

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成21年3月10日
【計算期間】	第6期（自 平成19年12月11日 至 平成20年12月10日）
【ファンド名】	中央三井DC日本株式インデックスファンドA
【発行者名】	中央三井アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 渡辺 輝夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝三丁目23番1号
【事務連絡者氏名】	大供 修二
【連絡場所】	東京都港区芝三丁目23番1号 業務企画部
【電話番号】	03-5440-0181
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

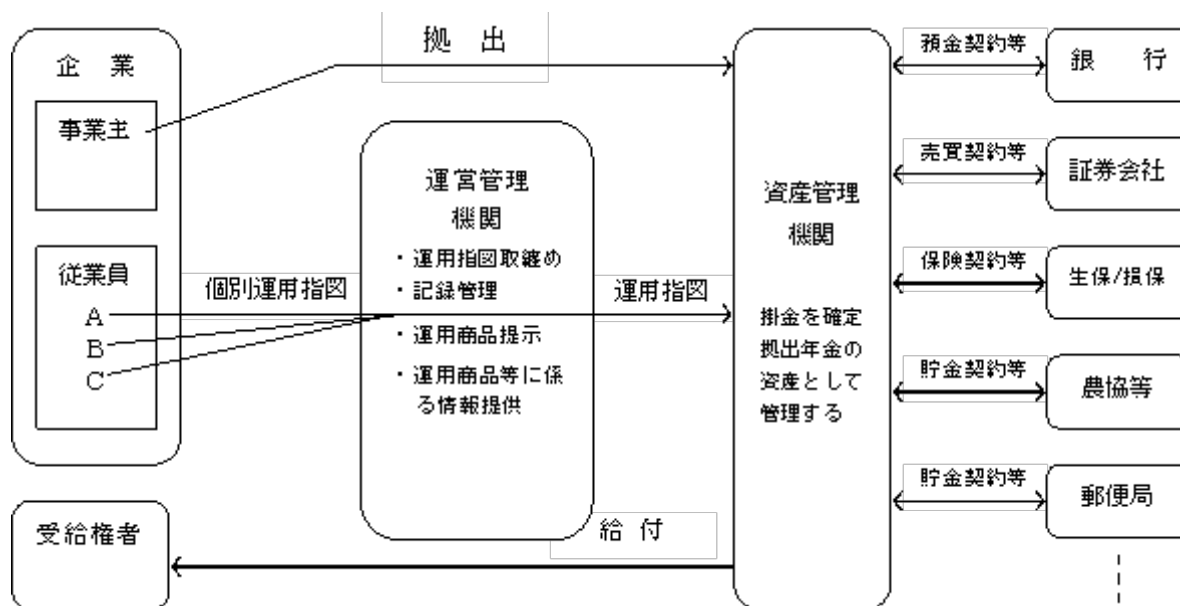
①ファンドの目的

当ファンドは、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。

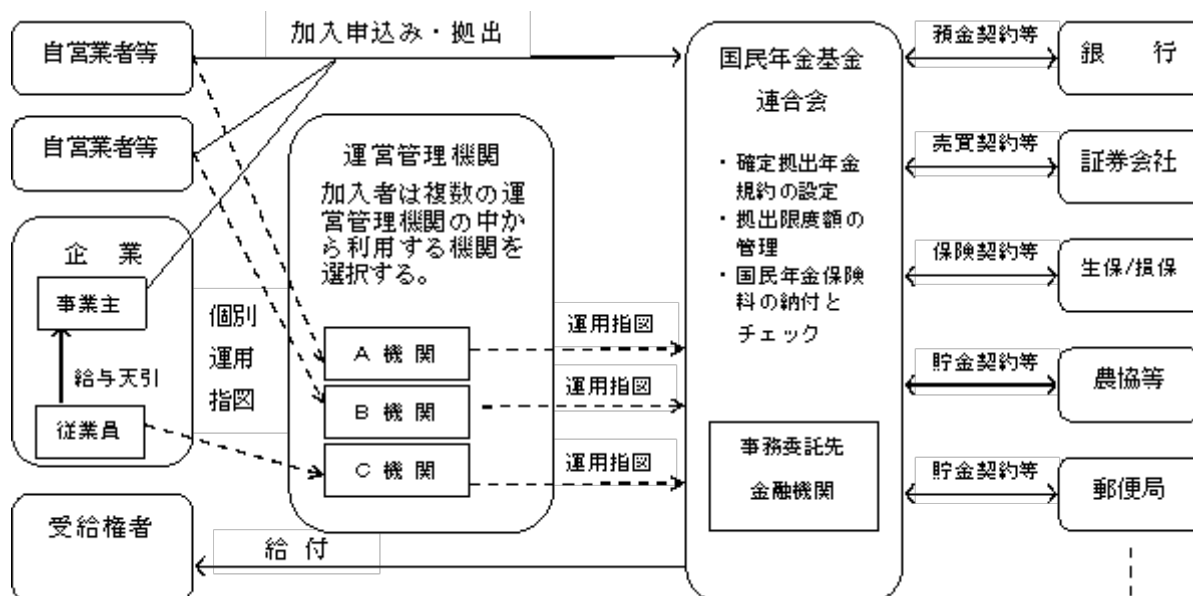
（参考）

確定拠出年金制度には、厚生年金保険の適用事業所の事業主が実施する「企業型年金」と国民年金基金連合会が実施する「個人型年金」がありますが、その概要は次のとおりとなります。

〔企業型年金のイメージ図〕



〔個人型年金のイメージ図〕



企業型年金のイメージ図の資産管理機関及び個人型年金のイメージ図の国民年金基金連合会が当ファンドの受益者に該当し、各イメージ図の証券会社が販売会社に該当します。

②信託金限度額

上限：3,000億円

③基本的性格

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

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単 位 型 追 加 型	国 内	株 式	インデックス型
	海 外	債 券	
	内 外	不動産投信	特 殊 型
		その他資産 ()	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

（用語の定義について）

当ファンドが該当する商品分類に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

＜単位型投信・追加型投信＞

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

＜投資対象地域＞

- ・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。

＜補足分類＞

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
--------	------	--------	------	----------

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(用語の定義について)

当ファンドが該当する属性区分に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

<投資対象資産>

・その他資産（投資信託証券）

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

・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ています。

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

<決算頻度>

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

<投資対象地域>

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

<投資形態>

・ファミリーファンド

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

<インデックスファンドにおける対象インデックス>

・T O P I X

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

なお、T O P I Xにつきましては、後記「2 投資方針 （1）投資方針 ②投資態度 A. 」の記載もご参照ください。

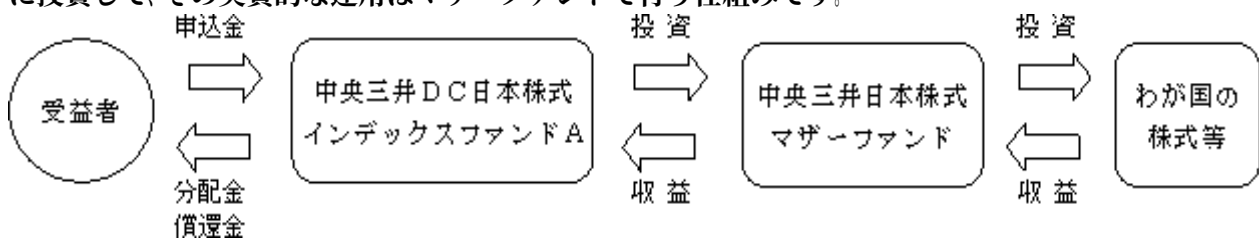
④ファンドの特色

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

（2）【ファンドの仕組み】

①ファミリーファンド方式での運用

ファミリーファンド方式とは、投資家から投資された資金をまとめてベビーファンド（中央三井DC日本株式インデックスファンドA）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。



②ファンドの関係法人

委託会社 中央三井アセットマネジメント株式会社

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

受託会社 中央三井アセット信託銀行株式会社

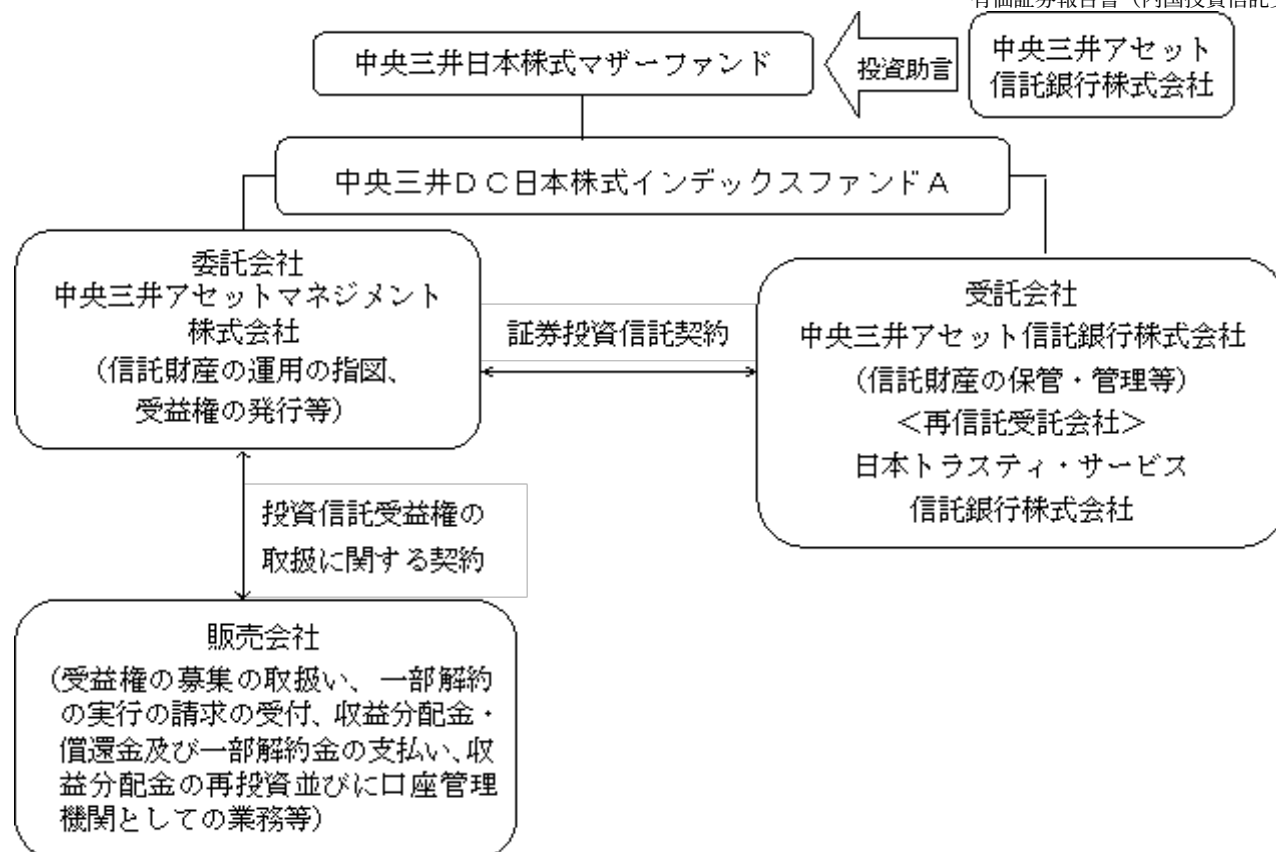
（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

販売会社

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

ファンドの関係法人



委託会社と関係法人との契約の概要

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

③委託会社の概況

A. 資本金の額：3億円（平成21年3月10日現在）

B. 委託会社の沿革

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

昭和62年2月：投資顧問業法に基づく登録

昭和62年9月：投資一任業務の認可取得

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

平成12年3月：証券投資信託委託業務認可取得

C. 大株主の状況（平成21年3月10日現在）

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

①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。

②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）（※）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

※「TOPIX」（東証株価指数）の著作権等について

1. TOPIXの指数値及びTOPIX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TOPIXに関する全ての権利及びTOPIX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、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止又はTOPIX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、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及するものではありません。
4. 東証は、TOPIX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、TOPIX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、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用を行いますが、当ファンドの基準価額とTOPIXの指数値が著しく乖離することがあります。
6. 当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。
7. 東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
8. 東証は、委託会社又は当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する構成銘柄、計算に考慮するものではありません。
9. 以上に限らず、東証は当ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

B. 株式への実質投資割合（信託財産に属する他の投資信託受益証券（振替受益権を含みます。）の時価総額に、当該他の投資信託の信託財産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額と、信託財産に属する株式の時価総額との合計額が信託財産総額に占める割合）は、原則として信託財産総額の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】

①投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 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。）
 - A. 有価証券
 - B. 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）①J.、K. 及びL. に定めるものに限りします。）
 - C. 金銭債権（上記A.、B. 及び下記D. に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - D. 約束手形（上記A. に掲げるものに該当するものを除きます。）

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

- A. 為替手形

②運用指図できる投資対象である有価証券

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

- A. 株券又は新株引受権証券
 - B. 国債証券
 - C. 地方債証券
 - D. 特別の法律により法人の発行する債券
 - E. 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。）
 - F. 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。）
 - G. 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。）
 - H. 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券
 - I. 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。）
 - J. コマーシャル・ペーパー
 - K. 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
 - L. 外国又は外国の者の発行する証券又は証券で、上記A. からK. までの証券又は証券の性質を有するもの
 - M. 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。）
 - N. 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。）
 - O. 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。）
 - P. オプションを表示する証券又は証券（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します。）
 - Q. 預託証券（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。）
 - R. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
 - S. 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。）

T. 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。）

U. 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

V. 外国の者に対する権利で上記U. の有価証券の性質を有するもの

なお、上記A. の証券又は証書並びに上記L. 及び上記Q. の証券又は証書のうち上記A. 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B. から上記F. までの証券並びに上記L. 及び上記Q. の証券又は証書のうち上記B. から上記F. 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M. の証券及び上記N. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③運用指図できる金融商品

A. 委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

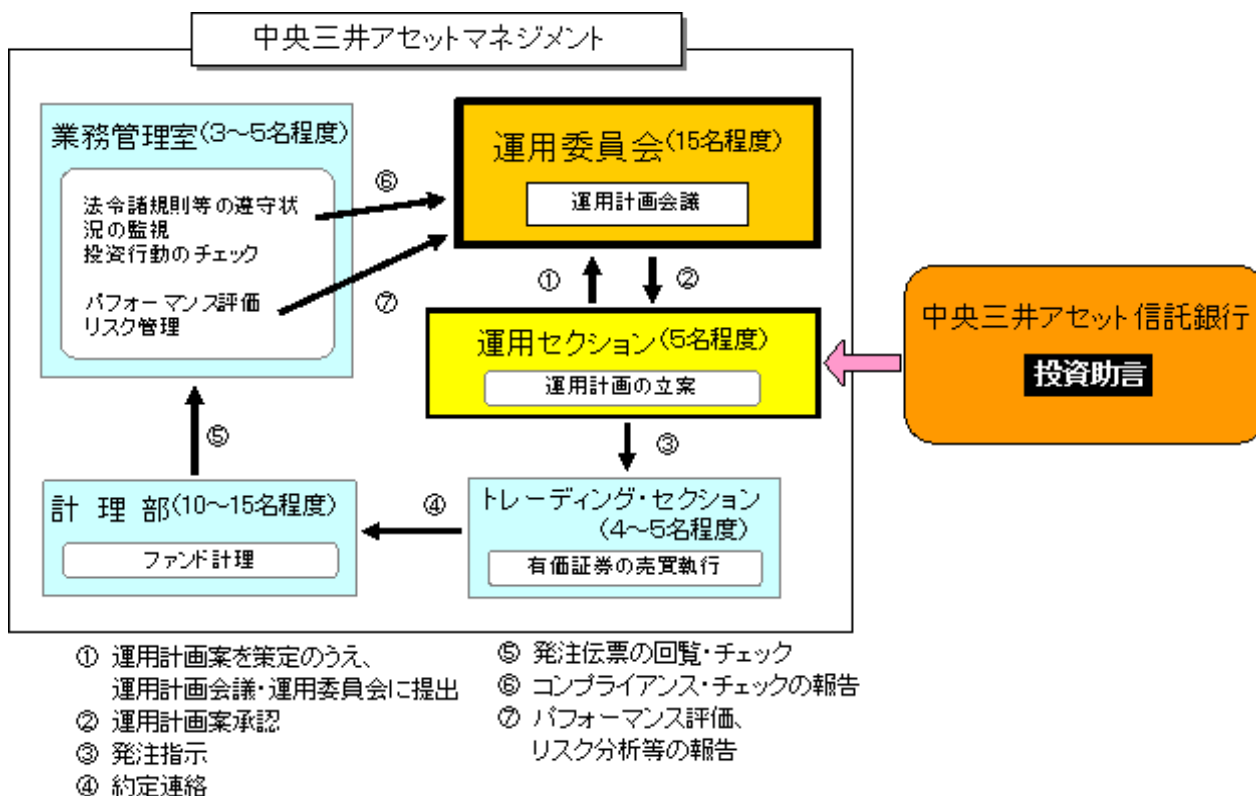
6. 外国の者に対する権利で上記5. の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

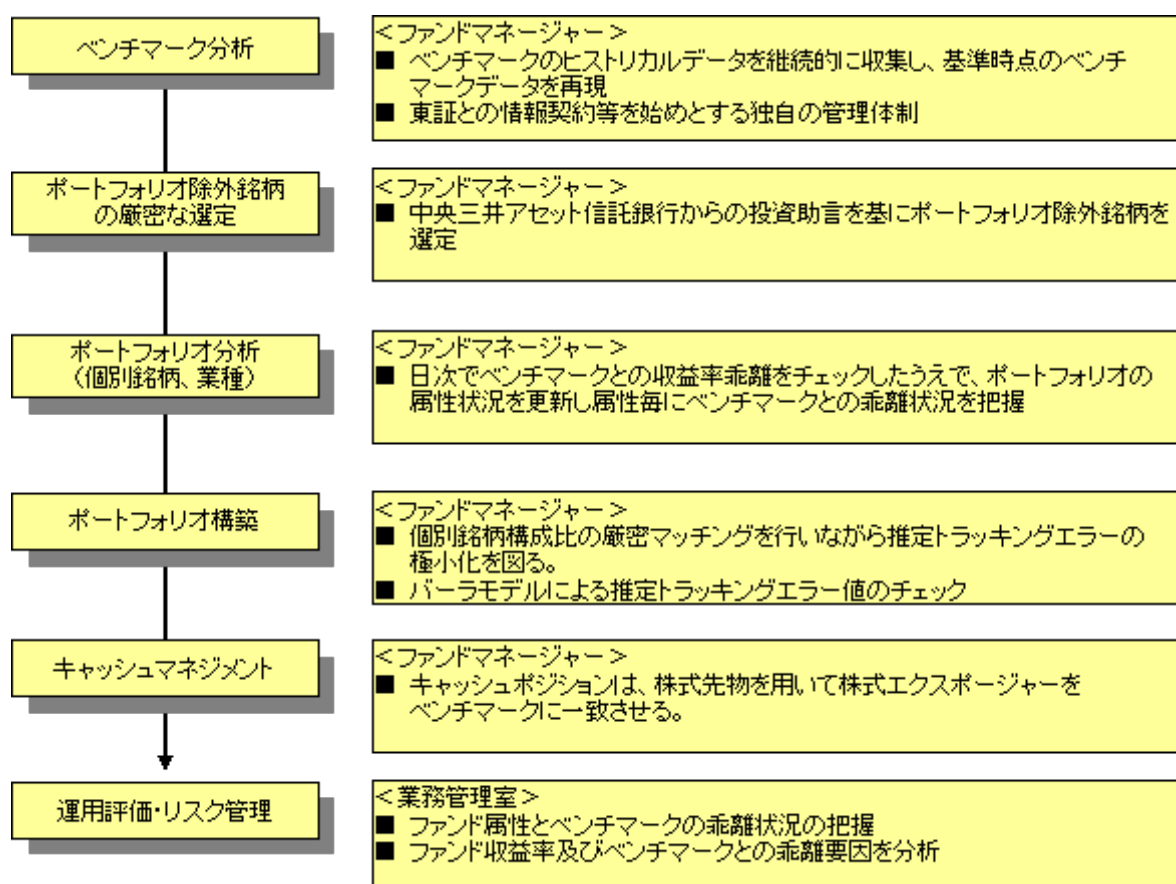
当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記A. に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（３）【運用体制】

当ファンドの運用体制は以下のとおりです。



具体的なポートフォリオ構築プロセスは、以下のとおりです。



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

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

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

（４）【分配方針】

①分配方針

年１回の毎決算時（決算日は12月10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。

②分配収益の計算

A. 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

イ. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額

（「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①」の記載をご参照ください。）、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金に充てるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

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

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

B. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③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】

①約款に定める投資制限

A. 株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

B. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

C. 新株引受権証券等への投資割合

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

D. 投資信託証券への投資割合

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

E. 同一銘柄の株式への投資割合

同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

F. 同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

G. 同一銘柄の転換社債等への投資割合

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

H. 投資する株式等の範囲

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

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

I. 信用取引の運用指図

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、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、委託会社はすみやかに、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。

ニ. 上記ロ.において信託財産に属するとみなした額とは、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。

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あたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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あたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約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あたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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、委託会社はすみやかに、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、有価証券の貸付けにあたり、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、信託財産において有していない公社債又は、下記O. の規定により借入れた公社債を売付け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、売付けた公社債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、委託会社はすみやかに、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あたり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

ロ. 上記イ. の借入れの指図は、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、委託会社はすみやかに、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。

②関連法令に基づく投資制限

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

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

委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社等が定めた合理的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

- ①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）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②運用に際しては、中央三井アセット信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、中央三井アセット信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。
- ③株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。
- ④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。
- ⑤ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ⑥国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における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。
- ⑦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。
- ⑧信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

- ①株式への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資は、行いません。
- ③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。
- ④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。
- ⑤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。
- ⑥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。
- ⑦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）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）の変動により当ファンドの基準価額も変動し、これにより損失が生ずることとなるおそれがあります。

当ファンドの主なリスクは以下のとおりです。

①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。

②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。

③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。

④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））と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、当ファンドの基準価額騰落率とベンチマークの騰落率は必ずしも一致しません。

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

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

- (2) 当ファンドはファミリーファンド方式（前記「1 ファンドの性格 (2) ファンドの仕組み ①ファミリーファンド方式での運用」をご参照ください。）で運用を行います。そのため、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等に伴う資金変動があり、その結果、当該マザーファンドにおいて有価証券の売買等が行われた場合等には、その売買による組入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委員会に報告する体制としております。

- ①法令諸規則、約款等に定められた運用制限の遵守状況は、業務管理室が日々チェックしております。指摘事項については、運用担当者に連絡されすみ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。
- ②業務管理室において、リスクのモニタリング、パフォーマンス分析等を行っております。問題が生じた場合は、運用担当者に連絡されすみ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】

①解約手数料はありませんが、下記②の信託財産留保額が控除されます。

②一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の基準価額から、当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額とします。

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

マザーファンド名	A 欄	B 欄
中央三井日本株式マザーファンド	一部解約を行う日の前営業日の信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額を受益権総口数で除した金額	0.2%

（３）【信託報酬等】

①信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の40.95（税抜 年10,000分の39）の率を乗じて得た額とします。その配分は、委託会社10,000分の23.1（税抜 10,000分の22）、受託会社10,000分の5.25（税抜 10,000分の5）及び販売会社10,000分の12.6（税抜 10,000分の12）です。

なお、マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

②上記①の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに信託財産中から支弁するものとします。

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

（４）【その他の手数料等】

①信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、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。

②借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

③当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。

①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。

②個人型年金

個人型年金の年金資産は国民年金基金連合会のものとされていますので、当ファンドの毎決算時の収益分配金、一部解約金及び償還金について所得税及び地方税が課されることはありません。

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

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

5【運用状況】

以下の記載事項は、平成20年12月30日現在の状況について記載してあります。

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	1,077,257,194	100.02
その他の資産（負債控除後）		△232,267	△0.02
合計（純資産総額）		1,077,024,927	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「中央三井日本株式マザーファンド」の状況は次のとおりです。

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	208,803,610,580	95.42
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,033,564,938	4.58
合計（純資産総額）		218,837,175,518	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

種類	銘柄	口数	簿価（円）		評価額（円）		投資 比率 （％）
			単価	金額	単価	金額	
親投資信託 受益証券	中央三井日本株式 マザーファンド	1,473,272,969	0.7094	1,045,181,214	0.7312	1,077,257,194	100.02

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

<参考>

当ファンドが主要投資対象としている親投資信託「中央三井日本株式マザーファンド」の状況

① 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	2,444,500	4,760.77	11,637,712,900	2,905.00	7,101,272,500	3.25
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,951,400	838.10	9,178,461,667	549.00	6,012,318,600	2.75
3	日本電信電話	情報・通信業	8,633	477,607.55	4,123,186,064	468,000.00	4,040,244,000	1.85
4	東京電力	電気・ガス業	1,198,900	2,721.65	3,262,987,500	3,000.00	3,596,700,000	1.64
5	任天堂	その他製品	100,400	50,556.74	5,075,897,600	33,750.00	3,388,500,000	1.55
6	武田薬品工業	医薬品	722,400	5,840.03	4,218,844,624	4,640.00	3,351,936,000	1.53
7	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	18,557	153,588.07	2,850,133,908	176,400.00	3,273,454,800	1.50
8	本田技研工業	輸送用機器	1,626,000	2,914.54	4,739,049,000	1,906.00	3,099,156,000	1.42
9	キャノン	電気機器	1,103,100	4,141.41	4,568,399,486	2,770.00	3,055,587,000	1.40
10	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	7,954	674,228.59	5,362,814,247	376,000.00	2,990,704,000	1.37
11	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	10,607	428,073.90	4,540,579,909	257,700.00	2,733,423,900	1.25
12	東日本旅客鉄道	陸運業	3,545	855,527.49	3,032,844,985	689,000.00	2,442,505,000	1.12
13	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	749,700	2,652.71	1,988,741,040	3,050.00	2,286,585,000	1.04
14	パナソニック	電気機器	2,029,000	1,946.08	3,948,616,000	1,113.00	2,258,277,000	1.03
15	東京海上ホールディングス	保険業	808,000	3,364.38	2,718,420,585	2,580.00	2,084,640,000	0.95
16	関西電力	電気・ガス業	789,700	2,587.27	2,043,169,300	2,600.00	2,053,220,000	0.94
17	ソニー	電気機器	1,008,900	4,845.27	4,888,397,100	1,922.00	1,939,105,800	0.89
18	三菱地所	不動産業	1,307,000	2,188.61	2,860,521,000	1,447.00	1,891,229,000	0.86
19	KDDI	情報・通信業	2,915	695,075.80	2,026,145,958	635,000.00	1,851,025,000	0.85
20	中部電力	電気・ガス業	644,300	2,674.70	1,723,309,400	2,735.00	1,762,160,500	0.81
21	三菱商事	卸売業	1,402,600	2,264.21	3,175,785,000	1,238.00	1,736,418,800	0.79
22	アステラス製薬	医薬品	446,600	4,266.47	1,905,409,581	3,630.00	1,621,158,000	0.74
23	新日本製鐵	鉄鋼	5,228,000	584.27	3,054,614,000	290.00	1,516,120,000	0.69
24	三井物産	卸売業	1,617,000	1,615.15	2,611,704,000	901.00	1,456,917,000	0.67
25	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	1,974,500	1,363.63	2,692,502,636	729.00	1,439,410,500	0.66
26	日本たばこ産業	食料品	4,726	553,787.15	2,617,198,114	295,000.00	1,394,170,000	0.64
27	花王	化学	511,000	3,100.72	1,584,470,000	2,710.00	1,384,810,000	0.63
28	信越化学工業	化学	331,900	5,449.49	1,808,687,400	4,070.00	1,350,833,000	0.62
29	三菱重工業	機械	3,388,000	391.18	1,325,341,000	395.00	1,338,260,000	0.61
30	三井住友海上グループホールディングス	保険業	448,100	3,067.31	1,374,462,992	2,785.00	1,247,958,500	0.57
合計			40,887,937		106,938,406,996		75,698,099,900	34.59

（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。

（注）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	0.11
	鉱業	0.38
	建設業	2.12
	食料品	3.41
	繊維製品	0.89
	パルプ・紙	0.54
	化学	5.16
	医薬品	5.06
	石油・石炭製品	0.76
	ゴム製品	0.56
	ガラス・土石製品	0.88
	鉄鋼	2.27
	非鉄金属	0.96
	金属製品	0.62
	機械	3.77
	電気機器	10.96
	輸送用機器	7.01
	精密機器	1.11
	その他製品	2.58
	電気・ガス業	6.70
	陸運業	4.53
	海運業	0.64
	空運業	0.59
	倉庫・運輸関連業	0.29
	情報・通信業	6.69
	卸売業	3.75
	小売業	4.13
	銀行業	10.14
	証券、商品先物取引業	1.33
	保険業	2.70
	その他金融業	0.81
	不動産業	2.29
	サービス業	1.68
	合計	95.42

（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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

銘柄名	国／地域	数量	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	1,182	9,885,782,575	10,188,840,000	4.66

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

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額（円）	1万口当たりの 基準価額（円）
第1期計算期間（平成15年12月10日現在）	407,421,334	11,512
第2期計算期間（平成16年12月10日現在）	625,537,604	12,800
第3期計算期間（平成17年12月12日現在）	1,232,308,671	19,308
第4期計算期間（平成18年12月11日現在）	1,683,350,552	19,622
第5期計算期間（平成19年12月10日現在）	1,726,750,155	18,965
第6期計算期間（平成20年12月10日現在）	1,033,304,713	10,321
平成19年12月末日	1,639,457,965	17,972
平成20年1月末日	1,500,505,839	16,390
平成20年2月末日	1,502,896,544	16,118
平成20年3月末日	1,397,297,091	14,901
平成20年4月末日	1,579,717,290	16,687
平成20年5月末日	1,645,445,592	17,288
平成20年6月末日	1,557,490,333	16,221
平成20年7月末日	1,531,608,727	16,011
平成20年8月末日	1,481,786,659	15,415
平成20年9月末日	1,286,765,895	13,458
平成20年10月末日	1,047,179,669	10,705
平成20年11月末日	1,039,220,273	10,324
平成20年12月末日	1,077,024,927	10,636

（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。

② 【分配の推移】

	1万口当たりの収益分配金
第1期計算期間	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

③ 【収益率の推移】

	収益率
第1期計算期間	15.1 %
第2期計算期間	11.2 %
第3期計算期間	50.8 %
第4期計算期間	1.6 %
第5期計算期間	△3.3 %
第6期計算期間	△45.6 %

（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12月11日）の基準価額を使用しております。

第二部【ファンドの詳細情報】

第1【ファンドの沿革】

平成14年12月11日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

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

第2【手続等】

1【申込（販売）手続等】

（1）募集の取扱いの期間と受付時間

①平成21年3月11日から平成22年3月10日まで、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（年末年始など本邦金融商品取引所が半日立会いの場合は午前10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。

募集期間は、募集期間満了前に委託会社が「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。

②上記①の規定にかかわらず、分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、販売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ます。）（以下「資産管理機関等」といいます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

※1. 信託会社、信託業務を営む金融機関、厚生年金基金、企業年金基金

2. 生命保険会社

3. 農業協同組合連合会

4. 損害保険会社

（3）募集取扱いの単位

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

（4）販売価額

継続募集期間における受益権の販売価額は、取得申込受付日の基準価額とします。

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の販売価額は、原則として後記「第3 管理及び運営 1 資産管理等の概要 （4）計算期間」に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

（5）申込の際に負担するコストの有無

申込手数料はありません。

（6）その他

①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。

②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み旨の申込書を提出していただきます。

③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される、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

- ④取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

2【換金（解約）手続等】

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

（注）一部解約の実行の請求の受付は、営業日の午後2時（年末年始など本邦金融商品取引所が半日立会
いの場合は午前10時）までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱
いとさせていただきます。

- （2）受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとし、
（3）委託会社は、一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。
（4）一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の基準価額から、当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た解
約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出され、日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせいた
だければ、いつでもお知らせいたします。また、解約価額は原則として、委託会社のホームページ
（<http://www.cmam.co.jp/>）に掲載しております。

販売会社の詳細につきましては、以下の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

中央三井アセットマネジメント株式会社

・お客様相談窓口

電 話：０３－５４４０－０１９０

受付時間：営業日の９時～１７時（本邦金融商品取引所が半日立会いの場合は９時～１２時）

・ホームページ アドレス：<http://www.cmam.co.jp/>

- （５）委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、上記（１）による一部解約の実行の請求の受付を中止することができます。
- （６）上記（５）により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして上記（４）の記載に準じて計算された価額とします。
- （７）一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、５営業日目から販売会社において当該受益者に支払います。
- なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。
- （８）解約に係る手数料については、徴収しません。
- （９）一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

第3【管理及び運営】

1【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

①基準価額

信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上1万口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「第2 手続等 2 換金（解約）手続等」に記載の照会先までお問い合わせください。）。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.cmam.co.jp/>）でご覧いただけるほか、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に（〔中央三井AM〕の〔D日株A〕の略号にて）掲載されております。

②当ファンドの主たる投資対象としている資産及び基準価額に与える影響が大きいと想定される資産の評価方法

A. 親投資信託受益証券（中央三井日本株式マザーファンド）

移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、基準価額で評価しております。

B. 株式

移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。

（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12月11日）から無期限とします。ただし、委託会社は、下記（5）①の事項に該当することとなった場合は、この信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（4）【計算期間】

①当ファンドの計算期間は、毎年12月11日から翌年12月10日までとすることを原則とします。

②上記①の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、上記（3）に定める信託期間の終了日とします。

（5）【その他】

①信託の終了

この信託契約を解約し信託を終了させる場合は下記のとおりです。

A. 委託会社の所定の手続を経て信託を終了させる場合

イ. 受益権の口数が30億口を下回った場合

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30億口を下回るることとなった場合は、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。

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

ア. 委託会社は、上記イ. 及びロ. の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

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

B. 監督官庁の命令

- イ. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。
- ロ. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款の変更をしようとするときは、下記③の規定に従います。

C. 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

- イ. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ロ. 上記イ. の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、下記③D. に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

D. 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い

- イ. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、下記③の規定に従い、新受託会社を選任します。
- ロ. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

②委託会社の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い

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

③信託約款の変更

- A. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。
- B. 委託会社は、上記A. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- C. 上記B. の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- D. 上記C. の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記A. の信託約款の変更をしません。
- E. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

④反対者の買取請求権

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

⑤公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥信託財産の管理

A. 保管業務の委任

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

B. 有価証券の保管

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

C. 混蔵寄託

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

D. 信託財産の登記等及び記載等の留保等

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

ロ. 上記イ. の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、すみやかに登記又は登録をするものとします。

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

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

⑦運用報告書

委託会社は、計算期間の終了毎に、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況等を記載

した運用報告書を作成のうえ、販売会社を通じて、あらかじめ受益者からお申し出いただいた住所にお届けいたします。また、販売会社でもお受取りいただけます。

⑧関係法人との契約の更改等に関する手続、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。

⑨信託事務処理の再委託

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

2【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次のとおりです。

（1）収益分配金に対する請求権

①受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

②収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付されます。

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

（2）償還金に対する請求権

①受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

②償還金は、信託終了日（償還日）後1ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日）から起算して5営業日までの日）から、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に対する支払いを開始します。

③償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

④受益者が、信託終了による償還金について、上記②に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

（３）一部解約請求権

- ①受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し１口単位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。
- ②一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、５営業日目から当該受益者に支払います。
- ③一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

（４）投資信託約款等重要事項変更時の反対者の買取請求権

前記「１ 資産管理等の概要 （５）その他 ④反対者の買取請求権」をご参照ください。

（５）受益権均等分割

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

（６）帳簿閲覧権

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

（参考）

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

第4【ファンドの経理状況】

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

ただし、「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則等の一部を改正する内閣府令（平成19年8月9日内閣府令第61号）」附則第3条により、第5期計算期間（平成18年12月12日から平成19年12月10日まで）については改正前の「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」に基づき作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（平成18年12月12日から平成19年12月10日まで）及び第6期計算期間（平成19年12月11日から平成20年12月10日まで）の財務諸表について、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A

(1) 【貸借対照表】

項目	第 5 期 (平成19年12月10日現在) 金額 (円)	第 6 期 (平成20年12月10日現在) 金額 (円)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,730,342,714	1,035,992,232
未収入金	17,513,923	1,540,737
流動資産合計	1,747,856,637	1,037,532,969
資産合計	1,747,856,637	1,037,532,969
負債の部		
流動負債		
未払解約金	17,513,923	1,540,737
未払受託者報酬	460,594	344,560
未払委託者報酬	3,131,965	2,342,959
流動負債合計	21,106,482	4,228,256
負債合計	21,106,482	4,228,256
純資産の部		
元本等		
元本	910,484,079	1,001,134,546
剰余金		
期末剰余金	816,266,076	32,170,167
純資産合計	1,726,750,155	1,033,304,713
負債・純資産合計	1,747,856,637	1,037,532,969

（２）【損益及び剰余金計算書】

項目	第 5 期 自 平成18年12月12日 至 平成19年12月10日 金額（円）	第 6 期 自 平成19年12月11日 至 平成20年12月10日 金額（円）
営業収益		
有価証券売買等損益	△53,204,724	△808,548,260
営業収益合計	△53,204,724	△808,548,260
営業費用		
受託者報酬	924,569	743,945
委託者報酬	6,286,954	5,058,734
営業費用合計	7,211,523	5,802,679
営業損失金額	60,416,247	814,350,939
経常損失金額	60,416,247	814,350,939
当期純損失金額	60,416,247	814,350,939
一部解約に伴う当期純利益金額分配額 （△純損失金額分配額）	13,276,958	△76,670,127
期首剰余金	825,445,939	816,266,076
剰余金増加額	290,387,860	128,778,960
（当期追加信託に伴う剰余金増加額）	(290,387,860)	(128,778,960)
剰余金減少額	225,874,518	175,194,057
（当期一部解約に伴う剰余金減少額）	(225,874,518)	(175,194,057)
期末剰余金	816,266,076	32,170,167

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第 5 期 自 平成18年12月12日 至 平成19年12月10日	第 6 期 自 平成19年12月11日 至 平成20年12月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、法令及び 社団法人投資信託協会規則に従 い、基準価額で評価しておりま す。	親投資信託受益証券 同左
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12月11日から翌 年12月10日までとなっております が、前計算期間末日が休業日 のため、平成18年12月12日から 平成19年12月10日までとなっ ております。	-----

(貸借対照表に関する注記)

	第 5 期 (平成19年12月10日現在)	第 6 期 (平成20年12月10日現在)
1. 当該計算期間の末日にお ける受益権総数	910,484,079 口	1,001,134,546 口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8965 円 (18,965 円)	1.0321 円 (10,321 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	第 5 期 自 平成18年12月12日 至 平成19年12月10日
1. 分配金の計算過 程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（15,931,742円）（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23,143,265円を含みます。）、費用控除後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（540,205,241円）及び分配準備積立金（260,129,093円）より分配対象収益は、816,266,076円（1万口当たり8,965.18円）であります。長期的な信託財産の成長に資するため、分配を行っておりません。

1. 分配金の計算過程

		第 6 期 自 平成19年12月11日 至 平成20年12月10日
費用控除後の配当等収益額	A	20,598,092 円 (26,400,771 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
収益調整金額	C	623,131,470 円
分配準備積立金額	D	222,352,296 円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	866,081,858 円
当ファンドの期末残存口数	F	1,001,134,546 口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	8,651.00 円
10,000口当たり分配金額	H	— 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	— 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 5 期 自 平成18年12月12日 至 平成19年12月10日	第 6 期 自 平成19年12月11日 至 平成20年12月10日
2. 剰余金増加額・減少額	当期追加信託に伴う剰余金増加額及び当期一部解約に伴う剰余金減少額はそれぞれ剰余金減少額と増加額との純額を表示しております。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第 5 期 自 平成18年12月12日 至 平成19年12月10日	第 6 期 自 平成19年12月11日 至 平成20年12月10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 5 期 自 平成18年12月12日 至 平成19年12月10日	第 6 期 自 平成19年12月11日 至 平成20年12月10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 5 期 自 平成18年12月12日 至 平成19年12月10日	第 6 期 自 平成19年12月11日 至 平成20年12月10日
期首元本額	857,904,613 円	910,484,079 円
期中追加設定元本額	285,026,590 円	295,481,661 円
期中一部解約元本額	232,447,124 円	204,831,194 円

2. 有価証券関係
売買目的有価証券

	第 5 期 (平成19年12月10日現在)		第 6 期 (平成20年12月10日現在)	
種類	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間（自 平成18年12月12日 至 平成19年12月10日） の損益に含まれた評 価差額（円）	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間（自 平成19年12月11日 至 平成20年12月10日） の損益に含まれた評 価差額（円）
親投資信託 受益証券	1,730,342,714	△59,160,857	1,035,992,232	△721,397,122
合計	1,730,342,714	△59,160,857	1,035,992,232	△721,397,122

3. デリバティブ取引関係

第5期（自 平成18年12月12日 至 平成19年12月10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6期（自 平成19年12月11日 至 平成20年12月10日）

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

① 有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	中央三井日本株式 マザーファンド	1,460,378,112	1,035,992,232	
合計		1,460,378,112	1,035,992,232	

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

- ④ 不動産等明細表
該当事項はありません。
- ⑤ その他特定資産の明細表
該当事項はありません。
- ⑥ 借入金明細表
該当事項はありません。

<参考>

「中央三井DC日本株式インデックスファンドA」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20年12月10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20年12月10日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,545,710,718
株式	202,624,020,436
派生商品評価勘定	89,354,850
未収配当金	73,940,510
未収利息	57,553
前払金	317,890,000
流動資産合計	211,650,974,067
資産合計	211,650,974,067
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	240,908,750
未払金	5,432,350
未払解約金	83,772,447
流動負債合計	330,113,547
負債合計	330,113,547
純資産の部	
元本等	
元本	297,888,285,769
剰余金	
欠損金	86,567,425,249
純資産合計	211,320,860,520
負債・純資産合計	211,650,974,067

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成20年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	株価指数先物取引 個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。 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。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には、予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。 (2) 派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	平成20年12月10日現在
1. 担保に供している資産	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。 株式 3,253,500,000 円 なお、上記の金額には、約定未受渡株式を含んでおります。
2. 計算日における受益権総数	297,888,285,769 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	元本の欠損 86,567,425,249 円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7094 円 (7,094 円)

（関連当事者との取引に関する注記）

平成20年12月10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20年12月10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20年12月10日現在	
計算期間の期首元本額	224,153,707,976 円
計算期間中の追加設定元本額	97,056,903,228 円
計算期間中の一部解約元本額	23,322,325,435 円
計算日の元本額	297,888,285,769 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	2,377,211,164 円
中央三井DC日本株式インデックスファンド	254,776,977 円
中央三井DC日本株式インデックスファンドL	30,101,945,632 円
中央三井DC日本株式インデックスファンドA	1,460,378,112 円
中央三井DCバランスファンド30	132,542,992 円
中央三井DCバランスファンド50	332,255,420 円
中央三井DCバランスファンド70	201,728,611 円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	469,928,134 円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	266,960,635 円
新生・4分散ファンド	312,549,460 円
ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド	370,084,760 円
4資産インデックスバランスオープン（分配型）	132,550,604 円
4資産インデックスバランスオープン（成長型）	268,318,785 円
中央三井日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	42,556,523,898 円
中央三井バランスVA30（適格機関投資家専用）	8,003,291,731 円
中央三井バランスVA50（適格機関投資家専用）	60,213,068,922 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）	49,551,312,232 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）	7,072,445,791 円
中央三井VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	1,038,145,283 円
中央三井VAバランスファンド（株60／100）（適格機関投資家専用）	8,695,214,074 円
中央三井バランスVA25（適格機関投資家専用）	6,385,960,811 円
中央三井バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	2,202,709,156 円
中央三井バランスVA50L（適格機関投資家専用）	39,694,065,206 円
中央三井バランスVA75（適格機関投資家専用）	2,114,473,627 円
中央三井VL株式30（適格機関投資家専用）	16,204,413 円
中央三井VL株式50（適格機関投資家専用）	24,530,284 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）	21,027,071,906 円
中央三井VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	4,302,996,120 円
中央三井VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	191,205,897 円
中央三井バランスVA40（適格機関投資家専用）	3,187,337,461 円
中央三井VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	2,659,130,648 円
CMAM・バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,186,115,950 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）	85,251,073 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

平成20年12月10日現在		
種類	貸借対照表計上額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	202,624,020,436	△85,269,220,711
合計	202,624,020,436	△85,269,220,711

（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20年1月23日から平成20年12月10日まで）に対応するものです。

3. デリバティブ取引関係

I. 取引の状況に関する事項

平成20年12月10日現在	
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株式関連の株価指数先物取引であります。
2. 取引に対する取組方針	株価指数先物取引は、ファンド運用の効率化を図ること及び将来の株価の変動によるリスク回避を目的としており、投機的な取引は行わない方針であります。
3. 取引の利用目的	株価指数先物取引は、ファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、キャッシュ運用の効率化、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用しております。
4. 取引に係るリスクの内容	株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
5. 取引に係るリスク管理体制	組織的な管理体制により、日々のポジション、評価金額及び評価損益の管理を行っております。また、リスク管理は、デリバティブ取引に限定することなく、デリバティブ取引と現物資産等を総合的に勘案し、各ファンド全体でのリスク管理を、リスクの種類ごとに実施しております。
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

Ⅱ. 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

株式関連

区分	種類	平成20年12月10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	8,796,973,900	—	8,645,420,000	△151,553,900
合計		8,796,973,900	—	8,645,420,000	△151,553,900

（注） 1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

(3) 附属明細表（平成20年12月10日現在）

① 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	90,000	213	19,170,000	
日本水産	245,700	224	55,036,800	
マルハニチロホールディングス	391,000	146	57,086,000	
サカタのタネ	39,100	1,409	55,091,900	
ホクト	19,700	2,440	48,068,000	
日鉄鉱業	57,000	274	15,618,000	
国際石油開発帝石	975	599,000	584,025,000	
関東天然瓦斯開発	26,000	553	14,378,000	
石油資源開発	30,400	3,420	103,968,000	
ショーボンドホールディングス	21,400	2,015	43,121,000	
ダイセキ環境ソリューション	16	173,300	2,772,800	
東急建設	84,270	235	19,803,450	
コムシスホールディングス	105,000	880	92,400,000	
高松コンストラクショングループ	18,200	1,344	24,460,800	
東建コーポレーション	8,150	2,085	16,992,750	
ヤマウラ	27,000	109	2,943,000	
大成建設	944,000	225	212,400,000	
大林組	597,000	553	330,141,000	
清水建設	606,000	522	316,332,000	
松井建設	31,000	312	9,672,000	
鹿島建設	875,000	295	258,125,000	
太平工業	38,000	292	11,096,000	
西松建設	259,000	134	34,706,000	
前田建設工業	138,000	354	48,852,000	
奥村組	208,000	417	86,736,000	
大和小田急建設	26,000	174	4,524,000	
東鉄工業	28,000	511	14,308,000	
戸田建設	235,000	328	77,080,000	
青木あすなろ建設	18,500	441	8,158,500	
北野建設	59,000	224	13,216,000	
三井ホーム	32,000	428	13,696,000	
矢作建設工業	33,000	422	13,926,000	
ピーエス三菱	21,600	180	3,888,000	
大東建託	95,100	4,260	405,126,000	
NIPPONコーポレーション	45,000	636	28,620,000	
前田道路	63,000	815	51,345,000	
日本道路	78,000	163	12,714,000	
五洋建設	259,500	123	31,918,500	
大成ロテック	48,000	120	5,760,000	
大林道路	36,000	145	5,220,000	
住友林業	146,700	660	96,822,000	
日本基礎技術	33,500	199	6,666,500	
巴コーポレーション	38,000	149	5,662,000	
パナホーム	86,000	547	47,042,000	
大和ハウス工業	532,000	837	445,284,000	
ライト工業	52,400	172	9,012,800	
積水ハウス	600,000	747	448,200,000	
北陸電気工事	15,000	334	5,010,000	
コミュニチュア	22,000	494	10,868,000	
ユアテック	37,000	496	18,352,000	
西部電気工業	21,000	390	8,190,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
四電工	21,000	488	10,248,000	
中電工	31,700	1,468	46,535,600	
関電工	99,000	615	60,885,000	
大明	31,000	837	25,947,000	
きんでん	126,000	834	105,084,000	
東京エネシス	24,000	589	14,136,000	
トーエネック	33,000	544	17,952,000	
住友電設	19,400	523	10,146,200	
日本電設工業	44,000	936	41,184,000	
協和エクシオ	78,000	993	77,454,000	
新日本空調	18,200	729	13,267,800	
東電通	40,000	170	6,800,000	
日本電話施設	40,000	273	10,920,000	
九電工	42,000	716	30,072,000	
三機工業	52,000	636	33,072,000	
日揮	214,000	1,140	243,960,000	
中外炉工業	73,000	266	19,418,000	
ヤマト	26,000	266	6,916,000	
太平電業	31,000	896	27,776,000	
高砂熱学工業	62,000	788	48,856,000	
日立プラントテクノロジー	58,000	274	15,892,000	
三晃金属工業	29,000	274	7,946,000	
NEC ネットエスアイ	19,000	1,155	21,945,000	
朝日工業社	28,000	306	8,568,000	
大気社	31,500	1,372	43,218,000	
ダイダン	32,000	401	12,832,000	
日比谷総合設備	32,000	750	24,000,000	
東芝プラントシステム	35,000	819	28,665,000	
東洋エンジニアリング	125,000	222	27,750,000	
千代田化工建設	169,000	440	74,360,000	
新興プランテック	35,600	832	29,619,200	
日本製粉	134,000	459	61,506,000	
日清製粉グループ本社	193,000	1,130	218,090,000	
日東富士製粉	17,000	284	4,828,000	
昭和産業	96,000	302	28,992,000	
鳥越製粉	18,500	752	13,912,000	
日本農産工業	61,000	176	10,736,000	
協同飼料	74,000	103	7,622,000	
中部飼料	20,000	568	11,360,000	
日本配合飼料	59,000	88	5,192,000	
ユニ・チャーム ペットケア	12,100	3,340	40,414,000	
東洋精糖	35,000	98	3,430,000	
日本甜菜製糖	118,000	261	30,798,000	
三井製糖	84,000	354	29,736,000	
森永製菓	224,000	190	42,560,000	
明治製菓	319,000	433	138,127,000	
中村屋	49,000	498	24,402,000	
江崎グリコ	77,000	1,025	78,925,000	
名糖産業	9,300	1,867	17,363,100	
不二家	115,000	123	14,145,000	
山崎製パン	143,000	1,326	189,618,000	
第一屋製パン	28,000	94	2,632,000	
モロゾフ	33,000	305	10,065,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
明治乳業	253,000	490	123,970,000	
雪印乳業	233,500	355	82,892,500	
森永乳業	180,000	340	61,200,000	
ヤクルト本社	114,300	1,774	202,768,200	
プリマハム	119,000	170	20,230,000	
日本ハム	162,000	1,280	207,360,000	
伊藤ハム	137,000	322	44,114,000	
林兼産業	68,000	68	4,624,000	
丸大食品	86,000	255	21,930,000	
米久	20,500	1,105	22,652,500	
S Foods	11,500	738	8,487,000	
サッポロホールディングス	303,000	531	160,893,000	
アサヒビール	400,000	1,567	626,800,000	
キリンホールディングス	872,000	1,150	1,002,800,000	
宝ホールディングス	180,000	532	95,760,000	
オエノンホールディングス	58,000	237	13,746,000	
メルシャン	63,000	188	11,844,000	
養命酒製造	16,000	854	13,664,000	
三国コカ・コーラボトリング	28,500	852	24,282,000	
四国コカ・コーラボトリング	9,900	848	8,395,200	
コカ・コーラウエストホールディングス	65,700	2,010	132,057,000	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	48	662,000	31,776,000	
ダイドードリンコ	9,800	2,395	23,471,000	
伊藤園	59,300	1,233	73,116,900	
キーコーヒー	17,300	1,561	27,005,300	
ユニカフェ	4,900	1,117	5,473,300	
ジャパンフーズ	2,700	694	1,873,800	
日清オイリオグループ	92,000	434	39,928,000	
不二製油	56,900	1,266	72,035,400	
J-オイルミルズ	79,000	336	26,544,000	
キッコーマン	186,000	1,050	195,300,000	
味の素	579,000	1,004	581,316,000	
キュービー	110,200	1,187	130,807,400	
ハウス食品	78,600	1,596	125,445,600	
カゴメ	82,400	1,512	124,588,800	
焼津水産化学工業	10,800	1,027	11,091,600	
アリアケジャパン	17,400	1,361	23,681,400	
ニチレイ	239,000	421	100,619,000	
東洋水産	85,000	2,685	228,225,000	
日清食品ホールディングス	67,800	3,320	225,096,000	
永谷園	19,000	859	16,321,000	
フジッコ	23,000	1,157	26,611,000	
ロック・フィールド	9,500	1,161	11,029,500	
日本たばこ産業	4,726	308,000	1,455,608,000	
わらべや日洋	10,800	1,613	17,420,400	
なとり	9,200	705	6,486,000	
ミヨシ油脂	68,000	127	8,636,000	
片倉工業	22,900	900	20,610,000	
グンゼ	149,000	281	41,869,000	
川島織物セルコン	72,000	61	4,392,000	
東洋紡績	661,000	135	89,235,000	
ユニチカ	452,000	64	28,928,000	
富士紡ホールディングス	86,000	100	8,600,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日清紡績	141,000	639	90,099,000	
倉敷紡績	205,000	140	28,700,000	
大和紡績	130,000	360	46,800,000	
シキボウ	130,000	126	16,380,000	
日本毛織	73,000	645	47,085,000	
大東紡績	33,000	55	1,815,000	
トーア紡コーポレーション	75,000	61	4,575,000	
ダイドーリミテッド	26,900	722	19,421,800	
御幸ホールディングス	20,000	197	3,940,000	
帝国繊維	21,000	349	7,329,000	
帝人	815,000	254	207,010,000	
東レ	1,325,000	429	568,425,000	
三菱レイヨン	496,000	241	119,536,000	
サカイオーベックス	58,000	78	4,524,000	
住江織物	50,000	140	7,000,000	
日本フェルト	15,600	401	6,255,600	
イチカワ	19,000	303	5,757,000	
日本バイリーン	27,000	409	11,043,000	
日東製網	25,000	67	1,675,000	
芦森工業	47,000	88	4,136,000	
アツギ	186,000	126	23,436,000	
ダイニック	39,000	110	4,290,000	
セーレン	49,700	424	21,072,800	
東海染工	30,000	69	2,070,000	
小松精練	34,000	418	14,212,000	
ワコールホールディングス	119,000	1,271	151,249,000	
ホギメディカル	9,700	5,500	53,350,000	
サンエー・インターナショナル	8,600	975	8,385,000	
レナウン	35,000	121	4,235,000	
クラウディア	2,500	1,000	2,500,000	
三陽商会	97,000	419	40,643,000	
ナイガイ	65,000	35	2,275,000	
オンワードホールディングス	133,000	731	97,223,000	
シルバーオックス	22,000	51	1,122,000	
ルック	33,000	77	2,541,000	
ゴールドウイン	46,000	142	6,532,000	
東京スタイル	70,000	662	46,340,000	
デサント	55,000	460	25,300,000	
ヤマトインターナショナル	13,400	437	5,855,800	
特種東海ホールディングス	141,000	263	37,083,000	
王子製紙	817,000	494	403,598,000	
三菱製紙	294,000	196	57,624,000	
北越製紙	118,000	511	60,298,000	
中越パルプ工業	86,000	184	15,824,000	
大王製紙	86,000	1,063	91,418,000	
日本製紙グループ本社	928	346,000	321,088,000	
レンゴー	156,000	672	104,832,000	
トーモク	73,000	175	12,775,000	
ザ・バック	13,900	1,263	17,555,700	
クラレ	294,000	723	212,562,000	
旭化成	1,243,000	372	462,396,000	
共和レザー	12,800	520	6,656,000	
コープケミカル	26,000	198	5,148,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
昭和電工	1,032,000	140	144,480,000	
住友化学	1,467,000	314	460,638,000	
日本化成	37,000	125	4,625,000	
住友精化	37,000	263	9,731,000	
日産化学工業	139,000	875	121,625,000	
ラサ工業	80,000	121	9,680,000	
クレハ	130,000	445	57,850,000	
テイカ	33,000	209	6,897,000	
石原産業	310,000	65	20,150,000	
片倉チッカリン	15,000	320	4,800,000	
日本曹達	119,000	345	41,055,000	
東ソー	533,000	188	100,204,000	
トクヤマ	244,000	763	186,172,000	
セントラル硝子	206,000	329	67,774,000	
東亜合成	218,000	265	57,770,000	
ダイソー	79,000	232	18,328,000	
関東電化工業	44,000	235	10,340,000	
電気化学工業	418,000	217	90,706,000	
信越化学工業	331,900	4,020	1,334,238,000	
日本カーバイド工業	44,000	83	3,652,000	
堺化学工業	68,000	227	15,436,000	
エア・ウォーター	142,000	816	115,872,000	
大陽日酸	310,000	628	194,680,000	
日本化学工業	69,000	166	11,454,000	
日本パーカライジング	47,000	825	38,775,000	
高圧ガス工業	30,000	477	14,310,000	
チタン工業	25,000	99	2,475,000	
四国化成工業	29,000	324	9,396,000	
戸田工業	31,000	184	5,704,000	
ステラ ケミファ	9,400	970	9,118,000	
保土谷化学工業	50,000	163	8,150,000	
日本触媒	133,000	620	82,460,000	
大日精化工業	71,000	246	17,466,000	
カネカ	248,000	476	118,048,000	
三菱瓦斯化学	343,000	323	110,789,000	
三井化学	608,000	359	218,272,000	
J S R	181,400	992	179,948,800	
東京応化工業	39,500	1,379	54,470,500	
三菱ケミカルホールディングス	1,157,000	419	484,783,000	
日本合成化学工業	52,000	227	11,804,000	
ダイセル化学工業	259,000	423	109,557,000	
住友ベークライト	204,000	306	62,424,000	
積水化学工業	446,000	524	233,704,000	
日本ゼオン	172,000	266	45,752,000	
アイカ工業	61,900	917	56,762,300	
宇部興産	835,000	197	164,495,000	
積水樹脂	31,000	658	20,398,000	
タキロン	47,000	290	13,630,000	
旭有機材工業	71,000	274	19,454,000	
日立化成工業	88,000	964	84,832,000	
ニチバン	22,000	296	6,512,000	
リケンテクノス	35,000	172	6,020,000	
大倉工業	48,000	207	9,936,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
積水化成品工業	54,000	308	16,632,000	
群栄化学工業	53,000	203	10,759,000	
タイガースポリマー	10,100	378	3,817,800	
日本カーリット	15,800	371	5,861,800	
日本化薬	151,000	466	70,366,000	
日本精化	16,500	430	7,095,000	
A D E K A	85,700	631	54,076,700	
日油	177,000	301	53,277,000	
ハリマ化成	17,000	395	6,715,000	
花王	511,000	2,710	1,384,810,000	
第一工業製薬	33,000	169	5,577,000	
三洋化成工業	63,000	528	33,264,000	
大日本塗料	114,000	93	10,602,000	
日本ペイント	220,000	338	74,360,000	
関西ペイント	225,000	429	96,525,000	
トウベ	17,000	70	1,190,000	
中国塗料	57,000	453	25,821,000	
日本特殊塗料	17,000	371	6,307,000	
藤倉化成	23,200	426	9,883,200	
太陽インキ製造	15,100	1,506	22,740,600	
D I C	656,000	158	103,648,000	
サカタインクス	41,000	321	13,161,000	
東洋インキ製造	197,000	265	52,205,000	
富士フイルムホールディングス	486,500	2,175	1,058,137,500	
資生堂	339,000	1,721	583,419,000	
ライオン	230,000	531	122,130,000	
高砂香料工業	71,000	597	42,387,000	
マンダム	20,000	2,550	51,000,000	
ミルボン	8,200	2,550	20,910,000	
ファンケル	37,300	1,177	43,902,100	
コーセー	32,200	2,285	73,577,000	
ドクターシーラボ	132	166,900	22,030,800	
エステー	13,900	1,140	15,846,000	
コニシ	15,600	770	12,012,000	
長谷川香料	22,700	1,239	28,125,300	
小林製薬	27,600	3,780	104,328,000	
荒川化学工業	16,700	930	15,531,000	
メック	13,200	338	4,461,600	
日本高純度化学	52	196,500	10,218,000	
荏原ユーザライト	2,100	1,776	3,729,600	
アース製薬	15,400	2,680	41,272,000	
イハラケミカル工業	37,000	249	9,213,000	
北興化学工業	21,000	296	6,216,000	
大成ラミック	5,700	1,999	11,394,300	
クミアイ化学工業	51,000	270	13,770,000	
日本農薬	46,000	603	27,738,000	
アキレス	163,000	125	20,375,000	
有沢製作所	28,000	349	9,772,000	
日東電工	174,500	1,613	281,468,500	
スルガ	5,100	940	4,794,000	
アロン化成	15,000	295	4,425,000	
きもと	17,600	288	5,068,800	
シーアイ化成	18,000	235	4,230,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
藤森工業	13,300	646	8,591,800	
前澤化成工業	16,500	750	12,375,000	
J S P	13,400	568	7,611,200	
エフピコ	9,900	4,450	44,055,000	
天馬	16,600	1,485	24,651,000	
信越ポリマー	39,500	405	15,997,500	
東リ	62,000	183	11,346,000	
ニフコ	41,300	956	39,482,800	
日本バルカー工業	78,000	239	18,642,000	
日本マタイ	33,000	131	4,323,000	
ユニ・チャーム	40,800	6,870	280,296,000	
協和発酵キリン	272,000	902	245,344,000	
武田薬品工業	722,400	4,510	3,258,024,000	代用有価証券で 200,000株 担保差入
アステラス製薬	446,600	3,600	1,607,760,000	
大日本住友製薬	141,000	819	115,479,000	
塩野義製薬	290,000	2,075	601,750,000	
田辺三菱製薬	199,000	1,221	242,979,000	
わかもと製薬	23,000	354	8,142,000	
あすか製薬	22,000	756	16,632,000	
日本新薬	50,000	1,080	54,000,000	
中外製薬	264,500	1,522	402,569,000	
科研製薬	84,000	969	81,396,000	
エーザイ	245,300	3,450	846,285,000	
ロート製薬	91,000	1,230	111,930,000	
小野薬品工業	100,000	4,740	474,000,000	
久光製薬	61,800	3,640	224,952,000	
有機合成薬品工業	16,000	490	7,840,000	
持田製薬	82,000	1,078	88,396,000	
大正製薬	189,000	1,852	350,028,000	
参天製薬	61,600	2,560	157,696,000	
エスエス製薬	51,000	649	33,099,000	
扶桑薬品工業	67,000	233	15,611,000	
日本ケミファ	32,000	274	8,768,000	
ツムラ	58,500	3,230	188,955,000	
キッセイ薬品工業	40,000	2,440	97,600,000	
生化学工業	38,100	973	37,071,300	
栄研化学	12,900	647	8,346,300	
日水製薬	8,000	704	5,632,000	
鳥居薬品	11,900	1,373	16,338,700	
東和薬品	8,100	3,850	31,185,000	
沢井製薬	13,000	4,390	57,070,000	
ゼリア新薬工業	29,000	1,011	29,319,000	
第一三共	586,400	1,871	1,097,154,400	
キョーリン	49,000	1,059	51,891,000	
新日本石油	1,384,000	393	543,912,000	
昭和シェル石油	155,900	836	130,332,400	
コスモ石油	551,000	254	139,954,000	
ニチレキ	30,000	295	8,850,000	
東燃ゼネラル石油	301,000	890	267,890,000	
ユシロ化学工業	10,200	1,472	15,014,400	
ピーピー・カストロール	9,100	245	2,229,500	
新日鉱ホールディングス	823,000	331	272,413,000	

[次へ](#)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
AOCホールディングス	47,400	454	21,519,600	
出光興産	23,600	5,210	122,956,000	
横浜ゴム	243,000	463	112,509,000	
東洋ゴム工業	203,000	169	34,307,000	
ブリヂストン	624,500	1,537	959,856,500	
住友ゴム工業	170,900	840	143,556,000	
藤倉ゴム工業	12,800	280	3,584,000	
オカモト	83,000	325	26,975,000	
フコク	9,400	510	4,794,000	
ニッタ	18,000	1,175	21,150,000	
東海ゴム工業	37,000	755	27,935,000	
三ツ星ベルト	61,000	520	31,720,000	
バンドー化学	73,000	217	15,841,000	
日東紡績	195,000	144	28,080,000	
旭硝子	982,000	509	499,838,000	
日本板硝子	633,000	306	193,698,000	
石塚硝子	35,000	137	4,795,000	
日本山村硝子	96,000	196	18,816,000	
日本電気硝子	323,000	497	160,531,000	
オハラ	9,900	824	8,157,600	
住友大阪セメント	383,000	219	83,877,000	
太平洋セメント	786,000	152	119,472,000	
デイ・シイ	22,300	233	5,195,900	
日本ヒューム	21,000	284	5,964,000	
日本コンクリート工業	44,000	112	4,928,000	
東海カーボン	173,000	326	56,398,000	
日本カーボン	101,000	222	22,422,000	
東洋炭素	8,600	3,890	33,454,000	
ノリタケカンパニーリミテド	105,000	344	36,120,000	
TOTO	307,000	574	176,218,000	
日本碍子	239,000	985	235,415,000	
日本特殊陶業	176,000	733	129,008,000	
ダントーホールディングス	49,000	80	3,920,000	
MARUWA	6,000	977	5,862,000	
日本セラテック	35	40,950	1,433,250	
品川白煉瓦	61,000	180	10,980,000	
黒崎播磨	54,000	241	13,014,000	
東京窯業	32,000	223	7,136,000	
ニッカトー	10,700	437	4,675,900	
フジミインコーポレーテッド	20,600	1,088	22,412,800	
ニチアス	105,000	221	23,205,000	
ニチハ	25,500	493	12,571,500	
新日本製鐵	5,228,000	303	1,584,084,000	
住友金属工業	3,407,000	231	787,017,000	
神戸製鋼所	2,761,000	161	444,521,000	
日新製鋼	764,000	159	121,476,000	
中山製鋼所	110,000	248	27,280,000	
合同製鐵	123,000	257	31,611,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	508,200	2,655	1,349,271,000	
東京製鐵	82,500	890	73,425,000	
共英製鋼	16,800	1,756	29,500,800	
大和工業	46,800	2,575	120,510,000	
東京鐵鋼	40,000	220	8,800,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
大阪製鐵	13,700	1,149	15,741,300	
淀川製鋼所	153,000	408	62,424,000	
東洋鋼鋳	42,000	397	16,674,000	
住友鋼管	14,100	636	8,967,600	
丸一鋼管	55,500	2,625	145,687,500	
モリ工業	36,000	217	7,812,000	
大同特殊鋼	308,000	290	89,320,000	
日本高周波鋼業	82,000	90	7,380,000	
日本金属工業	139,000	106	14,734,000	
日本冶金工業	111,500	263	29,324,500	
山陽特殊製鋼	100,000	269	26,900,000	
愛知製鋼	107,000	316	33,812,000	
日立金属	135,000	530	71,550,000	
日本金属	54,000	128	6,912,000	
太平洋金属	139,000	421	58,519,000	
日本電工	78,000	493	38,454,000	
日本鑄鉄管	23,000	115	2,645,000	
三菱製鋼	122,000	238	29,036,000	
日亜鋼業	32,000	234	7,488,000	
日本精線	17,000	213	3,621,000	
シンニッタン	18,700	355	6,638,500	
新家工業	58,000	142	8,236,000	
日本軽金属	487,000	87	42,369,000	
大紀アルミニウム工業所	34,000	181	6,154,000	
三井金属鋁業	575,000	186	106,950,000	
東邦亜鉛	106,000	217	23,002,000	
三菱マテリアル	1,209,000	211	255,099,000	
住友金属鋁山	515,000	885	455,775,000	
DOWAホールディングス	251,000	289	72,539,000	
古河機械金属	338,000	95	32,110,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,600	2,350	46,060,000	
東邦チタニウム	32,700	1,022	33,419,400	
住友軽金属工業	286,000	83	23,738,000	
古河スカイ	96,000	187	17,952,000	
古河電気工業	626,000	448	280,448,000	
住友電気工業	656,700	753	494,495,100	
フジクラ	298,000	299	89,102,000	
三菱電線工業	129,000	84	10,836,000	
昭和電線ホールディングス	255,000	64	16,320,000	
東京特殊電線	28,000	77	2,156,000	
タツタ電線	51,000	258	13,158,000	
日立電線	162,000	207	33,534,000	
沖電線	22,000	145	3,190,000	
カナレ電気	2,400	969	2,325,600	
平河ヒューテック	5,800	889	5,156,200	
リョービ	122,000	197	24,034,000	
アサヒブリテック	28,100	1,244	34,956,400	
稲葉製作所	9,700	1,000	9,700,000	
三協・立山ホールディングス	270,000	92	24,840,000	
トーカロ	12,600	718	9,046,800	
アルファC o	6,700	598	4,006,600	
SUMCO	106,600	964	102,762,400	
東洋製罐	153,600	1,548	237,772,800	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ホッカンホールディングス	48,000	248	11,904,000	
コロナ	9,200	929	8,546,800	
横河ブリッジホールディングス	40,000	768	30,720,000	
松尾橋梁	53,000	63	3,339,000	
駒井鉄工	40,000	148	5,920,000	
ハルテック	40,000	61	2,440,000	
高田機工	25,000	119	2,975,000	
三和ホールディングス	204,000	343	69,972,000	
文化シャッター	57,000	377	21,489,000	
川田工業	71,000	103	7,313,000	
東洋シャッター	8,000	648	5,184,000	
住生活グループ	240,400	1,308	314,443,200	
日本フィルコン	14,600	478	6,978,800	
ノーリツ	34,900	1,098	38,320,200	
長府製作所	22,200	2,030	45,066,000	
リンナイ	38,400	3,530	135,552,000	
ダイニチ工業	11,600	560	6,496,000	
日東精工	27,000	288	7,776,000	
三洋工業	44,000	142	6,248,000	
岡部	44,100	400	17,640,000	
中国工業	29,000	85	2,465,000	
東プレ	41,500	773	32,079,500	
高周波熱錬	29,200	553	16,147,600	
東京製綱	152,000	207	31,464,000	
パイオラックス	8,500	1,409	11,976,500	
日本発條	130,000	300	39,000,000	
中央発條	26,000	233	6,058,000	
アドバネクス	37,000	83	3,071,000	
三益半導体工業	16,800	872	14,649,600	
アタカ大機	15,000	186	2,790,000	
日本製鋼所	285,000	947	269,895,000	
日立ツール	11,500	757	8,705,500	
三浦工業	29,700	2,100	62,370,000	
タクマ	78,000	149	11,622,000	
ツガミ	57,000	164	9,348,000	
オークマ	120,000	320	38,400,000	
東芝機械	109,000	244	26,596,000	
アマダ	310,000	404	125,240,000	
アイダエンジニアリング	51,700	341	17,629,700	
牧野フライス製作所	93,000	216	20,088,000	
オーエスジー	82,000	712	58,384,000	
ダイジェット工業	24,000	201	4,824,000	
旭ダイヤモンド工業	50,000	575	28,750,000	
森精機製作所	85,500	755	64,552,500	
ディスコ	18,100	1,639	29,665,900	
日東工器	11,700	1,587	18,567,900	
豊和工業	113,000	66	7,458,000	
大阪機工	67,000	103	6,901,000	
東洋機械金属	12,800	173	2,214,400	
オーエム製作所	18,000	313	5,634,000	
津田駒工業	49,000	88	4,312,000	
島精機製作所	23,800	1,721	40,959,800	
日本スピンドル製造	26,000	159	4,134,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日阪製作所	21,000	1,059	22,239,000	
やまびこ	5,412	723	3,912,876	
ペガサスミシン製造	17,300	197	3,408,100	
ナブテスコ	83,000	469	38,927,000	
三井海洋開発	13,300	1,415	18,819,500	
レオン自動機	21,000	248	5,208,000	
SMC	59,400	8,620	512,028,000	
新川	17,800	1,138	20,256,400	
ホソカワミクロン	31,000	360	11,160,000	
ユニオンツール	11,000	1,818	19,998,000	
オイレス工業	23,100	1,383	31,947,300	
サトー	21,200	1,128	23,913,600	
日本エアーテック	6,100	365	2,226,500	
日精樹脂工業	16,100	256	4,121,600	
ワイエイシイ	8,600	315	2,709,000	
小松製作所	885,100	1,101	974,495,100	
住友重機械工業	512,000	326	166,912,000	
日立建機	101,700	1,068	108,615,600	
日工	27,000	258	6,966,000	
巴工業	7,600	825	6,270,000	
井関農機	201,000	187	37,587,000	
TOWA	17,700	167	2,955,900	
丸山製作所	45,000	137	6,165,000	
北川鉄工所	91,000	115	10,465,000	
クボタ	912,000	595	542,640,000	
荏原実業	4,700	1,010	4,747,000	
三菱化工機	61,000	212	12,932,000	
月島機械	30,000	629	18,870,000	
帝国電機製作所	7,300	975	7,117,500	
東京機械製作所	59,000	161	9,499,000	
新東工業	40,300	583	23,494,900	
澁谷工業	11,200	790	8,848,000	
アイチ コーポレーション	32,900	320	10,528,000	
小森コーポレーション	56,500	1,081	61,076,500	
鶴見製作所	15,000	656	9,840,000	
住友精密工業	35,000	344	12,040,000	
酒井重工業	38,000	159	6,042,000	
荏原製作所	425,000	166	70,550,000	
石井鐵工所	29,000	156	4,524,000	
西島製作所	17,800	818	14,560,400	
ダイキン工業	207,800	2,170	450,926,000	
オルガノ	34,000	542	18,428,000	
トーヨーカネツ	124,000	177	21,948,000	
栗田工業	109,800	2,480	272,304,000	
椿本チエイン	102,000	241	24,582,000	
大同工業	37,000	162	5,994,000	
TCM	50,000	140	7,000,000	
日本コンベヤ	69,000	84	5,796,000	
木村化工機	18,300	633	11,583,900	
アネスト岩田	38,000	288	10,944,000	
ダイフク	80,500	531	42,745,500	
加藤製作所	43,000	232	9,976,000	
油研工業	35,000	193	6,755,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
タダノ	92,000	481	44,252,000	
フジテック	59,000	312	18,408,000	
シーケーディ	53,700	305	16,378,500	
キトー	44	74,900	3,295,600	
平和	51,900	940	48,786,000	
理想科学工業	15,800	1,179	18,628,200	
SANKYO	51,900	4,490	233,031,000	
日本金銭機械	21,600	735	15,876,000	
マースエンジニアリング	11,000	2,655	29,205,000	
福島工業	5,900	758	4,472,200	
キャノンファインテック	18,100	944	17,086,400	
オーイズミ	8,800	209	1,839,200	
ダイコク電機	8,300	1,149	9,536,700	
アマノ	58,200	794	46,210,800	
JUKI	100,000	100	10,000,000	
サンデン	108,000	245	26,460,000	
蛇の目ミシン工業	190,000	40	7,600,000	
マックス	33,000	977	32,241,000	
グローリー	60,200	1,704	102,580,800	
大和冷機工業	31,000	310	9,610,000	
セガサミーホールディングス	217,500	1,038	225,765,000	
日本ピストンリング	75,000	90	6,750,000	
リケン	88,000	213	18,744,000	
帝国ピストンリング	23,200	388	9,001,600	
大豊工業	15,100	415	6,266,500	
日本精工	391,000	343	134,113,000	
NTN	334,000	272	90,848,000	
ジェイテクト	189,900	653	124,004,700	
不二越	192,000	177	33,984,000	
日本トムソン	61,000	347	21,167,000	
THK	118,600	906	107,451,600	
ユーシン精機	8,500	835	7,097,500	
前澤給装工業	9,600	1,345	12,912,000	
イーグル工業	24,000	289	6,936,000	
前澤工業	15,200	203	3,085,600	
日本ピラー工業	21,000	295	6,195,000	
キッツ	89,000	274	24,386,000	
日立工機	65,600	691	45,329,600	
マキタ	119,100	1,767	210,449,700	
日立造船	846,500	82	69,413,000	
三菱重工業	3,388,000	403	1,365,364,000	
IHI	1,300,000	111	144,300,000	
イビデン	133,700	1,630	217,931,000	
コニカミノルタホールディングス	502,500	730	366,825,000	
ブラザー工業	229,600	740	169,904,000	
ミネベア	283,000	288	81,504,000	
日立製作所	3,184,000	424	1,350,016,000	
東芝	2,869,000	327	938,163,000	
三菱電機	1,776,000	500	888,000,000	
富士電機ホールディングス	441,000	124	54,684,000	
東洋電機製造	33,000	337	11,121,000	
安川電機	209,000	343	71,687,000	
神鋼電機	121,000	276	33,396,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
明電舎	175,000	227	39,725,000	
オリジン電気	27,000	202	5,454,000	
デンヨー	19,500	730	14,235,000	
東芝テック	138,000	262	36,156,000	
芝浦メカトロニクス	34,000	392	13,328,000	
マブチモーター	29,800	4,010	119,498,000	
日本電産	94,300	3,970	374,371,000	
高岳製作所	75,000	120	9,000,000	
ダイヘン	96,000	331	31,776,000	
JVC・ケンウッド・ホールディングス	718,300	35	25,140,500	
日新電機	46,000	427	19,642,000	
大崎電気工業	30,000	555	16,650,000	
オムロン	226,000	1,230	277,980,000	
日東工業	28,600	853	24,395,800	
I D E C	25,000	899	22,475,000	
エルピーダメモリ	84,400	461	38,908,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	304,000	351	106,704,000	
サクサホールディングス	61,000	104	6,344,000	
メルコホールディングス	12,000	1,068	12,816,000	
テクノメディカ	14	192,300	2,692,200	
日本電気	1,919,000	264	506,616,000	
富士通	1,957,000	446	872,822,000	
沖電気工業	606,000	61	36,966,000	
岩崎通信機	84,000	73	6,132,000	
電気興業	50,000	589	29,450,000	
サンケン電気	111,000	355	39,405,000	
エプソントヨコム	68,000	169	11,492,000	
ナカヨ通信機	31,000	147	4,557,000	
アイホン	13,700	1,596	21,865,200	
NECエレクトロニクス	36,500	834	30,441,000	
セイコーエプソン	139,200	1,388	193,209,600	
ワコム	379	95,300	36,118,700	
アルバック	30,400	1,070	32,528,000	
ナナオ	16,100	1,530	24,633,000	
日本信号	48,000	583	27,984,000	
京三製作所	45,000	312	14,040,000	
能美防災	25,000	1,000	25,000,000	
ホーチキ	19,000	637	12,103,000	
マスプロ電工	15,700	839	13,172,300	
日本無線	88,000	134	11,792,000	
パナソニック	2,029,000	1,066	2,162,914,000	
シャープ	919,000	650	597,350,000	
アンリツ	91,000	231	21,021,000	
富士通ゼネラル	54,000	157	8,478,000	
日立国際電気	56,000	427	23,912,000	
ソニー	1,008,900	1,917	1,934,061,300	
NEC トーキン	61,000	232	14,152,000	
TDK	99,500	2,915	290,042,500	
帝国通信工業	46,000	197	9,062,000	
三洋電機	1,881,000	150	282,150,000	
ミツミ電機	67,200	1,330	89,376,000	
タムラ製作所	59,000	157	9,263,000	
アルプス電気	160,900	417	67,095,300	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
池上通信機	77,000	77	5,929,000	
パイオニア	148,900	155	23,079,500	
日本電波工業	14,900	1,101	16,404,900	
日本トリム	2,800	2,260	6,328,000	
ローランド ディー. ジー.	8,500	1,153	9,800,500	
フォスター電機	18,800	773	14,532,400	
クラリオン	94,000	71	6,674,000	
SMK	57,000	270	15,390,000	
ヨコオ	16,100	442	7,116,200	
東光	88,000	101	8,888,000	
ティアック	104,000	35	3,640,000	
ホシデン	47,300	1,207	57,091,100	
ヒロセ電機	33,100	9,480	313,788,000	
日本航空電子工業	44,000	392	17,248,000	
TOA	23,000	485	11,155,000	
日立マクセル	41,700	793	33,068,100	
ユニデン	59,000	164	9,676,000	
アルパイン	41,900	600	25,140,000	
スミダ コーポレーション	13,400	436	5,842,400	
島田理化工業	10,200	109	1,111,800	
アイコム	10,900	1,912	20,840,800	
船井電機	17,500	1,279	22,382,500	
横河電機	206,300	558	115,115,400	
新電元工業	68,000	165	11,220,000	
山武	48,800	2,030	99,064,000	
日本光電工業	37,900	1,804	68,371,600	
チノー	37,000	216	7,992,000	
共和電業	20,000	306	6,120,000	
日本電子材料	7,500	334	2,505,000	
堀場製作所	27,700	1,200	33,240,000	
アドバンテスト	129,700	1,267	164,329,900	
小野測器	22,000	402	8,844,000	
エスベック	18,300	620	11,346,000	
サンクス	17,200	297	5,108,400	
キーエンス	35,600	16,650	592,740,000	
日置電機	9,100	1,720	15,652,000	
シスメックス	36,300	3,240	117,612,000	
メガチップス	17,500	1,517	26,547,500	
O B A R A	12,500	563	7,037,500	
日本電産コパル電子	21,400	500	10,700,000	
ミヤチテクノス	9,400	471	4,427,400	
東京電波	5,800	494	2,865,200	
澤藤電機	11,000	170	1,870,000	
コーセル	25,600	726	18,585,600	
日立メディコ	14,000	875	12,250,000	
新日本無線	14,000	180	2,520,000	
オブテックス	13,000	783	10,179,000	
千代田インテグレ	11,800	1,108	13,074,400	
東光電気	14,000	210	2,940,000	
スタンレー電気	133,500	1,072	143,112,000	
岩崎電気	65,000	119	7,735,000	
ウシオ電機	107,200	1,106	118,563,200	
岡谷電機産業	11,000	290	3,190,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
フェニックス電機	16,900	137	2,315,300	
日本セラミック	14,200	850	12,070,000	
新神戸電機	18,000	680	12,240,000	
日本デジタル研究所	18,100	959	17,357,900	
古河電池	14,000	835	11,690,000	
双信電機	9,800	300	2,940,000	
山一電機	16,500	244	4,026,000	
図研	13,400	625	8,375,000	
日本電子	70,000	280	19,600,000	
カシオ計算機	181,300	560	101,528,000	
ファナック	184,000	5,830	1,072,720,000	
日本シイエムケイ	37,700	343	12,931,100	
エンプラス	13,400	931	12,475,400	
ローム	98,300	4,040	397,132,000	
浜松ホトニクス	69,300	1,819	126,056,700	
三井ハイテック	25,100	461	11,571,100	
新光電気工業	55,900	558	31,192,200	
京セラ	169,500	6,600	1,118,700,000	
日本インター	20,500	111	2,275,500	
太陽誘電	93,000	500	46,500,000	
村田製作所	212,900	3,200	681,280,000	
ユーシン	22,800	395	9,006,000	
双葉電子工業	33,700	1,191	40,136,700	
北陸電気工業	89,000	190	16,910,000	
パナソニック電工	311,000	822	255,642,000	
ニチコン	62,000	525	32,550,000	
日本ケミコン	98,000	195	19,110,000	
KOA	28,600	550	15,730,000	
市光工業	49,000	129	6,321,000	
小糸製作所	95,000	586	55,670,000	
ミツバ	35,000	306	10,710,000	
アロカ	11,800	690	8,142,000	
スター精密	37,900	919	34,830,100	
大日本スクリーン製造	210,000	152	31,920,000	
キャノン電子	17,300	1,274	22,040,200	
キャノン	1,103,100	2,770	3,055,587,000	
リコー	616,000	1,032	635,712,000	
日本電産サンキョー	61,000	383	23,363,000	
MUTOHホールディングス	26,000	229	5,954,000	
東京エレクトロン	138,700	2,715	376,570,500	
トヨタ紡織	66,500	763	50,739,500	
鬼怒川ゴム工業	48,000	118	5,664,000	
ユニプレス	26,400	730	19,272,000	
豊田自動織機	154,000	1,849	284,746,000	
モリタホールディングス	30,000	398	11,940,000	
三櫻工業	24,200	408	9,873,600	
デンソー	417,800	1,532	640,069,600	
東海理化電機製作所	50,100	777	38,927,700	
三井造船	687,000	135	92,745,000	
佐世保重工業	115,000	148	17,020,000	
川崎重工業	1,578,000	191	301,398,000	
日本車輛製造	87,000	273	23,751,000	
日本輸送機	22,000	208	4,576,000	

[次へ](#)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
近畿車輛	33,000	512	16,896,000	
日産自動車	2,403,800	344	826,907,200	
いすゞ自動車	902,000	120	108,240,000	
トヨタ自動車	2,444,500	2,930	7,162,385,000	代用有価証券で 500,000株 担保差入
日野自動車	272,000	188	51,136,000	
三菱自動車工業	4,253,000	129	548,637,000	
エフテック	6,700	434	2,907,800	
武蔵精密工業	18,500	870	16,095,000	
トヨタ車体	41,500	1,417	58,805,500	
日産車体	66,000	537	35,442,000	
関東自動車工業	29,500	1,235	36,432,500	
新明和工業	85,000	220	18,700,000	
極東開発工業	37,900	324	12,279,600	
日信工業	34,800	652	22,689,600	
トピー工業	171,000	170	29,070,000	
ティラド	58,000	148	8,584,000	
曙ブレーキ工業	52,500	569	29,872,500	
タチエス	24,900	384	9,561,600	
NOK	102,300	622	63,630,600	
フタバ産業	40,500	326	13,203,000	
カヤバ工業	141,000	189	26,649,000	
シロキ工業	37,000	183	6,771,000	
大同メタル工業	34,000	239	8,126,000	
プレス工業	74,000	118	8,732,000	
カルソニックカンセイ	116,000	137	15,892,000	
太平洋工業	39,000	279	10,881,000	
ケーヒン	43,800	730	31,974,000	
河西工業	26,000	173	4,498,000	
アイシン精機	174,100	1,300	226,330,000	
富士機工	27,000	96	2,592,000	
マツダ	754,000	157	118,378,000	
ダイハツ工業	202,000	819	165,438,000	
愛知機械工業	48,000	194	9,312,000	
今仙電機製作所	13,700	595	8,151,500	
本田技研工業	1,626,000	2,035	3,308,910,000	
スズキ	384,700	1,230	473,181,000	
富士重工業	648,000	276	178,848,000	
ヤマハ発動機	220,100	851	187,305,100	
ショーワ	40,500	348	14,094,000	
TBK	21,000	155	3,255,000	
エクセディ	23,000	943	21,689,000	
豊田合成	53,800	1,088	58,534,400	
愛三工業	23,000	472	10,856,000	
ヨロズ	12,700	795	10,096,500	
エフ・シー・シー	28,000	789	22,092,000	
シマノ	73,700	3,750	276,375,000	
タカタ	33,900	711	24,102,900	
テイ・エス テック	30,600	564	17,258,400	
日本電産トソク	6,600	730	4,818,000	
テルモ	137,000	4,500	616,500,000	
クリエートメディック	5,800	799	4,634,200	
日機装	56,000	527	29,512,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
島津製作所	210,000	631	132,510,000	
JMS	31,000	336	10,416,000	
モリテックス	11,300	412	4,655,600	
長野計器	11,400	891	10,157,400	
東京計器	66,000	112	7,392,000	
愛知時計電機	33,000	205	6,765,000	
東京精密	35,700	839	29,952,300	
ニコン	332,000	1,041	345,612,000	
トプコン	43,900	397	17,428,300	
オリンパス	208,000	1,946	404,768,000	
理研計器	15,400	559	8,608,600	
タムロン	16,700	872	14,562,400	
HOYA	436,900	1,424	622,145,600	
ノーリツ鋼機	17,700	618	10,938,600	
エー・アンド・デイ	16,000	255	4,080,000	
日本電産コパル	18,600	725	13,485,000	
シチズンホールディングス	247,200	400	98,880,000	
リズム時計工業	95,000	85	8,075,000	
セイコーホールディングス	70,000	187	13,090,000	
ニプロ	45,000	1,510	67,950,000	
SRIスポーツ	122	100,900	12,309,800	
バンダイナムコホールディングス	206,800	1,036	214,244,800	
共立印刷	16,900	155	2,619,500	
フランスベッドホールディングス	129,000	137	17,673,000	
パイロットコーポレーション	180	146,400	26,352,000	
トッパン・フォームズ	40,800	1,161	47,368,800	
フジシールインターナショナル	21,300	1,503	32,013,900	
タカラトミー	57,200	579	33,118,800	
廣済堂	18,100	235	4,253,500	
アーケ	56,600	123	6,961,800	
タカノ	7,600	421	3,199,600	
プロネクス	23,300	780	18,174,000	
ホクシン	29,700	129	3,831,300	
ウッドワン	43,000	305	13,115,000	
大建工業	97,000	176	17,072,000	
凸版印刷	579,000	674	390,246,000	
大日本印刷	579,000	1,007	583,053,000	
図書印刷	41,000	240	9,840,000	
共同印刷	64,000	219	14,016,000	
日本写真印刷	29,300	3,950	115,735,000	
光村印刷	18,000	315	5,670,000	
宝印刷	9,200	830	7,636,000	
コンビ	12,000	510	6,120,000	
アシックス	189,000	625	118,125,000	
ツツミ	7,200	1,640	11,808,000	
ローランド	13,800	1,170	16,146,000	
小松ウオール工業	7,300	1,130	8,249,000	
ヤマハ	151,500	895	135,592,500	
河合楽器製作所	73,000	81	5,913,000	
クリナップ	26,300	401	10,546,300	
ピジョン	12,000	2,785	33,420,000	
パラマウントベッド	18,900	1,216	22,982,400	
キングジム	15,700	810	12,717,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
リンテック	36,300	1,170	42,471,000	
イトーキ	40,700	289	11,762,300	
任天堂	100,400	35,850	3,599,340,000	
三菱鉛筆	18,200	1,008	18,345,600	
タカラスタンダード	91,000	556	50,596,000	
コクヨ	99,200	664	65,868,800	
ナカバヤシ	44,000	172	7,568,000	
ダイワ精工	96,000	130	12,480,000	
サンウエーブ工業	44,000	147	6,468,000	
岡村製作所	80,000	456	36,480,000	
美津濃	95,000	438	41,610,000	
アデランスホールディングス	22,500	880	19,800,000	
東京電力	1,198,900	2,955	3,542,749,500	代用有価証券で 300,000株 担保差入
中部電力	644,300	2,730	1,758,939,000	
関西電力	789,700	2,635	2,080,859,500	
中国電力	285,000	2,330	664,050,000	
北陸電力	195,300	2,425	473,602,500	
東北電力	475,400	2,410	1,145,714,000	
四国電力	201,100	3,020	607,322,000	
九州電力	420,200	2,355	989,571,000	
北海道電力	178,100	2,270	404,287,000	
沖縄電力	13,500	6,340	85,590,000	
電源開発	137,800	3,530	486,434,000	
東京瓦斯	2,408,000	471	1,134,168,000	
大阪瓦斯	2,040,000	406	828,240,000	
東邦瓦斯	496,000	593	294,128,000	
北海道瓦斯	38,000	259	9,842,000	
西部瓦斯	215,000	238	51,170,000	
静岡瓦斯	58,500	517	30,244,500	
東武鉄道	812,000	511	414,932,000	
相模鉄道	255,000	397	101,235,000	
東京急行電鉄	1,045,000	380	397,100,000	
京浜急行電鉄	476,000	792	376,992,000	
小田急電鉄	610,000	727	443,470,000	
京王電鉄	494,000	507	250,458,000	
京成電鉄	306,000	526	160,956,000	
富士急行	52,000	410	21,320,000	
新京成電鉄	25,000	350	8,750,000	
東日本旅客鉄道	3,545	650,000	2,304,250,000	
西日本旅客鉄道	1,772	393,000	696,396,000	
東海旅客鉄道	1,588	781,000	1,240,228,000	
アートコーポレーション	3,900	1,258	4,906,200	
西日本鉄道	248,000	375	93,000,000	
ハマキョウレックス	6,000	2,095	12,570,000	
サカイ引越センター	3,500	2,025	7,087,500	
近畿日本鉄道	1,719,000	398	684,162,000	
阪急阪神ホールディングス	1,277,000	475	606,575,000	
南海電気鉄道	398,000	422	167,956,000	
京阪電気鉄道	428,000	417	178,476,000	
名糖運輸	7,900	800	6,320,000	
名古屋鉄道	667,000	288	192,096,000	
日本通運	816,000	400	326,400,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ヤマトホールディングス	378,000	1,273	481,194,000	
山九	231,000	345	79,695,000	
丸運	14,000	274	3,836,000	
丸全昭和運輸	58,000	281	16,298,000	
センコー	66,000	387	25,542,000	
トナミホールディングス	44,000	239	10,516,000	
日本梱包運輸倉庫	53,000	952	50,456,000	
日本石油輸送	22,000	183	4,026,000	
福山通運	148,000	429	63,492,000	
セイノーホールディングス	147,000	522	76,734,000	
神奈川中央交通	22,000	558	12,276,000	
日立物流	39,700	1,392	55,262,400	
日本郵船	1,018,000	528	537,504,000	
商船三井	998,000	550	548,900,000	
川崎汽船	453,000	394	178,482,000	
新和海運	77,000	231	17,787,000	
乾汽船	22,700	654	14,845,800	
明治海運	17,300	347	6,003,100	
飯野海運	92,100	489	45,036,900	
共栄タンカー	16,000	251	4,016,000	
第一中央汽船	125,000	232	29,000,000	
全日本空輸	1,958,000	339	663,762,000	
日本航空	2,744,000	215	589,960,000	
パスコ	22,000	105	2,310,000	
国際航業ホールディングス	19,000	168	3,192,000	
日新	72,000	230	16,560,000	
三菱倉庫	144,000	1,161	167,184,000	
三井倉庫	83,000	408	33,864,000	
住友倉庫	151,000	439	66,289,000	
澁澤倉庫	59,000	494	29,146,000	
東陽倉庫	33,000	176	5,808,000	
日本トランスシティ	43,000	326	14,018,000	
ケイヒン	39,000	113	4,407,000	
安田倉庫	13,700	805	11,028,500	
東洋埠頭	55,000	152	8,360,000	
宇徳	14,000	301	4,214,000	
上組	227,000	793	180,011,000	
サンリツ	5,400	577	3,115,800	
キムラユニティー	4,400	810	3,564,000	
キューソー流通システム	5,300	887	4,701,100	
郵船航空サービス	15,000	1,020	15,300,000	
近鉄エクスプレス	17,100	1,795	30,694,500	
東海運	12,200	285	3,477,000	
バンテック・グループ・ホールディングス	88	161,000	14,168,000	
システムプロ	123	47,800	5,879,400	
新日鉄ソリューションズ	12,500	1,223	15,287,500	
コア	7,000	538	3,766,000	
I Tホールディングス	63,800	1,301	83,003,800	
ドワンゴ	97	170,000	16,490,000	
ベリサーブ	9	120,600	1,085,400	
マクロミル	80	100,700	8,056,000	
ティーガイア	157	106,200	16,673,400	
インターネットイニシアティブ	114	105,700	12,049,800	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価 (円)	金額 (円)	
ソネットエンタテインメント	108	235,300	25,412,400	
S R Aホールディングス	9,000	675	6,075,000	
J B I Sホールディングス	21,300	394	8,392,200	
朝日ネット	16,000	217	3,472,000	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	3,800	1,839	6,988,200	
フェイス	902	7,300	6,584,600	
野村総合研究所	93,100	1,815	168,976,500	
サイバネットシステム	154	35,450	5,459,300	
シンプレクス・テクノロジー	314	31,800	9,985,200	
ソースネクスト	17	41,850	711,450	
クレスコ	2,800	1,107	3,099,600	
フジ・メディア・ホールディングス	1,956	122,000	238,632,000	
オービック	5,880	15,550	91,434,000	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	4,100	701	2,874,100	
ヤフー	14,010	33,700	472,137,000	
トレンドマイクロ	91,000	3,130	284,830,000	
日本オラクル	30,000	3,760	112,800,000	
アルファシステムズ	5,100	2,040	10,404,000	
フューチャーアーキテクト	226	38,300	8,655,800	
シーエーシー	10,200	872	8,894,400	
ソフトバンク・テクノロジー	5,500	505	2,777,500	
トーセ	5,300	617	3,270,100	
オービックビジネスコンサルタント	5,950	4,090	24,335,500	
日立ビジネスソリューション	5,900	527	3,109,300	
伊藤忠テクノソリューションズ	23,400	2,430	56,862,000	
アイティフォー	20,900	277	5,789,300	
東計電算	3,900	1,284	5,007,600	
エックスネット	20	85,800	1,716,000	
大塚商会	15,000	4,320	64,800,000	
サイボウズ	273	18,000	4,914,000	
アグレックス	3,700	750	2,775,000	
電通国際情報サービス	13,500	622	8,397,000	
ウェザーニューズ	6,200	1,425	8,835,000	
C I J	18,700	424	7,928,800	
ネットワンシステムズ	457	169,300	77,370,100	
アルゴグラフィックス	8,700	1,318	11,466,600	
エイベックス・グループ・ホールディングス	35,700	953	34,022,100	
日本ユニシス	45,400	737	33,459,800	
富士通ビジネスシステム	11,200	1,199	13,428,800	
兼松エレクトロニクス	13,500	768	10,368,000	
東京放送	112,500	1,306	146,925,000	
日本テレビ放送網	17,980	9,530	171,349,400	
テレビ朝日	479	117,400	56,234,600	
テレビ東京	7,400	4,200	31,080,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,437	38,200	54,893,400	
アイ・ティー・シーネットワーク	39	136,000	5,304,000	
イー・アクセス	910	47,800	43,498,000	
N E Cモバイルリング	7,000	1,332	9,324,000	
日本電信電話	8,633	460,000	3,971,180,000	
K D D I	2,915	626,000	1,824,790,000	
光通信	24,600	1,430	35,178,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	18,557	175,000	3,247,475,000	
学習研究社	70,000	145	10,150,000	
ゼンリン	27,500	986	27,115,000	
昭文社	11,300	440	4,972,000	
角川グループホールディングス	16,300	1,957	31,899,100	
インプレスホールディングス	228	13,400	3,055,200	
アイネット	9,000	500	4,500,000	
松竹	104,000	606	63,024,000	
東宝	138,900	1,812	251,686,800	
東映	79,000	429	33,891,000	
葵プロモーション	10,000	397	3,970,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,160	383,000	444,280,000	
テクモ	14,900	797	11,875,300	
光栄	16,900	972	16,426,800	
D T S	17,900	850	15,215,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	47,700	2,785	132,844,500	
シーイーシー	11,100	793	8,802,300	
日立ソフトウェアエンジニアリング	27,200	1,395	37,944,000	
カプコン	39,800	2,040	81,192,000	
ジャステック	9,800	561	5,497,800	
住商情報システム	19,300	1,514	29,220,200	
C S Kホールディングス	57,600	496	28,569,600	
日本システムウェア	7,100	328	2,328,800	
日立情報システムズ	15,300	1,846	28,243,800	
アイネス	22,700	447	10,146,900	
T K C	18,200	1,697	30,885,400	
富士ソフト	23,200	1,854	43,012,800	
ソラン	19,100	559	10,676,900	
日本システムディベロップメント	33,300	779	25,940,700	
コナミ	84,800	2,265	192,072,000	
福井コンピュータ	4,100	346	1,418,600	
日商エレクトロニクス	8,900	527	4,690,300	
J B C Cホールディングス	15,900	799	12,704,100	
ソフトバンク	766,400	1,406	1,077,558,400	
ハウスイ	15,000	82	1,230,000	
インターニックス	7,600	283	2,150,800	
高千穂交易	7,800	1,023	7,979,400	
伊藤忠食品	4,600	3,390	15,594,000	
高千穂電気	12,500	832	10,400,000	
J A L U X	6,000	1,385	8,310,000	
トーメンデバイス	2,400	989	2,373,600	
双日	1,166,300	138	160,949,400	
アルフレッサ ホールディングス	37,500	4,350	163,125,000	
横浜冷凍	43,000	621	26,703,000	
神栄	25,000	137	3,425,000	
山下医科器械	1,400	1,104	1,545,600	
ラサ商事	10,600	408	4,324,800	
あい ホールディングス	48,400	282	13,648,800	
三井鉱山	125,000	154	19,250,000	
ミタチ産業	4,300	407	1,750,100	
J F E 商事ホールディングス	130,000	249	32,370,000	
グリーンホスピタルサプライ	179	35,800	6,408,200	
協栄産業	23,000	237	5,451,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
小野建	16,000	895	14,320,000	
佐島電機	15,200	449	6,824,800	
エコートレーディング	3,900	620	2,418,000	
伯東	11,700	640	7,488,000	
中山福	12,100	534	6,461,400	
ナガイレーベン	10,200	1,841	18,778,200	
菱食	18,200	2,010	36,582,000	
松田産業	14,800	900	13,320,000	
メディセオ・パルタックホールディングス	202,300	1,066	215,651,800	
アドヴァン	17,700	396	7,009,200	
S P K	5,300	1,228	6,508,400	
アズワン	12,200	2,015	24,583,000	
スズデン	6,300	598	3,767,400	
尾家産業	6,000	741	4,446,000	
シモジマ	12,900	1,292	16,666,800	
ドウシシャ	10,800	1,143	12,344,400	
高速	11,200	531	5,947,200	
黒田電気	27,200	753	20,481,600	
丸文	14,900	367	5,468,300	
ハピネット	6,000	1,333	7,998,000	
トーメンエレクトロニクス	5,700	929	5,295,300	
エクセル	8,300	733	6,083,900	
マルカキカイ	6,200	586	3,633,200	
ガリバーインターナショナル	4,450	1,403	6,243,350	
日本エム・ディ・エム	16,800	163	2,738,400	
進和	10,300	1,495	15,398,500	
エスケイジャパン	5,600	211	1,181,600	
ダイトエレクトロン	8,300	473	3,925,900	
シークス	12,600	275	3,465,000	
田中商事	12,000	312	3,744,000	
オーハシテクニカ	13,300	627	8,339,100	
マクニカ	7,600	1,227	9,325,200	
白銅	6,600	572	3,775,200	
伊藤忠商事	1,405,000	420	590,100,000	
丸紅	1,643,000	312	512,616,000	
高島	36,000	105	3,780,000	
F & A アクアホールディングス	16,500	758	12,507,000	
長瀬産業	98,000	808	79,184,000	
蝶理	119,000	88	10,472,000	
豊田通商	188,300	895	168,528,500	
三共生興	33,100	145	4,799,500	
兼松	412,000	86	35,432,000	
ツカモトコーポレーション	34,000	61	2,074,000	
三井物産	1,617,000	796	1,287,132,000	
日本紙パルプ商事	103,000	282	29,046,000	
日立ハイテクノロジーズ	65,100	1,596	103,899,600	
カメイ	24,000	437	10,488,000	
東都水産	31,000	119	3,689,000	
スターゼン	62,000	227	14,074,000	
山善	75,300	290	21,837,000	
椿本興業	22,000	197	4,334,000	
住友商事	1,108,300	799	885,531,700	
内田洋行	45,000	324	14,580,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
三菱商事	1,402,600	1,150	1,612,990,000	
第一実業	45,000	260	11,700,000	
キヤノンマーケティングジャパン	71,400	1,437	102,601,800	
西華産業	80,000	210	16,800,000	
佐藤商事	17,300	589	10,189,700	
菱洋エレクトロ	18,900	745	14,080,500	
東京産業	18,500	240	4,440,000	
神鋼商事	53,000	165	8,745,000	
阪和興業	188,000	284	53,392,000	
カナデン	23,000	434	9,982,000	
菱電商事	29,000	501	14,529,000	
フルサト工業	11,800	867	10,230,600	
岩谷産業	213,000	205	43,665,000	
すてきナイスグループ	100,000	132	13,200,000	
昭光通商	76,000	107	8,132,000	
ニチモウ	36,000	116	4,176,000	
極東貿易	29,000	138	4,002,000	
イワキ	20,000	185	3,700,000	
三愛石油	46,000	384	17,664,000	
稲畑産業	53,400	280	14,952,000	
明和産業	23,300	124	2,889,200	
東邦薬品	42,300	998	42,215,400	
サンゲツ	32,400	2,035	65,934,000	
ミツウロコ	31,500	605	19,057,500	
シナネン	46,000	394	18,124,000	
伊藤忠エネクス	55,500	588	32,634,000	
ザ・トーカイ	45,000	430	19,350,000	
サンリオ	52,300	787	41,160,100	
サンワテクノス	9,500	489	4,645,500	
リョーサン	30,200	1,976	59,675,200	
新光商事	19,400	670	12,998,000	
トーホー	36,000	308	11,088,000	
三信電気	22,900	821	18,800,900	
東陽テクニカ	21,200	1,255	26,606,000	
モスフードサービス	26,600	1,266	33,675,600	
加賀電子	21,300	1,047	22,301,100	
ソーダニッカ	18,000	317	5,706,000	
立花エレテック	12,700	707	8,978,900	
ヤマタネ	101,000	94	9,494,000	
丸紅建材リース	20,000	112	2,240,000	
トラスコ中山	22,300	937	20,895,100	
オートバックスセブン	30,200	2,185	65,987,000	
ユーエスシー	7,300	951	6,942,300	
加藤産業	27,000	1,396	37,692,000	
イエローハット	19,500	395	7,702,500	
富士エレクトロニクス	10,600	678	7,186,800	
J Kホールディングス	20,200	637	12,867,400	
ユニダックス	10,500	414	4,347,000	
日伝	7,800	2,395	18,681,000	
バイタルネット	24,200	498	12,051,600	
北沢産業	30,500	144	4,392,000	
杉本商事	10,200	905	9,231,000	
因幡電機産業	18,000	2,495	44,910,000	

[次へ](#)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
住金物産	102,000	225	22,950,000	
ミスミグループ本社	63,100	1,110	70,041,000	
江守商事	3,700	729	2,697,300	
アルテック	8,500	179	1,521,500	
タキヒヨー	36,000	406	14,616,000	
スズケン	66,600	2,650	176,490,000	
ジェコス	18,300	430	7,869,000	
ローソン	58,800	5,230	307,524,000	
サンエー	7,200	3,210	23,112,000	
麒麟堂	7,400	521	3,855,400	
ダイユーエイト	2,700	629	1,698,300	
カワチ薬品	13,100	1,785	23,383,500	
エービーシー・マート	19,800	3,460	68,508,000	
ハードオフコーポレーション	8,600	377	3,242,200	
アスクル	18,200	1,708	31,085,600	
ゲオ	348	69,000	24,012,000	
ポイント	16,920	4,810	81,385,200	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	12,000	130	1,560,000	
くらコーポレーション	56	135,000	7,560,000	
キャンドゥ	85	76,800	6,528,000	
パル	4,950	825	4,083,750	
エディオン	75,300	449	33,809,700	
サーラコーポレーション	18,500	578	10,693,000	
バルス	104	138,000	14,352,000	
あみやき亭	34	122,000	4,148,000	
ハニーズ	14,980	967	14,485,660	
クリエイトエス・ディー	6,600	1,730	11,418,000	
アルペン	14,400	1,928	27,763,200	
ビックカメラ	520	29,300	15,236,000	
DCM Japanホールディングス	94,400	687	64,852,800	
J. フロント リテイリング	475,000	387	183,825,000	
ドトール・日レスホールディングス	26,900	1,872	50,356,800	
マツモトキヨシホールディングス	34,800	1,869	65,041,200	
ココカラファイン ホールディングス	11,600	1,096	12,713,600	
三越伊勢丹ホールディングス	343,700	771	264,992,700	
ブックオフコーポレーション	10,500	647	6,793,500	
あさひ	3,000	1,694	5,082,000	
サークルKサンクス	45,800	1,666	76,302,800	
日本調剤	3,500	1,152	4,032,000	
コスモス薬品	8,300	1,351	11,213,300	
セブン&アイ・ホールディングス	749,700	3,010	2,256,597,000	
ツルハホールディングス	12,600	3,060	38,556,000	
サンマルクホールディングス	6,100	2,580	15,738,000	
フェリシモ	5,400	1,991	10,751,400	
はるやま商事	9,100	395	3,594,500	
カップ・クリエイト	11,100	2,120	23,532,000	
ライトオン	15,800	1,693	26,749,400	
ジーンズメイト	6,100	512	3,123,200	
良品計画	19,900	4,340	86,366,000	
三城	26,700	871	23,255,700	
コナカ	24,300	288	6,998,400	
ハウス オブ ローゼ	2,000	1,398	2,796,000	
G-7ホールディングス	5,900	358	2,112,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
イオン北海道	11,800	334	3,941,200	
コーナン商事	22,100	1,197	26,453,700	
エコス	6,300	601	3,786,300	
ワタミ	24,700	2,420	59,774,000	
マルシェ	4,800	650	3,120,000	
ドン・キホーテ	42,600	1,926	82,047,600	
メガネトップ	13,600	945	12,852,000	
西松屋チェーン	49,500	894	44,253,000	
ゼンショー	63,500	483	30,670,500	
幸楽苑	11,700	1,121	13,115,700	
ユニマットライフ	7,400	754	5,579,600	
ハークスレイ	5,400	725	3,915,000	
サイゼリヤ	21,700	1,057	22,936,900	
ポプラ	5,300	571	3,026,300	
ユナイテッドアローズ	25,500	743	18,946,500	
ハイデイ日高	8,300	934	7,752,200	
京都きもの友禅	123	55,500	6,826,500	
コロワイド	42,500	529	22,482,500	
荳番屋	6,700	2,095	14,036,500	
トップカルチャー	6,500	275	1,787,500	
スギホールディングス	29,900	2,195	65,630,500	
ムトウ	22,200	515	11,433,000	
ファミリーマート	57,700	4,140	238,878,000	
木曽路	21,500	1,812	38,958,000	
千趣会	34,000	642	21,828,000	
タカキュー	15,500	127	1,968,500	
ケーヨー	38,900	605	23,534,500	
上新電機	44,000	776	34,144,000	
日本瓦斯	20,200	1,400	28,280,000	
ベスト電器	59,000	258	15,222,000	
マルエツ	38,000	574	21,812,000	
ロイヤルホールディングス	31,500	1,029	32,413,500	
東天紅	15,000	138	2,070,000	
いなげや	21,000	911	19,131,000	
島忠	45,500	2,270	103,285,000	
チヨダ	27,100	1,449	39,267,900	
鈴丹	5,400	176	950,400	
ライフコーポレーション	12,000	1,849	22,188,000	
カスミ	38,000	511	19,418,000	
リンガーハット	14,400	1,178	16,963,200	
さが美	16,000	120	1,920,000	
MrMax	21,500	418	8,987,000	
テンアライド	13,000	285	3,705,000	
相鉄ローゼン	12,000	467	5,604,000	
AOKIホールディングス	20,400	1,087	22,174,800	
オークワ	27,000	1,315	35,505,000	
コメリ	25,800	2,225	57,405,000	
青山商事	47,800	1,281	61,231,800	
しまむら	19,400	7,720	149,768,000	
CFSコーポレーション	23,000	624	14,352,000	
高島屋	254,000	718	182,372,000	
丸善	96,000	69	6,624,000	
松屋	37,800	1,838	69,476,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
エイチ・ツー・オー リテイリング	122,000	688	83,936,000	
丸栄	29,000	202	5,858,000	
ニッセンホールディングス	45,300	408	18,482,400	
パルコ	53,600	771	41,325,600	
丸井グループ	252,300	508	128,168,400	
原信ナルスホールディングス	11,300	1,028	11,616,400	
井筒屋	102,000	60	6,120,000	
ダイエー	86,900	436	37,888,400	
イズミヤ	62,000	587	36,394,000	
イオン	756,700	872	659,842,400	
ユニー	141,000	911	128,451,000	
イズミ	52,000	1,357	70,564,000	
東武ストア	25,000	352	8,800,000	
平和堂	38,000	1,363	51,794,000	
フジ	22,800	1,689	38,509,200	
ヤオコー	10,600	2,605	27,613,000	
ゼビオ	19,900	1,948	38,765,200	
ケーズホールディングス	33,000	1,577	52,041,000	
Olympic	12,400	615	7,626,000	
東日カーライフグループ	36,000	57	2,052,000	
元気寿司	5,900	1,182	6,973,800	
ヤマダ電機	91,170	5,940	541,549,800	
アークランドサカモト	13,600	1,009	13,722,400	
ニトリ	40,550	7,070	286,688,500	
グルメ杵屋	14,000	681	9,534,000	
愛眼	15,200	500	7,600,000	
吉野家ホールディングス	455	103,400	47,047,000	
松屋フーズ	9,100	1,221	11,111,100	
サガミチェーン	22,000	994	21,868,000	
セシール	21,700	90	1,953,000	
プレナス	23,700	1,635	38,749,500	
ミニストップ	13,900	1,901	26,423,900	
イマージュホールディングス	6,400	152	972,800	
アークス	22,200	1,326	29,437,200	
パロー	37,300	875	32,637,500	
大庄	11,400	1,337	15,241,800	
ファーストリテイリング	43,900	13,280	582,992,000	
サンドラッグ	35,700	2,320	82,824,000	
ヤマザワ	4,900	1,274	6,242,600	
やまや	3,800	441	1,675,800	
ペルーナ	24,000	242	5,808,000	
新生銀行	1,163,000	155	180,265,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,625,500	468	4,972,734,000	
りそなホールディングス	6,140	136,200	836,268,000	
中央三井トラスト・ホールディングス	958,000	353	338,174,000	
三井住友フィナンシャルグループ	7,954	312,000	2,481,648,000	
第四銀行	262,000	365	95,630,000	
北越銀行	214,000	191	40,874,000	
西日本シティ銀行	612,000	206	126,072,000	
札幌北洋ホールディングス	283	350,000	99,050,000	
千葉銀行	741,000	447	331,227,000	
横浜銀行	1,296,000	459	594,864,000	
常陽銀行	729,000	471	343,359,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
群馬銀行	439,000	533	233,987,000	
武蔵野銀行	28,500	3,180	90,630,000	
千葉興業銀行	36,400	1,075	39,130,000	
関東つくば銀行	54,600	305	16,653,000	
東京都民銀行	35,900	1,199	43,044,100	
七十七銀行	317,000	434	137,578,000	
青森銀行	118,000	393	46,374,000	
秋田銀行	130,000	371	48,230,000	
山形銀行	115,000	594	68,310,000	
岩手銀行	12,700	5,540	70,358,000	
東邦銀行	147,000	371	54,537,000	
荘内銀行	96,000	158	15,168,000	
東北銀行	99,000	146	14,454,000	
みちのく銀行	97,000	201	19,497,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	813,000	328	266,664,000	
静岡銀行	587,000	887	520,669,000	
十六銀行	243,000	378	91,854,000	
スルガ銀行	219,000	856	187,464,000	
八十二銀行	355,000	447	158,685,000	
山梨中央銀行	127,000	498	63,246,000	
大垣共立銀行	215,000	407	87,505,000	
福井銀行	162,000	317	51,354,000	
北國銀行	218,000	339	73,902,000	
清水銀行	6,500	4,030	26,195,000	
滋賀銀行	176,000	561	98,736,000	
南都銀行	186,000	514	95,604,000	
百五銀行	185,000	541	100,085,000	
京都銀行	322,000	927	298,494,000	
三重銀行	86,000	373	32,078,000	
池田銀行	17,300	4,370	75,601,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,315,000	187	245,905,000	
広島銀行	554,000	343	190,022,000	
山陰合同銀行	114,000	679	77,406,000	
中国銀行	154,000	1,271	195,734,000	
鳥取銀行	65,000	284	18,460,000	
伊予銀行	214,000	1,021	218,494,000	
百十四銀行	220,000	478	105,160,000	
四国銀行	138,000	448	61,824,000	
阿波銀行	167,000	592	98,864,000	
鹿児島銀行	132,000	698	92,136,000	
大分銀行	103,000	557	57,371,000	
宮崎銀行	99,000	319	31,581,000	
肥後銀行	149,000	530	78,970,000	
佐賀銀行	116,000	323	37,468,000	
十八銀行	121,000	302	36,542,000	
沖縄銀行	15,600	2,985	46,566,000	
琉球銀行	40,100	850	34,085,000	
住友信託銀行	1,805,000	453	817,665,000	
みずほ信託銀行	1,873,000	109	204,157,000	
八千代銀行	114	281,400	32,079,600	
みずほフィナンシャルグループ	10,607	225,700	2,393,999,900	
紀陽ホールディングス	743,000	134	99,562,000	
山口フィナンシャルグループ	175,000	904	158,200,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
長野銀行	72,000	241	17,352,000	
名古屋銀行	182,000	492	89,544,000	
愛知銀行	6,900	7,010	48,369,000	
第三銀行	117,000	300	35,100,000	
中京銀行	89,000	285	25,365,000	
東日本銀行	100,000	245	24,500,000	
愛媛銀行	119,000	302	35,938,000	
トマト銀行	75,000	224	16,800,000	
みなと銀行	198,000	112	22,176,000	
京葉銀行	168,000	442	74,256,000	
関西アーバン銀行	202,000	141	28,482,000	
栃木銀行	102,000	528	53,856,000	
北日本銀行	6,400	2,845	18,208,000	
香川銀行	72,000	534	38,448,000	
徳島銀行	56,000	400	22,400,000	
福島銀行	238,000	59	14,042,000	
SBIホールディングス	15,125	13,270	200,708,750	
日本アジア投資	91,000	67	6,097,000	
ジャフコ	30,900	2,505	77,404,500	
大和証券グループ本社	1,245,000	484	602,580,000	
野村ホールディングス	1,974,500	701	1,384,124,500	
新光証券	479,000	188	90,052,000	
みずほインベスターズ証券	441,000	73	32,193,000	
岡三証券グループ	161,000	379	61,019,000	
丸三証券	62,900	447	28,116,300	
東洋証券	73,000	171	12,483,000	
東海東京証券	221,000	229	50,609,000	
光世証券	48,000	80	3,840,000	
水戸証券	63,000	281	17,703,000	
いちよし証券	44,300	685	30,345,500	
松井証券	143,600	677	97,217,200	
だいこう証券ビジネス	8,300	747	6,200,100	
マネックスグループ	980	29,290	28,704,200	
カブドットコム証券	406	129,800	52,698,800	
極東証券	24,100	401	9,664,100	
岩井証券	19,600	685	13,426,000	
三井住友海上グループホールディングス	448,100	2,200	985,820,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	668	286,800	191,582,400	
日本興亜損害保険	724,000	539	390,236,000	
損害保険ジャパン	875,000	503	440,125,000	
ニッセイ同和損害保険	207,000	433	89,631,000	
あいおい損害保険	491,000	362	177,742,000	
富士火災海上保険	195,000	144	28,080,000	
東京海上ホールディングス	808,000	2,310	1,866,480,000	
T&Dホールディングス	247,400	3,100	766,940,000	
クレディセゾン	161,200	1,272	205,046,400	
オーエムシーカード	69,000	150	10,350,000	
フィデック	140	5,380	753,200	
芙蓉総合リース	19,900	1,567	31,183,300	
興銀リース	26,400	1,521	40,154,400	
センチュリー・リーシング・システム	28,300	819	23,177,700	
日本証券金融	74,700	424	31,672,800	
大阪証券金融	23,900	193	4,612,700	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ポケットカード	19,300	240	4,632,000	
武富士	125,900	637	80,198,300	
リコーリース	13,200	1,259	16,618,800	
シンキ	55,900	60	3,354,000	
イオンクレジットサービス	87,400	1,063	92,906,200	
アコム	85,820	3,330	285,780,600	
プロミス	89,500	1,920	171,840,000	
東京リース	24,600	555	13,653,000	
ジャックス	116,000	170	19,720,000	
日立キャピタル	44,700	954	42,643,800	
セントラルファイナンス	80,000	143	11,440,000	
オリックス	92,620	4,730	438,092,600	
三菱UFJリース	50,510	2,090	105,565,900	
SFCG	4,700	2,585	12,149,500	
アサックス	27	59,100	1,595,700	
NECキャピタルソリューション	7,400	717	5,305,800	
昭栄	35,000	924	32,340,000	
東京建物不動産販売	19,300	300	5,790,000	
野村不動産ホールディングス	59,700	1,630	97,311,000	
パーク24	114,100	470	53,627,000	
三井不動産	833,000	1,392	1,159,536,000	
三菱地所	1,307,000	1,417	1,852,019,000	
平和不動産	148,000	227	33,596,000	
東京建物	316,000	319	100,804,000	
ダイビル	53,500	854	45,689,000	
サンケイビル	38,700	380	14,706,000	
東急不動産	420,000	317	133,140,000	
京阪神不動産	33,000	370	12,210,000	
住友不動産	478,000	1,401	669,678,000	
東宝不動産	25,400	589	14,960,600	
藤和不動産	113,500	58	6,583,000	
有楽土地	46,000	112	5,152,000	
テーオーシー	82,000	440	36,080,000	
東京楽天地	43,000	381	16,383,000	
レオパレス21	142,700	842	120,153,400	
フジ住宅	36,600	227	8,308,200	
空港施設	25,500	544	13,872,000	
住友不動産販売	9,850	2,670	26,299,500	
ゴールドクレスト	16,660	2,075	34,569,500	
東急リバブル	28,900	412	11,906,800	
日神不動産	30,000	171	5,130,000	
サンヨーハウジング名古屋	122	73,700	8,991,400	
イオンモール	90,700	1,692	153,464,400	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,280	98,200	125,696,000	
大和システム	28,900	177	5,115,300	
日本空港ビルデング	53,600	1,153	61,800,800	
日本工営	67,000	207	13,869,000	
日本M&Aセンター	31	482,000	14,942,000	
アコーディア・ゴルフ	555	59,800	33,189,000	
パソナグループ	198	42,850	8,484,300	
テンプホールディングス	23,300	626	14,585,800	
学情	8,300	336	2,788,800	
スタジオアリス	9,300	993	9,234,900	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
シミック	320	22,750	7,280,000	
NECフィールドینگ	16,100	961	15,472,100	
総合警備保障	66,300	945	62,653,500	
カカクコム	154	379,000	58,366,000	
ルネサンス	10,800	328	3,542,400	
新日本科学	8,500	827	7,029,500	
ソネット・エムスリー	94	342,000	32,148,000	
ディー・エヌ・エー	258	268,000	69,144,000	
博報堂DYホールディングス	27,550	4,530	124,801,500	
一休	161	29,700	4,781,700	
ジャパンベストレスクューシステム	33	44,700	1,475,100	
ジェイコム	17	104,700	1,779,900	
パシフィックゴルフグループインターナショナルホールディングス	495	34,000	16,830,000	
イーピーエス	53	446,000	23,638,000	
アミューズ	4,300	1,170	5,031,000	
ドリームインキュベータ	62	60,800	3,769,600	
TAC	10,500	357	3,748,500	
電通	1,972	170,000	335,240,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	594	3,490	2,073,060	
イオンファンタジー	6,800	633	4,304,400	
みらかホールディングス	39,700	1,822	72,333,400	
アルプス技研	8,700	900	7,830,000	
サニックス	31,200	71	2,215,200	
ダイオーズ	4,700	383	1,800,100	
日本空調サービス	4,500	750	3,375,000	
オリエンタルランド	56,200	7,370	414,194,000	
ダスキン	59,700	1,539	91,878,300	
明光ネットワークジャパン	18,900	483	9,128,700	
ファルコバイオシステムズ	11,000	679	7,469,000	
秀英予備校	4,600	336	1,545,600	
田谷	3,400	625	2,125,000	
ラウンドワン	304	50,900	15,473,600	
リゾートトラスト	37,000	956	35,372,000	
ビー・エム・エル	10,400	2,005	20,852,000	
ワタベウェディング	6,100	1,080	6,588,000	
もしもしホットライン	14,750	2,045	30,163,750	
東急コミュニティー	5,300	1,447	7,669,100	
リソー教育	2,116	3,490	7,384,840	
シチエ	5,500	537	2,953,500	
ユー・エス・エス	27,040	5,270	142,500,800	
東京個別指導学院	28,400	117	3,322,800	
カルチュア・コンビニエンス・クラブ	91,300	845	77,148,500	
テー・オー・ダブリュー	3,400	565	1,921,000	
総合メディカル	4,600	2,880	13,248,000	
セントラルスポーツ	5,700	786	4,480,200	
リゾートソリューション	18,000	203	3,654,000	
エイチ・アイ・エス	18,300	1,631	29,847,300	
共立メンテナンス	8,100	1,453	11,769,300	
イチネンホールディングス	19,700	514	10,125,800	
建設技術研究所	10,900	658	7,172,200	
燦ホールディングス	4,400	1,882	8,280,800	
スバル興業	19,000	280	5,320,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
東京テアトル	89,000	193	17,177,000	
吉本興業	30,100	1,177	35,427,700	
ホリプロ	7,200	950	6,840,000	
よみうりランド	45,000	271	12,195,000	
東京都競馬	159,000	135	21,465,000	
カナモト	23,000	325	7,475,000	
東京ドーム	148,000	353	52,244,000	
トランス・コスモス	26,000	588	15,288,000	
乃村工藝社	39,000	324	12,636,000	
藤田観光	58,000	559	32,422,000	
近畿日本ツーリスト	64,000	165	10,560,000	
日本管財	7,700	1,640	12,628,000	
白洋舎	22,000	270	5,940,000	
セコム	193,000	4,420	853,060,000	
セントラル警備保障	8,800	818	7,198,400	
丹青社	28,000	221	6,188,000	
メイテック	33,500	1,808	60,568,000	
アサツー ディ・ケイ	40,000	1,920	76,800,000	
応用地質	22,800	1,138	25,946,400	
船井総合研究所	25,100	488	12,248,800	
進学会	10,200	288	2,937,600	
ベネッセコーポレーション	69,100	4,190	289,529,000	
イオンディライト	14,700	2,625	38,587,500	
ナック	9,300	801	7,449,300	
ニチイ学館	23,900	1,212	28,966,800	
ダイセキ	29,300	1,970	57,721,000	
合計	251,389,348	—	202,624,020,436	

（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。

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

⑥ 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20年12月30日

I 資産総額	1,077,464,119 円
II 負債総額	439,192 円
III 純資産総額（I－II）	1,077,024,927 円
IV 発行済口数	1,012,609,298 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.0636 円
1万口当たり純資産額	10,636 円

＜参考＞

マザーファンドの現況（平成20年12月30日）

純資産額計算書

I 資産総額	218,873,383,252 円
II 負債総額	36,207,734 円
III 純資産総額（I－II）	218,837,175,518 円
IV 発行済口数	299,280,833,530 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.7312 円
1万口当たり純資産額	7,312 円

第5【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1期計算期間	374,447,179	20,527,581	353,919,598
第2期計算期間	179,454,636	44,657,984	488,716,250
第3期計算期間	286,696,440	137,177,440	638,235,250
第4期計算期間	427,672,847	208,003,484	857,904,613
第5期計算期間	285,026,590	232,447,124	910,484,079
第6期計算期間	295,481,661	204,831,194	1,001,134,546

（注1）設定及び解約の実績は、全て本邦内における実績です。

（注2）第1期計算期間の設定口数には、当初自己設定の設定口数を含みます。

第三部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額

本書提出日現在の資本金の額：3億円

会社の発行可能株式総数：16,000株

発行済株式総数：5,050株

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

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

（2）委託会社の機構

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

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

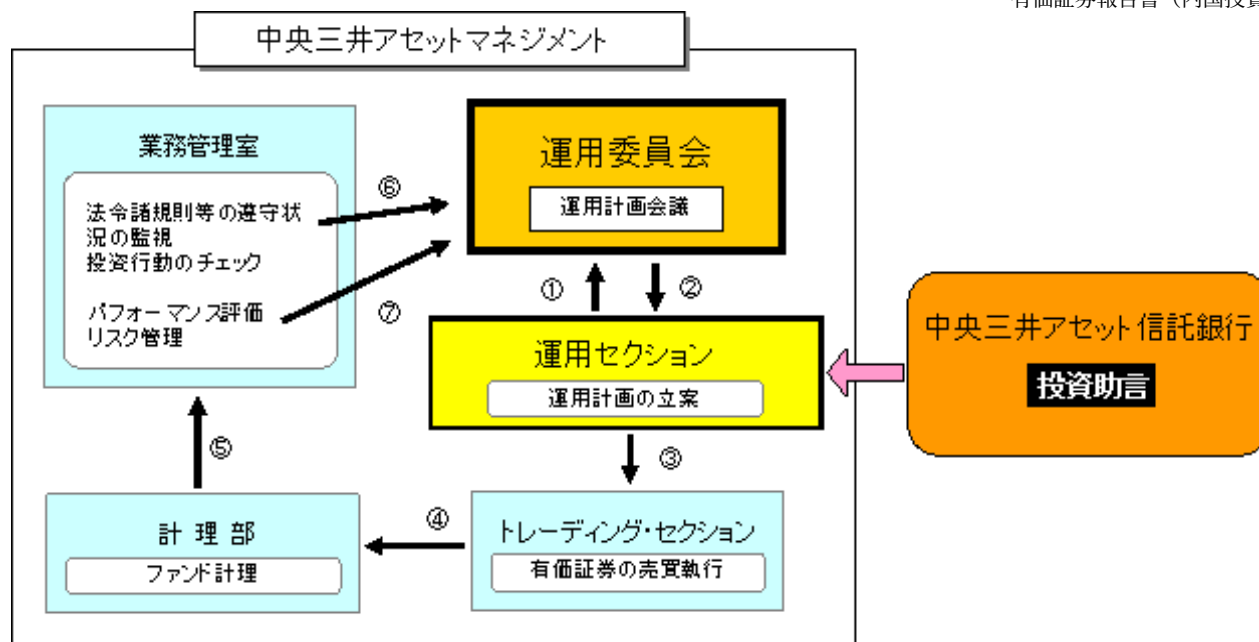
取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

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

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

委託会社は運用に当たり、中央三井トラスト・グループの運用会社として、クオリティの高い資産運用、スキル、ノウハウを結集し、分析力、運用力の向上を図っています。なお、その意思決定機構は以下のとおりです。



- ① 運用計画案を策定のうえ、運用計画会議・運用委員会に提出
 ② 運用計画案承認
 ③ 発注指示
 ④ 約定連絡
 ⑤ 発注伝票の回覧・チェック
 ⑥ コンプライアンス・チェックの報告
 ⑦ パフォーマンス評価、リスク分析等の報告

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20年12月30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	43	401,274
追加型公社債投資信託	—	—
単位型株式投資信託	28	182,095
単位型公社債投資信託	—	—
合計	71	583,368

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、第21期事業年度（平成18年4月1日から平成19年3月31日まで）の財務諸表については、改正前の財務諸表等規則及び「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則（平成12年総理府令第129号）」に基づいて作成しており、第22期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）の財務諸表については、改正後の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年8月6日内閣府令第52号）」に基づいて作成しております。

委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和52年大蔵省令第38号）」（以下「中間財務諸表等規則」といいます。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年8月6日内閣府令第52号）」に基づいて作成しております。

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

- （２）委託会社は、第21期事業年度（平成18年4月1日から平成19年3月31日まで）の財務諸表については、証券取引法第193条の2の規定に基づき、第22期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）の財務諸表及び第23期中間会計期間（平成20年4月1日から平成20年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、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。

(1) 【貸借対照表】

科目	第21期 平成19年3月31日			第22期 平成20年3月31日		
	金額（千円）	構成比 （%）		金額（千円）	構成比 （%）	
(資産の部)						
I 流動資産						
1. 現金		271			—	
2. 預金※2		701,025			—	
3. 現金・預金		—			615,636	
4. 有価証券※3		25,854			—	
5. 前払費用		356,186			397,534	
6. 未収委託者報酬		1,502,515			1,587,133	
7. 未収収益※2						
(1) 投資顧問報酬	837			493		
(2) その他	306	1,143		320	814	
8. 繰延税金資産		45,515			37,141	
9. その他※3		8,114			36,684	
流動資産 計		2,640,626	90.0		2,674,945	87.7
II 固定資産						
1. 有形固定資産※1						
(1) 建物		24,804			28,036	
(2) 器具備品		46,019			78,121	
有形固定資産 計		70,823	2.4		106,157	3.5
2. 無形固定資産						
(1) ソフトウェア		58,471			88,137	
(2) 電話加入権		1,847			1,847	
(3) 電話施設利用権		119			98	
無形固定資産 計		60,437	2.1		90,083	2.9
3. 投資その他の資産						
(1) 投資有価証券		65,000			65,000	
(2) 長期貸付金		47,188			44,788	
(3) 長期差入保証金		65,347			84,348	
(4) 預託金		1,000			—	
(5) 長期前払費用		5,871			5,510	
(6) 会員権		25,000			25,000	
(7) 貸倒引当金		△47,188			△44,788	
投資その他の資産 計		162,218	5.5		179,859	5.9
固定資産 計		293,480	10.0		376,100	12.3
資産合計		2,934,106	100.0		3,051,045	100.0

	第21期 平成19年 3 月31日			第22期 平成20年 3 月31日		
科目	金額（千円）		構成比 （%）	金額（千円）		構成比 （%）
(負債の部)						
I 流動負債						
1. 預り金		82,331			32,286	
2. 未払金						
(1) 未払手数料※ 2	427,581			497,835		
(2) その他未払金	117,713	545,294		105,201	603,037	
3. 未払費用		309,179			312,034	
4. 未払法人税等		440,734			259,393	
5. 未払消費税等		57,711			31,383	
6. 賞与引当金		27,569			35,351	
流動負債 計		1,462,820	49.8		1,273,487	41.8
II 固定負債						
1. 退職給付引当金		7,780			11,007	
2. 役員退職慰労引当金		—			8,150	
固定負債 計		7,780	0.3		19,157	0.6
負債合計		1,470,601	50.1		1,292,645	42.4
(純資産の部)						
I 株主資本						
1. 資本金		300,000	10.2		300,000	9.8
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	1.6
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		1,088,152			1,382,999	
利益剰余金 計		1,113,553	38.0		1,408,400	46.2
株主資本計		1,463,553	49.9		1,758,400	57.6
II 評価・換算差額等						
1. その他有価証券評価差額金		△48	△0.0		—	—
評価・換算差額等計		△48	△0.0		—	—
純資産合計		1,463,505	49.9		1,758,400	57.6
負債・純資産合計		2,934,106	100.0		3,051,045	100.0

(2) 【損益計算書】

科目	第21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)			第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)		
	金額（千円）		百分比 (%)	金額（千円）		百分比 (%)
I 営業収益						
1. 委託者報酬		10,331,700			13,110,388	
2. その他営業収益						
(1) 投資顧問料	19,127	19,127		14,182	14,182	
営業収益 計		10,350,827	100.0		13,124,570	100.0
II 営業費用						
1. 支払手数料※3		3,560,500			4,971,955	
2. 広告宣伝費		549,092			771,725	
3. 公告費		84			24,864	
4. 受益証券発行費		8,822			414	
5. 調査費						
(1) 調査費	177,345			226,207		
(2) 委託調査費	3,298,820	3,476,166		3,992,966	4,219,174	
6. 委託計算費		7,730			471	
7. 営業雑経費						
(1) 通信費	8,935			12,633		
(2) 印刷費	169,425			265,300		
(3) 協会費	10,509			13,076		
(4) 諸会費	62	188,932		57	291,066	
営業費用 計		7,791,329	75.3		10,279,674	78.3
III 一般管理費						
1. 給料						
(1) 役員報酬※1	39,507			48,578		
(2) 給料・手当	353,244			461,290		
(3) 賞与	71,530	464,282		103,468	613,337	
2. 役員退職金		2,300			800	
3. 福利厚生費		116,815			156,327	
4. 交際費		811			1,596	
5. 旅費交通費		16,901			25,255	
6. 租税公課		22,310			11,419	
7. 不動産賃借料		69,059			82,419	
8. 退職給付費用		2,560			3,950	
9. 役員退職慰労引当金繰入		—			6,950	
10. 賞与引当金繰入		27,569			35,351	
11. 減価償却費		35,321			46,548	
12. 諸経費		379,531			483,651	
一般管理費 計		1,137,463	11.0		1,467,609	11.2
営業利益		1,422,035	13.7		1,377,286	10.5

	第21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)			第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)		
科目	金額（千円）		百分比 (%)	金額（千円）		百分比 (%)
IV 営業外収益						
1. 受取配当金		3,167			2,738	
2. 有価証券利息		66			64	
3. 受取利息		875			1,513	
4. 雑収入		76			3,796	
営業外収益 計		4,186	0.0		8,113	0.0
V 営業外費用						
1. 雑損失		11,246			16,240	
営業外費用 計		11,246	0.0		16,240	0.1
経常利益		1,414,975	13.7		1,369,159	10.4
VI 特別利益						
1. 貸倒引当金戻入		2,400			2,400	
特別利益 計		2,400	0.0		2,400	0.0
VII 特別損失						
1. 固定資産除却損※2		—			814	
2. 役員退職慰労引当金繰入		—			13,600	
特別損失 計		—	0.0		14,414	0.1
税引前当期純利益		1,417,375	13.7		1,357,144	10.3
法人税、住民税及び事業税	590,686			551,986		
法人税等調整額	△14,556	576,129	5.6	8,340	560,326	4.2
当期純利益		841,245	8.1		796,817	6.1

(3) 【株主資本等変動計算書】

第21期（平成18年4月1日から平成19年3月31日まで）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				株主資本 合計
		資本 準備金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益 剰余金 合計	
					別途 積立金	繰越利益 剰余金		
平成18年 3 月31日残高	300,000	50,000	50,000	25,401	1,200,000	282,136	1,507,538	1,857,538
事業年度中の変動額								
別途積立金の取崩額					△1,200,000	1,200,000	—	—
剰余金の配当						△1,235,230	△1,235,230	△1,235,230
当期純利益						841,245	841,245	841,245
株主資本以外の項目の 事業年度中の変動額 (純額)								
事業年度中の変動額合計	—	—	—	—	△1,200,000	806,015	△393,984	△393,984
平成19年 3 月31日残高	300,000	50,000	50,000	25,401	—	1,088,152	1,113,553	1,463,553

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
平成18年3月31日残高	△204	△204	1,857,333
事業年度中の変動額			
別途積立金の取崩額			—
剰余金の配当			△1,235,230
当期純利益			841,245
株主資本以外の項目の 事業年度中の変動額 (純額)	156	156	156
事業年度中の変動額合計	156	156	△393,828
平成19年3月31日残高	△48	△48	1,463,505

第22期（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）

（単位：千円）

株主資本		
資本金	前期末残高	300,000
	当期変動額	—
	当期末残高	300,000
資本剰余金		
資本準備金	前期末残高	50,000
	当期変動額	—
	当期末残高	50,000
資本剰余金合計	前期末残高	50,000
	当期変動額	—
	当期末残高	50,000
利益剰余金		
利益準備金	前期末残高	25,401
	当期変動額	—
	当期末残高	25,401
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	前期末残高	1,088,152
	当期変動額 剰余金の配当	△501,970
	当期純利益	796,817
	当期末残高	1,382,999
利益剰余金合計	前期末残高	1,113,553
	当期変動額	294,847
	当期末残高	1,408,400
株主資本合計	前期末残高	1,463,553
	当期変動額	294,847
	当期末残高	1,758,400
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	前期末残高	△48
	当期変動額（純額）	48
	当期末残高	—
評価・換算差額等合計	前期末残高	△48
	当期変動額	48
	当期末残高	—
純資産合計	前期末残高	1,463,505
	当期変動額	294,895
	当期末残高	1,758,400

重要な会計方針

期別 項目	第21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)
1. 有価証券の評価基準 及び評価方法	その他有価証券 (1) 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額については全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。 (2) 時価のないもの 移動平均法に基づく原価法を採用しております。	その他有価証券 (1) 時価のあるもの ————— (2) 時価のないもの 同左
2. 固定資産の減価償却の方法		
(1) 有形固定資産	定率法を採用しております。 なお、耐用年数は、建物については主として13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。	定率法を採用しております。 なお、耐用年数は、建物については主として15年～18年、器具備品については主として5年～20年であります。
(2) 無形固定資産	定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（5年）を耐用年数としております。	同左
3. 引当金の計上基準		
(1) 貸倒引当金	一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。	同左
(2) 賞与引当金	従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当期負担分を計上しております。	同左
(3) 退職給付引当金	従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による期末退職給付債務相当額を計上しております。	同左
(4) 役員退職慰労引当金	—————	役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づき期末要支給額を計上しております。
4. リース取引の処理方法	リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引にかかる方法に準じた会計処理によって処理しております。	同左
5. 消費税等の会計処理	税抜方式を採用しております。	同左

会計方針の変更

第21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)
1. 当事業年度より、「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成17年12月9日 企業会計基準第5号）及び「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針」（企業会計基準委員会 平成17年12月9日 企業会計基準適用指針第8号）を適用しております。 これによる損益に与える影響はありません。 なお、従来の「資本の部」の合計に相当する金額は1,463,505千円であります。 財務諸表等規則の改正により、当事業年度における財務諸表は、改正後の財務諸表等規則により作成しております。 2. _____ 3. _____	1. _____ 2. 役員に対する退職慰労金は、従来、支出時の費用として処理しておりましたが、「役員賞与に関する会計基準」（企業会計基準第4号）及び「租税特別措置法上の準備金及び特別法上の引当金又は準備金並びに役員退職慰労引当金等に関する監査上の取扱い」（日本公認会計士協会監査・保証実務委員会報告第42号）の公表を踏まえ、当事業年度から引当金を計上する方法を適用し、内規に基づく期末要支給額を役員退職慰労引当金として計上しております。これにより、従来の方法に比べ経常利益が6,950千円、税引前当期純利益が20,550千円減少しております。 3. 法人税法の改正により、当事業年度より、平成19年4月1日以降に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。 当該変更による損益に与える影響は軽微であります。

追加情報

第21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)
	法人税法の改正により、平成19年3月31日以前に取得した資産については、改正前の法人税法に基づく減価償却の方法の適用により取得価額の5%に到達した事業年度の翌事業年度より、取得価額の5%相当額と備忘価額との差額を5年間にわたり均等償却し、減価償却費に含めて計上しております。当該変更による損益に与える影響は軽微であります。

表示方法の変更

第21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)
(貸借対照表) 前事業年度まで流動負債の「その他未払金」に含めて表示していた「未払消費税等」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より区分掲記しております。 なお、前事業年度の流動負債の「その他未払金」に含まれている「未払消費税等」は30,795千円であります。	

注記事項

1. 貸借対照表関係

期別 項目	第21期 (平成19年3月31日)	第22期 (平成20年3月31日)
※1. 有形固定資産の減価 償却累計額	建物 14,670千円 器具備品 119,739千円	建物 18,588千円 器具備品 141,460千円
※2. 関係会社に対する 主な資産・負債	資産 預金 701,025千円 未収収益 306千円 負債 未払手数料 418,032千円	_____
※3. 担保資産	有価証券のうち、次のものは営業保証 金として供託しております。 投資顧問業の営業保証金（25,000千円） 銘柄 第25回分離元本振替国債（5年） 貸借対照表価額 25,854千円 額面金額 26,000千円	その他のうち、次のものを供託してお ります。 取戻し手続中の投資顧問業の営業保証 金（25,000千円） 預け金 26,000千円

2. 損益計算書関係

期別 項目	第21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)
※1. 役員の報酬限度額	取締役 年額 120,000千円以内 監査役 年額 30,000千円以内	_____
※2. 固定資産除却損の内容	_____	建物附属設備 814千円
※3. 関係会社との取引	支払代行手数料 3,487,392千円	_____

3. 株主資本等変動計算書関係

期別	第21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)						
項目							
1. 発行済株式に関する事項							
	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						
	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18年6月30日 定時株主総会	普通株式	233,815	46,300	平成18年3月31日	平成18年6月30日	
	平成18年9月19日 取締役会	普通株式	600,950	119,000	平成18年9月30日	平成18年9月30日	
	平成19年3月29日 臨時株主総会	普通株式	400,465	79,300	平成19年3月28日	平成19年3月30日	
	(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの						
	決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
	平成19年6月29日 定時株主総会	普通株式	100,495	利益 剰余金	19,900	平成19年3月31日	平成19年6月29日

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

4. リース取引関係

第21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)
リース取引は重要性が乏しく、1件当たりの金額が少 額なため、注記を省略しております。	同左

5. 有価証券関係

第21期 (平成19年 3 月31日)				第22期 (平成20年 3 月31日)	
1. その他有価証券で時価のあるもの				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。	
区分	取得原価 (千円)	貸借対照 表計上額 (千円)	差額 (千円)		
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの					
① 債券	—	—	—		
② その他	—	—	—		
小計	—	—	—		
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの					
債券	25,935	25,854	△81		
合計	25,935	25,854	△81		
2. 当事業年度中に売却したその他有価証券 売却額 一千円 売却益合計額 一千円				2. 当事業年度中に売却したその他有価証券 該当事項はありません。	
3. 時価評価されていない有価証券				3. 時価評価されていない有価証券	
内容		貸借対照表計上額 (千円)		内容 貸借対照表計上額 (千円)	
その他有価証券				その他有価証券	
非上場株式		65,000		非上場株式 65,000	
4. その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額				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。	
区分	1 年以内 (千円)	1 年超 5 年以内 (千円)	5 年超 10 年以内 (千円)	10 年超 (千円)	
(債券)					
国債	25,854	—	—	—	

6. デリバティブ関係

第21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)
当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。	同左

7. 退職給付関係

第21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)																
1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。 2. 退職給付債務に関する事項 (平成19年3月31日現在) <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>△7,780千円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>△7,780千円</td></tr> </table> (注) 退職給付債務は、簡便法により算定しております。 3. 退職給付費用に関する事項 (平成18年4月1日から平成19年3月31日まで) <table> <tr> <td>勤務費用</td><td>2,560千円</td></tr> <tr> <td>退職給付費用</td><td>2,560千円</td></tr> </table> (注) 退職給付費用は、簡便法により算定しております。	退職給付債務	△7,780千円	退職給付引当金	△7,780千円	勤務費用	2,560千円	退職給付費用	2,560千円	1. 採用している退職給付制度の概要 同左 2. 退職給付債務に関する事項 (平成20年3月31日現在) <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>△11,007千円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>△11,007千円</td></tr> </table> (注) 退職給付債務は、簡便法により算定しております。 3. 退職給付費用に関する事項 (平成19年4月1日から平成20年3月31日まで) <table> <tr> <td>勤務費用</td><td>3,950千円</td></tr> <tr> <td>退職給付費用</td><td>3,950千円</td></tr> </table> (注) 退職給付費用は、簡便法により算定しております。	退職給付債務	△11,007千円	退職給付引当金	△11,007千円	勤務費用	3,950千円	退職給付費用	3,950千円
退職給付債務	△7,780千円																
退職給付引当金	△7,780千円																
勤務費用	2,560千円																
退職給付費用	2,560千円																
退職給付債務	△11,007千円																
退職給付引当金	△11,007千円																
勤務費用	3,950千円																
退職給付費用	3,950千円																

8. 税効果会計関係

第21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)																																
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 <table> <tr> <td colspan="2">繰延税金資産</td></tr> <tr> <td>貸倒引当金繰入超過額</td><td>19,200千円</td></tr> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td><td>11,217千円</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>33,019千円</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>4,454千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td><td>67,892千円</td></tr> <tr> <td>評価性引当額</td><td>△22,377千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td><td>45,515千円</td></tr> </table> 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、記載を省略しております。	繰延税金資産		貸倒引当金繰入超過額	19,200千円	賞与引当金繰入超過額	11,217千円	未払事業税	33,019千円	その他	4,454千円	繰延税金資産小計	67,892千円	評価性引当額	△22,377千円	繰延税金資産合計	45,515千円	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 <table> <tr> <td colspan="2">繰延税金資産</td></tr> <tr> <td>貸倒引当金繰入超過額</td><td>18,224千円</td></tr> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td><td>14,384千円</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>19,725千円</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>11,578千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td><td>63,912千円</td></tr> <tr> <td>評価性引当額</td><td>△26,771千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td><td>37,141千円</td></tr> </table> 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、記載を省略しております。	繰延税金資産		貸倒引当金繰入超過額	18,224千円	賞与引当金繰入超過額	14,384千円	未払事業税	19,725千円	その他	11,578千円	繰延税金資産小計	63,912千円	評価性引当額	△26,771千円	繰延税金資産合計	37,141千円
繰延税金資産																																	
貸倒引当金繰入超過額	19,200千円																																
賞与引当金繰入超過額	11,217千円																																
未払事業税	33,019千円																																
その他	4,454千円																																
繰延税金資産小計	67,892千円																																
評価性引当額	△22,377千円																																
繰延税金資産合計	45,515千円																																
繰延税金資産																																	
貸倒引当金繰入超過額	18,224千円																																
賞与引当金繰入超過額	14,384千円																																
未払事業税	19,725千円																																
その他	11,578千円																																
繰延税金資産小計	63,912千円																																
評価性引当額	△26,771千円																																
繰延税金資産合計	37,141千円																																

9. 関連当事者との取引関係

1. 親会社及び法人主要株主等

項目	第21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)
1. 会社等の名称	親会社 中央三井信託銀行株式会社	—
2. 住所	東京都港区	
3. 資本金	358,173百万円	
4. 事業の内容又は職業	銀行業務・信託業務	
5. 議決権等の所有（被所有） 割合	被所有 直接 50% 間接 50%	
6. 関係内容	役員の兼任等 なし 事業上の関係 投資顧問 投資信託販売	
7. 取引の内容	投資信託に係る営業費用の支払（注1） 取引金額 3,487,392千円 未払手数料 418,032千円	

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1） 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

2. 兄弟会社

項目	第21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)
1. 会社等の名称 2. 住所 3. 資本金 4. 事業の内容又は職業 5. 議決権等の所有（被所有） 割合 6. 関係内容 7. 取引の内容		親会社の子会社 中央三井信託銀行株式会社（注5） （注）親会社中央三井トラスト・ ホールディングス株式会社の 子会社 東京都港区 379,197百万円 銀行業務・信託業務 該当なし 役員の兼任等 なし 事業上の関係 投資信託販売 投資信託に係る営業費用の支払（注1） 取引金額 4,752,651千円 未払手数料 475,539千円
1. 会社等の名称 2. 住所 3. 資本金 4. 事業の内容又は職業 5. 議決権等の所有（被所有） 割合 6. 関係内容 7. 取引の内容	親会社の子会社 三井アセット信託銀行株式会社 （注）親会社中央三井信託銀行株式 会社の親会社三井トラスト・ ホールディングス株式会社の 子会社 東京都港区 11,000百万円 信託業務 該当なし 役員の兼任等 なし 事業上の関係 投資信託委託 投資顧問 支払投資顧問料（注2） 取引金額 3,242,366千円 未払費用 262,352千円 前払費用 327,765千円	親会社の子会社 中央三井アセット信託銀行株式会社 （注）親会社中央三井トラスト・ ホールディングス株式会社の 子会社 東京都港区 11,000百万円 信託業務 該当なし 役員の兼任等 なし 事業上の関係 投資信託委託 投資顧問 支払投資顧問料（注2） 取引金額 3,926,590千円 未払費用 265,697千円 前払費用 360,595千円
1. 会社等の名称 2. 住所 3. 資本金 4. 事業の内容又は職業 5. 議決権等の所有（被所有） 割合 6. 関係内容 7. 取引の内容		親会社の子会社 中央三井インフォメーションテクノ ロジー株式会社 （注）親会社中央三井トラスト・ ホールディングス株式会社の 子会社 東京都目黒区 200百万円 情報処理サービス業 該当なし 役員の兼任等 なし 事業上の関係 システムの管理・開発 委託 器具・備品の購入（注3） 取引金額 37,152千円 ソフトウェアの購入（注4） 取引金額 42,670千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注3) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

(注4) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

(注5) 平成19年10月1日付で親会社が中央三井信託銀行株式会社から中央三井トラスト・ホールディングス株式会社に變更となっており、第22期の中央三井信託銀行株式会社との取引はすべて兄弟会社として集計し記載しております。

10. 1株当たり情報

項目	第21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)
1. 1株当たり純資産額	289,803円02銭	348,198円11銭
2. 1株当たり当期純利益	166,583円24銭	157,785円55銭
	(注) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため、記載していません。	(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21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)
当期純利益（千円）	841,245	796,817
普通株主に帰属しない金額（千円）	—	—
普通株主に係る当期純利益（千円）	841,245	796,817
普通株式の期中平均株式数（株）	5,050	5,050

11. 重要な後発事象

第21期 (平成18年4月1日から 平成19年3月31日まで)	第22期 (平成19年4月1日から 平成20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

		第23期中間会計期間末 平成20年9月30日	
科目	金額（千円）	構成比 （％）	
(資産の部)			
I 流動資産			
1. 現金・預金	1,106,692		
2. 前払費用	224,200		
3. 未収委託者報酬	1,444,823		
4. 未収収益			
(1) 投資顧問報酬	406		
(2) その他	435	841	
5. 繰延税金資産	40,896		
6. その他※2	26,432		
流動資産 計	2,843,887	88.4	
II 固定資産			
1. 有形固定資産※1			
(1) 建物	31,843		
(2) 器具備品	67,447		
有形固定資産 計	99,291	3.1	
2. 無形固定資産			
(1) ソフトウェア	86,043		
(2) 電話加入権	1,847		
(3) 電話施設利用権	88		
無形固定資産 計	87,979	2.7	
3. 投資その他の資産			
(1) 投資有価証券	65,718		
(2) 長期貸付金	43,588		
(3) 長期差入保証金	87,326		
(4) 長期前払費用	7,518		
(5) 会員権	25,000		
(6) 貸倒引当金	△43,588		
投資その他の資産 計	185,562	5.8	
固定資産 計	372,833	11.6	
資産合計	3,216,721	100.0	

	第23期中間会計期間末 平成20年9月30日		
科目	金額（千円）		構成比 （％）
（負債の部）			
I 流動負債			
1. 預り金		2,316	
2. 未払金			
(1) 未払手数料	473,901		
(2) その他未払金※3	100,975	574,876	
3. 未払費用		301,698	
4. 未払法人税等		276,980	
5. 賞与引当金		40,193	
流動負債 計		1,196,064	37.2
II 固定負債			
1. 退職給付引当金		14,391	
2. 役員退職慰労引当金		16,400	
固定負債 計		30,791	0.9
負債合計		1,226,856	38.1
（純資産の部）			
I 株主資本			
1. 資本金		300,000	9.3
2. 資本剰余金			
(1) 資本準備金		50,000	
資本剰余金 計		50,000	1.6
3. 利益剰余金			
(1) 利益準備金		25,401	
(2) その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		1,614,745	
利益剰余金 計		1,640,146	51.0
株主資本 計		1,990,146	61.9
II 評価・換算差額等			
1. その他有価証券評価差額金		△281	△0.0
評価・換算差額等 計		△281	△0.0
純資産合計		1,989,864	61.9
負債・純資産合計		3,216,721	100.0

(5) 中間損益計算書

	第23期中間会計期間 (平成20年4月1日から 平成20年9月30日まで)		
科目	金額（千円）		百分比 (%)
I 営業収益			
1. 委託者報酬		6,515,832	
2. その他営業収益		5,229	
営業収益 計		6,521,061	100.0
II 営業費用			
1. 支払手数料		2,567,572	
2. 広告宣伝費		218,283	
3. 受益証券発行費		250	
4. 調査費			
(1) 調査費	113,991		
(2) 委託調査費	1,941,552	2,055,544	
5. 委託計算費		36,998	
6. 営業雑経費			
(1) 通信費	7,707		
(2) 印刷費	153,932		
(3) 協会費	7,548		
(4) 諸会費	277	169,466	
営業費用 計		5,048,115	77.4
III 一般管理費			
1. 給料			
(1) 役員報酬	24,407		
(2) 給料・手当	270,049		
(3) 賞与	42,161	336,619	
2. 福利厚生費		93,912	
3. 交際費		1,651	
4. 寄付金		300	
5. 旅費交通費		14,288	
6. 租税公課		8,309	
7. 不動産賃借料		54,411	
8. 退職給付費用		3,434	
9. 役員退職慰労引当金繰入		10,650	
10. 賞与引当金繰入		40,193	
11. 減価償却費※1		29,945	
12. 諸経費		236,733	
一般管理費 計		830,450	12.7
営業利益		642,496	9.9

	第23期中間会計期間 (平成20年4月1日から 平成20年9月30日まで)		
科目	金額（千円）		百分比 (%)
IV 営業外収益			
1. 受取配当金		7,500	
2. 受取利息		1,045	
3. 雑収入		206	
営業外収益 計		8,751	0.1
V 営業外費用			
1. 雑損失		65	
営業外費用 計		65	0.0
経常利益		651,181	10.0
VI 特別利益			
1. 貸倒引当金戻入		1,200	
特別利益 計		1,200	0.0
税引前中間純利益		652,381	10.0
法人税、住民税及び事業税	273,901		
法人税等調整額	△3,755	270,145	4.1
中間純利益		382,235	5.9

（６）中間株主資本等変動計算書

第23期中間会計期間（平成20年４月１日から平成20年９月30日まで）

（単位：千円）

株主資本		
資本金	前期末残高	300,000
	中間会計期間中の変動額	—
	中間会計期間末残高	300,000
資本剰余金		
資本準備金	前期末残高	50,000
	中間会計期間中の変動額	—
	中間会計期間末残高	50,000
資本剰余金合計	前期末残高	50,000
	中間会計期間中の変動額	—
	中間会計期間末残高	50,000
利益剰余金		
利益準備金	前期末残高	25,401
	中間会計期間中の変動額	—
	中間会計期間末残高	25,401
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	前期末残高	1,382,999
	中間会計期間中の変動額 剰余金の配当 中間純利益	△150,490 382,235
	中間会計期間末残高	1,614,745
利益剰余金合計	前期末残高	1,408,400
	中間会計期間中の変動額	231,745
	中間会計期間末残高	1,640,146
株主資本合計	前期末残高	1,758,400
	中間会計期間中の変動額	231,745
	中間会計期間末残高	1,990,146
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	前期末残高	—
	中間会計期間中の変動額（純額）	△281
	中間会計期間末残高	△281
評価・換算差額等合計	前期末残高	—
	中間会計期間中の変動額	△281
	中間会計期間末残高	△281
純資産合計	前期末残高	1,758,400
	中間会計期間中の変動額	231,463
	中間会計期間末残高	1,989,864

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

項目	第23期中間会計期間 (平成20年4月1日から 平成20年9月30日まで)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	その他有価証券 (1) 時価のあるもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額については全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。 (2) 時価のないもの 移動平均法に基づく原価法を採用しております。
2. 固定資産の減価償却の方法	
(1) 有形固定資産	定率法を採用しております。 なお、耐用年数は、建物については主として15年～18年、器具備品については主として5年～20年であります。
(2) 無形固定資産	定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（5年）を耐用年数としております。
3. 引当金の計上基準	
(1) 貸倒引当金	一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。
(2) 賞与引当金	従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間負担分を計上しております。
(3) 退職給付引当金	従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による中間期末退職給付債務相当額を計上しております。
(4) 役員退職慰労引当金	役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づき当中間期末要支給額を計上しております。
4. その他中間財務諸表作成の基本となる重要な事項	消費税等の会計処理は税抜方式を採用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第23期中間会計期間末 平成20年9月30日
※1. 有形固定資産の減価償却累計額	建物 21,025千円
※2. 担保資産	器具備品 164,292千円 その他のうち、次のものを供託しております。 取戻し手続中の投資顧問 (25,000千円) 業の営業保証金 預け金 26,000千円
※3. 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

項目	第23期中間会計期間 (平成20年4月1日から 平成20年9月30日まで)
※1. 減価償却実施額	有形固定資産 17,722千円 無形固定資産 12,222千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

項目	第23期中間会計期間 (平成20年4月1日から 平成20年9月30日まで)				
1. 発行済株式に関する事項					
	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	(1) 配当金支払額				
決議	株式の種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力 発生日
平成20年 6月26日 定時株主総会	普通株式	150,490	29,800	平成20年 3月31日	平成20年 6月27日

リース取引関係

第23期中間会計期間 (平成20年4月1日から 平成20年9月30日まで)
リース取引は重要性が乏しく、1件当たりの金額が少額なため、注記を省略しております。

有価証券関係

第23期中間会計期間末 平成20年9月30日			
1. その他有価証券で時価のあるもの			
区分	取得原価 (千円)	中間貸借対照表 計上額 (千円)	差額 (千円)
その他	1,000	718	△281
計	1,000	718	△281
2. 時価評価されていない有価証券			
区分	中間貸借対照表計上額 (千円)		
その他有価証券 非上場株式	65,000		
計	65,000		

デリバティブ関係

第23期中間会計期間 (平成20年4月1日から 平成20年9月30日まで)	
当社はデリバティブ取引を全く行っていないため、該当事項はありません。	

1株当たり情報

第23期中間会計期間 (平成20年4月1日から 平成20年9月30日まで)	
1株当たり純資産額	394,032円56銭
1株当たり中間純利益	75,690円26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23期中間会計期間 (平成20年4月1日から 平成20年9月30日まで)	
中間純利益(千円)	382,235
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)	382,235
普通株式の期中平均株式数(株)	5,050

重要な後発事象

第23期中間会計期間 (平成20年4月1日から 平成20年9月30日まで)	
該当事項はありません。	

4【利害関係人との取引制限】

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

（１）自己又はその役員との取引

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

（２）運用財産相互間の取引

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

（３）通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

（４）親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

（５）その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

（１）定款の変更

当会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

（２）訴訟事件その他の重要事項

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

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

- ①名称：中央三井アセット信託銀行株式会社
- ②資本金の額：11,000百万円（平成20年9月末日現在）
- ③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、「金融機関の信託業務の兼営等に関する法律」に基づき信託業務を営んでいます。

＜再信託受託会社＞

- ①名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ②資本金の額：51,000百万円（平成20年9月末日現在）
- ③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、「金融機関の信託業務の兼営等に関する法律」に基づき信託業務を営んでいます。

（2）販売会社

- ①名称：中央三井信託銀行株式会社
- ②資本金の額：379,197百万円（平成20年9月末日現在）
- ③事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、「金融機関の信託業務の兼営等に関する法律」に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

（1）受託会社

当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

＜再信託受託会社＞

当ファンドの再信託受託会社として、信託事務の一部を行います。

（2）販売会社

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

3【資本関係】

（1）受託会社

該当事項はありません。

＜再信託受託会社＞

該当事項はありません。

（2）販売会社

該当事項はありません。

第 3 【参考情報】

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

提出日	書類名
平成19年12月26日	有価証券届出書の訂正届出書
平成20年 3 月10日	有価証券報告書
平成20年 3 月10日	有価証券届出書
平成20年 9 月10日	半期報告書
平成20年 9 月10日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成20年2月8日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

監査法人 トーマツ

指定社員
業務執行社員 公認会計士 浅子 正明 印

指定社員
業務執行社員 公認会計士 木村 充男 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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Aの平成18年12月12日から平成19年12月10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Aの平成19年12月10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

※ 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](#)

独立監査人の監査報告書

平成19年6月29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 斉藤 智之 印

指定社員 業
務執行社員 公認会計士 木村 充男 印

当監査法人は、証券取引法第193条の2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18年4月1日から平成19年3月31日までの第21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19年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成21年2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

監査法人 トーマツ

指定社員
業務執行社員 公認会計士 松崎 雅 則 印

指定社員
業務執行社員 公認会計士 平 木 達 也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている中央三井DC日本株式インデックスファンドAの平成19年12月11日から平成20年12月10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Aの平成20年12月10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

※ 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](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年6月16日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

監査法人 トーマツ

指定社員 業
務執行社員 公認会計士 浅子 正 明 印

指定社員 業
務執行社員 公認会計士 木村 充 男 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている中央三井アセットマネジメント株式会社の平成19年4月1日から平成20年3月31日までの第22期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、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20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成20年12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

監査法人 トーマツ

指定社員 業 公認会計士 松崎 雅 則 印
務執行社員

指定社員 業 公認会計士 平 木 達 也 印
務執行社員

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期事業年度の中間会計期間（平成20年4月1日から平成20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であり、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20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20年4月1日から平成20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。

