422,800	
東京都民銀行	38,900	1,168	45,435,200	
七十七銀行	347,000	440	152,680,000	
青森銀行	164,000	234	38,376,000	
秋田銀行	141,000	249	35,109,000	
山形銀行	125,000	393	49,125,000	
岩手銀行	13,900	3,960	55,044,000	
東邦銀行	174,000	260	45,240,000	
東北銀行	111,000	137	15,207,000	
みちのく銀行	103,000	167	17,201,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	835,000	355	296,425,000	
静岡銀行	639,000	762	486,918,000	
十六銀行	252,000	274	69,048,000	
スルガ銀行	217,000	790	171,430,000	
八十二銀行	387,000	474	183,438,000	
山梨中央銀行	126,000	418	52,668,000	
大垣共立銀行	274,000	277	75,898,000	
福井銀行	177,000	256	45,312,000	
北國銀行	235,000	280	65,800,000	
清水銀行	7,000	3,675	25,725,000	
滋賀銀行	193,000	470	90,710,000	
南都銀行	191,000	439	83,849,000	

百五銀行	186,000	369	68,634,000	
京都銀行	368,000	784	288,512,000	
三重銀行	92,000	234	21,528,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,441,000	169	243,529,000	
広島銀行	607,000	358	217,306,000	
山陰合同銀行	124,000	625	77,500,000	
中国銀行	168,000	1,015	170,520,000	
鳥取銀行	65,000	180	11,700,000	
伊予銀行	220,000	678	149,160,000	
百十四銀行	241,000	309	74,469,000	
四国銀行	148,000	266	39,368,000	
阿波銀行	171,000	500	85,500,000	
鹿児島銀行	133,000	554	73,682,000	
大分銀行	133,000	308	40,964,000	
宮崎銀行	137,000	227	31,099,000	
肥後銀行	162,000	429	69,498,000	
佐賀銀行	125,000	240	30,000,000	
十八銀行	132,000	245	32,340,000	
沖縄銀行	15,600	3,335	52,026,000	
琉球銀行	43,200	1,000	43,200,000	
住友信託銀行	1,843,000	520	958,360,000	
みずほ信託銀行	1,951,000	84	163,884,000	
八千代銀行	10,800	2,689	29,041,200	
みずほフィナンシャルグループ	25,110,400	164	4,118,105,600	
紀陽ホールディングス	815,000	116	94,540,000	
山口フィナンシャルグループ	205,000	827	169,535,000	
長野銀行	72,000	170	12,240,000	
名古屋銀行	186,000	266	49,476,000	
愛知銀行	6,900	5,170	35,673,000	
第三銀行	125,000	220	27,500,000	
中京銀行	84,000	215	18,060,000	
東日本銀行	108,000	196	21,168,000	
愛媛銀行	129,000	231	29,799,000	
トマト銀行	79,000	158	12,482,000	
みなと銀行	213,000	153	32,589,000	
京葉銀行	169,000	420	70,980,000	
関西アーバン銀行	287,000	134	38,458,000	
栃木銀行	103,000	403	41,509,000	
北日本銀行	6,400	2,079	13,305,600	
東和銀行	221,000	88	19,448,000	
福島銀行	253,000	53	13,409,000	
大東銀行	131,000	65	8,515,000	
トモニホールディングス	158,300	354	56,038,200	
フィデアホールディングス	118,400	231	27,350,400	
池田泉州ホールディングス	578,600	125	72,325,000	
SBIホールディングス	24,516	11,920	292,230,720	
ジャフコ	28,100	2,435	68,423,500	
大和証券グループ本社	2,038,000	418	851,884,000	
野村ホールディングス	4,331,900	514	2,226,596,600	
みずほ証券	526,000	227	119,402,000	
みずほインベスターズ証券	480,000	86	41,280,000	
岡三証券グループ	175,000	335	58,625,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
丸三証券	65,900	472	31,104,800	
東洋証券	78,000	140	10,920,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	236,000	292	68,912,000	
光世証券	50,000	85	4,250,000	
水戸証券	56,000	131	7,336,000	
いちよし証券	46,200	628	29,013,600	
松井証券	122,000	535	65,270,000	
だいこう証券ビジネス	11,900	316	3,760,400	
マネックスグループ	1,220	22,500	27,450,000	
カブドットコム証券	88,700	339	30,069,300	
極東証券	27,700	692	19,168,400	
岩井コスモホールディングス	19,600	573	11,230,800	
N K S Jホールディングス	1,726,000	572	987,272,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	616,300	2,002	1,233,832,600	
ソニーフィナンシャルホールディングス	996	311,500	310,254,000	
第一生命保険	8,276	130,300	1,078,362,800	
東京海上ホールディングス	782,300	2,488	1,946,362,400	
T & Dホールディングス	376,450	2,134	803,344,300	
クレディセゾン	156,000	1,412	220,272,000	
セディナ	221,600	151	33,461,600	
芙蓉総合リース	20,300	2,918	59,235,400	
興銀リース	29,500	2,087	61,566,500	
東京センチュリーリース	49,600	1,442	71,523,200	
日本証券金融	87,800	611	53,645,800	
大阪証券金融	33,300	168	5,594,400	
ポケットカード	26,400	297	7,840,800	
リコーリース	14,900	2,374	35,372,600	
イオンクレジットサービス	91,400	1,170	106,938,000	
アコム	41,320	1,472	60,823,040	
プロミス	108,750	652	70,905,000	
ジャックス	144,000	257	37,008,000	
日立キャピタル	49,900	1,328	66,267,200	
オリックス	107,000	8,100	866,700,000	
三菱UFJリース	52,170	3,435	179,203,950	
アサックス	44	93,100	4,096,400	
N E Cキャピタルソリューション	7,000	1,380	9,660,000	
昭栄	41,300	749	30,933,700	
東京建物不動産販売	15,900	318	5,056,200	
野村不動産ホールディングス	96,900	1,572	152,326,800	
ヒューリック	62,600	696	43,569,600	
パーク24	96,400	885	85,314,000	
三井不動産	970,000	1,742	1,689,740,000	
三菱地所	1,440,000	1,619	2,331,360,000	
平和不動産	166,000	264	43,824,000	
東京建物	462,000	387	178,794,000	
ダイビル	64,700	756	48,913,200	
サンケイビル	45,700	546	24,952,200	
東急不動産	453,000	433	196,149,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
京阪神不動産	31,800	411	13,069,800	

住友不動産	493,000	2,119	1,044,667,000	
東宝不動産	26,700	664	17,728,800	
大京	363,000	172	62,436,000	
テーオーシー	88,200	351	30,958,200	
東京楽天地	42,000	312	13,104,000	
フジ住宅	28,300	450	12,735,000	
空港施設	29,300	366	10,723,800	
明和地所	16,500	602	9,933,000	
住友不動産販売	8,100	4,360	35,316,000	
ゴールドクレスト	19,870	2,220	44,111,400	
東栄住宅	17,800	1,315	23,407,000	
日本エスリード	12,400	879	10,899,600	
東急リバブル	24,700	1,083	26,750,100	
飯田産業	18,900	919	17,369,100	
日神不動産	16,600	656	10,889,600	
アーネストワン	41,000	1,029	42,189,000	
タカラレーベン	23,500	660	15,510,000	
サンヨーハウジング名古屋	121	85,000	10,285,000	
イオンモール	100,900	2,235	225,511,500	
タクトホーム	124	99,900	12,387,600	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,686	86,500	145,839,000	
日本空港ビルデング	67,900	1,297	88,066,300	
日本工営	76,000	261	19,836,000	
ネクスト	56	100,200	5,611,200	
日本M&Aセンター	50	351,000	17,550,000	
アコーディア・ゴルフ	623	66,500	41,429,500	
パソナグループ	200	70,000	14,000,000	
リンクアンドモチベーション	56	52,000	2,912,000	
テンブホールディングス	30,600	757	23,164,200	
学情	8,900	306	2,723,400	
スタジオアリス	9,900	818	8,098,200	
シミック	430	23,310	10,023,300	
NECフィールディング	18,400	1,019	18,749,600	
総合警備保障	79,200	1,012	80,150,400	
カカクコム	150	468,000	70,200,000	
ルネサンス	12,200	298	3,635,600	
新日本科学	14,900	402	5,989,800	
エムスリー	85	418,500	35,572,500	
ディー・エヌ・エー	84,900	2,778	235,852,200	
博報堂DYホールディングス	30,170	4,735	142,854,950	
ぐるなび	120	116,300	13,956,000	
一休	157	37,950	5,958,150	
ジャパンベストレスキューシステム	39	68,600	2,675,400	
ジェイコムホールディングス	25	116,800	2,920,000	
PGMホールディングス	473	52,200	24,690,600	
イーピーエス	121	195,800	23,691,800	
アミューズ	6,900	967	6,672,300	
ドリームインキュベータ	91	64,100	5,833,100	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
TAC	14,200	343	4,870,600	
電通	198,000	2,516	498,168,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,197	8,200	9,815,400	
イオンファンタジー	7,900	1,178	9,306,200	
みらかホールディングス	53,000	3,140	166,420,000	

アルプス技研	10,300	665	6,849,500	
ダイオーズ	5,000	480	2,400,000	
日本空調サービス	6,100	742	4,526,200	
オリエンタルランド	58,800	7,630	448,644,000	
ダスキン	61,100	1,528	93,360,800	
明光ネットワークジャパン	17,200	692	11,902,400	
ファルコSDホールディングス	11,800	792	9,345,600	
秀英予備校	5,500	376	2,068,000	
田谷	4,400	673	2,961,200	
ラウンドワン	57,100	465	26,551,500	
リゾートトラスト	35,500	1,424	50,552,000	
ビー・エム・エル	13,100	2,233	29,252,300	
ワタベウェディング	7,300	925	6,752,500	
もしもしホットライン	13,850	1,980	27,423,000	
東急コミュニティー	5,900	2,508	14,797,200	
リソー教育	2,385	4,765	11,364,525	
ウェアハウス	7,400	300	2,220,000	
ユー・エス・エス	28,380	6,650	188,727,000	
東京個別指導学院	18,300	240	4,392,000	
カルチュア・コンビニエンス・クラブ	114,800	459	52,693,200	
テー・オー・ダブリュー	6,500	490	3,185,000	
セントラルスポーツ	7,600	912	6,931,200	
リゾートソリューション	23,000	161	3,703,000	
エイチ・アイ・エス	22,600	2,121	47,934,600	
共立メンテナンス	10,400	1,405	14,612,000	
イチネンホールディングス	24,500	459	11,245,500	
建設技術研究所	14,100	486	6,852,600	
燦ホールディングス	4,900	1,338	6,556,200	
スバル興業	24,000	257	6,168,000	
東京テアトル	107,000	125	13,375,000	
ホリプロ	8,500	739	6,281,500	
よみうりランド	52,000	288	14,976,000	
東京都競馬	155,000	127	19,685,000	
カナモト	28,000	414	11,592,000	
東京ドーム	165,000	214	35,310,000	
トランス・コスモス	29,400	804	23,637,600	
乃村工藝社	45,000	301	13,545,000	
藤田観光	57,000	377	21,489,000	
日本管財	8,500	1,390	11,815,000	
白洋舎	26,000	225	5,850,000	
セコム	226,400	3,915	886,356,000	
セントラル警備保障	10,400	885	9,204,000	
丹青社	41,000	445	18,245,000	
メイテック	32,200	1,696	54,611,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
アサツー ディ・ケイ	35,100	2,259	79,290,900	
応用地質	20,800	717	14,913,600	
船井総合研究所	23,600	535	12,626,000	
進学会	14,200	318	4,515,600	
ベネッセホールディングス	68,800	3,695	254,216,000	
イオンディライト	25,000	1,522	38,050,000	
ナック	7,500	1,141	8,557,500	
ニチイ学館	38,900	715	27,813,500	
ダイセキ	32,500	1,587	51,577,500	

合計	307,427,467		254,920,676,635	
----	-------------	--	-----------------	--

(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

該当事項はありません。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引関係)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。



## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】平成23年2月28日

資産総額	267,455,400 円
負債総額	827,910 円
純資産総額（ - ）	266,627,490 円
発行済口数	254,401,746 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0481 円
1万口当たり純資産額	10,481 円

## &lt;参考&gt;

マザーファンドの現況（平成23年2月28日）

純資産額計算書

（中央三井日本株式マザーファンド）

資産総額	262,395,585,618 円
負債総額	409,539,955 円
純資産総額（ - ）	261,986,045,663 円
発行済口数	310,822,438,326 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8429 円
1万口当たり純資産額	8,429 円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### （1）投資信託受益証券の名義書換等

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

### （2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

### （3）譲渡制限

該当事項はありません。

### （4）振替受益権に関する記載

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

#### 受益証券の不発行

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

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

#### 受益権の譲渡

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

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

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、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。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

本書提出日現在の資本金の額：3億円

会社の発行可能株式総数：16,000株

発行済株式総数：5,050株

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

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

##### (2) 委託会社の機構

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

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

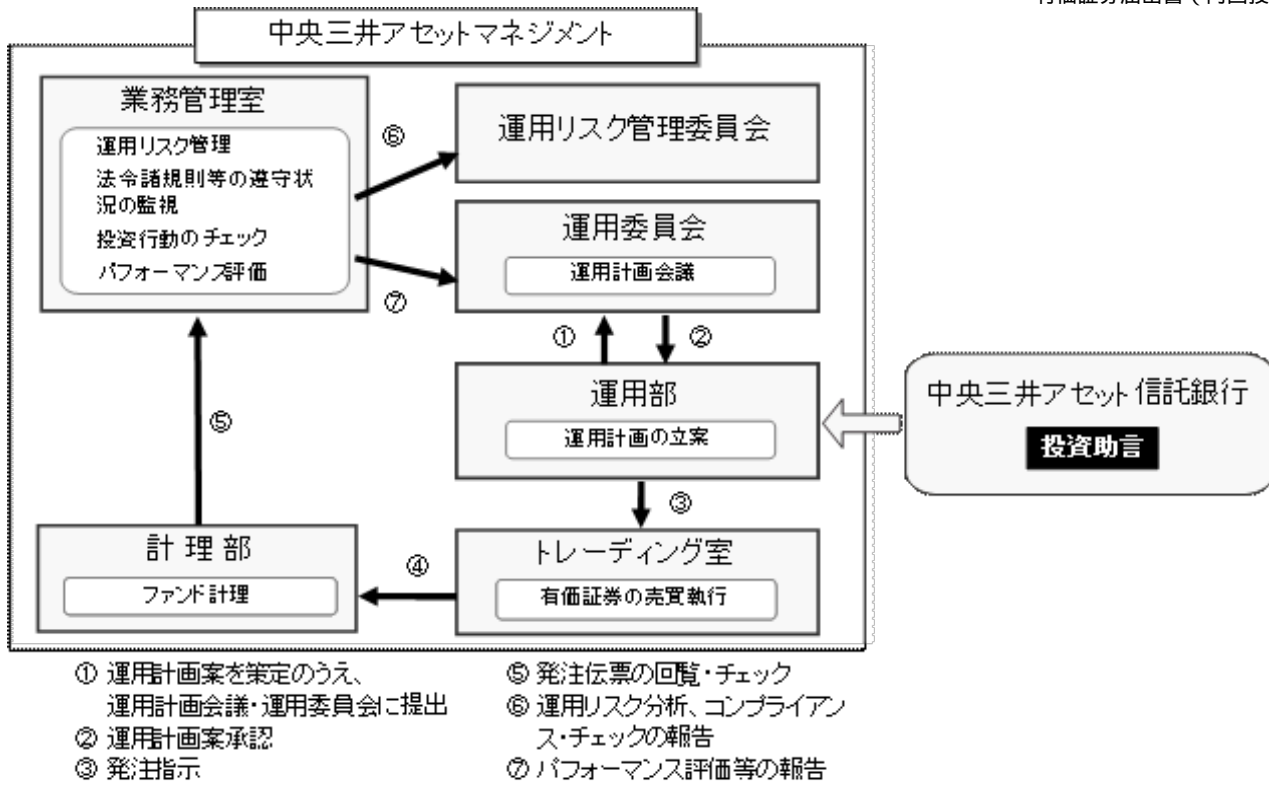
取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

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

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

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

なお、委託会社の意思決定機構は以下のとおりです。



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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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

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

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和52年大蔵省令第38号）」（以下「中間財務諸表等規則」といいます。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び業府令に基づいて作成しております。

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

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

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

## ( 1 ) 【貸借対照表】

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

科目	第23期 平成21年3月31日		第24期 平成22年3月31日		
	金額（千円）	構成比 （％）	金額（千円）	構成比 （％）	
（負債の部）					
流動負債					
1．預り金		3,008		3,792	
2．未払金					
（1）未払手数料	316,013		327,341		
（2）その他未払金	71,990	388,004	56,890	384,231	
3．未払費用		246,794		279,266	
4．未払法人税等		103,823		114,387	
5．賞与引当金		45,488		46,407	
流動負債計		787,118	26.5	828,085	24.8
固定負債					
1．退職給付引当金		16,535		22,905	
2．役員退職慰労引当金		22,100		31,800	
固定負債計		38,635	1.3	54,705	1.6
負債合計		825,754	27.8	882,791	26.4
（純資産の部）					
株主資本					
1．資本金		300,000	10.1	300,000	9.0
2．資本剰余金					
（1）資本準備金		50,000		50,000	
資本剰余金計		50,000	1.7	50,000	1.5
3．利益剰余金					
（1）利益準備金		25,401		25,401	
（2）その他利益剰余金					
繰越利益剰余金		1,771,709		2,086,808	
利益剰余金計		1,797,110	60.4	2,112,210	63.1
株主資本計		2,147,110	72.2	2,462,210	73.6
評価・換算差額等					
1．その他有価証券評価差額金		-		103	
評価・換算差額等計		-	-	103	0.0
純資産合計		2,147,110	72.2	2,462,107	73.6
負債・純資産合計		2,972,864	100.0	3,344,898	100.0



## ( 2 ) 【損益計算書】

科目	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)		第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)	
	金額(千円)	百分比 (%)	金額(千円)	百分比 (%)
営業収益				
1. 委託者報酬		11,250,556		9,668,856
2. その他営業収益				
(1) 投資顧問料	7,937	7,937		-
営業収益 計		11,258,493	100.0	9,668,856
100.0				100.0
営業費用				
1. 支払手数料		4,424,596		3,855,512
2. 広告宣伝費		305,210		89,996
3. 受益証券発行費		250		-
4. 調査費				
(1) 調査費	229,875		234,896	
(2) 委託調査費	3,355,436	3,585,312	2,921,144	3,156,040
5. 営業雑経費				
(1) 通信費	15,143		14,562	
(2) 印刷費	284,199		192,040	
(3) 協会費	13,436		11,699	
(4) 諸会費	317	313,096	389	218,692
営業費用 計		8,628,465	76.6	7,320,241
76.6				75.7
一般管理費				
1. 給料				
(1) 役員報酬	50,723		57,119	
(2) 給料・手当	561,245		609,618	
(3) 賞与	130,680	742,649	132,613	799,351
2. 福利厚生費		191,032		211,448
3. 交際費		2,300		1,056
4. 寄付金		300		-
5. 旅費交通費		27,150		20,394
6. 租税公課		11,916		11,448
7. 不動産賃借料		109,171		112,953
8. 退職給付費用		6,212		6,497
9. 役員退職慰労引当金繰入		16,350		12,900
10. 賞与引当金繰入		45,488		46,407
11. 減価償却費		61,317		56,560
12. 諸経費		507,792		520,606
一般管理費 計		1,721,681	15.3	1,799,626
15.3				18.6
営業利益		908,346	8.1	548,988
				5.7

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

## （ 3 ） 【 株主資本等変動計算書 】

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

## 重要な会計方針

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

## 注記事項

## 1. 貸借対照表関係

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

## 2. 損益計算書関係

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

## 3. 株主資本等変動計算書関係

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

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

## 4．リース取引関係

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

## 5．金融商品関係

第24期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）

## 1．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

## 2．金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

## （注1）金融商品の時価の算定方法

## (1) 現金・預金

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

## (2) 未収委託者報酬及び(4) 未払金

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

## (3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	65,000

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

（追加情報）

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

## 6. 有価証券関係

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

## 7. デリバティブ関係

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

## 8. 退職給付関係

第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)	第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)																
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成21年3月31日現在）</p> <table 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>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">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>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;">6,212千円</td> </tr> </table> <p>(注) 退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	16,535千円	退職給付引当金	16,535千円	勤務費用	6,212千円	退職給付費用	6,212千円	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 同左</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成22年3月31日現在）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">22,905千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">22,905千円</td> </tr> </table> <p>(注) 退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 (平成21年4月1日から平成22年3月31日まで)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">6,497千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;">6,497千円</td> </tr> </table> <p>(注) 退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	22,905千円	退職給付引当金	22,905千円	勤務費用	6,497千円	退職給付費用	6,497千円
退職給付債務	16,535千円																
退職給付引当金	16,535千円																
勤務費用	6,212千円																
退職給付費用	6,212千円																
退職給付債務	22,905千円																
退職給付引当金	22,905千円																
勤務費用	6,497千円																
退職給付費用	6,497千円																

## 9. 税効果会計関係

第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)	第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)																																
<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <table 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>繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right;">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>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right;">29,168千円</td> </tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、記載を省略しております。</p>	繰延税金資産		貸倒引当金繰入超過額	17,247千円	賞与引当金繰入超過額	18,509千円	未払事業税	8,540千円	その他	18,609千円	繰延税金資産小計	62,906千円	評価性引当額	33,738千円	繰延税金資産合計	29,168千円	<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <table 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;">16,271千円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">18,883千円</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">9,168千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">25,501千円</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right;">69,823千円</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td style="text-align: right;">39,576千円</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right;">30,247千円</td> </tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳 同左</p>	繰延税金資産		貸倒引当金繰入超過額	16,271千円	賞与引当金繰入超過額	18,883千円	未払事業税	9,168千円	その他	25,501千円	繰延税金資産小計	69,823千円	評価性引当額	39,576千円	繰延税金資産合計	30,247千円
繰延税金資産																																	
貸倒引当金繰入超過額	17,247千円																																
賞与引当金繰入超過額	18,509千円																																
未払事業税	8,540千円																																
その他	18,609千円																																
繰延税金資産小計	62,906千円																																
評価性引当額	33,738千円																																
繰延税金資産合計	29,168千円																																
繰延税金資産																																	
貸倒引当金繰入超過額	16,271千円																																
賞与引当金繰入超過額	18,883千円																																
未払事業税	9,168千円																																
その他	25,501千円																																
繰延税金資産小計	69,823千円																																
評価性引当額	39,576千円																																
繰延税金資産合計	30,247千円																																



## 10. 関連当事者との取引関係

第23期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）

（追加情報）

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

これによる開示対象範囲の変更はありません。

## 1. 関連当事者との取引

## 当社と同一の親会社を持つ会社等

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

第24期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）

## 1. 関連当事者との取引

## 当社と同一の親会社を持つ会社等

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

## 11. 1株当たり情報

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

1株当たり当期純損益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

## 12. 重要な後発事象

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

[次へ](#)

## (4) 中間貸借対照表

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

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

## ( 5 ) 中間損益計算書

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

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

## ( 6 ) 中間株主資本等変動計算書

第25期中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）

（単位：千円）

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



## 中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

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

## 会計方針の変更

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

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

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

## (中間損益計算書関係)

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

## (中間株主資本等変動計算書関係)

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

## リース取引関係

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

## 金融商品関係

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

## 金融商品の時価等に関する事項

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

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

(\*) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

## (1) 現金・預金

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

## (2) 未収委託者報酬及び(4) 未払金

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

## (3) 投資有価証券

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

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

内 容	中間貸借対照表計上額(千円)
非上場株式	10,000

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

## 有価証券関係

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

## デリバティブ関係

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

## 資産除去債務関係

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

## セグメント情報等

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

## （セグメント情報）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## （関連情報）

## 1．製品及びサービスごとの情報

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

## 2．地域ごとの情報

## （1）営業収益

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

## （2）有形固定資産

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

## 3．主要な顧客ごとの情報

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

（注）当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載しております。

## （追加情報）

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

## 1 株当たり情報

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

(注) 1株当たり中間純利益算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

## 重要な後発事象

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1) 自己又はその役員との取引

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

##### (2) 運用財産相互間の取引

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

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

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

##### (4) 親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

##### (5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更

当会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称：中央三井アセット信託銀行株式会社

資本金の額：11,000百万円（平成22年9月末日現在）

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

#### <再信託受託会社>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成22年9月末日現在）

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

#### (2) 販売会社

名称：中央三井信託銀行株式会社

資本金の額：399,697百万円（平成22年9月末日現在）

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

### 2【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（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2) 交付目論見書には約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載しています。
- (3) 目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案及びキャッチコピーを採用すること、また、ファンドの形態、申込みに関する事項などを記載することがあります。
- (4) 目論見書（表紙を含みます。）等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。
- 当ファンドは預貯金や保険契約とは異なり、預金保険機構、貯金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象とはなりません。
- 金融商品取引業者以外でご購入いただいた場合は、投資者保護基金の対象とはなりません。
- 当ファンドは、実質的に国内の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。
- ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認いたします。
- 投資信託の信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
- ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- (5) 目論見書等は電子媒体としてインターネット等に掲載されることがあります。
- (6) 目論見書等に、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示する場合があります。
- (7) 目論見書（表紙を含みます。）等に金融商品取引業者登録番号、目論見書の使用開始日を別途記載することがあります。

# 独立監査人の監査報告書

平成22年3月19日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 松崎雅則

印

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 平木達也

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている中央三井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XBR Lデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

平成21年6月12日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

## 監査法人 トーマツ

指定社員  
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

指定社員  
業務執行社員 公認会計士 平木達也 印

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

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

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

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

以上

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

# 独立監査人の監査報告書

平成23年3月24日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 松崎雅則

印

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 平木達也

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている中央三井DC日本株式インデックスファンドの平成22年1月23日から平成23年1月24日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

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

以上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

平成22年6月10日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

## 有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 松崎雅則

印

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 平木達也

印

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

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

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

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

以上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成22年12月14日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 松崎雅則

印

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 平木達也

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている中央三井アセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第25期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、中央三井アセットマネジメント株式会社の平成22年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以上

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