

**【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21年9月10日
<b>【計算期間】</b>	第2期（自平成20年6月11日至平成21年6月10日）
<b>【ファンド名】</b>	新生・4分散ファンド
<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>	山口 知樹
<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、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。

###### 信託金限度額

上限 1兆円

###### 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)
単位型	国内	株式 債券
追加型	海外	不動産投信
	内外	その他資産 ( ) 資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

##### (用語の定義について)

当ファンドが該当する商品分類に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

##### < 単位型投信・追加型投信 >

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

##### < 投資対象地域 >

- ・内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に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） >

- ・資産複合...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、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
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 (日本を含む) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり ( )
不動産投信	日々	中南米	ファンド ・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産複合 (株式、債券)資産配分固定 型))	その他 ( )	アフリカ 中近東 (中東)		
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## (用語の定義について)

当ファンドが該当する属性区分に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

## &lt; 投資対象資産 &gt;

## ・ その他資産 (投資信託証券)

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

## ・ 資産複合 (株式、債券) 資産配分固定型

…目論見書又は投資信託約款において、複数資産 (株式、債券) を投資対象とし、投資割合については固定的とする旨の記載があるものをいいます。

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

なお、商品分類表の投資対象資産 (収益の源泉) が「資産複合」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 >

- ・グローバル（日本を含む）  
...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産（日本を含みます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

#### < 投資形態 >

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

#### < 為替ヘッジ >

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

#### 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、中央三井日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンド及び中央三井外国債券マザーファンド（以下これらを「マザーファンド」又は「親投資信託」という場合があります。）の各受益証券への投資を通じて、国内外の株式及び公社債へ分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。

当ファンドが主要投資対象とする各マザーファンドは、それぞれが定めている以下のベンチマーク（運用成果を判断するうえで基準になる市場全体の動きを示す指数です。）と連動する投資成果を目標とする運用を行います。

中央三井日本株式マザーファンド：「TOPIX」（東証株価指数）

中央三井日本債券マザーファンド：「NOMURA - BPI総合」

中央三井外国株式マザーファンド：「MSCIコクサイ指数（円ベース）」

中央三井外国債券マザーファンド：「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」

#### 「TOPIX」（東証株価指数）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。

#### NOMURA - BPI総合について

野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。この指数は野村證券株式会社の知的財産であり、野村證券株式会社は、中央三井日本債券マザーファンドの運用成果に関し、一切責任はありません。

#### MSCIコクサイ指数について

MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

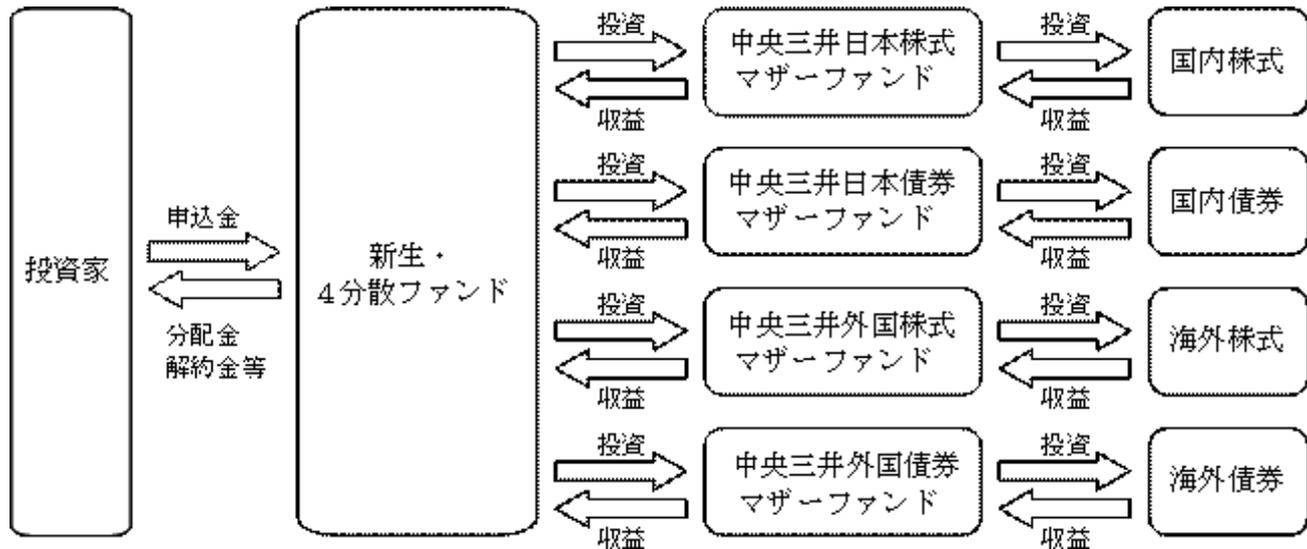
## シティグループ世界国債インデックスについて

シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

## (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（新生・4分散ファンド）とし、その資金をマザーファンド（中央三井日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンド及び中央三井外国債券マザーファンド）に投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



## 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

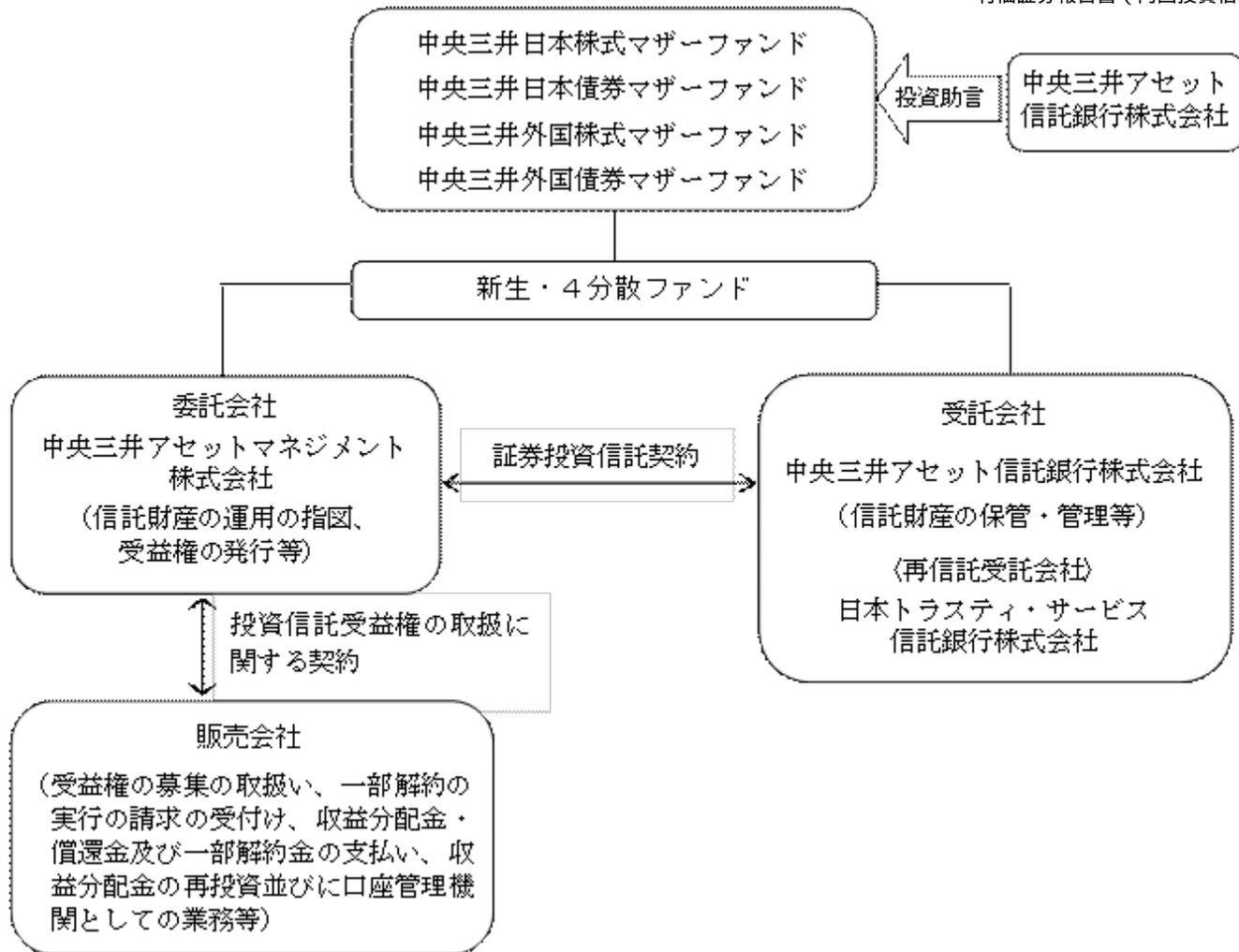
（再信託受託会社 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

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に関する契約」	販売会社の受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資並びに口座管理機関としての業務等に係る事務の内容等が定められています。

## 委託会社の概況

A．資本金の額：3億円（平成21年9月10日現在）

## B．委託会社の沿革

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

昭和62年2月：投資顧問業法に基づく登録

昭和62年9月：投資一任業務の認可取得

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

平成12年3月：証券投資信託委託業務認可取得

C．大株主の状況（平成21年9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

中央三井日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンド及び中央三井外国債券マザーファンドの各受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

従って当ファンドでは、基本的に各マザーファンドを通じて、国内外の株式・公社債に分散投資することになります。このほか、国内外の株式・公社債等に直接投資することもあります。

#### 投資態度

- A．主として、マザーファンド受益証券に投資し、国内外の株式・公社債への分散投資をすることにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。
- B．基本配分比率は国内株式25%、国内債券25%、海外株式25%、海外債券25%とします。
- C．上記の基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設け、一定以上乖離した場合にはリバランスを行います。また、市況動向等の変化に応じて、当該基本配分比率の見直しを行う場合があります。
- D．実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。
- E．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引及び債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式及び債券の組入総額と株価指数先物取引及び債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- F．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の75%以下とします。
- G．ただし、資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに不適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- H．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- I．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- J．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

### (2)【投資対象】

#### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- A．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定

めるものをいいます。以下同じ。)

1. 有価証券
2. デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記(5) J.、K.及びL.に定めるものに限り、)をいいます。)
3. 金銭債権(上記1.、2.及び下記4.に掲げるものに該当するものを除きます。)
4. 約束手形(上記1.に掲げるものに該当するものを除きます。)

B. 次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として中央三井アセットマネジメント株式会社を委託者とし、中央三井アセット信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「中央三井日本株式マザーファンド」、「中央三井日本債券マザーファンド」、「中央三井外国株式マザーファンド」及び「中央三井外国債券マザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券又は新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証券
9. 資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))及び新株予約権証券
12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証券で、上記1. から11. までの証券又は証券の性質を有するもの
13. 投資信託又は外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。)
14. 投資証券又は外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券又は証券(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り、)をいいます。)
17. 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り、)をいいます。)
20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で上記21. の有価証券の性質を有するもの

なお、上記1.の証券又は証書並びに上記12.及び17.の証券又は証書のうち上記1.の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2.から6.までの証券並びに上記12.及び17.の証券又は証書のうち上記2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記13.の証券及び上記14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 運用指図できる金融商品

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

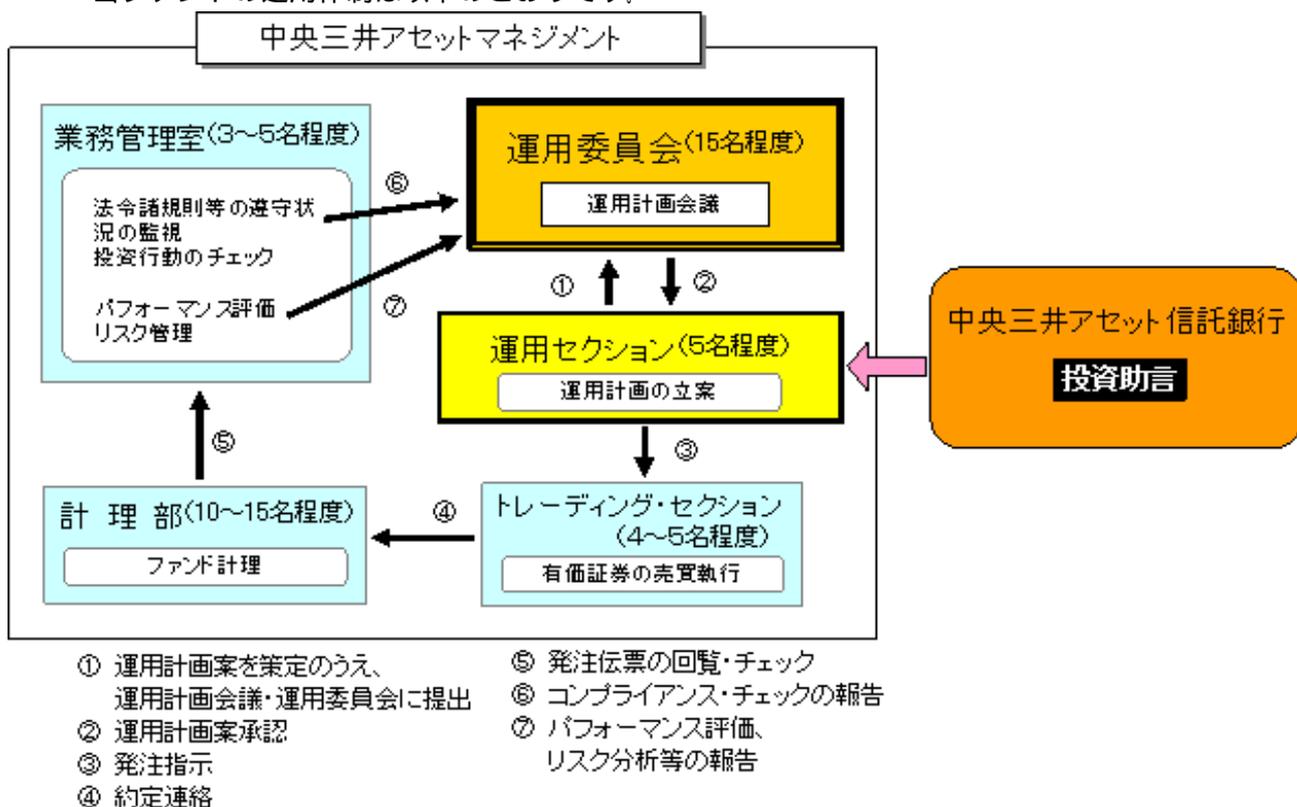
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

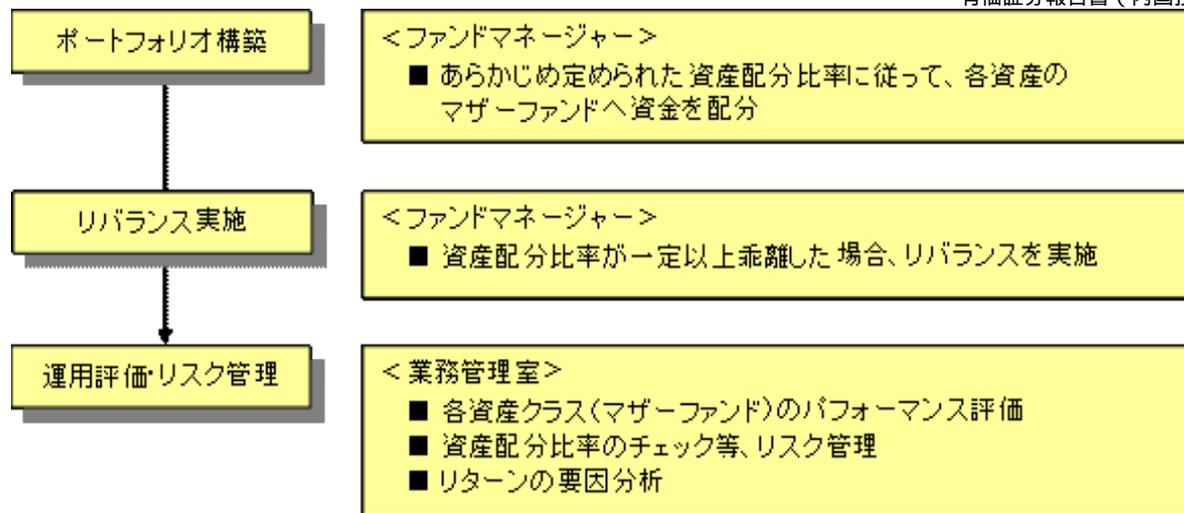
当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記A. に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

### (3) 【運用体制】

当ファンドの運用体制は以下のとおりです。



具体的なポートフォリオ構築プロセスは、以下のとおりです。



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

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

委託会社は、ファンドの関係法人である再信託受託会社に対する管理・統制としては、モニタリングの一環として外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書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6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、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）及び売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額。）等の全額とします。なお、前期から繰り越された分配準備積立金及び収益調整金、その他の調整金は、全額分配に使用することがあります。
- 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、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- C．収益分配にあてず信託財産内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（以下「配当等収益」といいます。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額は、諸経費（後記「4 手数料等及び税金（4）その他の手数料等」の記載をご参照ください。）、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、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あてるため、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額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、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填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- ハ．上記イ．及びロ．においてみなし配当等収益とは、マザーファンドの配当等収益にマザーファ

ンドの受益権総口数に占める信託財産に属するマザーファンドの受益権口数の割合を乗じて得た額をいいます。

二．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。

ホ．「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額(ただし、後記「4 手数料等及び税金(1) 申込手数料」に規定する申込手数料及び当該手数料に係る消費税等に相当する金額を除きます。以下本項において同じ。)と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、上記二．に規定する「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。

収益分配金の支払い

A．支払時期と場所

イ．収益分配金は、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(原則として計算期間終了日から起算して5営業日までの日)から、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てします。)に対する支払いを開始します。

ロ．上記イ．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受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者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。

ハ．上記イ．に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

B．時効

受益者が、収益分配金については上記A．イ．に規定する支払開始日から5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。

## (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は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

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．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10%以下とします。

E．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。

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．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。

#### 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、金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

#### I．信用取引の指図範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### J．先物取引等の運用指図

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

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

ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### K．スワップ取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

- 二．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- L．金利先渡取引及び為替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、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、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。
- 二．委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- M．有価証券の貸付の指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の a．及び b．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
- a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ． a．及び b．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- N．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記 O．の規定により借入れた公社債を売付けの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- O．公社債の借入れの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 二．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- P．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- Q．外国為替予約取引の指図

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- ロ．上記イ．の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- R．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。
- S．再投資の指図  
委託会社は、上記R．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。
- T．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等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、当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。
- U．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。
- V．利害関係人等との取引等  
イ．受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託会社が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下イ．及び下記ロ．において同じ。）信託業務の委託先及びその利害

関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記(2)に掲げる資産への投資等並びに上記I.からO.まで及びQ.からT.までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

ロ. 受託会社は、受託会社がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託会社又は受託会社の利害関係人の計算で行うことができるものとし、なお、受託会社の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

ハ. 委託会社は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託会社、その取締役、執行役及び委託会社の利害関係人等(金融商品取引法第31条の4に規定する親法人等又は子法人等をいいます。)又は委託会社が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前記(2)に掲げる資産への投資等並びに上記I.からO.まで及びQ.からT.までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託会社は、委託会社の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。

ニ. 上記イ.からハ.までの場合、委託会社及び受託会社は、受益者に対して信託法第31条第3項及び同法第32条第3項の通知は行いません。

#### 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、「TO

PIX」（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

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、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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。

## 「中央三井日本債券マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

わが国の公社債に投資を行い、NOMURA - BPI総合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。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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。

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

株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）を行使したものに限ることとし、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5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

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。

## 「中央三井外国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

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

M S C I コクサイ指数に採用されている国の株式に投資を行い、同指数（円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

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。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

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有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

### 3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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10%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。

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。

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。

#### 「中央三井外国債券マザーファンド」の概要

##### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

##### 2. 運用方法

###### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

###### (2) 投資態度

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

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。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

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

##### 3. 投資制限

株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

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外の株式や公社債を投資対象としています。組入れた株式や公社債の値動きや為替レートの変動等により基準価額が変動しますので、元本保証はなく、投資元本を割り込むことがあり収益（投資利回り）は未確定です。また、組入れた株式や公社債の発行体の経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化等により、投資元本を割り込むことがあり収益（投資利回り）は未確定です。

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。

#### 金利変動リスク

金利変動リスクとは、金利変動により債券価格が変動するリスクをいいます。一般に、金利が上昇（低下）した場合には債券価格は下落（上昇）し、基準価額の下落（上昇）要因となります。

#### 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。

#### カントリーリスク

カントリーリスクとは、投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等による影響を受けるリスクをいいます。一般に、このような事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

#### 為替変動リスク

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

米ドル、カナダドル、ユーロ、英ポンド、スイスフラン、スウェーデンクローナ、ノルウェークローネ、デンマーククローネ、ポーランドズロチ、オーストラリアドル、ニュージーランドドル、香港ドル、マレ - シアリングット、シンガポールドル（平成21年6月末現在・マザーファンドベース）

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

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

(4) 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資家の皆様に帰属します。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

申込手数料は、お申込価額(1)、お申込金額(2)、お申込口数等に応じて、3.15%(税抜(3)3.0%)の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を「お申込受付日の翌営業日の基準価額×取得口数」に乗じて得た額とします。

なお、マザーファンドにおいては、申込手数料はかかりません。

1：お申込受付日の翌営業日の基準価額に取得口数を乗じて得た額をいいます(以下同じ。)

2：お申込価額に申込手数料及び申込手数料に係る消費税及び地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額を加えた総額をいいます(以下同じ。)

3：「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます(以下同じ。)

「分配金再投資コース」( )において収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」(税金を差引いた後に現金でお受取りになるコース)と「分配金再投資コース」(税金を差引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース)の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

償還乗換えにより当ファンドの受益権をお求めいただく場合には、当該償還金額の範囲内(単位型証券投資信託にあっては、当該償還金額とその元本額のいずれか大きい額とします。)で取得する口数について申込手数料を優遇することがあります。(「償還乗換優遇制度」( ))

「償還乗換優遇制度」とは、取得申込日の属する月の前3ヶ月以内に償還となった証券投資信託の償還金(信託期間を延長した単位型証券投資信託及び延長前の信託終了日以降、収益分配金の再投資以外の追加信託を行わない追加型証券投資信託にあっては、延長前の信託終了日以降でかつ取得申込日の属する月の前3ヶ月以内における受益権の買取請求による売却代金及び一部解約金を含みます。)をもって、その支払いを行った販売会社で当ファンドの受益権をお求めいただく場合に申込手数料を優遇する制度等のことをいいます。なお、この際に、償還金の支払いを受けたことを証する書類をご提示いただくことがあります。

申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額はお申込金額の中から差引きます。

上記 から までの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、以下の照会先までお問い合わせください。

(照会先)

中央三井アセットマネジメント株式会社

・お客様相談窓口

電話：03-5440-0190

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

・ホームページアドレス：<http://www.cmam.co.jp/>

### (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受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.15%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

受益者の手取額は、当該解約価額から下記「（5）課税上の取扱い」「個人の受益者に対する課税」もしくは「法人の受益者に対する課税」に記載の税額を差引いた金額となります。

なお、当ファンドが保有する各マザーファンドの受益証券を一部解約する場合には、各マザーファンド毎に、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%
中央三井日本債券マザーファンド		0.1%
中央三井外国株式マザーファンド		0.2%
中央三井外国債券マザーファンド		0.1%

税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になる場合があります。

### （3）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の98.7（税抜 年10,000分の94）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29.4（税抜10,000分の28）、受託会社10,000分の6.3（税抜 10,000分の6）及び販売会社10,000分の63（税抜10,000分の60）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。

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

### （4）【その他の手数料等】

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

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、受益者の負担とし、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに信託財産中から支弁します。

なお、マザーファンドにおいては、監査報酬はかかりません。

借入金の利息は、原則として借入金返済時に信託財産中から支弁します。

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

### （5）【課税上の取扱い】

個別元本について

A. 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。

B. 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

C. ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には各販売会社毎に、個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は当該支

店等毎に、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」の両コースで取得する場合はコース別に、個別元本の算出が行われる場合があります。

D. 受益者が特別分配金を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「特別分配金」については、下記の「収益分配金の課税について」をご参照ください。）

一部解約時及び償還時の課税について

一部解約時及び償還時の譲渡益（個人の場合）又は個別元本超過額（法人の場合）が課税対象となります。詳しくは下記 又は をご参照ください。

収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「特別分配金」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

A. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、

B. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が特別分配金を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

個人の受益者に対する課税

A. 収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金の源泉徴収の税率は、平成23年12月31日までは10%（所得税7%及び地方税3%）、平成24年1月1日以降は20%（所得税15%及び地方税5%）となります。

B. 一部解約時及び償還時の譲渡益が譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、平成21年から平成23年までにおいては10%（所得税7%及び地方税3%）、平成24年以降は20%（所得税15%及び地方税5%）となります。

C. 一部解約時及び償還時の損失の金額については、確定申告により、上場株式等の譲渡所得の金額及び申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得の金額から控除することが可能となります。また、一部解約時及び償還時の差益については、上場株式等の譲渡損との通算が可能となります。

詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めいたします。

法人の受益者に対する課税

法人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、7%（所得税のみ）の税率（ ）による源泉徴収が行われます。

平成24年1月1日以降は、上記の7%（所得税のみ）の税率は15%（所得税のみ）となります。

税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になる場合があります。

## 5【運用状況】

以下の記載事項は、平成21年6月30日現在の状況について記載してあります。

### （1）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
-------	------	---------	---------

親投資信託 受益証券	中央三井日本株式マザーファンド	日本	237,389,038	25.60
	中央三井日本債券マザーファンド	日本	231,311,847	24.94
	中央三井外国株式マザーファンド	日本	229,771,701	24.78
	中央三井外国債券マザーファンド	日本	229,461,596	24.74
	親投資信託受益証券合計			927,934,182
その他の資産（負債控除後）			502,924	0.05
合計（純資産総額）			927,431,258	100.00

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

<参考>

当ファンドが主要投資対象としている親投資信託の状況は次のとおりです。

（中央三井日本株式マザーファンド）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	250,370,093,930	97.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,456,342,541	2.13
合計（純資産総額）		255,826,436,471	100.00

（中央三井日本債券マザーファンド）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
公社債	日本	254,018,365,482	98.73
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,263,375,682	1.27
合計（純資産総額）		257,281,741,164	100.00

（中央三井外国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	アメリカ	145,765,995,437	50.48
	イギリス	30,428,125,248	10.54
	カナダ	14,480,020,470	5.02
	フランス	14,357,289,398	4.97
	スイス	12,348,414,514	4.28
	その他	58,217,280,234	20.16
	小計	275,597,125,301	95.45
投資信託受益証券、 投資証券	アメリカ	1,566,896,900	0.54
	オーストラリア	607,656,610	0.21
	その他	1,320,196,307	0.46
	小計	3,494,749,817	1.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		9,639,721,149	3.34
合計（純資産総額）		288,731,596,267	100.00

（中央三井外国債券マザーファンド）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
-------	------	---------	---------

国債証券	アメリカ	136,244,661,767	29.77
	イタリア	53,581,602,955	11.71
	ドイツ	52,077,578,874	11.38
	フランス	46,914,643,868	10.25
	イギリス	40,710,226,539	8.89
	その他	110,007,192,985	24.03
	小計	439,535,906,988	96.03
特殊債券	オーストラリア	2,589,739,951	0.57
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		15,590,774,083	3.41
合計(純資産総額)		457,716,421,022	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	297,070,502	0.8050	239,141,755	0.7991	237,389,038	25.60
	中央三井日本債券 マザーファンド	204,248,872	1.1205	228,860,862	1.1325	231,311,847	24.94
	中央三井外国株式 マザーファンド	278,443,652	0.8469	235,841,089	0.8252	229,771,701	24.78
	中央三井外国債券 マザーファンド	138,471,786	1.6472	228,103,576	1.6571	229,461,596	24.74

(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	2,693,300	2,887.96	7,778,148,900	3,670.00	9,884,411,000	3.86
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	12,131,900	487.78	5,917,721,200	598.00	7,254,876,200	2.84
3	本田技研工業	輸送用機器	1,791,600	2,052.51	3,677,282,700	2,660.00	4,765,656,000	1.86

4	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,116,300	3,495.32	3,901,832,300	3,930.00	4,387,059,000	1.71
5	キヤノン	電気機器	1,215,500	2,681.29	3,259,117,400	3,160.00	3,840,980,000	1.50
6	日本電信電話	情報・通信業	951,200	4,525.69	4,304,841,900	3,920.00	3,728,704,000	1.46
7	東京電力	電気・ガス業	1,321,000	2,772.75	3,662,806,900	2,480.00	3,276,080,000	1.28
8	任天堂	その他製品	110,700	30,952.47	3,426,439,400	26,630.00	2,947,941,000	1.15
9	パナソニック	電気機器	2,235,500	1,123.00	2,510,473,100	1,302.00	2,910,621,000	1.14
10	武田薬品工業	医薬品	771,000	4,258.59	3,283,377,600	3,760.00	2,898,960,000	1.13
11	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	20,026	158,975.51	3,183,643,563	141,200.00	2,827,671,200	1.11
12	ソニー	電気機器	1,111,600	1,936.20	2,152,282,600	2,525.00	2,806,790,000	1.10
13	三菱商事	卸売業	1,545,600	1,221.12	1,887,366,000	1,788.00	2,763,532,800	1.08
14	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	11,643,000	219.54	2,556,192,300	226.00	2,631,318,000	1.03
15	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	2,944,800	581.67	1,712,928,710	814.00	2,397,067,200	0.94
16	東京海上ホールディングス	保険業	890,300	2,233.75	1,988,713,500	2,670.00	2,377,101,000	0.93
17	三菱地所	不動産業	1,448,000	1,268.22	1,836,382,560	1,611.00	2,332,728,000	0.91
18	東日本旅客鉄道	陸運業	390,600	6,349.58	2,480,148,500	5,810.00	2,269,386,000	0.89
19	新日本製鐵	鉄鋼	5,760,000	278.71	1,605,374,000	370.00	2,131,200,000	0.83
20	三井物産	卸売業	1,781,900	898.29	1,600,679,200	1,146.00	2,042,057,400	0.80
21	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	826,100	2,560.01	2,114,824,700	2,270.00	1,875,247,000	0.73
22	関西電力	電気・ガス業	870,000	2,356.21	2,049,908,200	2,130.00	1,853,100,000	0.72
23	ジェイ エフ イーホールディングス	鉄鋼	560,000	2,330.08	1,304,844,800	3,250.00	1,820,000,000	0.71
24	アステラス製薬	医薬品	492,100	3,380.34	1,663,468,300	3,420.00	1,682,982,000	0.66
25	KDDI	情報・通信業	3,211	569,736.36	1,829,423,480	512,000.00	1,644,032,000	0.64
26	富士フィルムホールディングス	化学	536,000	2,038.35	1,092,557,500	3,060.00	1,640,160,000	0.64
27	信越化学工業	化学	365,700	4,198.36	1,535,342,600	4,480.00	1,638,336,000	0.64
28	ソフトバンク	情報・通信業	844,400	1,323.42	1,117,501,400	1,882.00	1,589,160,800	0.62
29	中部電力	電気・ガス業	709,900	2,498.86	1,773,947,200	2,230.00	1,583,077,000	0.62
30	ファナック	電気機器	202,700	5,575.64	1,130,183,300	7,760.00	1,572,952,000	0.61
合計			57,283,937		78,337,753,813		87,373,186,600	34.15

(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	0.42
	建設業	2.15
	食料品	3.11
	繊維製品	0.94
	パルプ・紙	0.40
	化学	5.67
	医薬品	4.21
	石油・石炭製品	0.91
	ゴム製品	0.60
	ガラス・土石製品	1.18
	鉄鋼	2.74
	非鉄金属	1.24
	金属製品	0.68
	機械	4.35
	電気機器	12.90
	輸送用機器	9.22
	精密機器	1.33
	その他製品	2.37
	電気・ガス業	5.17
	陸運業	3.97
	海運業	0.59
	空運業	0.51
	倉庫・運輸関連業	0.26
	情報・通信業	5.68
	卸売業	4.53
	小売業	3.58
	銀行業	10.10
	証券、商品先物取引業	1.74
	保険業	2.38
	その他金融業	0.75
不動産業	2.52	
サービス業	1.59	
合計	97.87	

（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 T O P I X 先物取引	日本	592	5,531,752,725	5,473,040,000	2.14

（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。

（中央三井日本債券マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄

A．主要銘柄の明細

順位	銘柄名	利率 (%)	償還日	額面金額 (円)	簿価(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
1	利付国庫債券(10年)第288回	1.7	2017/9/20	3,100,000,000	104.44	3,237,741,000	104.36	3,235,253,000	1.26
2	利付国庫債券(5年)第81回	0.8	2014/3/20	3,200,000,000	100.03	3,201,052,000	100.54	3,217,504,000	1.25
3	利付国庫債券(10年)第269回	1.3	2015/3/20	2,640,000,000	102.41	2,703,803,200	102.73	2,712,098,400	1.05
4	利付国庫債券(10年)第298回	1.3	2018/12/20	2,700,000,000	100.26	2,707,067,000	99.95	2,698,839,000	1.05
5	利付国庫債券(5年)第63回	1.2	2012/3/20	2,600,000,000	102.23	2,658,163,000	102.17	2,656,498,000	1.03
6	利付国庫債券(5年)第60回	1.2	2011/9/20	2,600,000,000	102.02	2,652,732,000	101.92	2,650,050,000	1.03
7	利付国庫債券(10年)第289回	1.5	2017/12/20	2,500,000,000	103.04	2,576,186,000	102.62	2,565,500,000	1.00
8	利付国庫債券(5年)第64回	1.5	2012/6/20	2,200,000,000	103.14	2,269,112,000	103.14	2,269,234,000	0.88
9	利付国庫債券(10年)第296回	1.5	2018/9/20	2,000,000,000	102.50	2,050,100,000	101.98	2,039,620,000	0.79
10	利付国庫債券(5年)第70回	0.8	2013/3/20	2,000,000,000	100.84	2,016,985,000	100.94	2,018,920,000	0.78
11	利付国庫債券(5年)第50回	0.8	2010/9/20	2,000,000,000	100.76	2,015,220,000	100.72	2,014,560,000	0.78
12	利付国庫債券(10年)第286回	1.8	2017/6/20	1,800,000,000	106.11	1,909,980,000	105.31	1,895,724,000	0.74
13	利付国庫債券(10年)第285回	1.7	2017/3/20	1,800,000,000	105.28	1,895,194,000	104.67	1,884,132,000	0.73
14	利付国庫債券(10年)第234回	1.4	2011/9/20	1,840,000,000	102.59	1,887,674,400	102.34	1,883,111,200	0.73
15	利付国庫債券(10年)第284回	1.7	2016/12/20	1,750,000,000	105.72	1,850,200,000	104.82	1,834,455,000	0.71
16	利付国庫債券(2年)第281回	0.4	2011/6/15	1,800,000,000	100.15	1,802,790,000	100.20	1,803,654,000	0.70
17	利付国庫債券(10年)第299回	1.3	2019/3/20	1,800,000,000	99.14	1,784,616,000	99.65	1,793,808,000	0.70
18	利付国庫債券(10年)第283回	1.8	2016/9/20	1,600,000,000	106.31	1,701,064,000	105.70	1,691,264,000	0.66
19	利付国庫債券(5年)第62回	1.3	2011/12/20	1,600,000,000	102.38	1,638,103,000	102.29	1,636,752,000	0.64
20	利付国庫債券(5年)第61回	1.2	2011/12/20	1,600,000,000	102.17	1,634,776,000	102.05	1,632,848,000	0.63
21	利付国庫債券(10年)第240回	1.3	2012/6/20	1,570,000,000	102.70	1,612,452,800	102.56	1,610,207,700	0.63
22	利付国庫債券(2年)第278回	0.4	2011/3/15	1,600,000,000	100.00	1,600,099,000	100.21	1,603,504,000	0.62
23	利付国庫債券(5年)第67回	1.3	2012/9/20	1,500,000,000	102.80	1,542,135,000	102.62	1,539,435,000	0.60
24	利付国庫債券(5年)第59回	1.3	2011/6/20	1,500,000,000	102.01	1,530,260,000	101.95	1,529,280,000	0.59
25	利付国庫債券(10年)第300回	1.5	2019/3/20	1,500,000,000	100.16	1,502,430,000	101.54	1,523,235,000	0.59
26	利付国庫債券(2年)第276回	0.5	2011/1/15	1,500,000,000	100.36	1,505,523,000	100.39	1,505,970,000	0.59
27	利付国庫債券(10年)第232回	1.2	2011/6/20	1,420,000,000	101.93	1,447,448,600	101.76	1,445,091,400	0.56
28	利付国庫債券(10年)第253回	1.6	2013/9/20	1,350,000,000	104.37	1,409,103,000	104.13	1,405,795,500	0.55
29	利付国庫債券(2年)第279回	0.4	2011/4/15	1,400,000,000	100.03	1,400,554,000	100.21	1,402,968,000	0.55

30	利付国庫債券(10年)第2 92回	1.7	2018/3/20	1,300,000,000	104.76	1,361,958,000	104.10	1,353,404,000	0.53
合計				57,770,000,000		59,104,522,000		59,052,715,200	22.95

(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、種類は全て国債証券です。

## B. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	73.16
地方債証券	6.24
特殊債券	11.03
社債券	8.31
合計	98.73

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

### 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 (%)
債券先物取引 買建 長期国債先物	日本	10	1,371,654,700	1,381,000,000	0.54

(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。

## (中央三井外国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	国/地域	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	アメリカ	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	906,676	7,701.92	6,983,148,012	6,776.38	6,143,986,371	2.13
2	アメリカ	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・ サービス	1,468,991	1,884.67	2,768,572,522	2,290.79	3,365,162,526	1.17
3	アメリカ	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエ ンス	507,470	5,602.18	2,842,940,060	5,468.72	2,775,216,210	0.96
4	アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パー ソナル用品	537,815	5,168.21	2,779,545,325	5,014.60	2,696,928,335	0.93
5	イギリス	BP PLC	エネルギー	3,436,228	812.05	2,790,418,498	770.17	2,646,511,847	0.92
6	アメリカ	AT&T INC	電気通信サー ビス	1,081,352	2,497.22	2,700,373,949	2,421.37	2,618,355,671	0.91
7	イギリス	HSBC HLDGS PLC	銀行	3,156,562	740.75	2,338,227,571	815.64	2,574,644,270	0.89
8	アメリカ	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE	テクノロジー・ ハードウェアお よび機器	246,178	9,213.11	2,268,067,356	10,160.73	2,501,350,233	0.87
9	スイス	NESTLE SA-REGISTERD	食品・飲料・タ バコ	667,555	3,391.40	2,263,949,030	3,655.28	2,440,106,448	0.85
10	アメリカ	CHEVRON CORP	エネルギー	367,842	7,166.18	2,636,024,337	6,421.14	2,361,968,216	0.82

11	アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	684,887	2,632.59	1,803,029,543	3,321.94	2,275,157,630	0.79
12	アメリカ	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	163,400	9,541.91	1,559,149,620	13,630.53	2,227,230,186	0.77
13	アメリカ	GENERAL ELECTRIC	資本財	1,939,045	1,060.00	2,055,405,840	1,129.07	2,189,332,274	0.76
14	フランス	TOTAL SA	エネルギー	391,433	5,665.15	2,217,528,225	5,281.60	2,067,394,137	0.72
15	アメリカ	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	431,826	4,760.17	2,055,567,675	4,681.44	2,021,570,791	0.70
16	アメリカ	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	1,582,000	734.79	1,162,440,814	1,266.37	2,003,400,345	0.69
17	アメリカ	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,071,013	1,629.28	1,744,990,449	1,823.22	1,952,702,924	0.68
18	アメリカ	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	802,720	1,898.11	1,523,657,040	2,355.12	1,890,506,180	0.65
19	アメリカ	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,237,286	1,417.10	1,753,367,393	1,465.11	1,812,763,308	0.63
20	イギリス	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	9,627,572	220.16	2,119,656,314	187.61	1,806,315,815	0.63
21	アメリカ	GOOGLE INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	44,100	35,543.56	1,567,471,109	40,721.68	1,795,826,149	0.62
22	アメリカ	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	382,134	4,172.59	1,594,490,264	4,636.32	1,771,696,615	0.61
23	スペイン	BANCO SANTANDER SA	銀行	1,496,307	815.89	1,220,822,816	1,165.55	1,744,032,594	0.60
24	スペイン	TELEFONICA S.A.	電気通信サービス	776,953	1,996.35	1,551,075,482	2,202.36	1,711,132,151	0.59
25	スイス	ROCHE HLDGS AG GENUSSCHINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	128,908	12,865.47	1,658,463,295	13,238.64	1,706,567,894	0.59
26	アメリカ	HEWLETT-PACKARD CO	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	441,700	3,520.68	1,555,087,315	3,742.46	1,653,048,910	0.57
27	オーストラリア	BHP BILLITON LTD	素材	615,780	2,499.76	1,539,304,368	2,639.11	1,625,114,234	0.56
28	イギリス	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	951,875	1,999.03	1,902,832,582	1,703.08	1,621,128,317	0.56
29	アメリカ	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	1,020,565	1,409.42	1,438,411,662	1,572.64	1,604,985,219	0.56
30	イギリス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	650,565	2,774.40	1,804,927,926	2,450.53	1,594,231,911	0.55
合計						64,198,946,392		67,198,367,711	23.27

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

(注2) 種類は全て株式です。

#### B. 種類別及び業種別の投資比率

種類	業種	投資比率(%)
----	----	---------

株式	エネルギー	12.15
	素材	6.41
	資本財	6.58
	商業・専門サービス	0.71
	運輸	1.65
	自動車・自動車部品	1.01
	耐久消費財・アパレル	0.91
	消費者サービス	1.30
	メディア	2.20
	小売	2.28
	食品・生活必需品小売り	2.74
	食品・飲料・タバコ	6.16
	家庭用品・パーソナル用品	1.84
	ヘルスケア機器・サービス	2.72
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.18
	銀行	8.19
	各種金融	5.29
	保険	3.90
	不動産	0.72
	ソフトウェア・サービス	4.48
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.28
	電気通信サービス	4.63
	公益事業	4.73
	半導体・半導体製造装置	1.38
小計	95.45	
投資信託受益証券、投資証券	1.21	
合計	96.66	

（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

取引名	国/地域	資産名	種類	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
株価指数 先物取引	アメリカ	S&P 500 FUTU	買建	287	6,246,726,616	6,345,886,561	2.20
	ドイツ	DJ EURO STOXX	買建	604	1,949,536,435	1,990,838,118	0.69
	イギリス	FTSE 100 IDX	買建	192	1,301,386,924	1,303,990,617	0.45

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

（注2）株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算  
値段又は最終相場で評価しております。

（中央三井外国債券マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄

A. 主要銘柄の明細

順位	国/ 地域	銘柄名	利率 (%)	償還日	額面金額	簿価(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
						単価	金額	単価	金額	
1	ドイツ	DEUTSCHLAND REP	5.000	2011/7/4	23,690,000	14,642.66	3,468,846,438	14,503.06	3,435,776,169	0.75
2	ドイツ	DEUTSCHLAND REP	3.750	2015/1/4	24,060,000	14,331.61	3,448,187,735	14,274.01	3,434,329,115	0.75
3	アメリカ	US TREASURY N/B	3.625	2010/6/15	33,680,000	9,985.04	3,362,961,472	9,896.15	3,333,025,261	0.73
4	ドイツ	DEUTSCHLAND REP	5.000	2012/7/4	21,400,000	14,850.02	3,177,904,729	14,764.63	3,159,632,574	0.69
5	フランス	FRANCE O.A.T.	5.000	2011/10/25	21,650,000	14,635.88	3,168,669,037	14,581.67	3,156,932,139	0.69
6	アメリカ	US TREASURY N/B	4.625	2011/8/31	29,810,000	10,419.96	3,106,191,655	10,298.57	3,070,004,508	0.67
7	イタリア	BTPS	5.250	2011/8/1	20,670,000	14,428.52	2,982,375,869	14,484.09	2,993,861,630	0.65
8	アメリカ	US TREASURY N/B	5.125	2016/5/15	27,000,000	11,200.16	3,024,044,971	10,792.12	2,913,873,496	0.64
9	イタリア	BTPS	5.250	2017/8/1	19,200,000	14,607.42	2,804,625,292	14,820.20	2,845,479,456	0.62
10	アメリカ	US TREASURY N/B	5.000	2011/8/15	27,050,000	10,541.59	2,851,502,249	10,384.08	2,808,894,062	0.61
11	イギリス	TREASURY	5.000	2012/3/7	15,930,000	17,246.27	2,747,331,448	17,166.50	2,734,624,087	0.60
12	アメリカ	US TREASURY N/B	4.500	2011/9/30	26,420,000	10,408.08	2,749,815,809	10,294.07	2,719,693,871	0.59
13	アメリカ	US TREASURY N/B	5.000	2011/2/15	25,960,000	10,405.08	2,701,159,741	10,241.56	2,658,710,720	0.58
14	アメリカ	US TREASURY N/B	4.500	2017/5/15	25,530,000	10,721.61	2,737,228,747	10,384.08	2,651,056,022	0.58
15	アメリカ	US TREASURY N/B	4.500	2012/4/30	25,370,000	10,504.09	2,664,888,663	10,395.33	2,637,295,926	0.58
16	アメリカ	US TREASURY N/B	2.625	2016/2/29	27,900,000	9,827.52	2,741,879,083	9,327.97	2,602,504,065	0.57
17	イギリス	TREASURY	4.250	2032/6/7	16,320,000	15,484.95	2,527,144,231	15,897.36	2,594,449,690	0.57
18	アメリカ	US TREASURY N/B	4.750	2014/5/15	24,400,000	10,974.90	2,677,876,356	10,598.60	2,586,059,353	0.56
19	アメリカ	US TREASURY N/B	1.750	2011/11/15	26,480,000	9,707.57	2,570,564,827	9,706.76	2,570,350,329	0.56
20	アメリカ	US TREASURY N/B	4.375	2010/12/15	25,300,000	10,222.81	2,586,372,146	10,106.55	2,556,957,821	0.56
21	イギリス	TREASURY	4.500	2013/3/7	15,020,000	17,235.04	2,588,704,017	16,998.50	2,553,175,958	0.56
22	アメリカ	US TREASURY N/B	4.500	2011/11/30	24,300,000	10,441.08	2,537,184,262	10,342.82	2,513,307,036	0.55
23	アメリカ	US TREASURY N/B	1.500	2013/12/31	27,120,000	9,416.48	2,553,749,587	9,257.46	2,510,624,296	0.55
24	フランス	FRANCE O.A.T.	3.500	2015/4/25	17,920,000	13,871.49	2,485,771,993	13,947.39	2,499,372,700	0.55
25	フランス	BTAN-5YR ISSUE	3.500	2011/7/12	17,640,000	14,082.92	2,484,227,493	14,096.47	2,486,618,242	0.54
26	アメリカ	US TREASURY N/B	4.625	2017/2/15	23,500,000	10,804.12	2,538,969,448	10,468.09	2,460,001,223	0.54
27	アメリカ	US TREASURY N/B	4.750	2012/1/31	22,670,000	10,553.59	2,392,500,942	10,437.33	2,366,144,333	0.52
28	イタリア	BTPS	3.750	2015/8/1	17,160,000	13,580.10	2,330,346,189	13,772.55	2,363,371,055	0.52
29	イタリア	BTPS	4.250	2019/2/1	16,850,000	13,458.12	2,267,694,736	13,639.73	2,298,296,055	0.50

30	フランス	FRANCE O.A.T.	4.250	2017/10/25	16,010,000	14,165.59	2,267,911,855	14,244.20	2,280,496,900	0.50
合計							82,546,631,020		81,794,918,092	17.87

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

（注2）種類は全て国債証券です。

#### B. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	96.03
特殊債券	0.57
合計	96.59

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

#### 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

取引名	国/地域	資産名	種類	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	US 5YR NOTE	買建	67	738,017,860	738,952,966	0.16
	アメリカ	US 10YR NOTE	買建	52	578,637,753	581,394,580	0.13
	アメリカ	US LONG BOND	買建	39	435,922,890	443,944,239	0.10
	ドイツ	EURO-SCHATZ	買建	62	906,351,182	906,626,579	0.20
	ドイツ	EURO-BOBL FU	買建	69	1,075,205,705	1,079,919,303	0.24
	ドイツ	EURO-BUND FU	買建	122	1,980,912,985	2,003,174,059	0.44

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

（注2）債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

#### （3）【運用実績】

##### 【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20年6月10日現在）	1,309,148,844	9,162
第2期計算期間（平成21年6月10日現在）	935,358,682	7,309
平成20年6月末日	1,254,298,114	8,962
平成20年7月末日	1,261,286,571	8,975
平成20年8月末日	1,252,590,203	8,874
平成20年9月末日	1,108,592,010	8,004
平成20年10月末日	927,458,985	6,938

平成20年11月末日	892,083,273	6,716
平成20年12月末日	888,579,005	6,755
平成21年1月末日	834,267,302	6,354
平成21年2月末日	834,311,084	6,393
平成21年3月末日	859,631,262	6,575
平成21年4月末日	894,026,961	6,910
平成21年5月末日	915,800,428	7,145
平成21年6月末日	927,431,258	7,273

(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

#### 【収益率の推移】

	収益率
第1期計算期間	8.4%
第2期計算期間	20.2%

(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募集時の発行価額(1万口当たり10,000円)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19年10月31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」及び「中央三井日本債券マザーファンド」は平成13年1月23日に、また、「中央三井外国株式マザーファンド」及び「中央三井外国債券マザーファンド」は平成13年2月22日に、それぞれ設定され、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）申込みの受付

申込期間中において、毎営業日お申込みいただけます。

（注）お申込みの取扱いは、営業日の午後3時（本邦金融商品取引所が半日立会いの場合は午前11時）までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

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

##### （2）募集取扱いの単位

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」（ ）を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。）。

収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります（注）。

詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

販売会社の詳細につきましては、後記「2 換金（解約）手続等」に記載の照会先までお問い合わせください。

（注）平成21年9月11日現在で、「分配金受取りコース」を取扱う販売会社はありません。

##### （3）販売価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、下記（4）に記載する申込手数料及び当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額とします。

（注）分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の販売価額は、原則として、後記「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。

##### （4）申込の際に負担するコストの有無

申込手数料及び当該手数料に係る消費税等相当額をご負担いただきます。

申込手数料は、お申込価額（1）、お申込金額（2）、お申込口数等に応じて、3.15%（税抜（3）3.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を「お申込受付日の翌営業日の基準価額×取得口数」に乗じて得た額とします。

1：お申込受付日の翌営業日の基準価額に取得口数を乗じて得た額をいいます（以下同じ。）。

2：お申込価額に申込手数料及び申込手数料に係る消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加えた総額をいいます（以下同じ。）。

3：「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。

「分配金再投資コース」において収益分配金を再投資する場合については無手数料とします。

償還乗換えにより当ファンドの受益権をお求めいただく場合には、当該償還金額の範囲内(単位型証券投資信託にあつては、当該償還金額とその元本額のいずれか大きい額とします。)で取得する口数について申込手数料を優遇することがあります。(「償還乗換優遇制度」( ))

「償還乗換優遇制度」とは、取得申込日の属する月の前3ヶ月以内に償還となった証券投資信託の償還金(信託期間を延長した単位型証券投資信託及び延長前の信託終了日以降、収益分配金の再投資以外の追加信託を行わない追加型証券投資信託にあつては、延長前の信託終了日以降でかつ取得申込日の属する月の前3ヶ月以内における受益権の買取請求による売却代金及び一部解約金を含みます。)をもって、その支払いを行った販売会社で当ファンドの受益権をお求めいただく場合に申込手数料を優遇する制度等のことをいいます。なお、この際に、償還金の支払いを受けたことを証する書類をご提示いただくことがあります。

申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額はお申込金額の中から差引きます。

上記及びの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、後記「2 換金(解約)手続等」に記載の照会先までお問い合わせください。

#### (5) その他

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

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、自動けいぞく約款に従い分配金から税金を差引いた後に自動的に当ファンドの受益権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。

受益権取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、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、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3時(本邦金融商品取引所が半日立会いの場合は午前11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。

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

(4) 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.15%

の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額(以下「解約価額」といいます。)とします。

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

なお、受益者の手取額は、当該解約価額から税額を差引いた金額となります。

販売会社の詳細につきましては、以下の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

中央三井アセットマネジメント株式会社

・お客様相談窓口

電話：03-5440-0190

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

・ホームページ アドレス：<http://www.cmam.co.jp/>

- (5) 委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、上記(1)による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。
- (6) 上記(5)により一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記(4)の規定に準じて計算された価額とします。
- (7) 一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。
- (8) 解約に係る手数料については、徴収しません。

## 第3【管理及び運営】

### 1【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額

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

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出され、日々の基準価額は、販売会社へお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします（販売会社の詳細につきましては、前記「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「4分散」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、中央三井日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンド及び中央三井外国債券マザーファンド）

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

#### B．株式、投資信託受益証券及び投資証券

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、時価で評価します。

#### C．国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

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、時価で評価します。

ただし、買付後の最初の利払いまでは個別法によります。

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

当ファンドの信託期間は、信託契約締結日（平成19年10月31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には、この信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

#### (4)【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年6月11日から翌年6月10日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成19年10月31日から平成20年6月10日までとし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

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

#### (5)【その他】

##### 信託の終了

この信託契約を解約し信託を終了させる場合は下記のとおりです。

#### A．委託会社の所定の手続きを経て信託を終了させる場合

##### イ．受益権の口数が10億口を下回った場合

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10億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。

##### 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。

#### 八．所定の手続き

- a．委託会社は、上記イ．及びロ．の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b．委託会社は、上記イ．及びロ．の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c．上記b．の書面決議において、受益者(委託会社及び当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下c．において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d．上記b．の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e．上記b．からd．までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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．からd．までの手続き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．に該当する場合には、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

#### D．受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い

- イ．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。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。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- 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。

#### 信託約款の変更等

- 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又は当ファンドと他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更又は併合しようとする旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は に定める以外の方法によって変更することができないものとし、
- B. 委託会社は、上記A. の事項（上記A. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款の変更等の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- C. 上記B. の書面決議において、受益者（委託会社及び当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下C. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- D. 上記B. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- E. 書面決議の効力は、当ファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。
- F. 上記B. からE. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- G. 上記A. からF. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### 反対者の買取請求権

信託契約の解約又は重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約又は重大な約款の変更等に反対した受益者は、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べき旨を請求することができます。この買取請求権の内容及び買取請求の手續きに関する事項は、上記

A. 八. b. 又は B. に規定する書面に付記します。

#### 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. 信託業務の委託等

イ. 受託会社は、委託会社と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準の全てに適合するもの（受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下、下記八. 及び において同じ。）を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

ロ. 受託会社は、上記イ. に定める委託先の選定に当たっては、当該委託先が上記イ. 1. から4. までに掲げる基準に適合していることを確認するものとし、

八. 上記イ. 及びロ. にかかわらず、受託会社は、次の1. から4. までに掲げる業務を、受託会社及び委託会社が適当と認める者（受託会社の利害関係人を含みます。）に委託することができる

ものとし、

1. 信託財産の保存に係る業務
2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用又は改良を目的とする業務
3. 委託会社のみの方針により信託財産の処分及びその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
4. 受託会社が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

#### B. 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B.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、

#### C. 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、ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

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

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、ただし、受託会社が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

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

#### 運用報告書

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

#### 関係法人との契約の更改等に関する手続き、変更した場合の開示方法

A. 委託会社が販売会社と締結している「投資信託受益権の取扱に関する契約」の有効期間は、有効期間満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

B. 上記A. の契約を変更した場合には、有価証券報告書等においてその内容を開示します。

#### 信託事務処理の再委託

A. 受託会社は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託会社の利害関係人を含みます。）と信託契約を締結し、これを再委託することができます。

B. 上記A. における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとし、

C. 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、受託会社の利害関係人である日本トラスティ・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、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（原則として計算期間終了日から起算して5営業日までの日）から、毎計算期間終了日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に対する支払いを開始します。

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受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者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。

上記に規定する収益分配金の支払いは、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、収益分配金については上記に規定する支払開始日から5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。

## （2）償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

## （3）一部解約請求権

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

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

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。

## （7）他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

当ファンドの受益者は、委託会社又は受託会社に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名又は名称及び住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容



## 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1期計算期間（平成19年10月31日から平成20年6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1期計算期間（平成19年10月31日から平成20年6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2期計算期間（平成20年6月11日から平成21年6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】  
 新生・4分散ファンド  
 (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (平成20年6月10日現在)	第2期 (平成21年6月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,310,601,775	939,674,980
未収入金	368,023	144,611
流動資産合計	1,310,969,798	939,819,591
資産合計	1,310,969,798	939,819,591
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	368,023	144,611
未払受託者報酬	92,251	274,060
未払委託者報酬	1,353,007	4,019,464
その他未払費用	7,673	22,774
流動負債合計	1,820,954	4,460,909
負債合計	1,820,954	4,460,909
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,428,855,625	1,279,743,399
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	119,706,781	344,384,717
純資産合計	1,309,148,844	935,358,682
負債純資産合計	1,310,969,798	939,819,591

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 (自平成19年10月31日 至平成20年6月10日)	第2期 (自平成20年6月11日 至平成21年6月10日)
<b>営業収益</b>		
受取利息	9,018	6
有価証券売買等損益	70,740,920	251,741,987
営業収益合計	70,731,902	251,741,981
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	452,588	626,494
委託者報酬	6,637,859	9,188,433
その他費用	37,647	52,082
営業費用合計	7,128,094	9,867,009
営業損失( )	77,859,996	261,608,990
経常損失( )	77,859,996	261,608,990
当期純損失( )	77,859,996	261,608,990
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	6,096,305	32,640,837
期首剰余金又は期首欠損金( )	-	119,706,781
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,532,536	19,102,980
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,532,536	19,102,980
剰余金減少額又は欠損金増加額	50,475,626	14,812,763
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	50,475,626	14,812,763
期末剰余金又は期末欠損金( )	119,706,781	344,384,717

## ( 3 ) 【注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

	第 1 期 自 平成19年10月31日 至 平成20年 6 月10日	第 2 期 自 平成20年 6 月11日 至 平成21年 6 月10日
1 . 有価証券の評価基準及び 評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、法令及 び社団法人投資信託協会規則 に従い、基準価額で評価して おります。	親投資信託受益証券 同左
2 . その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原 則として、毎年 6 月11日から翌 年 6 月10日までとなっております が、第 1 期計算期間は信託 約款の定めにより、平成19年10 月31日から平成20年 6 月10日 までとなっております。	

( 貸借対照表に関する注記 )

	第 1 期 ( 平成20年 6 月10日現在 )	第 2 期 ( 平成21年 6 月10日現在 )
1 . 当該計算期間の末日にお ける受益権総数	1,428,855,625 口	1,279,743,399 口
2 . 「投資信託財産の計算に 関する規則（平成12年総理 府令第133号）」第55条の 6 第10号に規定する額	元本の欠損 119,706,781 円	元本の欠損 344,384,717 円
3 . 1 口当たり純資産額 ( 1 万口当たり純資産額 )	0.9162 円 ( 9,162 円 )	0.7309 円 ( 7,309 円 )

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

	第 1 期 自 平成19年10月31日 至 平成20年 6 月10日

1. 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益 (11,951,690円)(親投資信託の信託財産に属する配当等収益のうち、当ファンドに帰属すべき金額19,070,766円を含みます。)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(1,775,276円)より分配対象収益は、13,726,966円(1万口当たり96.06円)であります。長期的な信託財産の成長に資するため、分配を行っておりません。</p>
-------------	---

## 1. 分配金の計算過程

		第 2 期 自 平成20年 6 月11日 至 平成21年 6 月10日
費用控除後の配当等収益額	A	15,594,291 円 (25,461,294 円)
費用控除後・繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益額	B	円
収益調整金額	C	2,273,270 円
分配準備積立金額	D	10,306,497 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	28,174,058 円
当ファンドの期末残存口数	F	1,279,743,399 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	220.15 円
10,000口当たり分配金額	H	円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	円

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

	第 1 期 自 平成19年10月31日 至 平成20年 6 月10日	第 2 期 自 平成20年 6 月11日 至 平成21年 6 月10日
2. 剰余金増加額・減少額及び欠損金減少額・増加額	「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ剰余金減少額と増加額との純額を表示しております。	「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ欠損金増加額と減少額との純額を表示しております。

(関連当事者との取引に関する注記)

第 1 期 自 平成19年10月31日 至 平成20年 6 月10日	第 2 期 自 平成20年 6 月11日 至 平成21年 6 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 1 期 自 平成19年10月31日 至 平成20年 6 月10日	第 2 期 自 平成20年 6 月11日 至 平成21年 6 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 1 期 自 平成19年10月31日 至 平成20年 6 月10日	第 2 期 自 平成20年 6 月11日 至 平成21年 6 月10日
期首元本額	475,020,555 円	1,428,855,625 円
期中追加設定元本額	1,040,544,685 円	71,959,034 円
期中一部解約元本額	86,709,615 円	221,071,260 円

## 2. 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第 1 期 (平成20年 6 月10日現在)		第 2 期 (平成21年 6 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10月31日 至 平成20年 6 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 6 月11日 至 平成21年 6 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	1,310,601,775	63,070,602	939,674,980	195,811,180
合計	1,310,601,775	63,070,602	939,674,980	195,811,180

## 3. デリバティブ取引関係

第 1 期(自 平成19年10月31日 至 平成20年 6 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 2 期(自 平成20年 6 月11日 至 平成21年 6 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	299,806,641	241,344,346	
	中央三井日本債券マザーファンド	205,307,644	230,067,745	
	中央三井外国株式マザーファンド	281,038,513	238,039,620	
	中央三井外国債券マザーファンド	139,740,983	230,223,269	
合計		925,893,781	939,674,980	

## 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;

「新生・4分散ファンド」は、「中央三井日本株式マザーファンド」、「中央三井日本債券マザーファンド」、「中央三井外国株式マザーファンド」及び「中央三井外国債券マザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。

各マザーファンドの平成21年6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6月10日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,968,082,512
株式	251,436,315,500
派生商品評価勘定	634,406,100
未収配当金	1,904,976,763
未収利息	10,656
流動資産合計	257,943,791,531
資産合計	257,943,791,531
負債の部	
流動負債	
前受金	511,800,000
未払解約金	69,005,675
流動負債合計	580,805,675
負債合計	580,805,675
純資産の部	
元本等	
元本	319,696,672,699
剰余金	
欠損金	62,333,686,843
純資産合計	257,362,985,856
負債・純資産合計	257,943,791,531

## (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 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	株価指数先物取引 個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。 (2) 派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

	平成21年 6月10日現在
1. 担保に供している資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。  株式 3,410,000,000 円  なお、上記の金額には、約定未受渡株式を含んでおります。
2. 計算日における受益権総数	319,696,672,699 口
3. 「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 62,333,686,843 円
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8050 円 ( 8,050 円)

## (関連当事者との取引に関する注記)

平成21年 6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 6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 6月10日現在	
計算期間の期首元本額	247,569,994,601 円
計算期間中の追加設定元本額	102,529,632,931 円
計算期間中の一部解約元本額	30,402,954,833 円
計算日の元本額	319,696,672,699 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	2,478,527,960 円
中央三井DC日本株式インデックスファンド	286,206,409 円
中央三井DC日本株式インデックスファンドL	33,380,053,919 円
中央三井DC日本株式インデックスファンドA	1,576,613,808 円
中央三井DCバランスファンド30	161,198,747 円
中央三井DCバランスファンド50	402,064,264 円
中央三井DCバランスファンド70	251,909,471 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	441,739,276 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	261,136,542 円
新生・4分散ファンド	299,806,641 円
ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド	551,658,461 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	150,180,075 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	294,428,614 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)	43,111,898,545 円
中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)	8,772,155,778 円
中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)	60,453,702,364 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)	46,860,169,753 円
中央三井VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	6,893,275,201 円
中央三井VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	1,073,909,425 円
中央三井VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	8,157,829,057 円
中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)	7,321,712,009 円
中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,776,382,329 円
中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)	44,488,495,987 円
中央三井バランスVA75(適格機関投資家専用)	2,682,275,424 円
中央三井VL株式30(適格機関投資家専用)	15,331,154 円
中央三井VL株式50(適格機関投資家専用)	23,532,034 円
中央三井VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	20,541,240,363 円
中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	7,229,277,688 円
中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	264,584,956 円
中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)	4,159,314,341 円
中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	3,117,908,825 円
CMAM・バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	6,022,246,498 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)	416,842,037 円
CMAM私募日本株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,156,910,124 円
CMAM・VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	183,934,281 円
中央三井バランスVA20(適格機関投資家専用)	1,438,220,339 円

## 2. 有価証券関係

### 売買目的有価証券

平成21年6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	251,436,315,500	37,798,410,720
合計	251,436,315,500	37,798,410,720

(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6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6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6月10日現在			
		契約額等（円）		時価 （円）	評価損益 （円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,324,913,900		5,959,320,000	634,406,100
	合計	5,324,913,900		5,959,320,000	634,406,100

（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6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	100,000	201	20,100,000	
日本水産	270,700	267	72,276,900	
マルハニチロホールディングス	431,000	147	63,357,000	
サカタのタネ	43,200	1,328	57,369,600	
ホクト	21,800	1,956	42,640,800	
日鉄鉱業	60,000	432	25,920,000	
三井松島産業	77,000	153	11,781,000	
国際石油開発帝石	1,075	833,000	895,475,000	
関東天然瓦斯開発	31,000	609	18,879,000	
石油資源開発	33,500	5,600	187,600,000	
ショーボンドホールディングス	22,100	1,833	40,509,300	
ダイセキ環境ソリューション	25	194,700	4,867,500	
東急建設	98,970	308	30,482,760	
コムシスホールディングス	117,000	1,027	120,159,000	
高松コンストラクショングループ	20,900	1,398	29,218,200	
東建コーポレーション	10,780	2,685	28,944,300	
大成建設	1,040,000	231	240,240,000	
大林組	658,000	431	283,598,000	
清水建設	667,000	411	274,137,000	
松井建設	37,000	378	13,986,000	
鹿島建設	964,000	293	282,452,000	
太平工業	38,000	310	11,780,000	
前田建設工業	157,000	364	57,148,000	
奥村組	234,000	368	86,112,000	
大和小田急建設	32,500	226	7,345,000	
東鉄工業	33,000	523	17,259,000	
戸田建設	265,000	385	102,025,000	
青木あすなろ建設	27,000	405	10,935,000	
北野建設	69,000	235	16,215,000	
三井ホーム	40,000	505	20,200,000	
矢作建設工業	37,000	623	23,051,000	
ピーエス三菱	23,200	467	10,834,400	
大東建託	103,900	4,440	461,316,000	
NIPPOコーポレーション	50,000	889	44,450,000	
前田道路	70,000	903	63,210,000	
日本道路	85,000	273	23,205,000	
五洋建設	289,500	142	41,109,000	
大成ロテック	55,000	160	8,800,000	
大林道路	41,000	179	7,339,000	
住友林業	161,700	665	107,530,500	
日本基礎技術	40,200	213	8,562,600	
巴コーポレーション	41,800	265	11,077,000	
パナホーム	96,000	514	49,344,000	
大和ハウス工業	586,000	903	529,158,000	
ライト工業	58,200	242	14,084,400	
積水ハウス	661,000	926	612,086,000	
北陸電気工事	20,000	294	5,880,000	
コミュニチュア	24,000	657	15,768,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ユアテック	41,000	484	19,844,000	
西部電気工業	25,000	410	10,250,000	
四電工	25,000	482	12,050,000	
中電工	35,500	1,452	51,546,000	
関電工	110,000	698	76,780,000	
大明	35,000	857	29,995,000	
きんでん	139,000	799	111,061,000	
東京エネシス	27,000	803	21,681,000	
トーエネック	37,000	487	18,019,000	
住友電設	23,100	483	11,157,300	
日本電設工業	49,000	1,012	49,588,000	
協和エクシオ	87,000	911	79,257,000	
新日本空調	20,900	712	14,880,800	
東電通	47,000	177	8,319,000	
日本電話施設	47,000	287	13,489,000	
九電工	47,000	635	29,845,000	
三機工業	59,000	727	42,893,000	
日揮	236,000	1,595	376,420,000	
中外炉工業	81,000	282	22,842,000	
ヤマト	29,000	339	9,831,000	
太平電業	35,000	932	32,620,000	
高砂熱学工業	70,000	790	55,300,000	
日立プラントテクノロジー	64,000	491	31,424,000	
三晃金属工業	32,000	367	11,744,000	
N E C ネットエスアイ	21,700	1,106	24,000,200	
朝日工業社	33,000	326	10,758,000	
大気社	35,400	1,056	37,382,400	
ダイダン	37,000	450	16,650,000	
日比谷総合設備	35,000	834	29,190,000	
東芝プラントシステム	38,000	1,056	40,128,000	
東洋エンジニアリング	138,000	355	48,990,000	
千代田化工建設	186,000	822	152,892,000	
新興プランテック	39,200	837	32,810,400	
日本製粉	148,000	430	63,640,000	
日清製粉グループ本社	213,000	1,097	233,661,000	
日東富士製粉	19,000	289	5,491,000	
昭和産業	106,000	291	30,846,000	
鳥越製粉	20,500	725	14,862,500	
日本農産工業	61,000	246	15,006,000	
協同飼料	82,000	125	10,250,000	
中部飼料	23,000	658	15,134,000	
日本配合飼料	66,000	128	8,448,000	
ユニ・チャーム ペットケア	13,400	2,755	36,917,000	
東洋精糖	40,000	115	4,600,000	
日本甜菜製糖	130,000	228	29,640,000	
三井製糖	93,000	304	28,272,000	
森永製菓	247,000	201	49,647,000	
中村屋	55,000	465	25,575,000	
江崎グリコ	85,000	916	77,860,000	
名糖産業	9,500	1,400	13,300,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
不二家	128,000	137	17,536,000	
山崎製パン	158,000	1,011	159,738,000	
第一屋製パン	32,000	123	3,936,000	
モロゾフ	36,000	307	11,052,000	
雪印乳業	257,500	287	73,902,500	
森永乳業	199,000	333	66,267,000	
ヤクルト本社	126,000	1,919	241,794,000	
明治ホールディングス	67,300	3,380	227,474,000	
プリマハム	132,000	119	15,708,000	
日本ハム	178,000	1,181	210,218,000	
伊藤ハム	178,000	356	63,368,000	
丸大食品	95,000	251	23,845,000	
米久	22,500	975	21,937,500	
S Foods	12,500	741	9,262,500	
サッポロホールディングス	333,000	426	141,858,000	
アサヒビール	440,700	1,330	586,131,000	
キリンホールディングス	961,000	1,231	1,182,991,000	
宝ホールディングス	198,000	550	108,900,000	
オエノンホールディングス	65,000	222	14,430,000	
メルシャン	70,000	189	13,230,000	
養命酒製造	18,000	920	16,560,000	
三国コカ・コーラボトリング	31,500	770	24,255,000	
四国コカ・コーラボトリング	11,000	852	9,372,000	
コカ・コーラウエスト	72,300	1,658	119,873,400	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	26,400	1,315	34,716,000	
ダイトードリンコ	10,800	2,590	27,972,000	
伊藤園	65,400	1,325	86,655,000	
キーコーヒー	19,100	1,599	30,540,900	
ユニカフェ	5,500	993	5,461,500	
ジャパンフーズ	3,100	785	2,433,500	
日清オイリオグループ	102,000	478	48,756,000	
不二製油	62,800	1,072	67,321,600	
J-オイルミルズ	88,000	330	29,040,000	
キッコーマン	205,000	955	195,775,000	
味の素	638,000	741	472,758,000	
キュービー	121,400	967	117,393,800	
ハウス食品	86,600	1,422	123,145,200	
カゴメ	90,800	1,518	137,834,400	
焼津水産化学工業	12,000	998	11,976,000	
アリアケジャパン	19,300	1,429	27,579,700	
ニチレイ	263,000	363	95,469,000	
東洋水産	94,000	2,095	196,930,000	
日清食品ホールディングス	74,700	3,010	224,847,000	
永谷園	21,000	864	18,144,000	
フジッコ	25,000	1,112	27,800,000	
ロック・フィールド	11,400	1,201	13,691,400	
日本たばこ産業	5,208	294,300	1,532,714,400	
わらべや日洋	12,000	1,160	13,920,000	
なとり	10,200	776	7,915,200	
ミヨシ油脂	76,000	149	11,324,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
片倉工業	25,200	810	20,412,000	
グンゼ	154,000	367	56,518,000	
川島織物セルコン	79,000	100	7,900,000	
東洋紡績	728,000	154	112,112,000	
ユニチカ	502,000	95	47,690,000	
富士紡ホールディングス	98,000	108	10,584,000	
日清紡ホールディングス	156,000	988	154,128,000	
倉敷紡績	229,000	176	40,304,000	
大和紡績	156,000	290	45,240,000	
シキボウ	147,000	153	22,491,000	
日本毛織	83,000	580	48,140,000	
トーア紡コーポレーション	89,000	78	6,942,000	
ダイドーリミテッド	30,600	525	16,065,000	
御幸ホールディングス	24,000	304	7,296,000	
帝国繊維	25,000	437	10,925,000	
帝人	897,000	265	237,705,000	
東レ	1,460,000	499	728,540,000	
三菱レイヨン	547,000	264	144,408,000	
サカイオーバックス	69,000	104	7,176,000	
住江織物	55,000	132	7,260,000	
日本フェルト	16,800	405	6,804,000	
イチカワ	21,000	228	4,788,000	
日本バイリーン	30,000	441	13,230,000	
日東製網	33,000	110	3,630,000	
芦森工業	52,000	157	8,164,000	
アツギ	208,000	143	29,744,000	
ダイニツク	44,000	152	6,688,000	
セーレン	54,800	455	24,934,000	
東海染工	39,000	99	3,861,000	
小松精練	38,000	379	14,402,000	
ワコールホールディングス	131,000	1,198	156,938,000	
ホギメディカル	10,600	5,000	53,000,000	
サンエー・インターナショナル	11,400	836	9,530,400	
クラウディア	2,900	1,128	3,271,200	
三陽商会	104,000	332	34,528,000	
オンワードホールディングス	146,000	575	83,950,000	
シルバーオックス	33,000	104	3,432,000	
ルック	40,000	109	4,360,000	
ゴールドウイン	55,000	262	14,410,000	
東京スタイル	74,000	754	55,796,000	
デサント	62,000	420	26,040,000	
ヤマトインターナショナル	16,000	385	6,160,000	
特種東海ホールディングス	155,000	268	41,540,000	
王子製紙	901,000	418	376,618,000	
三菱製紙	323,000	149	48,127,000	
北越製紙	128,500	460	59,110,000	
中越パルプ工業	90,000	247	22,230,000	
大王製紙	94,000	849	79,806,000	
紀州製紙	81,000	91	7,371,000	
日本製紙グループ本社	102,300	2,615	267,514,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
レンゴー	172,000	540	92,880,000	
トーモク	79,000	189	14,931,000	
ザ・パック	15,300	1,469	22,475,700	
クラレ	324,000	1,002	324,648,000	
旭化成	1,370,000	456	624,720,000	
共和レザー	12,900	406	5,237,400	
コープケミカル	32,000	199	6,368,000	
昭和電工	1,138,000	161	183,218,000	
住友化学	1,616,000	448	723,968,000	
日本化成	44,000	180	7,920,000	
住友精化	43,000	364	15,652,000	
日産化学工業	149,000	1,043	155,407,000	
ラサ工業	92,000	134	12,328,000	
クレハ	143,000	449	64,207,000	
テイカ	39,000	261	10,179,000	
片倉チッカリン	18,000	336	6,048,000	
日本曹達	132,000	435	57,420,000	
東ソー	587,000	303	177,861,000	
トクヤマ	269,000	729	196,101,000	
セントラル硝子	224,000	378	84,672,000	
東亜合成	243,000	254	61,722,000	
ダイソー	90,000	219	19,710,000	
関東電化工業	50,000	448	22,400,000	
電気化学工業	461,000	262	120,782,000	
信越化学工業	365,700	4,720	1,726,104,000	
日本カーバイド工業	54,000	109	5,886,000	
堺化学工業	77,000	425	32,725,000	
エア・ウォーター	157,000	1,033	162,181,000	
大陽日酸	341,000	875	298,375,000	
日本化学工業	78,000	240	18,720,000	
日本パーカライズン	52,000	942	48,984,000	
高圧ガス工業	34,000	483	16,422,000	
チタン工業	30,000	244	7,320,000	
四国化成工業	33,000	445	14,685,000	
戸田工業	36,000	388	13,968,000	
ステラ ケミファ	10,600	3,540	37,524,000	
保土谷化学工業	57,000	210	11,970,000	
日本触媒	146,000	775	113,150,000	
大日精化工業	81,000	264	21,384,000	
カネカ	273,000	674	184,002,000	
三菱瓦斯化学	378,000	560	211,680,000	
三井化学	670,000	337	225,790,000	
J S R	199,900	1,488	297,451,200	
東京応化工業	42,600	1,829	77,915,400	
三菱ケミカルホールディングス	1,274,500	435	554,407,500	
日本合成化学工業	59,000	452	26,668,000	
ダイセル化学工業	285,000	539	153,615,000	
住友ベークライト	223,000	460	102,580,000	
積水化学工業	492,000	590	290,280,000	
日本ゼオン	190,000	395	75,050,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
アイカ工業	73,100	922	67,398,200	
宇部興産	920,000	242	222,640,000	
積水樹脂	35,000	796	27,860,000	
タキロン	52,000	282	14,664,000	
旭有機材工業	78,000	256	19,968,000	
日立化成工業	94,900	1,493	141,685,700	
ニチバン	24,000	290	6,960,000	
リケンテクノス	42,000	191	8,022,000	
大倉工業	53,000	253	13,409,000	
積水化成成品工業	59,000	293	17,287,000	
群栄化学工業	61,000	210	12,810,000	
タイガースポリマー	11,400	395	4,503,000	
日本カーリット	18,900	438	8,278,200	
日本化薬	154,000	594	91,476,000	
日本精化	27,800	532	14,789,600	
A D E K A	95,200	870	82,824,000	
日油	193,000	380	73,340,000	
ハリマ化成	20,000	396	7,920,000	
花王	563,000	2,095	1,179,485,000	
第一工業製薬	39,000	249	9,711,000	
三洋化成工業	70,000	480	33,600,000	
大日本塗料	131,000	111	14,541,000	
日本ペイント	243,000	462	112,266,000	
関西ペイント	248,000	636	157,728,000	
中国塗料	64,000	651	41,664,000	
日本特殊塗料	17,100	330	5,643,000	
藤倉化成	26,800	518	13,882,400	
太陽インキ製造	16,400	2,180	35,752,000	
D I C	723,000	155	112,065,000	
サカタインクス	47,000	323	15,181,000	
東洋インキ製造	219,000	303	66,357,000	
富士フイルムホールディングス	536,000	2,820	1,511,520,000	
資生堂	374,000	1,645	615,230,000	
ライオン	253,000	445	112,585,000	
高砂香料工業	80,000	539	43,120,000	
マンダム	22,000	2,195	48,290,000	
ミルボン	9,000	2,085	18,765,000	
ファンケル	38,200	1,126	43,013,200	
コーセー	35,500	2,035	72,242,500	
ドクターシーラボ	146	152,500	22,265,000	
エステー	15,400	985	15,169,000	
コニシ	17,900	808	14,463,200	
長谷川香料	28,300	1,069	30,252,700	
小林製薬	30,400	3,680	111,872,000	
荒川化学工業	19,100	1,016	19,405,600	
メック	15,900	530	8,427,000	
日本高純度化学	59	292,000	17,228,000	
荏原ユーザライト	2,700	1,613	4,355,100	
アース製薬	17,000	2,590	44,030,000	
イハラケミカル工業	42,000	372	15,624,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
北興化学工業	25,000	321	8,025,000	
大成ラミック	6,600	2,045	13,497,000	
クミアイ化学工業	58,000	448	25,984,000	
日本農薬	50,000	877	43,850,000	
アキレス	184,000	158	29,072,000	
有沢製作所	30,000	575	17,250,000	
日東電工	192,300	2,875	552,862,500	
スルガ	5,600	1,128	6,316,800	
アロン化成	31,000	307	9,517,000	
きもと	19,700	510	10,047,000	
藤森工業	14,700	886	13,024,200	
前澤化成工業	20,000	960	19,200,000	
J S P	15,900	700	11,130,000	
エフピコ	11,000	4,280	47,080,000	
天馬	16,600	1,085	18,011,000	
信越ポリマー	43,200	535	23,112,000	
東リ	81,000	193	15,633,000	
ニフコ	45,500	1,305	59,377,500	
日本バルカー工業	86,000	227	19,522,000	
ユニ・チャーム	44,900	6,540	293,646,000	
協和発酵キリン	300,000	1,047	314,100,000	
武田薬品工業	771,000	3,780	2,914,380,000	代用有価証券で 200,000株 担保差 入
アステラス製薬	492,100	3,240	1,594,404,000	
大日本住友製薬	155,400	773	120,124,200	
塩野義製薬	320,000	1,857	594,240,000	
田辺三菱製薬	219,000	1,052	230,388,000	
わかもと製薬	25,000	380	9,500,000	
あすか製薬	24,000	823	19,752,000	
日本新薬	55,000	1,128	62,040,000	
中外製薬	291,500	1,755	511,582,500	
科研製薬	93,000	857	79,701,000	
エーザイ	270,300	3,300	891,990,000	
ロート製薬	100,000	995	99,500,000	
小野薬品工業	110,100	4,320	475,632,000	
久光製薬	68,100	3,040	207,024,000	
有機合成薬品工業	19,000	302	5,738,000	
持田製薬	90,000	897	80,730,000	
大正製薬	209,000	1,789	373,901,000	
参天製薬	67,900	2,900	196,910,000	
エスエス製薬	56,000	501	28,056,000	
扶桑薬品工業	74,000	304	22,496,000	
日本ケミファ	35,000	274	9,590,000	
ツムラ	64,500	3,030	195,435,000	
キッセイ薬品工業	44,000	2,270	99,880,000	
生化学工業	41,900	1,025	42,947,500	
栄研化学	14,200	742	10,536,400	
日水製薬	8,800	781	6,872,800	
鳥居薬品	13,100	1,502	19,676,200	
東和薬品	8,900	4,460	39,694,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
沢井製薬	14,300	5,160	73,788,000	
ゼリア新薬工業	31,000	1,080	33,480,000	
第一三共	646,100	1,729	1,117,106,900	
キョーリン	54,000	1,388	74,952,000	
新日本石油	1,525,000	607	925,675,000	
昭和シェル石油	171,700	969	166,377,300	
コスモ石油	607,000	352	213,664,000	
ニチレキ	34,000	355	12,070,000	
東燃ゼネラル石油	331,000	1,022	338,282,000	
ユシロ化学工業	12,500	1,095	13,687,500	
ピーピー・カストロール	13,600	309	4,202,400	
新日鉱ホールディングス	906,500	578	523,957,000	
AOCホールディングス	53,300	1,051	56,018,300	
出光興産	26,000	8,880	230,880,000	
横浜ゴム	268,000	428	114,704,000	
東洋ゴム工業	224,000	236	52,864,000	
ブリヂストン	688,100	1,402	964,716,200	
住友ゴム工業	188,300	706	132,939,800	
藤倉ゴム工業	14,500	342	4,959,000	
オカモト	91,000	344	31,304,000	
フコク	10,500	485	5,092,500	
ニッタ	19,800	1,457	28,848,600	
東海ゴム工業	40,800	968	39,494,400	
三ツ星ベルト	67,000	420	28,140,000	
パンドー化学	80,000	244	19,520,000	
日東紡績	211,000	173	36,503,000	
旭硝子	1,081,000	768	830,208,000	
日本板硝子	697,000	307	213,979,000	
石塚硝子	35,000	208	7,280,000	
日本山村硝子	103,000	233	23,999,000	
日本電気硝子	356,000	999	355,644,000	
オハラ	10,100	1,413	14,271,300	
住友大阪セメント	418,000	214	89,452,000	
太平洋セメント	866,000	182	157,612,000	
デイ・シイ	22,300	314	7,002,200	
日本ヒューム	25,000	294	7,350,000	
日本コンクリート工業	51,000	162	8,262,000	
東海カーボン	190,000	486	92,340,000	
日本カーボン	109,000	279	30,411,000	
東洋炭素	9,500	4,160	39,520,000	
ノリタケカンパニーリミテド	114,000	332	37,848,000	
TOTO	339,000	618	209,502,000	
日本碍子	264,000	1,786	471,504,000	
日本特殊陶業	194,000	882	171,108,000	
MARUWA	6,700	1,550	10,385,000	
品川白煉瓦	61,000	233	14,213,000	
黒崎播磨	55,000	211	11,605,000	
東京窯業	32,000	226	7,232,000	
ニッカトー	10,700	418	4,472,600	
フジインコーポレーテッド	22,200	1,543	34,254,600	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ニチアス	124,000	288	35,712,000	
ニチハ	31,900	646	20,607,400	
新日本製鐵	5,760,000	372	2,142,720,000	
住友金属工業	3,754,000	275	1,032,350,000	
神戸製鋼所	3,042,000	184	559,728,000	
日新製鋼	842,000	259	218,078,000	
中山製鋼所	128,000	235	30,080,000	
合同製鐵	141,000	312	43,992,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	560,000	3,230	1,808,800,000	
東京製鐵	90,800	1,237	112,319,600	
共英製鋼	18,500	2,700	49,950,000	
大和工業	51,500	2,675	137,762,500	
東京鐵鋼	49,000	389	19,061,000	
大阪製鐵	14,900	1,757	26,179,300	
淀川製鋼所	172,000	537	92,364,000	
東洋鋼鈹	51,000	478	24,378,000	
住友鋼管	18,900	531	10,035,900	
丸一鋼管	61,200	1,935	118,422,000	
モリ工業	47,000	224	10,528,000	
大同特殊鋼	339,000	450	152,550,000	
日本高周波鋼業	106,000	112	11,872,000	
日本金属工業	163,000	229	37,327,000	
日本冶金工業	127,000	472	59,944,000	
山陽特殊製鋼	114,000	416	47,424,000	
愛知製鋼	122,000	394	48,068,000	
日立金属	143,000	909	129,987,000	
日本金属	71,000	189	13,419,000	
大平洋金属	153,000	836	127,908,000	
日本電工	86,000	651	55,986,000	
日本鑄鉄管	38,000	145	5,510,000	
三菱製鋼	142,000	234	33,228,000	
日亜鋼業	41,000	301	12,341,000	
日本精線	26,000	250	6,500,000	
シンニッタン	19,600	292	5,723,200	
新家工業	84,000	146	12,264,000	
大紀アルミニウム工業所	46,000	248	11,408,000	
三井金属鉱業	634,000	248	157,232,000	
東邦亜鉛	121,000	428	51,788,000	
三菱マテリアル	1,332,000	338	450,216,000	
住友金属鉱山	568,000	1,529	868,472,000	
DOWAホールディングス	277,000	472	130,744,000	
古河機械金属	390,000	118	46,020,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	21,600	4,050	87,480,000	
東邦チタニウム	36,900	1,889	69,704,100	
住友軽金属工業	332,000	115	38,180,000	
古河スカイ	115,000	191	21,965,000	
古河電気工業	690,000	383	264,270,000	
住友電気工業	723,500	1,067	771,974,500	
フジクラ	329,000	461	151,669,000	
三菱電線工業	143,000	102	14,586,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
東京特殊電線	31,000	110	3,410,000	
タツタ電線	60,000	243	14,580,000	
日立電線	178,000	313	55,714,000	
沖電線	39,000	147	5,733,000	
カナレ電気	2,600	1,015	2,639,000	
平河ヒューテック	6,600	710	4,686,000	
リョービ	134,000	284	38,056,000	
アサヒホールディングス	32,100	1,806	57,972,600	
稲葉製作所	11,400	975	11,115,000	
トーカロ	15,200	1,353	20,565,600	
アルファC o	7,400	529	3,914,600	
SUMCO	117,400	1,411	165,651,400	
川田テクノロジーズ	9,100	1,338	12,175,800	
東洋製罐	169,200	1,901	321,649,200	
ホッカンホールディングス	53,000	262	13,886,000	
コロナ	10,800	1,150	12,420,000	
横河ブリッジホールディングス	44,000	792	34,848,000	
駒井鉄工	43,000	223	9,589,000	
ハルテック	43,000	107	4,601,000	
高田機工	31,000	237	7,347,000	
三和ホールディングス	233,000	295	68,735,000	
文化シャッター	69,000	364	25,116,000	
東洋シャッター	11,900	650	7,735,000	
住生活グループ	264,900	1,426	377,747,400	
日本フィルコン	16,200	491	7,954,200	
ノーリツ	39,800	1,173	46,685,400	
長府製作所	25,700	1,897	48,752,900	
リンナイ	42,400	4,210	178,504,000	
ダイニチ工業	14,100	558	7,867,800	
日東精工	30,000	291	8,730,000	
三洋工業	57,000	176	10,032,000	
岡部	53,900	405	21,829,500	
中国工業	78,000	132	10,296,000	
東プレ	45,800	776	35,540,800	
高周波熱錬	32,200	774	24,922,800	
東京製綱	167,000	317	52,939,000	
パイオラックス	9,400	1,360	12,784,000	
日本発條	143,000	553	79,079,000	
中央発條	29,000	269	7,801,000	
三益半導体工業	16,800	1,181	19,840,800	
アタカ大機	16,000	222	3,552,000	
日本製鋼所	314,000	1,272	399,408,000	
日立ツール	13,200	750	9,900,000	
三浦工業	32,800	2,025	66,420,000	
タクマ	87,000	246	21,402,000	
ツガミ	65,000	225	14,625,000	
オークマ	132,000	502	66,264,000	
東芝機械	121,000	405	49,005,000	
アマダ	338,000	692	233,896,000	
アイダエンジニアリング	58,200	330	19,206,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
牧野フライス製作所	103,000	371	38,213,000	
オーエスジー	90,900	753	68,447,700	
ダイジェット工業	28,000	165	4,620,000	
旭ダイヤモンド工業	54,000	562	30,348,000	
森精機製作所	94,200	1,111	104,656,200	
ディスコ	20,000	3,960	79,200,000	
日東工器	13,000	1,969	25,597,000	
豊和工業	130,000	72	9,360,000	
大阪機工	77,000	111	8,547,000	
東洋機械金属	16,600	168	2,788,800	
オーエム製作所	18,000	393	7,074,000	
津田駒工業	57,000	145	8,265,000	
島精機製作所	26,400	2,415	63,756,000	
日本スピンドル製造	29,000	168	4,872,000	
日阪製作所	24,000	1,196	28,704,000	
やまびこ	7,900	1,285	10,151,500	
ペガサスミシン製造	21,200	189	4,006,800	
ナプテスコ	91,000	1,018	92,638,000	
三井海洋開発	14,600	1,751	25,564,600	
レオン自動機	24,000	253	6,072,000	
S M C	65,500	10,240	670,720,000	
新川	19,700	1,276	25,137,200	
ホソカワミクロン	35,000	439	15,365,000	
ユニオンツール	12,200	2,635	32,147,000	
オイレス工業	25,400	1,351	34,315,400	
サトー	23,500	910	21,385,000	
日本エアージェット	7,400	492	3,640,800	
日精樹脂工業	19,300	316	6,098,800	
ワイエイシイ	9,900	617	6,108,300	
小松製作所	975,200	1,581	1,541,791,200	
住友重機械工業	552,000	444	245,088,000	
日立建機	112,000	1,746	195,552,000	
日工	30,000	280	8,400,000	
巴工業	8,400	1,158	9,727,200	
井関農機	221,000	327	72,267,000	
丸山製作所	49,000	205	10,045,000	
北川鉄工所	101,000	135	13,635,000	
クボタ	1,004,000	730	732,920,000	
荏原実業	5,200	1,339	6,962,800	
三菱化工機	68,000	276	18,768,000	
月島機械	33,000	557	18,381,000	
帝国電機製作所	8,300	2,075	17,222,500	
東京機械製作所	67,000	170	11,390,000	
新東工業	44,900	761	34,168,900	
澁谷工業	12,700	724	9,194,800	
アイチ コーポレーション	36,200	455	16,471,000	
小森コーポレーション	62,200	1,211	75,324,200	
鶴見製作所	17,000	576	9,792,000	
住友精密工業	39,000	394	15,366,000	
酒井重工業	42,000	184	7,728,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
荏原製作所	468,000	309	144,612,000	
石井鐵工所	32,000	187	5,984,000	
西島製作所	19,800	1,514	29,977,200	
ダイキン工業	229,000	3,210	735,090,000	
オルガノ	38,000	808	30,704,000	
トーヨーカネツ	135,000	204	27,540,000	
栗田工業	121,000	2,700	326,700,000	
椿本チエイン	113,000	352	39,776,000	
大同工業	43,000	174	7,482,000	
T C M	56,000	152	8,512,000	
日本コンベヤ	76,000	100	7,600,000	
木村化工機	20,100	913	18,351,300	
アネスト岩田	44,000	274	12,056,000	
ダイフク	89,000	675	60,075,000	
加藤製作所	46,000	246	11,316,000	
油研工業	41,000	179	7,339,000	
タダノ	101,000	505	51,005,000	
フジテック	61,000	429	26,169,000	
シーケーディ	59,200	508	30,073,600	
キトー	67	83,500	5,594,500	
平和	39,500	1,089	43,015,500	
理想科学工業	17,600	880	15,488,000	
S A N K Y O	57,200	4,970	284,284,000	
日本金銭機械	23,700	904	21,424,800	
マースエンジニアリング	11,000	2,715	29,865,000	
福島工業	6,500	655	4,257,500	
キャノンファインテック	19,900	1,217	24,218,300	
オーイズミ	9,700	234	2,269,800	
ダイコク電機	9,100	1,275	11,602,500	
アマノ	64,100	898	57,561,800	
サンデン	119,000	271	32,249,000	
マックス	37,000	1,063	39,331,000	
グローリー	64,800	1,844	119,491,200	
大和冷機工業	34,000	431	14,654,000	
セガサミーホールディングス	239,700	1,109	265,827,300	
日本ピストンリング	82,000	113	9,266,000	
リケン	97,000	327	31,719,000	
帝国ピストンリング	25,600	482	12,339,200	
ホシザキ電機	42,200	1,104	46,588,800	
大豊工業	16,600	785	13,031,000	
日本精工	431,000	498	214,638,000	
N T N	367,000	377	138,359,000	
ジェイテクト	209,200	904	189,116,800	
不二越	213,000	209	44,517,000	
日本トムソン	67,000	515	34,505,000	
T H K	130,700	1,592	208,074,400	
ユーシン精機	9,700	1,479	14,346,300	
前澤給装工業	11,100	1,615	17,926,500	
イーグル工業	26,000	485	12,610,000	
前澤工業	16,700	187	3,122,900	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日本ビラー工業	23,000	352	8,096,000	
キッツ	95,000	334	31,730,000	
日立工機	72,600	946	68,679,600	
マキタ	128,100	2,445	313,204,500	
日立造船	933,000	117	109,161,000	
三菱重工業	3,733,000	378	1,411,074,000	
I H I	1,432,000	173	247,736,000	
イビデン	147,300	2,935	432,325,500	
コニカミノルタホールディングス	553,500	1,116	617,706,000	
ブラザー工業	252,900	952	240,760,800	
ミネベア	312,000	410	127,920,000	
日立製作所	3,508,000	322	1,129,576,000	
東芝	4,035,000	355	1,432,425,000	
三菱電機	1,957,000	601	1,176,157,000	
富士電機ホールディングス	486,000	161	78,246,000	
東洋電機製造	42,000	581	24,402,000	
安川電機	230,000	645	148,350,000	
シンフォニアテクノロジー	136,000	238	32,368,000	
明電舎	193,000	489	94,377,000	
オリジン電気	30,000	294	8,820,000	
デンヨー	21,500	819	17,608,500	
東芝テック	152,000	395	60,040,000	
芝浦メカトロニクス	38,000	450	17,100,000	
マブチモーター	32,100	4,790	153,759,000	
日本電産	103,900	6,010	624,439,000	
高岳製作所	83,000	334	27,722,000	
ダイヘン	106,000	358	37,948,000	
J V C ・ ケンウッド ・ ホールディングス	788,900	72	56,800,800	
日新電機	46,000	466	21,436,000	
大崎電気工業	33,000	943	31,119,000	
オムロン	249,000	1,515	377,235,000	
日東工業	31,500	1,003	31,594,500	
I D E C	27,600	680	18,768,000	
エルピーダメモリ	101,400	1,168	118,435,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	335,000	906	303,510,000	
サクサホールディングス	61,000	133	8,113,000	
メルコホールディングス	12,000	1,270	15,240,000	
テクノメディカ	16	254,000	4,064,000	
日本電気	2,114,000	381	805,434,000	
富士通	2,156,000	513	1,106,028,000	
沖電気工業	668,000	108	72,144,000	
岩崎通信機	92,000	105	9,660,000	
電気興業	55,000	494	27,170,000	
サンケン電気	123,000	410	50,430,000	
ナカヨ通信機	31,000	209	6,479,000	
アイホン	15,100	1,620	24,462,000	
N E C エレクトロニクス	40,400	969	39,147,600	
セイコーエプソン	153,400	1,558	238,997,200	
ワコム	412	186,000	76,632,000	
アルバック	33,500	2,490	83,415,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ナナオ	17,800	1,899	33,802,200	
日本信号	52,800	761	40,180,800	
京三製作所	49,000	368	18,032,000	
能美防災	28,000	782	21,896,000	
ホーチキ	21,000	573	12,033,000	
マスプロ電工	16,000	859	13,744,000	
日本無線	88,000	252	22,176,000	
パナソニック	2,235,500	1,324	2,959,802,000	
シャープ	1,012,000	1,083	1,095,996,000	
アンリツ	100,000	394	39,400,000	
富士通ゼネラル	54,000	311	16,794,000	
日立国際電気	62,000	621	38,502,000	
ソニー	1,111,600	2,700	3,001,320,000	
NEC トーキン	67,000	232	15,544,000	
TDK	109,700	4,440	487,068,000	
帝国通信工業	50,000	254	12,700,000	
三洋電機	2,072,000	245	507,640,000	
ミツミ電機	74,000	1,941	143,634,000	
タムラ製作所	64,000	356	22,784,000	
アルプス電気	177,300	545	96,628,500	
池上通信機	77,000	101	7,777,000	
パイオニア	164,100	296	48,573,600	
日本電波工業	16,300	2,190	35,697,000	
日本トリム	3,450	1,932	6,665,400	
ローランド ディー・ジー	8,500	1,407	11,959,500	
フォスター電機	20,700	1,148	23,763,600	
クラリオン	98,000	101	9,898,000	
SMK	62,000	361	22,382,000	
ヨコオ	17,800	508	9,042,400	
東光	97,000	162	15,714,000	
ティアック	105,000	61	6,405,000	
ホシデン	52,100	1,250	65,125,000	
ヒロセ電機	36,500	10,670	389,455,000	
日本航空電子工業	48,000	620	29,760,000	
TOA	25,000	580	14,500,000	
日立マクセル	45,900	1,133	52,004,700	
ユニデン	62,000	322	19,964,000	
アルパイン	46,100	883	40,706,300	
スミダコーポレーション	14,700	644	9,466,800	
島田理化工業	12,800	238	3,046,400	
アイコム	11,600	1,945	22,562,000	
船井電機	19,000	3,890	73,910,000	
横河電機	227,300	580	131,834,000	
新電元工業	75,000	236	17,700,000	
山武	53,800	1,936	104,156,800	
日本光電工業	41,700	1,250	52,125,000	
チノー	41,000	246	10,086,000	
共和電業	22,000	262	5,764,000	
日本電子材料	8,700	587	5,106,900	
堀場製作所	30,500	2,330	71,065,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
アドバンテスト	142,900	1,844	263,507,600	
小野測器	24,000	430	10,320,000	
エスペック	20,200	728	14,705,600	
サンクス	19,100	316	6,035,600	
キーエンス	43,200	20,350	879,120,000	
日置電機	10,100	1,810	18,281,000	
シスメックス	40,000	3,410	136,400,000	
メガチップス	19,400	1,941	37,655,400	
OBARA	15,600	855	13,338,000	
日本電産コパル電子	22,000	494	10,868,000	
ミヤチテクノス	11,200	591	6,619,200	
東京電波	6,600	749	4,943,400	
澤藤電機	13,000	180	2,340,000	
コーセル	28,100	869	24,418,900	
日立メディコ	15,000	1,085	16,275,000	
新日本無線	16,000	289	4,624,000	
オプテックス	14,400	938	13,507,200	
千代田インテグレ	13,000	1,129	14,677,000	
東光電気	15,000	270	4,050,000	
スタンレー電気	147,000	1,627	239,169,000	
岩崎電気	71,000	231	16,401,000	
ウシオ電機	118,200	1,491	176,236,200	
岡谷電機産業	12,200	309	3,769,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	19,000	220	4,180,000	
日本セラミック	15,600	1,024	15,974,400	
新神戸電機	20,000	825	16,500,000	
日本デジタル研究所	19,900	1,123	22,347,700	
古河電池	15,000	913	13,695,000	
双信電機	10,900	379	4,131,100	
山一電機	18,700	240	4,488,000	
図研	14,700	699	10,275,300	
日本電子	78,000	375	29,250,000	
カシオ計算機	199,800	890	177,822,000	
ファナック	202,700	8,100	1,641,870,000	
F D K	93,000	188	17,484,000	
日本シイエムケイ	41,400	794	32,871,600	
エンプラス	13,400	1,087	14,565,800	
ローム	108,300	6,440	697,452,000	
浜松ホトニクス	76,300	1,920	146,496,000	
三井ハイテック	27,900	1,019	28,430,100	
新光電気工業	61,800	1,200	74,160,000	
京セラ	186,800	7,570	1,414,076,000	
太陽誘電	102,000	991	101,082,000	
村田製作所	234,600	4,180	980,628,000	
ユーシン	25,200	495	12,474,000	
双葉電子工業	37,300	1,915	71,429,500	
北陸電気工業	97,000	169	16,393,000	
パナソニック電工	342,000	790	270,180,000	
ニチコン	66,200	1,285	85,067,000	
日本ケミコン	108,000	364	39,312,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
K O A	29,300	700	20,510,000	
市光工業	51,000	183	9,333,000	
小糸製作所	105,000	1,075	112,875,000	
ミツバ	39,000	351	13,689,000	
アロカ	13,000	871	11,323,000	
スター精密	40,400	958	38,703,200	
大日本スクリーン製造	232,000	286	66,352,000	
キャノン電子	19,000	1,492	28,348,000	
キャノン	1,215,500	3,370	4,096,235,000	
リコー	679,000	1,391	944,489,000	
日本電産サンキョー	63,000	480	30,240,000	
M U T O Hホールディングス	28,000	171	4,788,000	
東京エレクトロン	152,800	4,980	760,944,000	
トヨタ紡織	73,300	1,461	107,091,300	
鬼怒川ゴム工業	53,000	153	8,109,000	
ユニプレス	29,100	964	28,052,400	
豊田自動織機	169,700	2,535	430,189,500	
モリタホールディングス	34,000	374	12,716,000	
三櫻工業	26,700	470	12,549,000	
デンソー	460,400	2,400	1,104,960,000	
東海理化電機製作所	55,200	1,488	82,137,600	
三井造船	757,000	239	180,923,000	
佐世保重工業	127,000	224	28,448,000	
川崎重工業	1,739,000	250	434,750,000	
日本車輛製造	96,000	541	51,936,000	
日本輸送機	24,000	253	6,072,000	
近畿車輛	36,000	643	23,148,000	
日産自動車	2,648,500	615	1,628,827,500	
いすゞ自動車	994,000	175	173,950,000	
トヨタ自動車	2,693,300	3,880	10,450,004,000	代用有価証券で 500,000株 担保差 入
日野自動車	299,000	320	95,680,000	
三菱自動車工業	4,686,000	177	829,422,000	
エフテック	7,400	940	6,956,000	
武蔵精密工業	20,400	1,521	31,028,400	
トヨタ車体	45,800	1,580	72,364,000	
日産車体	72,000	752	54,144,000	
関東自動車工業	31,900	966	30,815,400	
新明和工業	94,000	354	33,276,000	
極東開発工業	41,700	455	18,973,500	
日信工業	38,400	1,242	47,692,800	
トピー工業	189,000	182	34,398,000	
ティラド	64,000	210	13,440,000	
曙ブレーキ工業	57,900	484	28,023,600	
タチエス	27,500	794	21,835,000	
N O K	112,700	1,218	137,268,600	
フタバ産業	45,600	387	17,647,200	
カヤバ工業	145,000	228	33,060,000	
シロキ工業	41,000	191	7,831,000	
大同メタル工業	35,000	402	14,070,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
プレス工業	82,000	195	15,990,000	
カルソニックカンセイ	125,000	208	26,000,000	
太平洋工業	43,000	319	13,717,000	
ケーヒン	48,200	1,278	61,599,600	
河西工業	29,000	248	7,192,000	
アイシン精機	191,800	2,085	399,903,000	
富士機工	27,000	127	3,429,000	
マツダ	831,000	288	239,328,000	
ダイハツ工業	222,000	892	198,024,000	
愛知機械工業	53,000	283	14,999,000	
今仙電機製作所	15,200	1,014	15,412,800	
本田技研工業	1,791,600	2,885	5,168,766,000	
スズキ	423,900	2,180	924,102,000	
富士重工業	713,000	402	286,626,000	
ヤマハ発動機	242,500	1,190	288,575,000	
ショーワ	44,700	466	20,830,200	
T B K	23,000	190	4,370,000	
エクセディ	25,300	2,005	50,726,500	
豊田合成	59,200	2,240	132,608,000	
愛三工業	25,400	765	19,431,000	
ヨロズ	14,000	989	13,846,000	
エフ・シー・シー	30,900	1,382	42,703,800	
シマノ	81,200	3,460	280,952,000	
タカタ	37,400	1,483	55,464,200	
テイ・エス テック	44,300	1,386	61,399,800	
日本電産トーソク	6,600	708	4,672,800	
テルモ	151,000	4,050	611,550,000	
クリエートメディック	6,300	903	5,688,900	
日機装	62,000	674	41,788,000	
島津製作所	231,000	749	173,019,000	
J M S	34,000	377	12,818,000	
モリテックス	11,300	369	4,169,700	
長野計器	12,500	855	10,687,500	
東京計器	72,000	152	10,944,000	
愛知時計電機	40,000	245	9,800,000	
東京精密	39,500	1,379	54,470,500	
ニコン	365,000	1,557	568,305,000	
トプコン	48,300	590	28,497,000	
オリンパス	230,000	2,090	480,700,000	
理研計器	17,000	600	10,200,000	
タムロン	18,400	1,358	24,987,200	
H O Y A	481,400	2,030	977,242,000	
ノーリツ鋼機	19,500	833	16,243,500	
エー・アンド・デイ	17,600	459	8,078,400	
日本電産コパル	20,500	945	19,372,500	
シチズンホールディングス	272,300	482	131,248,600	
リズム時計工業	111,000	108	11,988,000	
セイコーホールディングス	80,000	269	21,520,000	
ニプロ	50,000	1,800	90,000,000	
S R I スポーツ	144	79,000	11,376,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
バンダイナムコホールディングス	227,800	1,022	232,811,600	
共立印刷	19,900	157	3,124,300	
フランスベッドホールディングス	147,000	137	20,139,000	
パイロットコーポレーション	198	115,600	22,888,800	
トッパン・フォームズ	45,100	1,176	53,037,600	
フジシールインターナショナル	23,500	1,630	38,305,000	
タカラトミー	64,900	603	39,134,700	
廣済堂	20,800	226	4,700,800	
タカノ	9,700	646	6,266,200	
プロネクサス	26,000	681	17,706,000	
ウッドワン	57,000	314	17,898,000	
大建工業	120,000	165	19,800,000	
凸版印刷	637,000	870	554,190,000	
大日本印刷	638,000	1,222	779,636,000	
図書印刷	46,000	246	11,316,000	
共同印刷	71,000	269	19,099,000	
日本写真印刷	32,200	3,920	126,224,000	
光村印刷	20,000	324	6,480,000	
宝印刷	10,400	848	8,819,200	
コンビ	14,000	669	9,366,000	
アシックス	208,000	815	169,520,000	
ツツミ	8,300	1,795	14,898,500	
ローランド	15,700	1,070	16,799,000	
小松ウオール工業	8,600	1,070	9,202,000	
ヤマハ	166,900	1,200	200,280,000	
河合楽器製作所	88,000	109	9,592,000	
クリナップ	32,800	501	16,432,800	
ピジョン	13,200	2,715	35,838,000	
パラマウントベッド	21,300	1,333	28,392,900	
キングジム	16,100	756	12,171,600	
リンテック	40,000	1,587	63,480,000	
イトーキ	47,400	268	12,703,200	
任天堂	110,700	26,330	2,914,731,000	
三菱鉛筆	20,000	1,120	22,400,000	
タカラスタンダード	104,000	557	57,928,000	
コクヨ	108,900	830	90,387,000	
ナカバヤシ	48,000	226	10,848,000	
ダイワ精工	110,000	140	15,400,000	
岡村製作所	90,000	519	46,710,000	
美津濃	106,000	438	46,428,000	
アデランスホールディングス	25,200	1,031	25,981,200	
東京電力	1,321,000	2,380	3,143,980,000	代用有価証券で 300,000株 担保差 入
中部電力	709,900	2,150	1,526,285,000	
関西電力	870,000	2,030	1,766,100,000	
中国電力	314,000	1,940	609,160,000	
北陸電力	215,100	2,165	465,691,500	
東北電力	523,800	1,917	1,004,124,600	
四国電力	219,700	2,710	595,387,000	
九州電力	463,000	1,999	925,537,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
北海道電力	196,200	1,786	350,413,200	
沖縄電力	14,800	4,970	73,556,000	
電源開発	151,800	2,605	395,439,000	
東京瓦斯	2,653,000	346	917,938,000	
大阪瓦斯	2,248,000	309	694,632,000	
東邦瓦斯	547,000	389	212,783,000	
北海道瓦斯	41,000	249	10,209,000	
西部瓦斯	237,000	251	59,487,000	
静岡瓦斯	64,500	508	32,766,000	
東武鉄道	894,000	524	468,456,000	
相模鉄道	302,000	400	120,800,000	
東京急行電鉄	1,151,000	438	504,138,000	
京浜急行電鉄	539,000	720	388,080,000	
小田急電鉄	672,000	803	539,616,000	
京王電鉄	544,000	560	304,640,000	
京成電鉄	337,000	517	174,229,000	
富士急行	57,000	407	23,199,000	
新京成電鉄	27,000	346	9,342,000	
東日本旅客鉄道	390,600	5,640	2,202,984,000	
西日本旅客鉄道	1,953	312,000	609,336,000	
東海旅客鉄道	1,750	621,000	1,086,750,000	
アートコーポレーション	5,100	1,224	6,242,400	
西日本鉄道	274,000	357	97,818,000	
ハマキョウレックス	6,600	1,999	13,193,400	
サカイ引越センター	3,900	2,035	7,936,500	
近畿日本鉄道	1,894,000	413	782,222,000	
阪急阪神ホールディングス	1,407,000	456	641,592,000	
南海電気鉄道	439,000	429	188,331,000	
京阪電気鉄道	472,000	410	193,520,000	
名糖運輸	8,700	791	6,881,700	
名古屋鉄道	735,000	302	221,970,000	
日本通運	899,000	410	368,590,000	
ヤマトホールディングス	417,000	1,197	499,149,000	
山九	255,000	354	90,270,000	
丸運	15,500	263	4,076,500	
丸全昭和運輸	64,000	266	17,024,000	
センコー	73,000	313	22,849,000	
トナミホールディングス	49,000	240	11,760,000	
日本梱包運輸倉庫	58,000	989	57,362,000	
日本石油輸送	24,000	191	4,584,000	
福山通運	164,000	411	67,404,000	
セイノーホールディングス	162,000	742	120,204,000	
神奈川中央交通	25,000	511	12,775,000	
日立物流	43,800	1,165	51,027,000	
日本郵船	1,121,000	456	511,176,000	
商船三井	1,099,000	691	759,409,000	
川崎汽船	499,000	449	224,051,000	
新和海運	85,000	320	27,200,000	
乾汽船	25,100	780	19,578,000	
明治海運	19,000	579	11,001,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
飯野海運	101,500	592	60,088,000	
共栄タンカー	18,000	276	4,968,000	
第一中央汽船	138,000	310	42,780,000	
全日本空輸	2,158,000	344	742,352,000	
日本航空	3,024,000	184	556,416,000	
パスコ	24,000	186	4,464,000	
国際航業ホールディングス	19,000	261	4,959,000	
日新	80,000	207	16,560,000	
三菱倉庫	154,000	990	152,460,000	
三井倉庫	91,000	356	32,396,000	
住友倉庫	166,000	394	65,404,000	
澁澤倉庫	65,000	385	25,025,000	
東陽倉庫	36,000	193	6,948,000	
日本トランスシティ	44,000	281	12,364,000	
ケイヒン	43,000	129	5,547,000	
安田倉庫	15,200	708	10,761,600	
東洋埠頭	61,000	148	9,028,000	
宇徳	15,500	318	4,929,000	
上組	250,000	738	184,500,000	
サンリツ	6,100	625	3,812,500	
キムラユニティー	4,900	711	3,483,900	
キューソー流通システム	5,900	921	5,433,900	
郵船航空サービス	16,600	1,252	20,783,200	
近鉄エクスプレス	18,800	2,375	44,650,000	
東海運	13,600	241	3,277,600	
バンテック	98	86,500	8,477,000	
システムプロ	136	41,950	5,705,200	
新日鉄ソリューションズ	13,800	1,423	19,637,400	
コア	7,800	581	4,531,800	
ITホールディングス	72,000	1,642	118,224,000	
コーエーテクモホールディングス	32,600	723	23,569,800	
ドワンゴ	116	153,700	17,829,200	
ベリサーブ	10	158,500	1,585,000	
マクロミル	123	112,900	13,886,700	
ティーガイア	168	126,800	21,302,400	
GMOペイメントゲートウェイ	47	98,000	4,606,000	
ザッパラス	68	207,000	14,076,000	
インターネットイニシアティブ	126	149,700	18,862,200	
ソネットエンタテインメント	119	195,500	23,264,500	
SRAホールディングス	10,000	838	8,380,000	
JBIホールディングス	23,600	355	8,378,000	
朝日ネット	17,000	303	5,151,000	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	4,200	1,928	8,097,600	
フェイス	960	6,900	6,624,000	
野村総合研究所	105,800	1,901	201,125,800	
サイバネットシステム	170	34,650	5,890,500	
インテージ	5,300	1,470	7,791,000	
シンプレクス・テクノロジー	347	48,500	16,829,500	
クレスコ	6,100	495	3,019,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	

フジ・メディア・ホールディングス	2,155	133,600	287,908,000	
オービック	6,900	15,510	107,019,000	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	4,500	715	3,217,500	
ヤフー	15,308	27,500	420,970,000	
トレンドマイクロ	102,500	3,390	347,475,000	
日本オラクル	34,700	3,390	117,633,000	
アルファシステムズ	5,700	2,090	11,913,000	
フューチャーアーキテクト	249	41,550	10,345,950	
シーエーシー	11,300	727	8,215,100	
ソフトバンク・テクノロジー	5,900	618	3,646,200	
トーセ	5,900	616	3,634,400	
オービックビジネスコンサルタント	6,600	3,900	25,740,000	
日立ビジネスソリューション	6,600	560	3,696,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	25,800	2,700	69,660,000	
アイティフォー	23,100	401	9,263,100	
東計電算	4,300	1,130	4,859,000	
エクスネット	22	130,700	2,875,400	
大塚商会	17,900	4,830	86,457,000	
サイボウズ	311	18,920	5,884,120	
アグレックス	4,100	751	3,079,100	
電通国際情報サービス	14,900	604	8,999,600	
ウェザーニューズ	6,200	1,229	7,619,800	
C I J	20,700	337	6,975,900	
ネットワンシステムズ	504	159,000	80,136,000	
アルゴグラフィックス	8,700	1,013	8,813,100	
エイベックス・グループ・ホールディングス	39,900	916	36,548,400	
日本ユニシス	50,000	835	41,750,000	
富士通ビジネスシステム	12,100	1,768	21,392,800	
兼松エレクトロニクス	13,500	833	11,245,500	
東京放送ホールディングス	124,000	1,383	171,492,000	
日本テレビ放送網	19,810	11,120	220,287,200	
テレビ朝日	525	145,500	76,387,500	
テレビ東京	8,200	2,960	24,272,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,573	37,350	58,751,550	
アイ・ティー・シーネットワーク	43	189,400	8,144,200	
イー・アクセス	925	73,900	68,357,500	
NECモバイルリング	7,700	1,699	13,082,300	
日本電信電話	951,200	3,700	3,519,440,000	
K D D I	3,211	512,000	1,644,032,000	
光通信	26,600	2,030	53,998,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	20,026	139,200	2,787,619,200	
GMOインターネット	39,200	389	15,248,800	
学習研究社	73,000	180	13,140,000	
ゼンリン	30,200	1,411	42,612,200	
昭文社	12,500	662	8,275,000	
角川グループホールディングス	17,900	2,240	40,096,000	
インプレスホールディングス	23,300	213	4,962,900	
アイネット	10,000	528	5,280,000	
松竹	116,000	791	91,756,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
東宝	154,100	1,460	224,986,000	

東映	88,000	422	37,136,000	
葵プロモーション	11,000	507	5,577,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,278	298,500	381,483,000	
D T S	19,700	973	19,168,100	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	52,500	2,200	115,500,000	
シーイーシー	12,300	767	9,434,100	
日立ソフトウェアエンジニアリング	29,400	1,580	46,452,000	
カプコン	43,900	1,875	82,312,500	
ジャステック	10,800	524	5,659,200	
住商情報システム	21,200	1,426	30,231,200	
日本システムウエア	7,900	353	2,788,700	
日立情報システムズ	16,900	1,919	32,431,100	
アイネス	25,100	592	14,859,200	
T K C	20,000	1,820	36,400,000	
富士ソフト	25,600	1,930	49,408,000	
ソラン	21,100	578	12,195,800	
日本システムディベロップメント	36,700	981	36,002,700	
コナミ	93,400	1,768	165,131,200	
福井コンピュータ	4,600	301	1,384,600	
J B C Cホールディングス	17,100	636	10,875,600	
ソフトバンク	844,400	1,934	1,633,069,600	
ハウスイ	17,000	127	2,159,000	
インターニックス	9,100	341	3,103,100	
高千穂交易	8,800	956	8,412,800	
伊藤忠食品	5,100	3,220	16,422,000	
高千穂電気	13,700	986	13,508,200	
J A L U X	6,800	1,283	8,724,400	
トーメンデバイス	2,900	1,132	3,282,800	
双日	1,285,100	227	291,717,700	
アルフレッサ ホールディングス	41,300	4,160	171,808,000	
横浜冷凍	47,000	579	27,213,000	
神栄	27,000	145	3,915,000	
山下医科器械	1,500	1,045	1,567,500	
ラサ商事	12,400	353	4,377,200	
あい ホールディングス	49,700	380	18,886,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25,500	513	13,081,500	
日本コークス工業	147,000	142	20,874,000	
ミタチ産業	5,000	406	2,030,000	
J F E 商事ホールディングス	143,000	379	54,197,000	
グリーンホスピタルサプライ	197	58,400	11,504,800	
協栄産業	26,000	220	5,720,000	
小野建	19,300	995	19,203,500	
佐鳥電機	15,700	526	8,258,200	
エコトレーディング	4,300	862	3,706,600	
伯東	12,900	756	9,752,400	
中山福	14,500	579	8,395,500	
ナガイレーベン	12,800	1,739	22,259,200	
菱食	20,100	2,300	46,230,000	
松田産業	16,200	1,660	26,892,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	

メディセオ・パルタックホールディングス	222,800	1,113	247,976,400	
アドヴァン	22,700	478	10,850,600	
S P K	5,300	1,169	6,195,700	
アズワン	13,600	1,670	22,712,000	
スズデン	7,600	495	3,762,000	
尾家産業	6,700	771	5,165,700	
シモジマ	14,200	1,300	18,460,000	
ドウシシャ	11,900	1,336	15,898,400	
高速	12,300	589	7,244,700	
黒田電気	30,000	1,086	32,580,000	
丸文	17,200	635	10,922,000	
ハビネット	6,000	1,140	6,840,000	
トーメンエレクトロニクス	6,500	959	6,233,500	
エクセル	9,100	956	8,699,600	
マルカキカイ	7,400	742	5,490,800	
ガリバーインターナショナル	4,910	3,280	16,104,800	
日本エム・ディ・エム	17,400	212	3,688,800	
進和	11,600	1,350	15,660,000	
エスケイジャパン	9,900	182	1,801,800	
ダイトエレクトロン	9,200	486	4,471,200	
シークス	13,700	468	6,411,600	
田中商事	19,200	453	8,697,600	
オーハシテクニカ	13,300	616	8,192,800	
マクニカ	8,400	1,280	10,752,000	
白銅	10,400	582	6,052,800	
伊藤忠商事	1,548,000	725	1,122,300,000	
丸紅	1,810,000	478	865,180,000	
高島	68,000	166	11,288,000	
F & A アクアホールディングス	18,600	1,040	19,344,000	
長瀬産業	108,000	969	104,652,000	
蝶理	135,000	115	15,525,000	
豊田通商	207,400	1,447	300,107,800	
三共生興	38,700	212	8,204,400	
兼松	455,000	106	48,230,000	
ツカモトコーポレーション	42,000	101	4,242,000	
三井物産	1,781,900	1,307	2,328,943,300	
日本紙パルプ商事	113,000	290	32,770,000	
日立ハイテクノロジーズ	71,700	1,643	117,803,100	
カメイ	28,000	465	13,020,000	
東都水産	35,000	149	5,215,000	
スターゼン	69,000	220	15,180,000	
山善	83,600	318	26,584,800	
椿本興業	25,000	234	5,850,000	
住友商事	1,221,100	1,036	1,265,059,600	
内田洋行	50,000	309	15,450,000	
三菱商事	1,545,600	1,995	3,083,472,000	
第一実業	50,000	331	16,550,000	
キャノンマーケティングジャパン	78,700	1,278	100,578,600	
西華産業	89,000	235	20,915,000	
佐藤商事	22,300	507	11,306,100	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
菱洋エレクトロ	21,100	787	16,605,700	

東京産業	20,500	294	6,027,000	
神鋼商事	59,000	179	10,561,000	
阪和興業	207,000	405	83,835,000	
カナデン	25,000	477	11,925,000	
菱電商事	33,000	564	18,612,000	
フルサト工業	13,400	724	9,701,600	
岩谷産業	234,000	264	61,776,000	
すてきナイスグループ	118,000	154	18,172,000	
昭光通商	85,000	117	9,945,000	
ニチモウ	39,000	170	6,630,000	
極東貿易	32,000	160	5,120,000	
イワキ	22,000	203	4,466,000	
三愛石油	53,000	433	22,949,000	
稲畑産業	59,600	380	22,648,000	
明和産業	25,800	191	4,927,800	
東邦ホールディングス	47,500	978	46,455,000	
サンゲツ	35,700	2,100	74,970,000	
ミツウロコ	36,300	585	21,235,500	
シナネン	52,000	515	26,780,000	
伊藤忠エネクス	55,500	600	33,300,000	
ザ・トーカイ	49,000	383	18,767,000	
サンリオ	58,500	823	48,145,500	
サンワテクノス	10,600	442	4,685,200	
リョーサン	33,000	2,175	71,775,000	
新光商事	21,300	795	16,933,500	
トーホー	40,000	343	13,720,000	
三信電気	25,200	749	18,874,800	
東陽テクニカ	31,900	959	30,592,100	
モスフードサービス	29,300	1,528	44,770,400	
加賀電子	22,600	1,140	25,764,000	
ソーダニッカ	21,000	301	6,321,000	
立花エレテック	14,300	850	12,155,000	
ヤマタネ	112,000	118	13,216,000	
丸紅建材リース	22,000	140	3,080,000	
トラスコ中山	24,600	1,520	37,392,000	
オートボックスセブン	33,300	3,390	112,887,000	
ユーエスシー	8,300	952	7,901,600	
加藤産業	29,900	1,456	43,534,400	
イエローハット	21,700	362	7,855,400	
富士エレクトロニクス	12,000	756	9,072,000	
J Kホールディングス	25,800	471	12,151,800	
ユニダックス	12,000	391	4,692,000	
日伝	8,600	2,685	23,091,000	
北沢産業	41,000	188	7,708,000	
杉本商事	11,600	859	9,964,400	
因幡電機産業	19,800	2,110	41,778,000	
住金物産	113,000	239	27,007,000	
ミスミグループ本社	69,500	1,433	99,593,500	
江守商事	5,000	616	3,080,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
タキヒヨー	39,000	494	19,266,000	
スズケン	73,400	2,590	190,106,000	

ジェコス	23,500	430	10,105,000	
ローソン	64,800	3,920	254,016,000	
サンエー	8,000	3,000	24,000,000	
キリン堂	8,500	500	4,250,000	
ダイユーエイト	3,100	604	1,872,400	
カワチ薬品	14,500	1,829	26,520,500	
エービーシー・マート	21,900	2,220	48,618,000	
ハードオフコーポレーション	9,600	448	4,300,800	
アスクル	19,800	1,444	28,591,200	
ゲオ	384	67,300	25,843,200	
ポイント	18,650	4,530	84,484,500	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	15,000	146	2,190,000	
くらコーポレーション	62	149,900	9,293,800	
キャンドゥ	95	94,500	8,977,500	
パル	5,400	1,530	8,262,000	
エディオン	82,900	629	52,144,100	
サーラコーポレーション	20,000	527	10,540,000	
バルス	115	77,900	8,958,500	
あみやき亭	37	125,300	4,636,100	
ハニーズ	14,980	671	10,051,580	
アルペン	15,900	1,678	26,680,200	
ビックカメラ	570	31,150	17,755,500	
DCM Japanホールディングス	104,100	595	61,939,500	
ユニバース	2,800	1,099	3,077,200	
J.フロント リテイリング	524,000	421	220,604,000	
ドトール・日レスホールディングス	29,700	1,327	39,411,900	
マツモトキヨシホールディングス	38,500	1,980	76,230,000	
ココカラファイン ホールディングス	11,900	1,343	15,981,700	
三越伊勢丹ホールディングス	378,700	929	351,812,300	
クリエイトSDホールディングス	7,400	1,630	12,062,000	
ブックオフコーポレーション	11,600	1,059	12,284,400	
あさひ	3,500	2,330	8,155,000	
サークルKサンクス	50,600	1,368	69,220,800	
日本調剤	4,200	1,645	6,909,000	
コスモス薬品	8,300	1,434	11,902,200	
セブン&アイ・ホールディングス	826,100	2,330	1,924,813,000	
ツルハホールディングス	15,500	2,870	44,485,000	
サンマルクホールディングス	6,700	2,750	18,425,000	
フェリシモ	6,000	1,632	9,792,000	
トリドール	17	478,000	8,126,000	
はるやま商事	10,200	387	3,947,400	
カップ・クリエイト	12,250	1,908	23,373,000	
ライトオン	17,400	866	15,068,400	
ジーンズメイト	6,100	560	3,416,000	
良品計画	21,900	4,080	89,352,000	
三城ホールディングス	29,400	959	28,194,600	
コナカ	26,800	259	6,941,200	
ハウス オブ ローゼ	2,200	1,242	2,732,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
G-7ホールディングス	6,600	367	2,422,200	
イオン北海道	13,600	310	4,216,000	
コーナン商事	24,400	940	22,936,000	

エコス	7,300	668	4,876,400	
ワタミ	27,200	1,800	48,960,000	
マルシェ	5,300	704	3,731,200	
ドン・キホーテ	42,600	1,787	76,126,200	
メガネトップ	17,600	1,471	25,889,600	
西松屋チェーン	54,600	849	46,355,400	
ゼンショー	70,000	512	35,840,000	
幸楽苑	12,900	1,123	14,486,700	
ユニマツライフ	8,400	870	7,308,000	
ハークスレイ	6,000	891	5,346,000	
サイゼリヤ	30,800	1,229	37,853,200	
ポプラ	6,200	636	3,943,200	
ユナイテッドアローズ	28,200	628	17,709,600	
ハイデイ日高	9,200	1,032	9,494,400	
京都きもの友禅	13,500	798	10,773,000	
コロワイド	47,000	551	25,897,000	
壱番屋	7,400	2,040	15,096,000	
トップカルチャー	7,200	361	2,599,200	
スギホールディングス	33,100	1,805	59,745,500	
ムトウ	24,600	407	10,012,200	
ファミリーマート	63,600	2,890	183,804,000	
木曽路	23,700	1,946	46,120,200	
千趣会	37,500	662	24,825,000	
タカキュー	17,000	153	2,601,000	
ケーヨー	43,000	484	20,812,000	
上新電機	49,000	679	33,271,000	
日本瓦斯	22,200	1,375	30,525,000	
ベスト電器	65,500	413	27,051,500	
マルエツ	42,000	490	20,580,000	
ロイヤルホールディングス	34,700	1,045	36,261,500	
東天紅	16,000	185	2,960,000	
いなげや	23,000	920	21,160,000	
島忠	49,800	2,070	103,086,000	
チヨダ	29,900	1,397	41,770,300	
鈴丹	6,000	214	1,284,000	
ライフコーポレーション	13,300	1,635	21,745,500	
カスミ	43,000	412	17,716,000	
リンガーハット	15,900	1,248	19,843,200	
さが美	17,000	154	2,618,000	
MrMax	23,600	416	9,817,600	
テンアライド	14,400	303	4,363,200	
AOKIホールディングス	22,600	1,036	23,413,600	
オークワ	30,000	1,089	32,670,000	
コメリ	28,400	2,135	60,634,000	
青山商事	52,600	1,612	84,791,200	
しまむら	21,400	7,520	160,928,000	
CFSコーポレーション	25,500	600	15,300,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
高島屋	280,000	641	179,480,000	
丸善	105,000	97	10,185,000	
松屋	41,800	1,163	48,613,400	
エイチ・ツー・オー リテイリング	135,000	556	75,060,000	

丸栄	31,000	183	5,673,000	
ニッセンホールディングス	50,000	425	21,250,000	
パルコ	59,300	747	44,297,100	
丸井グループ	269,700	662	178,541,400	
原信ナルスホールディングス	12,600	929	11,705,400	
ダイエー	96,250	473	45,526,250	
イズミヤ	67,000	571	38,257,000	
イオン	833,700	927	772,839,900	
ユニー	155,000	771	119,505,000	
イズミ	56,300	1,127	63,450,100	
東武ストア	28,000	309	8,652,000	
平和堂	42,100	1,224	51,530,400	
フジ	24,400	1,725	42,090,000	
ヤオコー	11,800	2,845	33,571,000	
ゼビオ	21,900	1,875	41,062,500	
ケーズホールディングス	36,400	2,125	77,350,000	
Olympic	14,000	613	8,582,000	
東日カーライフグループ	36,000	135	4,860,000	
元気寿司	6,500	1,200	7,800,000	
ヤマダ電機	100,450	5,190	521,335,500	
アークランドサカモト	15,100	874	13,197,400	
ニトリ	44,700	5,850	261,495,000	
グルメ杵屋	15,000	620	9,300,000	
愛眼	16,800	572	9,609,600	
吉野家ホールディングス	476	108,800	51,788,800	
松屋フーズ	10,100	1,295	13,079,500	
サガミチェーン	25,000	910	22,750,000	
セシール	24,700	180	4,446,000	
プレナス	26,100	1,389	36,252,900	
ミニストップ	15,400	1,523	23,454,200	
アークス	24,600	1,311	32,250,600	
バロー	41,400	741	30,677,400	
ベルク	9,500	814	7,733,000	
大庄	12,600	1,295	16,317,000	
ファーストリテイリング	41,400	12,770	528,678,000	
サンドラッグ	39,500	1,857	73,351,500	
ヤマザワ	5,600	1,174	6,574,400	
やまや	4,100	667	2,734,700	
ベルーナ	26,300	369	9,704,700	
新生銀行	1,207,000	156	188,292,000	
あおぞら銀行	752,000	142	106,784,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	12,131,900	640	7,764,416,000	
りそなホールディングス	669,800	1,509	1,010,728,200	
中央三井トラスト・ホールディングス	1,056,000	378	399,168,000	
三井住友フィナンシャルグループ	873,200	4,300	3,754,760,000	
第四銀行	289,000	387	111,843,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
北越銀行	235,000	202	47,470,000	
西日本シティ銀行	674,000	238	160,412,000	
札幌北洋ホールディングス	312,000	277	86,424,000	
千葉銀行	816,000	622	507,552,000	
横浜銀行	1,418,000	480	680,640,000	

常陽銀行	803,000	473	379,819,000	
群馬銀行	483,000	538	259,854,000	
武蔵野銀行	31,400	2,965	93,101,000	
千葉興業銀行	39,800	1,016	40,436,800	
関東つくば銀行	60,100	337	20,253,700	
東京都民銀行	39,100	1,750	68,425,000	
七十七銀行	349,000	552	192,648,000	
青森銀行	129,000	384	49,536,000	
秋田銀行	142,000	337	47,854,000	
山形銀行	125,000	450	56,250,000	
岩手銀行	13,900	5,370	74,643,000	
東邦銀行	161,000	391	62,951,000	
荘内銀行	105,000	190	19,950,000	
東北銀行	108,000	152	16,416,000	
みちのく銀行	105,000	220	23,100,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	895,000	420	375,900,000	
静岡銀行	647,000	951	615,297,000	
十六銀行	267,000	358	95,586,000	
スルガ銀行	241,000	941	226,781,000	
八十二銀行	391,000	558	218,178,000	
山梨中央銀行	138,000	503	69,414,000	
大垣共立銀行	237,000	437	103,569,000	
福井銀行	178,000	312	55,536,000	
北國銀行	239,000	340	81,260,000	
清水銀行	7,100	3,790	26,909,000	
滋賀銀行	194,000	573	111,162,000	
南都銀行	205,000	519	106,395,000	
百五銀行	204,000	474	96,696,000	
京都銀行	357,000	894	319,158,000	
三重銀行	94,000	316	29,704,000	
池田銀行	18,900	3,760	71,064,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,449,000	215	311,535,000	
広島銀行	611,000	397	242,567,000	
山陰合同銀行	125,000	816	102,000,000	
中国銀行	170,000	1,307	222,190,000	
鳥取銀行	71,000	271	19,241,000	
伊予銀行	236,000	997	235,292,000	
百十四銀行	242,000	453	109,626,000	
四国銀行	151,000	373	56,323,000	
阿波銀行	184,000	560	103,040,000	
鹿児島銀行	145,000	677	98,165,000	
大分銀行	113,000	490	55,370,000	
宮崎銀行	107,000	379	40,553,000	
肥後銀行	164,000	537	88,068,000	
佐賀銀行	127,000	290	36,830,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
十八銀行	132,000	291	38,412,000	
沖縄銀行	17,100	3,530	60,363,000	
琉球銀行	43,700	960	41,952,000	
住友信託銀行	1,973,000	536	1,057,528,000	
みずほ信託銀行	2,052,000	131	268,812,000	
八千代銀行	12,400	3,130	38,812,000	

みずほフィナンシャルグループ	11,643,000	261	3,038,823,000	
紀陽ホールディングス	819,000	122	99,918,000	
山口フィナンシャルグループ	193,000	1,284	247,812,000	
長野銀行	78,000	231	18,018,000	
名古屋銀行	200,000	446	89,200,000	
愛知銀行	7,600	7,600	57,760,000	
第三銀行	128,000	278	35,584,000	
中京銀行	97,000	317	30,749,000	
東日本銀行	109,000	219	23,871,000	
愛媛銀行	130,000	254	33,020,000	
トマト銀行	82,000	239	19,598,000	
みなと銀行	216,000	134	28,944,000	
京葉銀行	186,000	474	88,164,000	
関西アーバン銀行	289,000	199	57,511,000	
栃木銀行	111,000	495	54,945,000	
北日本銀行	7,000	2,595	18,165,000	
香川銀行	78,000	409	31,902,000	
東和銀行	182,000	60	10,920,000	
徳島銀行	61,000	464	28,304,000	
福島銀行	262,000	69	18,078,000	
大東銀行	140,000	82	11,480,000	
SBIホールディングス	17,484	17,900	312,963,600	
ジャフコ	40,300	3,350	135,005,000	
大和証券グループ本社	1,372,000	664	911,008,000	
野村ホールディングス	2,944,800	848	2,497,190,400	
みずほ証券	529,000	320	169,280,000	
みずほインベスターズ証券	483,000	129	62,307,000	
岡三証券グループ	177,000	495	87,615,000	
丸三証券	68,900	630	43,407,000	
東洋証券	78,000	270	21,060,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	242,000	352	85,184,000	
光世証券	52,000	128	6,656,000	
水戸証券	68,000	318	21,624,000	
いちよし証券	46,500	859	39,943,500	
松井証券	157,900	867	136,899,300	
だいこう証券ビジネス	9,000	612	5,508,000	
マネックスグループ	1,074	39,400	42,315,600	
カブドットコム証券	446	115,300	51,423,800	
極東証券	26,200	460	12,052,000	
岩井証券	21,400	937	20,051,800	
三井住友海上グループホールディングス	493,700	2,870	1,416,919,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	736	269,300	198,204,800	
日本興亜損害保険	797,000	591	471,027,000	
損害保険ジャパン	964,000	721	695,044,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ニッセイ同和損害保険	229,000	486	111,294,000	
あいおい損害保険	541,000	483	261,303,000	
富士火災海上保険	248,000	140	34,720,000	
東京海上ホールディングス	890,300	2,900	2,581,870,000	
T&Dホールディングス	303,150	2,925	886,713,750	

クレディセゾン	177,600	1,317	233,899,200	
セディナ	154,000	216	33,264,000	
芙蓉総合リース	22,400	1,975	44,240,000	
興銀リース	30,000	1,223	36,690,000	
東京センチュリーリース	50,600	946	47,867,600	
日本証券金融	81,600	787	64,219,200	
大阪証券金融	31,100	210	6,531,000	
ポケットカード	25,300	242	6,122,600	
リコリース	15,000	1,824	27,360,000	
イオンクレジットサービス	109,700	1,373	150,618,100	
アコム	101,250	2,445	247,556,250	
プロミス	110,450	1,265	139,719,250	
ジャックス	132,000	194	25,608,000	
日立キャピタル	49,900	1,174	58,582,600	
オリックス	102,050	5,860	598,013,000	
三菱UFJリース	60,350	3,050	184,067,500	
アサックス	53	59,700	3,164,100	
NECキャピタルソリューション	8,700	1,345	11,701,500	
昭栄	42,200	811	34,224,200	
東京建物不動産販売	27,900	301	8,397,900	
野村不動産ホールディングス	63,700	1,819	115,870,300	
ヒューリック	69,300	465	32,224,500	
パーク24	126,100	849	107,058,900	
三井不動産	918,000	1,710	1,569,780,000	
三菱地所	1,448,000	1,614	2,337,072,000	
平和不動産	165,000	306	50,490,000	
東京建物	335,000	501	167,835,000	
ダイビル	59,900	812	48,638,800	
サンケイビル	42,200	510	21,522,000	
東急不動産	441,000	418	184,338,000	
京阪神不動産	42,000	406	17,052,000	
住友不動産	527,000	1,569	826,863,000	
東宝不動産	32,100	470	15,087,000	
有楽土地	67,000	211	14,137,000	
テーオーシー	95,100	386	36,708,600	
東京楽天地	51,000	386	19,686,000	
レオパレス21	156,700	814	127,553,800	
フジ住宅	41,300	244	10,077,200	
空港施設	31,300	508	15,900,400	
住友不動産販売	10,660	4,350	46,371,000	
ゴールドクレスト	18,510	2,385	44,146,350	
東急リバブル	30,200	744	22,468,800	
サンヨーハウジング名古屋	155	82,300	12,756,500	
イオンモール	100,600	1,771	178,162,600	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,389	89,600	124,454,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
大和システム	37,000	209	7,733,000	
日本空港ビルデング	57,900	1,186	68,669,400	
日本工営	74,000	294	21,756,000	
日本M&Aセンター	34	339,000	11,526,000	
アコーディア・ゴルフ	560	75,600	42,336,000	
パナソニックグループ	222	61,400	13,630,800	

リンクアンドモチベーション	31	51,500	1,596,500	
テンプホールディングス	26,000	763	19,838,000	
学情	9,800	318	3,116,400	
スタジオアリス	11,200	695	7,784,000	
シミック	360	22,100	7,956,000	
NECフィールドディング	17,800	1,196	21,288,800	
総合警備保障	73,300	932	68,315,600	
カカクコム	169	357,000	60,333,000	
ルネサンス	13,500	314	4,239,000	
新日本科学	11,800	386	4,554,800	
ソネット・エムスリー	103	312,000	32,136,000	
ディー・エヌ・エー	285	315,000	89,775,000	
博報堂DYホールディングス	30,350	4,910	149,018,500	
ぐるなび	118	231,500	27,317,000	
一休	177	40,600	7,186,200	
ジャパンベストレスキューシステム	46	44,400	2,042,400	
ジェイコム	22	86,800	1,909,600	
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	556	56,600	31,469,600	
イーピーエス	59	370,000	21,830,000	
アミューズ	6,200	968	6,001,600	
ドリームインキュベータ	73	74,300	5,423,900	
TAC	12,500	425	5,312,500	
電通	217,300	1,928	418,954,400	
イオンファンタジー	8,000	807	6,456,000	
みらかホールディングス	41,800	2,145	89,661,000	
アルプス技研	10,000	544	5,440,000	
ダイオーズ	4,700	440	2,068,000	
日本空調サービス	5,200	747	3,884,400	
オリエンタルランド	61,900	6,350	393,065,000	
ダスキン	65,800	1,615	106,267,000	
明光ネットワークジャパン	21,000	461	9,681,000	
ファルコバイオシステムズ	12,100	743	8,990,300	
秀英予備校	6,600	381	2,514,600	
田谷	4,400	684	3,009,600	
ラウンドワン	36,600	900	32,940,000	
リゾートトラスト	42,100	958	40,331,800	
ビー・エム・エル	11,600	1,964	22,782,400	
ワタベウェディング	6,900	1,540	10,626,000	
もしもしホットライン	15,950	1,942	30,974,900	
東急コミュニティー	6,100	1,969	12,010,900	
リソー教育	2,481	3,590	8,906,790	
ウェアハウス	7,300	505	3,686,500	
ユー・エス・エス	29,800	5,210	155,258,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
東京個別指導学院	28,400	172	4,884,800	
カルチュア・コンビニエンス・クラブ	101,700	773	78,614,100	
テー・オー・ダブリュー	5,200	579	3,010,800	
総合メディカル	5,100	2,225	11,347,500	
セントラルスポーツ	6,800	870	5,916,000	
リゾートソリューション	22,000	149	3,278,000	
エイチ・アイ・エス	20,500	1,900	38,950,000	
共立メンテナンス	9,000	1,585	14,265,000	

イチネンホールディングス	21,400	414	8,859,600	
建設技術研究所	12,400	558	6,919,200	
燦ホールディングス	5,200	1,687	8,772,400	
スバル興業	23,000	292	6,716,000	
東京テアトル	104,000	196	20,384,000	
吉本興業	33,800	910	30,758,000	
ホリプロ	8,600	784	6,742,400	
よみうりランド	52,000	294	15,288,000	
東京都競馬	172,000	166	28,552,000	
カナモト	26,000	463	12,038,000	
東京ドーム	165,000	318	52,470,000	
トランス・コスモス	28,600	1,084	31,002,400	
乃村工藝社	44,000	258	11,352,000	
藤田観光	65,000	412	26,780,000	
近畿日本ツーリスト	75,000	110	8,250,000	
日本管財	8,200	1,419	11,635,800	
白洋舎	26,000	255	6,630,000	
セコム	212,600	3,920	833,392,000	
セントラル警備保障	9,900	855	8,464,500	
丹青社	40,000	238	9,520,000	
メイテック	36,700	1,413	51,857,100	
アサツー ディ・ケイ	44,100	1,994	87,935,400	
応用地質	25,100	1,055	26,480,500	
船井総合研究所	28,100	500	14,050,000	
進学会	13,400	267	3,577,800	
ベネッセコーポレーション	76,200	3,750	285,750,000	
イオンディライト	16,300	1,486	24,221,800	
ナック	11,600	848	9,836,800	
ニチイ学館	53,200	776	41,283,200	
ダイセキ	32,400	2,155	69,822,000	
合計	292,418,777		251,436,315,500	

(注) 代用有価証券の担保差入株数には、約定未受渡株数を含んでおります。

#### B. 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

#### 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引関係)に記載したとおりであります。

#### 不動産等明細表

該当事項はありません。

#### 商品明細表

該当事項はありません。

#### 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次△](#)

## 「中央三井日本債券マザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

項目	平成21年6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,754,211,511
国債証券	179,553,173,500
地方債証券	15,681,211,427
特殊債券	27,024,600,597
社債券	20,370,159,000
未収入金	341,780
未収利息	1,020,090,337
前払費用	108,126,808
流動資産合計	251,511,914,960
資産合計	251,511,914,960
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	298,220
前受金	2,440,000
未払金	4,471,160
未払解約金	100,968,421
流動負債合計	108,177,801
負債合計	108,177,801
純資産の部	
元本等	
元本	224,341,953,998
剰余金	
剰余金	27,061,783,161
純資産合計	251,403,737,159
負債・純資産合計	251,511,914,960

## (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6月10日現在
--	--------------

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 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、時価で評価しております。 ただし、買付後の最初の利払いまでは個別法によっております。</p>
2．デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>債券先物取引 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>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6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;">国債証券 51,495,000 円</p> <p>なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおります。</p>
2．計算日における受益権総数	224,341,953,998 口
3．1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	<p>1.1206 円</p> <p>( 11,206 円 )</p>

## (関連当事者との取引に関する注記)

平成21年6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6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6月10日現在	
計算期間の期首元本額	234,283,534,118 円

計算期間中の追加設定元本額	68,554,717,895 円
計算期間中の一部解約元本額	78,496,298,015 円
計算日の元本額	224,341,953,998 円
計算日の元本額の内訳	
中央三井日本債券インデックスファンド	4,695,752,794 円
中央三井DC日本債券インデックスファンド	1,738,024,550 円
中央三井DC日本債券インデックスファンドL	11,009,890,226 円
中央三井DCバランスファンド30	317,659,524 円
中央三井DCバランスファンド50	358,833,395 円
中央三井DCバランスファンド70	107,449,034 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	295,497,674 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	173,830,083 円
中央三井日本債券インデックスファンド(SMA専用)	1,761,979,267 円
新生・4分散ファンド	205,307,644 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	101,047,759 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	203,057,681 円
中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)	12,262,453,932 円
中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)	39,149,955,536 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)	37,987,959,312 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)	1,863,196,014 円
中央三井VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	8,269,262,711 円
中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)	12,329,321,198 円
中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,872,028,704 円
中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)	29,094,287,704 円
中央三井バランスVA75(適格機関投資家専用)	242,680,002 円
中央三井VL株式30(適格機関投資家専用)	30,877,618 円
中央三井VL株式50(適格機関投資家専用)	21,011,634 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)	34,697,696,659 円
中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	7,599,379,008 円
中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	732,543,532 円
中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)	3,780,802,910 円
中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	1,931,390,382 円
CMAM・バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	4,223,656,395 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)	1,127,054,896 円
CMAM・VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	1,122,428,361 円
中央三井バランスVA20(適格機関投資家専用)	4,035,637,859 円

## 2. 有価証券関係

## 売買目的有価証券

平成21年6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)

国債証券	179,553,173,500	2,859,619,000
地方債証券	15,681,211,427	138,394,566
特殊債券	27,024,600,597	218,653,979
社債券	20,370,159,000	89,502,800
合計	242,629,144,524	3,306,170,345

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「中央三井日本債券マザーファンド」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6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6月10日現在
<p>1. 取引の内容 当ファンドの利用している取引は、債券関連の債券先物取引であります。</p>
<p>2. 取引に対する取組方針 債券先物取引は、ファンド運用の効率化を図ること及び将来の価格変動リスクの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。</p>
<p>3. 取引の利用目的 債券先物取引は、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。</p>
<p>4. 取引に係るリスクの内容 債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。</p>
<p>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。</p>
<p>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。</p>

#### ・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  
債券関連

区分	種類	平成21年6月10日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	3,526,678,220		3,526,380,000	298,220
	合計	3,526,678,220		3,526,380,000	298,220

(注) 1. 時価の算定方法

債券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. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

[次へ](#)

## (3) 附属明細表(平成21年6月10日現在)

## 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(円)	評価額(円)	備考
国債 証券	利付国庫債券(2年)第270回	400,000,000	403,000,000	
	利付国庫債券(2年)第271回	200,000,000	201,350,000	
	利付国庫債券(2年)第272回	900,000,000	905,274,000	
	利付国庫債券(2年)第273回	500,000,000	503,755,000	
	利付国庫債券(2年)第274回	400,000,000	402,008,000	
	利付国庫債券(2年)第275回	1,100,000,000	1,105,500,000	
	利付国庫債券(2年)第276回	1,500,000,000	1,505,085,000	
	利付国庫債券(2年)第277回	100,000,000	100,157,000	
	利付国庫債券(2年)第278回	1,600,000,000	1,601,936,000	
	利付国庫債券(2年)第279回	1,400,000,000	1,401,274,000	
	利付国庫債券(2年)第280回	700,000,000	700,532,000	
	利付国庫債券(5年)第49回	1,000,000,000	1,004,600,000	
	利付国庫債券(5年)第50回	2,000,000,000	2,014,260,000	
	利付国庫債券(5年)第51回	1,200,000,000	1,211,580,000	
	利付国庫債券(5年)第52回	900,000,000	907,128,000	
	利付国庫債券(5年)第53回	1,100,000,000	1,112,023,000	
	利付国庫債券(5年)第54回	1,100,000,000	1,114,927,000	
	利付国庫債券(5年)第55回	1,300,000,000	1,324,466,000	
	利付国庫債券(5年)第56回	1,300,000,000	1,326,754,000	
	利付国庫債券(5年)第57回	400,000,000	408,232,000	
	利付国庫債券(5年)第58回	700,000,000	715,806,000	
	利付国庫債券(5年)第59回	1,500,000,000	1,527,870,000	
	利付国庫債券(5年)第60回	2,600,000,000	2,645,500,000	
	利付国庫債券(5年)第61回	1,400,000,000	1,425,746,000	
	利付国庫債券(5年)第62回	1,600,000,000	1,633,408,000	
	利付国庫債券(5年)第63回	2,400,000,000	2,446,080,000	
	利付国庫債券(5年)第64回	2,200,000,000	2,263,624,000	
	利付国庫債券(5年)第65回	1,200,000,000	1,231,140,000	
	利付国庫債券(5年)第66回	1,000,000,000	1,016,660,000	
	利付国庫債券(5年)第67回	1,500,000,000	1,534,605,000	
	利付国庫債券(5年)第68回	1,100,000,000	1,118,161,000	
	利付国庫債券(5年)第69回	1,300,000,000	1,312,285,000	
	利付国庫債券(5年)第70回	2,100,000,000	2,109,996,000	
	利付国庫債券(5年)第71回	1,300,000,000	1,330,043,000	
	利付国庫債券(5年)第72回	1,200,000,000	1,236,504,000	
	利付国庫債券(5年)第73回	400,000,000	409,048,000	
	利付国庫債券(5年)第74回	700,000,000	707,504,000	
	利付国庫債券(5年)第75回	800,000,000	811,064,000	
	利付国庫債券(5年)第76回	800,000,000	814,368,000	
	利付国庫債券(5年)第77回	1,000,000,000	1,009,700,000	
利付国庫債券(5年)第78回	700,000,000	702,891,000		
利付国庫債券(5年)第79回	900,000,000	895,878,000		
利付国庫債券(5年)第80回	1,300,000,000	1,299,428,000		
利付国庫債券(5年)第81回	3,200,000,000	3,193,408,000		
利付国庫債券(5年)第82回	1,100,000,000	1,103,014,000		
利付国庫債券(40年)第1回	500,000,000	512,870,000		

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債 証券	利付国庫債券(40年)第2回	100,000,000	97,518,000	
	利付国庫債券(10年)第223回	1,060,000,000	1,079,451,000	
	利付国庫債券(10年)第224回	410,000,000	418,044,200	
	利付国庫債券(10年)第225回	1,030,000,000	1,055,245,300	
	利付国庫債券(10年)第226回	510,000,000	521,730,000	
	利付国庫債券(10年)第227回	600,000,000	613,308,000	
	利付国庫債券(10年)第228回	650,000,000	663,279,500	
	利付国庫債券(10年)第229回	340,000,000	346,351,200	
	利付国庫債券(10年)第230回	340,000,000	344,559,400	
	利付国庫債券(10年)第231回	610,000,000	621,211,800	
	利付国庫債券(10年)第232回	1,420,000,000	1,443,259,600	
	利付国庫債券(10年)第233回	410,000,000	418,355,800	
	利付国庫債券(10年)第234回	1,840,000,000	1,880,461,600	
	利付国庫債券(10年)第235回	1,290,000,000	1,320,469,800	
	利付国庫債券(10年)第236回	690,000,000	708,015,900	
	利付国庫債券(10年)第237回	1,120,000,000	1,150,979,200	
	利付国庫債券(10年)第238回	1,190,000,000	1,219,666,700	
	利付国庫債券(10年)第239回	910,000,000	933,614,500	
	利付国庫債券(10年)第240回	1,570,000,000	1,606,094,300	
	利付国庫債券(10年)第241回	750,000,000	767,430,000	
	利付国庫債券(10年)第242回	730,000,000	744,621,900	
	利付国庫債券(10年)第243回	1,020,000,000	1,037,156,400	
	利付国庫債券(10年)第244回	930,000,000	941,987,700	
	利付国庫債券(10年)第245回	1,030,000,000	1,039,558,400	
	利付国庫債券(10年)第246回	680,000,000	683,971,200	
	利付国庫債券(10年)第247回	910,000,000	914,331,600	
	利付国庫債券(10年)第248回	170,000,000	170,187,000	
	利付国庫債券(10年)第249回	760,000,000	758,046,800	
	利付国庫債券(10年)第250回	600,000,000	594,732,000	
	利付国庫債券(10年)第251回	770,000,000	775,405,400	
	利付国庫債券(10年)第252回	730,000,000	737,971,600	
	利付国庫債券(10年)第253回	1,350,000,000	1,397,142,000	
	利付国庫債券(10年)第254回	520,000,000	533,748,800	
	利付国庫債券(10年)第255回	710,000,000	731,853,800	
	利付国庫債券(10年)第256回	1,040,000,000	1,067,185,600	
	利付国庫債券(10年)第257回	1,100,000,000	1,123,958,000	
	利付国庫債券(10年)第258回	480,000,000	490,219,200	
	利付国庫債券(10年)第259回	1,180,000,000	1,215,931,000	
	利付国庫債券(10年)第260回	860,000,000	890,160,200	
	利付国庫債券(10年)第261回	790,000,000	825,486,800	
利付国庫債券(10年)第262回	730,000,000	766,302,900		
利付国庫債券(10年)第263回	750,000,000	776,392,500		
利付国庫債券(10年)第264回	730,000,000	751,827,000	(注)	
利付国庫債券(10年)第265回	730,000,000	751,827,000		
利付国庫債券(10年)第266回	460,000,000	471,339,000		
利付国庫債券(10年)第267回	610,000,000	621,840,100		
利付国庫債券(10年)第268回	900,000,000	926,028,000		
利付国庫債券(10年)第269回	2,640,000,000	2,686,780,800		
利付国庫債券(10年)第270回	800,000,000	813,376,000		
利付国庫債券(10年)第271回	900,000,000	909,693,000		
利付国庫債券(10年)第272回	1,100,000,000	1,122,957,000		

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
----	----	---------	--------	----

国債 証券	利付国庫債券(10年)第273回	1,000,000,000	1,027,050,000	
	利付国庫債券(10年)第274回	1,000,000,000	1,025,870,000	
	利付国庫債券(10年)第275回	700,000,000	713,846,000	
	利付国庫債券(10年)第276回	800,000,000	825,816,000	
	利付国庫債券(10年)第277回	600,000,000	618,684,000	
	利付国庫債券(10年)第278回	300,000,000	313,215,000	
	利付国庫債券(10年)第279回	1,200,000,000	1,268,364,000	
	利付国庫債券(10年)第280回	600,000,000	629,610,000	
	利付国庫債券(10年)第281回	1,000,000,000	1,056,190,000	
	利付国庫債券(10年)第282回	1,100,000,000	1,135,618,000	
	利付国庫債券(10年)第283回	1,600,000,000	1,663,600,000	
	利付国庫債券(10年)第284回	1,750,000,000	1,804,092,500	
	利付国庫債券(10年)第285回	1,400,000,000	1,440,992,000	
	利付国庫債券(10年)第286回	1,800,000,000	1,863,288,000	
	利付国庫債券(10年)第287回	1,000,000,000	1,043,160,000	
	利付国庫債券(10年)第288回	3,100,000,000	3,181,840,000	
	利付国庫債券(10年)第289回	2,000,000,000	2,016,740,000	
	利付国庫債券(10年)第290回	300,000,000	299,766,000	
	利付国庫債券(10年)第291回	600,000,000	594,618,000	
	利付国庫債券(10年)第292回	1,300,000,000	1,330,953,000	
	利付国庫債券(10年)第293回	600,000,000	618,462,000	
	利付国庫債券(10年)第294回	1,300,000,000	1,329,081,000	
	利付国庫債券(10年)第295回	900,000,000	905,022,000	
	利付国庫債券(10年)第296回	2,000,000,000	2,005,700,000	
	利付国庫債券(10年)第297回	1,000,000,000	992,080,000	
	利付国庫債券(10年)第298回	2,700,000,000	2,655,018,000	
	利付国庫債券(10年)第299回	1,800,000,000	1,765,584,000	
	利付国庫債券(10年)第300回	1,500,000,000	1,498,710,000	
	利付国庫債券(30年)第1回	50,000,000	55,093,000	
	利付国庫債券(30年)第2回	100,000,000	103,579,000	
	利付国庫債券(30年)第3回	130,000,000	132,432,300	
	利付国庫債券(30年)第4回	190,000,000	212,307,900	
	利付国庫債券(30年)第5回	180,000,000	179,469,000	
	利付国庫債券(30年)第6回	70,000,000	72,102,800	
	利付国庫債券(30年)第7回	190,000,000	191,871,500	
	利付国庫債券(30年)第8回	270,000,000	248,305,500	
	利付国庫債券(30年)第9回	80,000,000	67,720,000	
	利付国庫債券(30年)第10回	170,000,000	134,322,100	
	利付国庫債券(30年)第11回	110,000,000	98,947,200	
	利付国庫債券(30年)第12回	170,000,000	164,961,200	
	利付国庫債券(30年)第13回	250,000,000	237,682,500	
	利付国庫債券(30年)第14回	150,000,000	153,699,000	
利付国庫債券(30年)第15回	140,000,000	145,951,400		
利付国庫債券(30年)第16回	150,000,000	156,418,500		
利付国庫債券(30年)第17回	230,000,000	235,400,400		
利付国庫債券(30年)第18回	260,000,000	261,055,600		
利付国庫債券(30年)第19回	270,000,000	270,880,200		
利付国庫債券(30年)第20回	140,000,000	145,898,200		
利付国庫債券(30年)第21回	120,000,000	120,296,400		
利付国庫債券(30年)第22回	700,000,000	729,225,000		
利付国庫債券(30年)第24回	300,000,000	312,672,000		

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債	利付国庫債券(30年)第25回	200,000,000	200,336,000	

証券				
	利付国庫債券(30年)第26回	700,000,000	715,491,000	
	利付国庫債券(30年)第27回	700,000,000	730,233,000	
	利付国庫債券(30年)第28回	500,000,000	521,825,000	
	利付国庫債券(30年)第29回	800,000,000	818,280,000	
	利付国庫債券(30年)第30回	300,000,000	300,795,000	
	利付国庫債券(20年)第13回	50,000,000	54,142,500	
	利付国庫債券(20年)第14回	90,000,000	101,030,400	
	利付国庫債券(20年)第15回	120,000,000	133,431,600	
	利付国庫債券(20年)第16回	80,000,000	91,516,800	
	利付国庫債券(20年)第17回	140,000,000	159,525,800	
	利付国庫債券(20年)第18回	100,000,000	115,909,000	
	利付国庫債券(20年)第19回	150,000,000	175,603,500	
	利付国庫債券(20年)第20回	70,000,000	81,249,000	
	利付国庫債券(20年)第21回	40,000,000	47,434,400	
	利付国庫債券(20年)第22回	170,000,000	199,134,600	
	利付国庫債券(20年)第23回	130,000,000	155,620,400	
	利付国庫債券(20年)第24回	160,000,000	188,577,600	
	利付国庫債券(20年)第25回	80,000,000	92,024,800	
	利付国庫債券(20年)第26回	50,000,000	59,028,500	
	利付国庫債券(20年)第27回	410,000,000	494,718,300	
	利付国庫債券(20年)第28回	110,000,000	134,445,300	
	利付国庫債券(20年)第29回	100,000,000	118,805,000	
	利付国庫債券(20年)第30回	200,000,000	231,442,000	
	利付国庫債券(20年)第31回	280,000,000	322,714,000	
	利付国庫債券(20年)第32回	80,000,000	93,241,600	
	利付国庫債券(20年)第33回	430,000,000	505,727,300	
	利付国庫債券(20年)第34回	70,000,000	81,143,300	
	利付国庫債券(20年)第35回	270,000,000	309,050,100	
	利付国庫債券(20年)第37回	410,000,000	464,214,300	
	利付国庫債券(20年)第39回	640,000,000	701,305,600	
	利付国庫債券(20年)第40回	450,000,000	481,045,500	
	利付国庫債券(20年)第41回	620,000,000	618,939,800	
	利付国庫債券(20年)第42回	380,000,000	416,122,800	
	利付国庫債券(20年)第43回	340,000,000	382,173,600	
	利付国庫債券(20年)第44回	370,000,000	401,675,700	
	利付国庫債券(20年)第45回	370,000,000	397,905,400	
	利付国庫債券(20年)第46回	290,000,000	305,868,800	
	利付国庫債券(20年)第47回	370,000,000	389,706,200	
	利付国庫債券(20年)第48回	230,000,000	249,041,700	
	利付国庫債券(20年)第49回	280,000,000	290,981,600	
	利付国庫債券(20年)第50回	490,000,000	498,628,900	
	利付国庫債券(20年)第51回	240,000,000	246,568,800	
	利付国庫債券(20年)第52回	230,000,000	238,369,700	
	利付国庫債券(20年)第53回	350,000,000	362,390,000	
	利付国庫債券(20年)第54回	280,000,000	292,933,200	
	利付国庫債券(20年)第55回	390,000,000	398,505,900	
	利付国庫債券(20年)第56回	310,000,000	316,203,100	
	利付国庫債券(20年)第57回	260,000,000	262,186,600	
	利付国庫債券(20年)第58回	250,000,000	251,465,000	
	利付国庫債券(20年)第59回	340,000,000	333,043,600	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債	利付国庫債券(20年)第60回	270,000,000	254,658,600	
証券	利付国庫債券(20年)第61回	490,000,000	437,354,400	

利付国庫債券(20年)第62回	250,000,000	215,745,000	
利付国庫債券(20年)第63回	470,000,000	464,280,100	
利付国庫債券(20年)第64回	410,000,000	409,081,600	
利付国庫債券(20年)第65回	370,000,000	368,531,100	
利付国庫債券(20年)第66回	340,000,000	334,417,200	
利付国庫債券(20年)第67回	360,000,000	358,344,000	
利付国庫債券(20年)第68回	230,000,000	237,679,700	
利付国庫債券(20年)第69回	360,000,000	367,452,000	
利付国庫債券(20年)第70回	400,000,000	423,608,000	
利付国庫債券(20年)第71回	300,000,000	309,969,000	
利付国庫債券(20年)第72回	720,000,000	732,700,800	
利付国庫債券(20年)第73回	340,000,000	340,805,800	
利付国庫債券(20年)第74回	310,000,000	314,975,500	
利付国庫債券(20年)第75回	360,000,000	364,532,400	
利付国庫債券(20年)第76回	430,000,000	424,083,200	
利付国庫債券(20年)第77回	210,000,000	209,874,000	
利付国庫債券(20年)第78回	200,000,000	196,738,000	
利付国庫債券(20年)第79回	300,000,000	299,274,000	
利付国庫債券(20年)第80回	550,000,000	556,330,500	
利付国庫債券(20年)第81回	620,000,000	617,346,400	
利付国庫債券(20年)第82回	510,000,000	514,992,900	
利付国庫債券(20年)第83回	530,000,000	533,927,300	
利付国庫債券(20年)第84回	400,000,000	397,532,000	
利付国庫債券(20年)第85回	250,000,000	251,402,500	
利付国庫債券(20年)第86回	270,000,000	279,115,200	
利付国庫債券(20年)第87回	600,000,000	611,604,000	
利付国庫債券(20年)第88回	400,000,000	412,612,000	
利付国庫債券(20年)第89回	600,000,000	610,194,000	
利付国庫債券(20年)第90回	700,000,000	710,668,000	
利付国庫債券(20年)第91回	500,000,000	514,955,000	
利付国庫債券(20年)第92回	1,100,000,000	1,099,296,000	
利付国庫債券(20年)第93回	900,000,000	884,916,000	
利付国庫債券(20年)第94回	800,000,000	798,448,000	
利付国庫債券(20年)第95回	600,000,000	615,678,000	
利付国庫債券(20年)第96回	100,000,000	99,609,000	
利付国庫債券(20年)第97回	800,000,000	807,360,000	
利付国庫債券(20年)第98回	700,000,000	695,863,000	
利付国庫債券(20年)第99回	1,100,000,000	1,091,992,000	
利付国庫債券(20年)第100回	800,000,000	806,424,000	
利付国庫債券(20年)第101回	300,000,000	311,484,000	
利付国庫債券(20年)第102回	500,000,000	518,620,000	
利付国庫債券(20年)第103回	400,000,000	408,924,000	
利付国庫債券(20年)第104回	100,000,000	99,057,000	
利付国庫債券(20年)第105回	900,000,000	891,432,000	
利付国庫債券(20年)第106回	300,000,000	301,836,000	
利付国庫債券(20年)第107回	400,000,000	395,888,000	
利付国庫債券(20年)第108回	1,000,000,000	958,380,000	
利付国庫債券(20年)第109回	600,000,000	574,416,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	利付国庫債券(20年)第110回	800,000,000	792,248,000	
	国債証券 小計	176,240,000,000	179,553,173,500	
地方債	東京都公募公債第564回	100,000,000	101,730,000	

証券				
	東京都公募公債第569回	100,000,000	102,060,000	
	東京都公募公債第579回	100,000,000	101,784,000	
	東京都公募公債第582回	100,000,000	102,399,000	
	東京都公募公債第586回	100,000,000	102,235,000	
	東京都公募公債第590回	100,000,000	101,927,000	
	東京都公募公債第598回	103,000,000	101,571,390	
	東京都公募公債第602回	200,000,000	204,252,000	
	東京都公募公債第605回	100,000,000	102,061,000	
	東京都公募公債第608回	100,000,000	102,854,000	
	東京都公募公債第609回	100,000,000	102,580,000	
	東京都公募公債第613回	100,000,000	102,629,000	
	東京都公募公債第616回	100,000,000	101,799,000	
	東京都公募公債第617回	100,000,000	101,747,000	
	東京都公募公債第619回	100,000,000	102,308,000	
	東京都公募公債第624回	100,000,000	101,973,000	
	東京都公募公債第626回	100,000,000	102,424,000	
	東京都公募公債第627回	100,000,000	101,957,000	
	東京都公募公債第628回	100,000,000	102,267,000	
	東京都公募公債第637回	180,000,000	185,398,200	
	東京都公募公債第642回	100,000,000	103,069,000	
	東京都公募公債第646回	100,000,000	103,956,000	
	東京都公募公債第647回	100,000,000	103,812,000	
	東京都公募公債第656回	100,000,000	99,725,000	
	東京都公募公債第657回	100,000,000	102,204,000	
	東京都公募公債第659回	100,000,000	100,555,000	
	東京都公募公債（20年）第3回	100,000,000	102,384,000	
	東京都公募公債（5年）第21回	100,000,000	101,649,000	
	北海道平成13年度第1回公募公債	100,000,000	101,562,000	
	北海道平成13年度第4回公募公債	100,000,000	101,999,000	
	北海道平成17年度第1回公募公債	100,000,000	100,574,000	
	北海道平成17年度第5回公募公債（5年）	100,000,000	99,990,000	
	北海道平成19年度第14回公募公債（10年）	100,000,000	99,768,000	
	北海道平成14年度第1回公募公債	100,000,000	101,757,000	
	宮城県公募公債第28回1号	100,000,000	100,035,000	
	神奈川県第113回公募公債	100,000,000	102,158,000	
	神奈川県第126回公募公債	100,000,000	102,318,000	
	神奈川県第127回公募公債	100,000,000	103,745,000	
	神奈川県第130回公募公債	100,000,000	101,580,000	
	神奈川県第135回公募公債	100,000,000	102,281,000	
	神奈川県第143回公募公債	150,000,000	153,624,000	
	神奈川県第144回公募公債	100,000,000	102,860,000	
	神奈川県第21回5年公募公債	100,000,000	101,534,000	
	第245回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,502,000	
	第250回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	101,516,000	
	第254回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	98,586,000	
	第267回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,167,000	
	第285回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,808,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
地方債 証券	第286回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,744,000	
	第293回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,024,000	
	第298回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,318,000	
	第305回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,206,000	
	第18回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	100,554,000	

京都府平成12年度第2回公募公債	165,000,000	168,469,950	
京都府平成17年度第3回公募公債	100,000,000	101,571,000	
兵庫県平成14年度第4回公募公債	100,000,000	100,478,000	
兵庫県平成16年度第10回公募公債	100,000,000	101,667,000	
兵庫県平成17年度第3回公募公債	100,000,000	100,166,000	
兵庫県平成18年度第3回公募公債	110,000,000	114,188,800	
兵庫県平成18年度第8回公募公債	100,000,000	104,184,000	
兵庫県平成18年度第10回公募公債	100,000,000	103,372,000	
兵庫県平成21年度第1回公募公債	100,000,000	98,908,000	
静岡県平成15年度第3回公募公債	100,000,000	102,022,000	
静岡県平成17年度第7回公募公債	100,000,000	102,683,000	
静岡県平成19年度第4回公募公債	100,000,000	103,289,000	
静岡県平成19年度第7回公募公債	100,000,000	102,136,000	
愛知県平成13年度第1回公募公債	100,000,000	101,675,000	
愛知県平成13年度第2回公募公債	100,000,000	101,932,000	
愛知県平成18年度第4回公募公債(10年)	129,000,000	132,559,110	
愛知県平成21年度第1回公募公債(10年)	100,000,000	99,536,000	
広島県平成14年度第1回公募公債	100,000,000	101,841,000	
広島県平成16年度第1回公募公債	100,000,000	100,919,000	
埼玉県平成13年度第3回公募公債	100,000,000	101,729,000	
埼玉県平成14年度第1回公募公債	100,000,000	102,130,000	
埼玉県平成15年度第5回公募公債	100,000,000	101,953,000	
埼玉県平成19年度第2回公募公債	100,000,000	103,346,000	
埼玉県平成19年度第5回公募公債	100,000,000	102,137,000	
埼玉県平成19年度第7回公募公債	100,000,000	100,727,000	
埼玉県平成21年度第1回公募公債	200,000,000	197,632,000	
福岡県平成12年度第1回公募公債	110,000,000	112,125,200	
福岡県平成14年度第3回公募公債	100,000,000	99,981,000	
千葉県平成12年度第2回公募公債	100,000,000	102,035,000	
千葉県平成15年度第1回公募公債	100,000,000	98,536,000	
千葉県平成17年度第4回公募公債	100,000,000	100,268,000	
千葉県平成17年度第7回公募公債	100,000,000	101,572,000	
千葉県平成18年度第6回公募公債	175,000,000	178,335,500	
千葉県平成18年度第7回公募公債	100,000,000	102,493,000	
千葉県平成21年度第1回公募公債	100,000,000	98,815,000	
新潟県平成17年度第1回公募公債	100,000,000	100,444,000	
岐阜県平成18年度第1回公募公債	100,000,000	102,671,000	
第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,493,000	
第5回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,020,000	
第6回共同発行市場公募地方債	155,700,000	160,204,401	
第9回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,834,000	
第11回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,487,000	
第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,753,000	
第16回共同発行市場公募地方債	127,000,000	131,745,990	
第17回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,737,000	
第18回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,734,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
地方債 証券	第19回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,719,000	
	第20回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,191,000	
	第22回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,577,000	
	第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,973,000	
	第29回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,163,000	
	第30回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,496,000	

第3 1回共同発行市場公募地方債	150,000,000	152,482,500		
第3 4回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,873,000		
第3 5回共同発行市場公募地方債	160,000,000	163,323,200		
第3 8回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,538,000		
第4 1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,283,000		
第4 8回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,708,000		
第5 3回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,448,000		
第5 4回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,393,000		
第6 3回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,538,000		
静岡市平成1 8年度第1回公募公債	100,000,000	103,376,000		
大阪市平成1 4年度第1 1回公募公債	100,000,000	99,471,000		
大阪市平成1 6年度第5回公募公債	100,000,000	101,997,000		
大阪市平成1 7年度第1回公募公債	100,000,000	99,887,000		
大阪市平成1 8年度第3回公募公債	200,000,000	208,004,000		
大阪市平成1 9年度第1回公募公債(5年)	100,000,000	101,670,000		
名古屋市第1 2回や号公募公債	100,000,000	101,719,000		
名古屋市第1 2回て号公募公債	100,000,000	101,856,000		
名古屋市第1 2回し号公募公債	100,000,000	101,982,000		
名古屋市第1 2回こ号公募公債	100,000,000	102,152,000		
名古屋市第1 2回す号公募公債	100,000,000	102,644,000		
名古屋市第4 5 5回1 0年公募公債	186,700,000	193,716,186		
名古屋市第4 6 3回1 0年公募公債	100,000,000	103,285,000		
横浜市平成1 2年度第3回公募公債	100,000,000	101,705,000		
横浜市平成1 3年度第3回公募公債	100,000,000	101,847,000		
横浜市平成2 0年度第1回公募公債	100,000,000	102,428,000		
横浜市平成1 5年度第2回公募公債	100,000,000	99,001,000		
横浜市平成1 7年度第3回公募公債	100,000,000	102,308,000		
横浜市第2 4回5年公募公債	100,000,000	101,186,000		
札幌市平成1 4年度第3回公募公債	100,000,000	101,125,000		
札幌市平成1 8年度第4回公募公債	100,000,000	102,728,000		
第7 9回川崎市公募公債	100,000,000	102,645,000		
北九州市平成1 4年度第2回公募公債	100,000,000	100,686,000		
福岡市平成1 7年度第1回公募公債(5年)	100,000,000	100,114,000		
福岡市平成1 8年度第2回公募公債(5年)	100,000,000	102,193,000		
福岡市平成1 9年度第2回公募公債(5年)	100,000,000	102,653,000		
福岡市平成1 9年度第3回公募公債	100,000,000	102,520,000		
福岡市平成1 9年度第5回公募公債	100,000,000	99,227,000		
広島市平成1 7年度第1回公募公債	100,000,000	101,326,000		
地方債証券 小計	15,401,400,000	15,681,211,427		
特殊 債券	政府保証第1回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,785,000	
	政府保証第4回日本政策投資銀行債券	101,000,000	103,069,490	
	政府保証第6回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,184,000	
	政府保証第7回日本政策投資銀行債券	102,000,000	103,822,740	
	政府保証第8回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,075,000	
	政府保証第10回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,605,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
特殊 債券	政府保証第1 5回日本政策投資銀行債券	210,000,000	212,658,600	
	政府保証第1 6回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,034,000	
	政府保証第2 1回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,884,000	
	第7回日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,653,000	
	第1 3回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,525,000	
	第1 6回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,994,000	
	第1 9回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,135,000	

第24回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,238,000	
第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,471,000	
第41回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,795,000	
第43回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,840,000	
第16回道路債券	200,000,000	200,804,000	
第24回道路債券	100,000,000	101,092,000	
政府保証第312回道路債券	136,000,000	138,375,920	
政府保証第313回道路債券	100,000,000	102,103,000	
政府保証第314回道路債券	100,000,000	101,033,000	
政府保証第319回道路債券	100,000,000	100,304,000	
政府保証第323回道路債券	100,000,000	102,744,000	
政府保証第325回道路債券	101,000,000	102,825,070	
政府保証第327回道路債券	100,000,000	102,647,000	
政府保証第329回道路債券	150,000,000	154,651,500	
政府保証第330回道路債券	100,000,000	104,099,000	
政府保証第334回道路債券	100,000,000	102,565,000	
政府保証第335回道路債券	100,000,000	102,017,000	
政府保証第336回道路債券	131,000,000	133,566,290	
政府保証第338回道路債券	100,000,000	102,431,000	
政府保証第346回道路債券	115,000,000	116,879,100	
第3回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,014,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	152,356,500	
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,923,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,025,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,376,000	
政府保証第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,066,000	
政府保証第10回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,824,000	
政府保証第14回日本高速道路保有・債務返済機構債券	157,000,000	163,856,190	
政府保証第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	105,966,170	
政府保証第21回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,263,000	
政府保証第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	128,895,000	
政府保証第33回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,246,000	
政府保証第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,208,000	
政府保証第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,530,000	
政府保証第43回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,853,000	
政府保証第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,618,000	
政府保証第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,113,000	
政府保証第58回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,306,000	
政府保証第62回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,528,000	
政府保証第66回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,636,000	
政府保証第67回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,462,000	
政府保証第69回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,389,000	
政府保証第71回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,571,000	

政府保証第75回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,515,000	
---------------------------	-------------	------------	--

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
特殊 債券	政府保証第78回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,295,000	
	第2回道路債券	200,000,000	205,774,000	
	第6回道路債券	100,000,000	102,858,000	
	第21回道路債券	100,000,000	101,770,000	
	第33回道路債券	100,000,000	104,290,000	
	第42回道路債券	100,000,000	99,243,000	
	政府保証第791回公営企業債券	100,000,000	101,534,000	
	政府保証第795回公営企業債券	100,000,000	102,269,000	
	政府保証第796回公営企業債券	100,000,000	102,216,000	
	政府保証第797回公営企業債券	100,000,000	102,161,000	
	政府保証第799回公営企業債券	100,000,000	102,057,000	
	政府保証第800回公営企業債券	100,000,000	101,747,000	
	政府保証第801回公営企業債券	100,000,000	101,805,000	
	政府保証第807回公営企業債券	100,000,000	102,098,000	
	政府保証第809回公営企業債券	100,000,000	102,199,000	
	政府保証第810回公営企業債券	100,000,000	102,246,000	
	政府保証第812回公営企業債券	100,000,000	102,544,000	
	政府保証第815回公営企業債券	100,000,000	102,363,000	
	政府保証第817回公営企業債券	100,000,000	102,093,000	
	政府保証第823回公営企業債券	100,000,000	100,283,000	
	政府保証第824回公営企業債券	100,000,000	100,253,000	
	政府保証第826回公営企業債券	100,000,000	99,755,000	
	政府保証第829回公営企業債券	100,000,000	101,156,000	
	政府保証第830回公営企業債券	100,000,000	100,304,000	
	政府保証第832回公営企業債券	100,000,000	102,340,000	
	政府保証第833回公営企業債券	100,000,000	102,764,000	
	政府保証第838回公営企業債券	100,000,000	102,647,000	
	政府保証第839回公営企業債券	100,000,000	102,634,000	
	政府保証第841回公営企業債券	100,000,000	104,092,000	
	政府保証第843回公営企業債券	100,000,000	102,571,000	
	政府保証第847回公営企業債券	100,000,000	101,958,000	
	政府保証第850回公営企業債券	100,000,000	101,821,000	
	政府保証第851回公営企業債券	100,000,000	101,203,000	
	政府保証第852回公営企業債券	100,000,000	101,132,000	
	政府保証第855回公営企業債券	100,000,000	100,996,000	
	政府保証第857回公営企業債券	100,000,000	102,740,000	
	政府保証第859回公営企業債券	100,000,000	102,016,000	
	政府保証第860回公営企業債券	100,000,000	102,614,000	
	政府保証第862回公営企業債券	100,000,000	103,821,000	
	政府保証第871回公営企業債券	100,000,000	103,146,000	
	政府保証第876回公営企業債券	200,000,000	207,290,000	
	政府保証第877回公営企業債券	200,000,000	207,198,000	
	政府保証第885回公営企業債券	100,000,000	101,686,000	
	政府保証第886回公営企業債券	100,000,000	102,468,000	
	政府保証15年第2回公営企業債券	100,000,000	102,879,000	
20年第9回公営企業債券	100,000,000	102,247,000		
第1回公営企業債券	100,000,000	102,018,000		
第5回公営企業債券	200,000,000	199,522,000		
第6回公営企業債券	100,000,000	99,285,000		
第13回公営企業債券	100,000,000	102,253,000		

第17回公営企業債券	200,000,000	204,030,000	
------------	-------------	-------------	--

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
特殊 債券	第19回公営企業債券	200,000,000	209,232,000	
	第23回公営企業債券	100,000,000	103,264,000	
	第24回公営企業債券	100,000,000	103,503,000	
	政府保証第187回首都高速道路債券	200,000,000	205,396,000	
	政府保証第189回首都高速道路債券	100,000,000	101,755,000	
	政府保証第190回首都高速道路債券	100,000,000	102,211,000	
	政府保証第197回首都高速道路債券	100,000,000	102,371,000	
	第9回首都高速道路債券	100,000,000	103,639,000	
	政府保証第144回阪神高速道路債券	100,000,000	102,393,000	
	政府保証第148回阪神高速道路債券	100,000,000	100,911,000	
	政府保証第142回中小企業債券	108,000,000	110,032,560	
	政府保証第157回中小企業債券	100,000,000	101,523,000	
	政府保証第165回中小企業債券	100,000,000	102,551,000	
	政府保証第176回中小企業債券	100,000,000	103,176,000	
	政府保証第184回中小企業債券	100,000,000	101,990,000	
	第9回中小企業債券	100,000,000	100,849,000	
	第10回中小企業債券	100,000,000	100,928,000	
	第22回中小企業債券	100,000,000	100,622,000	
	第24回中小企業債券	100,000,000	101,984,000	
	第2回国際協力銀行債券	100,000,000	101,888,000	
	第6回国際協力銀行債券	100,000,000	101,343,000	
	第12回国際協力銀行債券	100,000,000	102,617,000	
	第15回国際協力銀行債券	100,000,000	103,194,000	
	第19回国際協力銀行債券	100,000,000	98,111,000	
	第29回国際協力銀行債券	100,000,000	101,568,000	
	政府保証第16回都市再生債券	100,000,000	99,535,000	
	第9回都市再生債券	100,000,000	100,670,000	
	第3回都市基盤整備債券	100,000,000	103,001,000	
	第8回都市基盤整備債券	100,000,000	101,137,000	
	政府保証第27回本州四国連絡橋債券	100,000,000	101,577,000	
	第2回本州四国連絡橋債券	100,000,000	103,572,000	
	政府保証第32回電源開発債券	100,000,000	101,880,000	
	政府保証第37回関西国際空港債券	100,000,000	101,977,000	
	政府保証第3回中部国際空港債券	100,000,000	101,720,000	
	政府保証第80回預金保険機構債券	100,000,000	100,916,000	
	政府保証第84回預金保険機構債券	100,000,000	101,249,000	
	政府保証第98回預金保険機構債券	100,000,000	101,249,000	
	政府保証第105回預金保険機構債券	100,000,000	101,297,000	
	政府保証第108回預金保険機構債券	100,000,000	102,143,000	
	政府保証第112回預金保険機構債券	200,000,000	203,178,000	
	政府保証第121回預金保険機構債券	100,000,000	101,191,000	
	政府保証第140回預金保険機構債券	100,000,000	100,556,000	
	政府保証第143回預金保険機構債券	100,000,000	100,832,000	
	政府保証第147回預金保険機構債券	100,000,000	101,110,000	
	政府保証第153回預金保険機構債券	100,000,000	101,388,000	
政府保証第4回住宅金融公庫債券	136,000,000	138,982,480		
政府保証第7回住宅金融公庫債券	100,000,000	102,074,000		
貸付債権担保第18回住宅金融公庫債券	64,074,000	62,887,990		
貸付債権担保S種第1回住宅金融支援機構債券	158,028,000	156,792,221		
貸付債権担保第1回住宅金融支援機構債券	88,067,000	87,416,184		
貸付債権担保S種第2回住宅金融支援機構債券	80,918,000	81,237,626		

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊 債券	貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	184,130,000	180,462,130	
	貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	188,718,000	184,977,609	
	貸付債権担保S種第5回住宅金融公庫債券	65,902,000	64,160,210	
	貸付債権担保S種第7回住宅金融公庫債券	216,555,000	217,278,293	
	貸付債権担保S種第9回住宅金融公庫債券	74,146,000	74,044,419	
	貸付債権担保S種第10回住宅金融公庫債券	75,693,000	75,503,010	
	貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券	50,785,000	49,748,478	
	貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券	109,902,000	104,703,635	
	貸付債権担保第11回住宅金融公庫債券	58,513,000	53,862,971	
	貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	60,396,000	58,512,852	
	貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	136,666,000	135,915,703	
	貸付債権担保第25回住宅金融公庫債券	72,525,000	70,203,474	
	貸付債権担保第28回住宅金融公庫債券	74,451,000	72,248,739	
	貸付債権担保第29回住宅金融公庫債券	231,681,000	225,314,406	
	貸付債権担保第31回住宅金融公庫債券	79,227,000	76,351,852	
	貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	240,639,000	231,521,188	
	貸付債権担保第36回住宅金融公庫債券	81,237,000	79,150,833	
	貸付債権担保第37回住宅金融公庫債券	81,471,000	79,350,309	
	貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	246,942,000	239,647,333	
	貸付債権担保第41回住宅金融公庫債券	83,153,000	82,039,581	
	貸付債権担保第47回住宅金融公庫債券	84,761,000	84,186,320	
	貸付債権担保第51回住宅金融公庫債券	260,892,000	259,130,979	
	貸付債権担保第53回住宅金融公庫債券	87,572,000	86,212,882	
	政府保証第8回国民生活債券	200,000,000	200,402,000	
	政府保証第9回国民生活債券	100,000,000	101,151,000	
	政府保証第12回国民生活債券	100,000,000	102,241,000	
	政府保証第19回国民生活債券	125,000,000	128,077,500	
	第11回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	101,941,000	
	第4回日本学生支援債券	100,000,000	100,214,000	
	い第662号商工債券	100,000,000	100,002,000	
	い第676号商工債券	100,000,000	101,570,000	
	い第694号商工債	100,000,000	100,603,000	
	い第662号農林債券	100,000,000	99,968,000	
	い第665号農林債券	300,000,000	301,230,000	
	い第666号農林債券	100,000,000	100,558,000	
	い第670号農林債券	100,000,000	100,829,000	
	い第671号農林債券	130,000,000	132,037,100	
	い第675号農林債	200,000,000	203,674,000	
	い第679号農林債	200,000,000	203,222,000	
	い第681号農林債	200,000,000	203,084,000	
	い第685号農林債	100,000,000	102,047,000	
	い第686号農林債	100,000,000	102,369,000	
	い第687号農林債	200,000,000	204,444,000	
	い第689号農林債	100,000,000	101,916,000	
	い第695号農林債	100,000,000	100,559,000	
い第697号農林債	100,000,000	101,805,000		
第188回しんきん中金債券（5年）	200,000,000	200,004,000		
第191回しんきん中金債券（5年）	100,000,000	100,424,000		
第193回しんきん中金債券（5年）	200,000,000	201,026,000		
第196回しんきん中金債券（5年）	200,000,000	201,676,000		
第197回しんきん中金債券（5年）	100,000,000	101,604,000		

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊 債券	第199回しんきん中金債券（5年）	100,000,000	101,583,000	
	第200回しんきん中金債券（5年）	100,000,000	102,149,000	
	第201回信金中金債（5年）	100,000,000	101,882,000	
	第204回信金中金債（5年）	200,000,000	203,018,000	
	第208回信金中金債（5年）	100,000,000	101,339,000	
	第212回信金中金債（5年）	200,000,000	204,926,000	
	第213回信金中金債（5年）	200,000,000	204,636,000	
	第219回信金中金債（5年）	100,000,000	100,897,000	
	第222回信金中金債（5年）	100,000,000	101,582,000	
	第223回信金中金債（5年）	100,000,000	101,924,000	
	第224回信金中金債（5年）	100,000,000	101,722,000	
	第228回信金中金債（5年）	100,000,000	101,597,000	
	第231回信金中金債（5年）	100,000,000	101,075,000	
	い第672号みずほコーポレート銀行債券	100,000,000	99,979,000	
	い第674号みずほコーポレート銀行債券	100,000,000	100,089,000	
	い第677号みずほコーポレート銀行債券	100,000,000	100,513,000	
	い第679号みずほコーポレート銀行債券	200,000,000	201,504,000	
	政府保証第5回東日本高速道路債券	100,000,000	104,765,000	
	政府保証第8回中日本高速道路債券	100,000,000	104,809,000	
	政府保証第10回中日本高速道路債券	172,000,000	177,466,160	
政府保証第3回西日本高速道路債券	100,000,000	103,191,000		
特殊債券 小計		26,687,044,000	27,024,600,597	
社債券	第323回東京交通債券	100,000,000	116,794,000	
	第324回東京交通債券	100,000,000	113,926,000	
	第336回東京交通債券	100,000,000	102,329,000	
	一般担保第14回住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,919,000	
	一般担保第21回住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,051,000	
	第11回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク円貨社債	100,000,000	92,118,000	
	第7回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	200,000,000	183,956,000	
	第9回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	200,000,000	173,364,000	
	第14回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	100,000,000	82,451,000	
	第5回JPMorgan Chase and Company円貨債券	100,000,000	98,654,000	
	第2回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	100,000,000	99,065,000	
	第11回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	82,835,000	
	第15回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	86,315,000	
	第17回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	66,624,000	
	第22回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	83,636,000	
	第6回ザ・ベアー・スターズ・カンパニー・インク円貨社債	100,000,000	95,527,000	
	第3回ドイツ銀行AGロンドン支店円貨社債	100,000,000	96,474,000	
	第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債	100,000,000	84,936,000	
	第4回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債	200,000,000	191,762,000	
	第5回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債	100,000,000	89,403,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	味の素株式会社第17回無担保社債	100,000,000	98,236,000	

住友化学株式会社第29回無担保社債	100,000,000	100,535,000	
三菱化学株式会社第37回無担保社債	100,000,000	98,907,000	
三井化学株式会社第31回無担保社債	100,000,000	97,416,000	
新日本石油株式会社第21回無担保社債	100,000,000	100,431,000	
新日本石油株式会社第26回無担保社債	100,000,000	103,161,000	
株式会社ブリヂストン第4回無担保社債	100,000,000	98,795,000	
三井金属鉱業株式会社第4回無担保社債	100,000,000	99,970,000	
株式会社豊田自動織機第9回無担保社債	100,000,000	101,425,000	
株式会社豊田自動織機第12回無担保社債	200,000,000	200,756,000	
株式会社豊田自動織機第15回無担保社債	100,000,000	101,032,000	
松下電器産業株式会社第5回無担保社債	100,000,000	101,823,000	
ソニー株式会社第15回無担保社債	100,000,000	100,125,000	
ソニー株式会社第16回無担保社債	100,000,000	100,316,000	
ソニー株式会社第17回無担保社債	100,000,000	99,944,000	
松下電工株式会社第3回無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,479,000	
三菱重工業株式会社第17回無担保社債	100,000,000	98,149,000	
アイシン精機株式会社第5回無担保社債	100,000,000	99,098,000	
大日本印刷株式会社第1回無担保社債	200,000,000	203,874,000	
三井物産株式会社第12回無担保社債	100,000,000	105,383,000	
住友商事株式会社第29回無担保社債	100,000,000	101,211,000	
三菱商事株式会社第45回無担保社債	100,000,000	100,961,000	
三菱商事株式会社第46回無担保社債	100,000,000	99,131,000	
三菱商事株式会社第53回無担保社債	100,000,000	96,994,000	
三菱商事株式会社第70回無担保社債	100,000,000	99,708,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第3回無担保社債	100,000,000	101,595,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第4回無担保社債	200,000,000	203,002,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第9回無担保社債	100,000,000	101,638,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第11回無担保社債	200,000,000	200,832,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第13回無担保社債	100,000,000	101,225,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第1回無担保社債	100,000,000	101,600,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第19回無担保社債	100,000,000	101,622,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第77回無担保社債	100,000,000	100,908,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第80回無担保社債	200,000,000	200,160,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第83回無担保社債	200,000,000	206,666,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第85回無担保社債	200,000,000	203,256,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第92回無担保社債	100,000,000	101,987,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第98回無担保社債	100,000,000	100,778,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第3回2号無担保社債	200,000,000	198,814,000	
株式会社三井住友銀行第35回無担保社債	300,000,000	304,863,000	
株式会社三井住友銀行第36回無担保社債	300,000,000	305,190,000	
NTTファイナンス株式会社第32回無担保社債	100,000,000	102,214,000	
株式会社ホンダファイナンス第8回無担保社債	200,000,000	202,098,000	
トヨタファイナンス株式会社第14回無担保社債	100,000,000	99,904,000	
トヨタファイナンス株式会社第21回無担保社債	100,000,000	102,122,000	
トヨタファイナンス株式会社第25回無担保社債	100,000,000	101,211,000	
トヨタファイナンス株式会社第30回無担保社債	100,000,000	101,051,000	
オリックス株式会社第98回無担保社債	100,000,000	96,553,000	
野村證券株式会社第4回無担保社債	100,000,000	101,308,000	
三菱地所株式会社第30回無担保社債	100,000,000	106,705,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	三菱地所株式会社第53回無担保社債	100,000,000	101,642,000	

三菱地所株式会社第70回無担保社債	100,000,000	101,472,000	
三菱地所株式会社第79回無担保社債	100,000,000	99,528,000	
東日本旅客鉄道株式会社第7回社債(一般担保付)	200,000,000	227,228,000	
東日本旅客鉄道株式会社第21回無担保社債	100,000,000	100,006,000	
東日本旅客鉄道株式会社第23回無担保普通社債	100,000,000	100,995,000	
東日本旅客鉄道株式会社第27回無担保普通社債	100,000,000	102,265,000	
東日本旅客鉄道株式会社第33回無担保普通社債	100,000,000	104,088,000	
東日本旅客鉄道株式会社第37回無担保普通社債	100,000,000	102,057,000	
東日本旅客鉄道株式会社第43回無担保普通社債	100,000,000	99,892,000	
東日本旅客鉄道株式会社第50回無担保普通社債	100,000,000	102,494,000	
西日本旅客鉄道株式会社第7回社債(一般担保付)	100,000,000	106,690,000	
西日本旅客鉄道株式会社第11回無担保社債	100,000,000	101,185,000	
東海旅客鉄道株式会社第5回普通社債(一般担保付)	100,000,000	107,864,000	
東海旅客鉄道株式会社第20回無担保普通社債	200,000,000	203,588,000	
東海旅客鉄道株式会社第25回無担保普通社債	100,000,000	104,436,000	
東京地下鉄株式会社第3回社債(一般担保付)	100,000,000	103,356,000	
日本郵船株式会社第27回無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,755,000	
日本電信電話株式会社第43回電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	101,999,000	
日本電信電話株式会社第44回電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	102,268,000	
日本電信電話株式会社第47回電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	100,146,000	
日本電信電話株式会社第48回電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	102,725,000	
日本電信電話株式会社第51回電信電話債券(一般担保付)	200,000,000	209,510,000	
日本電信電話株式会社第52回電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	102,084,000	
株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第7回無担保社債	100,000,000	101,687,000	
株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第10回無担保社債	100,000,000	101,973,000	
株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第15回無担保社債	100,000,000	102,663,000	
東京電力株式会社第457回社債	100,000,000	103,536,000	
東京電力株式会社第478回社債	100,000,000	102,065,000	
東京電力株式会社第489回社債	100,000,000	101,943,000	
東京電力株式会社第491回社債	110,000,000	112,519,000	
東京電力株式会社第493回社債	100,000,000	102,357,000	
東京電力株式会社第496回社債	100,000,000	102,404,000	
東京電力株式会社第498回社債	100,000,000	101,110,000	
東京電力株式会社第507回社債	100,000,000	102,295,000	
東京電力株式会社第511回社債	100,000,000	102,840,000	
東京電力株式会社第513回社債	100,000,000	103,935,000	
東京電力株式会社第514回社債	100,000,000	102,495,000	
東京電力株式会社第515回社債	100,000,000	101,691,000	
東京電力株式会社第516回社債	100,000,000	101,487,000	
東京電力株式会社第518回社債	100,000,000	100,873,000	
東京電力株式会社第519回社債	100,000,000	102,025,000	
東京電力株式会社第521回社債	100,000,000	104,121,000	
東京電力株式会社第522回社債	100,000,000	104,482,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	東京電力株式会社第539回社債	100,000,000	100,046,000	
	東京電力株式会社第541回社債	100,000,000	100,952,000	

東京電力株式会社第542回社債	200,000,000	200,134,000	
東京電力株式会社第544回社債	100,000,000	103,176,000	
中部電力株式会社第405回社債	100,000,000	116,925,000	
中部電力株式会社第406回社債	200,000,000	229,836,000	
中部電力株式会社第426回社債	100,000,000	109,770,000	
中部電力株式会社第452回社債	100,000,000	101,801,000	
中部電力株式会社第466回社債	100,000,000	102,784,000	
中部電力株式会社第472回社債	100,000,000	100,755,000	
中部電力株式会社第478回社債	100,000,000	103,328,000	
中部電力株式会社第480回社債	100,000,000	102,403,000	
中部電力株式会社第484回社債	100,000,000	101,755,000	
関西電力株式会社第432回社債(一般担保付)	100,000,000	102,180,000	
関西電力株式会社第433回社債(一般担保付)	100,000,000	101,081,000	
関西電力株式会社第435回社債(一般担保付)	100,000,000	102,655,000	
関西電力株式会社第443回社債(一般担保付)	100,000,000	101,225,000	
関西電力株式会社第448回社債(一般担保付)	100,000,000	104,710,000	
関西電力株式会社第454回社債(一般担保付)	100,000,000	102,360,000	
関西電力株式会社第463回社債(一般担保付)	100,000,000	100,480,000	
関西電力株式会社第466回社債(一般担保付)	100,000,000	102,413,000	
中国電力株式会社第298回社債(一般担保付)	100,000,000	116,809,000	
中国電力株式会社第306回社債(一般担保付)	100,000,000	115,247,000	
中国電力株式会社第311回社債(一般担保付)	100,000,000	110,584,000	
中国電力株式会社第350回社債(一般担保付)	100,000,000	102,515,000	
中国電力株式会社第354回社債(一般担保付)	100,000,000	102,620,000	
北陸電力株式会社第277回社債(一般担保付)	100,000,000	101,957,000	
北陸電力株式会社第283回社債(一般担保付)	100,000,000	104,971,000	
北陸電力株式会社第288回社債(一般担保付)	100,000,000	102,669,000	
東北電力株式会社第383回社債(一般担保付)	100,000,000	110,608,000	
東北電力株式会社第402回社債(一般担保付)	100,000,000	101,727,000	
東北電力株式会社第408回社債(一般担保付)	100,000,000	102,334,000	
東北電力株式会社第414回社債(一般担保付)	100,000,000	98,268,000	
東北電力株式会社第416回社債(一般担保付)	100,000,000	93,545,000	
東北電力株式会社第420回社債(一般担保付)	100,000,000	101,757,000	
東北電力株式会社第435回社債(一般担保付)	100,000,000	103,234,000	
四国電力株式会社第249回社債(一般担保付)	100,000,000	102,204,000	
四国電力株式会社第253回社債(一般担保付)	100,000,000	86,917,000	
四国電力株式会社第257回社債(一般担保付)	100,000,000	101,402,000	
九州電力株式会社第363回社債(一般担保付)	100,000,000	101,946,000	
九州電力株式会社第366回社債(一般担保付)	100,000,000	102,392,000	
九州電力株式会社第371回社債(一般担保付)	100,000,000	92,688,000	
九州電力株式会社第372回社債(一般担保付)	100,000,000	99,521,000	
九州電力株式会社第376回社債(一般担保付)	100,000,000	102,504,000	
九州電力株式会社第384回社債(一般担保付)	100,000,000	99,709,000	
九州電力株式会社第387回社債(一般担保付)	100,000,000	102,555,000	
九州電力株式会社第391回社債(一般担保付)	100,000,000	102,645,000	
九州電力株式会社第399回社債(一般担保付)	100,000,000	100,055,000	
九州電力株式会社第405回社債(一般担保付)	100,000,000	101,302,000	
北海道電力株式会社第257回社債(一般担保付)	100,000,000	116,635,000	
北海道電力株式会社第282回社債(一般担保付)	100,000,000	102,155,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
社債券	北海道電力株式会社第284回社債(一般担保付)	100,000,000	101,240,000	
	北海道電力株式会社第285回社債(一般担保付)	100,000,000	102,345,000	

沖縄電力株式会社第9回社債(一般担保付)	100,000,000	94,342,000	
電源開発株式会社第14回無担保社債	100,000,000	101,929,000	
電源開発株式会社第16回無担保社債	100,000,000	104,327,000	
電源開発株式会社第17回無担保社債	200,000,000	209,684,000	
電源開発株式会社第19回無担保社債	200,000,000	206,238,000	
電源開発株式会社第21回無担保社債	100,000,000	101,025,000	
東京瓦斯株式会社第20回無担保社債	100,000,000	102,068,000	
大阪瓦斯株式会社第7回無担保社債	100,000,000	114,027,000	
大阪瓦斯株式会社第9回無担保社債	100,000,000	110,673,000	
大阪瓦斯株式会社第25回無担保社債	100,000,000	100,302,000	
株式会社エヌ・ティ・ティ・データ第20回無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,640,000	
社債券 小計	20,110,000,000	20,370,159,000	
合計	238,438,444,000	242,629,144,524	

(注) 代用有価証券で額面 50,000,000円 担保差入

なお、代用有価証券の担保差入券面額には、約定未受渡券面額を含んでおります。

#### 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。

[次へ](#)

## 「中央三井外国株式マザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

項目	平成21年6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	6,364,675,420
コール・ローン	2,511,123,006
株式	282,166,682,558
投資信託受益証券	64,825,655
投資証券	3,643,973,390
派生商品評価勘定	627,880,697
未収入金	4,840,612
未収配当金	936,803,746
未収利息	6,743
差入委託証拠金	2,160,961,558
流動資産合計	298,481,773,385
資産合計	298,481,773,385
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,616,801
未払金	289,109
未払解約金	779,204,605
流動負債合計	782,110,515
負債合計	782,110,515
純資産の部	
元本等	
元本	351,477,881,228
剰余金	
欠損金	53,778,218,358
純資産合計	297,699,662,870
負債・純資産合計	298,481,773,385

## (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6月10日現在

1．有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資信託受益証券及び投資証券 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、時価で評価しております。
2．デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3．外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4．収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券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入金日基準で計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
5．その他	<p>外貨建資産等の会計処理 外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	平成21年6月10日現在
1．計算日における受益権総数	351,477,881,228 □

2. 「投資信託財産の計算に関する規則 (平成12年総理府令第133号)」第55 条の6第10号に規定する額	元本の欠損 53,778,218,358 円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8470 円 (8,470 円)

## (関連当事者との取引に関する注記)

平成21年6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6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6月10日現在	
計算期間の期首元本額	240,232,205,493 円
計算期間中の追加設定元本額	158,801,292,347 円
計算期間中の一部解約元本額	47,555,616,612 円
計算日の元本額	351,477,881,228 円
計算日の元本額の内訳	
中央三井外国株式インデックスファンド	4,240,433,039 円
中央三井DC外国株式インデックスファンド	2,156,523,310 円
中央三井DC外国株式インデックスファンドL	12,442,814,806 円
中央三井DCバランスファンド30	77,638,490 円
中央三井DCバランスファンド50	256,929,094 円
中央三井DCバランスファンド70	182,694,672 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	425,855,863 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	249,615,486 円
新生・4分散ファンド	281,038,513 円
ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド	515,148,815 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	151,887,582 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	284,207,604 円
中央三井外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	28,072,667,886 円
中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)	8,227,415,430 円
中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)	60,134,919,231 円
中央三井VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	45,208,548,644 円
中央三井VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	6,649,468,187 円
中央三井VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	509,025,162 円
為替ヘッジ付外国株式ファンド(適格機関投資家専用)	8,457,486,668 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)	39,332,328,107 円
中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)	4,755,996,709 円
中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,385,286,547 円
中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)	43,694,868,685 円
中央三井バランスVA75(適格機関投資家専用)	2,972,119,514 円
中央三井VL株式30(適格機関投資家専用)	7,281,851 円
中央三井VL株式50(適格機関投資家専用)	14,864,062 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)	59,438,173,497 円
中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	6,865,805,152 円
中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	255,194,908 円
中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)	3,909,207,347 円
中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	2,963,306,391 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)	1,205,453,801 円
CMAM私募外国株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	2,219,197,092 円
CMAM・VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	1,591,862,806 円
中央三井バランスVA20(適格機関投資家専用)	1,342,616,277 円

## 2. 有価証券関係

### 売買目的有価証券

平成21年6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	282,166,682,558	23,295,448,860
投資信託受益証券	64,825,655	8,781,614
投資証券	3,643,973,390	240,723,550
合計	285,875,481,603	23,544,954,024

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「中央三井外国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2月10日から平成21年6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6月10日現在
<p>1. 取引の内容</p> <p>当ファンドの利用している取引は、株式関連では株価指数先物取引であり、また通貨関連では為替予約取引であります。</p> <p>2. 取引に対する取組方針</p> <p>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価格変動リスクの回避を目的としており、為替予約取引は、運用の効率化を図るため、将来の為替変動リスクの回避目的に限定せず利用する場合があります。ただし、いずれのデリバティブ取引においても、投機目的の取引は行わない方針であります。</p>

### 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、為替予約取引は、原則としてファンド運用の効率化を図るため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。また、為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。

### 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6月10日現在			
		契約額等（円）		時価 （円）	評価損益 （円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	10,848,799,021		11,424,193,546	575,394,525
	合計	10,848,799,021		11,424,193,546	575,394,525

#### （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、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2．株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3．計算日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

#### 通貨関連

区分	種類	平成21年6月10日現在			
		契約額等（円）		時価 （円）	評価損益 （円）
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買 建				
	米ドル	1,172,559,520		1,188,583,440	16,023,920
	ユーロ	369,136,303		384,235,590	15,099,287
	英ポンド	233,625,204		252,395,680	18,770,476
	計	1,775,321,027		1,825,214,710	49,893,683
	売 建				
	米ドル	193,756,980		193,756,980	0
	カナダドル	28,606,825		28,606,500	325
	ユーロ	50,566,420		50,579,000	12,580
	英ポンド	33,754,962		33,771,150	16,188
	スイスフラン	14,417,760		14,419,200	1,440
	スウェーデンクローナ	12,593,440		12,588,480	4,960
	ノルウェークローネ	9,452,550		9,458,700	6,150
	オーストラリアドル	14,644,636		14,632,040	12,596
	香港ドル	14,628,345		14,634,180	5,835
	計	372,421,918		372,446,230	24,312
	合計	2,147,742,945		2,197,660,940	49,869,371

## (注) 時価の算定方法

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

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

[次へ](#)

## (3) 附属明細表(平成21年6月10日現在)

## 有価証券明細表

## A. 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	91,600	48.46	4,438,936.00	
	APACHE CORP	61,412	83.70	5,140,184.40	
	ARCH COAL INC	27,100	18.82	510,022.00	
	BAKER HUGHES INC	56,523	39.64	2,240,571.72	
	BJ SERVICES CO	53,600	15.50	830,800.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	19,000	36.03	684,570.00	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	40,300	30.64	1,234,792.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	105,600	22.88	2,416,128.00	
	CHEVRON CORP	367,842	70.19	25,818,829.98	
	CIMAREX ENERGY CO	15,300	33.81	517,293.00	
	CONOCOPHILLIPS	258,100	45.55	11,756,455.00	
	CONSOL ENERGY INC	33,300	41.92	1,395,936.00	
	DENBURY RESOURCES INC	45,400	16.50	749,100.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	77,400	64.15	4,965,210.00	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	12,800	91.21	1,167,488.00	
	EL PASO CORP	128,200	9.93	1,273,026.00	
	ENSCO INTERNATIONAL INC	26,100	40.17	1,048,437.00	
	EOG RESOURCES INC	45,800	74.65	3,418,970.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	906,676	73.12	66,296,149.12	
	FMC TECHNOLOGIES INC	23,000	41.49	954,270.00	
	HALLIBURTON CO	164,000	22.94	3,762,160.00	
	HELMERICH & PAYNE	19,400	33.58	651,452.00	
	HESS CORP	53,900	58.93	3,176,327.00	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	13,341	45.36	605,147.76	
	MARATHON OIL CORP	129,500	32.73	4,238,535.00	
	MURPHY OIL CORP	33,300	59.24	1,972,692.00	
	NABORS INDUSTRIES INC	52,300	18.43	963,889.00	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	76,621	38.23	2,929,220.83	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	24,300	35.70	867,510.00	
	NOBLE CORP	48,500	36.21	1,756,185.00	
	NOBLE ENERGY INC	31,700	66.10	2,095,370.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	148,680	69.04	10,264,867.20	
	PATTERSON-UTI ENERGY INC	29,400	14.39	423,066.00	
	PEABODY ENERGY CORP	49,000	35.68	1,748,320.00	
	PETROHAWK ENERGY CORP	50,400	24.74	1,246,896.00	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	21,600	27.91	602,856.00	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION CO	22,000	30.61	673,420.00	
	PRIDE INTERNATIONAL INC	31,800	25.15	799,770.00	
	RANGE RESOURCES CORP	28,600	45.67	1,306,162.00	
	ROWAN COMPANIES INC	21,200	22.55	478,060.00	
SCHLUMBERGER LIMITED	219,540	58.85	12,919,929.00		
SMITH INTERNATIONAL INC	40,200	30.46	1,224,492.00		
SOUTHWESTERN ENERGY CO	63,200	42.77	2,703,064.00		
SPECTRA ENERGY CORP	118,078	16.81	1,984,891.18		
SUNOCO INC	21,500	27.98	601,570.00		
TRANSOCEAN LTD	58,624	83.06	4,869,309.44		
ULTRA PETROLEUM CORP	27,700	45.66	1,264,782.00		

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	VALERO ENERGY CORP	94,764	18.15	1,719,966.60	
	WEATHERFORD INTL LTD	128,048	21.32	2,729,983.36	
	WILLIAMS COS INC	106,220	16.96	1,801,491.20	
	XTO ENERGY INC	100,616	41.26	4,151,416.16	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	38,500	68.31	2,629,935.00	
	AIRGAS INC	13,400	42.27	566,418.00	
	ALCOA INC	174,400	11.15	1,944,560.00	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	16,000	41.97	671,520.00	
	BALL CORP	16,500	44.41	732,765.00	
	CELANESE CORP-SERIES A	26,400	23.13	610,632.00	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,500	80.17	681,445.00	
	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	23,600	30.12	710,832.00	
	CROWN HOLDINGS INC	29,200	24.20	706,640.00	
	DOW CHEMICAL COMPANY	193,702	17.87	3,461,454.74	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	165,646	26.93	4,460,846.78	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	13,400	41.86	560,924.00	
	ECOLAB INC	43,800	38.35	1,679,730.00	
	FMC CORP	12,600	53.93	679,518.00	
	FREEMONT-MCMORAN COPPER-B	75,538	58.96	4,453,720.48	
	INTERNATIONAL PAPER CO	74,600	14.61	1,089,906.00	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	14,436	32.96	475,810.56	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	7,700	78.36	603,372.00	
	MEADWESTVACO CORP	31,400	16.70	524,380.00	
	MONSANTO CO	100,600	85.07	8,558,042.00	
	MOSAIC CO/THE	28,600	53.73	1,536,678.00	
	NEWMONT MINING CORP HOLDING CO	87,750	44.89	3,939,097.50	
	NUCOR CORP	57,700	47.76	2,755,752.00	
	OWENS-ILLINOIS INC	30,700	29.50	905,650.00	
	PACTIV CORPORATION	24,200	21.87	529,254.00	
	PPG INDUSTRIES INC.	30,200	45.52	1,374,704.00	
	PRAXAIR INC	56,614	76.09	4,307,759.26	
	SEALED AIR CORP	29,000	19.49	565,210.00	
	SIGMA-ALDRICH	22,500	50.27	1,131,075.00	
	UNITED STATES STEEL CORP	25,600	37.82	968,192.00	
	VULCAN MATERIALS COMPANY	20,300	44.62	905,786.00	
	WEYERHAEUSER CO	38,833	34.06	1,322,651.98	
	3M COMPANY	120,838	60.34	7,291,364.92	
	AGCO CORP	16,900	29.21	493,649.00	
	AMETEK INC	19,600	34.89	683,844.00	
	BOEING COMPANY	126,595	52.35	6,627,248.25	
	CATERPILLAR INC	110,700	38.24	4,233,168.00	
COOPER INDUSTRIES INC-CL A	30,700	34.17	1,049,019.00		
CUMMINS INC	35,200	35.99	1,266,848.00		
DANAHER CORP	49,702	63.99	3,180,430.98		
DEERE & CO	77,626	45.94	3,566,138.44		
DOVER CORP	34,200	35.85	1,226,070.00		
EATON CORP	28,800	48.92	1,408,896.00		
EMERSON ELECTRIC CO	138,600	35.11	4,866,246.00		
FASTENAL CO	24,500	35.62	872,690.00		

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
----	----	-----	-----------	-----------	----

米ドル	FIRST SOLAR INC	8,200	182.88	1,499,616.00	
	FLOWSERVE CORP	10,400	82.27	855,608.00	
	FLUOR CORP	33,400	53.90	1,800,260.00	
	FOSTER WHEELER AG	23,200	27.92	647,744.00	
	GENERAL DYNAMICS CORPORATION	60,300	59.25	3,572,775.00	
	GENERAL ELECTRIC	1,939,045	13.57	26,312,840.65	
	GOODRICH CORP	22,600	53.33	1,205,258.00	
	GRAINGER (W.W.) INC	11,900	84.32	1,003,408.00	
	HARSCO CORP	15,400	30.99	477,246.00	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	128,100	35.72	4,575,732.00	
	ILLINOIS TOOL WORKS	77,876	37.26	2,901,659.76	
	INGERSOLL-RAND CO	58,568	22.83	1,337,107.44	
	ITT CORPORATION	31,700	45.81	1,452,177.00	
	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	22,600	44.98	1,016,548.00	
	JOY GLOBAL INC	18,800	41.00	770,800.00	
	KBR INC	29,700	18.89	561,033.00	
	L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	22,000	74.20	1,632,400.00	
	LOCKHEED MARTIN CORPORATION	61,700	84.01	5,183,417.00	
	MASCO CORP	67,700	10.18	689,186.00	
	MCDERMOTT INTL INC	41,900	22.14	927,666.00	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	57,000	48.34	2,755,380.00	
	PACCAR INC	63,275	34.15	2,160,841.25	
	PALL CORP	21,800	28.95	631,110.00	
	PARKER HANNIFIN CORP	29,650	47.26	1,401,259.00	
	PENTAIR INC	17,200	28.46	489,512.00	
	PRECISION CASTPARTS CORP	25,600	86.51	2,214,656.00	
	QUANTA SERVICES INC	36,100	25.41	917,301.00	
	RAYTHEON COMPANY	73,500	44.98	3,306,030.00	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	26,000	33.10	860,600.00	
	ROCKWELL COLLONS	29,100	45.94	1,336,854.00	
	ROPER INDUSTRIES INC	16,500	47.39	781,935.00	
	SPX CORP	10,000	49.55	495,500.00	
	SUNPOWER CORP-CLASS A	9,700	30.55	296,335.00	
	SUNPOWER CORP-CLASS B-W/I	8,200	27.36	224,352.00	
	TEXTRON INC	48,700	11.95	581,965.00	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	86,832	27.54	2,391,353.28	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	164,500	55.52	9,133,040.00	
	URS CORP	15,300	52.45	802,485.00	
	AVERY DENNISON CORP	17,600	28.10	494,560.00	
	CINTAS CORP	25,300	22.96	580,888.00	
DUN & BRADSTREET CORP	9,900	83.91	830,709.00		
EQUIFAX INC	23,200	26.98	625,936.00		
FTI CONSULTING INC	9,700	51.76	502,072.00		
IHS INC-CLASS A	9,500	49.57	470,915.00		
IRON MOUNTAIN INC	33,400	28.83	962,922.00		
MANPOWER INC	14,400	45.73	658,512.00		
PITNEY BOWES INC	37,906	22.26	843,787.56		
REPUBLIC SERVICES INC	69,270	22.66	1,569,658.20		
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	27,100	23.15	627,365.00		

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	RR DONNELLEY & SONS CO	37,700	14.09	531,193.00	
	STERICYCLE INC	14,900	49.87	743,063.00	

WASTE MANAGEMENT INC	85,700	27.83	2,385,031.00	
BURLINGTON NORTHERN SANTA FE	62,275	76.32	4,752,828.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	31,100	53.80	1,673,180.00	
CSX CORP	73,300	35.27	2,585,291.00	
DELTA AIR LINES INC	30,600	6.90	211,140.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	39,000	34.90	1,361,100.00	
FEDEX CORP	54,295	57.06	3,098,072.70	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	16,200	32.92	533,304.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	67,300	41.13	2,768,049.00	
SOUTHWEST AIRLINES	35,900	6.81	244,479.00	
UNION PACIFIC CORPORATION	92,360	53.92	4,980,051.20	
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	124,320	51.88	6,449,721.60	
BORGWARNER INC	21,300	34.95	744,435.00	
FORD MOTOR CO	512,270	6.26	3,206,810.20	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	43,000	13.50	580,500.00	
HARLEY-DAVIDSON INC	42,800	17.00	727,600.00	
JOHNSON CONTROLS INC	109,042	22.11	2,410,918.62	
BLACK & DECKER CORP	11,090	31.89	353,660.10	
COACH INC	58,900	27.94	1,645,666.00	
DR HORTON INC	52,300	9.69	506,787.00	
FORTUNE BRANDS INC	27,600	37.06	1,022,856.00	
GARMIN LTD	22,100	23.73	524,433.00	
HASBRO INC	23,000	25.45	585,350.00	
LEGGETT & PLATT INC	28,700	16.38	470,106.00	
MATTEL INC	65,800	16.26	1,069,908.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	10,700	42.25	452,075.00	
NEWELL RUBBERMAID INC	50,900	11.63	591,967.00	
NIKE INC. CLASS B	67,900	58.66	3,983,014.00	
POLO RALPH LAUREN CORP	10,200	56.63	577,626.00	
PULTE HOMES INC	40,200	9.56	384,312.00	
STANLEY WORKS	13,100	37.01	484,831.00	
TOLL BROTHERS INC	24,800	18.03	447,144.00	
VF CORP	16,200	59.57	965,034.00	
WHIRLPOOL CORP	13,500	43.85	591,975.00	
APOLLO GROUP INC-CL A	24,800	64.75	1,605,800.00	
CARNIVAL CORP	80,200	25.03	2,007,406.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	24,200	34.59	837,078.00	
DEVRY INC	11,900	46.85	557,515.00	
H&R BLOCK INC	62,200	15.76	980,272.00	
INTL GAME TECHNOLOGY	54,100	16.95	916,995.00	
ITT EDUCATIONAL SERVICES INC	7,100	93.88	666,548.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	58,600	9.75	571,350.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	54,600	24.88	1,358,448.00	
MC DONALD'S CORPORATION	204,556	59.08	12,085,168.48	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	26,100	14.23	371,403.00	
STARBUCKS CORP	134,600	15.20	2,045,920.00	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	33,620	25.78	866,723.60	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	TIM HORTONS INC	33,303	26.75	890,855.25	
	WYNN RESORTS LTD	13,400	38.31	513,354.00	
	YUM BRANDS INC	84,900	35.61	3,023,289.00	
	CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	44,400	18.87	837,828.00	

CBS CORP-CL B	108,470	8.68	941,519.60	
COMCAST CORP-CL A	359,123	14.40	5,171,371.20	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	148,750	13.74	2,043,825.00	
DIRECTV GROUP INC/THE	93,400	23.35	2,180,890.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	24,684	23.55	581,308.20	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	25,884	21.57	558,317.88	
DISH NETWORK CORP-A	38,300	16.08	615,864.00	
INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES	87,460	5.85	511,641.00	
LIBERTY GLOBAL INC-A	25,053	14.16	354,750.48	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	23,100	13.87	320,397.00	
LIBERTY MEDIA CORP-ENT SER A	90,556	24.98	2,262,088.88	
MCGRAW-HILL INC	57,800	31.73	1,833,994.00	
NEWS CORP INC CLASS A	333,105	10.46	3,484,278.30	
NEWS CORP INC CLASS B	80,665	11.81	952,653.65	
OMNICOM GROUP	57,100	32.64	1,863,744.00	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	16,400	28.71	470,844.00	
THE WALT DISNEY CO.	323,558	25.33	8,195,724.14	
TIME WARNER CABLE	64,641	32.21	2,082,086.61	
TIME WARNER INC	219,462	26.49	5,813,548.38	
VIACOM INC-CLASS B	100,670	22.85	2,300,309.50	
VIRGIN MEDIA INC	52,350	8.66	453,351.00	
WASHINGTON POST -CL B	1,200	351.86	422,232.00	
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	16,000	27.89	446,240.00	
ADVANCE AUTO PARTS	17,450	44.35	773,907.50	
AMAZON.COM INC	63,000	87.08	5,486,040.00	
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	34,000	14.61	496,740.00	
AUTONATION INC	21,100	17.78	375,158.00	
AUTOZONE INC	6,400	160.27	1,025,728.00	
BED BATH & BEYOND INC	47,700	29.74	1,418,598.00	
BEST BUY CO INC	64,350	39.52	2,543,112.00	
CARMAX INC	40,500	13.61	551,205.00	
DOLLAR TREE INC	16,600	44.32	735,712.00	
EXPEDIA INC	36,050	16.73	603,116.50	
FAMILY DOLLAR STORES	24,400	30.85	752,740.00	
GAMESTOP CORP-CLASS A	28,600	25.00	715,000.00	
GAP INC/THE	91,400	16.94	1,548,316.00	
GENUINE PARTS CO	29,300	34.05	997,665.00	
HOME DEPOT INC	311,704	24.35	7,589,992.40	
J.C. PENNEY CO INC (HLDG CO)	38,800	28.97	1,124,036.00	
KOHL'S CORP	53,120	46.67	2,479,110.40	
LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	103,647	5.90	611,517.30	
LIMITED BRANDS	50,330	12.80	644,224.00	
LOWE'S COS INC	268,996	20.46	5,503,658.16	
MACY'S INC	77,252	12.82	990,370.64	
NORDSTROM INC	29,700	21.37	634,689.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	24,700	38.04	939,588.00	
	PETSMART INC	23,400	21.31	498,654.00	
	PRICELINE.COM INC	7,100	118.00	837,800.00	
	ROSS STORES INC	24,200	39.87	964,854.00	
	SEARS HOLDING CORP	10,285	69.40	713,779.00	
	SHERWIN-WILLIAMS CO	18,300	55.91	1,023,153.00	

STAPLES INC	130,550	20.96	2,736,328.00	
TARGET CORP	131,220	41.14	5,398,390.80	
TIFFANY & CO	22,800	29.65	676,020.00	
TJX COMPANIES INC	76,400	30.99	2,367,636.00	
URBAN OUTFITTERS INC	23,100	22.01	508,431.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	79,300	47.13	3,737,409.00	
CVS CAREMARK CORP	263,583	30.82	8,123,628.06	
KROGER CO	113,800	22.33	2,541,154.00	
SAFeway INC	78,700	21.26	1,673,162.00	
SUPERVALU INC	38,878	16.86	655,483.08	
SYSCO CORP	108,190	23.82	2,577,085.80	
WAL-MART STORES	431,826	50.61	21,854,713.86	
WALGREEN CO	181,506	31.11	5,646,651.66	
WHOLE FOODS MARKET INC	25,800	21.62	557,796.00	
ALTRIA GROUP INC	378,075	17.35	6,559,601.25	
ARCHER DANIELS MIDLAND COMPANY	106,010	28.25	2,994,782.50	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,780	45.27	669,090.60	
BUNGE LIMITED	22,400	65.41	1,465,184.00	
CAMPBELL SOUP	39,800	28.95	1,152,210.00	
COCA-COLA CO/THE	382,134	49.09	18,758,958.06	
COCA-COLA ENTERPRISES	53,800	17.39	935,582.00	
CONAGRA FOODS INC	82,050	19.60	1,608,180.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	35,800	12.46	446,068.00	
DEAN FOODS CO	33,050	18.42	608,781.00	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	46,586	22.59	1,052,377.74	
GENERAL MILLS INC	60,190	54.41	3,274,937.90	
HANSEN NATURAL CORPORATION	14,400	34.00	489,600.00	
HEINZ (H.J.) CO	57,700	36.23	2,090,471.00	
HERSHEY CO/THE	29,100	35.33	1,028,103.00	
HORMEL FOODS CORP	13,700	35.05	480,185.00	
JM SMUCKER CO/THE	21,700	43.75	949,375.00	
KELLOGG CO	49,100	43.94	2,157,454.00	
KRAFT FOODS INC-A	269,618	26.21	7,066,687.78	
LORILLARD INC	30,887	66.95	2,067,884.65	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	21,600	30.87	666,792.00	
MOLSON COORS BREWING CO -B	27,800	44.71	1,242,938.00	
PEPSI BOTTLING GROUP INC	27,200	33.15	901,680.00	
PEPSIAMERICAS INC	11,700	26.41	308,997.00	
PEPSICO INC	285,496	53.48	15,268,326.08	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	367,675	43.85	16,122,548.75	
RALCORP HOLDINGS INC	10,400	61.41	638,664.00	
REYNOLDS AMERICAN INC	32,100	38.20	1,226,220.00	
SARA LEE CORP	121,300	9.03	1,095,339.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	TYSON FOODS INC-CL A	53,700	13.23	710,451.00	
	AVON PRODUCTS, INC	78,240	26.81	2,097,614.40	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	12,900	50.33	649,257.00	
	CLOROX COMPANY	25,500	53.67	1,368,585.00	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	92,700	70.17	6,504,759.00	
	ENERGIZER HOLDINGS INC	11,800	53.48	631,064.00	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	20,700	33.71	697,797.00	
	KIMBERLY-CLARK CORP	75,947	52.58	3,993,293.26	

PROCTER & GAMBLE CO	537,815	52.41	28,186,884.15	
AETNA INC	84,700	23.93	2,026,871.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	28,000	35.74	1,000,720.00	
BARD (C.R.) INC	18,300	74.08	1,355,664.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC	112,710	46.80	5,274,828.00	
BECKMAN COULTER INC	11,500	54.03	621,345.00	
BECTON DICKINSON & CO	44,000	68.01	2,992,440.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	275,486	9.40	2,589,568.40	
CARDINAL HEALTH INC	66,054	29.88	1,973,693.52	
CERNER CORP	12,600	57.78	728,028.00	
CIGNA CORP	49,900	20.41	1,018,459.00	
COVENTRY HEALTH CARE INC	27,350	17.40	475,890.00	
COVIDIEN PLC	92,432	35.40	3,272,092.80	
DAVITA INC	19,100	46.06	879,746.00	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	26,000	29.09	756,340.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10,200	64.40	656,880.00	
EXPRESS SCRIPTS INC	43,200	63.64	2,749,248.00	
HENRY SCHEIN INC	16,400	45.23	741,772.00	
HOLOGIC INC	47,044	13.77	647,795.88	
HOSPIRA INC	29,315	34.32	1,006,090.80	
HUMANA INC	31,000	29.20	905,200.00	
IMS HEALTH INC	33,400	11.90	397,460.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	7,200	156.76	1,128,672.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	19,900	60.49	1,203,751.00	
MCKESSON CORP	50,200	41.40	2,078,280.00	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	90,110	44.35	3,996,378.50	
MEDTRONIC, INCORPORATED	205,245	34.08	6,994,749.60	
OMNICARE INC	21,800	24.46	533,228.00	
PATTERSON COS INC	16,800	20.31	341,208.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	29,800	51.20	1,525,760.00	
ST JUDE MEDICAL INC	63,200	39.07	2,469,224.00	
STRYKER CORP	54,600	40.63	2,218,398.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	223,068	25.98	5,795,306.64	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	22,800	36.80	839,040.00	
WELLPOINT INC	91,498	45.50	4,163,159.00	
ZIMMER HOLDINGS INC	41,300	42.40	1,751,120.00	
ABBOTT LABORATORIES	283,553	44.35	12,575,575.55	
ALLERGAN INC	55,800	44.46	2,480,868.00	
AMGEN INC	192,162	50.75	9,752,221.50	
BIOGEN IDEC INC	54,557	52.38	2,857,695.66	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	363,275	19.45	7,065,698.75	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	CELGENE CORP	84,100	44.25	3,721,425.00	
	CEPHALON INC	13,500	58.82	794,070.00	
	CHARLES RIVER LABORATORIES	12,500	31.11	388,875.00	
	COVANCE INC	11,700	44.87	524,979.00	
	ELI LILLY & CO	187,833	33.91	6,369,417.03	
	FOREST LABORATORIES INC	55,300	23.29	1,287,937.00	
	GENZYME CORP - GENL DIVISION	49,700	60.58	3,010,826.00	
	GILEAD SCIENCES INC	167,100	44.58	7,449,318.00	
	ILLUMINA INC	22,800	38.32	873,696.00	
	JOHNSON & JOHNSON	507,470	55.70	28,266,079.00	

LIFE TECHNOLOGIES CORP	31,900	39.57	1,262,283.00	
MERCK & CO. INC.	387,958	25.72	9,978,279.76	
MILLIPORE CORP	10,200	67.01	683,502.00	
MYLAN INC	56,000	13.55	758,800.00	
MYRIAD GENETICS INC	17,400	37.03	644,322.00	
PERRIGO CO	14,900	25.79	384,271.00	
PFIZER	1,237,286	14.13	17,482,851.18	
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVEL	19,500	21.12	411,840.00	
SCHERING-PLOUGH CORP	298,400	23.57	7,033,288.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	77,200	40.79	3,148,988.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	29,600	30.55	904,280.00	
WARNER CHILCOTT LTD-CLASS A	19,500	12.84	250,380.00	
WATERS CORPORATION	18,100	46.82	847,442.00	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	18,200	30.00	546,000.00	
WYETH	244,360	43.90	10,727,404.00	
ASSOCIATED BANC-CORP	22,300	13.88	309,524.00	
BB&T CORPORATION	116,600	22.45	2,617,670.00	
COMERICA INC	27,700	21.51	595,827.00	
FIFTH THIRD BANCORP	95,443	7.17	684,326.31	
HUDSON CITY BANCORP INC	86,100	12.84	1,105,524.00	
KEYCORP	90,840	5.64	512,337.60	
M & T BANK CORP	13,900	49.21	684,019.00	
MARSHALL & ILSLEY CORP	43,899	6.58	288,855.42	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	60,000	10.62	637,200.00	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN	63,900	15.57	994,923.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	81,288	44.18	3,591,303.84	
REGIONS FINANCIAL CORP	200,937	4.06	815,804.22	
SUNTRUST BANKS INC	64,208	17.06	1,095,388.48	
TFS FINANCIAL CORP	17,200	11.25	193,500.00	
US BANCORP	348,157	18.18	6,329,494.26	
WELLS FARGO & COMPANY	802,720	25.66	20,597,795.20	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	191,601	26.93	5,159,814.93	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	39,780	28.39	1,129,354.20	
BANK OF AMERICA CORP	1,404,100	12.06	16,933,446.00	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	210,792	28.79	6,068,701.68	
BLACKROCK INC	4,000	182.14	728,560.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	82,884	24.05	1,993,360.20	
CITIGROUP INC	999,966	3.41	3,409,884.06	
CME GROUP INC	11,100	332.99	3,696,189.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	88,057	9.67	851,511.19	
	EATON VANCE CORP	20,100	29.73	597,573.00	
	FRANKLIN RESOURCES INC	29,900	76.70	2,293,330.00	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	87,700	149.31	13,094,487.00	
	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	11,300	117.84	1,331,592.00	
	INVESCO LTD	75,411	18.04	1,360,414.44	
	JEFFERIES GROUP INC (NEW)	18,000	21.57	388,260.00	
	JPMORGAN CHASE & CO	684,887	35.26	24,149,115.62	
	LEGG MASON INC	25,900	24.65	638,435.00	
	LEUCADIA NATIONAL CORP	34,200	22.42	766,764.00	
	MOODY'S CORP	37,400	29.33	1,096,942.00	
	MORGAN STANLEY	202,714	30.98	6,280,079.72	

NASDAQ OMX GROUP	25,800	22.05	568,890.00	
NORTHERN TRUST CORP	39,400	56.36	2,220,584.00	
NYSE GROUP INC	48,600	30.68	1,491,048.00	
SCHWAB (CHARLES) CORP	180,200	18.30	3,297,660.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	25,200	17.75	447,300.00	
SLM CORP	85,800	7.91	678,678.00	
STATE STREET CORP	89,173	48.26	4,303,488.98	
T ROWE PRICE GROUP INC	46,978	44.68	2,098,977.04	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	43,500	18.41	800,835.00	
ACE LTD	61,300	45.85	2,810,605.00	
AFLAC INC	85,610	33.76	2,890,193.60	
ALLSTATE CORP	93,460	25.46	2,379,491.60	
AMERICAN INT'L GROUP	444,276	1.65	733,055.40	
AON CORP	44,600	36.81	1,641,726.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	7,800	59.14	461,292.00	
ASSURANT INC	21,600	23.74	512,784.00	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	24,700	26.41	652,327.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	2,020	2,978.00	6,015,560.00	
CHUBB CORP	65,318	41.07	2,682,610.26	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	28,371	24.02	681,471.42	
EVEREST RE GROUP LTD	11,300	73.07	825,691.00	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC CL-A	39,065	13.15	513,704.75	
FIRST AMERICAN CORPORATION	14,500	23.40	339,300.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GR	59,700	14.28	852,516.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	47,007	18.64	876,210.48	
LOEWS CORP	63,890	28.05	1,792,114.50	
MARSH & MCLENNAN COS	94,339	20.34	1,918,855.26	
METLIFE INC	145,640	33.03	4,810,489.20	
OLD REPUBLIC INTL CORP	43,150	10.11	436,246.50	
PARTNERRE LTD	10,200	67.54	688,908.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	57,000	21.97	1,252,290.00	
PROGRESSIVE CORP	117,800	16.65	1,961,370.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	77,486	39.51	3,061,471.86	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	11,300	47.41	535,733.00	
TORCHMARK CORP	15,700	39.44	619,208.00	
TRAVELERS COS INC/THE	107,313	44.04	4,726,064.52	
UNUM GROUP	60,800	16.95	1,030,560.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	WHITE MOUNTAINS INSURANCE GP	1,500	209.92	314,880.00	
	WILLIS GROUP HOLDINGS LTD	30,600	28.48	871,488.00	
	WR BERKLEY CORP	26,650	23.53	627,074.50	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	99,400	14.79	1,470,126.00	
	RAYONIER INC	14,500	40.06	580,870.00	
	ACCENTURE LTD-CL A	111,500	30.28	3,376,220.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	109,400	12.74	1,393,756.00	
	ADOBE SYSTEMS INC	96,200	29.77	2,863,874.00	
	AFFILIATED COMPUTER SVCS-A	16,700	45.48	759,516.00	
	AKAMAI TECHNOLOGIES	31,100	22.29	693,219.00	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	11,900	45.84	545,496.00	
	AUTODESK INC	41,600	22.46	934,336.00	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	93,200	38.30	3,569,560.00	
	BMC SOFTWARE INC	34,500	34.91	1,204,395.00	

CA INC	76,100	17.85	1,358,385.00	
CITRIX SYSTEMS INC	33,400	32.72	1,092,848.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	53,500	27.48	1,470,180.00	
COMPUTER SCIENCES CORP	27,800	43.69	1,214,582.00	
DST SYSTEMS INC	7,300	38.67	282,291.00	
EBAY INC	199,172	17.71	3,527,336.12	
ELECTRONIC ARTS INC	58,910	22.00	1,296,020.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	34,958	20.26	708,249.08	
FISERV INC	29,400	46.07	1,354,458.00	
GOOGLE INC-CLASS A	44,100	435.62	19,210,842.00	
INTUIT INC	56,300	28.59	1,609,617.00	
LENDER PROCESSING SERVICES	17,500	29.26	512,050.00	
MASTERCARD INC-CLASS A	16,300	168.18	2,741,334.00	
MCAFEE INC	28,100	40.57	1,140,017.00	
METAVANTE TECHNOLOGIES	16,500	26.88	443,520.00	
MICROSOFT CORP	1,468,991	22.08	32,435,321.28	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	36,200	14.17	512,954.00	
ORACLE CORP	740,676	20.99	15,546,789.24	
PAYCHEX INC	59,600	27.65	1,647,940.00	
RED HAT INC	34,900	20.50	715,450.00	
SAIC INC	37,200	18.23	678,156.00	
SALESFORCE.COM INC	20,100	39.58	795,558.00	
SYMANTEC CORP	150,700	16.53	2,491,071.00	
SYNOPSYS INC	26,500	19.97	529,205.00	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	30,775	14.27	439,159.25	
VERISIGN INC	35,700	18.93	675,801.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	82,400	68.63	5,655,112.00	
VMWARE INC-CLASS A	8,700	32.66	284,142.00	
WESTERN UNION CO	131,348	17.03	2,236,856.44	
YAHOO! INC	241,900	16.40	3,967,160.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	65,700	19.72	1,295,604.00	
AMPHENOL CORP-CL A	31,500	32.91	1,036,665.00	
APPLE INC	163,400	142.72	23,320,448.00	
ARROW ELECTRONICS INC	21,900	23.13	506,547.00	
AVNET INC	27,700	22.85	632,945.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	CISCO SYSTEMS INC	1,071,013	20.08	21,505,941.04	
	CORNING INC	285,200	16.12	4,597,424.00	
	DELL INC	321,158	12.60	4,046,590.80	
	DOLBY LABORATORIES INC-CL A	9,600	38.34	368,064.00	
	EMC CORP/MASS	374,500	12.86	4,816,070.00	
	FLEXTRONICS INTL LTD	148,600	4.21	625,606.00	
	FLIR SYSTEMS INC	25,500	24.42	622,710.00	
	HARRIS CORP	24,700	30.34	749,398.00	
	HEWLETT-PACKARD CO	441,700	36.84	16,272,228.00	
	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE	246,178	108.14	26,621,688.92	
	JUNIPER NETWORKS INC	96,900	24.22	2,346,918.00	
	MOTOROLA INC	415,900	6.71	2,790,689.00	
	NETAPP INC	60,160	19.50	1,173,120.00	
	QUALCOMM INC	302,638	46.03	13,930,427.14	
	SANDISK CORP	41,500	16.44	682,260.00	
	SEAGATE TECHNOLOGY	89,600	9.46	847,616.00	

SUN MICROSYSTEMS INC	135,600	9.24	1,252,944.00	
TERADATA CORP	32,300	24.10	778,430.00	
TYCO ELECTRONICS LTD	84,032	19.96	1,677,278.72	
WESTERN DIGITAL CORP	40,700	24.92	1,014,244.00	
XEROX CORP	158,900	7.12	1,131,368.00	
AMERICAN TOWER CORP-CL A	72,800	30.66	2,232,048.00	
AT&T INC	1,081,352	24.21	26,179,531.92	
CENTURYTEL INC	18,400	32.10	590,640.00	
CROWN CASTLE INTL CORP	53,000	23.16	1,227,480.00	
EMBARQ CORP	26,176	43.54	1,139,703.04	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS	295,600	1.13	334,028.00	
METROPCS COMMUNICATIONS INC	45,100	15.02	677,402.00	
NII HOLDINGS INC	30,500	20.58	627,690.00	
QWEST COMMUNICATIONS INTL	281,300	4.06	1,142,078.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	19,400	24.00	465,600.00	
SPRINT NEXTEL CORP	510,538	4.95	2,527,163.10	
TELEPHONE AND DATA SYSTEMS	9,500	31.12	295,640.00	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	521,248	29.42	15,335,116.16	
WINDSTREAM CORP	80,700	8.39	677,073.00	
AES CORP	121,600	10.07	1,224,512.00	
ALLEGHENY ENERGY INC	31,100	25.94	806,734.00	
ALLIANT ENERGY CORP	20,300	23.89	484,967.00	
AMEREN CORPORATION	38,800	23.48	911,024.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY	85,600	26.14	2,237,584.00	
AQUA AMERICA INC	24,900	16.58	412,842.00	
CALPINE CORP	62,900	11.36	714,544.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	60,000	10.04	602,400.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	50,300	35.44	1,782,632.00	
CONSTELLATION ENERGY GROUP	32,900	26.62	875,798.00	
DOMINION RESOURCES INC	106,700	31.87	3,400,529.00	
DTE ENERGY COMPANY	30,000	30.90	927,000.00	
DUKE ENERGY CORP	232,256	14.08	3,270,164.48	
EDISON INTERNATIONAL	56,800	29.79	1,692,072.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	ENERGEN CORP	12,500	39.48	493,500.00	
	ENERGY CORP	34,800	73.46	2,556,408.00	
	EQT CORP	22,800	36.59	834,252.00	
	EXELON CORP	120,800	47.88	5,783,904.00	
	FIRSTENERGY CORP	56,000	37.77	2,115,120.00	
	FPL GROUP INC	71,294	55.05	3,924,734.70	
	INTEGRYS ENERGY GROUP INC	14,100	28.09	396,069.00	
	MDU RESOURCES GROUP INC	32,100	18.73	601,233.00	
	MIRANT CORP	28,800	16.54	476,352.00	
	NISOURCE INC	50,400	10.95	551,880.00	
	NORTHEAST UTILITIES	31,700	20.88	661,896.00	
	NRG ENERGY INC	43,300	22.49	973,817.00	
	NSTAR	19,600	30.61	599,956.00	
	ONEOK INC	18,300	29.61	541,863.00	
	P G & E CORP	67,100	37.02	2,484,042.00	
	PEPCO HOLDINGS INC	39,700	12.67	502,999.00	
	PINNACLE WEST CAPITAL	18,500	28.20	521,700.00	
PPL CORPORATION	68,800	31.99	2,200,912.00		

PROGRESS ENERGY INC	50,600	35.27	1,784,662.00		
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	92,900	31.99	2,971,871.00		
QUESTAR CORP	31,900	33.62	1,072,478.00		
SCANA CORP	20,500	30.16	618,280.00		
SEMPRA ENERGY	42,500	47.22	2,006,850.00		
SOUTHERN COMPANY	142,132	28.63	4,069,239.16		
WISCONSIN ENERGY CORP	21,500	39.43	847,745.00		
XCEL ENERGY INC	82,400	17.45	1,437,880.00		
ADVANCED MICRO DEVICES	114,092	4.75	541,937.00		
ALTERA CORPORATION	54,600	17.44	952,224.00		
ANALOG DEVICES	53,500	25.73	1,376,555.00		
APPLIED MATERIALS INC	243,900	11.03	2,690,217.00		
BROADCOM CORP-CL A	78,235	27.25	2,131,903.75		
INTEL CORP	1,020,565	16.42	16,757,677.30		
KLA-TENCOR CORPORATION	31,061	26.90	835,540.90		
LAM RESEARCH CORP	23,000	26.37	606,510.00		
LINEAR TECHNOLOGY CORP	40,725	23.95	975,363.75		
LSI CORP	118,400	4.64	549,376.00		
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	95,300	12.84	1,223,652.00		
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	55,800	16.74	934,092.00		
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	41,237	20.89	861,440.93		
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	33,400	23.07	770,538.00		
MICRON TECHNOLOGY INC	153,700	5.58	857,646.00		
NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	42,200	14.57	614,854.00		
NVIDIA CORP	97,100	11.36	1,103,056.00		
TEXAS INSTRUMENTS INCORPORATED	234,227	21.02	4,923,451.54		
XILINX INC	50,300	21.85	1,099,055.00		
米ドル 小計	55,073,882		1,592,280,482.40 (154,737,817,279)		
カナダドル	ADDAX PETROLEUM CORP	15,800	42.23	667,234.00	
	CAMECO CORP	71,400	30.75	2,195,550.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
カナダドル	CANADIAN NATURAL RESOURCES	99,320	63.72	6,328,670.40	
	ENBRIDGE INC	64,920	39.21	2,545,513.20	
	ENCANA CORP	137,640	60.74	8,360,253.60	
	ENSIGN ENERGY SERVICES INC	24,400	17.37	423,828.00	
	HUSKY ENERGY INC	46,800	34.45	1,612,260.00	
	IMPERIAL OIL LTD	55,200	45.40	2,506,080.00	
	NEXEN INC	86,100	27.50	2,367,750.00	
	NIKO RESOURCES LTD	8,200	76.46	626,972.00	
	PETRO CANADA	88,900	48.78	4,336,542.00	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	29,500	11.05	325,975.00	
	SUNCOR ENERGY INC	171,640	38.66	6,635,602.40	
	TALISMAN ENERGY INC	187,000	17.13	3,203,310.00	
	TRANSCANADA CORP	113,550	33.35	3,786,892.50	
	TRICAN WELL SERVICE LTD	23,500	10.35	243,225.00	
	AGNICO-EAGLE MINES	28,400	62.51	1,775,284.00	
	AGRIUM INC	29,000	53.01	1,537,290.00	
	BARRICK GOLD CORP	160,100	39.77	6,367,177.00	
	ELDORADO GOLD CORPORATION	67,200	10.15	682,080.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	14,100	51.95	732,495.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	17,200	30.16	518,752.00	

GERDAU AMERISTEEL CORP	29,400	8.30	244,020.00	
GOLDCORP INC	133,740	39.33	5,259,994.20	
IAMGOLD CORP	62,700	11.18	700,986.00	
INMET MINING CORPORATION	8,200	44.50	364,900.00	
IVANHOE MINES LTD	45,800	6.71	307,318.00	
KINROSS GOLD CORP	126,523	20.28	2,565,886.44	
PAN AMERICAN SILVER CORP	15,900	24.10	383,190.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	54,200	127.50	6,910,500.00	
SHERRITT INTERNATIONAL CORP	56,700	4.95	280,665.00	
SILVER WHEATON CORP	51,900	11.39	591,141.00	
SINO-FOREST CORPORATION	32,400	13.88	449,712.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	87,645	19.60	1,717,842.00	
YAMANA GOLD INC	134,500	11.66	1,568,270.00	
BOMBARDIER INC CL B	263,640	3.36	885,830.40	
CAE INC	47,900	7.00	335,300.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	32,400	17.89	579,636.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	27,700	43.29	1,199,133.00	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	18,300	25.15	460,245.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	85,900	48.62	4,176,458.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	30,610	47.70	1,460,097.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC-CL A	19,500	41.73	813,735.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,500	18.71	402,265.00	
ASTRAL MEDIA INC	9,500	30.19	286,805.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	63,140	18.79	1,186,400.60	
THOMSON REUTERS CORP	41,400	34.91	1,445,274.00	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	14,400	53.05	763,920.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	25,300	13.20	333,960.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	5,000	46.75	233,750.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	20,200	36.30	733,260.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
カナダドル	METRO INC -A	20,300	36.07	732,221.00	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	37,900	46.30	1,754,770.00	
	WESTON (GEORGE) LTD	9,500	60.95	579,025.00	
	SAPUTO INC	26,600	22.05	586,530.00	
	VITERRA INC	42,700	9.38	400,526.00	
	BIOVAIL CORP	27,700	13.18	365,086.00	
	BANK OF MONTREAL	99,000	45.07	4,461,930.00	
	BANK OF NOVA SCOTIA	182,000	40.26	7,327,320.00	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	69,900	54.97	3,842,403.00	
	NATIONAL BANK OF CANADA	29,300	53.32	1,562,276.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	257,800	45.50	11,729,900.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	155,750	57.50	8,955,625.00	
	CI FINANCIAL CORP	29,800	19.45	579,610.00	
	IGM FINANCIAL INC	21,700	43.31	939,827.00	
	ONEX CORPORATION	18,500	22.00	407,000.00	
	TMX GROUP INC	13,900	34.30	476,770.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,100	285.00	883,500.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	52,000	22.88	1,189,760.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	15,100	25.83	390,033.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	15,500	35.59	551,645.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	295,400	23.88	7,054,152.00		
POWER CO OF CANADA	63,600	25.90	1,647,240.00		

	POWER FINANCIAL CORP	45,300	26.70	1,209,510.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	102,700	30.30	3,111,810.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT-CL A	89,925	19.70	1,771,522.50	
	BROOKFIELD PROPERTIES CORP	40,525	8.80	356,620.00	
	CGI GROUP INC	50,300	10.19	512,557.00	
	OPEN TEXT CORP	9,500	38.75	368,125.00	
	RESEARCH IN MOTION	93,500	90.68	8,478,580.00	
	BCE INC	48,892	24.99	1,221,811.08	
	MANITOBA TELECOM SVCS INC	4,100	35.39	145,099.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	91,300	32.14	2,934,382.00	
	TELUS CORP	7,300	32.66	238,418.00	
	TELUS CORPORATION -NON VOTE	29,800	31.20	929,760.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	15,400	35.91	553,014.00	
	FORTIS INC	31,100	24.53	762,883.00	
	TRANSALTA CORP	36,300	20.15	731,445.00	
	カナダドル 小計	5,288,860		174,161,915.32 (15,331,473,405)	
ユーロ	CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	27,221	13.29	361,767.09	
	ENI SPA	477,692	17.68	8,450,051.42	
	FUGRO NV-CVA	11,947	30.11	359,724.17	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	28,298	10.81	305,901.38	
	HELLENIC PETROLEUM SA	16,823	7.38	124,153.74	
	NESTE OIL OYJ	23,523	10.45	245,815.35	
	OMV AG	27,521	29.45	810,493.45	
	REPSOL YPF SA	134,404	16.19	2,176,000.76	
	SAIPEM	48,577	18.55	901,335.54	
	SARAS SPA	52,344	2.12	111,402.68	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	SBM OFFSHORE NV	27,482	12.00	329,784.00	
	TECHNIP S.A.	19,037	35.85	682,476.45	
	TENARIS SA	86,643	10.87	942,019.08	
	TOTAL SA	391,433	41.30	16,166,182.90	
	ACERINOX SA	25,663	13.33	342,087.79	
	AIR LIQUIDE	45,472	65.81	2,992,512.32	
	AKZO NOBEL	42,504	32.80	1,394,343.72	
	ARCELORMITTAL	143,191	24.03	3,441,595.68	
	BASF SE	169,378	30.70	5,199,904.60	
	CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	43,153	4.79	206,702.87	
	CRH PLC	125,521	17.40	2,184,065.40	
	ERAMET	1,015	200.94	203,959.17	
	IMERYS SA	6,220	30.95	192,540.10	
	ITALCEMENTI SPA	13,755	8.14	112,008.47	
	K+S AG	27,248	51.74	1,409,811.52	
	KONINKLIJKE DSM NV	28,293	24.62	696,715.12	
	LAFARGE SA	36,614	48.83	1,787,861.62	
	LINDE AG	27,821	60.09	1,671,763.89	
	OUTOKUMPU OYJ	22,152	13.70	303,482.40	
	RAUTARUUKKI OYJ	15,438	15.59	240,678.42	
	SALZGITTER AG	7,168	64.75	464,128.00	
	SOLVAY SA	10,879	61.87	673,083.73	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	106,744	4.12	439,785.28	
	THYSSENKRUPP AG	61,356	19.62	1,203,804.72	

TITAN CEMENT CO. S.A.	11,207	21.20	237,588.40
UMICORE	20,916	16.85	352,434.60
UPM-KYMMENE OYJ	95,405	6.53	622,994.65
VOESTALPINE AG	21,121	19.95	421,363.95
WACKER CHEMIE AG	2,939	86.67	254,723.13
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	26,308	36.95	972,080.60
ALSTOM	36,866	44.30	1,633,163.80
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	10,475	16.25	170,218.75
BOUYGUES	40,883	26.51	1,083,808.33
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	67,688	26.95	1,824,191.60
EIFFAGE	7,561	43.80	331,171.80
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	74,743	11.41	853,191.34
FINMECCANICA SPA	74,256	9.59	712,253.15
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	7,007	28.30	198,298.10
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	33,481	14.60	488,822.60
GEA GROUP AG	28,665	10.64	304,995.60
GRUPO FERROVIAL	10,294	22.16	228,115.04
HOCHTIEF AG	7,889	34.91	275,404.99
KONE OYJ-B	28,125	21.88	615,375.00
LEGRAND SA	19,287	15.29	294,898.23
MAN SE	19,400	43.68	847,392.00
METSO OYJ	23,963	13.42	321,583.46
PHILIPS ELECTRONICS NV	178,420	13.40	2,391,720.10
PRYSMIAN SPA	18,219	10.05	183,256.17
SACYR VALLEHERMOSO SA	16,786	10.25	172,056.50

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	SAFRAN S.A.	34,433	9.14	314,820.91	
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	40,855	53.32	2,178,388.60	
	SIEMENS AG-REG	150,956	53.45	8,068,598.20	
	SOLARWORLD AG	15,374	20.29	311,938.46	
	THALES SA	16,376	32.34	529,599.84	
	VALLOUREC	9,731	95.99	934,078.69	
	VINCI S.A.	77,339	33.29	2,575,002.00	
	WARTSILA OYJ	15,381	24.30	373,758.30	
	ZARDOYA OTIS SA	23,262	15.75	366,376.50	
	BIC	5,040	40.52	204,220.80	
	BUREAU VERITAS SA	8,966	36.55	327,707.30	
	RANDSTAD HOLDING NV	18,665	21.46	400,550.90	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	51,168	13.59	695,373.12	
	ADP	5,448	52.85	287,926.80	
	AIR FRANCE - KLM	25,375	9.93	251,999.12	
	ATLANTIA SPA	47,261	14.84	701,534.72	
	BRISA	33,025	5.01	165,587.35	
	CINTRA CONCESIONES DE INFRAE	36,508	4.32	157,714.56	
	DEUTSCHE POST AG-REG	155,249	9.98	1,550,161.26	
	FRAPORT AG	6,887	29.25	201,444.75	
	HAMBURGER HAFEN UND LOGISTIK	4,751	28.32	134,548.32	
	IBERIA LINEAS AER DE ESPANA	89,510	1.61	144,111.10	
	LUFTHANSA (REGD)	42,012	9.66	406,045.98	
	SOCIETE DES AUTOROUTES PARIS	4,246	45.00	191,070.00	
	TNT NV	67,709	13.80	934,722.74	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	60,751	28.15	1,710,444.40	

BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	10,134	17.50	177,345.00
DAIMLER AG	165,471	26.56	4,394,909.76
FIAT SPA	140,276	7.47	1,049,056.87
MICHELIN CLASS B (BROWN BDS)	26,604	43.51	1,157,540.04
NOKIAN RENKAAT OYJ	19,930	13.38	266,663.40
PEUGEOT SA	27,914	21.75	607,129.50
PIRELLI & CO SPA	508,022	0.27	138,126.10
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PFD	16,055	46.80	751,374.00
RENAULT SA	33,983	28.95	983,807.85
VOLKSWAGEN AG	16,234	254.50	4,131,553.00
VOLKSWAGEN AG (PREF)	19,310	52.97	1,022,850.70
ADIDAS-SALOMON AG	35,505	25.84	917,449.20
CHRISTIAN DIOR	11,669	56.26	656,556.28
HERMES INTERNATIONAL	9,737	93.52	910,604.24
LUXOTTICA GROUP SPA	21,259	14.82	315,189.97
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	44,948	58.42	2,625,862.16
PUMA AG	883	164.00	144,812.00
ACCOR SA	26,224	30.16	790,915.84
AUTOGRILL SPA	19,757	6.49	128,418.12
LOTTOMATICA SPA	8,383	16.14	135,364.32
OPAP SA	40,972	20.88	855,495.36
SODEXO	17,299	36.50	631,413.50
TUI AG	25,401	6.34	161,042.34

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	EUTELSAT COMMUNICATIONS	18,134	17.62	319,521.08	
	GESTEVISION TELECOM SA	18,101	7.36	133,223.36	
	JC DECAUX SA	12,994	11.99	155,798.06	
	LAGARDERE S.C.A.	21,655	23.33	505,211.15	
	M6-METROPOLE TELEVISION	12,111	13.99	169,493.44	
	MEDIASET SPA	130,032	4.14	539,623.69	
	PAGESJAUNES GROUPE SA	23,721	8.34	197,833.14	
	PUBLICIS GROUPE	21,579	22.00	474,738.00	
	REED ELSEVIER NV	121,206	8.13	986,374.42	
	SANOMAWSOY OYJ	15,832	11.25	178,110.00	
	SES	51,933	13.39	695,382.87	
	TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	22,047	8.20	180,785.40	
	VIVENDI SA	214,634	17.67	3,792,582.78	
	WOLTERS KLUWER	50,042	12.53	627,026.26	
	INDITEX	40,030	32.63	1,306,178.90	
	PPR	13,933	60.93	849,007.35	
	CARREFOUR SA	116,404	30.99	3,607,941.98	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	8,969	50.37	451,768.53	
	CASINO GUICHARD PERRACHON-RTS	7,984	2.63	20,997.92	
	COLRUYT SA	2,759	168.14	463,912.05	
	DELHAIZE GROUP	18,400	49.82	916,780.00	
	JERONIMO MARTINS	41,370	4.90	202,919.85	
	KESKO OYJ-B SHS	12,125	19.56	237,165.00	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	218,690	8.40	1,836,996.00	
	METRO AG	20,814	35.25	733,693.50	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	132,153	24.87	3,287,305.87	
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	33,520	14.71	493,079.20	
	DANONE	80,133	34.56	2,769,797.14	

DANONE-RTS	80,133	2.32	185,908.56
HEINEKEN HOLDING NV	20,231	21.22	429,301.82
HEINEKEN NV	44,951	25.16	1,131,191.91
KERRY GROUP PLC-A	25,652	16.10	412,997.20
PARMALAT SPA	306,089	1.74	534,783.39
PERNOD-RICARD	35,566	44.00	1,564,904.00
SUEDZUCKER AG	12,867	15.42	198,409.14
UNILEVER NV-CVA	298,890	17.54	5,242,530.60
BEIERSDORF AG	16,184	33.79	546,857.36
HENKEL AG & CO KGAA	23,834	19.68	469,053.12
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	32,690	22.48	734,871.20
L'OREAL	43,919	54.38	2,388,315.22
BIOMERIEUX	2,681	61.28	164,291.68
CELESIO AG	15,606	16.20	252,817.20
ESSILOR INTERNATIONAL	36,962	33.66	1,244,325.73
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	35,051	30.88	1,082,374.88
FRESENIUS SE	5,475	32.70	179,032.50
FRESENIUS SE-PFD	14,783	38.57	570,180.31
BAYER AG	140,243	40.77	5,717,707.11
ELAN CORP PLC	87,103	5.63	490,389.89
GRIFOLS SA	23,457	12.02	281,953.14

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	IPSEN	4,895	31.32	153,311.40	
	MERCK KGAA	11,857	68.70	814,575.90	
	ORION OYJ	17,338	11.40	197,653.20	
	QIAGEN N.V.	36,308	12.54	455,302.32	
	SANOFI AVENTIS SA	193,019	46.22	8,921,338.18	
	UCB SA	18,505	22.98	425,337.42	
	ALPHA BANK A.E.	65,774	8.35	549,212.90	
	ANGLO IRISH BANK CORP PLC	126,938	0.01	1,269.38	
	BANCA CARIGE SPA	118,524	2.04	242,887.67	
	BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	403,119	1.15	465,703.22	
	BANCA POPOLARE DI MILANO	72,344	4.67	338,565.57	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	653,300	8.50	5,553,050.00	
	BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REG	430,687	0.76	330,767.61	
	BANCO DE SABADELL SA	165,123	4.53	748,007.19	
	BANCO DE VALENCIA SA	39,085	6.72	262,651.20	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	96,328	3.88	373,752.64	
	BANCO POPOLARE SPA	117,517	5.56	653,958.60	
	BANCO POPULAR ESPANOL	136,033	6.33	861,769.05	
	BANCO SANTANDER SA	1,496,307	7.74	11,581,416.18	
	BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD	102,253	4.24	433,552.72	
	BANK OF PIRAEUS	55,573	7.48	415,686.04	
	BANKINTER SA	52,128	9.66	503,556.48	
	BNP PARIBAS	172,641	47.84	8,260,008.64	
	COMMERZBANK AG	130,060	5.29	688,017.40	
	CREDIT AGRICOLE SA	163,398	10.79	1,763,881.41	
	DEUTSCHE POSTBANK AG	16,059	17.66	283,601.94	
	DEXIA	99,313	5.66	562,210.89	
	EFG EUROBANK ERGASIAS	58,082	8.10	470,464.20	
	ERSTE GROUP BANK AG	31,990	19.98	639,160.20	
	INTESA SANPAOLO	1,413,188	2.43	3,436,887.34	

INTESA SANPAOLO-RNC	171,084	1.98	340,008.91
KBC GROUP	29,325	14.90	436,942.50
NATIONAL BANK OF GREECE	91,127	19.12	1,742,348.24
NATIXIS	160,067	1.51	241,861.23
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	10,168	27.10	275,552.80
SOCIETE GENERALE	85,243	41.86	3,568,271.98
UNICREDIT SPA	2,644,513	2.00	5,311,239.90
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	105,538	9.67	1,020,649.55
CNP -CIE NATL A PORTEFEUILLE	6,176	34.56	213,473.44
CRITERIA CAIXACORP SA	154,258	3.11	480,513.67
DEUTSCHE BANK AG-REG	102,518	46.90	4,808,094.20
DEUTSCHE BOERSE AG	35,779	59.46	2,127,419.34
EURAZEO	4,674	32.10	150,058.77
EXOR SPA	13,763	11.85	163,160.64
FORTIS	409,902	2.53	1,038,281.76
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	14,804	53.36	789,941.44
ING GROEP NV-CVA	359,301	7.84	2,816,919.84
MARFIN INVESTMENT GROUP SA	116,526	3.62	421,824.12
MEDIOBANCA SPA	82,751	9.09	752,383.67

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	POHJOLA BANK PLC	25,302	5.69	143,968.38	
	AEGON NV	260,619	4.77	1,243,152.63	
	ALLEANZA ASSICURAZIONI	77,669	5.14	399,314.19	
	ALLIANZ SE-REG	83,127	68.50	5,694,199.50	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	194,035	15.67	3,042,307.75	
	AXA	287,473	14.66	4,215,791.54	
	CNP ASSURANCES	6,814	69.70	474,935.80	
	FONDIARIA-SAI SPA	11,420	12.27	140,125.34	
	HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	11,064	25.50	282,132.00	
	MAPFRE SA	133,263	2.34	311,835.42	
	MEDIOLANUM SPA	42,526	3.84	163,533.73	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	37,872	96.00	3,635,712.00	
	SAMPO OYJ-A SHS	77,086	13.48	1,039,119.28	
	SCOR SE	30,407	15.00	456,105.00	
	UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SP	129,298	0.86	112,195.75	
	VIENNA INSURANCE GROUP	7,213	29.14	210,186.82	
	ATOS ORIGIN	8,315	23.50	195,402.50	
	CAP GEMINI SA	26,758	26.22	701,594.76	
	DASSAULT SYSTEMS SA	12,010	32.91	395,249.10	
	INDRA SISTEMAS SA	18,070	15.32	276,832.40	
	SAP AG	157,434	30.50	4,801,737.00	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	24,410	8.42	205,532.20	
	ALCATEL-LUCENT	425,212	1.96	836,817.21	
	NEOPOST SA	5,704	59.91	341,755.16	
	NOKIA OYJ	697,405	11.28	7,866,728.40	
	BELGACOM SA	27,908	22.39	624,999.66	
	DEUTSCHE TELEKOM AG (REGD)	520,145	7.99	4,155,958.55	
	ELISA CORPORATION-A SHS	24,410	10.65	259,966.50	
	FRANCE TELECOM SA	335,780	16.14	5,421,168.10	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	44,964	11.88	534,172.32	
	ILIAD SA	3,051	73.07	222,936.57	
	KONINKLIJKE KPN NV	314,534	9.22	2,901,576.15	

MOBISTAR SA	5,688	43.80	249,134.40
PORTUGAL TELECOM SGPS SA (REGD	106,914	6.35	678,903.90
TELECOM ITALIA SPA	1,841,348	0.95	1,764,582.20
TELECOM ITALIA-RNC	1,105,683	0.67	745,993.26
TELEFONICA S.A.	776,953	15.31	11,895,150.43
TELEKOM AUSTRIA AG	59,078	10.29	607,912.62
A2A SPA	201,178	1.35	272,109.33
ACCIONA S.A.	4,664	90.05	419,993.20
ACEA SPA	13,676	8.67	118,678.68
E.ON AG	348,790	24.64	8,594,185.60
EDP RENOVAVEIS SA	40,014	7.13	285,299.82
ELECTRICITE DE FRANCE	43,461	35.42	1,539,388.62
ENAGAS	32,853	13.14	431,688.42
ENEL AXA-RTS	794,478	0.39	310,076.81
ENEL SPA	794,478	3.54	2,813,016.19
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	335,454	2.83	949,334.82
FORTUM OYJ	81,422	16.91	1,376,846.02

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	GAS NATURAL SDG SA	41,080	12.43	510,624.40	
	GDF SUEZ	221,357	26.93	5,961,144.01	
	IBERDROLA RENOVABLES	155,008	3.33	516,176.64	
	IBERDROLA SA	642,484	6.01	3,861,328.84	
	OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A	14,138	36.29	513,068.02	
	PUBLIC POWER CORP	21,282	15.70	334,127.40	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	19,856	32.21	639,561.76	
	RWE AG	76,824	58.61	4,502,654.64	
	RWE AG-NON VTG PFD	7,156	50.90	364,240.40	
	SNAM RETE GAS	275,212	3.06	843,912.82	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	49,418	12.88	636,503.84	
	TERNA SPA	238,619	2.52	602,880.44	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	69,362	22.22	1,541,223.64	
	ASML HOLDING NV	79,133	14.79	1,170,377.07	
STMICROELECTRONICS NV	125,269	5.53	693,363.91		
	ユーロ 小計	32,069,185		354,082,718.64 (48,406,648,465)	
英ポンド	AMEC PLC	60,974	6.92	421,940.08	
	BG GROUP PLC	615,706	11.40	7,019,048.40	
	BP PLC	3,436,228	5.29	18,203,417.83	
	CAIRN ENERGY PLC	25,459	25.31	644,367.29	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	650,565	16.71	10,870,941.15	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	494,632	17.00	8,408,744.00	
	TULLOW OIL PLC	146,459	9.98	1,461,660.82	
	ANGLO AMERICAN PLC	241,551	17.72	4,280,283.72	
	ANTOFAGASTA PLC	72,355	6.49	469,583.95	
	BHP BILLITON PLC	404,946	14.95	6,053,942.70	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES	47,253	6.75	319,194.01	
	FRESNILLO PLC	32,896	6.63	218,100.48	
	JOHNSON MATTHEY PLC	39,390	12.22	481,345.80	
	KAZAKHMYS PLC	39,269	6.95	272,919.55	
	LONMIN PLC	28,311	14.42	408,244.62	
RANDGOLD RESOURCES LTD	14,072	43.64	614,102.08		
REXAM PLC	117,946	2.96	349,120.16		

RIO TINTO PLC	164,872	29.52	4,867,021.44	
VEDANTA RESOURCES PLC	25,902	16.31	422,461.62	
XSTRATA PLC	349,800	7.21	2,523,807.00	
BAE SYSTEMS PLC	647,043	3.30	2,136,859.50	
BALFOUR BEATTY PLC	87,686	3.44	301,639.84	
BUNZL PLC	60,010	5.05	303,050.50	
COBHAM PLC	209,123	1.70	355,718.22	
INVENSYS PLC	146,955	2.34	344,242.08	
ROLLS-ROYCE GROUP PLC	336,251	3.32	1,116,353.32	
SMITHS GROUP PLC	71,375	7.17	511,758.75	
TOMKINS PLC	162,226	1.52	246,989.08	
WOLSELEY PLC	52,079	11.03	574,431.37	
CAPITA GROUP PLC	113,644	7.28	827,896.54	
EXPERIAN PLC	188,066	4.78	899,895.81	
G4S PLC	232,556	2.16	502,320.96	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
英ポンド	SERCO GROUP PLC	89,226	4.09	364,934.34	
	BRITISH AIRWAYS	108,294	1.45	157,676.06	
	FIRSTGROUP PLC	88,400	3.82	337,909.00	
	BURBERRY GROUP PLC	79,421	3.91	310,734.66	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	16,421	7.82	128,412.22	
	CARNIVAL PLC	29,805	16.05	478,370.25	
	COMPASS GROUP PLC	338,711	3.39	1,148,230.29	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	47,155	6.59	310,751.45	
	LADBROKES PLC	110,203	1.97	217,650.92	
	THOMAS COOK GROUP PLC	78,741	2.35	185,631.90	
	TUI TRABEL PLC	102,570	2.50	256,681.42	
	WHITBREAD PLC	31,966	8.77	280,341.82	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	209,050	4.53	946,996.50	
	PEARSON PLC	148,484	6.23	925,797.74	
	REED ELSEVIER PLC	202,327	4.67	944,867.09	
	THOMSON REUTERS PLC	31,588	17.02	537,627.76	
	WPP PLC	230,317	4.25	978,847.25	
	CARPHONE WAREHOUSE GROUP	79,866	1.69	135,173.20	
	HOME RETAIL PLC	160,996	2.58	415,772.17	
	KINGFISHER PLC	433,170	1.95	848,146.86	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	289,294	2.83	818,702.02	
	NEXT PLC	36,164	15.20	549,692.80	
	MORRISON <WM.>#194SUPERMARKETS	385,993	2.48	958,227.62	
	SAINSBURY (J) PLC	208,539	3.24	676,187.70	
	TESCO PLC	1,442,458	3.60	5,200,061.09	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	65,366	7.43	485,996.21	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	366,256	16.55	6,061,536.80	
	CADBURY PLC	249,490	5.39	1,345,998.55	
	DIAGEO PLC	459,025	8.40	3,855,810.00	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	186,459	16.05	2,992,666.95	
	SABMILLER PLC	165,938	12.95	2,148,897.10	
	UNILEVER PLC	235,492	14.87	3,501,766.04	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	110,476	27.15	2,999,423.40	
SMITH & NEPHEW PLC	162,030	4.75	769,642.50		
ASTRAZENECA PLC	265,516	25.03	6,645,865.48		
GLAXOSMITHKLINE PLC	951,875	10.35	9,851,906.25		

SHIRE PLC	102,756	8.42	865,205.52
BARCLAYS PLC	1,535,824	2.90	4,453,889.60
HSBC HLDGS PLC	3,156,562	5.17	16,343,099.75
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,990,152	0.63	1,883,795.76
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	3,102,623	0.36	1,120,046.90
STANDARD CHARTERED PLC	347,017	12.25	4,250,958.25
3I GROUP PLC	77,339	2.57	198,761.23
ICAP PLC	95,065	4.44	422,801.58
INVESTEC PLC	70,167	3.58	251,373.27
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	28,076	7.78	218,571.66
MAN GROUP PLC	310,529	2.68	832,217.72
SCHRODERS PLC	23,083	8.64	199,437.12
ADMIRAL GROUP PLC	33,977	8.60	292,202.20

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
英ポンド	AVIVA PLC	487,640	3.44	1,678,700.70	
	FRIENDS PROVIDENT PLC	426,378	0.70	300,596.49	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,075,477	0.63	680,776.94	
	OLD MUTUAL PLC	968,116	0.76	738,672.50	
	PRUDENTIAL PLC	458,144	4.38	2,008,961.44	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	609,145	1.25	761,431.25	
	STANDARD LIFE PLC	399,577	1.82	730,826.33	
	AUTONOMY CORP PLC	39,175	14.18	555,501.50	
	SAGE GROUP PLC	240,280	1.85	446,440.24	
	BT GROUP PLC	1,420,597	0.92	1,312,631.62	
	CABLE & WIRELESS PLC	461,348	1.30	599,752.40	
	VODAFONE GROUP PLC	9,627,572	1.14	11,009,128.58	
	CENTRICA PLC	935,979	2.31	2,162,111.49	
	DRAX GROUP PLC	62,274	4.60	286,460.40	
	INTERNATIONAL POWER PLC	278,657	2.50	698,035.78	
	NATIONAL GRID PLC	445,542	5.52	2,461,619.55	
	SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	168,129	11.40	1,916,670.60	
	SEVERN TRENT PLC	43,283	11.61	502,515.63	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	125,037	5.39	673,949.43		
英ポンド 小計		47,658,202		196,061,479.51 (31,087,508,191)	
スイスフラン	GIVAUDAN-REG	1,240	700.00	868,000.00	
	HOLCIM LTD-REG	37,726	58.40	2,203,198.40	
	SYNGENTA AG	17,783	267.00	4,748,061.00	
	ABB LTD	403,699	17.58	7,097,028.42	
	GEBERIT AG-REG	7,496	131.60	986,473.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,988	65.00	259,220.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	9,346	64.00	598,144.00	
	ADECCO SA-REG	22,573	47.50	1,072,217.50	
	SGS SA	862	1,400.00	1,206,800.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	9,909	88.05	872,487.45	
	CIE FINANC RICHEMONT-BR A	95,778	23.24	2,225,880.72	
	THE SWATCH GROUP AG-B	5,659	181.90	1,029,372.10	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	7,966	37.00	294,742.00	
	ARYZTA AG	14,485	35.55	514,941.75	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	153	2,064.00	315,792.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	21	24,460.00	513,660.00	
NESTLE SA-REGISTERD	667,555	39.24	26,194,858.20		

NOBEL BIOCARE HOLDING AG-REG	22,808	25.40	579,323.20	
SONOVA HOLDING AG	8,485	84.70	718,679.50	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,468	206.00	302,408.00	
SYNTHESE INC	10,890	110.20	1,200,078.00	
ACTELION LTD-REG	18,125	54.75	992,343.75	
LONZA GROUP AG-REG	8,331	111.40	928,073.40	
NOVARTIS AG-REG SHS	388,020	43.42	16,847,828.40	
ROCHE HLDGS AG GENUSSCHINE	128,908	141.90	18,292,045.20	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	206,478	49.60	10,241,308.80	
JULIUS BAER HOLDING AG-REG	38,721	45.00	1,742,445.00	
PARGESA HOLDING SA-BR	4,959	76.00	376,884.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
スイスフラン	UBS AG REG	538,074	14.88	8,006,541.12	
	BALOISE HOLDING-REG	9,175	85.95	788,591.25	
	REINSURANCE (REGD)	63,359	38.56	2,443,123.04	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	5,472	100.50	549,936.00	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	26,809	196.90	5,278,692.10	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	33,396	15.56	519,641.76	
	SWISSCOM AG (REG)	4,413	317.00	1,398,921.00	
	BKW FMB ENERGIE AG	2,422	78.00	188,916.00	
スイスフラン 小計		2,826,552		122,396,656.66 (11,030,386,698)	
スウェーデン クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	41,333	64.10	2,649,445.30	
	HOLMEN AB-B SHARES	9,920	187.50	1,860,000.00	
	SSAB AB-A SHARES	33,133	102.00	3,379,566.00	
	SSAB AB-B SHARES	16,135	94.00	1,516,690.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	103,569	82.50	8,544,442.50	
	ALFA LAVAL AB	63,025	75.30	4,745,782.50	
	ASSA ABLOY AB B	57,259	99.75	5,711,585.25	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	123,211	77.50	9,548,852.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	71,599	69.25	4,958,230.75	
	SANDVIK AB	185,013	62.00	11,470,806.00	
	SCANIA AB-B SHS	58,715	78.25	4,594,448.75	
	SKANSKA AB-B SHS	72,777	82.75	6,022,296.75	
	SKF AB-B SHS	71,049	93.00	6,607,557.00	
	VOLVO AB-A SHS	80,813	46.90	3,790,129.70	
	VOLVO AB-B SHS	199,649	47.40	9,463,362.60	
	SECURITAS AB-B SHS	57,453	63.25	3,633,902.25	
	ELECTROLUX AB-SER B	43,948	102.25	4,493,683.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	74,976	43.70	3,276,451.20	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	93,803	359.50	33,722,178.50	
	SWEDISH MATCH AB	46,788	122.50	5,731,530.00	
	GETINGE AB-B SHS	36,723	100.75	3,699,842.25	
	NORDEA BANK AB	591,570	59.90	35,435,043.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK-A	279,319	32.60	9,105,799.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	89,786	135.00	12,121,110.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	61,462	39.00	2,397,018.00	
	INVESTOR AB-B SHS	83,573	117.75	9,840,720.75	
	ERICSSON(L.M.)TEL CLASS B	543,968	70.30	38,240,950.40	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	13,876	443.00	6,147,068.00		
TELE2 AB -B SHS	55,964	73.20	4,096,564.80		
TELIASONERA AB	411,959	38.20	15,736,833.80		

スウェーデンクローナ 小計		3,672,368		272,541,890.95 (3,461,282,015)	
ノルウェー クローネ	SEADRILL LTD	51,450	97.00	4,990,650.00	
	STATOILHYDRO ASA	206,150	134.90	27,809,635.00	
	NORSK HYDRO ASA	125,950	35.50	4,471,225.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	34,800	205.50	7,151,400.00	
	ORKLA ASA	141,650	49.00	6,940,850.00	
	RENEWABLE ENERGY CORP AS	45,300	57.40	2,600,220.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ノルウェー クローネ	DNB NOR ASA	134,590	53.70	7,227,483.00	
	TELENOR ASA	154,200	50.70	7,817,940.00	
ノルウェークローネ 小計		894,090		69,009,403.00 (1,062,054,712)	
デンマーク クローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,461	427.50	3,617,077.50	
	VESTAS WIND SYSTEM AS	37,374	391.50	14,631,921.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	101	33,400.00	3,373,400.00	
	A P MOLLER MAERSK A/S	202	33,800.00	6,827,600.00	
	DSV A/S	33,143	65.50	2,170,866.50	
	CARLSBERG AS-B	19,626	344.50	6,761,157.00	
	COLOPLAST-B	4,451	361.00	1,606,811.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	4,429	286.00	1,266,694.00	
	H LUNDBECK A/S	10,837	101.25	1,097,246.25	
	NOVO NORDISK AS-B	82,115	275.50	22,622,682.50	
	DANSKE BANK AS	83,342	92.00	7,667,464.00	
	TOPDANMARK A/S	2,603	650.00	1,691,950.00	
	TRYGVESTA AS	4,367	304.00	1,327,568.00	
デンマーククローネ 小計		291,051		74,662,437.75 (1,370,802,357)	
オーストラリア ドル	ARROW ENERGY LTD	103,336	3.61	373,042.96	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	25,357	12.47	316,201.79	
	ENERGY RESOURCES OF AUST	12,248	25.73	315,141.04	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	161,962	14.45	2,340,350.90	
	PALADIN ENERGY LTD	102,728	5.00	513,640.00	
	SANTOS	156,238	15.06	2,352,944.28	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	89,721	42.17	3,783,534.57	
	WORLEYPARSONS LTD	29,997	22.50	674,932.50	
	ALUMINA LTD	455,327	1.50	685,267.13	
	AMCOR LTD	153,221	5.05	773,766.05	
	BHP BILLITON LTD	615,780	36.50	22,475,970.00	
	BLUESCOPE STEEL LIMITED	332,570	2.50	831,425.00	
	BORAL LIMITED	109,390	4.36	476,940.40	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	226,517	3.11	704,467.87	
	INCITEC PIVOT LTD	293,236	2.68	785,872.48	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES NV	81,320	4.20	341,544.00	
	NEWCREST MINING LIMITED	88,196	31.65	2,791,403.40	
	NUFARM LTD	29,523	11.77	347,485.71	
	ONESTEEL LIMITED	252,380	2.63	663,759.40	
	ORICA LIMITED	65,906	21.15	1,393,911.90	
	OZ MINERALS LTD	544,073	0.91	495,106.43	
	RIO TINTO LTD	52,429	70.61	3,702,011.69	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	26,695	22.78	608,112.10	
	CSR	243,740	1.53	374,140.90	

LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	27,337	23.85	651,987.45	
BRAMBLES LTD	254,063	5.95	1,511,674.85	
MACQUARIE AIRPORTS	133,474	2.41	321,672.34	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE GRP	441,060	1.40	617,484.00	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	199,582	2.19	437,084.58	
TOLL HOLDINGS LIMITED	120,513	6.83	823,103.79	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
オーストラリア ドル	TRANSURBAN GROUP	211,801	4.05	857,794.05	
	BILLABONG INTERNATIONAL LTD	36,406	8.42	306,538.52	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	71,477	3.73	266,609.21	
	CROWN LTD	86,079	7.64	657,643.56	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	107,286	7.24	776,750.64	
	TATTS GROUP LTD	220,547	2.52	555,778.44	
	FAIRFAX MEDIA LTD	401,368	1.24	497,696.32	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	103,127	3.03	312,474.81	
	METCASH LTD	140,339	4.28	600,650.92	
	WESFARMERS LTD	185,776	22.27	4,137,231.52	
	WESFARMERS LTD-PPP	27,880	22.30	621,724.00	
	WOOLWORTHS LIMITED	224,691	26.19	5,884,657.29	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	101,219	8.48	858,337.12	
	FOSTER'S GROUP LTD	352,592	5.10	1,798,219.20	
	GOODMAN FIELDER LTD	248,874	1.35	335,979.90	
	LION NATHAN LIMITED	53,913	11.48	618,921.24	
	COCHLEAR LIMITED	10,271	56.15	576,716.65	
	SONIC HEALTHCARE LTD	66,238	11.80	781,608.40	
	CSL LIMITED	110,618	30.49	3,372,742.82	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	395,946	16.41	6,497,473.86	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	56,598	6.25	353,737.50	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	269,939	36.99	9,985,043.61	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	351,741	21.70	7,632,779.70	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	533,863	19.35	10,330,249.05	
	ASX LTD	31,403	35.66	1,119,830.98	
	MACQUARIE GROUP LTD	55,676	36.84	2,051,103.84	
	PERPETUAL LTD	7,375	29.23	215,571.25	
	AMP LIMITED	361,799	4.80	1,736,635.20	
	AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS	188,378	3.85	725,255.30	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	373,997	3.57	1,335,169.29	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	181,025	18.76	3,396,029.00	
SUNCORP-METWAY LIMITED	239,019	6.25	1,493,868.75		
LEND LEASE	79,113	7.46	590,182.98		
COMPUTERSHARE LTD	81,557	9.03	736,459.71		
TELSTRA CORPORATION LTD	807,180	3.24	2,615,263.20		
AGL ENERGY LTD	81,858	14.11	1,155,016.38		
SP AUSNET	243,146	0.82	199,379.72		
オーストラリアドル 小計		12,528,034		128,471,103.44 (10,001,475,402)	
ニュージー ランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	106,785	6.82	728,273.70	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	157,320	1.59	250,138.80	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	92,579	2.80	259,221.20	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	335,461	2.61	875,553.21	
	CONTACT ENERGY LIMITED	54,154	5.63	304,887.02	

ニュージーランドドル 小計		746,299		2,418,073.93 (147,429,967)	
香港ドル	MONGOLIA ENERGY CO LTD	352,000	3.33	1,172,160.00	
	HUTCHISON WHAMPOA LTD	392,000	56.40	22,108,800.00	
	NWS HOLDINGS LTD	155,000	15.60	2,418,000.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
香港ドル	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	222,000	10.12	2,246,640.00	
	HONG KONG AIRCRAFT ENGINEERG	12,800	94.40	1,208,320.00	
	MTR CORPORATION	260,000	24.10	6,266,000.00	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	42,500	34.20	1,453,500.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	125,000	17.28	2,160,000.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	240,000	13.82	3,316,800.00	
	TELEVISION BROADCASTS LTD	53,000	31.60	1,674,800.00	
	ESPRIT HOLDINGS LTD	205,600	47.80	9,827,680.00	
	LI & FUNG LTD	400,200	23.10	9,244,620.00	
	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	107,500	10.88	1,169,600.00	
	BANK OF EAST ASIA LIMITED	270,220	25.35	6,850,077.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	679,000	13.10	8,894,900.00	
	HANG SENG BANK LTD	140,400	112.60	15,809,040.00	
	WING HANG BANK LIMITED	33,500	66.85	2,239,475.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	187,400	119.10	22,319,340.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	255,000	91.60	23,358,000.00	
	CHINESE ESTATES HOLDINGS LTD	132,000	13.82	1,824,240.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	147,000	34.65	5,093,550.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	381,000	25.60	9,753,600.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	197,585	45.60	9,009,876.00	
	HOPEWELL HOLDINGS	105,000	24.30	2,551,500.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	111,000	18.26	2,026,860.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	131,000	33.15	4,342,650.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	449,000	14.82	6,654,180.00	
	SINO LAND CO	320,000	13.12	4,198,400.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	259,000	94.10	24,371,900.00	
	SWIRE PACIFIC CL A	141,500	75.00	10,612,500.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	253,000	29.45	7,450,850.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	168,000	20.95	3,519,600.00	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	411,000	5.59	2,297,490.00	
	PCCW LTD	683,000	2.23	1,523,090.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	83,000	27.20	2,257,600.00	
	CLP HOLDINGS LTD	375,500	51.65	19,394,575.00	
HONG KONG & CHINA GAS	733,970	15.66	11,493,970.20		
HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	255,000	41.95	10,697,250.00		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	37,900	44.60	1,690,340.00		
香港ドル 小計		9,507,575		284,501,773.20 (3,567,652,235)	
シンガポール ドル	COSCO CORP SINGAPORE LTD	174,000	1.36	236,640.00	
	FRASER & NEAVE LTD	178,500	3.64	649,740.00	
	KEPPEL CORP LTD	234,000	6.96	1,628,640.00	
	NOBLE GROUP LTD	241,800	1.68	406,224.00	
	SEBACORP INDUSTRIES LIMITED	181,000	2.97	537,570.00	
	SEBACORP MARINE LTD	160,400	2.85	457,140.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	248,000	2.39	592,720.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	345,000	1.30	448,500.00	

NEPTUNE ORIENT LINES LTD	100,000	1.59	159,000.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	98,600	13.34	1,315,324.00	
GENTING SINGAPORE PLC	707,000	0.68	484,295.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
シンガポール ドル	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	292,250	3.15	920,587.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	23,000	17.56	403,880.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	232,800	2.11	491,208.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,046,720	0.43	450,089.60	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	153,000	4.85	742,050.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	314,000	12.52	3,931,280.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	459,000	7.30	3,350,700.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	224,000	15.32	3,431,680.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	157,000	7.61	1,194,770.00	
	CAPITALAND LIMITED	467,000	3.67	1,713,890.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	92,000	9.09	836,280.00	
	UOL GROUP LTD	100,400	3.55	356,420.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,461,880	2.96	4,327,164.80	
	STARHUB LTD	110,000	2.08	228,800.00	
シンガポールドル 小計		7,801,350		29,294,592.90 (1,962,151,832)	
合計		178,357,448		282,166,682,558 (282,166,682,558)	

## B . 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託 受益証券	シンガポール ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	252,000	393,120.00	
		CAPITAMALL TRUST	407,600	574,716.00	
	シンガポールドル 小計		659,600	967,836.00 (64,825,655)	
投資信託受益証券 合計			659,600	64,825,655 (64,825,655)	
投資証券	米ドル	AMB PROPERTY CORP	25,700	514,771.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,629	914,019.92	
		BOSTON PROPERTIES INC	22,200	1,129,536.00	
		DUKE REALTY CORP	39,300	372,564.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	50,000	1,249,000.00	
		FED REALTY INVS TRUST	10,900	601,244.00	
		HCP INC	50,000	1,186,500.00	
		HEALTH CARE REIT INC	20,000	721,200.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	108,666	1,054,060.20	
		KIMCO REALTY CORP	63,300	752,004.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	18,100	438,020.00	
		PLUM CREEK TIMBER CO	30,700	1,067,439.00	
		PROLOGIS	77,100	701,610.00	
		PUBLIC STORAGE INC	23,400	1,557,738.00	
		REGENCY CENTERS CORP	14,400	536,976.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	50,500	2,695,185.00	
	VENTAS INC	28,700	879,655.00		
VORNADO REALTY TRUST	28,633	1,422,773.77			
米ドル 小計		676,228	17,794,295.89 (1,729,249,674)		
カナダドル	ARC ENERGY TRUST UNITS	20,800	389,792.00		

	CANADIAN OIL SANDS TRUST	43,300	1,191,183.00	
--	--------------------------	--------	--------------	--

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考	
投資証券	カナダドル	CRESCENT POINT ENERGY TRUST	13,300	438,900.00		
		ENERPLUS RESOURCES FUND	30,400	791,616.00		
		GROUPE AEROPLAN INC	38,800	292,940.00		
		PENN WEST ENERGY TRUST	74,378	1,111,951.10		
		PROVIDENT ENERGY TRUST-UTS	48,000	288,000.00		
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	20,200	303,000.00		
		VERMILION ENERGY TRUST	6,300	211,050.00		
		YELLOW PAGES INCOME FUND	47,200	245,440.00		
	カナダドル 小計			342,678	5,263,872.10 (463,378,660)	
	ユーロ	CORIO NV	8,021	271,992.11		
		FONCIERE DES REGIONS	4,273	232,707.58		
		GECINA SA	3,437	198,761.71		
		ICADE	3,611	209,438.00		
		KLEPIERRE	18,363	327,871.36		
		UNIBAIL	15,040	1,695,760.00		
	ユーロ 小計			52,745	2,936,530.76 (401,453,120)	
	英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	156,359	609,800.10		
		HAMMERSON PLC	127,636	386,417.99		
		LAND SECURITIES GROUP PLC	138,712	687,664.74		
		LIBERTY INTERNATIONAL PLC	72,656	298,434.52		
		SEGRO PLC	1,041,694	260,423.50		
	英ポンド 小計			1,537,057	2,242,740.85 (355,608,989)	
	オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	314,273	507,550.89		
		DEXUS PROPERTY GROUP	824,010	572,686.95		
		GPT GROUP	1,639,253	778,645.17		
		MIRVAC GROUP	302,762	360,286.78		
		STOCKLAND	418,763	1,340,041.60		
		WESTFIELD GROUP	370,058	4,300,073.96		
	オーストラリアドル 小計			3,869,119	7,859,285.35 (611,845,364)	
	香港ドル	LINK REIT	396,500	6,573,970.00		
	香港ドル 小計			396,500	6,573,970.00 (82,437,583)	
投資証券 合計			6,874,327	3,643,973,390 (3,643,973,390)		
合計				3,708,799,045 (3,708,799,045)		

## (注) 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (注1)	組入投資信託 受益証券 時価比率 (注2)	組入投資証券 時価比率 (注3)	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	600	98.9%		1.1%	54.7%
カナダドル	98	97.1%		2.9%	5.5%
ユーロ	277	99.2%		0.8%	17.1%
英ポンド	105	98.9%		1.1%	11.0%
スイスフラン	36	100.0%			3.9%
スウェーデンクローナ	30	100.0%			1.2%
ノルウェークローネ	8	100.0%			0.4%
デンマーククローネ	13	100.0%			0.5%
オーストラリアドル	73	94.2%		5.8%	3.7%
ニュージーランドドル	5	100.0%			0.1%
香港ドル	40	97.7%		2.3%	1.3%
シンガポールドル	26	96.8%	3.2%		0.7%
合計	1,311	98.7%	0.0%	1.3%	100.0%

(注1) 組入株式時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する株式の比率であります。

(注2) 組入投資信託受益証券時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する投資信託受益証券の比率であります。

(注3) 組入投資証券時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する投資証券の比率であります。

#### 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。

[次へ](#)

## 「中央三井外国債券マザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

項目	平成21年6月10日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	732,345,561
コール・ローン	4,032,527,219
国債証券	437,867,859,283
特殊債券	2,571,204,413
派生商品評価勘定	271,136,990
未収利息	6,390,698,775
前払費用	473,296,171
差入委託証拠金	334,725,210
流動資産合計	452,673,793,622
資産合計	452,673,793,622
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	183,213,880
未払解約金	173,990,857
流動負債合計	357,204,737
負債合計	357,204,737
純資産の部	
元本等	
元本	274,553,745,400
剰余金	
剰余金	177,762,843,485
純資産合計	452,316,588,885
負債・純資産合計	452,673,793,622

## (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6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び特殊債券 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、時価で評価しております。 ただし、買付後の最初の利払いまでは個別法によっております。</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

	平成21年6月10日現在
1. 計算日における受益権総数	274,553,745,400 口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6475 円 (16,475 円)

## (関連当事者との取引に関する注記)

平成21年6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6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6月10日現在

計算期間の期首元本額	283,562,076,317 円
計算期間中の追加設定元本額	41,122,835,829 円
計算期間中の一部解約元本額	50,131,166,746 円
計算日の元本額	274,553,745,400 円
計算日の元本額の内訳	
中央三井外国債券インデックスファンド	6,021,736,452 円
中央三井DC外国債券インデックスファンド	1,628,926,734 円
中央三井DC外国債券インデックスファンドL	6,321,203,374 円
物価連動債組入世界債券ファンド	261,290,814 円
中央三井DCバランスファンド30	36,114,911 円
中央三井DCバランスファンド50	61,185,863 円
中央三井DCバランスファンド70	14,825,759 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	204,717,383 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	120,239,610 円
新生・4分散ファンド	139,740,983 円
ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド	263,325,335 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	70,275,236 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	139,477,403 円
中央三井外国債券インデックスファンドF(一般投資家私募)	740,670,940 円
中央三井外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	23,475,546,580 円
中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)	8,780,855,806 円
中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)	27,400,294,269 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)	105,825,607,338 円
中央三井VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	5,190,047,365 円
中央三井VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	119,176,843 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)	9,597,100,644 円
中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)	7,409,877,300 円
中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,120,187,768 円
中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)	19,816,779,687 円
中央三井バランスVA75(適格機関投資家専用)	717,455,061 円
中央三井VL株式30(適格機関投資家専用)	3,621,711 円
中央三井VL株式50(適格機関投資家専用)	3,721,559 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)	33,827,123,051 円
中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	5,172,261,120 円
中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	498,448,925 円
中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)	2,665,217,046 円
中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	2,681,413,090 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)	392,264,779 円
CMAM・VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	86,673,775 円
中央三井バランスVA20(適格機関投資家専用)	2,746,340,886 円

## 2. 有価証券関係

## 売買目的有価証券

平成21年 6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）
国債証券	437,867,859,283	8,652,205,945
特殊債券	2,571,204,413	44,504,136
合計	440,439,063,696	8,696,710,081

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「中央三井外国債券マザーファンド」の期首から計算日までの期間（平成21年2月10日から平成21年6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 6月10日現在
<p>1. 取引の内容</p> <p>当ファンドの利用している取引は、債券関連では債券先物取引であり、また、通貨関連では為替予約取引であります。</p> <p>2. 取引に対する取組方針</p> <p>債券先物取引は、ファンド運用の効率化を図ること及び将来の価格変動リスクの回避を目的としており、為替予約取引は、運用の効率化を図るため、将来の為替変動リスクの回避目的に限定せずに利用する場合があります。ただし、いずれのデリバティブ取引においても、投機目的の取引は行わない方針であります。</p> <p>3. 取引の利用目的</p> <p>債券先物取引は、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、為替予約取引は、原則としてファンド運用の効率化を図るために利用しております。</p> <p>4. 取引に係るリスクの内容</p> <p>債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。</p> <p>また、為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。</p> <p>5. 取引に係るリスク管理体制</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明</p> <p>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。</p>

## . 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

## 債券関連

区分	種類	平成21年6月10日現在			
		契約額等（円）		時価 （円）	評価損益 （円）
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	3,191,658,167		3,161,607,302	30,050,865
	合計	3,191,658,167		3,161,607,302	30,050,865

（注）1．時価の算定方法

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

2．債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3．計算日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

## 通貨関連

区分	種類	平成21年6月10日現在			
		契約額等（円）		時価 （円）	評価損益 （円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	米ドル	3,047,231,350		3,090,006,000	42,774,650
	カナダドル	237,830,800		246,456,000	8,625,200
	ユーロ	5,186,149,950		5,358,248,000	172,098,050
	英ポンド	873,149,350		919,532,000	46,382,650
	計	9,344,361,450		9,614,242,000	269,880,550
	売建				
	米ドル	1,854,952,200		1,894,815,000	39,862,800
	カナダドル	146,571,200		149,634,000	3,062,800
	ユーロ	3,154,161,150		3,239,553,000	85,391,850
英ポンド	555,081,875		578,671,000	23,589,125	
計	5,710,766,425		5,862,673,000	151,906,575	
	合計	15,055,127,875		15,476,915,000	117,973,975

（注）時価の算定方法

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

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

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

[次へ](#)

## (3) 附属明細表(平成21年6月10日現在)

## 有価証券明細表

## A. 株式

該当事項はありません。

## B. 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B 3.625% 2010/06/15	33,680,000	34,687,768.91	
		US TREASURY N/B 3.875% 2010/07/15	8,300,000	8,583,367.22	
		US TREASURY N/B 4.125% 2010/08/15	12,000,000	12,474,375.00	
		US TREASURY N/B 5.750% 2010/08/15	7,200,000	7,618,500.00	
		US TREASURY N/B 3.875% 2010/09/15	4,200,000	4,359,140.64	
		US TREASURY N/B 4.250% 2010/10/15	7,500,000	7,831,640.62	
		US TREASURY N/B 4.500% 2010/11/15	5,000,000	5,246,875.00	
		US TREASURY N/B 4.375% 2010/12/15	25,300,000	26,559,070.43	
		US TREASURY N/B 5.000% 2011/02/15	25,960,000	27,635,231.25	
		US TREASURY N/B 0.875% 2011/03/31	16,960,000	16,855,325.08	
		US TREASURY N/B 4.750% 2011/03/31	18,740,000	19,927,354.78	
		US TREASURY N/B 4.875% 2011/04/30	18,000,000	19,200,937.50	
		US TREASURY N/B 4.875% 2011/05/31	2,300,000	2,459,562.50	
		US TREASURY N/B 5.125% 2011/06/30	9,010,000	9,695,604.68	
		US TREASURY N/B 4.875% 2011/07/31	9,960,000	10,687,546.92	
		US TREASURY N/B 5.000% 2011/08/15	27,050,000	29,133,695.31	
		US TREASURY N/B 4.625% 2011/08/31	29,810,000	31,875,739.99	
		US TREASURY N/B 4.500% 2011/09/30	26,420,000	28,221,926.69	
		US TREASURY N/B 4.625% 2011/10/31	19,040,000	20,417,425.00	
		US TREASURY N/B 1.750% 2011/11/15	26,480,000	26,612,400.00	
		US TREASURY N/B 4.500% 2011/11/30	24,300,000	26,037,070.43	
		US TREASURY N/B 1.125% 2011/12/15	12,000,000	11,872,500.00	
		US TREASURY N/B 1.125% 2012/01/15	16,600,000	16,383,421.95	
		US TREASURY N/B 4.750% 2012/01/31	22,670,000	24,487,142.18	
		US TREASURY N/B 1.375% 2012/02/15	8,600,000	8,530,125.00	
		US TREASURY N/B 4.875% 2012/02/15	2,830,000	3,066,570.31	
		US TREASURY N/B 1.375% 2012/03/15	20,000,000	19,806,250.00	
		US TREASURY N/B 4.500% 2012/03/31	5,000,000	5,376,171.90	
		US TREASURY N/B 4.500% 2012/04/30	25,370,000	27,300,498.43	
		US TREASURY N/B 4.750% 2012/05/31	18,670,000	20,251,115.62	
		US TREASURY N/B 4.625% 2012/07/31	7,910,000	8,555,159.37	
		US TREASURY N/B 4.375% 2012/08/15	11,100,000	11,920,359.37	
		US TREASURY N/B 4.125% 2012/08/31	18,200,000	19,412,859.46	
		US TREASURY N/B 4.250% 2012/09/30	18,190,000	19,503,090.62	
		US TREASURY N/B 3.875% 2012/10/31	18,200,000	19,316,171.96	
		US TREASURY N/B 4.000% 2012/11/15	17,000,000	18,123,593.75	
		US TREASURY N/B 2.875% 2013/01/31	17,740,000	18,195,973.52	
		US TREASURY N/B 3.875% 2013/02/15	16,200,000	17,154,281.25	
		US TREASURY N/B 2.750% 2013/02/28	15,630,000	15,941,378.98	
		US TREASURY N/B 3.125% 2013/04/30	12,700,000	13,088,937.50	
US TREASURY N/B 3.625% 2013/05/15	10,000,000	10,484,375.00			
US TREASURY N/B 3.375% 2013/07/31	20,810,000	21,578,994.63			
US TREASURY N/B 4.250% 2013/08/15	6,930,000	7,423,762.50			
US TREASURY N/B 4.250% 2013/11/15	11,250,000	12,012,890.62			
US TREASURY N/B 2.000% 2013/11/30	6,500,000	6,323,789.09			
US TREASURY N/B 1.500% 2013/12/31	27,120,000	25,757,643.88			

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B 4.000% 2014/02/15	10,000,000	10,554,687.50	
		US TREASURY N/B 1.750% 2014/03/31	13,000,000	12,378,437.50	

US TREASURY N/B	1.875%	2014/04/30	8,920,000	8,524,175.00	
US TREASURY N/B	4.750%	2014/05/15	24,400,000	26,538,812.50	
US TREASURY N/B	4.250%	2014/08/15	12,550,000	13,342,218.75	
US TREASURY N/B	4.250%	2014/11/15	9,230,000	9,815,528.12	
US TREASURY N/B	11.250%	2015/02/15	9,550,000	13,611,734.37	
US TREASURY N/B	4.000%	2015/02/15	10,020,000	10,480,293.75	
US TREASURY N/B	4.125%	2015/05/15	7,040,000	7,388,700.00	
US TREASURY N/B	4.250%	2015/08/15	6,000,000	6,347,812.50	
US TREASURY N/B	4.500%	2015/11/15	4,210,000	4,514,567.18	
US TREASURY N/B	4.500%	2016/02/15	18,200,000	19,427,078.21	
US TREASURY N/B	2.625%	2016/02/29	27,900,000	26,544,234.37	
US TREASURY N/B	5.125%	2016/05/15	27,000,000	29,721,093.75	
US TREASURY N/B	7.250%	2016/05/15	5,670,000	6,989,160.93	
US TREASURY N/B	4.875%	2016/08/15	12,000,000	13,025,625.00	
US TREASURY N/B	4.625%	2016/11/15	9,450,000	10,108,546.87	
US TREASURY N/B	7.500%	2016/11/15	8,250,000	10,338,925.82	
US TREASURY N/B	4.625%	2017/02/15	23,500,000	25,141,328.12	
US TREASURY N/B	4.500%	2017/05/15	25,530,000	27,057,810.93	
US TREASURY N/B	8.750%	2017/05/15	5,200,000	6,990,343.77	
US TREASURY N/B	8.875%	2017/08/15	6,750,000	9,155,214.87	
US TREASURY N/B	4.250%	2017/11/15	12,950,000	13,474,070.31	
US TREASURY N/B	3.500%	2018/02/15	9,900,000	9,714,375.00	
US TREASURY N/B	3.875%	2018/05/15	7,980,000	8,031,121.87	
US TREASURY N/B	9.125%	2018/05/15	7,500,000	10,509,375.00	
US TREASURY N/B	3.750%	2018/11/15	9,840,000	9,758,512.50	
US TREASURY N/B	9.000%	2018/11/15	9,350,000	13,100,226.56	
US TREASURY N/B	2.750%	2019/02/15	11,000,000	10,013,437.50	
US TREASURY N/B	8.875%	2019/02/15	4,200,000	5,839,968.75	
US TREASURY N/B	3.125%	2019/05/15	14,900,000	14,003,671.87	
US TREASURY N/B	8.125%	2019/08/15	11,600,000	15,473,312.50	
US TREASURY N/B	8.500%	2020/02/15	8,100,000	11,075,484.37	
US TREASURY N/B	8.750%	2020/08/15	6,800,000	9,467,937.50	
US TREASURY N/B	7.875%	2021/02/15	6,650,000	8,745,789.06	
US TREASURY N/B	8.125%	2021/05/15	1,000,000	1,342,031.25	
US TREASURY N/B	8.125%	2021/08/15	4,750,000	6,375,390.62	
US TREASURY N/B	8.000%	2021/11/15	8,400,000	11,200,875.00	
US TREASURY N/B	7.250%	2022/08/15	7,000,000	8,860,468.75	
US TREASURY N/B	7.125%	2023/02/15	6,550,000	8,243,789.06	
US TREASURY N/B	6.250%	2023/08/15	4,660,000	5,461,665.62	
US TREASURY N/B	7.500%	2024/11/15	4,690,000	6,219,379.68	
US TREASURY N/B	7.625%	2025/02/15	5,000,000	6,720,312.50	
US TREASURY N/B	6.875%	2025/08/15	5,850,000	7,382,882.81	
US TREASURY N/B	6.000%	2026/02/15	840,000	974,137.50	
US TREASURY N/B	6.500%	2026/11/15	5,150,000	6,297,484.37	
US TREASURY N/B	6.625%	2027/02/15	2,500,000	3,097,851.57	
US TREASURY N/B	6.125%	2027/11/15	15,160,000	17,910,118.75	
US TREASURY N/B	5.500%	2028/08/15	9,660,000	10,675,809.37	
US TREASURY N/B	5.250%	2028/11/15	4,140,000	4,451,146.87	
US TREASURY N/B	5.250%	2029/02/15	4,650,000	5,003,109.37	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B 6.125% 2029/08/15	6,200,000	7,389,625.00	
		US TREASURY N/B 6.250% 2030/05/15	7,520,000	9,130,925.00	
		US TREASURY N/B 5.375% 2031/02/15	7,390,000	8,094,359.37	
		US TREASURY N/B 4.500% 2036/02/15	17,000,000	16,582,968.75	
		US TREASURY N/B 4.750% 2037/02/15	11,150,000	11,294,601.56	
		US TREASURY N/B 5.000% 2037/05/15	2,730,000	2,874,604.68	

		US TREASURY N/B	4.375%	2038/02/15	6,100,000	5,822,640.62	
		US TREASURY N/B	4.500%	2038/05/15	9,500,000	9,268,437.50	
		US TREASURY N/B	3.500%	2039/02/15	6,810,000	5,556,534.37	
		US TREASURY N/B	4.250%	2039/05/15	4,710,000	4,403,850.00	
		米ドル 小計			1,298,680,000	1,395,826,227.38 (135,646,392,776)	
カナダドル	国債証券	CANADA-GOV'T	5.500%	2010/06/01	4,130,000	4,326,009.80	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2010/09/01	2,990,000	3,111,304.30	
		CANADA-GOV'T	2.750%	2010/12/01	5,560,000	5,711,843.60	
		CANADA-GOV'T	1.250%	2011/06/01	2,220,000	2,216,004.00	
		CANADA-GOV'T	6.000%	2011/06/01	6,600,000	7,194,528.00	
		CANADA-GOV'T	1.000%	2011/09/01	2,200,000	2,174,722.00	
		CANADA-GOV'T	3.750%	2011/09/01	5,380,000	5,640,768.60	
		CANADA-GOV'T	3.750%	2012/06/01	1,090,000	1,145,982.40	
		CANADA-GOV'T	5.250%	2012/06/01	8,030,000	8,785,623.00	
		CANADA-GOV'T	3.500%	2013/06/01	2,590,000	2,696,785.70	
		CANADA-GOV'T	5.250%	2013/06/01	8,850,000	9,795,091.50	
		CANADA-GOV'T	3.000%	2014/06/01	4,220,000	4,282,456.00	
		CANADA-GOV'T	5.000%	2014/06/01	3,740,000	4,139,619.00	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2014/12/01	3,110,000	2,982,334.50	
		CANADA-GOV'T	4.500%	2015/06/01	8,900,000	9,675,457.00	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2016/06/01	6,570,000	6,960,520.80	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2017/06/01	5,790,000	6,100,112.40	
		CANADA-GOV'T	4.250%	2018/06/01	3,390,000	3,613,807.80	
		CANADA-GOV'T	3.750%	2019/06/01	2,750,000	2,800,875.00	
		CANADA-GOV'T	8.000%	2023/06/01	3,200,000	4,600,352.00	
		CANADA-GOV'T	8.000%	2027/06/01	5,630,000	8,403,000.20	
		CANADA-GOV'T	5.750%	2029/06/01	6,960,000	8,509,365.60	
		CANADA-GOV'T	5.750%	2033/06/01	6,130,000	7,646,316.80	
CANADA-GOV'T	5.000%	2037/06/01	7,060,000	8,221,370.00			
CANADA-GOV'T	4.000%	2041/06/01	1,710,000	1,696,662.00			
		カナダドル 小計			118,800,000	132,430,912.00 (11,657,893,183)	
ユーロ	国債証券 (ベルギー)	BELGIAN 0295	5.750%	2010/09/28	6,670,000	7,043,520.00	
		BELGIAN 0313	3.500%	2011/03/28	6,180,000	6,367,872.00	
		BELGIAN 0296	5.000%	2011/09/28	6,680,000	7,128,896.00	
		BELGIAN 0298	5.000%	2012/09/28	6,830,000	7,355,910.00	
		BELGIAN 0262	8.000%	2012/12/24	2,340,000	2,748,564.00	
		BELGIAN 0310	4.000%	2013/03/28	4,660,000	4,856,186.00	
		BELGIAN 0301	4.250%	2013/09/28	8,040,000	8,436,372.00	
		BELGIAN 0314	4.000%	2014/03/28	5,370,000	5,546,136.00	
		BELGIAN 0303	4.250%	2014/09/28	690,000	718,497.00	
		BELGIAN 0282	8.000%	2015/03/28	3,870,000	4,742,685.00	
		BELGIAN 0316	3.500%	2015/03/28	4,490,000	4,462,162.00	
		BELGIAN 0306	3.750%	2015/09/28	9,560,000	9,596,328.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
ユーロ	国債証券 (ベルギー)	BELGIAN 0307	3.250%	2016/09/28	3,300,000	3,177,240.00
		BELGIAN 0309	4.000%	2017/03/28	2,020,000	2,027,676.00
		BELGIAN 0300	5.500%	2017/09/28	7,200,000	7,948,800.00
		BELGIAN 0312	4.000%	2018/03/28	7,120,000	7,088,672.00
		BELGIAN 0315	4.000%	2019/03/28	2,950,000	2,905,750.00
		BELGIAN 0308	4.000%	2022/03/28	4,870,000	4,687,375.00
		BELGIAN 0291	5.500%	2028/03/28	5,340,000	5,932,740.00
		BELGIAN 0304	5.000%	2035/03/28	6,500,000	6,799,000.00
	国債証券 (イタリア)	BTPS	2.750%	2010/06/15	14,540,000	14,749,521.40
		BTPS	5.500%	2010/11/01	9,500,000	10,014,710.00

	BTPS	3.750%	2011/02/01	7,940,000	8,188,680.80	
	BTPS	3.500%	2011/03/15	10,760,000	11,056,760.80	
	BTPS	5.250%	2011/08/01	20,670,000	21,976,344.00	
	BTPS	4.250%	2011/09/01	5,680,000	5,923,672.00	
	BTPS	3.750%	2011/09/15	6,500,000	6,709,950.00	
	BTPS	5.000%	2012/02/01	12,150,000	12,894,795.00	
	BTPS	3.000%	2012/03/01	4,400,000	4,442,240.00	
	BTPS	4.000%	2012/04/15	12,350,000	12,790,895.00	
	BTPS	4.250%	2012/10/15	8,050,000	8,378,440.00	
	BTPS	4.750%	2013/02/01	10,240,000	10,816,512.00	
	BTPS	4.250%	2013/04/15	4,760,000	4,936,596.00	
	BTPS	4.250%	2013/08/01	15,880,000	16,459,620.00	
	BTPS	3.750%	2013/12/15	7,000,000	7,072,100.00	
	BTPS	4.250%	2014/08/01	11,840,000	12,191,648.00	
	BTPS	4.250%	2015/02/01	6,400,000	6,561,920.00	
	BTPS	3.750%	2015/08/01	17,160,000	17,122,248.00	
	BTPS	3.750%	2016/08/01	4,470,000	4,417,701.00	
	BTPS	4.000%	2017/02/01	12,870,000	12,833,964.00	
	BTPS	5.250%	2017/08/01	19,200,000	20,630,400.00	
	BTPS	4.500%	2018/02/01	9,060,000	9,196,806.00	
	BTPS	4.500%	2018/08/01	6,030,000	6,072,813.00	
	BTPS	4.250%	2019/02/01	16,850,000	16,617,470.00	
	BTPS	4.500%	2019/03/01	7,200,000	7,200,000.00	
	BTPS	4.250%	2019/09/01	2,760,000	2,677,200.00	
	BTPS	4.500%	2020/02/01	9,820,000	9,710,998.00	
	BTPS	3.750%	2021/08/01	9,270,000	8,405,109.00	
	BTPS	4.750%	2023/08/01	1,230,000	1,198,635.00	
	BTPS	9.000%	2023/11/01	9,790,000	13,748,097.00	
	BTPS	7.250%	2026/11/01	6,020,000	7,372,694.00	
	BTPS	6.500%	2027/11/01	13,650,000	15,494,115.00	
	BTPS	5.250%	2029/11/01	9,920,000	9,949,760.00	
	BTPS	6.000%	2031/05/01	12,330,000	13,341,060.00	
	BTPS	5.750%	2033/02/01	11,900,000	12,524,750.00	
	BTPS	5.000%	2034/08/01	10,450,000	10,084,250.00	
	BTPS	4.000%	2037/02/01	12,360,000	10,173,516.00	
	BTPS	5.000%	2039/08/01	7,320,000	6,910,080.00	
国債証券 (ドイツ)	BUNDESUBL-147	2.500%	2010/10/08	15,560,000	15,780,952.00	
	BUNDESUBL-148	3.500%	2011/04/08	15,640,000	16,157,684.00	
	BUNDESUBL-149	3.500%	2011/10/14	6,410,000	6,661,913.00	
	BUNDESUBL-150	4.000%	2012/04/13	13,210,000	13,923,340.00	
	BUNDESUBL-151	4.250%	2012/10/12	8,820,000	9,372,132.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
ユーロ	国債証券 (ドイツ)	BUNDESUBL-152	3.500% 2013/04/12	9,050,000	9,364,035.00	
		BUNDESUBL-153	4.000% 2013/10/11	4,870,000	5,121,779.00	
		DEUTSCHLAND REP	5.250% 2010/07/04	5,140,000	5,359,992.00	
		DEUTSCHLAND REP	5.250% 2011/01/04	15,690,000	16,595,313.00	
		DEUTSCHLAND REP	5.000% 2011/07/04	23,690,000	25,234,588.00	
		DEUTSCHLAND REP	5.000% 2012/01/04	10,940,000	11,765,970.00	
		DEUTSCHLAND REP	5.000% 2012/07/04	21,400,000	23,139,820.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.500% 2013/01/04	9,220,000	9,871,854.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.750% 2013/07/04	5,850,000	6,102,720.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.250% 2014/01/04	13,950,000	14,805,135.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.250% 2014/07/04	8,350,000	8,876,885.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.750% 2015/01/04	24,060,000	24,926,160.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.250% 2015/07/04	2,430,000	2,445,673.50	
		DEUTSCHLAND REP	3.500% 2016/01/04	12,600,000	12,795,300.00	

	DEUTSCHLAND REP	6.000%	2016/06/20	11,490,000	13,311,165.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.000%	2016/07/04	7,300,000	7,589,080.00	
	DEUTSCHLAND REP	3.750%	2017/01/04	10,430,000	10,645,901.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.250%	2017/07/04	10,010,000	10,521,511.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.000%	2018/01/04	12,160,000	12,547,904.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.250%	2018/07/04	8,170,000	8,594,840.00	
	DEUTSCHLAND REP	3.750%	2019/01/04	1,800,000	1,819,620.00	
	DEUTSCHLAND REP	3.500%	2019/07/04	4,010,000	3,954,662.00	
	DEUTSCHLAND REP	6.250%	2024/01/04	4,370,000	5,324,845.00	
	DEUTSCHLAND REP	6.500%	2027/07/04	8,200,000	10,342,660.00	
	DEUTSCHLAND REP	5.625%	2028/01/04	970,000	1,115,306.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.750%	2028/07/04	10,090,000	10,636,878.00	
	DEUTSCHLAND REP	6.250%	2030/01/04	2,190,000	2,715,381.00	
	DEUTSCHLAND REP	5.500%	2031/01/04	10,460,000	11,934,860.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.750%	2034/07/04	10,120,000	10,560,220.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.000%	2037/01/04	12,040,000	11,377,800.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.250%	2039/07/04	6,900,000	6,837,210.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.750%	2040/07/04	1,350,000	1,445,850.00	
国債証券 (フィンランド)	FINNISH GOV'T	2.750%	2010/09/15	2,240,000	2,277,184.00	
	FINNISH GOV'T	5.750%	2011/02/23	2,930,000	3,131,291.00	
	FINNISH GOV'T	4.250%	2012/09/15	2,590,000	2,731,932.00	
	FINNISH GOV'T	5.375%	2013/07/04	3,390,000	3,721,203.00	
	FINNISH GOV'T	3.125%	2014/09/15	2,810,000	2,796,512.00	
	FINNISH GOV'T	4.250%	2015/07/04	2,300,000	2,396,370.00	
	FINNISH GOV'T	3.875%	2017/09/15	3,090,000	3,098,034.00	
	FINNISH GOV'T	4.375%	2019/07/04	2,340,000	2,401,308.00	
国債証券 (フランス)	BTAN-5YR ISSUE	2.500%	2010/07/12	1,330,000	1,349,418.00	
	BTAN-5YR ISSUE	3.000%	2011/01/12	8,840,000	9,043,320.00	
	BTAN-5YR ISSUE	3.500%	2011/07/12	17,640,000	18,245,052.00	
	BTAN-5YR ISSUE	3.750%	2012/01/12	13,580,000	14,157,150.00	
	BTAN-5YR ISSUE	4.500%	2012/07/12	9,120,000	9,705,504.00	
	BTAN-5YR ISSUE	3.750%	2013/01/12	3,210,000	3,336,474.00	
	BTAN-5YR ISSUE	4.500%	2013/07/12	4,680,000	4,984,200.00	
	BTAN-5YR ISSUE	2.500%	2014/01/12	120,000	117,600.00	
	FRANCE O.A.T.	5.500%	2010/10/25	10,520,000	11,109,120.00	
	FRANCE O.A.T.	6.500%	2011/04/25	3,500,000	3,803,800.00	
	FRANCE O.A.T.	5.000%	2011/10/25	21,650,000	23,171,995.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
ユーロ	国債証券 (フランス)	FRANCE O.A.T.	5.000% 2012/04/25	2,290,000	2,470,910.00	
		FRANCE O.A.T.	4.750% 2012/10/25	7,750,000	8,320,400.00	
		FRANCE O.A.T.	8.500% 2012/12/26	6,170,000	7,400,729.90	
		FRANCE O.A.T.	4.000% 2013/04/25	12,720,000	13,338,192.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000% 2013/10/25	10,700,000	11,182,570.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000% 2014/04/25	14,560,000	15,174,432.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000% 2014/10/25	2,170,000	2,255,715.00	
		FRANCE O.A.T.	3.500% 2015/04/25	17,920,000	18,115,328.00	
		FRANCE O.A.T.	3.000% 2015/10/25	12,200,000	11,938,920.00	
		FRANCE O.A.T.	3.250% 2016/04/25	6,700,000	6,612,230.00	
		FRANCE O.A.T.	5.000% 2016/10/25	8,750,000	9,543,362.50	
		FRANCE O.A.T.	3.750% 2017/04/25	13,240,000	13,282,368.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250% 2017/10/25	16,010,000	16,504,709.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000% 2018/04/25	9,580,000	9,692,086.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250% 2018/10/25	3,470,000	3,556,056.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250% 2019/04/25	11,300,000	11,563,290.00	
		FRANCE O.A.T.	8.500% 2019/10/25	7,880,000	10,857,773.20	
		FRANCE O.A.T.	3.750% 2021/04/25	8,350,000	8,019,340.00	

	FRANCE O.A.T.	8.500%	2023/04/25	4,640,000	6,649,352.00	
	FRANCE O.A.T.	4.250%	2023/10/25	4,090,000	4,052,372.00	
	FRANCE O.A.T.	6.000%	2025/10/25	4,650,000	5,517,225.00	
	FRANCE O.A.T.	5.500%	2029/04/25	9,280,000	10,500,134.40	
	FRANCE O.A.T.	5.750%	2032/10/25	8,580,000	10,088,878.80	
	FRANCE O.A.T.	4.750%	2035/04/25	13,000,000	13,459,680.00	
	FRANCE O.A.T.	4.000%	2038/10/25	6,500,000	6,005,350.00	
	FRANCE O.A.T.	4.000%	2055/04/25	7,220,000	6,609,910.00	
国債証券 (ギリシャ)	HELLENIC REPUBLI	3.800%	2011/03/20	2,130,000	2,183,889.00	
	HELLENIC REPUBLI	5.350%	2011/05/18	2,450,000	2,579,605.00	
	HELLENIC REPUBLI	3.900%	2011/08/20	8,890,000	9,110,472.00	
	HELLENIC REPUBLI	4.300%	2012/03/20	3,320,000	3,404,992.00	
	HELLENIC REPUBLI	5.250%	2012/05/18	5,450,000	5,739,940.00	
	HELLENIC REPUBLI	4.100%	2012/08/20	1,400,000	1,422,960.00	
	HELLENIC REPUBLI	4.600%	2013/05/20	5,780,000	5,908,316.00	
	HELLENIC REPUBLI	4.000%	2013/08/20	4,220,000	4,206,074.00	
	HELLENIC REPUBLI	6.500%	2014/01/11	2,860,000	3,134,274.00	
	HELLENIC REPUBLI	4.500%	2014/05/20	2,700,000	2,721,600.00	
	HELLENIC REPUBLI	5.500%	2014/08/20	3,100,000	3,236,710.00	
	HELLENIC REPUBLI	3.700%	2015/07/20	9,110,000	8,690,029.00	
	HELLENIC REPUBLI	3.600%	2016/07/20	2,670,000	2,481,498.00	
	HELLENIC REPUBLI	4.300%	2017/07/20	6,100,000	5,780,970.00	
	HELLENIC REPUBLI	4.600%	2018/07/20	3,650,000	3,482,465.00	
	HELLENIC REPUBLI	6.500%	2019/10/22	6,370,000	6,915,272.00	
	HELLENIC REPUBLI	5.900%	2022/10/22	3,310,000	3,401,356.00	
	HELLENIC REPUBLI	4.700%	2024/03/20	6,460,000	5,717,746.00	
HELLENIC REPUBLI	4.500%	2037/09/20	4,420,000	3,551,470.00		
HELLENIC REPUBLI	4.600%	2040/09/20	3,690,000	2,953,476.00		
国債証券 (アイルランド)	IRISH GOVT	4.000%	2011/11/11	2,080,000	2,133,705.60	
	IRISH GOVT	3.900%	2012/03/05	1,910,000	1,940,751.00	
	IRISH GOVT	5.000%	2013/04/18	3,080,000	3,182,194.40	
	IRISH GOVT	4.000%	2014/01/15	2,960,000	2,916,636.00	
	IRISH GOVT	4.600%	2016/04/18	3,150,000	3,074,998.50	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券 (アイルランド)	IRISH GOVT 4.500% 2018/10/18	3,120,000	2,889,588.00	
		IRISH GOVT 4.400% 2019/06/18	4,080,000	3,684,444.00	
		IRISH GOVT 4.500% 2020/04/18	3,580,000	3,216,773.20	
	国債証券 (オランダ)	NETHERLANDS GOVT 5.500% 2010/07/15	6,890,000	7,206,940.00	
		NETHERLANDS GOVT 4.000% 2011/01/15	4,000,000	4,154,000.00	
		NETHERLANDS GOVT 5.000% 2011/07/15	7,170,000	7,636,050.00	
		NETHERLANDS GOVT 2.500% 2012/01/15	4,870,000	4,920,161.00	
		NETHERLANDS GOVT 5.000% 2012/07/15	6,600,000	7,106,880.00	
		NETHERLANDS GOVT 4.250% 2013/07/15	6,590,000	6,947,178.00	
		NETHERLANDS GOVT 3.750% 2014/07/15	4,020,000	4,121,706.00	
		NETHERLANDS GOVT 3.250% 2015/07/15	8,410,000	8,325,900.00	
		NETHERLANDS GOVT 4.000% 2016/07/15	8,480,000	8,649,600.00	
		NETHERLANDS GOVT 4.500% 2017/07/15	4,540,000	4,750,656.00	
		NETHERLANDS GOVT 4.000% 2018/07/15	3,900,000	3,923,400.00	
		NETHERLANDS GOVT 4.000% 2019/07/15	2,060,000	2,051,348.00	
		NETHERLANDS GOVT 3.750% 2023/01/15	3,070,000	2,900,229.00	
		NETHERLANDS GOVT 7.500% 2023/01/15	4,120,000	5,451,584.00	
		NETHERLANDS GOVT 5.500% 2028/01/15	4,390,000	4,956,310.00	
		NETHERLANDS GOVT 4.000% 2037/01/15	6,010,000	5,619,350.00	
	国債証券 (ポルトガル)	PORTUGUESE OT'S 3.200% 2011/04/15	2,880,000	2,943,043.20	
		PORTUGUESE OT'S 5.150% 2011/06/15	2,630,000	2,785,459.30	
		PORTUGUESE OT'S 5.000% 2012/06/15	3,870,000	4,119,808.50	

		PORTUGUESE OT'S	5.450%	2013/09/23	2,890,000	3,134,494.00	
		PORTUGUESE OT'S	4.375%	2014/06/16	2,430,000	2,513,786.40	
		PORTUGUESE OT'S	3.350%	2015/10/15	3,780,000	3,666,789.00	
		PORTUGUESE OT'S	4.200%	2016/10/15	2,810,000	2,818,907.70	
		PORTUGUESE OT'S	4.350%	2017/10/16	2,300,000	2,306,578.00	
		PORTUGUESE OT'S	4.450%	2018/06/15	3,320,000	3,333,877.60	
		PORTUGUESE OT'S	4.750%	2019/06/14	1,900,000	1,925,118.00	
		PORTUGUESE OT'S	3.850%	2021/04/15	3,400,000	3,193,824.00	
		PORTUGUESE OT'S	4.950%	2023/10/25	2,290,000	2,328,128.50	
		PORTUGUESE OT'S	4.100%	2037/04/15	3,060,000	2,711,251.80	
	国債証券 (オーストリア)	REP OF AUSTRIA	5.250%	2011/01/04	4,020,000	4,244,718.00	
		REP OF AUSTRIA	5.000%	2012/07/15	5,050,000	5,402,995.00	
		REP OF AUSTRIA	3.800%	2013/10/20	5,570,000	5,696,439.00	
		REP OF AUSTRIA	4.300%	2014/07/15	5,660,000	5,863,760.00	
		REP OF AUSTRIA	3.400%	2014/10/20	2,740,000	2,709,860.00	
		REP OF AUSTRIA	3.500%	2015/07/15	3,590,000	3,520,354.00	
		REP OF AUSTRIA	4.000%	2016/09/15	5,690,000	5,668,947.00	
		REP OF AUSTRIA	4.300%	2017/09/15	2,310,000	2,322,243.00	
		REP OF AUSTRIA	4.650%	2018/01/15	5,040,000	5,170,032.00	
		REP OF AUSTRIA	4.350%	2019/03/15	3,980,000	3,954,130.00	
		REP OF AUSTRIA	3.900%	2020/07/15	4,010,000	3,793,861.00	
		REP OF AUSTRIA	3.500%	2021/09/15	5,120,000	4,597,248.00	
		REP OF AUSTRIA	6.250%	2027/07/15	3,470,000	4,082,455.00	
	REP OF AUSTRIA	4.150%	2037/03/15	3,320,000	3,012,900.00		
	国債証券 (スペイン)	SPANISH GOV'T	3.250%	2010/07/30	6,510,000	6,656,475.00	
		SPANISH GOV'T	4.100%	2011/04/30	7,690,000	8,012,826.20	
		SPANISH GOV'T	5.400%	2011/07/30	7,000,000	7,490,000.00	
		SPANISH GOV'T	5.350%	2011/10/31	6,600,000	7,087,080.00	
		SPANISH GOV'T	2.750%	2012/04/30	5,270,000	5,319,011.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
ユーロ	国債証券 (スペイン)	SPANISH GOV'T	5.000% 2012/07/30	11,590,000	12,425,639.00	
		SPANISH GOV'T	3.900% 2012/10/31	7,530,000	7,819,001.40	
		SPANISH GOV'T	6.150% 2013/01/31	9,180,000	10,211,832.00	
		SPANISH GOV'T	4.200% 2013/07/30	700,000	730,310.00	
		SPANISH GOV'T	4.250% 2014/01/31	2,190,000	2,281,542.00	
		SPANISH GOV'T	4.750% 2014/07/30	9,560,000	10,168,972.00	
		SPANISH GOV'T	4.400% 2015/01/31	6,640,000	6,923,528.00	
		SPANISH GOV'T	3.150% 2016/01/31	4,120,000	3,976,212.00	
		SPANISH GOV'T	3.800% 2017/01/31	8,800,000	8,704,960.00	
		SPANISH GOV'T	5.500% 2017/07/30	8,640,000	9,539,424.00	
		SPANISH GOV'T	4.100% 2018/07/30	4,120,000	4,117,116.00	
		SPANISH GOV'T	4.600% 2019/07/30	5,950,000	6,095,775.00	
		SPANISH GOV'T	4.800% 2024/01/31	5,270,000	5,343,253.00	
		SPANISH GOV'T	6.000% 2029/01/31	7,570,000	8,700,201.00	
		SPANISH GOV'T	5.750% 2032/07/30	6,850,000	7,676,795.00	
		SPANISH GOV'T	4.200% 2037/01/31	6,620,000	5,962,634.00	
		SPANISH GOV'T	4.900% 2040/07/30	5,780,000	5,847,048.00	
		ユーロ 小計	1,626,010,000	1,691,576,310.60 (231,255,397,422)		
英ポンド	国債証券	TREASURY	4.750% 2010/06/07	8,920,000	9,259,673.60	
		TREASURY	6.250% 2010/11/25	4,100,000	4,405,737.00	
		TREASURY	4.250% 2011/03/07	7,920,000	8,280,360.00	
		TREASURY	9.000% 2011/07/12	3,750,000	4,306,875.00	
		TREASURY	3.250% 2011/12/07	9,470,000	9,725,690.00	
		TREASURY	5.000% 2012/03/07	15,930,000	17,092,890.00	
		TREASURY	5.250% 2012/06/07	2,810,000	3,024,965.00	

TREASURY	4.500%	2013/03/07	15,020,000	15,910,686.00	
TREASURY	8.000%	2013/09/27	3,950,000	4,749,875.00	
TREASURY	2.250%	2014/03/07	6,070,000	5,839,036.50	
TREASURY	5.000%	2014/09/07	6,180,000	6,848,428.80	
TREASURY	4.750%	2015/09/07	5,190,000	5,719,380.00	
TREASURY	8.000%	2015/12/07	6,430,000	8,391,150.00	
TREASURY	4.000%	2016/09/07	12,730,000	13,411,055.00	
TREASURY	8.750%	2017/08/25	2,950,000	4,073,950.00	
TREASURY	5.000%	2018/03/07	9,840,000	10,873,200.00	
TREASURY	4.500%	2019/03/07	5,210,000	5,485,088.00	
TREASURY	4.750%	2020/03/07	6,030,000	6,461,145.00	
TREASURY	8.000%	2021/06/07	7,330,000	10,229,015.00	
TREASURY	4.000%	2022/03/07	900,000	886,941.00	
TREASURY	5.000%	2025/03/07	8,840,000	9,554,890.80	
TREASURY	4.250%	2027/12/07	6,410,000	6,334,169.70	
TREASURY	6.000%	2028/12/07	7,630,000	9,288,914.60	
TREASURY	4.750%	2030/12/07	150,000	157,500.00	
TREASURY	4.250%	2032/06/07	16,320,000	16,033,584.00	
TREASURY	4.250%	2036/03/07	9,640,000	9,246,591.60	
TREASURY	4.750%	2038/12/07	10,620,000	11,076,660.00	
TREASURY	4.250%	2039/09/07	880,000	833,360.00	
TREASURY	4.500%	2042/12/07	5,880,000	5,841,780.00	
TREASURY	4.250%	2046/12/07	11,370,000	10,784,445.00	
TREASURY	4.250%	2049/12/07	9,000,000	8,532,000.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
英ポンド	国債証券	TREASURY 4.250% 2055/12/07	9,210,000	8,826,495.60	
		英ポンド 小計	236,680,000	251,485,532.20 (39,875,545,985)	
スイスフラン	国債証券	SWISS (GOVT) 3.500% 2010/08/07	4,880,000	5,045,920.00	
		SWISS (GOVT) 4.000% 2011/06/10	3,710,000	3,965,619.00	
		SWISS (GOVT) 2.750% 2012/06/10	860,000	908,160.00	
		SWISS (GOVT) 4.000% 2013/02/11	5,610,000	6,160,341.00	
		SWISS (GOVT) 4.250% 2014/01/06	2,120,000	2,374,400.00	
		SWISS (GOVT) 2.500% 2016/03/12	1,830,000	1,882,887.00	
		SWISS (GOVT) 4.250% 2017/06/05	6,000,000	6,867,600.00	
		SWISS (GOVT) 3.000% 2018/01/08	1,550,000	1,630,600.00	
		SWISS (GOVT) 3.000% 2019/05/12	2,610,000	2,732,670.00	
		SWISS (GOVT) 4.000% 2023/02/11	1,740,000	1,961,850.00	
		SWISS (GOVT) 4.000% 2028/04/08	2,720,000	3,087,200.00	
	スイスフラン 小計		33,630,000	36,617,247.00 (3,299,946,299)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDEN GOVT 5.250% 2011/03/15	24,700,000	26,347,490.00	
		SWEDEN GOVT 5.500% 2012/10/08	30,030,000	33,108,075.00	
		SWEDEN GOVT 6.750% 2014/05/05	34,480,000	40,482,968.00	
		SWEDEN GOVT 4.500% 2015/08/12	19,090,000	20,453,026.00	
		SWEDEN GOVT 3.000% 2016/07/12	24,060,000	23,436,846.00	
		SWEDEN GOVT 3.750% 2017/08/12	27,630,000	27,991,953.00	
		SWEDEN GOVT 4.250% 2019/03/12	22,290,000	23,235,096.00	
		SWEDEN GOVT 5.000% 2020/12/01	25,830,000	28,348,425.00	
		SWEDEN GOVT 3.500% 2039/03/30	19,360,000	16,849,008.00	
	スウェーデンクローナ 小計		227,470,000	240,252,887.00 (3,051,211,664)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOV'T 6.000% 2011/05/16	21,220,000	22,796,646.00	
		NORWEGIAN GOV'T 6.500% 2013/05/15	24,770,000	27,866,250.00	
		NORWEGIAN GOV'T 5.000% 2015/05/15	18,510,000	19,814,955.00	
		NORWEGIAN GOV'T 4.250% 2017/05/19	13,920,000	14,121,840.00	

		ノルウェークローネ 小計			78,420,000	84,599,691.00 (1,301,989,244)
デンマーク クローネ	国債証券	DENMARK - BULLET	4.000%	2010/11/15	21,600,000	22,232,880.00
		DENMARK - BULLET	6.000%	2011/11/15	34,260,000	37,343,400.00
		DENMARK - BULLET	5.000%	2013/11/15	35,440,000	38,292,920.00
		DENMARK - BULLET	4.000%	2015/11/15	28,190,000	28,727,019.50
		DENMARK - BULLET	4.000%	2017/11/15	26,300,000	26,563,000.00
		DENMARK - BULLET	7.000%	2024/11/10	11,400,000	14,706,000.00
		DENMARK - BULLET	4.500%	2039/11/15	42,420,000	43,141,140.00
		デンマーククローネ 小計			199,610,000	211,006,359.50 (3,874,076,760)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVT BOND	6.000%	2010/11/24	15,150,000	15,318,468.00
		POLAND GOVT BOND	4.250%	2011/05/24	18,480,000	18,093,768.00
		POLAND GOVT BOND	0.000%	2011/07/25	1,790,000	1,599,812.50
		POLAND GOVT BOND	4.750%	2012/04/25	15,910,000	15,570,162.40
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2013/04/25	10,820,000	10,667,979.00
		POLAND GOVT BOND	5.000%	2013/10/24	11,430,000	11,123,218.80
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2014/04/25	5,810,000	5,788,444.90
		POLAND GOVT BOND	6.250%	2015/10/24	12,970,000	13,165,328.20
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2017/10/25	13,230,000	12,520,607.40

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVT BOND	5.500%	2019/10/25	7,230,000	6,809,069.40	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2022/09/23	10,910,000	10,394,829.80	
		ポーランドズロチ 小計			123,730,000	121,051,688.40 (3,692,076,496)	
シンガポ ールドル	国債証券	SPR GOV'T	4.625%	2010/07/01	2,150,000	2,246,019.00	
		SPR GOV'T	3.125%	2011/02/01	1,820,000	1,899,224.60	
		SPR GOV'T	3.625%	2011/07/01	2,140,000	2,274,541.80	
		SPR GOV'T	2.625%	2012/04/01	810,000	855,870.30	
		SPR GOV'T	3.500%	2012/07/01	2,100,000	2,284,968.00	
		SPR GOV'T	2.500%	2012/10/01	1,490,000	1,583,870.00	
		SPR GOV'T	1.625%	2013/04/01	1,810,000	1,873,114.70	
		SPR GOV'T	2.250%	2013/07/01	900,000	953,469.00	
		SPR GOV'T	3.625%	2014/07/01	2,320,000	2,589,120.00	
		SPR GOV'T	2.875%	2015/07/01	1,690,000	1,799,072.60	
		SPR GOV'T	3.750%	2016/09/01	2,710,000	2,993,411.80	
		SPR GOV'T	4.000%	2018/09/01	1,580,000	1,777,705.40	
		SPR GOV'T	3.250%	2020/09/01	1,050,000	1,097,701.50	
		SPR GOV'T	3.125%	2022/09/01	1,940,000	1,972,844.20	
SPR GOV'T	3.500%	2027/03/01	1,760,000	1,828,604.80			
		シンガポールドル 小計			26,270,000	28,029,537.70 (1,877,418,435)	
マレーシ アリンギ ット	国債証券	MALAYSIAN GOV'T	3.756%	2011/04/28	24,580,000	25,103,062.40	
		MALAYSIAN GOV'T	3.718%	2012/06/15	8,270,000	8,434,573.00	
		MALAYSIAN GOV'T	3.702%	2013/02/25	10,750,000	10,817,510.00	
		MALAYSIAN GOV'T	3.461%	2013/07/31	3,570,000	3,563,681.10	
		MALAYSIAN GOV'T	5.094%	2014/04/30	7,470,000	7,938,443.70	
		MALAYSIAN GOV'T	4.262%	2016/09/15	10,510,000	10,630,654.80	
		MALAYSIAN GOV'T	3.814%	2017/02/15	4,540,000	4,442,798.60	
		MALAYSIAN GOV'T	4.240%	2018/02/07	7,360,000	7,294,716.80	
		MALAYSIAN GOV'T	3.502%	2027/05/31	3,820,000	3,245,472.00	
		MALAYSIAN GOV'T	5.248%	2028/09/15	2,800,000	2,979,956.00	
		マレーシアリンギット 小計			83,670,000	84,450,868.40 (2,335,911,019)	
国債証券 合計						437,867,859,283 (437,867,859,283)	
オーストラ	特殊債券	NEW S WALES TREAS	6.000%	2012/05/01	630,000	647,501.40	

リアドル	NEW S WALES TREAS	5.500%	2017/03/01	1,930,000	1,839,232.10	
	QUEENSLAND TREAS	6.000%	2011/06/14	3,590,000	3,700,823.30	
	QUEENSLAND TREAS	6.000%	2013/08/14	7,620,000	7,728,280.20	
	QUEENSLAND TREAS	6.000%	2015/10/14	19,210,000	19,111,836.90	
オーストラリアドル 小計				32,980,000	33,027,673.90 (2,571,204,413)	
特殊債券 合計					2,571,204,413 (2,571,204,413)	
合計					440,439,063,696 (440,439,063,696)	

## (注) 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券時価比率(注)	有価証券の合計金額 に対する比率
米ドル	107	100.0%	30.8%
カナダドル	25	100.0%	2.6%
ユーロ	233	100.0%	52.5%
英ポンド	32	100.0%	9.1%
スイスフラン	11	100.0%	0.7%
スウェーデンクローナ	9	100.0%	0.7%
ノルウェークローネ	4	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	7	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	11	100.0%	0.8%
シンガポールドル	15	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	10	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	5	100.0%	0.6%
合計	469	100.0%	100.0%

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

## 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。

[前△](#)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】平成21年6月30日

資産総額	927,934,182 円
負債総額	502,924 円
純資産総額( - )	927,431,258 円
発行済口数	1,275,142,717 口
1口当たり純資産額( / )	0.7273 円
1万口当たり純資産額	7,273 円

## &lt;参考&gt;

マザーファンドの現況(平成21年6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	255,946,109,947 円
負債総額	119,673,476 円
純資産総額( - )	255,826,436,471 円
発行済口数	320,145,301,696 口
1口当たり純資産額( / )	0.7991 円
1万口当たり純資産額	7,991 円

(中央三井日本債券マザーファンド)

資産総額	262,845,343,212 円
負債総額	5,563,602,048 円
純資産総額( - )	257,281,741,164 円
発行済口数	227,179,367,740 口
1口当たり純資産額( / )	1.1325 円
1万口当たり純資産額	11,325 円

(中央三井外国株式マザーファンド)

資産総額	289,028,259,367 円
負債総額	296,663,100 円
純資産総額( - )	288,731,596,267 円
発行済口数	349,893,137,122 口
1口当たり純資産額( / )	0.8252 円
1万口当たり純資産額	8,252 円

(中央三井外国債券マザーファンド)

資産総額	457,830,720,145 円
負債総額	114,299,123 円
純資産総額( - )	457,716,421,022 円
発行済口数	276,210,583,650 口
1口当たり純資産額( / )	1.6571 円
1万口当たり純資産額	16,571 円

## 第5【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1期計算期間	1,515,565,240	86,709,615	1,428,855,625
第2期計算期間	71,959,034	221,071,260	1,279,743,399

(注1) 設定及び解約の実績は、全て本邦内における実績です。

(注2) 第1期計算期間の設定口数には、当初募集期間中の募集に係る設定口数を含みます。

## 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。

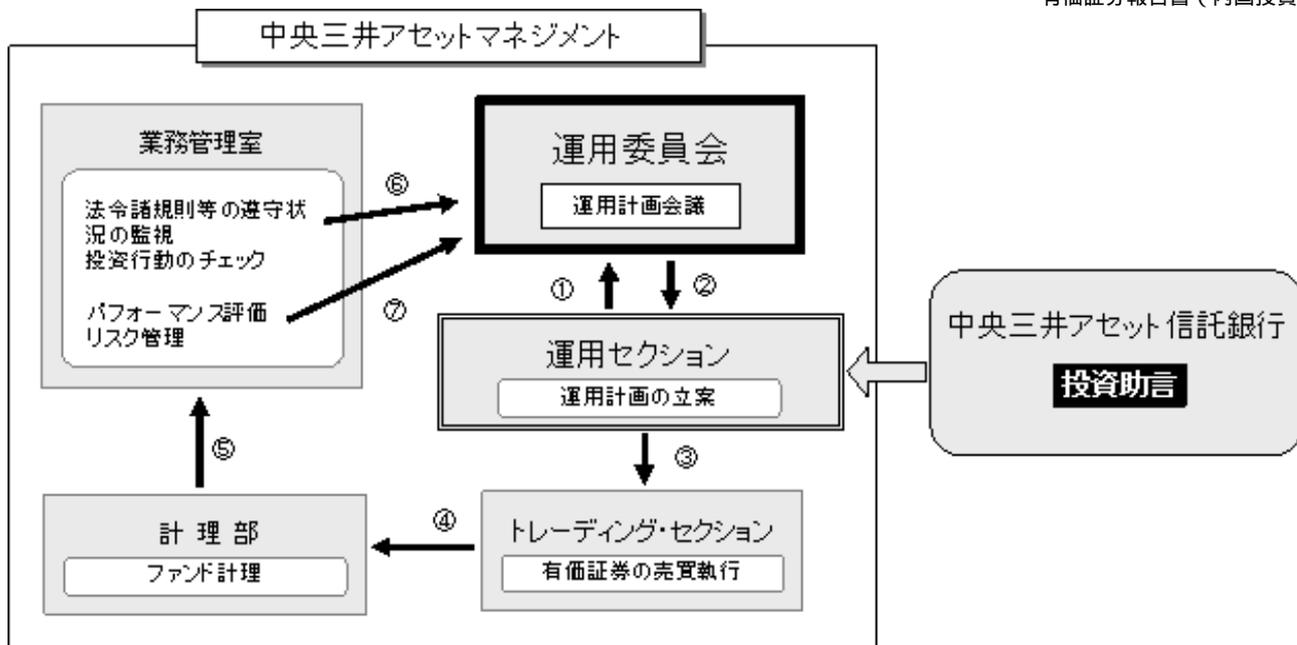
取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

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、招集の手続き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6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	48	452,882
追加型公社債投資信託	-	-
単位型株式投資信託	30	193,210
単位型公社債投資信託	-	-
合計	78	646,092

### 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。

なお、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、監査法人トーマツによる監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

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

科目	第22期 平成20年3月31日		第23期 平成21年3月31日		
	金額（千円）	構成比 （％）	金額（千円）	構成比 （％）	
（負債の部）					
流動負債					
1．預り金		32,286	3,008		
2．未払金					
（1）未払手数料	497,835		316,013		
（2）その他未払金	105,201	603,037	71,990	388,004	
3．未払費用		312,034		246,794	
4．未払法人税等		259,393		103,823	
5．未払消費税等		31,383		-	
6．賞与引当金		35,351		45,488	
流動負債計		1,273,487	41.8	787,118	26.5
固定負債					
1．退職給付引当金		11,007		16,535	
2．役員退職慰労引当金		8,150		22,100	
固定負債計		19,157	0.6	38,635	1.3
負債合計		1,292,645	42.4	825,754	27.8
（純資産の部）					
株主資本					
1．資本金		300,000	9.8	300,000	10.1
2．資本剰余金					
（1）資本準備金		50,000		50,000	
資本剰余金計		50,000	1.6	50,000	1.7
3．利益剰余金					
（1）利益準備金		25,401		25,401	
（2）その他利益剰余金					
繰越利益剰余金		1,382,999		1,771,709	
利益剰余金計		1,408,400	46.2	1,797,110	60.4
株主資本計		1,758,400	57.6	2,147,110	72.2
純資産合計		1,758,400	57.6	2,147,110	72.2
負債・純資産合計		3,051,045	100.0	2,972,864	100.0

## ( 2 ) 【損益計算書】

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

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

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

		第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)	第23期 (平成20年4月1日から 平成21年3月31日まで)
株主資本		(単位：千円)	(単位：千円)
資本金	前期末残高	300,000	300,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	300,000	300,000
資本剰余金			
資本準備金	前期末残高	50,000	50,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	50,000	50,000
資本剰余金合計	前期末残高	50,000	50,000
	当期変動額	-	-
	当期末残高	50,000	50,000
利益剰余金			
利益準備金	前期末残高	25,401	25,401
	当期変動額	-	-
	当期末残高	25,401	25,401
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金	前期末残高	1,088,152	1,382,999
	当期変動額 剰余金の配当 当期純利益	501,970	150,490
		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>	<p>同左</p>
(2) 無形固定資産	<p>定額法を採用しております。</p> <p>なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（5年）を耐用年数としております。</p>	<p>同左</p>
3. 引当金の計上基準 (1) 貸倒引当金	<p>一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p>	<p>同左</p>
(2) 賞与引当金	<p>従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当期負担分を計上しております。</p>	<p>同左</p>
(3) 退職給付引当金	<p>従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による期末退職給付債務相当額を計上しております。</p>	<p>同左</p>
(4) 役員退職慰労引当金	<p>役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づき期末要支給額を計上しております。</p>	<p>同左</p>
4. リース取引の処理方法	<p>リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引にかかる方法に準じた会計処理によって処理しております。</p>	<p>-</p>
5. 消費税等の会計処理	<p>税抜方式を採用しております。</p>	<p>同左</p>

## 会計方針の変更

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

## 追加情報

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

## 注記事項

## 1. 貸借対照表関係

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

## 2. 損益計算書関係

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

## 3. 株主資本等変動計算書関係

項目	期別	第22期 (平成19年4月1日から 平成20年3月31日まで)																																																
1. 発行済株式に関する事項		<table border="1"> <thead> <tr> <th>株式の種類</th> <th>前事業年度末</th> <th>増加</th> <th>減少</th> <th>当事業年度末</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>普通株式(株)</td> <td>5,050</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>5,050</td> </tr> </tbody> </table>					株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末	普通株式(株)	5,050	-	-	5,050																																		
株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末																																														
普通株式(株)	5,050	-	-	5,050																																														
2. 自己株式に関する事項		該当事項はありません。																																																
3. 新株予約権等に関する事項		該当事項はありません。																																																
4. 配当に関する事項		(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																																												

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

## 4. リース取引関係

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

## 5. 有価証券関係

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

## 6. デリバティブ関係

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

## 7. 退職給付関係

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

## 8. 税効果会計関係

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

## 9. 関連当事者情報

第22期（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）

## 兄弟会社

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

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

## 4【利害関係人との取引制限】

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

### (1) 自己又はその役員との取引

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

### (2) 運用財産相互間の取引

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

### (3) 通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

### (4) 親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

### (5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

## 5【その他】

### (1) 定款の変更

当会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称：中央三井アセット信託銀行株式会社

資本金の額：11,000百万円（平成21年3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3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：株式会社新生銀行

資本金の額：476,296百万円(平成21年3月末日現在)

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

## 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20年8月26日	有価証券報告書
平成20年8月26日	有価証券届出書の訂正届出書
平成20年8月26日	有価証券届出書
平成21年3月10日	半期報告書
平成21年3月10日	有価証券届出書の訂正届出書

# 独立監査人の監査報告書

平成20年8月8日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

## 監査法人 トーマツ

指定社員 業務執行社員	公認会計士	浅子正明	印
----------------	-------	------	---

指定社員 業務執行社員	公認会計士	木村充男	印
----------------	-------	------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている新生・4分散ファンドの平成19年10月31日から平成20年6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、新生・4分散ファンドの平成20年6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。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成20年 6月16日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

監査法人 トーマツ

指定社員 業  
務執行社員 公認会計士 浅子正明 印

指定社員 業  
務執行社員 公認会計士 木村充男 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている中央三井アセットマネジメント株式会社の平成19年4月1日から平成20年3月31日までの第22期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、中央三井アセットマネジメント株式会社の平成20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

# 独立監査人の監査報告書

平成21年8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」に掲げられている新生・4分散ファンドの平成20年6月1日から平成21年6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、新生・4分散ファンドの平成21年6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。

[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。