

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券報告書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	平成22年3月10日
<b>【計算期間】</b>	第7期（自平成20年12月11日 至平成21年12月10日）
<b>【ファンド名】</b>	中央三井DC日本株式インデックスファンドA
<b>【発行者名】</b>	中央三井アセットマネジメント株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 渡辺 輝夫
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都港区芝三丁目23番1号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	鈴木 勝宏
<b>【連絡場所】</b>	東京都港区芝三丁目23番1号 業務企画部
<b>【電話番号】</b>	03-5440-0181
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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】

###### ファンドの目的

当ファンドは、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

###### 信託金限度額

上限：3,000億円

###### 基本的性格

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

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

##### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### (用語の定義について)

当ファンドが該当する商品分類に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

###### < 単位型投信・追加型投信 >

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

###### < 投資対象地域 >

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

###### < 投資対象資産（収益の源泉） >

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

を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

< 補足分類 >

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グローバル ( )  日本		日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)  日々	北米  欧州  アジア  オセアニア	ファミリー ファンド	TOPIX
不動産投信  その他資産 (投資信託証券(株式一般))	その他 ( )	中南米  アフリカ  中近東 (中東)	ファンド ・オブ ファンズ	その他 ( )
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		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ます。

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

は組入れている資産そのもの（形式基準）を記載することとなっているためです。

#### < 決算頻度 >

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

#### < 投資対象地域 >

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

#### < 投資形態 >

- ・ファミリーファンド

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

#### < インデックスファンドにおける対象インデックス >

- ・ T O P I X

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

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 投資態度 A .」の記載もご参照ください。

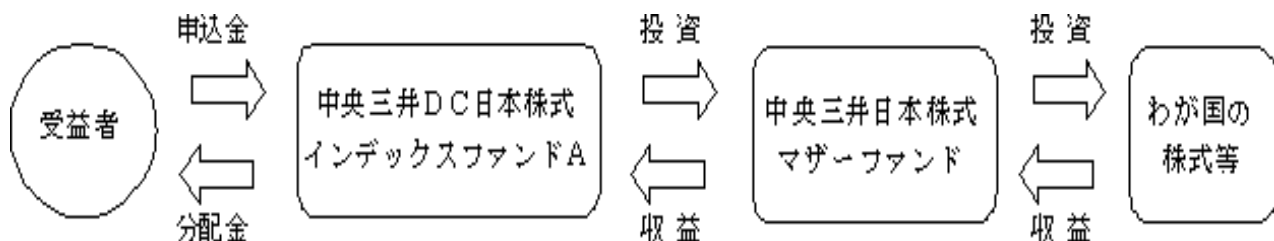
#### ファンドの特色

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

#### （2）【ファンドの仕組み】

##### ファミリーファンド方式での運用

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



##### ファンドの関係法人

委託会社 中央三井アセットマネジメント株式会社

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

受託会社 中央三井アセット信託銀行株式会社

（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

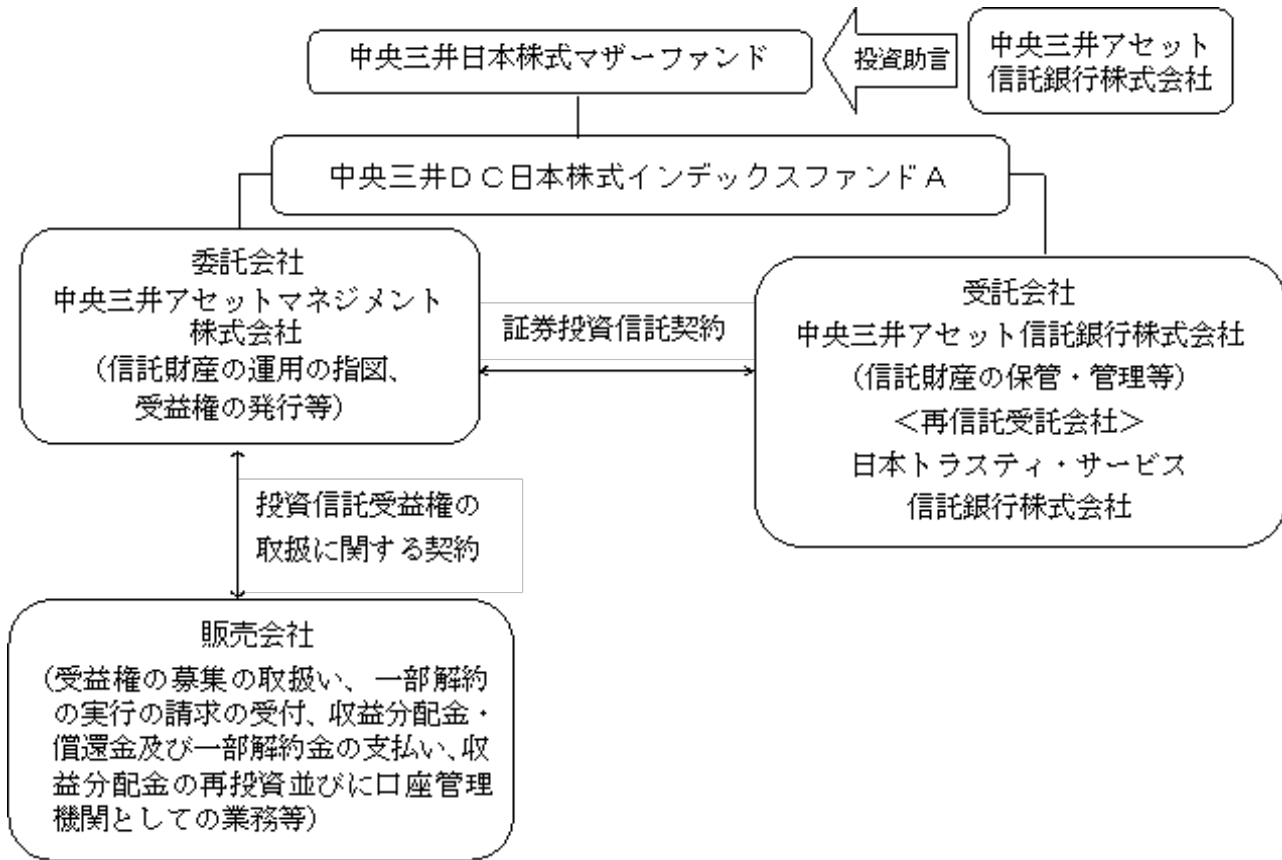
当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

##### 販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付け、収益

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

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

### 委託会社の概況

A．資本金の額：3億円（平成22年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9月：投資一任業務の認可取得

平成11年7月：中信投資顧問株式会社（中央信託銀行グループの投資顧問会社）と合併し

「中央三井アセットマネジメント株式会社」に社名変更

平成12年3月：証券投資信託委託業務認可取得

平成19年9月：金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録

## C．大株主の状況（平成22年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】

## 運用方針

当ファンドは、主としてわが国の株式に投資する中央三井日本株式マザーファンドを主要投資対象とし、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。なお、株式等に直接投資することもあります。

## 投資態度

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

## 「TOPIX」（東証株価指数）の著作権等について

- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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

号口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号八に掲げるものをいいます。以下同じ)、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

F. 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことができます。

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

## (2)【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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) J.、K.及びL.に定めるものに限り、)

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

### 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、)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書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- Q．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- R．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 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

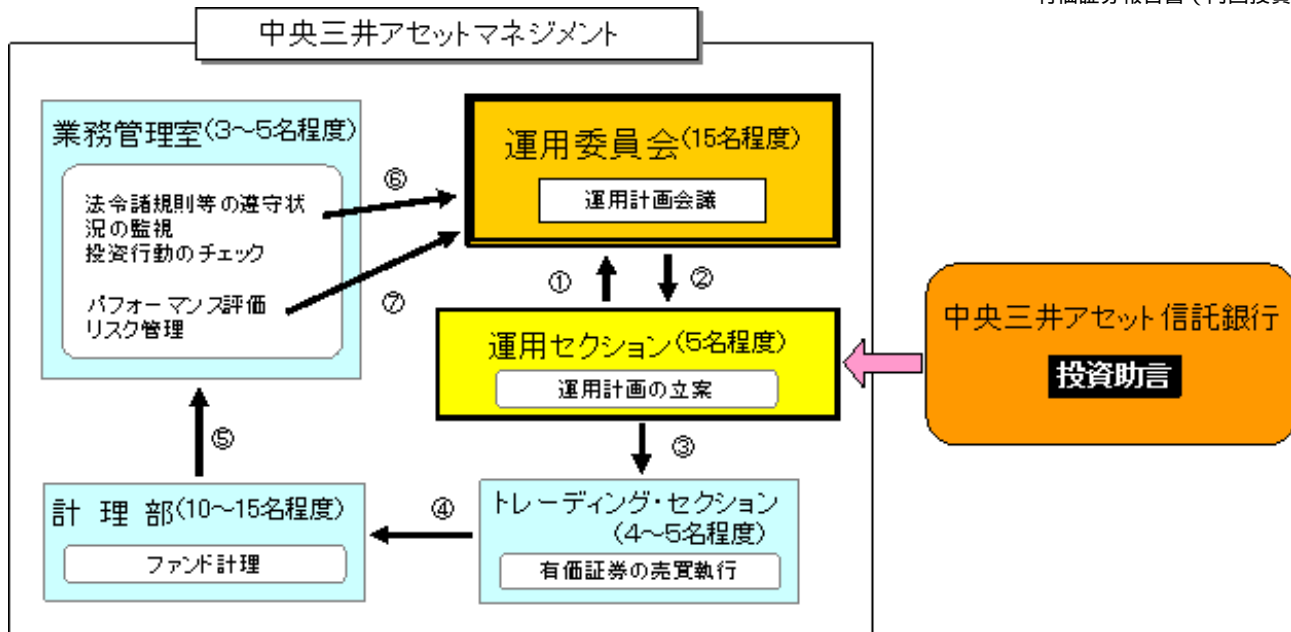
なお、上記A．の証券又は証書並びに上記L．及び上記Q．の証券又は証書のうち上記A．の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記B．から上記F．までの証券並びに上記L．及び上記Q．の証券又は証書のうち上記B．から上記F．までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記M．の証券及び上記N．の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 運用指図できる金融商品

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

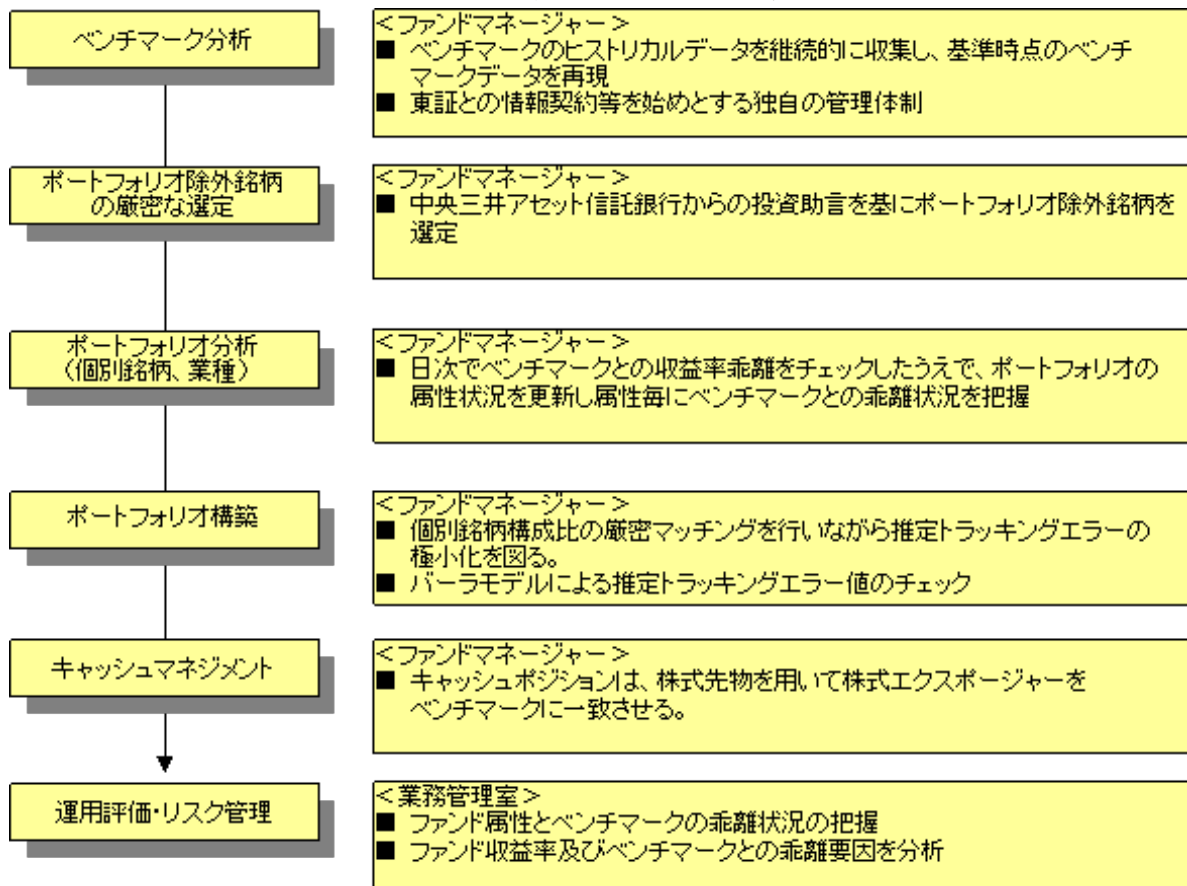
### （3）【運用体制】

当ファンドの運用体制は以下のとおりです。



- 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

具体的なポートフォリオ構築プロセスは、以下のとおりです。



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

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

あります。

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

#### （４）【分配方針】

##### 分配方針

年1回の毎決算時（決算日は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。

##### 分配収益の計算

- A．信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。
  - イ．配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費（後記「４ 手数料等及び税金（４）その他の手数料等」の記載をご参照ください。）、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税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。
  - 二．「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。
- B．毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

##### 収益分配金の再投資等

収益分配金は、自動的に当ファンドの受益権に再投資されます。

- A．別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払込むことにより、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ます。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。
- C．信託契約の一部解約が行われた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、上記A．及びB．の規定にかかわらず、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する

日から当該受益権に係る受益者に支払います。

#### (5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

##### A. 株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

##### B. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

##### C. 新株引受権証券等への投資割合

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

##### D. 投資信託証券への投資割合

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

##### E. 同一銘柄の株式への投資割合

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

##### F. 同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

##### G. 同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

##### H. 投資する株式等の範囲

イ. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所では有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、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、下記オ．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、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。

○．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るときは、担保の提供の指図を行うものとします。

ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社はすみやかに、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。

関連法令に基づく投資制限

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

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

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

#### B. 同一の法人の発行する株式への投資制限

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

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

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

ロ. 当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数

#### (参考) マザーファンドの概要

##### 「中央三井日本株式マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

株式への投資は、原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、「TOPIX」(東証株価指数、配当込み)と連動する投資成果を目標として運用を行います。運用に際しては、中央三井アセット信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、中央三井アセット信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

株式の組入比率は、原則として高位(90%以上)とします。

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

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

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

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

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

### 3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

### 3【投資リスク】

(1) 当ファンドは、マザーファンドを通じて主に国内株式を投資対象としています。組入れた株式の株価の変動等により基準価額が変動しますので、元本保証はなく、投資元本を割り込むことがあり収益（投資利回り）は未確定です。また、組入れた株式の発行体の経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化等により、投資元本を割り込むことがあり収益（投資利回り）は未確定です。

なお当ファンドは、「TOPIX」（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行いますので、「TOPIX」（東証株価指数、配当込み）の変動により当ファンドの基準価額も変動し、これにより損失が生ずることとなるおそれがあります。

当ファンドの主なリスクは以下のとおりです。

#### 株価変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

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

#### その他のリスク

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

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

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

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

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】

解約手数料はありませんが、下記 の信託財産留保額が控除されます。

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

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

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

##### (3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率10,000分の40.95（税抜 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。

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

上記 の信託報酬に係る消費税等相当額は、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】

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

なお、マザーファンドにおいては、監査報酬はかかりません。

借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

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。

## 企業型年金

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

## 個人型年金

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

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

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

## 5 【運用状況】

以下の記載事項は、平成21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	中央三井日本株式マザーファンド	日本	1,250,095,611	100.02
受益証券	親投資信託受益証券合計		1,250,095,611	100.02
その他の資産(負債控除後)			276,782	0.02
合計(純資産総額)			1,249,818,829	100.00

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

## &lt;参考&gt;

当ファンドが主要投資対象としている親投資信託の状況は次のとおりです。

## (中央三井日本株式マザーファンド)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	258,518,783,420	97.33
新株予約権証券	日本	3,650,000	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		7,078,917,799	2.67
合計(純資産総額)		265,601,351,219	100.00

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

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

種類	銘柄	口数	簿価(円)		評価額(円)		投資比率(%)
			単価	金額	単価	金額	

親投資信託 受益証券	中央三井日本株式 マザーファンド	1,588,431,527	0.7571	1,202,601,510	0.7870	1,250,095,611	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。

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### < 参考 >

当ファンドが主要投資対象としている親投資信託の状況

(中央三井日本株式マザーファンド)

投資有価証券の主要銘柄

#### A. 主要銘柄の明細

順位	銘柄名	業種	株数	簿価(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額	
1	トヨタ自動車	輸送用機器	2,962,400	2,953.19	8,748,530,056	3,880.00	11,494,112,000	4.33
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	16,021,100	483.36	7,743,958,896	452.00	7,241,537,200	2.73
3	本田技研工業	輸送用機器	1,839,200	2,082.91	3,830,888,072	3,110.00	5,719,912,000	2.15
4	キヤノン	電気機器	1,336,900	2,759.25	3,688,841,325	3,910.00	5,227,279,000	1.97
5	三菱商事	卸売業	1,700,300	1,291.31	2,195,614,393	2,305.00	3,919,191,500	1.48
6	日本電信電話	情報・通信業	896,700	4,495.08	4,030,738,236	3,650.00	3,272,955,000	1.23
7	武田薬品工業	医薬品	848,100	4,185.09	3,549,374,829	3,830.00	3,248,223,000	1.22
8	東京電力	電気・ガス業	1,356,100	2,750.71	3,730,237,831	2,335.00	3,166,493,500	1.19
9	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,165,900	3,468.04	4,043,387,836	2,645.00	3,083,805,500	1.16
10	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	18,528,200	209.27	3,877,396,414	166.00	3,075,681,200	1.16
11	ソニー	電気機器	1,150,800	1,962.02	2,257,892,616	2,670.00	3,072,636,000	1.16
12	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	4,260,500	599.85	2,555,660,925	681.00	2,901,400,500	1.09
13	パナソニック	電気機器	2,107,600	1,126.07	2,373,305,132	1,325.00	2,792,570,000	1.05
14	任天堂	その他製品	121,700	30,133.04	3,667,190,968	22,040.00	2,682,268,000	1.01
15	東芝	電気機器	4,854,000	396.79	1,926,018,660	511.00	2,480,394,000	0.93
16	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	18,880	157,821.53	2,979,670,486	129,600.00	2,446,848,000	0.92
17	三井物産	卸売業	1,833,500	909.97	1,668,429,995	1,311.00	2,403,718,500	0.91
18	新日本製鐵	鉄鋼	6,336,000	283.84	1,798,410,240	375.00	2,376,000,000	0.89
19	東日本旅客鉄道	陸運業	400,900	6,331.70	2,538,378,530	5,870.00	2,353,283,000	0.89
20	三菱地所	不動産業	1,493,000	1,271.40	1,898,200,200	1,478.00	2,206,654,000	0.83
21	東京海上ホールディングス	保険業	865,300	2,246.11	1,943,558,983	2,530.00	2,189,209,000	0.82
22	日産自動車	輸送用機器	2,589,400	315.74	817,577,156	810.00	2,097,414,000	0.79
23	ソフトバンク	情報・通信業	930,000	1,402.75	1,304,557,500	2,170.00	2,018,100,000	0.76
24	信越化学工業	化学	371,300	4,233.52	1,571,905,976	5,230.00	1,941,899,000	0.73
25	小松製作所	機械	1,001,100	1,030.96	1,032,094,056	1,934.00	1,936,127,400	0.73
26	ファナック	電気機器	222,900	5,794.70	1,291,638,630	8,630.00	1,923,627,000	0.72

27	関西電力	電気・ガス業	888,600	2,344.14	2,083,002,804	2,100.00	1,866,060,000	0.70
28	ジェイ エフ イー ホールディングス	鉄鋼	483,900	2,357.76	1,140,920,064	3,650.00	1,766,235,000	0.66
29	K D D I	情報・通信業	3,532	561,197.94	1,982,151,124	493,000.00	1,741,276,000	0.66
30	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	908,600	2,501.03	2,272,435,858	1,897.00	1,723,614,200	0.65
合計			77,496,412		84,541,967,791		94,368,523,500	35.53

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

(注2) 国/地域は全て日本、種類は全て株式です。

#### B. 種類別及び業種別の投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	水産・農林業	0.10
	鉱業	0.40
	建設業	1.83
	食料品	3.36
	繊維製品	0.87
	パルプ・紙	0.37
	化学	5.76
	医薬品	4.20
	石油・石炭製品	0.63
	ゴム製品	0.59
	ガラス・土石製品	1.21
	鉄鋼	2.69
	非鉄金属	1.19
	金属製品	0.66
	機械	4.56
	電気機器	14.37
	輸送用機器	10.38
	精密機器	1.61
	その他製品	2.10
	電気・ガス業	4.92
	陸運業	3.69
	海運業	0.46
	空運業	0.30
	倉庫・運輸関連業	0.24
	情報・通信業	5.25
	卸売業	4.97
	小売業	3.37
	銀行業	8.78
	証券、商品先物取引業	1.86
	保険業	2.10
	その他金融業	0.65
	不動産業	2.32
サービス業	1.55	
	小計	97.33
新株予約権証券		0.00
合計		97.33

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該種類及び業種の評価金額の比率をいいます。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

銘柄名	国/地域	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引 買建 TOPIX先物取引	日本	781	7,052,673,450	7,064,145,000	2.66

(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】

## 【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
第7期計算期間(平成21年12月10日現在)	1,204,086,539	10,971
平成20年12月末日	1,077,024,927	10,636
平成21年1月末日	1,001,650,258	9,824
平成21年2月末日	970,215,120	9,373
平成21年3月末日	1,009,408,671	9,682
平成21年4月末日	1,128,445,359	10,471
平成21年5月末日	1,210,025,177	11,210
平成21年6月末日	1,280,951,152	11,603
平成21年7月末日	1,319,299,740	11,869
平成21年8月末日	1,348,544,544	12,051
平成21年9月末日	1,273,424,205	11,434
平成21年10月末日	1,247,436,445	11,236
平成21年11月末日	1,167,324,616	10,544
平成21年12月末日	1,249,818,829	11,403

(注) 決算日における基準価額は、分配付、分配落とも同一です。

## 【分配の推移】

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

## 【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 %
第7期計算期間	6.3 %

（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）申込みの受け付け

申込期間中において、毎営業日お申込みいただけます。

（注）お申込みの取扱いは、営業日の午後2時（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。

上記の規定にかかわらず、分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場  
合を除き、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会  
社は受益権の取得申込みの受け付けを中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取り消す  
ことができます。

##### （2）取得申込者

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

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

##### （3）募集取扱いの単位

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

##### （4）販売価額

継続募集期間における受益権の販売価額は、取得申込受付日の基準価額とします。

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

##### （5）申込の際に負担するコストの有無

申込手数料はありません。

##### （6）その他

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

等」に記載する一部解約の実行の請求を行うこととなります。

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

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

(注) 一部解約の実行の請求の受付けは、営業日の午後2時(本邦金融商品取引所が半日立会の場合)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けは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

(2) 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとし、

(3) 委託会社は、一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

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

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

販売会社の詳細につきましては、以下の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

中央三井アセットマネジメント株式会社

・お問い合わせ窓口

電話：03-5440-0190

受付時間：営業日の9時～17時(本邦金融商品取引所が半日立会の場合は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けを中止することができます。
- (6) 上記(5)により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受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よることとなります。
- (8) 解約に係る手数料については、徴収しません。
- (9) 一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

## 第3【管理及び運営】

### 1【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額

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

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

##### A．親投資信託受益証券（中央三井日本株式マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

##### B．国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

当ファンドの信託期間は、信託契約締結日（平成14年12月11日）から無期限とします。ただし、委託会社は、下記（5）の事項に該当することとなった場合は、この信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

#### (4)【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年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。

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

#### (5)【その他】

##### 信託の終了

この信託契約を解約し信託を終了させる場合は下記のとおりです。

##### A．委託会社の所定の手続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

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

#### B．監督官庁の命令

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

#### C．委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

#### D．受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い

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

#### 委託会社の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い

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

#### 信託約款の変更

- A．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

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

#### 反対者の買取請求権

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

#### 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 信託財産の管理

##### A. 保管業務の委任

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

##### B. 有価証券の保管

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

##### C. 混蔵寄託

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

##### D. 信託財産の登記等及び記載等の留保等

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

ロ. 上記イ. 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できます。

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できます。

#### 運用報告書

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

す。

関係法人との契約の更改等に関する手続、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いに関する契約」の有効期間は、有効期間満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。
- B．上記A．の契約を変更した場合には、有価証券報告書等においてその内容を開示します。

信託事務処理の再委託

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

## 2【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次のとおりです。

### (1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

### (2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

### (3) 一部解約請求権

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

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

一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

### (4) 投資信託約款等重要事項変更時の反対者の買取請求権

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

(5) 受益権均等分割

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

(6) 帳簿閲覧権

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

(参考)

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

## 第4【ファンドの経理状況】

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

ただし、第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）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は、監査法人トーマツによる監査を受け、第7期計算期間（平成20年12月11日から平成21年12月10日まで）の財務諸表については、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

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

## 1【財務諸表】

中央三井DC日本株式インデックスファンドA

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 (平成20年12月10日現在)	第7期 (平成21年12月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,035,992,232	1,206,672,295
未収入金	1,540,737	1,393,674
流動資産合計	1,037,532,969	1,208,065,969
資産合計	1,037,532,969	1,208,065,969
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,540,737	1,393,674
未払受託者報酬	344,560	331,514
未払委託者報酬	2,342,959	2,254,242
流動負債合計	4,228,256	3,979,430
負債合計	4,228,256	3,979,430
純資産の部		
元本等		
元本	1,001,134,546	1,097,544,565
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	32,170,167	106,541,974
純資産合計	1,033,304,713	1,204,086,539
負債純資産合計	1,037,532,969	1,208,065,969

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期	第7期
	自平成19年12月11日 至平成20年12月10日	自平成20年12月11日 至平成21年12月10日
営業収益		
有価証券売買等損益	808,548,260	74,450,778
営業収益合計	808,548,260	74,450,778
営業費用		
受託者報酬	743,945	608,105
委託者報酬	5,058,734	4,134,992
営業費用合計	5,802,679	4,743,097
営業利益又は営業損失( )	814,350,939	69,707,681
経常利益又は経常損失( )	814,350,939	69,707,681
当期純利益又は当期純損失( )	814,350,939	69,707,681
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	76,670,127	6,279,065
期首剰余金又は期首欠損金( )	816,266,076	32,170,167
剰余金増加額又は欠損金減少額	128,778,960	14,891,510
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	128,778,960	14,891,510
剰余金減少額又は欠損金増加額	175,194,057	3,948,319
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	175,194,057	3,948,319
期末剰余金又は期末欠損金( )	32,170,167	106,541,974

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第 6 期 自 平成19年12月11日 至 平成20年12月10日	第 7 期 自 平成20年12月11日 至 平成21年12月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、法令及び 社団法人投資信託協会規則に従 い、基準価額で評価してありま す。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

	第 6 期 (平成20年12月10日現在)	第 7 期 (平成21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	1,001,134,546 口	1,097,544,565 口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0321 円 (10,321 円)	1.0971 円 (10,971 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

## 1. 分配金の計算過程

		第 6 期 自 平成19年12月11日 至 平成20年12月10日	第 7 期 自 平成20年12月11日 至 平成21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)	19,488,233 円 (20,945,787 円)
費用控除後・繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益額	B	円	円
収益調整金額	C	623,131,470 円	732,790,705 円
分配準備積立金額	D	222,352,296 円	217,128,330 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	866,081,858 円	969,407,268 円
当ファンドの期末残存口数	F	1,001,134,546 口	1,097,544,565 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	8,651.00 円	8,832.50 円
10,000口当たり分配金額	H	円	円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	円	円

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

	第 6 期 自 平成19年12月11日 至 平成20年12月10日	第 7 期 自 平成20年12月11日 至 平成21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又は欠損金減少額」及び「当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ剰余金減少額と増加額との純額を表示しております。	同左
---------------	--	----

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

第 6 期 自 平成19年12月11日 至 平成20年12月10日	第 7 期 自 平成20年12月11日 至 平成21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 6 期 自 平成19年12月11日 至 平成20年12月10日	第 7 期 自 平成20年12月11日 至 平成21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 6 期 自 平成19年12月11日 至 平成20年12月10日	第 7 期 自 平成20年12月11日 至 平成21年12月10日
期首元本額	910,484,079 円	1,001,134,546 円
期中追加設定元本額	295,481,661 円	217,735,038 円
期中一部解約元本額	204,831,194 円	121,325,019 円

## 2. 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第 6 期 (平成20年12月10日現在)		第 7 期 (平成21年12月10日現在)	
	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)	貸借対照表計上額 (円)	最終の計算期間(自平成20年12月11日至平成21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	1,035,992,232	721,397,122	1,206,672,295	73,158,654
合計	1,035,992,232	721,397,122	1,206,672,295	73,158,654

## 3. デリバティブ取引関係

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。

第7期(自平成20年12月11日至平成21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】

## 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	1,594,018,884	1,206,672,295	
合計		1,594,018,884	1,206,672,295	

## 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 商品明細表

該当事項はありません。

## 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

## &lt; 参考 &gt;

「中央三井DC日本株式インデックスファンド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21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21年12月10日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,098,553,302
株式	251,488,032,760
新株予約権証券	3,358,000
未収入金	343,575,475
未収配当金	55,248,120
未収利息	23,312
流動資産合計	260,988,790,969
資産合計	260,988,790,969
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	151,400,000
前受金	302,915,000
未払金	80,984,809
未払解約金	242,082,917
流動負債合計	777,382,726
負債合計	777,382,726
純資産の部	
元本等	
元本	343,750,575,489
剰余金	
欠損金	83,539,167,246
純資産合計	260,211,408,243
負債・純資産合計	260,988,790,969

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成21年12月10日現在
--	---------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

平成21年12月10日現在	
1．担保に供している資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。</p> <p style="text-align: right;">株式 3,271,500,000 円</p> <p>なお、上記の金額には、約定未受渡株式を含んでおりません。</p>
2．計算日における受益権総数	343,750,575,489 口
3．「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第55条の6第10号に規定する額	<p>元本の欠損</p> <p>83,539,167,246 円</p>
4．1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	<p>0.7570 円</p> <p>( 7,570 円)</p>

## (関連当事者との取引に関する注記)

平成21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21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21年12月10日現在	
計算期間の期首元本額	297,888,285,769 円
計算期間中の追加設定元本額	80,200,414,906 円
計算期間中の一部解約元本額	34,338,125,186 円
計算日の元本額	343,750,575,489 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	2,513,995,457 円
中央三井DC日本株式インデックスファンド	287,319,780 円
中央三井DC日本株式インデックスファンドL	36,262,129,266 円
中央三井DC日本株式インデックスファンドA	1,594,018,884 円
中央三井DCバランスファンド30	174,733,331 円
中央三井DCバランスファンド50	472,128,065 円
中央三井DCバランスファンド70	304,464,802 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	442,069,303 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	261,924,834 円
新生・4分散ファンド	294,494,030 円
ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド	655,821,759 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	143,853,829 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	362,563,898 円
日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)	36,400,997 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)	42,494,435,689 円
中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)	8,190,666,107 円
中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)	59,896,084,558 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)	49,642,834,845 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)	7,408,064,009 円
中央三井VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	1,006,607,816 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)	9,479,607,024 円
中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)	7,212,307,012 円
中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	3,016,059,631 円
中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)	45,674,369,955 円
中央三井バランスVA75(適格機関投資家専用)	2,955,176,456 円
中央三井VL株式30(適格機関投資家専用)	15,268,886 円
中央三井VL株式50(適格機関投資家専用)	23,830,846 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)	23,076,094,350 円
中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	8,823,791,662 円
中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	305,905,881 円
中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)	3,880,280,757 円
中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	2,999,056,675 円
CMAA・バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	7,909,493,980 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)	492,613,190 円
CMAA私募日本株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	4,304,879,297 円
CMAA・VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	357,766,809 円
中央三井バランスVA20(適格機関投資家専用)	2,052,745,241 円
中央三井VAファンド25(適格機関投資家専用)	3,498,903,759 円
CMAA・バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	2,918,630,112 円
中央三井バランスVA20L(適格機関投資家専用)	150,493,113 円
中央三井バランスVA25L(適格機関投資家専用)	2,157,222,775 円
CMAA・バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	484,899 円
中央三井世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	242,450 円
中央三井国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	417,595 円
中央三井国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	321,875 円

## 2. 有価証券関係

## 売買目的有価証券

平成21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	251,488,032,760	20,857,326,996
新株予約権証券	3,358,000	3,358,000
合計	251,491,390,760	20,860,684,996

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

## . 取引の状況に関する事項

平成21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。

## . 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21年12月10日現在		
		契約額等（円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引 買建	8,846,400,000	8,695,000,000	151,400,000

合計	8,846,400,000		8,695,000,000	151,400,000
----	---------------	--	---------------	-------------

(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。

[次へ](#)

## (3) 附属明細表(平成21年12月10日現在)

## 有価証券明細表

## A. 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	104,000	178	18,512,000	
日本水産	262,400	250	65,600,000	
マルハニチロホールディングス	519,000	127	65,913,000	
サカタのタネ	48,300	1,379	66,605,700	
ホクト	26,800	1,843	49,392,400	
日鉄鉱業	67,000	405	27,135,000	
三井松島産業	114,000	140	15,960,000	
国際石油開発帝石	1,202	640,000	769,280,000	
関東天然瓦斯開発	29,000	469	13,601,000	
石油資源開発	41,600	3,950	164,320,000	
ショーボンドホールディングス	24,500	1,546	37,877,000	
ダイセキ環境ソリューション	26	112,500	2,925,000	
東急建設	104,890	245	25,698,050	
コムシスホールディングス	108,500	915	99,277,500	
高松コンストラクショングループ	23,400	1,255	29,367,000	
東建コーポレーション	11,620	2,225	25,854,500	
大成建設	1,112,000	152	169,024,000	
大林組	683,000	291	198,753,000	
清水建設	689,000	299	206,011,000	
松井建設	44,000	366	16,104,000	
鹿島建設	1,078,000	173	186,494,000	
太平工業	40,000	325	13,000,000	
前田建設工業	195,000	217	42,315,000	
奥村組	247,000	301	74,347,000	
大和小田急建設	34,000	229	7,786,000	
東鉄工業	35,000	484	16,940,000	
戸田建設	299,000	270	80,730,000	
青木あすなろ建設	27,500	475	13,062,500	
北野建設	78,000	215	16,770,000	
三井ホーム	39,000	449	17,511,000	
矢作建設工業	42,000	618	25,956,000	
ピーエス三菱	23,000	323	7,429,000	
大東建託	105,400	4,250	447,950,000	
NIPPO	55,000	639	35,145,000	
前田道路	71,000	664	47,144,000	
日本道路	82,000	187	15,334,000	
五洋建設	290,000	88	25,520,000	
大林道路	46,000	151	6,946,000	
住友林業	180,800	688	124,390,400	
日本基礎技術	42,000	180	7,560,000	
巴コーポレーション	46,000	188	8,648,000	
パナホーム	95,000	601	57,095,000	
大和ハウス工業	611,000	940	574,340,000	
ライト工業	65,400	185	12,099,000	
積水ハウス	739,000	779	575,681,000	
北陸電気工事	22,000	252	5,544,000	
コミュニチュア	26,000	611	15,886,000	
ユアテック	45,000	501	22,545,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
西部電気工業	28,000	339	9,492,000	
四電工	27,000	474	12,798,000	
中電工	34,800	1,138	39,602,400	
関電工	108,000	572	61,776,000	
大明	32,900	676	22,240,400	
きんでん	155,000	795	123,225,000	
東京エネシス	31,000	599	18,569,000	
トーエネック	40,000	523	20,920,000	
住友電設	22,600	447	10,102,200	
日本電設工業	50,000	687	34,350,000	
協和エクシオ	88,400	759	67,095,600	
新日本空調	21,700	570	12,369,000	
東電通	50,000	170	8,500,000	
日本電話施設	47,000	283	13,301,000	
九電工	52,000	520	27,040,000	
三機工業	59,000	630	37,170,000	
日揮	245,000	1,661	406,945,000	
中外炉工業	85,000	226	19,210,000	
ヤマト	30,000	314	9,420,000	
太平電業	32,000	829	26,528,000	
高砂熱学工業	71,200	770	54,824,000	
三晃金属工業	39,000	220	8,580,000	
NEC ネットエスアイ	19,800	1,073	21,245,400	
朝日工業社	35,000	352	12,320,000	
大気社	36,300	1,270	46,101,000	
ダイダン	37,000	449	16,613,000	
日比谷総合設備	37,000	771	28,527,000	
東芝プラントシステム	36,000	1,127	40,572,000	
東洋エンジニアリング	156,000	262	40,872,000	
千代田化工建設	190,000	676	128,440,000	
新興プランテック	44,400	894	39,693,600	
日本製粉	152,000	464	70,528,000	
日清製粉グループ本社	238,000	1,199	285,362,000	
日東富士製粉	21,000	334	7,014,000	
昭和産業	108,000	298	32,184,000	
鳥越製粉	22,900	824	18,869,600	
協同飼料	92,000	109	10,028,000	
中部飼料	25,000	805	20,125,000	
日本配合飼料	74,000	100	7,400,000	
ユニ・チャーム ペットケア	15,000	3,070	46,050,000	
東洋精糖	41,000	113	4,633,000	
日本甜菜製糖	135,000	238	32,130,000	
三井製糖	93,000	298	27,714,000	
森永製菓	257,000	194	49,858,000	
中村屋	61,000	465	28,365,000	
江崎グリコ	95,000	1,030	97,850,000	
名糖産業	11,900	1,265	15,053,500	
不二家	151,000	160	24,160,000	
山崎製パン	192,000	1,108	212,736,000	
第一屋製パン	36,000	94	3,384,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
モロゾフ	41,000	300	12,300,000	

森永乳業	222,000	392	87,024,000	
ヤクルト本社	140,900	2,795	393,815,500	
明治ホールディングス	77,800	3,470	269,966,000	
雪印メグミルク	51,600	1,527	78,793,200	
プリマハム	132,000	92	12,144,000	
日本ハム	183,000	1,052	192,516,000	
伊藤ハム	163,000	323	52,649,000	
丸大食品	107,000	286	30,602,000	
米久	21,000	776	16,296,000	
S Foods	14,500	794	11,513,000	
サッポロホールディングス	373,000	440	164,120,000	
アサヒビール	457,700	1,652	756,120,400	
キリンホールディングス	1,075,000	1,395	1,499,625,000	
宝ホールディングス	206,000	494	101,764,000	
オエノンホールディングス	68,000	177	12,036,000	
メルシャン	79,000	196	15,484,000	
養命酒製造	20,000	820	16,400,000	
三国コカ・コーラボトリング	31,400	731	22,953,400	
コカ・コーラウエスト	64,700	1,654	107,013,800	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	29,600	1,163	34,424,800	
ダイドードリンコ	10,900	2,780	30,302,000	
伊藤園	73,100	1,358	99,269,800	
キーコーヒー	21,300	1,599	34,058,700	
ユニカフェ	6,200	570	3,534,000	
ジャパンフーズ	3,500	840	2,940,000	
日清オイリオグループ	101,000	433	43,733,000	
不二製油	63,800	1,428	91,106,400	
J - オイルミルズ	98,000	279	27,342,000	
キッコーマン	199,000	1,030	204,970,000	
味の素	663,000	817	541,671,000	
キューピー	135,800	988	134,170,400	
ハウス食品	96,900	1,325	128,392,500	
カゴメ	94,300	1,703	160,592,900	
焼津水産化学工業	12,400	1,096	13,590,400	
アリアケジャパン	21,600	1,395	30,132,000	
ニチレイ	272,000	314	85,408,000	
東洋水産	113,000	2,200	248,600,000	
日清食品ホールディングス	92,800	3,030	281,184,000	
永谷園	23,000	870	20,010,000	
フジッコ	26,000	1,081	28,106,000	
ロック・フィールド	12,800	1,215	15,552,000	
日本たばこ産業	5,460	285,100	1,556,646,000	
わらべや日洋	13,400	1,032	13,828,800	
なとり	11,500	796	9,154,000	
ミヨシ油脂	85,000	142	12,070,000	
片倉工業	28,200	859	24,223,800	
ゲンゼ	170,000	323	54,910,000	
川島織物セルコン	89,000	58	5,162,000	
東洋紡績	820,000	142	116,440,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ユニチカ	532,000	68	36,176,000	
富士紡ホールディングス	116,000	139	16,124,000	
日清紡ホールディングス	161,000	774	124,614,000	
倉敷紡績	239,000	137	32,743,000	

シキボウ	155,000	142	22,010,000	
日本毛織	93,000	538	50,034,000	
トーア紡コーポレーション	103,000	55	5,665,000	
ダイドーリミテッド	31,500	638	20,097,000	
帝国繊維	27,000	483	13,041,000	
帝人	860,000	291	250,260,000	
東レ	1,530,000	469	717,570,000	
三菱レイヨン	568,000	368	209,024,000	
サカイオーベックス	74,000	79	5,846,000	
住江織物	62,000	123	7,626,000	
日本フェルト	15,600	398	6,208,800	
イチカワ	21,000	150	3,150,000	
日本バイリーン	29,000	421	12,209,000	
日東製網	39,000	108	4,212,000	
芦森工業	58,000	117	6,786,000	
アツギ	235,000	112	26,320,000	
ダイニック	48,000	135	6,480,000	
セーレン	56,500	632	35,708,000	
東海染工	43,000	93	3,999,000	
小松精練	43,000	363	15,609,000	
ワコールホールディングス	136,000	998	135,728,000	
ホギメディカル	10,700	4,600	49,220,000	
サンエー・インターナショナル	12,600	805	10,143,000	
クラウドディア	3,400	1,190	4,046,000	
三陽商会	113,000	290	32,770,000	
オンワードホールディングス	151,000	537	81,087,000	
ルック	49,000	84	4,116,000	
ゴールドウイン	59,000	147	8,673,000	
東京スタイル	83,000	687	57,021,000	
デサント	69,000	455	31,395,000	
ヤマトインターナショナル	17,000	322	5,474,000	
特種東海ホールディングス	158,000	233	36,814,000	
王子製紙	1,007,000	371	373,597,000	
三菱製紙	331,000	105	34,755,000	
北越紀州製紙	167,500	442	74,035,000	
中越パルプ工業	98,000	149	14,602,000	
大王製紙	104,000	732	76,128,000	
日本製紙グループ本社	101,600	2,325	236,220,000	
レンゴー	181,740	544	98,866,560	
トーモク	81,000	202	16,362,000	
ザ・パック	16,500	1,314	21,681,000	
クラレ	334,500	1,088	363,936,000	
旭化成	1,327,000	442	586,534,000	
共和レザー	14,400	302	4,348,800	
コープケミカル	41,000	125	5,125,000	
昭和電工	1,498,000	164	245,672,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
住友化学	1,567,000	363	568,821,000	
日本化成	49,000	174	8,526,000	
住友精化	47,000	332	15,604,000	
日産化学工業	152,000	1,277	194,104,000	
ラサ工業	99,000	83	8,217,000	
クレハ	147,000	443	65,121,000	
テイカ	40,000	248	9,920,000	

片倉チッカリン	18,000	266	4,788,000	
日本曹達	148,000	306	45,288,000	
東ソー	569,000	236	134,284,000	
トクヤマ	382,000	528	201,696,000	
セントラル硝子	235,000	340	79,900,000	
東亜合成	271,000	352	95,392,000	
ダイソー	100,000	221	22,100,000	
関東電化工業	55,000	668	36,740,000	
電気化学工業	479,000	391	187,289,000	
信越化学工業	377,500	4,940	1,864,850,000	
日本カーバイド工業	59,000	107	6,313,000	
堺化学工業	86,000	393	33,798,000	
エア・ウォーター	178,000	1,110	197,580,000	
大陽日酸	323,000	984	317,832,000	
日本化学工業	94,000	192	18,048,000	
日本パーカライジング	54,000	1,160	62,640,000	
高压ガス工業	37,000	543	20,091,000	
チタン工業	32,000	169	5,408,000	
四国化成工業	36,000	546	19,656,000	
戸田工業	39,000	790	30,810,000	
ステラ ケミファ	11,800	4,850	57,230,000	
保土谷化学工業	58,000	244	14,152,000	
日本触媒	136,000	798	108,528,000	
大日精化工業	90,000	328	29,520,000	
カネカ	306,000	597	182,682,000	
三菱瓦斯化学	387,000	430	166,410,000	
三井化学	871,000	216	188,136,000	
J S R	223,500	1,771	395,818,500	
東京応化工業	40,700	1,695	68,986,500	
三菱ケミカルホールディングス	1,316,000	340	447,440,000	
日本合成化学工業	58,000	682	39,556,000	
ダイセル化学工業	292,000	518	151,256,000	
住友ベークライト	211,000	433	91,363,000	
積水化学工業	471,000	548	258,108,000	
日本ゼオン	212,000	394	83,528,000	
アイカ工業	66,000	916	60,456,000	
宇部興産	1,029,000	233	239,757,000	
積水樹脂	34,000	724	24,616,000	
タキロン	76,000	243	18,468,000	
旭有機材工業	80,000	203	16,240,000	
日立化成工業	106,200	1,817	192,965,400	
ニチバン	27,000	273	7,371,000	
リケンテクノス	46,000	214	9,844,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
大倉工業	59,000	254	14,986,000	
積水化成品工業	64,000	404	25,856,000	
群栄化学工業	68,000	211	14,348,000	
タイガースポリマー	12,300	305	3,751,500	
日本カーリット	21,000	409	8,589,000	
日本化薬	173,000	757	130,961,000	
日本精化	21,100	741	15,635,100	
A D E K A	98,800	826	81,608,800	
日油	202,000	373	75,346,000	
ハリマ化成	22,000	500	11,000,000	

花王	629,200	2,170	1,365,364,000	
第一工業製薬	43,000	229	9,847,000	
三洋化成工業	70,000	488	34,160,000	
大日本塗料	147,000	93	13,671,000	
日本ペイント	214,000	568	121,552,000	
関西ペイント	278,000	762	211,836,000	
中国塗料	66,000	642	42,372,000	
日本特殊塗料	19,100	382	7,296,200	
藤倉化成	29,900	418	12,498,200	
太陽インキ製造	18,200	2,305	41,951,000	
D I C	750,000	143	107,250,000	
サカタインクス	52,000	343	17,836,000	
東洋インキ製造	222,000	337	74,814,000	
富士フイルムホールディングス	487,100	2,505	1,220,185,500	
資生堂	417,900	1,805	754,309,500	
ライオン	283,000	463	131,029,000	
高砂香料工業	75,000	446	33,450,000	
マンダム	22,800	2,480	56,544,000	
ミルボン	11,000	2,100	23,100,000	
ファンケル	47,500	1,765	83,837,500	
コーセー	35,300	1,874	66,152,200	
ドクターシーラボ	163	192,400	31,361,200	
エステー	15,000	1,025	15,375,000	
コニシ	19,900	880	17,512,000	
長谷川香料	31,600	1,181	37,319,600	
小林製薬	34,100	3,980	135,718,000	
荒川化学工業	19,600	1,111	21,775,600	
メック	18,700	587	10,976,900	
日本高純度化学	66	298,000	19,668,000	
荏原ユーザライト	3,200	1,800	5,760,000	
アース製薬	17,600	2,930	51,568,000	
イハラケミカル工業	47,000	260	12,220,000	
北興化学工業	26,000	275	7,150,000	
大成ラミック	6,700	2,155	14,438,500	
クミアイ化学工業	53,000	255	13,515,000	
日本農薬	52,000	505	26,260,000	
アキレス	190,000	134	25,460,000	
有沢製作所	33,100	481	15,921,100	
日東電工	189,800	3,170	601,666,000	
レック	7,000	1,850	12,950,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
アロン化成	30,000	350	10,500,000	
きもと	21,100	1,046	22,070,600	
藤森工業	16,400	1,192	19,548,800	
前澤化成工業	22,200	955	21,201,000	
J S P	16,700	976	16,299,200	
エフピコ	11,000	4,170	45,870,000	
天馬	17,500	998	17,465,000	
信越ポリマー	42,100	532	22,397,200	
東リ	88,000	175	15,400,000	
ニフコ	50,900	1,672	85,104,800	
日本バルカー工業	96,000	167	16,032,000	
ユニ・チャーム	45,200	8,970	405,444,000	
協和発酵キリン	294,000	924	271,656,000	

武田薬品工業	862,300	3,730	3,216,379,000	代用有価証券で 200,000株 担保差入
アステラス製薬	485,100	3,320	1,610,532,000	
大日本住友製薬	173,800	920	159,896,000	
塩野義製薬	332,300	1,941	644,994,300	
田辺三菱製薬	204,000	1,155	235,620,000	
わかもと製薬	25,000	336	8,400,000	
あすか製薬	27,000	635	17,145,000	
日本新薬	56,000	1,054	59,024,000	
中外製薬	244,500	1,683	411,493,500	
科研製薬	104,000	765	79,560,000	
エーザイ	280,700	3,270	917,889,000	
ロート製薬	103,000	1,095	112,785,000	
小野薬品工業	114,400	3,980	455,312,000	
久光製薬	69,300	3,010	208,593,000	
有機合成薬品工業	20,000	230	4,600,000	
持田製薬	92,000	844	77,648,000	
大正製薬	197,000	1,598	314,806,000	
参天製薬	69,600	2,945	204,972,000	
エスエス製薬	51,000	506	25,806,000	
扶桑薬品工業	83,000	281	23,323,000	
日本ケミファ	36,000	243	8,748,000	
ツムラ	67,000	2,915	195,305,000	
キッセイ薬品工業	46,000	1,885	86,710,000	
生化学工業	42,700	979	41,803,300	
栄研化学	17,700	816	14,443,200	
日水製薬	8,500	642	5,457,000	
鳥居薬品	14,700	1,787	26,268,900	
東和薬品	11,300	4,240	47,912,000	
沢井製薬	14,900	5,050	75,245,000	
ゼリア新薬工業	35,000	857	29,995,000	
第一三共	722,600	1,798	1,299,234,800	
キョーリン	60,000	1,393	83,580,000	
新日本石油	1,386,000	367	508,662,000	
昭和シェル石油	219,500	726	159,357,000	
コスモ石油	617,000	182	112,294,000	
ニチレキ	36,000	328	11,808,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
東燃ゼネラル石油	329,000	748	246,092,000	
ユシロ化学工業	13,200	1,205	15,906,000	
ビービー・カストロール	13,600	341	4,637,600	
新日鉱ホールディングス	878,500	339	297,811,500	
AOCホールディングス	59,200	487	28,830,400	
出光興産	26,200	4,990	130,738,000	
横浜ゴム	249,000	347	86,403,000	
東洋ゴム工業	223,000	151	33,673,000	
ブリヂストン	710,300	1,482	1,052,664,600	
住友ゴム工業	172,400	746	128,610,400	
藤倉ゴム工業	15,600	310	4,836,000	
オカモト	94,000	364	34,216,000	
フコク	10,300	577	5,943,100	
ニッタ	22,100	1,277	28,221,700	
東海ゴム工業	38,000	925	35,150,000	
三ツ星ベルト	64,000	364	23,296,000	

バンドー化学	88,000	257	22,616,000	
日東紡績	200,000	142	28,400,000	
旭硝子	1,123,000	813	912,999,000	
日本板硝子	682,000	246	167,772,000	
石塚硝子	33,000	181	5,973,000	
日本山村硝子	98,000	310	30,380,000	
日本電気硝子	399,000	1,093	436,107,000	
オハラ	9,400	1,430	13,442,000	
住友大阪セメント	406,000	138	56,028,000	
太平洋セメント	899,000	99	89,001,000	
デイ・シイ	26,100	222	5,794,200	
日本ヒューム	25,000	250	6,250,000	
日本コンクリート工業	51,000	121	6,171,000	
東海カーボン	229,000	430	98,470,000	
日本カーボン	121,000	254	30,734,000	
東洋炭素	10,600	4,790	50,774,000	
ノリタケカンパニーリミテド	128,000	237	30,336,000	
TOTO	352,000	551	193,952,000	
日本碍子	270,000	1,990	537,300,000	
日本特殊陶業	201,000	977	196,377,000	
MARUWA	6,400	2,130	13,632,000	
品川リフラクトリーズ	63,000	194	12,222,000	
黒崎播磨	54,000	144	7,776,000	
東京窯業	31,000	203	6,293,000	
ニッカトー	9,200	358	3,293,600	
フジインコーポレーテッド	22,500	1,359	30,577,500	
ニチアス	132,000	340	44,880,000	
ニチハ	36,600	518	18,958,800	
新日本製鐵	6,442,000	350	2,254,700,000	
住友金属工業	4,199,000	228	957,372,000	
神戸製鋼所	3,175,000	163	517,525,000	
日新製鋼	869,000	146	126,874,000	
中山製鋼所	118,000	118	13,924,000	
合同製鐵	126,000	212	26,712,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ジェイ エフ イー ホールディングス	492,100	3,350	1,648,535,000	
東京製鐵	112,900	1,020	115,158,000	
共英製鋼	23,100	1,716	39,639,600	
大和工業	57,600	2,895	166,752,000	
東京鐵鋼	49,000	248	12,152,000	
大阪製鐵	15,600	1,562	24,367,200	
淀川製鋼所	175,000	354	61,950,000	
東洋鋼鈑	52,000	412	21,424,000	
住友鋼管	15,000	449	6,735,000	
丸一鋼管	68,400	1,772	121,204,800	
モリ工業	43,000	205	8,815,000	
大同特殊鋼	380,000	314	119,320,000	
日本高周波鋼業	100,000	84	8,400,000	
日本金属工業	170,000	135	22,950,000	
日本冶金工業	136,500	355	48,457,500	
山陽特殊製鋼	123,000	363	44,649,000	
愛知製鋼	131,000	405	53,055,000	
日立金属	133,000	862	114,646,000	
日本金属	66,000	138	9,108,000	

大平洋金属	171,000	576	98,496,000	
日本電工	105,000	536	56,280,000	
日本鑄鉄管	27,000	114	3,078,000	
三菱製鋼	150,000	146	21,900,000	
日亜鋼業	35,000	247	8,645,000	
日本精線	20,000	227	4,540,000	
シンニッタン	21,500	185	3,977,500	
新家工業	88,000	124	10,912,000	
日本軽金属	560,000	81	45,360,000	
大紀アルミニウム工業所	40,000	200	8,000,000	
三井金属鉱業	667,000	225	150,075,000	
東邦亜鉛	119,000	412	49,028,000	
三菱マテリアル	1,304,000	217	282,968,000	
住友金属鉱山	593,000	1,386	821,898,000	
DOWAホールディングス	265,000	478	126,670,000	
古河機械金属	415,000	100	41,500,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	24,100	2,475	59,647,500	
東邦チタニウム	40,100	1,247	50,004,700	
住友軽金属工業	350,000	72	25,200,000	
古河スカイ	102,000	135	13,770,000	
古河電気工業	720,000	362	260,640,000	
住友電気工業	751,400	1,053	791,224,200	
フジクラ	342,000	424	145,008,000	
三菱電線工業	159,000	70	11,130,000	
東京特殊電線	33,000	85	2,805,000	
タツタ電線	55,000	217	11,935,000	
日立電線	199,000	238	47,362,000	
沖電線	26,000	112	2,912,000	
カナレ電気	2,700	987	2,664,900	
平河ヒューテック	5,100	682	3,478,200	
リョービ	137,000	218	29,866,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
アサヒホールディングス	34,500	1,461	50,404,500	
稲葉製作所	12,400	909	11,271,600	
トーカロ	12,900	1,369	17,660,100	
アルファC o	8,300	578	4,797,400	
SUMCO	131,400	1,468	192,895,200	
川田テクノロジーズ	6,700	1,609	10,780,300	
東洋製罐	173,500	1,370	237,695,000	
ホッカフホールディングス	59,000	210	12,390,000	
コロナ	11,600	1,195	13,862,000	
横河ブリッジホールディングス	49,000	687	33,663,000	
駒井鉄工	46,000	156	7,176,000	
ハルテック	44,000	92	4,048,000	
高田機工	33,000	136	4,488,000	
三和ホールディングス	245,000	231	56,595,000	
文化シャッター	80,000	295	23,600,000	
東洋シャッター	12,700	596	7,569,200	
住生活グループ	296,300	1,517	449,487,100	
日本ファイルコン	17,900	485	8,681,500	
ノーリツ	41,100	1,075	44,182,500	
長府製作所	26,900	1,895	50,975,500	
リンナイ	39,500	4,470	176,565,000	
ダイニチ工業	13,600	544	7,398,400	

日東精工	33,000	216	7,128,000	
三洋工業	70,000	121	8,470,000	
岡部	63,100	309	19,497,900	
中国工業	89,000	80	7,120,000	
東ブレ	47,300	810	38,313,000	
高周波熱錬	36,000	553	19,908,000	
東京製綱	164,000	231	37,884,000	
パイオラックス	10,500	1,461	15,340,500	
日本発條	160,000	828	132,480,000	
中央発條	32,000	253	8,096,000	
三益半導体工業	18,100	1,016	18,389,600	
アタカ大機	18,000	206	3,708,000	
日本製鋼所	352,000	1,118	393,536,000	
日立ツール	14,500	843	12,223,500	
三浦工業	33,600	2,335	78,456,000	
タクマ	92,000	222	20,424,000	
ツガミ	72,000	173	12,456,000	
オークマ	160,000	427	68,320,000	
東芝機械	123,000	336	41,328,000	
アマダ	375,000	563	211,125,000	
アイダエンジニアリング	59,200	262	15,510,400	
牧野フライス製作所	115,000	333	38,295,000	
オーエスジー	101,300	899	91,068,700	
ダイジェット工業	32,000	131	4,192,000	
旭ダイヤモンド工業	60,000	620	37,200,000	
森精機製作所	91,300	804	73,405,200	
ディスコ	22,300	5,370	119,751,000	
日東工器	14,500	2,010	29,145,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
豊和工業	136,000	48	6,528,000	
大阪機工	82,000	62	5,084,000	
東洋機械金属	19,600	127	2,489,200	
オーエム製作所	21,000	241	5,061,000	
津田駒工業	63,000	107	6,741,000	
島精機製作所	29,500	1,749	51,595,500	
日本スピンドル製造	36,000	117	4,212,000	
日阪製作所	27,000	805	21,735,000	
やまびこ	9,600	850	8,160,000	
ペガサスミシン製造	24,900	151	3,759,900	
ナブテスコ	93,000	975	90,675,000	
三井海洋開発	16,600	1,697	28,170,200	
レオン自動機	26,000	243	6,318,000	
S M C	73,300	10,280	753,524,000	
新川	19,000	1,324	25,156,000	
ホソカワミクロン	39,000	313	12,207,000	
ユニオンツール	15,300	2,485	38,020,500	
オイレス工業	27,200	1,329	36,148,800	
サトー	27,000	980	26,460,000	
日本エアーテック	8,000	454	3,632,000	
日精樹脂工業	19,500	224	4,368,000	
ワイエイシイ	10,600	597	6,328,200	
小松製作所	1,018,000	1,805	1,837,490,000	
住友重機械工業	485,000	423	205,155,000	
日立建機	94,000	2,215	208,210,000	

日工	34,000	233	7,922,000	
巴工業	9,300	1,153	10,722,900	
井関農機	234,000	263	61,542,000	
T O W A	25,500	747	19,048,500	
丸山製作所	55,000	141	7,755,000	
北川鉄工所	109,000	84	9,156,000	
クボタ	936,000	829	775,944,000	
荏原実業	5,700	1,253	7,142,100	
三菱化工機	71,000	227	16,117,000	
月島機械	41,000	523	21,443,000	
帝国電機製作所	8,500	1,630	13,855,000	
東京機械製作所	76,000	99	7,524,000	
新東工業	45,900	632	29,008,800	
澁谷工業	14,100	782	11,026,200	
アイチ コーポレーション	40,500	342	13,851,000	
小森コーポレーション	64,600	925	59,755,000	
鶴見製作所	19,000	610	11,590,000	
住友精密工業	36,000	251	9,036,000	
酒井重工業	43,000	120	5,160,000	
荏原製作所	462,000	361	166,782,000	
石井鐵工所	39,000	147	5,733,000	
西島製作所	22,000	1,915	42,130,000	
ダイキン工業	256,100	3,440	880,984,000	
オルガノ	43,000	583	25,069,000	
トーヨーカネツ	124,000	180	22,320,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
栗田工業	125,700	2,915	366,415,500	
椿本チエイン	126,000	356	44,856,000	
大同工業	47,000	141	6,627,000	
T C M	62,000	220	13,640,000	
日本コンベヤ	75,000	67	5,025,000	
木村化工機	21,600	803	17,344,800	
アネスト岩田	45,000	279	12,555,000	
ダイフク	91,000	548	49,868,000	
加藤製作所	51,000	139	7,089,000	
油研工業	43,000	121	5,203,000	
タダノ	104,000	396	41,184,000	
フジテック	61,000	468	28,548,000	
シーケーディ	60,800	649	39,459,200	
キトー	73	84,500	6,168,500	
平和	44,300	911	40,357,300	
理想科学工業	20,700	768	15,897,600	
S A N K Y O	63,900	4,780	305,442,000	
日本金銭機械	23,200	835	19,372,000	
マースエンジニアリング	10,200	2,190	22,338,000	
福島工業	6,400	735	4,704,000	
キャノンファインテック	19,800	1,177	23,304,600	
オーイズミ	11,600	208	2,412,800	
ダイコク電機	7,900	1,606	12,687,400	
アマノ	66,700	817	54,493,900	
サンデン	133,000	226	30,058,000	
マックス	41,000	864	35,424,000	
グローリー	66,100	1,987	131,340,700	
大和冷機工業	30,000	434	13,020,000	

セガサミーホールディングス	247,400	1,117	276,345,800	
日本ピストンリング	86,000	85	7,310,000	
リケン	93,000	284	26,412,000	
帝国ピストンリング	28,600	337	9,638,200	
ホシザキ電機	47,200	1,131	53,383,200	
大豊工業	16,500	570	9,405,000	
日本精工	441,000	612	269,892,000	
NTN	504,000	384	193,536,000	
ジェイテクト	210,600	1,030	216,918,000	
不二越	238,000	195	46,410,000	
日本トムソン	75,000	480	36,000,000	
THK	146,200	1,627	237,867,400	
ユーシン精機	10,700	1,236	13,225,200	
前澤給装工業	12,500	1,379	17,237,500	
イーグル工業	25,000	432	10,800,000	
前澤工業	22,000	156	3,432,000	
日本ピラー工業	26,000	359	9,334,000	
キッツ	105,000	428	44,940,000	
日立工機	63,100	1,041	65,687,100	
マキタ	142,700	3,140	448,078,000	
日立造船	985,500	126	124,173,000	
三菱重工業	3,684,000	304	1,119,936,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
IHI	1,602,000	139	222,678,000	
イビデン	153,800	3,090	475,242,000	
コニカミノルタホールディングス	503,000	894	449,682,000	
ブラザー工業	303,100	994	301,281,400	
ミネベア	320,000	433	138,560,000	
日立製作所	3,982,000	233	927,806,000	
東芝	4,936,000	481	2,374,216,000	
三菱電機	2,032,000	654	1,328,928,000	
富士電機ホールディングス	598,000	141	84,318,000	
東洋電機製造	47,000	687	32,289,000	
安川電機	257,000	718	184,526,000	
シンフォニアテクノロジー	130,000	182	23,660,000	
明電舎	215,000	399	85,785,000	
オリジン電気	32,000	236	7,552,000	
デンヨー	22,200	698	15,495,600	
東芝テック	151,000	332	50,132,000	
芝浦メカトロニクス	34,000	258	8,772,000	
マブチモーター	31,900	4,400	140,360,000	
日本電産	105,600	7,970	841,632,000	
高岳製作所	93,000	253	23,529,000	
ダイヘン	118,000	279	32,922,000	
JVC・ケンウッド・ホールディングス	906,600	40	36,264,000	
日新電機	39,000	430	16,770,000	
大崎電気工業	34,000	774	26,316,000	
オムロン	261,100	1,565	408,621,500	
日東工業	35,200	928	32,665,600	
IDEC	30,800	568	17,494,400	
エルピーダメモリ	229,000	1,303	298,387,000	
ジーエス・ユアサコーポレーション	422,000	646	272,612,000	
サクサホールディングス	60,000	163	9,780,000	
メルコホールディングス	11,400	1,550	17,670,000	

テクノメディカ	17	273,600	4,651,200	
日本電気	2,804,000	212	594,448,000	
富士通	2,261,000	551	1,245,811,000	
沖電気工業	747,000	75	56,025,000	
岩崎通信機	98,000	74	7,252,000	
電気興業	62,000	374	23,188,000	
サンケン電気	128,000	249	31,872,000	
ナカヨ通信機	24,000	157	3,768,000	
アイホン	15,900	1,600	25,440,000	
NECエレクトロニクス	53,900	601	32,393,900	
セイコーエプソン	174,600	1,343	234,487,800	
ワコム	431	190,500	82,105,500	
アルバック	37,500	2,195	82,312,500	
ナナオ	18,200	2,110	38,402,000	
日本信号	54,600	770	42,042,000	
京三製作所	50,000	396	19,800,000	
能美防災	27,000	532	14,364,000	
ホーチキ	23,000	515	11,845,000	
マスプロ電工	16,500	777	12,820,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日本無線	81,000	172	13,932,000	
パナソニック	2,143,100	1,226	2,627,440,600	
シャープ	1,051,000	1,077	1,131,927,000	
アンリツ	113,000	315	35,595,000	
富士通ゼネラル	60,000	281	16,860,000	
日立国際電気	54,000	741	40,014,000	
ソニー	1,170,100	2,490	2,913,549,000	
TDK	113,200	4,980	563,736,000	
帝国通信工業	52,000	196	10,192,000	
三洋電機	2,310,000	176	406,560,000	
ミツミ電機	70,100	1,435	100,593,500	
タムラ製作所	60,000	255	15,300,000	
アルプス電気	185,100	505	93,475,500	
池上通信機	71,000	69	4,899,000	
パイオニア	183,500	277	50,829,500	
日本電波工業	15,100	1,479	22,332,900	
日本トリム	3,350	1,861	6,234,350	
ローランド ディー・ジー	9,200	991	9,117,200	
フォスター電機	19,300	2,270	43,811,000	
クラリオン	139,000	82	11,398,000	
SMK	69,000	496	34,224,000	
ヨコオ	18,300	503	9,204,900	
東光	99,000	109	10,791,000	
ティアック	147,000	33	4,851,000	
ホンデン	58,200	933	54,300,600	
ヒロセ電機	37,900	9,350	354,365,000	
日本航空電子工業	47,000	601	28,247,000	
TOA	28,000	540	15,120,000	
ユニデン	70,000	168	11,760,000	
アルパイン	47,100	912	42,955,200	
スミダコーポレーション	16,000	574	9,184,000	
アイコム	12,000	1,975	23,700,000	
船井電機	18,700	4,820	90,134,000	
横河電機	234,700	725	170,157,500	

新電元工業	75,000	199	14,925,000	
山武	60,200	1,944	117,028,800	
日本光電工業	40,100	1,533	61,473,300	
チノー	43,000	219	9,417,000	
共和電業	23,000	275	6,325,000	
日本電子材料	8,600	550	4,730,000	
堀場製作所	37,300	2,190	81,687,000	
アドバンテスト	159,800	2,065	329,987,000	
小野測器	29,000	415	12,035,000	
エスベック	23,000	437	10,051,000	
サンクス	20,500	300	6,150,000	
キーエンス	44,300	18,710	828,853,000	
日置電機	11,300	1,752	19,797,600	
シスメックス	41,100	5,050	207,555,000	
メガチップス	18,000	1,276	22,968,000	
O B A R A	17,200	722	12,418,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日本電産コパル電子	24,200	576	13,939,200	
ミヤチテクノス	12,100	572	6,921,200	
東京電波	6,900	522	3,601,800	
澤藤電機	13,000	156	2,028,000	
コーセル	31,200	1,056	32,947,200	
日立メディコ	15,000	746	11,190,000	
新日本無線	14,000	177	2,478,000	
オブテックス	16,100	846	13,620,600	
千代田インテグレ	12,300	892	10,971,600	
東光電気	15,000	432	6,480,000	
スタンレー電気	150,700	1,807	272,314,900	
岩崎電気	80,000	145	11,600,000	
ウシオ電機	132,100	1,567	207,000,700	
岡谷電機産業	12,700	241	3,060,700	
ヘリオス テクノ ホールディング	18,600	282	5,245,200	
日本セラミック	15,300	1,170	17,901,000	
新神戸電機	19,000	915	17,385,000	
日本デジタル研究所	20,300	1,003	20,360,900	
古河電池	14,000	709	9,926,000	
双信電機	11,400	308	3,511,200	
山一電機	19,400	152	2,948,800	
図研	16,500	636	10,494,000	
日本電子	87,000	340	29,580,000	
カシオ計算機	243,800	698	170,172,400	
ファナック	226,700	7,860	1,781,862,000	
日本シイエムケイ	45,900	524	24,051,600	
エンプラス	12,200	1,537	18,751,400	
ローム	109,100	6,000	654,600,000	
浜松ホトニクス	85,400	2,145	183,183,000	
三井ハイテック	30,900	825	25,492,500	
新光電気工業	59,000	1,337	78,883,000	
京セラ	181,100	7,480	1,354,628,000	
日本インター	25,300	214	5,414,200	
太陽誘電	88,000	1,007	88,616,000	
村田製作所	246,000	4,450	1,094,700,000	
ユーシン	25,700	453	11,642,100	
双葉電子工業	40,300	1,567	63,150,100	

北陸電気工業	88,000	147	12,936,000	
パナソニック電工	383,000	1,057	404,831,000	
ニチコン	73,800	829	61,180,200	
日本ケミコン	111,000	277	30,747,000	
K O A	29,500	685	20,207,500	
市光工業	56,000	143	8,008,000	
小糸製作所	105,000	1,455	152,775,000	
ミツバ	40,000	391	15,640,000	
アロカ	12,700	658	8,356,600	
スター精密	45,200	662	29,922,400	
大日本スクリーン製造	240,000	378	90,720,000	
キャノン電子	21,100	1,955	41,250,500	
キャノン	1,359,400	3,710	5,043,374,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
リコー	651,000	1,195	777,945,000	
日本電産サンキョー	56,000	754	42,224,000	
MUTOHホールディングス	37,000	137	5,069,000	
東京エレクトロン	184,100	5,300	975,730,000	
トヨタ紡織	68,300	1,870	127,721,000	
鬼怒川ゴム工業	49,000	182	8,918,000	
ユニプレス	32,500	1,503	48,847,500	
豊田自動織機	189,800	2,555	484,939,000	
モリタホールディングス	34,000	391	13,294,000	
三櫻工業	27,100	522	14,146,200	
デンソー	514,900	2,585	1,331,016,500	
東海理化電機製作所	54,900	1,876	102,992,400	
三井造船	907,000	213	193,191,000	
佐世保重工業	153,000	188	28,764,000	
川崎重工業	1,702,000	221	376,142,000	
日本車輛製造	85,000	502	42,670,000	
日本輸送機	27,000	182	4,914,000	
近畿車輛	35,000	623	21,805,000	
日産自動車	2,632,900	701	1,845,662,900	
いすゞ自動車	1,482,000	160	237,120,000	
トヨタ自動車	3,012,300	3,650	10,994,895,000	代用有価証券で 500,000株 担保差入
日野自動車	293,000	299	87,607,000	
三菱自動車工業	4,838,000	131	633,778,000	
エフテック	8,200	918	7,527,600	
武蔵精密工業	22,700	1,884	42,766,800	
トヨタ車体	42,600	1,693	72,121,800	
日産車体	92,000	787	72,404,000	
関東自動車工業	35,700	765	27,310,500	
新明和工業	96,000	267	25,632,000	
極東開発工業	40,400	308	12,443,200	
日信工業	38,200	1,433	54,740,600	
トビー工業	193,000	158	30,494,000	
ティラド	71,000	197	13,987,000	
曙ブレーキ工業	89,200	452	40,318,400	
タチエス	30,700	832	25,542,400	
N O K	113,400	1,095	124,173,000	
フタバ産業	71,400	650	46,410,000	
カヤバ工業	146,000	274	40,004,000	
シロキ工業	46,000	161	7,406,000	

大同メタル工業	33,000	232	7,656,000	
プレス工業	108,000	162	17,496,000	
カルソニックカンセイ	159,000	221	35,139,000	
太平洋工業	48,000	459	22,032,000	
ケーヒン	43,100	1,288	55,512,800	
河西工業	29,000	228	6,612,000	
アイシン精機	193,100	2,270	438,337,000	
富士機工	28,000	93	2,604,000	
マツダ	1,426,000	195	278,070,000	
ダイハツ工業	218,000	867	189,006,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
愛知機械工業	53,000	320	16,960,000	
今仙電機製作所	16,900	1,097	18,539,300	
本田技研工業	1,870,100	2,930	5,479,393,000	
スズキ	434,600	2,215	962,639,000	
富士重工業	741,000	377	279,357,000	
ヤマハ発動機	271,200	1,114	302,116,800	
ショーワ	49,900	487	24,301,300	
T B K	24,000	134	3,216,000	
エクセディ	28,300	1,822	51,562,600	
豊田合成	66,300	2,600	172,380,000	
愛三工業	24,300	828	20,120,400	
ヨロズ	14,100	1,139	16,059,900	
エフ・シー・シー	30,700	1,627	49,948,900	
シマノ	90,900	3,750	340,875,000	
タカタ	35,800	1,916	68,592,800	
テイ・エス テック	44,600	1,687	75,240,200	
日本電産トーソク	7,100	879	6,240,900	
テルモ	168,900	5,130	866,457,000	
クリエートメディック	7,300	872	6,365,600	
日機装	69,000	455	31,395,000	
島津製作所	259,000	617	159,803,000	
J M S	36,000	374	13,464,000	
クボテック	59	24,790	1,462,610	
モリテックス	6,000	223	1,338,000	
東京計器	83,000	114	9,462,000	
愛知時計電機	44,000	251	11,044,000	
東京精密	44,200	996	44,023,200	
ニコン	408,600	1,690	690,534,000	
トプコン	47,700	488	23,277,600	
オリンパス	256,800	2,890	742,152,000	
理研計器	19,300	612	11,811,600	
タムロン	20,800	883	18,366,400	
HOYA	506,700	2,375	1,203,412,500	
ノーリツ鋼機	20,400	598	12,199,200	
エー・アンド・デイ	18,500	314	5,809,000	
日本電産コバル	23,100	1,304	30,122,400	
シチズンホールディングス	276,900	509	140,942,100	
リズム時計工業	114,000	115	13,110,000	
セイコーホールディングス	85,000	173	14,705,000	
ニプロ	46,600	1,897	88,400,200	
S R I スポーツ	134	84,900	11,376,600	
バンダイナムコホールディングス	254,800	891	227,026,800	
共立印刷	25,600	116	2,969,600	

フランスベッドホールディングス	161,000	141	22,701,000	
パイロットコーポレーション	204	104,200	21,256,800	
トッパン・フォームズ	42,400	963	40,831,200	
フジシールインターナショナル	21,900	1,940	42,486,000	
タカラトミー	70,900	780	55,302,000	
廣済堂	20,900	193	4,033,700	
タカノ	9,600	443	4,252,800	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
プロネクサス	26,800	541	14,498,800	
ウッドワン	65,000	201	13,065,000	
大建工業	119,000	207	24,633,000	
凸版印刷	662,000	739	489,218,000	
大日本印刷	663,000	1,153	764,439,000	
図書印刷	42,000	151	6,342,000	
共同印刷	75,000	251	18,825,000	
日本写真印刷	36,100	4,850	175,085,000	
光村印刷	24,000	285	6,840,000	
宝印刷	12,100	691	8,361,100	
コンビ	14,000	643	9,002,000	
アシックス	204,000	837	170,748,000	
ツツミ	10,600	1,872	19,843,200	
ローランド	17,500	755	13,212,500	
小松ウオール工業	8,500	1,050	8,925,000	
ヤマハ	158,000	985	155,630,000	
河合楽器製作所	93,000	108	10,044,000	
クリナップ	32,300	683	22,060,900	
ビジョン	13,300	3,710	49,343,000	
パラマウントベッド	23,400	2,020	47,268,000	
キングジム	19,800	690	13,662,000	
リンテック	50,200	1,782	89,456,400	
イトーキ	52,700	180	9,486,000	
任天堂	123,800	21,460	2,656,748,000	
三菱鉛筆	20,400	1,241	25,316,400	
タカラスタANDARD	117,000	512	59,904,000	
コクヨ	121,800	747	90,984,600	
ナカバヤシ	49,000	173	8,477,000	
グローブライド	122,000	105	12,810,000	
サンウエーブ工業	53,000	236	12,508,000	
岡村製作所	92,000	406	37,352,000	
美津濃	118,000	446	52,628,000	
アデランスホールディングス	27,500	1,082	29,755,000	
東京電力	1,378,900	2,335	3,219,731,500	代用有価証券で 300,000株 担保差入
中部電力	737,300	2,255	1,662,611,500	
関西電力	903,600	2,125	1,920,150,000	
中国電力	324,200	1,786	579,021,200	
北陸電力	224,600	2,055	461,553,000	
東北電力	549,200	1,853	1,017,667,600	
四国電力	242,700	2,540	616,458,000	
九州電力	483,300	1,949	941,951,700	
北海道電力	203,800	1,676	341,568,800	
沖縄電力	15,300	5,000	76,500,000	
電源開発	145,500	2,710	394,305,000	
東京瓦斯	2,770,000	366	1,013,820,000	

大阪瓦斯	2,357,000	318	749,526,000	
東邦瓦斯	611,000	510	311,610,000	
北海道瓦斯	42,000	244	10,248,000	
西部瓦斯	265,000	257	68,105,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
静岡瓦斯	66,500	578	38,437,000	
東武鉄道	938,000	488	457,744,000	
相鉄ホールディングス	342,000	390	133,380,000	
東京急行電鉄	1,196,000	382	456,872,000	
京浜急行電鉄	602,000	706	425,012,000	
小田急電鉄	698,000	738	515,124,000	
京王電鉄	608,000	581	353,248,000	
京成電鉄	326,000	499	162,674,000	
富士急行	64,000	478	30,592,000	
新京成電鉄	30,000	365	10,950,000	
東日本旅客鉄道	407,700	6,010	2,450,277,000	
西日本旅客鉄道	1,893	321,000	607,653,000	
東海旅客鉄道	1,878	640,000	1,201,920,000	
アートコーポレーション	5,600	1,390	7,784,000	
西日本鉄道	306,000	359	109,854,000	
ハマキョウレックス	6,700	2,150	14,405,000	
サカイ引越センター	4,300	2,030	8,729,000	
近畿日本鉄道	1,993,000	330	657,690,000	
阪急阪神ホールディングス	1,481,000	407	602,767,000	
南海電気鉄道	460,000	373	171,580,000	
京阪電気鉄道	494,000	381	188,214,000	
名糖運輸	8,800	786	6,916,800	
名古屋鉄道	770,000	277	213,290,000	
日本通運	928,000	400	371,200,000	
ヤマトホールディングス	443,000	1,269	562,167,000	
山九	261,000	449	117,189,000	
丸運	12,800	218	2,790,400	
丸全昭和運輸	72,000	299	21,528,000	
センコー	73,000	339	24,747,000	
トナミホールディングス	54,000	183	9,882,000	
日本梱包運輸倉庫	65,000	966	62,790,000	
日本石油輸送	27,000	193	5,211,000	
福山通運	162,000	450	72,900,000	
セイノーホールディングス	166,000	617	102,422,000	
神奈川中央交通	28,000	534	14,952,000	
日立物流	40,700	1,210	49,247,000	
日本郵船	1,576,000	260	409,760,000	
商船三井	1,054,000	477	502,758,000	
川崎汽船	558,000	243	135,594,000	
新和海運	83,000	234	19,422,000	
乾汽船	25,700	641	16,473,700	
明治海運	21,000	404	8,484,000	
飯野海運	105,100	394	41,409,400	
共栄タンカー	17,000	195	3,315,000	
第一中央汽船	153,000	190	29,070,000	
全日本空輸	3,125,000	248	775,000,000	
パスコ	30,000	166	4,980,000	
国際航業ホールディングス	34,000	257	8,738,000	
日新	89,000	211	18,779,000	

三菱倉庫	163,000	982	160,066,000	
------	---------	-----	-------------	--

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
三井倉庫	91,000	320	29,120,000	
住友倉庫	157,000	402	63,114,000	
澁澤倉庫	61,000	267	16,287,000	
東陽倉庫	37,000	182	6,734,000	
日本トランスシティ	49,000	264	12,936,000	
ケイヒン	43,000	99	4,257,000	
安田倉庫	18,100	593	10,733,300	
東洋埠頭	68,000	175	11,900,000	
宇徳	14,900	223	3,322,700	
上組	260,000	686	178,360,000	
サンリツ	6,100	520	3,172,000	
キムラユニティー	5,300	658	3,487,400	
キューソー流通システム	6,500	937	6,090,500	
郵船航空サービス	18,400	1,190	21,896,000	
近鉄エクスプレス	18,300	2,365	43,279,500	
東海運	14,800	213	3,152,400	
バンテック	108	129,600	13,996,800	
システムプロ	165	42,100	6,946,500	
新日鉄ソリューションズ	19,700	1,471	28,978,700	
コア	9,600	638	6,124,800	
ITホールディングス	74,200	1,028	76,277,600	
コーエーテックモホールディングス	46,700	691	32,269,700	
ドワンゴ	130	168,700	21,931,000	
ベリサーブ	16	219,900	3,518,400	
マクロミル	131	142,700	18,693,700	
ティーガイア	187	163,600	30,593,200	
GMOペイメントゲートウェイ	55	122,700	6,748,500	
ザッパラス	73	149,400	10,906,200	
インターネットイニシアティブ	135	178,000	24,030,000	
ソネットエンタテインメント	112	200,500	22,456,000	
SRAホールディングス	11,800	809	9,546,200	
JBISホールディングス	25,900	294	7,614,600	
朝日ネット	17,000	278	4,726,000	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	4,900	2,330	11,417,000	
フェイス	784	8,780	6,883,520	
野村総合研究所	133,900	1,835	245,706,500	
サイバネットシステム	204	40,250	8,211,000	
インテージ	7,200	1,658	11,937,600	
シンプレクス・テクノロジー	317	35,700	11,316,900	
クレスコ	7,200	423	3,045,600	
フジ・メディア・ホールディングス	2,410	124,600	300,286,000	
オービック	7,610	15,160	115,367,600	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	5,900	713	4,206,700	
ヤフー	12,692	28,800	365,529,600	
トレンドマイクロ	93,600	3,380	316,368,000	
日本オラクル	38,300	3,850	147,455,000	
アルファシステムズ	6,600	1,785	11,781,000	
フューチャーアーキテクト	258	38,450	9,920,100	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
シーエーシー	15,100	646	9,754,600	
ソフトバンク・テクノロジー	5,400	615	3,321,000	
トーセ	6,800	563	3,828,400	
オービックビジネスコンサルタント	6,000	3,860	23,160,000	
日立ビジネスソリューション	8,200	668	5,477,600	
伊藤忠テクノソリューションズ	33,100	2,485	82,253,500	
アイティフォー	27,600	323	8,914,800	
東計電算	4,600	1,225	5,635,000	
エクスネット	22	130,500	2,871,000	
大塚商会	19,700	4,240	83,528,000	
サイボウズ	326	39,050	12,730,300	
アグレックス	5,400	753	4,066,200	
電通国際情報サービス	15,300	544	8,323,200	
ウェザーニューズ	6,600	1,027	6,778,200	
C I J	24,900	305	7,594,500	
ネットワンシステムズ	443	104,100	46,116,300	
アルゴグラフィックス	8,500	885	7,522,500	
エイベックス・グループ・ホールディングス	35,200	731	25,731,200	
日本ユニシス	56,700	663	37,592,100	
兼松エレクトロニクス	12,700	819	10,401,300	
東京放送ホールディングス	124,800	1,335	166,608,000	
日本テレビ放送網	20,310	11,720	238,033,200	
テレビ朝日	586	135,800	79,578,800	
テレビ東京	9,000	1,816	16,344,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,756	37,750	66,289,000	
アイ・ティー・シーネットワーク	49	203,000	9,947,000	
イー・アクセス	1,159	53,300	61,774,700	
N E C モバイルリング	7,400	2,285	16,909,000	
日本電信電話	911,800	3,740	3,410,132,000	
K D D I	3,592	480,000	1,724,160,000	
光通信	29,700	1,650	49,005,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	19,198	130,400	2,503,419,200	
G M O インターネット	65,500	386	25,283,000	
学研ホールディングス	100,000	235	23,500,000	
ゼンリン	30,600	1,049	32,099,400	
昭文社	12,600	576	7,257,600	
角川グループホールディングス	19,800	2,180	43,164,000	
インプレスホールディングス	19,000	182	3,458,000	
アイネット	12,300	503	6,186,900	
松竹	130,000	823	106,990,000	
東宝	165,100	1,385	228,663,500	
東映	89,000	462	41,118,000	
葵プロモーション	9,500	511	4,854,500	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,429	267,000	381,543,000	
D T S	22,800	814	18,559,200	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	58,800	1,791	105,310,800	
シーイーシー	13,500	486	6,561,000	
カプコン	49,300	1,325	65,322,500	
ジャステック	14,500	458	6,641,000	
住商情報システム	24,200	1,277	30,903,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日本システムウエア	10,800	318	3,434,400	

アイネス	28,800	752	21,657,600	
TKC	22,700	1,742	39,543,400	
富士ソフト	29,000	1,505	43,645,000	
ソラン	24,100	776	18,701,600	
日本システムディベロップメント	49,000	946	46,354,000	
コナミ	94,000	1,484	139,496,000	
福井コンピュータ	7,200	290	2,088,000	
JBCCHホールディングス	18,700	575	10,752,500	
ソフトバンク	945,700	2,115	2,000,155,500	
ハウスイ	20,000	104	2,080,000	
インターニックス	8,700	370	3,219,000	
高千穂交易	8,900	960	8,544,000	
伊藤忠食品	5,700	3,040	17,328,000	
エレマテック	15,400	960	14,784,000	
JALUX	7,500	990	7,425,000	
トーメンデバイス	3,000	1,589	4,767,000	
双日	1,548,900	161	249,372,900	
アルフレッサホールディングス	55,000	3,740	205,700,000	
横浜冷凍	50,000	597	29,850,000	
神栄	30,000	131	3,930,000	
山下医科器械	1,800	1,120	2,016,000	
ラサ商事	13,000	300	3,900,000	
あいホールディングス	58,000	296	17,168,000	
ダイワボウホールディングス	169,000	179	30,251,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,300	538	16,301,400	
UKCホールディングス	12,600	1,031	12,990,600	
日本コークス工業	210,000	98	20,580,000	
ミタチ産業	4,800	446	2,140,800	
JFE商事ホールディングス	158,000	319	50,402,000	
シップヘルスケアホールディングス	274	52,200	14,302,800	
協栄産業	26,000	185	4,810,000	
小野建	19,100	642	12,262,200	
佐島電機	17,000	502	8,534,000	
エコートレーディング	5,300	896	4,748,800	
伯東	14,100	748	10,546,800	
中山福	14,400	539	7,761,600	
ナガイレーベン	14,300	1,883	26,926,900	
菱食	22,500	2,480	55,800,000	
松田産業	15,300	1,415	21,649,500	
メディパルホールディングス	231,400	1,194	276,291,600	
アドヴァン	22,600	545	12,317,000	
SPK	5,100	1,128	5,752,800	
アズワン	13,900	1,710	23,769,000	
スズデン	8,400	470	3,948,000	
尾家産業	7,600	789	5,996,400	
シモジマ	15,900	1,318	20,956,200	
ドウシシャ	11,300	2,270	25,651,000	
高速	13,700	660	9,042,000	
黒田電気	30,900	1,298	40,108,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
丸文	18,400	553	10,175,200	
ハピネット	6,700	1,239	8,301,300	
トーメンエレクトロニクス	7,100	883	6,269,300	
エクセル	9,900	1,003	9,929,700	

マルカキカイ	8,100	585	4,738,500	
ガリバーインターナショナル	5,460	6,190	33,797,400	
日本エム・ディ・エム	20,200	207	4,181,400	
進和	12,900	1,289	16,628,100	
エスケイジャパン	7,200	306	2,203,200	
ダイトエレクトロン	9,700	376	3,647,200	
シークス	14,700	973	14,303,100	
田中商事	20,400	338	6,895,200	
オーハシテクニカ	13,500	514	6,939,000	
マクニカ	9,200	1,355	12,466,000	
白銅	8,100	543	4,398,300	
伊藤忠商事	1,500,000	631	946,500,000	
丸紅	1,771,000	469	830,599,000	
高島	79,000	119	9,401,000	
F & A アクアホールディングス	19,000	1,010	19,190,000	
長瀬産業	121,000	1,090	131,890,000	
蝶理	165,000	94	15,510,000	
豊田通商	206,200	1,248	257,337,600	
三共生興	42,600	232	9,883,200	
兼松	506,000	68	34,408,000	
ツカモトコーポレーション	49,000	68	3,332,000	
三井物産	1,864,300	1,214	2,263,260,200	
日本紙パルプ商事	123,000	341	41,943,000	
日立ハイテクノロジーズ	70,200	1,583	111,126,600	
カメイ	30,000	398	11,940,000	
東都水産	39,000	142	5,538,000	
スターゼン	77,000	236	18,172,000	
山善	92,100	297	27,353,700	
椿本興業	26,000	179	4,654,000	
住友商事	1,183,600	878	1,039,200,800	
内田洋行	54,000	227	12,258,000	
三菱商事	1,728,800	2,155	3,725,564,000	
第一実業	54,000	242	13,068,000	
キヤノンマーケティングジャパン	77,000	1,332	102,564,000	
西華産業	89,000	203	18,067,000	
佐藤商事	21,400	433	9,266,200	
菱洋エレクトロ	25,700	710	18,247,000	
東京産業	21,000	234	4,914,000	
神鋼商事	64,000	149	9,536,000	
阪和興業	231,000	299	69,069,000	
カナデン	25,000	446	11,150,000	
菱電商事	35,000	433	15,155,000	
フルサト工業	13,900	490	6,811,000	
岩谷産業	241,000	256	61,696,000	
すてきナイスグループ	129,000	199	25,671,000	
昭光通商	91,000	103	9,373,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
二チモウ	40,000	142	5,680,000	
極東貿易	35,000	117	4,095,000	
イワキ	25,000	250	6,250,000	
三愛石油	59,000	355	20,945,000	
稲畑産業	60,000	305	18,300,000	
明和産業	24,500	151	3,699,500	
東邦ホールディングス	59,700	1,204	71,878,800	

サンゲツ	39,900	1,940	77,406,000	
ミツウロコ	39,700	655	26,003,500	
シナネン	58,000	379	21,982,000	
伊藤忠エネクス	51,100	378	19,315,800	
ザ・トーカイ	55,000	487	26,785,000	
サンリオ	65,000	710	46,150,000	
サンワテクノス	11,300	362	4,090,600	
リョーサン	35,200	2,220	78,144,000	
新光商事	21,700	683	14,821,100	
トーホー	44,000	345	15,180,000	
三信電気	24,300	631	15,333,300	
東陽テクニカ	36,000	725	26,100,000	
モスフードサービス	30,300	1,484	44,965,200	
加賀電子	23,000	927	21,321,000	
ソーダニッカ	26,000	311	8,086,000	
立花エレテック	14,700	649	9,540,300	
ヤマタネ	109,000	112	12,208,000	
丸紅建材リース	27,000	111	2,997,000	
トラスコ中山	27,100	1,299	35,202,900	
オートボックスセブン	27,300	2,650	72,345,000	
加藤産業	33,400	1,705	56,947,000	
イエローハット	21,900	760	16,644,000	
富士エレクトロニクス	13,100	768	10,060,800	
J Kホールディングス	32,000	385	12,320,000	
ユニダックス	13,000	411	5,343,000	
日伝	9,600	2,350	22,560,000	
北沢産業	42,500	205	8,712,500	
杉本商事	12,100	780	9,438,000	
因幡電機産業	23,900	2,010	48,039,000	
住金物産	113,000	168	18,984,000	
ミスミグループ本社	77,800	1,615	125,647,000	
江守商事	5,400	671	3,623,400	
タキヒヨー	39,000	492	19,188,000	
スズケン	82,100	3,210	263,541,000	
ジェコス	28,700	391	11,221,700	
ローソン	65,300	4,130	269,689,000	
サンエー	8,000	3,150	25,200,000	
キリン堂	9,300	411	3,822,300	
ダイユーエイト	3,300	588	1,940,400	
カワチ薬品	14,400	1,709	24,609,600	
エービーシー・マート	24,400	2,595	63,318,000	
ハードオフコーポレーション	9,300	413	3,840,900	
アスクル	19,500	1,687	32,896,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ゲオ	384	89,500	34,368,000	
ポイント	20,830	4,650	96,859,500	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	16,000	113	1,808,000	
くらコーポレーション	61	271,200	16,543,200	
キャンドウ	106	90,800	9,624,800	
パル	5,950	1,572	9,353,400	
エディオン	92,400	821	75,860,400	
サーラコーポレーション	22,500	572	12,870,000	
パルス	97	65,000	6,305,000	
あみやき亭	40	180,900	7,236,000	

ハニーズ	16,400	491	8,052,400	
アルペン	17,700	1,447	25,611,900	
ピックカメラ	564	31,150	17,568,600	
D C M J a p a nホールディングス	116,200	532	61,818,400	
ユニバース	3,000	1,174	3,522,000	
J・フロントリテイリング	547,000	394	215,518,000	
ドトール・日レスホールディングス	37,000	1,238	45,806,000	
マツモトキヨシホールディングス	39,100	2,215	86,606,500	
ココカラファインホールディングス	17,500	1,691	29,592,500	
三越伊勢丹ホールディングス	402,200	777	312,509,400	
クリエイトSDホールディングス	8,200	1,805	14,801,000	
ブックオフコーポレーション	10,000	1,031	10,310,000	
あさひ	9,600	1,495	14,352,000	
サークルKサンクス	44,000	1,110	48,840,000	
日本調剤	3,560	1,712	6,094,720	
コスモス薬品	8,800	2,110	18,568,000	
セブン&アイ・ホールディングス	923,900	1,951	1,802,528,900	
ツルハホールディングス	17,300	3,400	58,820,000	
サンマルクホールディングス	6,700	2,605	17,453,500	
フェリシモ	5,900	1,257	7,416,300	
トリドール	58	160,000	9,280,000	
総合メディカル	5,100	2,080	10,608,000	
はるやま商事	11,000	328	3,608,000	
カップ・クリエイト	15,300	1,906	29,161,800	
ライトオン	17,400	694	12,075,600	
ジーンズメイト	7,500	507	3,802,500	
良品計画	24,500	3,690	90,405,000	
三城ホールディングス	28,700	733	21,037,100	
コナカ	27,500	277	7,617,500	
ハウスオブローゼ	2,400	1,206	2,894,400	
G-7ホールディングス	7,000	516	3,612,000	
イオン北海道	14,900	284	4,231,600	
コジマ	31,300	474	14,836,200	
コーナン商事	20,400	996	20,318,400	
エコス	8,000	648	5,184,000	
ワタミ	24,300	1,675	40,702,500	
マルシェ	5,700	698	3,978,600	
ドン・キホーテ	42,000	2,060	86,520,000	
メガネトップ	19,900	997	19,840,300	
西松屋チェーン	50,800	731	37,134,800	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ゼンショー	86,600	623	53,951,800	
幸楽苑	13,100	1,183	15,497,300	
ユニマットライフ	9,700	865	8,390,500	
ハークスレイ	5,700	665	3,790,500	
サイゼリヤ	34,300	1,444	49,529,200	
ポブラ	6,800	566	3,848,800	
ユナイテッドアローズ	25,000	747	18,675,000	
ハイデイ日高	9,400	999	9,390,600	
京都きもの友禅	13,600	876	11,913,600	
コロワイド	52,500	569	29,872,500	
壱番屋	8,200	2,155	17,671,000	
トップカルチャー	7,600	351	2,667,600	
スギホールディングス	32,300	2,020	65,246,000	

スクロール	23,100	311	7,184,100	
ファミリーマート	71,100	2,725	193,747,500	
木曽路	24,600	1,960	48,216,000	
千趣会	41,800	516	21,568,800	
タカキュー	18,500	148	2,738,000	
ケーヨー	43,500	393	17,095,500	
上新電機	50,000	721	36,050,000	
日本瓦斯	24,900	1,506	37,499,400	
ベスト電器	72,500	352	25,520,000	
マルエツ	47,000	412	19,364,000	
ロイヤルホールディングス	35,700	958	34,200,600	
東天紅	17,000	146	2,482,000	
いなげや	26,000	964	25,064,000	
島忠	52,400	1,778	93,167,200	
チヨダ	30,400	1,067	32,436,800	
鈴丹	6,100	225	1,372,500	
ライフコーポレーション	14,900	1,660	24,734,000	
カスミ	47,600	445	21,182,000	
リンガーハット	16,000	1,190	19,040,000	
さが美	18,000	146	2,628,000	
MrMax	23,300	415	9,669,500	
テナアライド	15,700	313	4,914,100	
AOKIホールディングス	21,500	873	18,769,500	
オークワ	30,000	883	26,490,000	
コメリ	27,800	2,285	63,523,000	
青山商事	54,000	1,120	60,480,000	
しまむら	24,200	7,920	191,664,000	
CFSコーポレーション	19,000	485	9,215,000	
高島屋	289,000	587	169,643,000	
丸善	117,000	75	8,775,000	
松屋	42,800	741	31,714,800	
エイチ・ツー・オー リテイリング	120,000	550	66,000,000	
丸栄	34,000	132	4,488,000	
ニッセンホールディングス	46,400	268	12,435,200	
パルコ	60,200	800	48,160,000	
丸井グループ	255,200	524	133,724,800	
原信ナルスホールディングス	13,000	1,080	14,040,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ダイエー	98,550	308	30,353,400	
イズミヤ	75,000	392	29,400,000	
イオン	757,600	737	558,351,200	
ユニー	173,500	648	112,428,000	
イズミ	62,800	1,135	71,278,000	
東武ストア	31,000	280	8,680,000	
平和堂	42,700	1,107	47,268,900	
フジ	28,400	1,806	51,290,400	
ヤオコー	10,200	3,030	30,906,000	
ゼビオ	24,500	1,656	40,572,000	
ケーズホールディングス	37,100	2,930	108,703,000	
Olympic	15,500	618	9,579,000	
東日カーライフグループ	35,000	107	3,745,000	
元気寿司	6,500	1,190	7,735,000	
ヤマダ電機	105,540	5,390	568,860,600	
アークランドサカモト	13,600	976	13,273,600	

ニトリ	41,650	6,560	273,224,000	
グルメ杵屋	15,000	532	7,980,000	
愛眼	17,000	506	8,602,000	
吉野家ホールディングス	628	100,200	62,925,600	
松屋フーズ	11,200	1,291	14,459,200	
サガミチェーン	26,000	795	20,670,000	
プレナス	25,900	1,207	31,261,300	
ミニストップ	17,200	1,077	18,524,400	
アークス	27,500	1,249	34,347,500	
パロー	42,300	710	30,033,000	
ベルク	9,300	846	7,867,800	
大庄	14,000	1,246	17,444,000	
ファーストリテイリング	46,300	15,060	697,278,000	
サンドラッグ	44,100	2,265	99,886,500	
ヤマザワ	6,200	1,220	7,564,000	
やまや	4,400	719	3,163,600	
ペルーナ	29,050	365	10,603,250	
新生銀行	1,050,000	101	106,050,000	
あおぞら銀行	721,000	98	70,658,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	13,568,500	462	6,268,647,000	
りそなホールディングス	619,200	949	587,620,800	
中央三井トラスト・ホールディングス	1,206,000	301	363,006,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,185,500	2,745	3,254,197,500	
第四銀行	302,000	322	97,244,000	
北越銀行	243,000	143	34,749,000	
西日本シティ銀行	754,000	237	178,698,000	
札幌北洋ホールディングス	319,900	337	107,806,300	
千葉銀行	848,000	560	474,880,000	
横浜銀行	1,486,000	431	640,466,000	
常陽銀行	838,000	391	327,658,000	
群馬銀行	540,000	500	270,000,000	
武蔵野銀行	35,100	2,205	77,395,500	
千葉興業銀行	44,300	675	29,902,500	
関東つくば銀行	70,100	277	19,417,700	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
東京都民銀行	40,800	1,165	47,532,000	
七十七銀行	363,000	526	190,938,000	
青森銀行	163,000	210	34,230,000	
秋田銀行	158,000	357	56,406,000	
山形銀行	133,000	450	59,850,000	
岩手銀行	15,600	5,230	81,588,000	
東邦銀行	197,000	290	57,130,000	
東北銀行	118,000	130	15,340,000	
みちのく銀行	116,000	172	19,952,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	876,000	324	283,824,000	
静岡銀行	672,000	852	572,544,000	
十六銀行	283,000	343	97,069,000	
スルガ銀行	226,000	817	184,642,000	
八十二銀行	437,000	561	245,157,000	
山梨中央銀行	147,000	372	54,684,000	
大垣共立銀行	309,000	288	88,992,000	
福井銀行	199,000	297	59,103,000	
北國銀行	247,000	349	86,203,000	
清水銀行	7,800	3,830	29,874,000	

滋賀銀行	216,000	540	116,640,000	
南都銀行	217,000	515	111,755,000	
百五銀行	213,000	434	92,442,000	
京都銀行	386,000	764	294,904,000	
三重銀行	96,000	232	22,272,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,520,000	199	302,480,000	
広島銀行	637,000	366	233,142,000	
山陰合同銀行	140,000	764	106,960,000	
中国銀行	190,000	1,189	225,910,000	
鳥取銀行	74,000	257	19,018,000	
伊予銀行	264,000	787	207,768,000	
百十四銀行	253,000	333	84,249,000	
四国銀行	169,000	328	55,432,000	
阿波銀行	192,000	485	93,120,000	
鹿児島銀行	150,000	674	101,100,000	
大分銀行	150,000	348	52,200,000	
宮崎銀行	120,000	277	33,240,000	
肥後銀行	183,000	539	98,637,000	
佐賀銀行	134,000	286	38,324,000	
十八銀行	147,000	246	36,162,000	
沖縄銀行	17,800	3,660	65,148,000	
琉球銀行	45,800	1,111	50,883,800	
住友信託銀行	1,951,000	450	877,950,000	
みずほ信託銀行	1,829,000	81	148,149,000	
八千代銀行	12,200	2,055	25,071,000	
みずほフィナンシャルグループ	18,839,400	157	2,957,785,800	
紀陽ホールディングス	862,000	114	98,268,000	
山口フィナンシャルグループ	216,000	928	200,448,000	
長野銀行	81,000	193	15,633,000	
名古屋銀行	209,000	350	73,150,000	
愛知銀行	8,400	7,070	59,388,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
第三銀行	142,000	235	33,370,000	
中京銀行	95,000	277	26,315,000	
東日本銀行	121,000	177	21,417,000	
愛媛銀行	145,000	257	37,265,000	
トマト銀行	90,000	191	17,190,000	
みなと銀行	239,000	103	24,617,000	
京葉銀行	191,000	453	86,523,000	
関西アーバン銀行	231,000	126	29,106,000	
栃木銀行	116,000	392	45,472,000	
北日本銀行	7,200	2,395	17,244,000	
香川銀行	77,000	298	22,946,000	
東和銀行	234,000	57	13,338,000	
徳島銀行	63,000	309	19,467,000	
福島銀行	285,000	53	15,105,000	
大東銀行	147,000	60	8,820,000	
フィデアホールディングス	110,700	164	18,154,800	
池田泉州ホールディングス	740,500	326	241,403,000	
SBIホールディングス	21,378	15,430	329,862,540	
ジャフコ	38,800	1,809	70,189,200	
大和証券グループ本社	2,038,000	465	947,670,000	
野村ホールディングス	4,303,500	655	2,818,792,500	
みずほ証券	592,000	285	168,720,000	

みずほインベスターズ証券	540,000	88	47,520,000	
岡三証券グループ	197,000	449	88,453,000	
丸三証券	71,500	543	38,824,500	
東洋証券	87,000	158	13,746,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	250,000	345	86,250,000	
光世証券	57,000	89	5,073,000	
水戸証券	63,000	180	11,340,000	
いちよし証券	48,700	607	29,560,900	
松井証券	137,400	632	86,836,800	
だいこう証券ビジネス	11,400	384	4,377,600	
マネックスグループ	1,370	33,050	45,278,500	
カブドットコム証券	357	84,300	30,095,100	
極東証券	28,800	682	19,641,600	
岩井証券	20,200	639	12,907,800	
三井住友海上グループホールディングス	492,200	2,390	1,176,358,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	740	247,400	183,076,000	
日本興亜損害保険	779,000	511	398,069,000	
損害保険ジャパン	1,013,000	570	577,410,000	
ニッセイ同和損害保険	263,000	449	118,087,000	
あいおい損害保険	558,000	448	249,984,000	
東京海上ホールディングス	879,900	2,580	2,270,142,000	
T & Dホールディングス	329,600	1,920	632,832,000	
クレディセゾン	162,000	1,024	165,888,000	
セディナ	182,800	167	30,527,600	
芙蓉総合リース	20,300	2,025	41,107,500	
興銀リース	32,800	1,676	54,972,800	
東京センチュリーリース	55,300	956	52,866,800	
日本証券金融	97,000	655	63,535,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
大阪証券金融	32,200	199	6,407,800	
ポケットカード	26,500	243	6,439,500	
リコーリース	16,400	1,883	30,881,200	
イオンクレジットサービス	119,800	885	106,023,000	
アコム	70,730	1,158	81,905,340	
プロミス	123,750	559	69,176,250	
ジャックス	145,000	219	31,755,000	
日立キャピタル	55,300	1,178	65,143,400	
オリックス	112,340	6,110	686,397,400	
三菱UFJリース	64,410	2,700	173,907,000	
アサックス	47	64,500	3,031,500	
NECキャピタルソリューション	8,600	1,232	10,595,200	
昭栄	45,900	716	32,864,400	
東京建物不動産販売	31,200	294	9,172,800	
野村不動産ホールディングス	117,800	1,290	151,962,000	
ヒューリック	72,600	611	44,358,600	
パーク24	130,600	984	128,510,400	
三井不動産	963,000	1,521	1,464,723,000	
三菱地所	1,518,000	1,415	2,147,970,000	
平和不動産	181,000	273	49,413,000	
東京建物	460,000	294	135,240,000	
ダイビル	67,000	622	41,674,000	
サンケイビル	47,700	530	25,281,000	
東急不動産	458,000	320	146,560,000	
京阪神不動産	41,600	388	16,140,800	

住友不動産	520,000	1,599	831,480,000	
東宝不動産	35,500	530	18,815,000	
有楽土地	48,000	279	13,392,000	
テーオーシー	104,600	331	34,622,600	
東京楽天地	54,000	374	20,196,000	
レオパレス21	178,300	292	52,063,600	
フジ住宅	42,900	316	13,556,400	
空港施設	34,800	467	16,251,600	
住友不動産販売	10,010	3,520	35,235,200	
ゴールドクレスト	17,740	2,605	46,212,700	
東栄住宅	19,200	825	15,840,000	
東急リバブル	27,800	813	22,601,400	
飯田産業	15,300	1,562	23,898,600	
アーネストワン	43,300	927	40,139,100	
サンヨーハウジング名古屋	178	75,700	13,474,600	
イオンモール	111,200	1,669	185,592,800	
タクトホーム	187	80,100	14,978,700	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,578	57,700	91,050,600	
日本空港ビルデング	63,300	1,170	74,061,000	
日本工営	84,000	275	23,100,000	
日本M&Aセンター	45	336,000	15,120,000	
アコーディア・ゴルフ	626	93,900	58,781,400	
パソナグループ	251	69,700	17,494,700	
リンクアンドモチベーション	62	41,100	2,548,200	
テンブホールディングス	34,100	872	29,735,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
学情	10,000	272	2,720,000	
スタジオアリス	12,700	844	10,718,800	
シミック	420	19,060	8,005,200	
NECフィールドイング	20,300	1,177	23,893,100	
総合警備保障	82,300	1,028	84,604,400	
カカクコム	147	330,000	48,510,000	
ルネサンス	14,800	307	4,543,600	
新日本科学	13,600	537	7,303,200	
ソネット・エムスリー	95	294,500	27,977,500	
ディー・エヌ・エー	283	477,000	134,991,000	
博報堂DYホールディングス	31,120	4,270	132,882,400	
ぐるなび	135	205,400	27,729,000	
一休	152	38,450	5,844,400	
ジャパンベストレスキューシステム	57	67,500	3,847,500	
ジェイコムホールディングス	28	86,000	2,408,000	
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	536	63,400	33,982,400	
イーピーエス	68	359,000	24,412,000	
アミューズ	7,300	949	6,927,700	
ドリームインキュベータ	87	61,400	5,341,800	
TAC	15,500	348	5,394,000	
電通	222,800	2,040	454,512,000	
イオンファンタジー	9,100	1,035	9,418,500	
みらかホールディングス	46,800	2,785	130,338,000	
アルプス技研	10,900	562	6,125,800	
ダイオーズ	5,700	459	2,616,300	
日本空調サービス	6,300	666	4,195,800	
オリエンタルランド	59,600	6,120	364,752,000	

ダスキン	68,700	1,617	111,087,900	
明光ネットワークジャパン	22,300	583	13,000,900	
ファルコバイオシステムズ	13,300	839	11,158,700	
秀英予備校	6,900	490	3,381,000	
田谷	5,000	700	3,500,000	
ラウンドワン	34,000	527	17,918,000	
リゾートトラスト	38,600	1,034	39,912,400	
ピー・エム・エル	13,000	2,800	36,400,000	
ワタベウェディング	7,700	1,021	7,861,700	
もしもしホットライン	15,500	1,649	25,559,500	
東急コミュニティー	5,800	1,997	11,582,600	
リソー教育	2,697	5,110	13,781,670	
ウェアハウス	8,200	424	3,476,800	
ユー・エス・エス	30,940	5,540	171,407,600	
東京個別指導学院	22,300	173	3,857,900	
カルチャア・コンビニエンス・クラブ	86,600	519	44,945,400	
テー・オー・ダブリュー	6,400	546	3,494,400	
セントラルスポーツ	8,100	822	6,658,200	
リゾートソリューション	29,000	147	4,263,000	
エイチ・アイ・エス	23,100	1,707	39,431,700	
共立メンテナンス	10,800	1,308	14,126,400	
イチネンホールディングス	25,400	338	8,585,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
建設技術研究所	13,600	449	6,106,400	
燦ホールディングス	5,600	1,548	8,668,800	
スバル興業	25,000	253	6,325,000	
東京テアトル	118,000	151	17,818,000	
ホリプロ	9,100	699	6,360,900	
よみうりランド	53,000	301	15,953,000	
東京都競馬	177,000	134	23,718,000	
カナモト	29,000	358	10,382,000	
東京ドーム	172,000	253	43,516,000	
トランス・コスモス	29,200	737	21,520,400	
乃村工藝社	50,000	246	12,300,000	
藤田観光	65,000	369	23,985,000	
近畿日本ツーリスト	92,000	75	6,900,000	
日本管財	9,300	1,522	14,154,600	
白洋舎	30,000	280	8,400,000	
セコム	220,800	4,310	951,648,000	
セントラル警備保障	10,300	889	9,156,700	
丹青社	46,000	181	8,326,000	
メイテック	33,600	1,278	42,940,800	
アサツー ディ・ケイ	42,700	1,787	76,304,900	
応用地質	26,000	817	21,242,000	
船井総合研究所	24,800	549	13,615,200	
進学会	17,200	281	4,833,200	
ベネッセホールディングス	77,400	3,860	298,764,000	
イオンディライト	18,600	1,126	20,943,600	
ナック	12,700	858	10,896,600	
ニチイ学館	49,300	787	38,799,100	
ダイセキ	39,700	1,895	75,231,500	
合計	318,233,329		251,488,032,760	

(注) 代用有価証券の担保差入株数には、約定未受渡株数を含んでおります。

## B．株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額（円）	備考
新株予約権証券	DOWAホールディングス	146,000	3,358,000	
合計		146,000	3,358,000	

## 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

## 不動産等明細表

該当事項はありません。

## 商品明細表

該当事項はありません。

## 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

## 借入金明細表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】平成21年12月30日

資産総額	1,253,412,513 円
負債総額	3,593,684 円
純資産総額（ - ）	1,249,818,829 円
発行済口数	1,096,050,814 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1403 円
1万口当たり純資産額	11,403 円

#### <参考>

マザーファンドの現況（平成21年12月30日）

純資産額計算書

（中央三井日本株式マザーファンド）

資産総額	265,787,037,011 円
負債総額	185,685,792 円
純資産総額（ - ）	265,601,351,219 円
発行済口数	337,494,404,722 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7870 円
1万口当たり純資産額	7,870 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
第7期計算期間	217,735,038	121,325,019	1,097,544,565

（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

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

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

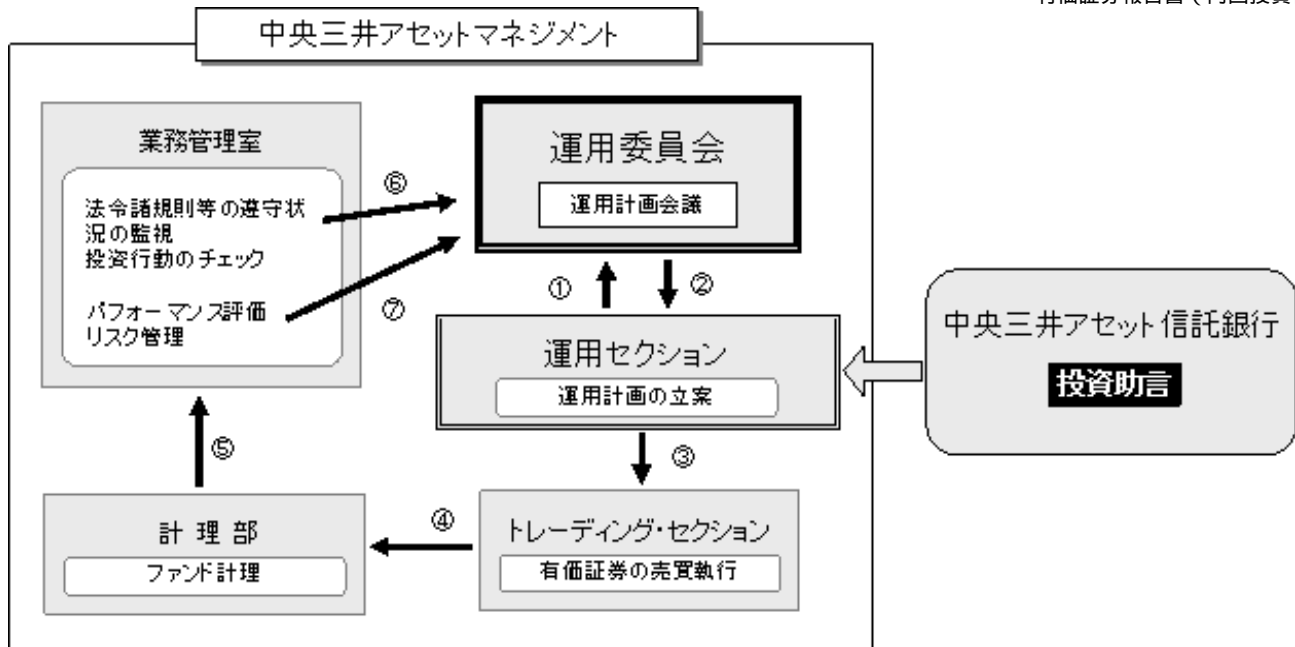
取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

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

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

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

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21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	52	441,033
追加型公社債投資信託	-	-
単位型株式投資信託	28	175,946
単位型公社債投資信託	-	-
合計	80	616,980

### 3【委託会社等の経理状況】

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

ただし、第22期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）は、改正前の財務諸表等規則に基づいて作成しており、第23期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）は、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

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

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

(2) 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第22期事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）及び第23期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）の財務諸表については、監査法人トーマツによる監査を受け、第24期中間会計期間（平成21年4月1日から平成21年9月30日まで）の中間財務諸表については、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

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

## (4) 中間貸借対照表

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

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

## ( 5 ) 中間損益計算書

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

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

## (6) 中間株主資本等変動計算書

第24期中間会計期間(平成21年4月1日から平成21年9月30日まで)

(単位:千円)

株主資本		
資本金	前期末残高	300,000
	中間会計期間中の変動額	-
	中間会計期間末残高	300,000
資本剰余金		
資本準備金	前期末残高	50,000
	中間会計期間中の変動額	-
	中間会計期間末残高	50,000
資本剰余金合計	前期末残高	50,000
	中間会計期間中の変動額	-
	中間会計期間末残高	50,000
利益剰余金		
利益準備金	前期末残高	25,401
	中間会計期間中の変動額	-
	中間会計期間末残高	25,401
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	前期末残高	1,771,709
	中間会計期間中の変動額	中間純利益 165,493
	中間会計期間末残高	1,937,202
利益剰余金合計	前期末残高	1,797,110
	中間会計期間中の変動額	165,493
	中間会計期間末残高	1,962,603
株主資本合計	前期末残高	2,147,110
	中間会計期間中の変動額	165,493
	中間会計期間末残高	2,312,603
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	前期末残高	-
	中間会計期間中の変動額(純額)	69
	中間会計期間末残高	69
評価・換算差額等合計	前期末残高	-
	中間会計期間中の変動額	69
	中間会計期間末残高	69
純資産合計	前期末残高	2,147,110
	中間会計期間中の変動額	165,562
	中間会計期間末残高	2,312,672

## 中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

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

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

項目	第24期中間会計期間末 (平成21年9月30日)
1.有形固定資産の減価償却 累計額	建物 25,848千円 器具備品 166,512千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺の うえ、流動負債の「その他未払金」に含 めて表示しております。

## （中間損益計算書関係）

項目	第24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21年9月30日まで)
1.減価償却実施額	有形固定資産 12,254千円 無形固定資産 13,416千円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

項目	第24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21年9月30日まで)				
	株式の種類	前事業 年度末	増加	減少	当中間 会計期末
1.発行済株式に関する事項	普通株式(株)	5,050	-	-	5,050
2.自己株式に関する事項	該当事項はありません。				
3.新株予約権等に関する事項	該当事項はありません。				
4.配当に関する事項	該当事項はありません。				

## リース取引関係

第24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21年9月30日まで)
リース取引は重要性が乏しく、1件当たりの金額が少額なため、注記を省略 しております。

## 有価証券関係

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

## デリバティブ関係

第24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21年9月30日まで)
当社はデリバティブ取引を全く行っていないため、該当事項はありません。

## 1 株当たり情報

第24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21年9月30日まで)	
1株当たり純資産額	457,954円99銭
1株当たり中間純利益	32,770円92銭
(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

(注) 1株当たり中間純利益算定上の基礎は以下のとおりであります。

第24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21年9月30日まで)	
中間純利益(千円)	165,493
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益(千円)	165,493
普通株式の期中平均株式数(株)	5,050

## 重要な後発事象

第24期中間会計期間 (平成21年4月1日から 平成21年9月30日まで)
該当事項はありません。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

科目	第22期 平成20年3月31日		第23期 平成21年3月31日	
	金額(千円)	構成比 (%)	金額(千円)	構成比 (%)
(資産の部)				
流動資産				
1. 現金・預金		615,636	1,464,505	
2. 前払費用		397,534	130,306	
3. 未収委託者報酬		1,587,133	972,672	
4. 未収収益				
(1) 投資顧問報酬	493		-	
(2) その他	320	814	170	170
5. 繰延税金資産		37,141	29,168	
6. その他 2		36,684	5,391	
流動資産 計		2,674,945	2,602,216	87.5
固定資産				
1. 有形固定資産 1				
(1) 建物		28,036	29,232	
(2) 器具備品		78,121	54,113	
有形固定資産 計		106,157	83,346	2.8
2. 無形固定資産				
(1) ソフトウェア		88,137	100,593	
(2) 電話加入権		1,847	1,847	
(3) 電話施設利用権		98	78	
無形固定資産 計		90,083	102,518	3.5
3. 投資その他の資産				
(1) 投資有価証券		65,000	65,000	
(2) 長期貸付金		44,788	42,388	
(3) 長期差入保証金		84,348	87,326	
(4) 長期前払費用		5,510	7,457	
(5) 会員権		25,000	25,000	
(6) 貸倒引当金		44,788	42,388	
投資その他の資産 計		179,859	184,784	6.2
固定資産 計		376,100	370,648	12.5
資産 合計		3,051,045	2,972,864	100.0

科目	第22期 平成20年3月31日		第23期 平成21年3月31日	
	金額（千円）	構成比 （％）	金額（千円）	構成比 （％）
（負債の部）				
流動負債				
1．預り金		32,286	3,008	
2．未払金				
（1）未払手数料	497,835		316,013	
（2）その他未払金	105,201	603,037	71,990	388,004
3．未払費用		312,034		246,794
4．未払法人税等		259,393		103,823
5．未払消費税等		31,383		-
6．賞与引当金		35,351		45,488
流動負債計		1,273,487		787,118
		41.8		26.5
固定負債				
1．退職給付引当金		11,007		16,535
2．役員退職慰労引当金		8,150		22,100
固定負債計		19,157		38,635
		0.6		1.3
負債合計		1,292,645		825,754
		42.4		27.8
（純資産の部）				
株主資本				
1．資本金		300,000		300,000
2．資本剰余金				
（1）資本準備金		50,000		50,000
資本剰余金計		50,000		50,000
		1.6		1.7
3．利益剰余金				
（1）利益準備金		25,401		25,401
（2）その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		1,382,999		1,771,709
利益剰余金計		1,408,400		1,797,110
		46.2		60.4
株主資本計		1,758,400		2,147,110
		57.6		72.2
純資産合計		1,758,400		2,147,110
		57.6		72.2
負債・純資産合計		3,051,045		2,972,864
		100.0		100.0

## ( 2 ) 【損益計算書】

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

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

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

		第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)
株主資本		(単位：千円)	(単位：千円)
資本金	前期末残高	300,000	300,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	300,000	300,000
資本剰余金			
資本準備金	前期末残高	50,000	50,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	50,000	50,000
資本剰余金合計	前期末残高	50,000	50,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	50,000	50,000
利益剰余金			
利益準備金	前期末残高	25,401	25,401
	当期変動額	-	-
	当期末残高	25,401	25,401
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金	前期末残高	1,088,152	1,382,999
	当期変動額 剰余金の配当	501,970	150,490
	当期純利益	796,817	539,200
	当期末残高	1,382,999	1,771,709
利益剰余金合計	前期末残高	1,113,553	1,408,400
	当期変動額	294,847	388,710
	当期末残高	1,408,400	1,797,110
株主資本合計	前期末残高	1,463,553	1,758,400
	当期変動額	294,847	388,710
	当期末残高	1,758,400	2,147,110
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金	前期末残高	48	-
	当期変動額 (純額)	48	-
	当期末残高	-	-
評価・換算差額等合計	前期末残高	48	-
	当期変動額	48	-
	当期末残高	-	-
純資産合計	前期末残高	1,463,505	1,758,400
	当期変動額	294,895	388,710
	当期末残高	1,758,400	2,147,110

## 重要な会計方針

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

## 会計方針の変更

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

## 追加情報

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

## 注記事項

## 1. 貸借対照表関係

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

## 2. 損益計算書関係

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

## 3. 株主資本等変動計算書関係

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

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

## 4. リース取引関係

第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)
リース取引は重要性が乏しく、1件当たりの金額が少額なため、注記を省略しております。	同左

## 5. 有価証券関係

第22期 (平成20年3月31日)	第23期 (平成21年3月31日)								
1. その他有価証券で時価のあるもの 該当事項はありません。	1. その他有価証券で時価のあるもの 該当事項はありません。								
2. 当事業年度中に売却したその他有価証券 該当事項はありません。	2. 当事業年度中に売却したその他有価証券 該当事項はありません。								
3. 時価評価されていない有価証券 <table border="1"> <thead> <tr> <th>内容</th> <th>貸借対照表計上額(千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>その他有価証券 非上場株式</td> <td>65,000</td> </tr> </tbody> </table>	内容	貸借対照表計上額(千円)	その他有価証券 非上場株式	65,000	3. 時価評価されていない有価証券 <table border="1"> <thead> <tr> <th>内容</th> <th>貸借対照表計上額(千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>その他有価証券 非上場株式</td> <td>65,000</td> </tr> </tbody> </table>	内容	貸借対照表計上額(千円)	その他有価証券 非上場株式	65,000
内容	貸借対照表計上額(千円)								
その他有価証券 非上場株式	65,000								
内容	貸借対照表計上額(千円)								
その他有価証券 非上場株式	65,000								
4. その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額 該当事項はありません。	4. その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額 該当事項はありません。								

## 6. デリバティブ関係

第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)
当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。	同左

## 7. 退職給付関係

第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)																
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項(平成20年3月31日現在)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 70%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">11,007千円</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">退職給付引当金</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">11,007千円</td> </tr> </table> <p>(注) 退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 (平成19年4月1日から平成20年3月31日まで)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 70%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">3,950千円</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">退職給付費用</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">3,950千円</td> </tr> </table> <p>(注) 退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	11,007千円	退職給付引当金	11,007千円	勤務費用	3,950千円	退職給付費用	3,950千円	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 同左</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項(平成21年3月31日現在)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 70%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">16,535千円</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">退職給付引当金</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">16,535千円</td> </tr> </table> <p>(注) 退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 (平成20年4月1日から平成21年3月31日まで)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 70%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">6,212千円</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">退職給付費用</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">6,212千円</td> </tr> </table> <p>(注) 退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	16,535千円	退職給付引当金	16,535千円	勤務費用	6,212千円	退職給付費用	6,212千円
退職給付債務	11,007千円																
退職給付引当金	11,007千円																
勤務費用	3,950千円																
退職給付費用	3,950千円																
退職給付債務	16,535千円																
退職給付引当金	16,535千円																
勤務費用	6,212千円																
退職給付費用	6,212千円																

## 8. 税効果会計関係

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

## 9. 関連当事者情報

第22期（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）

## 兄弟会社

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

項目	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)
1. 会社等の名称	親会社の子会社 中央三井インフォメーションテクノロジー株式会社 (注)親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社
2. 住所	東京都目黒区
3. 資本金	200百万円
4. 事業の内容又は職業	情報処理サービス業
5. 議決権等の所有(被所有)割合	該当なし
6. 関係内容	役員の兼任等 なし 事業上の関係 システムの管理・開発委託
7. 取引の内容	器具・備品の購入(注3) 取引金額 37,152千円 ソフトウェアの購入(注4) 取引金額 42,670千円

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注3) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

(注4) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

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

第23期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）

（追加情報）

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

これによる開示対象範囲の変更はありません。

## 1. 関連当事者との取引

### 当社と同一の親会社を持つ会社等

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

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

### (2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

## 10. 1株当たり情報

項目	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)
1. 1株当たり純資産額	348,198円11銭	425,170円41銭
2. 1株当たり当期純利益	157,785円55銭 (注)潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため、記載していません。	106,772円29銭 (注)潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

1株当たり当期純損益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

## 11. 重要な後発事象

第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)
該当事項はありません。	同左

[次へ](#)

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

##### (1) 自己又はその役員との取引

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

##### (2) 運用財産相互間の取引

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

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

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

##### (4) 親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

##### (5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更

当会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称：中央三井アセット信託銀行株式会社

資本金の額：11,000百万円（平成21年9月末日現在）

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

#### <再信託受託会社>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円(平成21年9月末日現在)

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

(2) 販売会社

名称：中央三井信託銀行株式会社

資本金の額：399,697百万円(平成21年9月末日現在)

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

## 2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

<再信託受託会社>

当ファンドの再信託受託会社として、信託事務の一部を行います。

(2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

<再信託受託会社>

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

### 第3【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21年3月10日	有価証券報告書
平成21年3月10日	有価証券届出書
平成21年9月10日	半期報告書
平成21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

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

# 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。

# 独立監査人の監査報告書

平成22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

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 平木達也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている中央三井DC日本株式インデックスファンドAの平成20年12月11日から平成21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21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

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

[次へ](#)

# 独立監査人の監査報告書

平成21年6月12日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

## 監査法人 トーマツ

指定社員  
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

指定社員  
業務執行社員 公認会計士 平木達也 印

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

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

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

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

以上

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

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成21年12月9日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 平木達也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている中央三井アセットマネジメント株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第24期事業年度の中間会計期間（平成21年4月1日から平成21年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、中央三井アセットマネジメント株式会社の平成21年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成21年4月1日から平成21年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以上

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