

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成22年7月26日
【計算期間】	第1期（自 平成21年10月30日 至 平成22年4月26日）
【ファンド名】	日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）
【発行者名】	中央三井アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 山本 聡
【本店の所在の場所】	東京都港区芝三丁目23番1号
【事務連絡者氏名】	大供 修二
【連絡場所】	東京都港区芝三丁目23番1号 業務企画部
【電話番号】	03-5440-0170
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

① ファンドの目的

当ファンドは、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。

② 信託金限度額

上限 1,000億円

③ 基本的性格

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

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単 位 型	国 内	株 式
	海 外	債 券
追 加 型	内 外	不動産投信
		その他資産 ()
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

（用語の定義について）

当ファンドが該当する商品分類に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

<単位型投信・追加型投信>

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

<投資対象地域>

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

<投資対象資産（収益の源泉）>

- ・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
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	
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド
不動産投信		中南米	ファンド ・オブ・ ファンズ
その他資産 ()	その他 ()	アフリカ 中近東 (中東)	
資産複合 (その他資産（投資信託証券 (株式、債券)）、短期金融商品) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング	

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(用語の定義について)

当ファンドが該当する属性区分に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

<投資対象資産>

- ・資産複合（その他資産（投資信託証券（株式、債券））、短期金融商品）資産配分変更型
…目論見書又は投資信託約款において、複数資産（株式、債券、短期金融商品）を投資対象とし、投資割合については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。

<決算頻度>

- ・年2回…目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。

<投資対象地域>

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

<投資形態>

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

④ ファンドの特色

A. 安定した値動き・利金収入に期待する「国内債券」に、高い成長に期待する「国内株式」をプラスします。

主として、中央三井日本債券マザーファンド及び中央三井日本株式マザーファンド（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。）への投資を通じて、国内の債券及び株式に投資することで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。

基本配分比率は国内債券（中央三井日本債券マザーファンド）80%、国内株式（中央三井日本株式マザーファンド）20%とします。

なお、当ファンドのベンチマークはありませんが、以下の各指数を、参考指数として使用することがあります。

イ. 中央三井日本債券マザーファンド：「NOMURA－BPI総合」

ロ. 中央三井日本株式マザーファンド：「TOPIX」（東証株価指数、配当込み）

ハ. 上記イ. 及びロ. を指数化したものに基本配分比率を乗じて当社が算出した複合指数

※NOMURA－BPI総合について

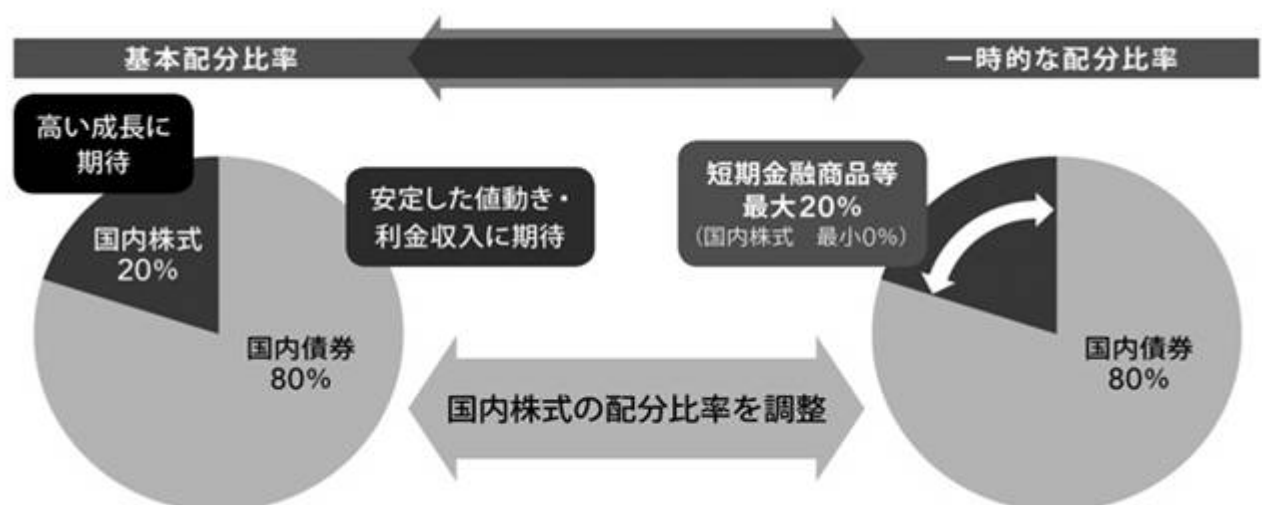
NOMURA－BPI総合は、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。この指数は野村證券株式会社の知的財産であり、野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果に関し、一切責任はありません。

※「TOPIX」（東証株価指数、配当込み）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。

B. 国内株式市場の動向を勘案し、国内株式の配分比率を調整します。

基本配分比率は国内債券80%、国内株式20%としますが、基準価額の変動を抑えることを目的として、国内株式の配分比率を20%未満（最小0%）に引下げ、その引下げた部分は短期金融商品等により運用することがあります。



※基本配分比率には各マザーファンド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原則リバランスを行います。

国内株式の配分比率調整に当たってのポイント

主として定量的側面から国内株式市場の方向性・リスク等を勘案の上、国内株式の配分比率を調整し

ます。下記のイ．及びロ．は国内株式の配分比率の調整ポイントの一例で、このような観点から国内株式の配分比率を引き下げることがあります。

イ．国内株式市場の方向性

ある時点において株価が上昇傾向にあるか下落傾向にあるかを「方向性」といい、方向性を表すものの一つに株価の移動平均線があります。短期の方向性（短期の移動平均線）が長期の方向性（長期の移動平均線）を下回っている期間は、株価が下落傾向となっていることがこれまで多く見られました。

ロ．国内株式市場のリスク

株価の騰落率のブレ（標準偏差）の大きさを「リスク」といいます。短期のリスク（短期の標準偏差）が長期のリスク（長期の標準偏差）を上回っている場合、一般に、値動きが過去に比べて大きく、不安定になっていると判断されます。

C. 原則として、半年に1度の決算時に、収益分配を行うことを目指します。

毎年4月、10月の各24日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、投資している債券からの利金収入に株式の値上がり益も付加した収益分配を目指します。ただし、委託会社の判断により、決算時に収益分配を行わないこともあります。

（2）【ファンドの沿革】

平成21年9月15日 有価証券届出書を関東財務局長に提出

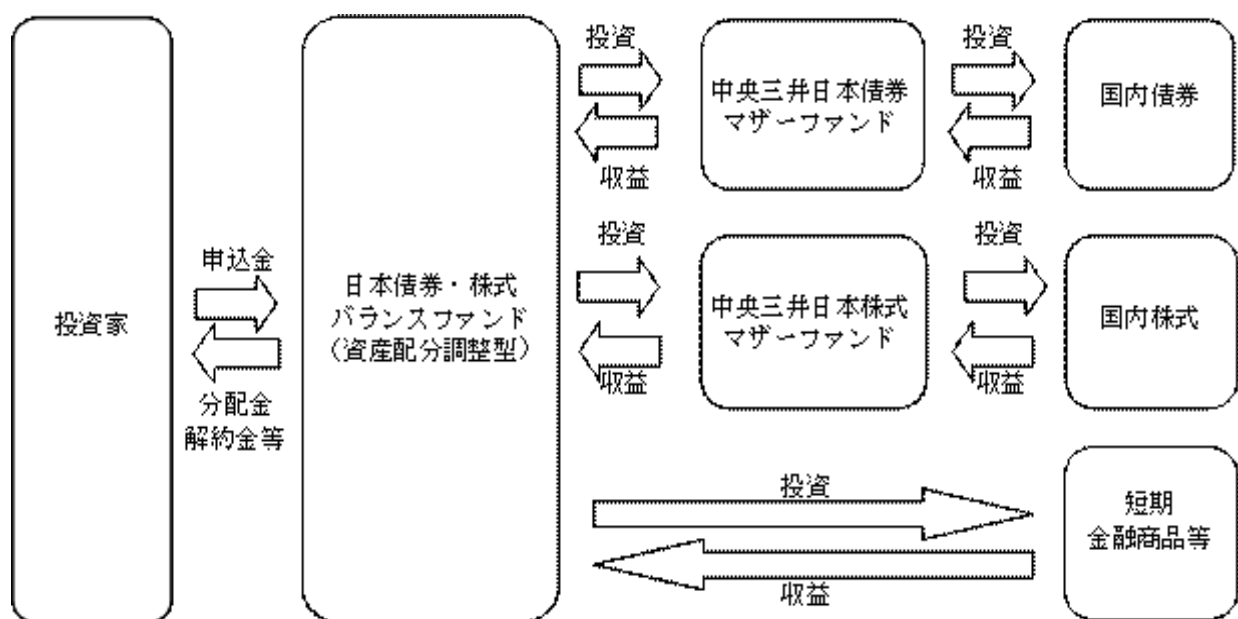
平成21年10月30日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

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

（3）【ファンドの仕組み】

① ファミリーファンド方式での運用

ファミリーファンド方式とは、投資家から投資された資金をまとめてベビーファンド（日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型））とし、その資金をマザーファンド（中央三井日本債券マザーファンド及び中央三井日本株式マザーファンド）に投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。なお、国内の債券、株式、短期金融商品等に直接投資することもあります。



② ファンドの関係法人

委託会社 中央三井アセットマネジメント株式会社

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

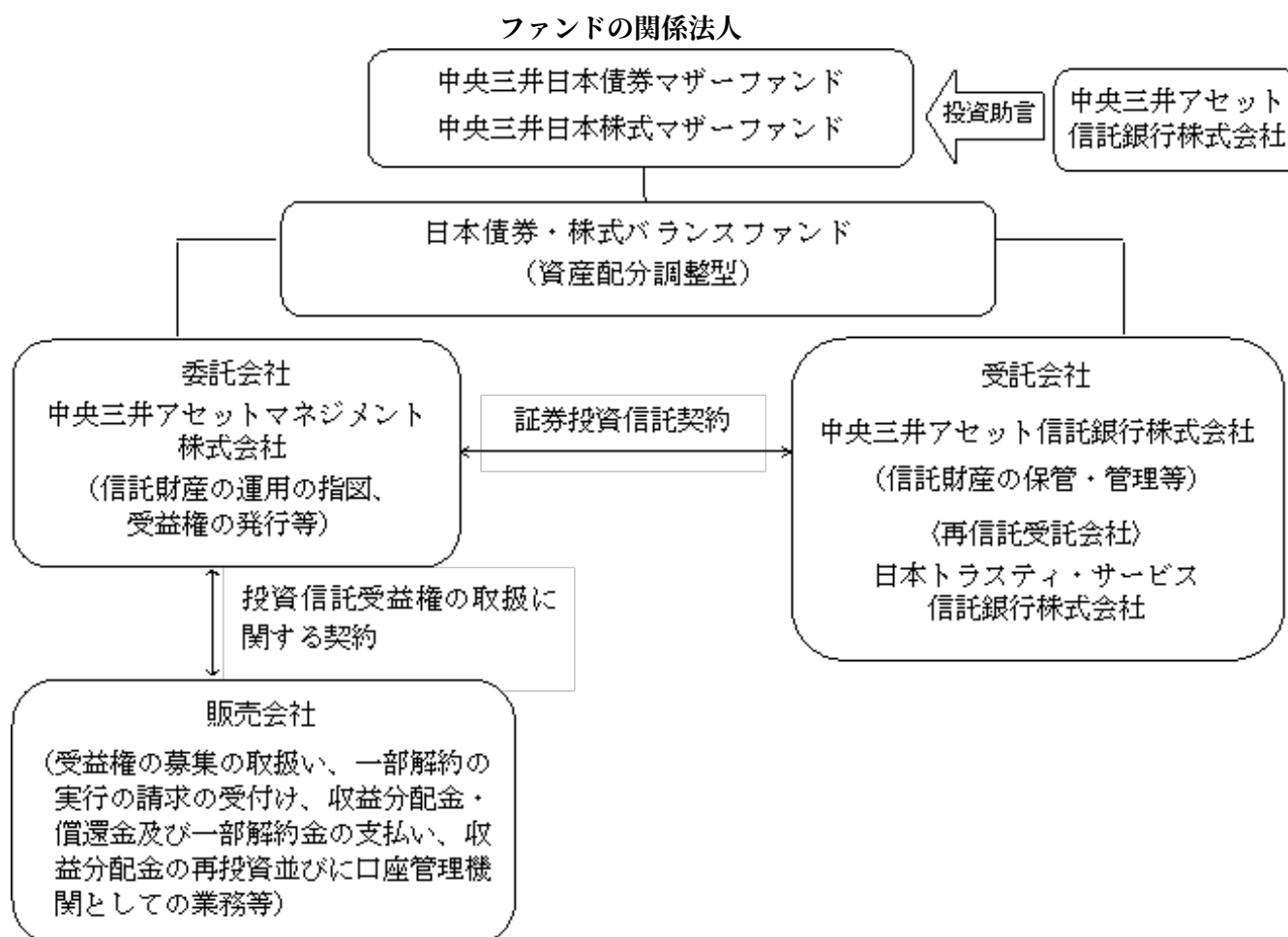
受託会社 中央三井アセット信託銀行株式会社

（再信託受託会社 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

販売会社

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



委託会社と関係法人との契約の概要

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

③ 委託会社の概況

A. 資本金の額：3 億円（平成22年7月26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22年7月26日現在）

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

① 運用方針

中央三井日本債券マザーファンド及び中央三井日本株式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、国内の債券・株式に分散投資することになります。このほか、国内の債券、株式、短期金融商品等に直接投資することもあります。

② 投資態度

A. 主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内の債券及び株式に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. マザーファンド受益証券の基本配分比率を、以下のとおりとします。なお、実際の配分比率が、基本配分比率から一定幅を超えて乖離した場合、原則リバランスを行います。

・中央三井日本債券マザーファンド受益証券：80%

・中央三井日本株式マザーファンド受益証券：20%

C. 上記B. の基本配分比率にかかわらず、基準価額の変動を抑えることを目的として、主として定量的側面から国内株式市場のリスク・方向性等を勘案のうえ、中央三井日本株式マザーファンド受益証券の配分比率を20%未満に引下げ、引下げた部分は短期金融商品等により運用することがあります。その結果、中央三井日本株式マザーファンド受益証券の組入れを行わない場合もあります。

D. 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。

E. 株式以外の資産への実質投資割合には制限を設けません。

F. 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。

G. 国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。

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

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

（2）【投資対象】

① 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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）①J.、K. 及びL. に定めるものに限ります。）

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

② 運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として中央三井アセットマネジメント株式会社を委託者とし、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「中央三井日本債券マザーファンド」及び「中央三井日本株式マザーファンド」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。）（本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

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

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

③ 運用指図できる金融商品

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

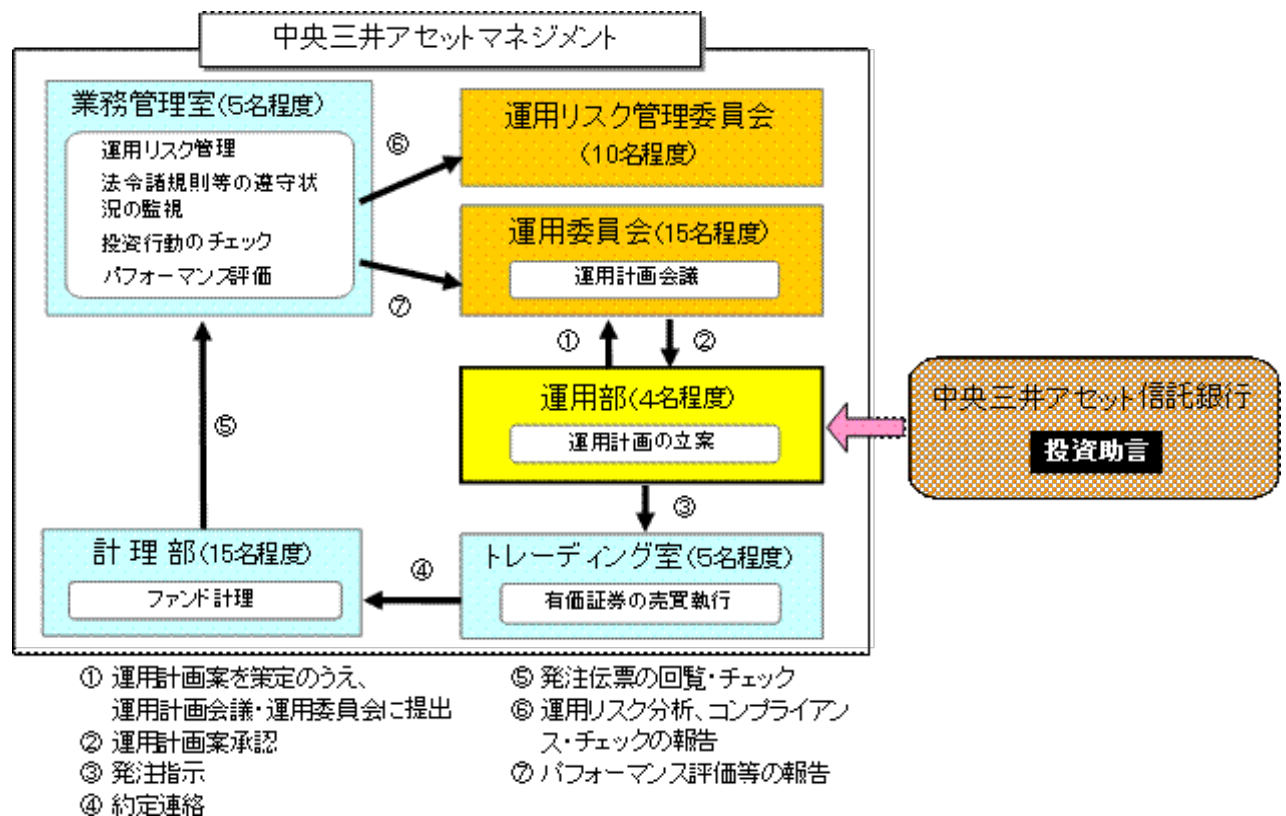
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で上記5. の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

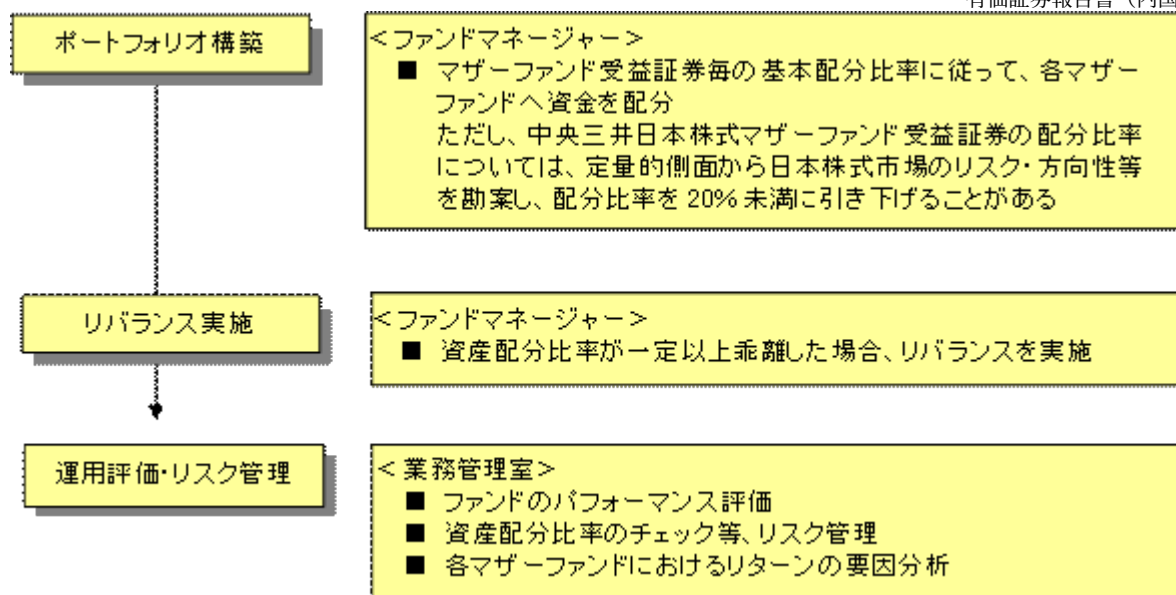
当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記A. に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(3) 【運用体制】

当ファンドの運用体制は以下のとおりです。



具体的なポートフォリオ構築プロセスは、以下のとおりです。



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

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

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

（４）【分配方針】

① 分配方針

年２回の毎決算時（決算日は４月及び１０月の各２４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。

② 分配収益の計算

- A. 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。
 - イ. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）とみなし配当等収益との合計額は、諸経費（後記「４ 手数料等及び税金（４）その他の手数料等 ①」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。

ニ. 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、上記ニ. 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。

③ 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、）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】

① 約款に定める投資制限

A. 株式への投資割合

株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の25%以下とします。

B. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

C. 新株引受権証券等への投資割合

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

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

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

I. 信用取引の指図範囲

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

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

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

J. 先物取引等の運用指図

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、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、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

K. スワップ取引の運用指図

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

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

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

ニ. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

L. 金利先渡取引の運用指図

- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ. 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- M. 有価証券の貸付の指図及び範囲
- イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の 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、有価証券の貸付にあたり、担保の受入れが必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- N. 公社債の空売りの指図及び範囲
- イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有し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ることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ロ. 上記イ. の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ. 信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ. の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、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あたり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ. 上記イ. の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ. 信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ. の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ. 上記イ. の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- P. 一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
- 委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
- Q. 再投資の指図
- 委託会社は、上記 P. の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。
- R. 資金の借入れ

- イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- ロ. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券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。
- S. 受託会社による資金の立替え
- イ. 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。
- ロ. 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ハ. 上記イ. 及びロ. の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。
- T. 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 R. 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ます。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 R. 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。
- 二. 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。

② 関連法令に基づく投資制限

- A. 発生し得る危険に対応する額として算出した額が運用財産の純資産額を超える場合におけるデリバティブ取引に関する制限
（金融商品取引法第42条の2第7号、金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）
委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社等が定めた合理的な方法

により算出した額が当該運用財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）を行い、又は継続することを内容とした運用を行わないものとします。

B. 同一の法人の発行する株式への投資制限

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

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

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

ロ. 当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数

（参考）マザーファンドの概要

「中央三井日本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

- ① 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。
- ② 運用に際しては、中央三井アセット信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、中央三井アセット信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことができます。
- ⑦ 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

- ① 株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（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。
- ② 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。
- ③ 外貨建資産への投資は、行いません。
- ④ 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。

「中央三井日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

（1）投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

（2）投資態度

- ① 株式への投資は、原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、「TOPIX」（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ② 運用に際しては、中央三井アセット信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、中央三井アセット信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。
- ③ 株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。
- ④ 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ⑤ ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- ⑥ 国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- ⑦ 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためスワップ取引を行うことができます。
- ⑧ 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

- ① 株式への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資は、行いません。
- ③ 新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ④ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ⑤ 同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥ 同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑦ 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

3【投資リスク】

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

当ファンドの主なリスクは以下のとおりです。

① 株価変動リスク

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

② 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。

③ 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、利払いや償還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、信用リスクが顕在化した場合、また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。

④ 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。

⑤ 資産配分調整に係るリスク

当ファンドは、基準価額の変動を抑えることを目的として、国内株式の配分比率を20%未満に引き下げることがあります。

この資産配分の調整がファンドの損失を減少させる場合もありますが、国内株式市場の動向によっては、株式投資から得られたであろう利益が得られなくなり、結果としてファンドの収益を減少させる場合があります。

- (2) 当ファンドはファミリーファンド方式（前記「1 ファンドの性格（3）ファンドの仕組み ① ファミリーファンド方式での運用」をご参照下さい。）で運用を行います。そのため、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等に伴う資金変動があり、その結果、当該マザーファンドにおいて有価証券の売買等が行われた場合等には、その売買による組入る有価証券等の価格の変化や売買手数料等の負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。この影響が、当ファンドの基準価額の変動要因となる可能性があります。

(3) 投資リスクに対する管理体制

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

- ① 法令諸規則、約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェック、リスクのモニタリングは、業務管理室が日々実施しております。問題が生じた場合は、運用担当者に連絡され速やかに是正を図るとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。
- ② パフォーマンス評価等は、業務管理室において行っております。問題が生じた場合は、運用担当者に連絡され速やかに是正を図るとともに、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。

（４）信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資家の皆様に帰属します。

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

- ① 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、2.1%（税抜（※３）2.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を「お申込受付日の基準価額（当初申込期間中は１口当たり１円）×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：お申込受付日の基準価額（当初申込期間中は１口当たり１円）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。）。

- ② 「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。

※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。

- ③ 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。

- ④ 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。

- ⑤ 上記①から③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

・お問い合わせ窓口

電 話：０３－５４４０－０１９０

受付時間：営業日の９時～１７時（本邦金融商品取引所が半日立会いの場合は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】

- ① 解約手数料はありませんが、下記②の信託財産留保額が控除されます。

- ② 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額から、当該基準価額に0.12%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」「④ 個人の受益者に対する課税」もしくは「⑤ 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
----------	-----	-----

中央三井日本債券マザーファンド	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	0.1%
中央三井日本株式マザーファンド		0.2%

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

- ① 信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の78.75（税抜 年10,000分の75）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42（税抜 10,000分の40）、受託会社10,000分の5.25（税抜 10,000分の5）及び販売会社10,000分の31.5（税抜 10,000分の30）です。

なお、マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

- ② 上記①の信託報酬は、毎計算期末又は信託終了のときに信託財産中から支弁します。
③ 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】

- ① 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど信託財産中から支弁します。
② 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。

- ③ 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。
④ 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】

① 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ついては各販売会社毎に、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「③ 収益分配金の課税について」をご参照ください。）

② 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④又は⑤をご参照ください。

③ 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。

④ 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。

⑤ 法人の受益者に対する課税

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22年5月31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	中央三井日本債券マザーファンド	日本	871,240,096	79.98
	中央三井日本株式マザーファンド	日本	214,189,361	19.66
	親投資信託受益証券合計		1,085,429,457	99.64
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）			3,876,776	0.36
合計（純資産総額）			1,089,306,233	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	304,679,251,526	98.66
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,151,553,582	1.34
合計（純資産総額）		308,830,805,108	100.00

（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	247,320,208,150	97.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,594,579,861	2.98
合計（純資産総額）		254,914,788,011	100.00

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

（2）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

種類	銘柄	口数	簿価（円）		評価額（円）		投資 比率 （％）
			単価	金額	単価	金額	
親投資信託 受益証券	中央三井日本債券 マザーファンド	751,198,566	1.1548	867,518,674	1.1598	871,240,096	79.98
	中央三井日本株式 マザーファンド	277,807,214	0.8504	236,260,236	0.7710	214,189,361	19.66

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

<参考>

当ファンドが主要投資対象としている親投資信託の状況

(中央三井日本債券マザーファンド)

① 投資有価証券の主要銘柄

A. 主要銘柄の明細

順位	銘柄名	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（５年）第８８回	0.5	2015/3/20	4,800,000,000	100.13	4,806,525,000	100.32	4,815,744,000	1.56
2	利付国庫債券（１０年）第３０５回	1.3	2019/12/20	4,500,000,000	100.07	4,503,394,000	100.72	4,532,715,000	1.47
3	利付国庫債券（５年）第８７回	0.5	2014/12/20	3,800,000,000	100.00	3,800,086,000	100.46	3,817,822,000	1.24
4	利付国庫債券（５年）第８６回	0.6	2014/9/20	3,600,000,000	100.73	3,626,284,000	101.05	3,638,088,000	1.18
5	利付国庫債券（５年）第６０回	1.2	2011/9/20	2,900,000,000	101.74	2,950,721,000	101.37	2,939,846,000	0.95
6	利付国庫債券（５年）第６３回	1.2	2012/3/20	2,800,000,000	102.20	2,861,852,000	101.87	2,852,612,000	0.92
7	利付国庫債券（１０年）第２８４回	1.7	2016/12/20	2,550,000,000	105.87	2,699,815,000	106.66	2,719,855,500	0.88
8	利付国庫債券（１０年）第２８８回	1.7	2017/9/20	2,500,000,000	105.42	2,635,525,000	106.50	2,662,500,000	0.86
9	利付国庫債券（１０年）第３０３回	1.4	2019/9/20	2,500,000,000	101.03	2,525,750,000	102.01	2,550,350,000	0.83
10	利付国庫債券（１０年）第２８５回	1.7	2017/3/20	2,300,000,000	105.72	2,431,638,000	106.65	2,453,134,000	0.79
11	利付国庫債券（１０年）第３０６回	1.4	2020/3/20	2,400,000,000	100.63	2,415,224,000	101.26	2,430,336,000	0.79
12	利付国庫債券（２年）第２９０回	0.2	2012/3/15	2,400,000,000	100.09	2,402,194,000	100.08	2,402,112,000	0.78
13	利付国庫債券（５年）第８１回	0.8	2014/3/20	2,300,000,000	101.77	2,340,799,000	101.93	2,344,459,000	0.76
14	利付国庫債券（１０年）第２８９回	1.5	2017/12/20	2,200,000,000	103.78	2,283,285,000	104.87	2,307,140,000	0.75
15	利付国庫債券（２年）第２９１回	0.2	2012/4/15	2,300,000,000	100.08	2,301,855,000	100.09	2,302,139,000	0.75
16	利付国庫債券（５年）第６４回	1.5	2012/6/20	2,200,000,000	103.13	2,268,948,000	102.73	2,260,126,000	0.73
17	利付国庫債券（５年）第７１回	1.3	2013/3/20	2,100,000,000	103.19	2,167,117,000	103.05	2,164,176,000	0.70
18	利付国庫債券（５年）第８２回	0.9	2014/3/20	2,100,000,000	101.99	2,141,895,000	102.30	2,148,468,000	0.70
19	利付国庫債券（５年）第６１回	1.2	2011/12/20	2,100,000,000	101.99	2,141,874,000	101.63	2,134,377,000	0.69
20	利付国庫債券（５年）第８５回	0.7	2014/9/20	2,100,000,000	100.99	2,120,790,000	101.48	2,131,122,000	0.69
21	利付国庫債券（１０年）第２９７回	1.4	2018/12/20	2,000,000,000	102.47	2,049,550,000	103.02	2,060,560,000	0.67
22	利付国庫債券（１０年）第３０２回	1.4	2019/6/20	2,000,000,000	101.18	2,023,698,000	102.34	2,046,840,000	0.66
23	利付国庫債券（５年）第８３回	0.9	2014/6/20	2,000,000,000	101.96	2,039,200,000	102.33	2,046,740,000	0.66
24	利付国庫債券（１０年）第２８６回	1.8	2017/6/20	1,900,000,000	106.27	2,019,154,000	107.27	2,038,282,000	0.66
25	利付国庫債券（１０年）第２９５回	1.5	2018/6/20	1,900,000,000	103.31	1,962,928,000	104.42	1,984,037,000	0.64
26	利付国庫債券（５年）第６９回	0.9	2012/12/20	1,900,000,000	101.88	1,935,826,000	101.80	1,934,200,000	0.63
27	利付国庫債券（１０年）第２６９回	1.3	2015/3/20	1,840,000,000	103.80	1,909,956,800	104.13	1,916,084,000	0.62
28	利付国庫債券（２年）第２８７回	0.3	2011/12/15	1,900,000,000	100.28	1,905,339,000	100.24	1,904,636,000	0.62
29	利付国庫債券（１０年）第２９６回	1.5	2018/9/20	1,800,000,000	103.08	1,855,478,000	104.11	1,873,980,000	0.61
30	利付国庫債券（１０年）第２３４回	1.4	2011/9/20	1,840,000,000	102.07	1,878,235,200	101.62	1,869,918,400	0.61
合計				73,530,000,000		75,004,936,000		75,282,398,900	24.38

(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	73.35

地方債証券	6.32
特殊債券	10.74
社債券	8.25
合計	98.66

（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の評価金額の比率をいいます。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

銘柄名	国／地域	数量 (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	7	985,470,290	982,870,000	0.32

（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、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段で評価しております。

（中央三井日本株式マザーファンド）

① 投資有価証券の主要銘柄

A. 主要銘柄の明細

順位	銘柄名	業種	株数	簿価（円）		評価額（円）		投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額	
1	トヨタ自動車	輸送用機器	2,882,900	4,055.00	11,690,159,500	3,280.00	9,455,912,000	3.71
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	15,772,700	493.00	7,775,941,100	441.00	6,955,760,700	2.73
3	本田技研工業	輸送用機器	1,789,800	3,230.00	5,781,054,000	2,770.00	4,957,746,000	1.94
4	キャノン	電気機器	1,300,900	3,766.27	4,899,540,643	3,745.00	4,871,870,500	1.91
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,576,400	2,986.06	4,707,224,984	2,703.00	4,261,009,200	1.67
6	三菱商事	卸売業	1,657,600	2,292.00	3,799,219,200	2,052.00	3,401,395,200	1.33
7	日本電信電話	情報・通信業	874,100	3,965.00	3,465,806,500	3,685.00	3,221,058,500	1.26
8	任天堂	その他製品	118,600	25,530.00	3,027,858,000	26,880.00	3,187,968,000	1.25
9	ソニー	電気機器	1,121,700	3,145.00	3,527,746,500	2,816.00	3,158,707,200	1.24
10	武田薬品工業	医薬品	826,700	4,000.00	3,306,800,000	3,795.00	3,137,326,500	1.23
11	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	18,352,700	189.89	3,485,013,774	164.00	3,009,842,800	1.18
12	東京電力	電気・ガス業	1,321,900	2,488.00	3,288,887,200	2,257.00	2,983,528,300	1.17
13	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	18,306	137,800.00	2,522,566,800	135,300.00	2,476,801,800	0.97
14	パナソニック	電気機器	2,054,400	1,506.00	3,093,926,400	1,161.00	2,385,158,400	0.94
15	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	4,153,000	707.00	2,936,171,000	566.00	2,350,598,000	0.92
16	三井物産	卸売業	1,787,200	1,394.00	2,491,356,800	1,294.00	2,312,636,800	0.91
17	東日本旅客鉄道	陸運業	390,800	6,180.00	2,415,144,000	5,880.00	2,297,904,000	0.90
18	東芝	電気機器	4,732,000	520.00	2,460,640,000	467.00	2,209,844,000	0.87
19	東京海上ホールディングス	保険業	844,600	2,615.00	2,208,629,000	2,549.00	2,152,885,400	0.84

20	ファナック	電気機器	217,300	8,460.00	1,838,358,000	9,610.00	2,088,253,000	0.82
21	三菱地所	不動産業	1,456,000	1,543.00	2,246,608,000	1,391.00	2,025,296,000	0.79
22	ソフトバンク	情報・通信業	906,600	2,435.00	2,207,571,000	2,181.00	1,977,294,600	0.78
23	新日本製鐵	鉄鋼	6,176,000	364.00	2,248,064,000	319.00	1,970,144,000	0.77
24	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	885,700	1,948.00	1,725,343,600	2,099.00	1,859,084,300	0.73
25	関西電力	電気・ガス業	858,600	2,121.00	1,821,090,600	2,086.00	1,791,039,600	0.70
26	日立製作所	電気機器	4,788,000	316.00	1,513,008,000	372.00	1,781,136,000	0.70
27	日産自動車	輸送用機器	2,524,100	750.00	1,893,075,000	664.00	1,676,002,400	0.66
28	小松製作所	機械	975,900	1,937.00	1,890,318,300	1,709.00	1,667,813,100	0.65
29	信越化学工業	化学	361,900	4,945.00	1,789,595,500	4,580.00	1,657,502,000	0.65
30	日本たばこ産業	食料品	5,234	323,000.00	1,690,582,000	285,600.00	1,494,830,400	0.59
合計			80,731,640		97,747,299,401		88,776,348,700	34.83

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

（注２）国／地域は全て日本、種類は全て株式です。

B. 種類別及び業種別の投資比率

種類	業種	投資比率（％）
----	----	---------

株式	水産・農林業	0.10
	鉱業	0.35
	建設業	1.83
	食料品	3.07
	繊維製品	0.79
	パルプ・紙	0.41
	化学	5.64
	医薬品	3.95
	石油・石炭製品	0.75
	ゴム製品	0.57
	ガラス・土石製品	1.23
	鉄鋼	2.47
	非鉄金属	1.21
	金属製品	0.69
	機械	4.44
	電気機器	14.47
	輸送用機器	9.41
	精密機器	1.44
	その他製品	2.30
	電気・ガス業	4.89
	陸運業	3.82
	海運業	0.60
	空運業	0.33
	倉庫・運輸関連業	0.23
	情報・通信業	5.34
	卸売業	4.97
	小売業	3.57
	銀行業	9.32
	証券、商品先物取引業	1.63
	保険業	2.70
	その他金融業	0.67
	不動産業	2.24
	サービス業	1.62
	合計	97.02

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

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

銘柄名	国／地域	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引 買建 TOPIX先物取引	日本	855	7,858,556,525	7,511,175,000	2.95

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

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

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）		１万口当たりの基準価額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第１期計算期間（平成22年４月26日現在）	817,273,434	836,068,629	10,001	10,231
平成21年10月末日	103,551,106	—	10,000	—
平成21年11月末日	228,765,524	—	10,000	—
平成21年12月末日	404,859,744	—	10,083	—
平成22年１月末日	548,298,022	—	10,013	—
平成22年２月末日	550,317,132	—	10,013	—
平成22年３月末日	569,914,468	—	10,146	—
平成22年４月末日	845,028,384	—	10,000	—
平成22年５月末日	1,089,306,233	—	9,794	—

②【分配の推移】

	１万口当たりの収益分配金
第１期計算期間	230 円

③【収益率の推移】

	収益率
第１期計算期間	2.3 %

（注）収益率とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ちの額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数とします。なお、第１期計算期間については、前期末基準価額の代わりに当初募集時の発行価額（１万口当たり10,000円）を使用しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済み口数
第１期計算期間	938,091,647	120,909,227	817,182,420

（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2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

（1）申込みの受付け

申込期間中において、毎営業日お申込みいただけます。

（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）②をご参照ください。）に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付けを中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

（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。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。

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。

（3）販売価額

① 当初申込期間

1口当たり1円に、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。

② 継続申込期間

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

（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。

① 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、2.1%（税抜（※3）2.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を「お申込受付日の基準価額（当初申込期間中は1口当たり1円）×取得口数」に乗じて得た額とします。

※1：お申込受付日の基準価額（当初申込期間中は1口当たり1円）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。

② 「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。

③ 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。

- ④ 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。
- ⑤ 上記①及び③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

- ① 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。
- ② 「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。
- ③ 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、信託契約締結により生じた受益権については信託設定時に、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、委託会社に対し販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

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、下記（4）に記載の照会先にお問い合わせください。

（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基準価額から、当該基準価額に0.12%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/>）でご覧いただけます。

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

・お問い合わせ窓口

電 話：03-5440-0190

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

・ホームページ アドレス：<http://www.cmam.co.jp/>

- （5）委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、上記（1）による一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、及び既に受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取消することができます。
- （6）上記（5）により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして上記（4）の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。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

① 基準価額

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

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出され、日々の基準価額は、販売会社へお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします（販売会社の詳細につきましては、前記「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「庭職人」の略号にて）掲載されております。

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

A. 親投資信託受益証券（中央三井日本債券マザーファンド及び中央三井日本株式マザーファンド）
計算日の基準価額で評価します。

B. 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

計算日における次のイ. からハ. までの掲げるいずれかの価額で評価します。

イ. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

ハ. 価格情報会社の提供する価額

C. 国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

当ファンドの信託期間は、信託契約締結日（平成21年10月30日）から無期限とします。ただし、委託会社は、下記（5）①の事項に該当することとなった場合は、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

(4) 【計算期間】

- ① 当ファンドの計算期間は、毎年4月25日から10月24日まで、及び10月25日から翌年4月24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21年10月30日から平成22年4月26日までとします。
- ② 上記①の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

① 信託の終了

この信託契約を解約し信託を終了させる場合は下記のとおりです。

A. 委託会社の所定の手続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。

ハ. 所定の手続き

- a. 委託会社は、上記イ. 及びロ. の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を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発します。
- 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も適用しません。

B. 監督官庁の命令

イ. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

ロ. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款の変更をしようとするときは、下記③の規定に従います。

C. 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

イ. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、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③の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

D. 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い

イ. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に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③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。

② 委託会社の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い

A. 委託会社は、事業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

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

③ 信託約款の変更等

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③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ます。

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であっても、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。

④ 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る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続きに関する事項は、上記①A. ハ、b. 又は③B. に規定する書面に付記します。

⑤ 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥ 信託財産の管理

A. 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、下記ハ、及び⑨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ます。

ハ. 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ます。

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. 委託会社のための指図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ます。

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

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

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

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

⑦ 運用報告書

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

⑧ 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。

⑨ 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ます。

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。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次のとおりです。

（1）収益分配金に対する請求権

- ① 受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。
- ② 収益分配金は、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します。）に対する支払いを開始します。
- ③ 上記②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。
- ④ 上記②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。
- ⑤ 受益者が、収益分配金については上記②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

- ① 受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。
- ② 償還金は、信託終了日（償還日）後1ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日）から起算して5営業日までの日）から、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に対する支払いを開始します。
- ③ 償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。
- ④ 受益者が、信託終了による償還金については上記②に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求

しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

（３）一部解約請求権

- ① 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。
- ② 一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、５営業日目から当該受益者に支払われます。
- ③ 一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

（４）投資信託約款等重要事項変更時の反対者の買取請求権

前記「３ 資産管理等の概要 （５）その他 ④ 反対者の買取請求権」をご参照ください。

（５）受益権均等分割

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

（６）帳簿閲覧権

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

（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3【ファンドの経理状況】

- （1）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」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。

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21年10月30日から平成22年4月26日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1 【財務諸表】

日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

第 1 期 (平成22年 4 月26日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,567,345
親投資信託受益証券	846,040,933
未収利息	16
流動資産合計	852,608,294
資産合計	852,608,294
負債の部	
流動負債	
未払収益分配金	18,795,195
未払解約金	14,813,623
未払受託者報酬	114,319
未払委託者報酬	1,600,349
その他未払費用	11,374
流動負債合計	35,334,860
負債合計	35,334,860
純資産の部	
元本等	
元本	817,182,420
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	91,014
純資産合計	817,273,434
負債純資産合計	852,608,294

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

第 1 期	
自 平成21年10月30日	
至 平成22年 4 月26日	
営業収益	
受取利息	13,797
有価証券売買等損益	12,975,268
営業収益合計	12,989,065
営業費用	
受託者報酬	114,319
委託者報酬	1,600,349
その他費用	11,374
営業費用合計	1,726,042
営業利益	11,263,023
経常利益	11,263,023
当期純利益	11,263,023
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	431,828
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,608,280
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,608,280
剰余金減少額又は欠損金増加額	553,266
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	553,266
分配金	18,795,195
期末剰余金又は期末欠損金（△）	91,014

(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21年10月30日 至 平成22年 4 月26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、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年4月25日から10月24日まで、及び10月25日から翌年4月24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21年10月30日から平成22年4月26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22年 4 月26日現在)
1. 当該計算期間の末日における受益権 総数	817,182,420 口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0001 円 (10,001 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

1. 分配金の計算過程

		第 1 期 自 平成21年10月30日 至 平成22年 4 月26日
費用控除後の配当等収益額	A	2,761,358 円 (3,187,702 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	8,069,837 円
収益調整金額	C	8,055,014 円
分配準備積立金額	D	— 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	18,886,209 円
当ファンドの期末残存口数	F	817,182,420 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	231.11 円
10,000口当たり分配金額	H	230 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	18,795,195 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21年10月30日 至 平成22年 4 月26日
2. 剰余金増加額・減少額	「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ剰余金減少額と増加額との純額を表示しております。

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

第 1 期 自 平成21年10月30日 至 平成22年 4 月26日
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは価格変動リスク等に晒されております。 3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、運用セクションから組織的に独立した業務管理室が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。 また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

第 1 期 (平成22年 4 月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 (1) 親投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額

金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

第 1 期 自 平成21年10月30日 至 平成22年 4月26日
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

第 1 期 自 平成21年10月30日 至 平成22年 4月26日
該当事項はありません。

（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21年10月30日 至 平成22年 4月26日
期首元本額	103,550,832 円
期中追加設定元本額	834,540,815 円
期中一部解約元本額	120,909,227 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 1 期 (平成22年 4月26日現在)
	最終の計算期間（自 平成21年10月30日 至 平成22年 4月26日）の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	13,815,934
合計	13,815,934

3. デリバティブ取引関係

第 1 期 自 平成21年10月30日 至 平成22年 4月26日
当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

① 有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
親投資信託 受益証券	中央三井日本債券マザーファンド	583,416,452	673,262,585	
	中央三井日本株式マザーファンド	197,958,695	172,778,348	
合計		781,375,147	846,040,933	

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 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。

⑦ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

<参考>

「日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）」は、「中央三井日本債券マザーファンド」及び「中央三井日本株式マザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、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22年4月26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。

「中央三井日本債券マザーファンド」の状況

（１）貸借対照表

項目	平成22年4月26日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	13,274,987,285
国債証券	227,761,380,400
地方債証券	19,115,510,842
特殊債券	33,411,416,812
社債券	25,423,116,100
派生商品評価勘定	6,946,770
未収入金	608,294,000
未収利息	883,342,621
前払費用	38,503,247
流動資産合計	320,523,498,077
資産合計	320,523,498,077
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,271,760
前受金	8,580,000
未払金	8,467,755,431
未払解約金	157,073,590
流動負債合計	8,634,680,781
負債合計	8,634,680,781
純資産の部	
元本等	
元本	270,269,862,471
剰余金	
剰余金	41,618,954,825
純資産合計	311,888,817,296
負債・純資産合計	320,523,498,077

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成22年4月26日現在
--	--------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日まで個別法）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、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等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	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、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段によっております。 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	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22年4月26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。 国債証券 52,339,500 円 なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおります。
2. 計算日における受益権総数	270,269,862,471 口
3. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1540 円 （ 11,540 円）

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

平成22年4月26日現在
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年4月26日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

(1) 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

(2) デリバティブ取引

デリバティブ取引については、「（その他の注記）」の「3. デリバティブ取引関係」に記載しております。

(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

4. 金銭債権の計算日後の償還予定額

金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

平成22年4月26日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

平成22年4月26日現在	
該当事項はありません。	

（その他の注記）

1. 元本の変動

平成22年4月26日現在	
計算期間の期首元本額	250,295,498,501 円
計算期間中の追加設定元本額	35,420,263,977 円
計算期間中の一部解約元本額	15,445,900,007 円
計算日の元本額	270,269,862,471 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	5,678,584,616 円
中央三井DC日本債券インデックスファンド	1,836,999,730 円
中央三井DC日本債券インデックスファンドL	12,586,863,782 円
中央三井DCバランスファンド30	425,118,072 円
中央三井DCバランスファンド50	484,640,063 円
中央三井DCバランスファンド70	145,483,073 円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	270,393,978 円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	166,308,778 円
中央三井日本債券インデックスファンド（SMA専用）	3,758,969,821 円
新生・4分散ファンド	189,313,565 円
4資産インデックスバランスオープン（分配型）	99,081,414 円
4資産インデックスバランスオープン（成長型）	223,373,052 円
日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）	583,416,452 円
CMAM日本債券インデックスe	1,049,228 円
中央三井バランスVA30（適格機関投資家専用）	12,147,800,481 円
中央三井バランスVA50（適格機関投資家専用）	39,694,880,624 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）	36,386,527,417 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）	1,887,317,260 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）	8,747,157,705 円
中央三井バランスVA25（適格機関投資家専用）	12,457,146,809 円
中央三井バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	3,000,586,770 円
中央三井バランスVA50L（適格機関投資家専用）	30,595,252,563 円
中央三井バランスVA75（適格機関投資家専用）	263,888,825 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）	35,706,516,363 円
中央三井VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	8,391,170,524 円
中央三井VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	744,584,992 円
中央三井バランスVA40（適格機関投資家専用）	3,921,392,606 円
中央三井VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	1,975,643,903 円
CMAM・バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	5,299,888,030 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）	1,226,727,893 円
CMAM・VAバランス50－50（適格機関投資家専用）	2,167,019,960 円
中央三井バランスVA20（適格機関投資家専用）	5,481,549,350 円
中央三井VAファンド25（適格機関投資家専用）	4,879,852,600 円
CMAM・バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	6,709,584,001 円
中央三井バランスVA20L（適格機関投資家専用）	683,035,763 円
中央三井バランスVA25L（適格機関投資家専用）	4,904,216,254 円
CMAM・バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	6,390,023,028 円
中央三井世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,061,930,500 円
中央三井国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	252,703,869 円
中央三井国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	112,368,921 円
CMAM・VAバランス20－80（適格機関投資家専用）	68,748,891 円

私募日本債券インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）
CMAM私募日本債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）

174,004 円
8,662,576,941 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

平成22年4月26日現在	
種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	556,293,100
地方債証券	47,895,585
特殊債券	95,037,271
社債券	93,909,600
合計	793,135,556

（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22年1月23日から平成22年4月26日まで）に対応するものです。

3. デリバティブ取引関係

I. ヘッジ会計が適用されていないもの 債券関連

区分	種類	平成22年4月26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	2,360,384,990	—	2,366,060,000	5,675,010
	合計	2,360,384,990	—	2,366,060,000	5,675,010

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 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。

II. ヘッジ会計が適用されているもの

平成22年4月26日現在	
該当事項はありません。	

[次へ](#)

(3) 附属明細表（平成22年4月26日現在）

① 有価証券明細表

A. 株式

該当事項はありません。

B. 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債 証券	利付国庫債券（2年）第280回	1,700,000,000	1,704,760,000	
	利付国庫債券（2年）第281回	800,000,000	802,424,000	
	利付国庫債券（2年）第282回	1,600,000,000	1,603,280,000	
	利付国庫債券（2年）第283回	1,700,000,000	1,703,604,000	
	利付国庫債券（2年）第284回	900,000,000	901,980,000	
	利付国庫債券（2年）第285回	1,300,000,000	1,301,131,000	
	利付国庫債券（2年）第286回	1,500,000,000	1,503,690,000	
	利付国庫債券（2年）第287回	1,900,000,000	1,904,921,000	
	利付国庫債券（2年）第288回	400,000,000	400,340,000	
	利付国庫債券（2年）第289回	1,800,000,000	1,801,602,000	
	利付国庫債券（2年）第290回	2,400,000,000	2,402,016,000	
	利付国庫債券（2年）第291回	1,500,000,000	1,501,170,000	
	利付国庫債券（5年）第57回	400,000,000	405,780,000	
	利付国庫債券（5年）第58回	700,000,000	710,913,000	
	利付国庫債券（5年）第59回	1,500,000,000	1,519,965,000	
	利付国庫債券（5年）第60回	2,900,000,000	2,942,688,000	
	利付国庫債券（5年）第61回	2,100,000,000	2,136,435,000	
	利付国庫債券（5年）第62回	1,600,000,000	1,630,384,000	
	利付国庫債券（5年）第63回	2,800,000,000	2,855,048,000	
	利付国庫債券（5年）第64回	2,200,000,000	2,262,612,000	
	利付国庫債券（5年）第65回	1,400,000,000	1,436,862,000	
	利付国庫債券（5年）第66回	1,500,000,000	1,532,865,000	
	利付国庫債券（5年）第67回	1,800,000,000	1,848,006,000	
	利付国庫債券（5年）第68回	1,100,000,000	1,126,301,000	
	利付国庫債券（5年）第69回	1,500,000,000	1,527,975,000	
	利付国庫債券（5年）第70回	2,500,000,000	2,542,325,000	
	利付国庫債券（5年）第71回	2,100,000,000	2,165,688,000	
	利付国庫債券（5年）第72回	1,200,000,000	1,247,496,000	
	利付国庫債券（5年）第73回	1,200,000,000	1,240,020,000	
	利付国庫債券（5年）第74回	1,200,000,000	1,228,800,000	
	利付国庫債券（5年）第75回	300,000,000	308,367,000	
	利付国庫債券（5年）第76回	800,000,000	825,000,000	
	利付国庫債券（5年）第77回	1,500,000,000	1,536,795,000	
	利付国庫債券（5年）第78回	700,000,000	715,127,000	
	利付国庫債券（5年）第79回	1,700,000,000	1,724,480,000	
	利付国庫債券（5年）第80回	1,300,000,000	1,323,400,000	
	利付国庫債券（5年）第81回	2,200,000,000	2,238,390,000	
	利付国庫債券（5年）第82回	2,100,000,000	2,144,709,000	
	利付国庫債券（5年）第83回	2,000,000,000	2,042,380,000	
	利付国庫債券（5年）第84回	1,400,000,000	1,418,256,000	
	利付国庫債券（5年）第85回	3,400,000,000	3,441,038,000	
	利付国庫債券（5年）第86回	2,600,000,000	2,620,176,000	
	利付国庫債券（5年）第87回	3,800,000,000	3,806,878,000	
	利付国庫債券（5年）第88回	1,700,000,000	1,700,799,000	
	利付国庫債券（40年）第1回	500,000,000	525,000,000	
	利付国庫債券（40年）第2回	700,000,000	697,802,000	

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231回	610,000,000	618,119,100	
	利付国庫債券（10年）第232回	1,420,000,000	1,437,281,400	

利付国庫債券（１０年）第２３３回	410,000,000	415,924,500	
利付国庫債券（１０年）第２３４回	1,840,000,000	1,872,200,000	
利付国庫債券（１０年）第２３５回	1,290,000,000	1,316,496,600	
利付国庫債券（１０年）第２３６回	690,000,000	705,304,200	
利付国庫債券（１０年）第２３７回	1,120,000,000	1,148,347,200	
利付国庫債券（１０年）第２３８回	1,190,000,000	1,217,881,700	
利付国庫債券（１０年）第２３９回	910,000,000	933,860,200	
利付国庫債券（１０年）第２４０回	1,570,000,000	1,607,821,300	
利付国庫債券（１０年）第２４１回	750,000,000	769,912,500	
利付国庫債券（１０年）第２４２回	730,000,000	747,636,800	
利付国庫債券（１０年）第２４３回	1,020,000,000	1,042,215,600	
利付国庫債券（１０年）第２４４回	930,000,000	949,790,400	
利付国庫債券（１０年）第２４５回	1,030,000,000	1,049,209,500	
利付国庫債券（１０年）第２４６回	680,000,000	690,900,400	
利付国庫債券（１０年）第２４７回	910,000,000	925,406,300	
利付国庫債券（１０年）第２４８回	170,000,000	172,390,200	
利付国庫債券（１０年）第２４９回	760,000,000	768,504,400	
利付国庫債券（１０年）第２５０回	600,000,000	605,046,000	
利付国庫債券（１０年）第２５１回	770,000,000	786,077,600	
利付国庫債券（１０年）第２５２回	730,000,000	747,520,000	
利付国庫債券（１０年）第２５３回	1,350,000,000	1,410,574,500	
利付国庫債券（１０年）第２５４回	520,000,000	539,838,000	
利付国庫債券（１０年）第２５５回	710,000,000	739,472,100	
利付国庫債券（１０年）第２５６回	1,040,000,000	1,081,194,400	
利付国庫債券（１０年）第２５７回	1,100,000,000	1,139,611,000	
利付国庫債券（１０年）第２５８回	480,000,000	497,678,400	
利付国庫債券（１０年）第２５９回	1,180,000,000	1,232,746,000	
利付国庫債券（１０年）第２６０回	860,000,000	902,939,800	
利付国庫債券（１０年）第２６１回	790,000,000	835,883,200	
利付国庫債券（１０年）第２６２回	730,000,000	775,376,800	
利付国庫債券（１０年）第２６３回	750,000,000	788,332,500	
利付国庫債券（１０年）第２６４回	730,000,000	764,156,700	（注）
利付国庫債券（１０年）第２６５回	730,000,000	764,842,900	
利付国庫債券（１０年）第２６６回	560,000,000	584,180,800	
利付国庫債券（１０年）第２６７回	410,000,000	425,842,400	
利付国庫債券（１０年）第２６８回	900,000,000	943,839,000	
利付国庫債券（１０年）第２６９回	1,840,000,000	1,911,594,400	
利付国庫債券（１０年）第２７０回	700,000,000	727,328,000	
利付国庫債券（１０年）第２７１回	1,400,000,000	1,447,656,000	
利付国庫債券（１０年）第２７２回	1,500,000,000	1,566,765,000	
利付国庫債券（１０年）第２７３回	1,000,000,000	1,049,740,000	
利付国庫債券（１０年）第２７４回	900,000,000	944,964,000	
利付国庫債券（１０年）第２７５回	2,000,000,000	2,089,000,000	
利付国庫債券（１０年）第２７６回	800,000,000	844,568,000	
利付国庫債券（１０年）第２７７回	1,400,000,000	1,477,924,000	
利付国庫債券（１０年）第２７８回	300,000,000	320,199,000	
利付国庫債券（１０年）第２７９回	1,200,000,000	1,294,428,000	
利付国庫債券（１０年）第２８０回	1,100,000,000	1,181,180,000	
利付国庫債券（１０年）第２８１回	1,000,000,000	1,079,700,000	

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２８２回	1,500,000,000	1,592,250,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８３回	1,400,000,000	1,494,668,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８４回	2,150,000,000	2,281,365,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８５回	2,900,000,000	3,074,377,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８６回	2,200,000,000	2,343,836,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８７回	1,000,000,000	1,072,480,000	

利付国庫債券（１０年）第２８８回	2,500,000,000	2,642,275,000	
利付国庫債券（１０年）第２８９回	2,200,000,000	2,289,452,000	
利付国庫債券（１０年）第２９０回	400,000,000	412,448,000	
利付国庫債券（１０年）第２９１回	900,000,000	921,078,000	
利付国庫債券（１０年）第２９２回	1,300,000,000	1,370,031,000	
利付国庫債券（１０年）第２９３回	600,000,000	635,886,000	
利付国庫債券（１０年）第２９４回	1,300,000,000	1,367,457,000	
利付国庫債券（１０年）第２９５回	1,900,000,000	1,969,274,000	
利付国庫債券（１０年）第２９６回	1,600,000,000	1,654,240,000	
利付国庫債券（１０年）第２９７回	1,000,000,000	1,023,260,000	
利付国庫債券（１０年）第２９８回	1,800,000,000	1,826,964,000	
利付国庫債券（１０年）第２９９回	1,200,000,000	1,214,016,000	
利付国庫債券（１０年）第３００回	1,500,000,000	1,542,945,000	
利付国庫債券（１０年）第３０１回	1,400,000,000	1,436,358,000	
利付国庫債券（１０年）第３０２回	2,000,000,000	2,034,620,000	
利付国庫債券（１０年）第３０３回	2,500,000,000	2,534,700,000	
利付国庫債券（１０年）第３０４回	1,600,000,000	1,608,064,000	
利付国庫債券（１０年）第３０５回	3,500,000,000	3,504,480,000	
利付国庫債券（１０年）第３０６回	1,000,000,000	1,006,990,000	
利付国庫債券（３０年）第１回	50,000,000	55,940,500	
利付国庫債券（３０年）第２回	100,000,000	105,227,000	
利付国庫債券（３０年）第３回	230,000,000	238,001,700	
利付国庫債券（３０年）第４回	190,000,000	215,697,500	
利付国庫債券（３０年）第５回	180,000,000	182,894,400	
利付国庫債券（３０年）第６回	70,000,000	73,443,300	
利付国庫債券（３０年）第７回	190,000,000	195,726,600	
利付国庫債券（３０年）第８回	270,000,000	253,905,300	
利付国庫債券（３０年）第９回	80,000,000	69,280,000	
利付国庫債券（３０年）第１０回	170,000,000	137,451,800	
利付国庫債券（３０年）第１１回	110,000,000	100,716,000	
利付国庫債券（３０年）第１２回	270,000,000	267,065,100	
利付国庫債券（３０年）第１３回	250,000,000	242,035,000	
利付国庫債券（３０年）第１４回	350,000,000	364,959,000	
利付国庫債券（３０年）第１５回	140,000,000	148,612,800	
利付国庫債券（３０年）第１６回	150,000,000	159,291,000	
利付国庫債券（３０年）第１７回	230,000,000	239,839,400	
利付国庫債券（３０年）第１８回	460,000,000	470,423,600	
利付国庫債券（３０年）第１９回	370,000,000	378,128,900	
利付国庫債券（３０年）第２０回	140,000,000	148,657,600	
利付国庫債券（３０年）第２１回	320,000,000	327,120,000	
利付国庫債券（３０年）第２２回	400,000,000	424,696,000	
利付国庫債券（３０年）第２３回	100,000,000	106,212,000	
利付国庫債券（３０年）第２４回	300,000,000	318,750,000	
利付国庫債券（３０年）第２５回	700,000,000	715,358,000	
利付国庫債券（３０年）第２６回	700,000,000	729,190,000	

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（３０年）第２７回	800,000,000	850,464,000	
	利付国庫債券（３０年）第２８回	800,000,000	851,040,000	
	利付国庫債券（３０年）第２９回	900,000,000	939,663,000	
	利付国庫債券（３０年）第３０回	1,100,000,000	1,124,387,000	
	利付国庫債券（３０年）第３１回	1,000,000,000	1,000,890,000	
	利付国庫債券（３０年）第３２回	300,000,000	307,068,000	
	利付国庫債券（２０年）第１６回	80,000,000	87,406,400	
	利付国庫債券（２０年）第１７回	140,000,000	152,572,000	
	利付国庫債券（２０年）第１８回	100,000,000	111,555,000	
	利付国庫債券（２０年）第１９回	150,000,000	170,271,000	

利付国庫債券（２０年）第２０回	70,000,000	78,941,100	
利付国庫債券（２０年）第２１回	40,000,000	46,276,400	
利付国庫債券（２０年）第２２回	170,000,000	194,695,900	
利付国庫債券（２０年）第２３回	130,000,000	152,696,700	
利付国庫債券（２０年）第２４回	160,000,000	186,873,600	
利付国庫債券（２０年）第２５回	80,000,000	91,593,600	
利付国庫債券（２０年）第２６回	50,000,000	58,820,000	
利付国庫債券（２０年）第２７回	410,000,000	491,389,100	
利付国庫債券（２０年）第２８回	110,000,000	133,807,300	
利付国庫債券（２０年）第２９回	100,000,000	119,247,000	
利付国庫債券（２０年）第３０回	200,000,000	233,128,000	
利付国庫債券（２０年）第３１回	280,000,000	326,102,000	
利付国庫債券（２０年）第３２回	80,000,000	94,082,400	
利付国庫債券（２０年）第３３回	430,000,000	512,022,500	
利付国庫債券（２０年）第３４回	70,000,000	82,661,600	
利付国庫債券（２０年）第３５回	270,000,000	315,090,000	
利付国庫債券（２０年）第３７回	410,000,000	474,320,800	
利付国庫債券（２０年）第３９回	640,000,000	717,222,400	
利付国庫債券（２０年）第４０回	450,000,000	493,569,000	
利付国庫債券（２０年）第４１回	620,000,000	638,011,000	
利付国庫債券（２０年）第４２回	380,000,000	425,972,400	
利付国庫債券（２０年）第４３回	340,000,000	389,935,800	
利付国庫債券（２０年）第４４回	370,000,000	410,877,600	
利付国庫債券（２０年）第４５回	470,000,000	517,564,000	
利付国庫債券（２０年）第４６回	290,000,000	313,814,800	
利付国庫債券（２０年）第４７回	670,000,000	724,216,400	
利付国庫債券（２０年）第４８回	230,000,000	255,327,600	
利付国庫債券（２０年）第４９回	280,000,000	298,947,600	
利付国庫債券（２０年）第５０回	490,000,000	513,152,500	
利付国庫債券（２０年）第５１回	240,000,000	253,512,000	
利付国庫債券（２０年）第５２回	330,000,000	351,489,600	
利付国庫債券（２０年）第５３回	250,000,000	265,917,500	
利付国庫債券（２０年）第５４回	280,000,000	300,764,800	
利付国庫債券（２０年）第５５回	590,000,000	620,078,200	
利付国庫債券（２０年）第５６回	410,000,000	430,167,900	
利付国庫債券（２０年）第５７回	260,000,000	269,986,600	
利付国庫債券（２０年）第５８回	450,000,000	466,371,000	
利付国庫債券（２０年）第５９回	540,000,000	546,539,400	
利付国庫債券（２０年）第６０回	270,000,000	263,765,700	
利付国庫債券（２０年）第６１回	490,000,000	453,735,100	
利付国庫債券（２０年）第６２回	250,000,000	224,507,500	

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６３回	570,000,000	580,795,800	
	利付国庫債券（２０年）第６４回	410,000,000	421,701,400	
	利付国庫債券（２０年）第６５回	470,000,000	482,276,400	
	利付国庫債券（２０年）第６６回	340,000,000	344,715,800	
	利付国庫債券（２０年）第６７回	360,000,000	368,503,200	
	利付国庫債券（２０年）第６８回	230,000,000	244,016,200	
	利付国庫債券（２０年）第６９回	460,000,000	482,296,200	
	利付国庫債券（２０年）第７０回	400,000,000	433,648,000	
	利付国庫債券（２０年）第７１回	500,000,000	529,705,000	
	利付国庫債券（２０年）第７２回	920,000,000	960,875,600	
	利付国庫債券（２０年）第７３回	440,000,000	452,817,200	
	利付国庫債券（２０年）第７４回	310,000,000	323,209,100	
	利付国庫債券（２０年）第７５回	360,000,000	374,436,000	
	利付国庫債券（２０年）第７６回	630,000,000	638,895,600	

利付国庫債券（２０年）第７７回	210,000,000	215,691,000	
利付国庫債券（２０年）第７８回	200,000,000	202,258,000	
利付国庫債券（２０年）第７９回	300,000,000	307,320,000	
利付国庫債券（２０年）第８０回	550,000,000	570,647,000	
利付国庫債券（２０年）第８１回	620,000,000	633,416,800	
利付国庫債券（２０年）第８２回	510,000,000	527,804,100	
利付国庫債券（２０年）第８３回	530,000,000	547,399,900	
利付国庫債券（２０年）第８４回	500,000,000	509,405,000	
利付国庫債券（２０年）第８５回	250,000,000	257,515,000	
利付国庫債券（２０年）第８６回	270,000,000	285,444,000	
利付国庫債券（２０年）第８７回	600,000,000	626,166,000	
利付国庫債券（２０年）第８８回	400,000,000	422,368,000	
利付国庫債券（２０年）第８９回	800,000,000	833,760,000	
利付国庫債券（２０年）第９０回	700,000,000	728,518,000	
利付国庫債券（２０年）第９１回	600,000,000	632,760,000	
利付国庫債券（２０年）第９２回	1,200,000,000	1,229,556,000	
利付国庫債券（２０年）第９３回	700,000,000	706,237,000	
利付国庫債券（２０年）第９４回	800,000,000	818,360,000	
利付国庫債券（２０年）第９５回	600,000,000	630,210,000	
利付国庫債券（２０年）第９６回	200,000,000	204,246,000	
利付国庫債券（２０年）第９７回	800,000,000	827,048,000	
利付国庫債券（２０年）第９８回	900,000,000	916,929,000	
利付国庫債券（２０年）第９９回	900,000,000	915,309,000	
利付国庫債券（２０年）第１００回	1,400,000,000	1,442,588,000	
利付国庫債券（２０年）第１０１回	300,000,000	318,114,000	
利付国庫債券（２０年）第１０２回	500,000,000	529,440,000	
利付国庫債券（２０年）第１０３回	400,000,000	417,360,000	
利付国庫債券（２０年）第１０４回	500,000,000	506,655,000	
利付国庫債券（２０年）第１０５回	1,200,000,000	1,213,680,000	
利付国庫債券（２０年）第１０６回	300,000,000	308,067,000	
利付国庫債券（２０年）第１０７回	500,000,000	504,730,000	
利付国庫債券（２０年）第１０８回	1,000,000,000	978,440,000	
利付国庫債券（２０年）第１０９回	600,000,000	585,750,000	
利付国庫債券（２０年）第１１０回	1,000,000,000	1,007,490,000	
利付国庫債券（２０年）第１１１回	500,000,000	511,010,000	
利付国庫債券（２０年）第１１２回	1,200,000,000	1,207,416,000	
利付国庫債券（２０年）第１１３回	1,700,000,000	1,708,228,000	

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１１４回	1,100,000,000	1,103,828,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１５回	900,000,000	917,613,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１６回	600,000,000	610,986,000	
国債証券 小計		221,140,000,000	227,761,380,400	
地方債証券	東京都公募公債第５７９回	100,000,000	101,712,000	
	東京都公募公債第５８２回	100,000,000	102,317,000	
	東京都公募公債第５８６回	100,000,000	102,498,000	
	東京都公募公債第５９０回	100,000,000	102,581,000	
	東京都公募公債第５９８回	103,000,000	103,627,270	
	東京都公募公債第６０２回	200,000,000	207,256,000	
	東京都公募公債第６０５回	100,000,000	103,745,000	
	東京都公募公債第６０８回	100,000,000	104,500,000	
	東京都公募公債第６０９回	200,000,000	208,538,000	
	東京都公募公債第６１３回	100,000,000	104,631,000	
	東京都公募公債第６１６回	100,000,000	104,017,000	
	東京都公募公債第６１７回	100,000,000	103,971,000	
	東京都公募公債第６１９回	100,000,000	104,650,000	
	東京都公募公債第６２４回	100,000,000	104,547,000	

東京都公募公債第6 2 6回	100,000,000	105,145,000	
東京都公募公債第6 2 7回	100,000,000	104,727,000	
東京都公募公債第6 2 8回	100,000,000	105,118,000	
東京都公募公債第6 3 7回	180,000,000	191,482,200	
東京都公募公債第6 4 2回	100,000,000	106,501,000	
東京都公募公債第6 4 6回	100,000,000	107,359,000	
東京都公募公債第6 4 7回	100,000,000	107,225,000	
東京都公募公債第6 5 6回	100,000,000	103,393,000	
東京都公募公債第6 5 7回	100,000,000	105,660,000	
東京都公募公債第6 5 9回	100,000,000	104,045,000	
東京都公募公債第6 6 8回	100,000,000	102,565,000	
東京都公募公債（20年）第3回	100,000,000	105,759,000	
東京都公募公債（20年）第11回	200,000,000	205,686,000	
東京都公募公債（20年）第18回	200,000,000	202,834,000	
東京都公募公債（20年）第21回	100,000,000	100,483,000	
北海道平成13年度第1回公募公債	100,000,000	101,407,000	
北海道平成13年度第4回公募公債	100,000,000	102,103,000	
北海道平成17年度第1回公募公債	100,000,000	103,385,000	
北海道平成19年度第14回公募公債（10年）	100,000,000	103,738,000	
北海道平成20年度第14回公募公債	100,000,000	103,200,000	
北海道平成20年度第15回公募公債（5年）	100,000,000	102,589,000	
北海道平成21年度第6回公募公債	100,000,000	101,444,000	
北海道平成14年度第1回公募公債	100,000,000	102,082,000	
宮城県公募公債第28回1号	100,000,000	101,370,000	
神奈川県第126回公募公債	100,000,000	104,162,000	
神奈川県第127回公募公債	100,000,000	105,510,000	
神奈川県第130回公募公債	100,000,000	103,894,000	
神奈川県第134回公募公債	100,000,000	103,966,000	
神奈川県第135回公募公債	100,000,000	105,050,000	
神奈川県第143回公募公債	150,000,000	158,889,000	
神奈川県第144回公募公債	100,000,000	106,304,000	
神奈川県第162回公募公債	100,000,000	102,781,000	
神奈川県第168回公募公債	100,000,000	99,833,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
地方債 証券	第250回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,251,000	
	第254回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,578,000	
	第267回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,235,000	
	第285回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,017,000	
	第286回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,992,000	
	第293回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	107,461,000	
	第298回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,139,000	
	第305回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,028,000	
	第309回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,778,000	
	第324回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,469,000	
	第331回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	99,711,000	
	第334回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	99,957,000	
	第50回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	101,443,000	
	京都府平成17年度第3回公募公債	100,000,000	104,522,000	
	京都府平成20年度第6回公募公債	100,000,000	101,882,000	
	兵庫県平成14年度第4回公募公債	100,000,000	101,729,000	
	兵庫県平成16年度第10回公募公債	100,000,000	104,038,000	
	兵庫県平成17年度第3回公募公債	100,000,000	103,096,000	
	兵庫県平成18年度第3回公募公債	110,000,000	117,691,200	
	兵庫県平成18年度第8回公募公債	100,000,000	107,604,000	
	兵庫県平成18年度第10回公募公債	100,000,000	107,007,000	
	兵庫県平成21年度第1回公募公債	100,000,000	102,366,000	

兵庫県平成21年度第35回公募公債	100,000,000	100,085,000	
静岡県平成15年度第3回公募公債	100,000,000	103,564,000	
静岡県平成17年度第7回公募公債	100,000,000	105,641,000	
静岡県平成19年度第4回公募公債	100,000,000	106,747,000	
静岡県平成19年度第7回公募公債	100,000,000	105,677,000	
静岡県平成21年度第5回公募公債	100,000,000	100,004,000	
愛知県平成13年度第2回公募公債	100,000,000	101,720,000	
愛知県平成18年度第4回公募公債（10年）	129,000,000	136,943,820	
愛知県平成20年度第6回公募公債（10年）	100,000,000	104,166,000	
愛知県平成20年度第10回公募公債（10年）	100,000,000	101,883,000	
愛知県平成21年度第1回公募公債（10年）	100,000,000	102,871,000	
広島県平成14年度第1回公募公債	100,000,000	102,446,000	
広島県平成16年度第1回公募公債	100,000,000	103,435,000	
広島県平成20年度第6回公募公債	100,000,000	101,882,000	
埼玉県平成13年度第3回公募公債	100,000,000	101,671,000	
埼玉県平成14年度第1回公募公債	100,000,000	102,275,000	
埼玉県平成15年度第5回公募公債	100,000,000	103,681,000	
埼玉県平成19年度第2回公募公債	100,000,000	106,799,000	
埼玉県平成19年度第5回公募公債	100,000,000	105,679,000	
埼玉県平成19年度第7回公募公債	100,000,000	104,347,000	
埼玉県平成21年度第1回公募公債	200,000,000	204,436,000	
埼玉県平成21年度第2回公募公債	100,000,000	102,440,000	
福岡県平成14年度第3回公募公債	100,000,000	101,409,000	
福岡県平成20年度第5回公募公債	100,000,000	103,887,000	
千葉県平成15年度第1回公募公債	100,000,000	100,546,000	
千葉県平成17年度第7回公募公債	100,000,000	104,528,000	
千葉県平成18年度第6回公募公債	175,000,000	184,546,250	
千葉県平成18年度第7回公募公債	100,000,000	106,066,000	
千葉県平成21年度第1回公募公債	100,000,000	102,220,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
地方債 証券	千葉県平成21年度第3回公募公債	100,000,000	102,950,000	
	新潟県平成17年度第1回公募公債	100,000,000	103,394,000	
	新潟県平成20年度第2回公募公債	100,000,000	102,228,000	
	岐阜県平成18年度第1回公募公債	100,000,000	106,094,000	
	第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,157,000	
	第5回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,812,000	
	第6回共同発行市場公募地方債	155,700,000	162,214,488	
	第9回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,980,000	
	第11回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,314,000	
	第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,613,000	
	第16回共同発行市場公募地方債	127,000,000	133,974,840	
	第17回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,534,000	
	第18回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,708,000	
	第19回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,745,000	
	第20回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,317,000	
	第22回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,883,000	
	第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,435,000	
	第29回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,964,000	
	第30回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,455,000	
	第31回共同発行市場公募地方債	150,000,000	156,760,500	
	第34回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,950,000	
	第35回共同発行市場公募地方債	160,000,000	168,105,600	
	第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,397,000	
	第41回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,426,000	
	第43回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,145,000	
	第48回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,373,000	

第53回共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,558,000	
第54回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,013,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,035,000	
第57回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,477,000	
第63回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,884,000	
第67回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,524,000	
第74回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,438,000	
第75回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,950,000	
第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,826,000	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,464,000	
第79回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,920,000	
第80回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,574,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,344,000	
静岡市平成18年度第1回公募公債	100,000,000	106,783,000	
大阪市平成14年度第11回公募公債	100,000,000	101,144,000	
大阪市平成16年度第5回公募公債	100,000,000	104,251,000	
大阪市平成17年度第1回公募公債	100,000,000	102,859,000	
大阪市平成18年度第3回公募公債	200,000,000	214,712,000	
大阪市平成19年度第1回公募公債（5年）	100,000,000	102,135,000	
大阪市平成21年度第7回公募公債	100,000,000	99,786,000	
名古屋市第12回㊦号公募公債	100,000,000	102,522,000	
名古屋市第12回㊨号公募公債	100,000,000	104,414,000	
名古屋市第12回㊩号公募公債	100,000,000	102,356,000	
名古屋市第12回㊪号公募公債	100,000,000	103,719,000	
名古屋市第12回㊫号公募公債	100,000,000	105,643,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
地方債証券	名古屋市第455回10年公募公債	186,700,000	199,436,674	
	名古屋市第463回10年公募公債	100,000,000	106,664,000	
	京都市平成19年度第2回公募公債	100,000,000	104,972,000	
	京都市第2回20年公募公債	100,000,000	102,255,000	
	横浜市平成13年度第3回公募公債	100,000,000	101,545,000	
	横浜市平成20年度第1回公募公債	100,000,000	105,797,000	
	横浜市平成20年度第6回公募公債	100,000,000	102,264,000	
	横浜市平成21年度第6回公募公債	100,000,000	99,833,000	
	横浜市平成15年度第2回公募公債	100,000,000	100,856,000	
	横浜市平成17年度第3回公募公債	100,000,000	105,046,000	
	横浜市第24回5年公募公債	100,000,000	102,650,000	
	札幌市平成14年度第3回公募公債	100,000,000	102,094,000	
	札幌市平成18年度第4回公募公債	100,000,000	106,188,000	
	第79回川崎市公募公債	100,000,000	106,146,000	
	北九州市平成14年度第2回公募公債	100,000,000	101,841,000	
	福岡市平成18年度第2回公募公債（5年）	100,000,000	101,681,000	
	福岡市平成19年度第2回公募公債（5年）	100,000,000	102,869,000	
	福岡市平成19年度第3回公募公債	100,000,000	106,029,000	
	福岡市平成19年度第5回公募公債	100,000,000	102,916,000	
	広島市平成17年度第1回公募公債	100,000,000	104,408,000	
	第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,891,000	
地方債証券 小計		18,426,400,000	19,115,510,842	
特殊債券	政府保証第6回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,574,000	
	政府保証第7回日本政策投資銀行債券	102,000,000	105,584,280	
	政府保証第8回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,765,000	
	政府保証第10回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,235,000	
	政府保証第15回日本政策投資銀行債券	210,000,000	219,865,800	
	政府保証第16回日本政策投資銀行債券	200,000,000	212,840,000	
	政府保証第21回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,351,000	
	第7回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,260,000	

第13回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,298,000	
第16回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,190,000	
第19回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,733,000	
第24回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,967,000	
第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,092,000	
第41回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,813,000	
第43回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,178,000	
第47回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,221,000	
第16回道路債券	200,000,000	203,612,000	
政府保証第313回道路債券	100,000,000	102,581,000	
政府保証第314回道路債券	100,000,000	102,029,000	
政府保証第319回道路債券	100,000,000	101,995,000	
政府保証第323回道路債券	100,000,000	104,201,000	
政府保証第325回道路債券	101,000,000	104,562,270	
政府保証第327回道路債券	100,000,000	104,374,000	
政府保証第328回道路債券	100,000,000	104,404,000	
政府保証第329回道路債券	150,000,000	157,282,500	
政府保証第330回道路債券	100,000,000	105,727,000	
政府保証第334回道路債券	100,000,000	104,559,000	
政府保証第335回道路債券	100,000,000	104,125,000	
政府保証第336回道路債券	131,000,000	136,448,290	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊 債券	政府保証第338回道路債券	100,000,000	104,674,000	
	政府保証第343回道路債券	100,000,000	103,726,000	
	政府保証第346回道路債券	115,000,000	119,901,300	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,891,000	
	第3回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,990,000	
	第6回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,044,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	158,523,000	
	第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,505,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,069,000	
	第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,427,000	
	第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,593,000	
	第35回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,921,000	
	第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,900,000	
	第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,930,000	
	第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,071,000	
	第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,391,000	
	第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,827,000	
	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	104,814,000	
	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	103,635,000	
	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	168,264,750	
	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	108,866,890	
	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	106,500,000	
	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	133,067,500	
	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	105,704,000	
	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	105,652,000	
	政府保証第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,768,000	
	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	104,025,000	
	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	210,552,000	
	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	103,677,000	
	政府保証第54回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,818,000	
	政府保証第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,767,000	
	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	209,934,000	
	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	104,822,000	
	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	103,045,000	

政府保証第67回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,578,000	
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	103,712,000	
政府保証第71回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,022,000	
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	100,958,000	
政府保証第77回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,881,000	
政府保証第78回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,080,000	
政府保証第80回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,289,000	
政府保証第86回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,291,000	
政府保証第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,130,000	
政府保証第91回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,115,000	
政府保証第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,846,000	
政府保証第98回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,611,000	
政府保証第100回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,431,000	
第2回道路債券	200,000,000	205,014,000	
第6回道路債券	100,000,000	102,949,000	
第21回道路債券	100,000,000	106,791,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊 債券	第30回道路債券	100,000,000	104,909,000	
	第33回道路債券	100,000,000	109,804,000	
	第37回道路債券	100,000,000	104,419,000	
	第42回道路債券	100,000,000	103,535,000	
	政府保証第807回公営企業債券	100,000,000	101,803,000	
	政府保証第809回公営企業債券	100,000,000	102,012,000	
	政府保証第810回公営企業債券	100,000,000	102,126,000	
	政府保証第812回公営企業債券	100,000,000	102,403,000	
	政府保証第815回公営企業債券	100,000,000	102,468,000	
	政府保証第817回公営企業債券	100,000,000	102,426,000	
	政府保証第823回公営企業債券	100,000,000	101,549,000	
	政府保証第824回公営企業債券	100,000,000	101,579,000	
	政府保証第826回公営企業債券	100,000,000	101,320,000	
	政府保証第829回公営企業債券	100,000,000	102,628,000	
	政府保証第830回公営企業債券	100,000,000	101,995,000	
	政府保証第832回公営企業債券	100,000,000	103,750,000	
	政府保証第833回公営企業債券	100,000,000	104,148,000	
	政府保証第838回公営企業債券	100,000,000	104,374,000	
	政府保証第839回公営企業債券	100,000,000	104,398,000	
	政府保証第841回公営企業債券	100,000,000	105,734,000	
	政府保証第843回公営企業債券	100,000,000	104,536,000	
	政府保証第847回公営企業債券	100,000,000	104,157,000	
	政府保証第850回公営企業債券	100,000,000	104,201,000	
	政府保証第851回公営企業債券	100,000,000	103,732,000	
	政府保証第852回公営企業債券	100,000,000	103,724,000	
	政府保証第855回公営企業債券	100,000,000	103,740,000	
	政府保証第857回公営企業債券	100,000,000	105,378,000	
	政府保証第859回公営企業債券	100,000,000	104,822,000	
	政府保証第860回公営企業債券	100,000,000	105,377,000	
	政府保証第862回公営企業債券	100,000,000	106,543,000	
	政府保証第864回公営企業債券	100,000,000	107,175,000	
	政府保証第871回公営企業債券	100,000,000	106,473,000	
	政府保証第874回公営企業債券	100,000,000	105,729,000	
	政府保証第876回公営企業債券	200,000,000	213,940,000	
	政府保証第877回公営企業債券	200,000,000	213,884,000	
	政府保証第879回公営企業債券	200,000,000	210,806,000	
	政府保証第884回公営企業債券	100,000,000	102,764,000	
	政府保証第885回公営企業債券	100,000,000	104,993,000	
	政府保証第886回公営企業債券	100,000,000	105,710,000	

政府保証第15年2回公営企業債券	100,000,000	106,254,000	
政府保証第2回地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	207,468,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,717,000	
政府保証第3回地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	204,084,000	
政府保証第4回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	101,070,000	
第3回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,108,000	
20年2回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	101,957,000	
政府保証第8回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,326,000	
第4回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	102,544,000	
政府保証第3回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,043,000	
政府保証第5回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,160,000	
政府保証第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,812,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊 債券	政府保証第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,656,000	
	20年第5回公営企業債券	100,000,000	104,021,000	
	20年第9回公営企業債券	100,000,000	105,883,000	
	20年第11回公営企業債券	100,000,000	102,678,000	
	20年第15回公営企業債券	100,000,000	102,613,000	
	20年第17回公営企業債券	200,000,000	210,940,000	
	第1回公営企業債券	100,000,000	101,944,000	
	第5回公営企業債券	200,000,000	202,646,000	
	第6回公営企業債券	100,000,000	100,948,000	
	第12回公営企業債券	200,000,000	208,716,000	
	第13回公営企業債券	100,000,000	104,653,000	
	第17回公営企業債券	200,000,000	209,676,000	
	第19回公営企業債券	200,000,000	214,834,000	
	第23回公営企業債券	100,000,000	106,775,000	
	第24回公営企業債券	100,000,000	106,964,000	
	政府保証第187回首都高速道路債券	200,000,000	208,358,000	
	政府保証第189回首都高速道路債券	100,000,000	103,512,000	
	政府保証第190回首都高速道路債券	100,000,000	103,913,000	
	政府保証第197回首都高速道路債券	100,000,000	104,664,000	
	第9回首都高速道路債券	100,000,000	105,215,000	
	政府保証第144回阪神高速道路債券	100,000,000	104,649,000	
	政府保証第148回阪神高速道路債券	100,000,000	103,708,000	
	政府保証第157回中小企業債券	100,000,000	101,256,000	
	政府保証第165回中小企業債券	100,000,000	102,443,000	
	政府保証第176回中小企業債券	100,000,000	104,350,000	
	政府保証第184回中小企業債券	100,000,000	104,101,000	
	政府保証第191回中小企業債券	200,000,000	210,788,000	
	第23回中小企業債券	100,000,000	102,953,000	
	第24回中小企業債券	100,000,000	101,503,000	
	第2回国際協力銀行債券	100,000,000	101,663,000	
	第6回国際協力銀行債券	100,000,000	102,111,000	
	第8回国際協力銀行債券	100,000,000	100,916,000	
	第12回国際協力銀行債券	100,000,000	104,376,000	
	第15回国際協力銀行債券	100,000,000	105,061,000	
	第19回国際協力銀行債券	100,000,000	102,076,000	
	第21回国際協力銀行債券	100,000,000	104,767,000	
	第25回国際協力銀行債券	100,000,000	107,421,000	
	第27回国際協力銀行債券	100,000,000	105,644,000	
	第29回国際協力銀行債券	100,000,000	105,375,000	
	政府保証第16回都市再生債券	100,000,000	100,982,000	
	第9回都市再生債券	100,000,000	101,631,000	
	第3回都市基盤整備債券	100,000,000	103,347,000	
	政府保証第27回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,247,000	

第2回本州四国連絡橋債券	100,000,000	105,030,000	
政府保証第37回関西国際空港債券	100,000,000	101,677,000	
政府保証第105回預金保険機構債券	100,000,000	101,049,000	
政府保証第108回預金保険機構債券	100,000,000	101,603,000	
政府保証第112回預金保険機構債券	200,000,000	202,806,000	
政府保証第121回預金保険機構債券	100,000,000	101,329,000	
政府保証第140回預金保険機構債券	100,000,000	101,288,000	
政府保証第143回預金保険機構債券	100,000,000	101,547,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊 債券	政府保証第147回預金保険機構債券	100,000,000	101,883,000	
	政府保証第153回預金保険機構債券	100,000,000	102,279,000	
	政府保証第7回住宅金融公庫債券	100,000,000	101,795,000	
	貸付債権担保第18回住宅金融公庫債券	58,306,000	59,061,645	
	貸付債権担保S種第1回住宅金融支援機構債券	139,834,000	143,364,808	
	貸付債権担保第1回住宅金融支援機構債券	413,135,000	425,669,515	
	貸付債権担保S種第2回住宅金融支援機構債券	71,801,000	74,410,248	
	貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	173,786,000	177,159,186	
	貸付債権担保S種第12回住宅金融支援機構債券	88,221,000	90,673,543	
	貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	94,220,000	98,464,611	
	貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券	283,974,000	288,616,974	
	貸付債権担保S種第1回住宅金融公庫債券	53,314,000	53,034,101	
	貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	164,469,000	166,445,917	
	貸付債権担保S種第5回住宅金融公庫債券	58,475,000	58,888,418	
	貸付債権担保S種第7回住宅金融公庫債券	255,012,000	264,289,336	
	貸付債権担保S種第8回住宅金融公庫債券	65,042,000	66,984,154	
	貸付債権担保S種第9回住宅金融公庫債券	65,624,000	67,755,467	
	貸付債権担保S種第10回住宅金融公庫債券	66,847,000	68,844,388	
	貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券	44,590,000	45,213,368	
	貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券	98,156,000	96,873,101	
	貸付債権担保第11回住宅金融公庫債券	52,871,000	50,454,266	
	貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	55,039,000	55,103,395	
	貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	124,688,000	128,118,166	
	貸付債権担保第25回住宅金融公庫債券	65,407,000	65,499,223	
	貸付債権担保第28回住宅金融公庫債券	68,092,000	68,426,331	
	貸付債権担保第29回住宅金融公庫債券	217,779,000	219,157,541	
	貸付債権担保第31回住宅金融公庫債券	74,521,000	74,462,873	
	貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	228,015,000	227,834,868	
	貸付債権担保第34回住宅金融公庫債券	77,424,000	77,902,480	
	貸付債権担保第36回住宅金融公庫債券	76,759,000	77,496,653	
	貸付債権担保第37回住宅金融公庫債券	76,739,000	77,471,857	
	貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	232,308,000	233,862,140	
	貸付債権担保第41回住宅金融公庫債券	78,487,000	80,375,397	
	貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	77,166,000	80,430,893	
	貸付債権担保第47回住宅金融公庫債券	78,301,000	80,639,850	
	貸付債権担保第51回住宅金融公庫債券	243,003,000	250,523,942	
	貸付債権担保第53回住宅金融公庫債券	82,521,000	84,399,177	
	政府保証第8回国民生活債券	200,000,000	203,160,000	
	政府保証第9回国民生活債券	100,000,000	102,616,000	
	政府保証第12回国民生活債券	100,000,000	103,926,000	
	政府保証第15回国民生活債券	100,000,000	104,652,000	
	政府保証第19回国民生活債券	125,000,000	132,270,000	
	政府保証第20回国民生活債券	100,000,000	104,074,000	
	第36回国民生活債券	200,000,000	204,586,000	
	第11回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	105,709,000	
	い第676号商工債券	100,000,000	101,685,000	
	い第692号商工債	100,000,000	102,343,000	

い第694号商工債	100,000,000	102,309,000	
い第704号商工債	200,000,000	206,600,000	
い第705号商工債	100,000,000	103,501,000	
い第707号商工債	200,000,000	206,712,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊 債券	い第710号商工債	200,000,000	203,442,000	
	い第713号商工債	100,000,000	100,965,000	
	い第714号商工債	100,000,000	101,384,000	
	い第675号農林債	200,000,000	203,390,000	
	い第679号農林債	200,000,000	203,706,000	
	い第681号農林債	200,000,000	203,860,000	
	い第685号農林債	100,000,000	102,563,000	
	い第686号農林債	100,000,000	102,871,000	
	い第687号農林債	200,000,000	205,700,000	
	い第689号農林債	100,000,000	102,775,000	
	い第695号農林債	100,000,000	102,192,000	
	い第697号農林債	100,000,000	103,376,000	
	い第701号農林債	100,000,000	103,372,000	
	い第704号農林債	100,000,000	102,925,000	
	い第708号農林債	100,000,000	102,356,000	
	い第715号農林債	200,000,000	200,496,000	
	第199回しんきん中金債券（5年）	100,000,000	101,422,000	
	第200回しんきん中金債券（5年）	100,000,000	101,812,000	
	第201回信金中金債（5年）	100,000,000	101,736,000	
	第204回信金中金債（5年）	200,000,000	203,434,000	
	第208回信金中金債（5年）	100,000,000	101,868,000	
	第212回信金中金債（5年）	200,000,000	205,834,000	
	第213回信金中金債（5年）	200,000,000	205,794,000	
	第219回信金中金債（5年）	100,000,000	102,318,000	
	第222回信金中金債（5年）	100,000,000	103,062,000	
	第223回信金中金債（5年）	100,000,000	103,441,000	
	第224回信金中金債（5年）	100,000,000	103,327,000	
	第225回信金中金債（5年）	100,000,000	102,865,000	
	第228回信金中金債（5年）	100,000,000	103,494,000	
	第230回信金中金債（5年）	200,000,000	205,634,000	
	第231回信金中金債（5年）	100,000,000	103,195,000	
	第234回信金中金債（5年）	100,000,000	102,438,000	
	第237回信金中金債（5年）	100,000,000	101,818,000	
	第110号商工債（3年）	100,000,000	101,659,000	
	第112号商工債（3年）	200,000,000	202,232,000	
	政府保証第5回東日本高速道路債券	100,000,000	107,751,000	
	政府保証第8回中日本高速道路債券	100,000,000	107,741,000	
	政府保証第10回中日本高速道路債券	172,000,000	183,128,400	
	政府保証第20回中日本高速道路債券	100,000,000	102,811,000	
	中日本高速道路株式会社第5回社債	100,000,000	105,035,000	
	中日本高速道路株式会社第6回社債	100,000,000	103,749,000	
	政府保証第3回西日本高速道路債券	100,000,000	106,462,000	
	政府保証第20回西日本高速道路債券	100,000,000	101,202,000	
特殊債券 小計		32,342,926,000	33,411,416,812	
社債券	第322回東京交通債券	100,000,000	115,229,000	
	第323回東京交通債券	100,000,000	118,188,000	
	第324回東京交通債券	100,000,000	116,403,000	
	一般担保第2回住宅金融支援機構債券	200,000,000	211,472,000	
	一般担保第6回住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,068,000	
	一般担保第11回住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,171,000	
	一般担保第14回住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,486,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	一般担保第17回住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,799,000	
	一般担保第21回住宅金融支援機構債券	200,000,000	211,148,000	
	一般担保第23回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,354,000	
	一般担保第25回住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,361,000	
	一般担保第29回住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,831,000	
	一般担保第30回住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,470,000	
	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	100,310,000	
	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	203,180,000	
	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	203,192,000	
	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	101,395,000	
	第11回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	96,575,000	
	第15回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	98,518,000	
	第17回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	86,996,000	
	第22回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	99,409,000	
	第6回ザ・ベアー・スターンズ・カンパニーズ・インク円貨社債	100,000,000	100,626,000	
	第3回ドイツ銀行AGロンドン支店円貨社債	100,000,000	100,206,000	
	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	99,872,000	
	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	99,904,000	
	パークレイズ・バンク・ピーエルシー第2回円貨社債（2007）	200,000,000	204,670,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行第2回円貨社債2009	100,000,000	101,586,000	
	エイチエスビーシー・バンク・ピーエルシー第1回円貨社債（2009）	100,000,000	102,792,000	
	麒麟ホールディングス株式会社第1回無担保社債	100,000,000	101,976,000	
	味の素株式会社第17回無担保社債	100,000,000	100,677,000	
	日本たばこ産業株式会社第3回社債	100,000,000	101,515,000	
	日本たばこ産業株式会社第5回社債	100,000,000	102,340,000	
	住友化学株式会社第29回無担保社債	100,000,000	101,165,000	
	三菱化学株式会社第37回無担保社債	100,000,000	104,493,000	
	三井化学株式会社第31回無担保社債	100,000,000	100,307,000	
	花王株式会社第2回無担保社債	100,000,000	104,715,000	
	エーザイ株式会社第6回無担保社債	100,000,000	103,734,000	
	エーザイ株式会社第7回無担保社債	100,000,000	105,564,000	
	第一三共株式会社第2回無担保社債	100,000,000	103,139,000	
	新日本石油株式会社第26回無担保社債	100,000,000	108,211,000	
	株式会社ブリヂストン第4回無担保社債	100,000,000	101,380,000	
	新日本製鐵株式会社第52回無担保社債	100,000,000	104,469,000	
	新日本製鐵株式会社第56回無担保社債	100,000,000	104,010,000	
	新日本製鐵株式会社第62回無担保社債	100,000,000	102,523,000	
	ジェイエフイーホールディングス株式会社第13回無担保社債	100,000,000	101,410,000	
	株式会社豊田自動織機第12回無担保社債	200,000,000	202,504,000	
	株式会社豊田自動織機第15回無担保社債	100,000,000	104,692,000	
	松下電器産業株式会社第5回無担保社債	100,000,000	102,148,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	パナソニック株式会社第6回無担保社債	100,000,000	101,502,000	
	パナソニック株式会社第7回無担保社債	100,000,000	103,334,000	

シャープ株式会社第24回無担保社債	100,000,000	101,002,000	
ソニー株式会社第16回無担保社債	100,000,000	101,772,000	
ソニー株式会社第17回無担保社債	100,000,000	104,090,000	
ソニー株式会社第25回無担保社債	100,000,000	102,782,000	
ソニー株式会社第26回無担保社債	100,000,000	105,117,000	
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	104,681,000	
三菱重工業株式会社第17回無担保社債	100,000,000	100,761,000	
三菱重工業株式会社第22回無担保社債	100,000,000	106,055,000	
トヨタ自動車株式会社第7回無担保社債	200,000,000	206,244,000	
トヨタ自動車株式会社第9回無担保社債	100,000,000	102,119,000	
トヨタ自動車株式会社第10回無担保社債	100,000,000	102,847,000	
アイシン精機株式会社第5回無担保社債	100,000,000	102,889,000	
大日本印刷株式会社第1回無担保社債	200,000,000	208,176,000	
三井物産株式会社第12回無担保社債	100,000,000	105,487,000	
三井物産株式会社第58回無担保社債	100,000,000	106,094,000	
住友商事株式会社第29回無担保社債	100,000,000	102,828,000	
三菱商事株式会社第45回無担保社債	100,000,000	102,222,000	
三菱商事株式会社第46回無担保社債	100,000,000	102,528,000	
三菱商事株式会社第53回無担保社債	100,000,000	100,863,000	
三菱商事株式会社第70回無担保社債	100,000,000	104,829,000	
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	101,688,000	
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	203,672,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第9回無担保社債	300,000,000	307,773,000	
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	203,866,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第12回無担保社債	100,000,000	102,609,000	
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	103,042,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第15回無担保社債	100,000,000	103,008,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第16回無担保社債	300,000,000	308,046,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第17回無担保社債	100,000,000	101,547,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第18回無担保社債	100,000,000	100,884,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第57回無担保社債	100,000,000	104,412,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第83回無担保社債	200,000,000	214,494,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第85回無担保社債	200,000,000	203,622,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第87回無担保社債	100,000,000	105,839,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第92回無担保社債	100,000,000	102,862,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第98回無担保社債	100,000,000	102,409,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第100回無担保社債	100,000,000	103,145,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第104回無担保社債	200,000,000	206,636,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第106回無担保社債	300,000,000	304,578,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第3回2号無担保社債	200,000,000	204,984,000	
株式会社三井住友銀行第36回無担保社債	300,000,000	304,770,000	
株式会社三井住友銀行第44回無担保社債	100,000,000	103,094,000	
株式会社三井住友銀行第45回無担保社債	200,000,000	205,650,000	
株式会社三井住友銀行第47回無担保社債	100,000,000	101,544,000	
株式会社三井住友銀行第48回無担保社債	100,000,000	100,889,000	
NTTファイナンス株式会社第32回無担保社債	100,000,000	102,951,000	
NTTファイナンス株式会社第37回無担保社債	100,000,000	100,646,000	
株式会社ホンダファイナンス第8回無担保社債	200,000,000	202,540,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	トヨタファイナンス株式会社第14回無担保社債	100,000,000	101,619,000	
	トヨタファイナンス株式会社第21回無担保社債	100,000,000	106,972,000	
	トヨタファイナンス株式会社第22回無担保社債	100,000,000	101,832,000	
	トヨタファイナンス株式会社第25回無担保社債	100,000,000	104,173,000	
	トヨタファイナンス株式会社第30回無担保社債	100,000,000	102,810,000	
	三菱地所株式会社第30回無担保社債	100,000,000	106,252,000	

三菱地所株式会社第53回無担保社債	100,000,000	102,445,000	
三菱地所株式会社第70回無担保社債	100,000,000	104,329,000	
三菱地所株式会社第79回無担保社債	100,000,000	105,208,000	
東日本旅客鉄道株式会社第7回社債（一般担保付）	200,000,000	232,280,000	
東日本旅客鉄道株式会社第18回無担保社債	100,000,000	102,654,000	
東日本旅客鉄道株式会社第21回無担保社債	100,000,000	103,859,000	
東日本旅客鉄道株式会社第23回無担保普通社債	100,000,000	102,052,000	
東日本旅客鉄道株式会社第27回無担保普通社債	100,000,000	103,679,000	
東日本旅客鉄道株式会社第33回無担保普通社債	100,000,000	105,676,000	
東日本旅客鉄道株式会社第37回無担保普通社債	100,000,000	104,238,000	
東日本旅客鉄道株式会社第43回無担保普通社債	100,000,000	103,635,000	
東日本旅客鉄道株式会社第50回無担保普通社債	100,000,000	106,110,000	
西日本旅客鉄道株式会社第7回社債（一般担保付）	100,000,000	109,674,000	
西日本旅客鉄道株式会社第11回無担保社債	100,000,000	104,908,000	
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	110,879,000	
東海旅客鉄道株式会社第10回無担保普通社債	100,000,000	102,963,000	
東海旅客鉄道株式会社第20回無担保普通社債	200,000,000	210,902,000	
東海旅客鉄道株式会社第25回無担保普通社債	100,000,000	107,347,000	
東京地下鉄株式会社第3回社債（一般担保付）	100,000,000	106,668,000	
東京地下鉄株式会社第8回社債（一般担保付）	100,000,000	102,969,000	
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	106,276,000	
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	102,064,000	
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	101,580,000	
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	104,666,000	
日本電信電話株式会社第50回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	104,876,000	
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	215,336,000	
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	105,713,000	
日本電信電話株式会社第53回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	103,505,000	
株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第10回無担保社債	100,000,000	101,695,000	
株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第15回無担保社債	100,000,000	106,085,000	
株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第16回無担保社債	100,000,000	102,926,000	
東京電力株式会社第457回社債	100,000,000	106,957,000	
東京電力株式会社第489回社債	100,000,000	101,775,000	
東京電力株式会社第491回社債	110,000,000	112,399,100	
東京電力株式会社第493回社債	100,000,000	102,437,000	
東京電力株式会社第496回社債	100,000,000	102,589,000	
東京電力株式会社第498回社債	100,000,000	102,116,000	
東京電力株式会社第507回社債	100,000,000	103,771,000	

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511回社債	100,000,000	104,593,000	
	東京電力株式会社第513回社債	100,000,000	105,667,000	
	東京電力株式会社第514回社債	100,000,000	104,536,000	
	東京電力株式会社第515回社債	100,000,000	104,061,000	
	東京電力株式会社第516回社債	100,000,000	104,033,000	
	東京電力株式会社第518回社債	100,000,000	103,756,000	
	東京電力株式会社第519回社債	100,000,000	105,026,000	
	東京電力株式会社第521回社債	100,000,000	107,192,000	
	東京電力株式会社第522回社債	100,000,000	107,742,000	
	東京電力株式会社第539回社債	100,000,000	103,766,000	

東京電力株式会社第541回社債	100,000,000	102,296,000	
東京電力株式会社第542回社債	200,000,000	207,532,000	
東京電力株式会社第544回社債	100,000,000	106,644,000	
中部電力株式会社第405回社債	100,000,000	117,333,000	
中部電力株式会社第406回社債	200,000,000	231,394,000	
中部電力株式会社第426回社債	100,000,000	112,411,000	
中部電力株式会社第466回社債	100,000,000	104,706,000	
中部電力株式会社第472回社債	100,000,000	101,607,000	
中部電力株式会社第478回社債	100,000,000	106,680,000	
中部電力株式会社第480回社債	100,000,000	105,967,000	
中部電力株式会社第484回社債	100,000,000	103,842,000	
関西電力株式会社第432回社債（一般担保付）	100,000,000	102,512,000	
関西電力株式会社第433回社債（一般担保付）	100,000,000	103,376,000	
関西電力株式会社第435回社債（一般担保付）	100,000,000	104,098,000	
関西電力株式会社第443回社債（一般担保付）	100,000,000	104,041,000	
関西電力株式会社第448回社債（一般担保付）	100,000,000	107,971,000	
関西電力株式会社第454回社債（一般担保付）	100,000,000	104,147,000	
関西電力株式会社第463回社債（一般担保付）	100,000,000	104,084,000	
関西電力株式会社第466回社債（一般担保付）	100,000,000	103,585,000	
中国電力株式会社第298回社債（一般担保付）	100,000,000	117,315,000	
中国電力株式会社第306回社債（一般担保付）	100,000,000	117,302,000	
中国電力株式会社第311回社債（一般担保付）	100,000,000	113,375,000	
中国電力株式会社第350回社債（一般担保付）	100,000,000	104,567,000	
中国電力株式会社第354回社債（一般担保付）	100,000,000	106,053,000	
北陸電力株式会社第277回社債（一般担保付）	100,000,000	104,138,000	
北陸電力株式会社第283回社債（一般担保付）	100,000,000	108,057,000	
北陸電力株式会社第288回社債（一般担保付）	100,000,000	106,244,000	
東北電力株式会社第383回社債（一般担保付）	100,000,000	113,410,000	
東北電力株式会社第408回社債（一般担保付）	100,000,000	102,472,000	
東北電力株式会社第414回社債（一般担保付）	100,000,000	101,236,000	
東北電力株式会社第416回社債（一般担保付）	100,000,000	97,644,000	
東北電力株式会社第420回社債（一般担保付）	100,000,000	103,501,000	
東北電力株式会社第435回社債（一般担保付）	100,000,000	106,606,000	
四国電力株式会社第249回社債（一般担保付）	100,000,000	102,454,000	
四国電力株式会社第253回社債（一般担保付）	100,000,000	91,149,000	
四国電力株式会社第257回社債（一般担保付）	100,000,000	103,859,000	
九州電力株式会社第363回社債（一般担保付）	100,000,000	101,656,000	
九州電力株式会社第366回社債（一般担保付）	100,000,000	102,513,000	
九州電力株式会社第371回社債（一般担保付）	100,000,000	96,985,000	
九州電力株式会社第372回社債（一般担保付）	100,000,000	101,232,000	
九州電力株式会社第376回社債（一般担保付）	100,000,000	104,044,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	九州電力株式会社第384回社債（一般担保付）	100,000,000	103,554,000	
	九州電力株式会社第387回社債（一般担保付）	100,000,000	105,518,000	
	九州電力株式会社第391回社債（一般担保付）	100,000,000	106,159,000	
	九州電力株式会社第399回社債（一般担保付）	100,000,000	102,862,000	
	九州電力株式会社第405回社債（一般担保付）	100,000,000	104,754,000	
	北海道電力株式会社第257回社債（一般担保付）	100,000,000	118,044,000	
	北海道電力株式会社第282回社債（一般担保付）	100,000,000	103,736,000	
	北海道電力株式会社第284回社債（一般担保付）	100,000,000	104,334,000	
	北海道電力株式会社第285回社債（一般担保付）	100,000,000	105,502,000	
	沖縄電力株式会社第9回社債（一般担保付）	100,000,000	98,398,000	
	電源開発株式会社第14回無担保社債	100,000,000	104,461,000	
	電源開発株式会社第16回無担保社債	100,000,000	106,992,000	
	電源開発株式会社第17回無担保社債	200,000,000	214,922,000	
	電源開発株式会社第19回無担保社債	200,000,000	212,930,000	

電源開発株式会社第21回無担保社債	100,000,000	104,480,000	
大阪瓦斯株式会社第7回無担保社債	100,000,000	116,432,000	
大阪瓦斯株式会社第9回無担保社債	100,000,000	113,530,000	
大阪瓦斯株式会社第25回無担保社債	100,000,000	102,858,000	
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）	200,000,000	204,736,000	
社債券 小計	24,410,000,000	25,423,116,100	
合計	296,319,326,000	305,711,424,154	

（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。

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 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。

⑦ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「中央三井日本株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成22年4月26日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	310,467
コール・ローン	4,121,736,081
株式	278,364,142,500
派生商品評価勘定	397,646,200
未収配当金	2,495,311,048
未収利息	10,581
流動資産合計	285,379,156,877
資産合計	285,379,156,877
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,925
前受金	297,018,000
未払解約金	207,721,729
流動負債合計	504,748,654
負債合計	504,748,654
純資産の部	
元本等	
元本	326,378,794,871
剰余金	
欠損金	41,504,386,648
純資産合計	284,874,408,223
負債・純資産合計	285,379,156,877

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成22年4月26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、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

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、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段によっております。 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22年４月26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 3,368,900,000 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	326,378,794,871 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 41,504,386,648 円
4. １口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	0.8728 円 （ 8,728 円）

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

平成22年４月26日現在
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

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

3. 金融商品に関するリスク体制

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年4月26日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

(1) 株式

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

(2) デリバティブ取引

デリバティブ取引については、「（その他の注記）」の「3. デリバティブ取引関係」に記載しております。

(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

4. 金銭債権の計算日後の償還予定額

金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成22年4月26日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

平成22年4月26日現在

該当事項はありません。

（その他の注記）

1. 元本の変動

平成22年4月26日現在

計算期間の期首元本額	330,523,538,134 円
計算期間中の追加設定元本額	24,175,436,645 円
計算期間中の一部解約元本額	28,320,179,908 円
計算日の元本額	326,378,794,871 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	2,468,929,610 円
中央三井DC日本株式インデックスファンド	292,932,170 円
中央三井DC日本株式インデックスファンドL	37,203,604,318 円
中央三井DC日本株式インデックスファンドA	1,506,441,684 円
中央三井DCバランスファンド30	201,495,845 円
中央三井DCバランスファンド50	512,385,840 円
中央三井DCバランスファンド70	319,892,667 円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	403,731,902 円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	239,462,694 円
新生・4分散ファンド	270,811,807 円
ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド	669,594,786 円
4資産インデックスバランスオープン（分配型）	139,384,742 円
4資産インデックスバランスオープン（成長型）	308,288,609 円
日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）	197,958,695 円
CMAM日本株式インデックスe	1,583,744 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）	40,202,149,707 円
中央三井バランスVA30（適格機関投資家専用）	7,671,781,241 円
中央三井バランスVA50（適格機関投資家専用）	57,830,545,798 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）	41,526,290,019 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）	6,459,662,309 円
中央三井VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	1,000,736,786 円
中央三井VAバランスファンド（株60／100）（適格機関投資家専用）	7,987,557,775 円
中央三井バランスVA25（適格機関投資家専用）	6,882,118,572 円
中央三井バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	2,915,623,245 円
中央三井バランスVA50L（適格機関投資家専用）	44,709,532,386 円
中央三井バランスVA75（適格機関投資家専用）	2,847,007,804 円
中央三井VAバランスファンド（株40／100）（適格機関投資家専用）	19,563,222,513 円
中央三井VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	7,661,318,024 円
中央三井VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	255,109,878 円
中央三井バランスVA40（適格機関投資家専用）	3,790,182,262 円
中央三井VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	2,924,440,391 円
CMAM・バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	7,599,299,819 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）	420,073,023 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）	4,939,787,063 円
CMAM・VAバランス50－50（適格機関投資家専用）	329,942,984 円
中央三井バランスVA20（適格機関投資家専用）	2,023,856,425 円
中央三井VAファンド25（適格機関投資家専用）	3,562,389,027 円
CMAM・バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	2,968,799,454 円
中央三井バランスVA20L（適格機関投資家専用）	147,608,859 円
中央三井バランスVA25L（適格機関投資家専用）	2,182,626,642 円
CMAM・バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	2,583,799,521 円
中央三井世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	429,319,398 円
中央三井国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	146,731,854 円

中央三井国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	49,781,617 円
CMAM・VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	30,772,030 円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	229,332 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

平成22年4月26日現在	
種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	15,525,234,687
合計	15,525,234,687

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「中央三井日本株式マザーファンド」の期首から計算日までの期間（平成22年1月23日から平成22年4月26日まで）に対応するものです。

3. デリバティブ取引関係

I. ヘッジ会計が適用されていないもの

株式関連

区分	種類	平成22年4月26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	6,249,017,725	—	6,646,655,000	397,637,275
	合計	6,249,017,725	—	6,646,655,000	397,637,275

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

II. ヘッジ会計が適用されているもの

平成22年4月26日現在
該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表（平成22年4月26日現在）

① 有価証券明細表

A. 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
極洋	100,000	189	18,900,000	
日本水産	252,100	276	69,579,600	
マルハニチロホールディングス	498,000	135	67,230,000	
サカタのタネ	35,700	1,322	47,195,400	
ホクト	25,700	1,998	51,348,600	
日鉄鉱業	65,000	439	28,535,000	
三井松島産業	114,000	207	23,598,000	
国際石油開発帝石	1,152	699,000	805,248,000	
日本海洋掘削	4,000	5,180	20,720,000	
関東天然瓦斯開発	28,000	514	14,392,000	
石油資源開発	39,900	4,945	197,305,500	
ショーボンドホールディングス	23,700	1,868	44,271,600	
ダイセキ環境ソリューション	26	129,000	3,354,000	
東急建設	104,370	282	29,432,340	
コムシスホールディングス	101,900	923	94,053,700	
高松コンストラクショングループ	23,400	1,175	27,495,000	
東建コーポレーション	10,040	2,874	28,854,960	
大成建設	1,129,000	216	243,864,000	
大林組	655,000	425	278,375,000	
清水建設	660,000	376	248,160,000	
松井建設	41,000	356	14,596,000	
鹿島建設	1,033,000	241	248,953,000	
太平工業	39,000	411	16,029,000	
前田建設工業	190,000	341	64,790,000	
奥村組	223,000	329	73,367,000	
大和小田急建設	32,500	294	9,555,000	
東鉄工業	35,000	570	19,950,000	
戸田建設	270,000	352	95,040,000	
青木あすなろ建設	27,000	432	11,664,000	
北野建設	77,000	213	16,401,000	
三井ホーム	39,000	520	20,280,000	
矢作建設工業	38,000	595	22,610,000	
ピーエス三菱	22,900	330	7,557,000	
大東建託	101,000	4,875	492,375,000	
NIPPON	53,000	744	39,432,000	
前田道路	69,000	826	56,994,000	
日本道路	79,000	249	19,671,000	
五洋建設	276,000	163	44,988,000	
大林道路	40,000	221	8,840,000	
住友林業	173,300	789	136,733,700	
日本基礎技術	41,500	221	9,171,500	
巴コーポレーション	44,100	239	10,539,900	
パナホーム	89,000	616	54,824,000	
大和ハウス工業	586,000	1,021	598,306,000	
ライト工業	63,100	230	14,513,000	
積水ハウス	709,000	909	644,481,000	
北陸電気工事	21,000	265	5,565,000	
コミュニチュア	26,000	597	15,522,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	

ユアテック	45,000	484	21,780,000	
西部電気工業	27,000	375	10,125,000	
四電工	26,000	468	12,168,000	
中電工	33,900	1,218	41,290,200	
関電工	104,000	635	66,040,000	
大明	32,300	789	25,484,700	
きんでん	149,000	849	126,501,000	
東京エネシス	29,000	673	19,517,000	
トーエネック	40,000	553	22,120,000	
住友電設	22,100	490	10,829,000	
日本電設工業	49,000	882	43,218,000	
協和エクシオ	82,200	797	65,513,400	
新日本空調	21,400	669	14,316,600	
東電通	49,000	177	8,673,000	
日本電話施設	45,000	307	13,815,000	
九電工	51,000	567	28,917,000	
三機工業	56,000	764	42,784,000	
日揮	235,000	1,631	383,285,000	
中外炉工業	75,000	277	20,775,000	
ヤマト	29,000	328	9,512,000	
太平電業	30,000	869	26,070,000	
高砂熱学工業	69,100	823	56,869,300	
三晃金属工業	37,000	232	8,584,000	
NECネッツエスアイ	19,500	1,187	23,146,500	
朝日工業社	35,000	385	13,475,000	
大気社	35,000	1,694	59,290,000	
ダイダン	36,000	522	18,792,000	
日比谷総合設備	36,200	889	32,181,800	
東芝プラントシステム	34,000	1,106	37,604,000	
東洋エンジニアリング	148,000	355	52,540,000	
千代田化工建設	182,000	902	164,164,000	
新興プランテック	42,000	875	36,750,000	
日本製粉	146,000	453	66,138,000	
日清製粉グループ本社	228,000	1,191	271,548,000	
日東富士製粉	20,000	348	6,960,000	
昭和産業	104,000	295	30,680,000	
鳥越製粉	22,000	764	16,808,000	
協同飼料	88,000	120	10,560,000	
中部飼料	24,000	858	20,592,000	
日本配合飼料	71,000	117	8,307,000	
ユニ・チャーム ペットケア	14,400	3,165	45,576,000	
東洋精糖	39,000	129	5,031,000	
日本甜菜製糖	129,000	232	29,928,000	
三井製糖	89,000	315	28,035,000	
森永製菓	247,000	208	51,376,000	
中村屋	59,000	460	27,140,000	
江崎グリコ	91,000	1,083	98,553,000	
名糖産業	11,400	1,290	14,706,000	
不二家	145,000	202	29,290,000	
山崎製パン	184,000	1,214	223,376,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
第一屋製パン	35,000	138	4,830,000	
モロゾフ	39,000	300	11,700,000	
森永乳業	213,000	370	78,810,000	
ヤクルト本社	135,000	2,457	331,695,000	

明治ホールディングス	74,600	3,445	256,997,000	
雪印メグミルク	49,400	1,578	77,953,200	
プリマハム	127,000	107	13,589,000	
日本ハム	175,000	1,218	213,150,000	
伊藤ハム	156,000	353	55,068,000	
丸大食品	102,000	262	26,724,000	
米久	20,500	872	17,876,000	
S Foods	13,500	796	10,746,000	
サッポロホールディングス	357,000	474	169,218,000	
アサヒビール	438,800	1,734	760,879,200	
麒麟ホールディングス	1,031,000	1,372	1,414,532,000	
宝ホールディングス	198,000	520	102,960,000	
オエノンホールディングス	65,000	203	13,195,000	
メルシャン	76,000	196	14,896,000	
養命酒製造	19,000	896	17,024,000	
三国コカ・コーラボトリング	30,100	777	23,387,700	
コカ・コーラウエスト	62,000	1,652	102,424,000	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	28,400	1,259	35,755,600	
ダイドードリンコ	10,500	3,485	36,592,500	
伊藤園	63,700	1,486	94,658,200	
キーコーヒー	20,500	1,567	32,123,500	
ユニカフェ	6,100	503	3,068,300	
ジャパンフーズ	3,400	892	3,032,800	
日清オイリオグループ	97,000	497	48,209,000	
不二製油	61,100	1,338	81,751,800	
J-オイルミルズ	94,000	318	29,892,000	
キッコーマン	191,000	1,073	204,943,000	
味の素	635,000	876	556,260,000	
キューピー	130,200	1,039	135,277,800	
ハウス食品	92,900	1,362	126,529,800	
カゴメ	90,400	1,591	143,826,400	
焼津水産化学工業	11,900	1,163	13,839,700	
アリアケジャパン	20,700	1,399	28,959,300	
ニチレイ	260,000	371	96,460,000	
東洋水産	108,000	2,284	246,672,000	
日清食品ホールディングス	82,000	3,230	264,860,000	
永谷園	22,000	878	19,316,000	
フジッコ	25,000	1,078	26,950,000	
ロック・フィールド	12,300	1,372	16,875,600	
日本たばこ産業	5,234	314,500	1,646,093,000	
わらべや日洋	12,900	1,150	14,835,000	
なとり	11,000	854	9,394,000	
ミヨシ油脂	82,000	151	12,382,000	
片倉工業	27,000	942	25,434,000	
グンゼ	164,000	353	57,892,000	
川島織物セルコン	85,000	86	7,310,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
東洋紡績	786,000	161	126,546,000	
ユニチカ	509,000	83	42,247,000	
富士紡ホールディングス	111,000	154	17,094,000	
日清紡ホールディングス	154,000	960	147,840,000	
倉敷紡績	229,000	160	36,640,000	
シキボウ	150,000	145	21,750,000	
日本毛織	86,000	784	67,424,000	
トーア紡コーポレーション	97,000	87	8,439,000	

ダイドーリミテッド	30,100	728	21,912,800	
帝国繊維	26,000	493	12,818,000	
帝人	825,000	309	254,925,000	
東レ	1,467,000	541	793,647,000	
サカイオーベックス	71,000	110	7,810,000	
住江織物	59,000	238	14,042,000	
日本フェルト	15,100	434	6,553,400	
イチカワ	21,000	188	3,948,000	
日本バイリーン	27,000	457	12,339,000	
日東製網	34,000	122	4,148,000	
芦森工業	56,000	149	8,344,000	
アツギ	225,000	126	28,350,000	
ダイニック	46,000	181	8,326,000	
セーレン	54,300	587	31,874,100	
東海染工	42,000	106	4,452,000	
小松精練	41,000	399	16,359,000	
ワコールホールディングス	130,000	1,235	160,550,000	
ホギメディカル	10,300	4,755	48,976,500	
サンエー・インターナショナル	11,900	1,594	18,968,600	
クラウディア	3,300	1,276	4,210,800	
三陽商会	108,000	326	35,208,000	
オンワードホールディングス	145,000	776	112,520,000	
ルック	45,000	166	7,470,000	
ゴールドウイン	57,000	209	11,913,000	
東京スタイル	80,000	769	61,520,000	
デサント	66,000	587	38,742,000	
ヤマトインターナショナル	16,500	383	6,319,500	
特種東海ホールディングス	152,000	265	40,280,000	
王子製紙	966,000	443	427,938,000	
三菱製紙	319,000	124	39,556,000	
北越紀州製紙	146,000	493	71,978,000	
中越パルプ工業	95,000	181	17,195,000	
巴川製紙所	36,000	223	8,028,000	
大王製紙	99,000	805	79,695,000	
日本製紙グループ本社	97,400	2,649	258,012,600	
レンゴー	174,000	546	95,004,000	
トーモク	78,000	225	17,550,000	
ザ・バック	15,900	1,622	25,789,800	
クラレ	320,500	1,200	384,600,000	
旭化成	1,273,000	527	670,871,000	
共和レザー	13,900	410	5,699,000	
コープケミカル	39,000	144	5,616,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
昭和電工	1,481,000	206	305,086,000	
住友化学	1,502,000	462	693,924,000	
日本化成	48,000	183	8,784,000	
住友精化	46,000	360	16,560,000	
日産化学工業	148,000	1,315	194,620,000	
ラサ工業	95,000	114	10,830,000	
クレハ	141,000	498	70,218,000	
テイカ	38,000	277	10,526,000	
片倉チッカリン	17,000	295	5,015,000	
日本曹達	142,000	431	61,202,000	
東ソー	552,000	260	143,520,000	
トクヤマ	371,000	542	201,082,000	

セントラル硝子	225,000	470	105,750,000	
東亜合成	261,000	400	104,400,000	
ダイソー	96,000	237	22,752,000	
関東電化工業	53,000	718	38,054,000	
電気化学工業	465,000	415	192,975,000	
信越化学工業	361,900	5,450	1,972,355,000	
日本カーバイド工業	55,000	198	10,890,000	
堺化学工業	82,000	437	35,834,000	
エア・ウォーター	178,000	1,049	186,722,000	
大陽日酸	309,000	847	261,723,000	
日本化学工業	90,000	240	21,600,000	
日本パーカライジング	51,000	1,356	69,156,000	
高压ガス工業	36,000	539	19,404,000	
チタン工業	31,000	256	7,936,000	
四国化成工業	35,000	548	19,180,000	
戸田工業	38,000	696	26,448,000	
ステラ ケミファ	11,300	3,955	44,691,500	
保土谷化学工業	55,000	374	20,570,000	
日本触媒	132,000	832	109,824,000	
大日精化工業	86,000	354	30,444,000	
カネカ	297,000	602	178,794,000	
三菱瓦斯化学	376,000	549	206,424,000	
三井化学	867,000	311	269,637,000	
J S R	214,300	1,933	414,241,900	
東京応化工業	39,000	1,988	77,532,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,261,500	485	611,827,500	
日本合成化学工業	56,000	668	37,408,000	
ダイセル化学工業	284,000	622	176,648,000	
住友ベークライト	204,000	533	108,732,000	
積水化学工業	458,000	647	296,326,000	
日本ゼオン	203,000	561	113,883,000	
アイカ工業	59,200	1,000	59,200,000	
宇部興産	986,000	249	245,514,000	
積水樹脂	33,000	859	28,347,000	
タキロン	55,000	298	16,390,000	
旭有機材工業	77,000	233	17,941,000	
日立化成工業	101,800	2,087	212,456,600	
ニチバン	26,000	325	8,450,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
リケンテクノス	44,000	299	13,156,000	
大倉工業	56,000	269	15,064,000	
積水化成品工業	62,000	471	29,202,000	
群栄化学工業	66,000	230	15,180,000	
タイガースポリマー	11,800	364	4,295,200	
日本カーリット	20,200	470	9,494,000	
日本化薬	168,000	843	141,624,000	
日本精化	20,400	716	14,606,400	
A D E K A	95,200	905	86,156,000	
日油	195,000	368	71,760,000	
ハリマ化成	21,000	553	11,613,000	
花王	603,200	2,333	1,407,265,600	
第一工業製薬	41,000	272	11,152,000	
三洋化成工業	67,000	580	38,860,000	
大日本塗料	141,000	109	15,369,000	
日本ペイント	206,000	603	124,218,000	

関西ペイント	270,000	726	196,020,000	
中国塗料	64,000	703	44,992,000	
日本特殊塗料	18,400	382	7,028,800	
藤倉化成	28,700	504	14,464,800	
太陽インキ製造	17,500	2,672	46,760,000	
D I C	728,000	204	148,512,000	
サカタインクス	49,000	448	21,952,000	
東洋インキ製造	213,000	410	87,330,000	
富士フイルムホールディングス	466,900	3,275	1,529,097,500	
資生堂	400,600	1,946	779,567,600	
ライオン	271,000	470	127,370,000	
高砂香料工業	72,000	484	34,848,000	
マンダム	21,900	2,542	55,669,800	
ミルボン	10,500	2,182	22,911,000	
ファンケル	45,500	1,685	76,667,500	
コーセー	33,800	2,208	74,630,400	
ドクターシーラボ	157	229,500	36,031,500	
エステー	14,400	1,073	15,451,200	
コニシ	19,100	1,114	21,277,400	
長谷川香料	30,200	1,450	43,790,000	
小林製薬	32,600	3,850	125,510,000	
荒川化学工業	18,900	1,200	22,680,000	
メック	18,300	604	11,053,200	
日本高純度化学	64	330,500	21,152,000	
荏原ユーザライト	3,100	1,614	5,003,400	
アース製薬	16,900	2,805	47,404,500	
イハラケミカル工業	46,000	280	12,880,000	
北興化学工業	25,000	322	8,050,000	
大成ラミック	6,500	2,298	14,937,000	
クミアイ化学工業	51,000	289	14,739,000	
日本農薬	50,000	532	26,600,000	
アキレス	183,000	144	26,352,000	
有沢製作所	31,800	744	23,659,200	
日東電工	181,900	3,605	655,749,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
レック	6,700	1,617	10,833,900	
アロン化成	19,000	415	7,885,000	
きもと	20,800	818	17,014,400	
藤森工業	15,700	1,358	21,320,600	
前澤化成工業	22,100	934	20,641,400	
J S P	16,000	1,141	18,256,000	
エフピコ	10,500	4,495	47,197,500	
天馬	17,200	1,188	20,433,600	
信越ポリマー	40,400	696	28,118,400	
東リ	86,000	195	16,770,000	
ニフコ	48,800	2,052	100,137,600	
日本バルカー工業	92,000	214	19,688,000	
ユニ・チャーム	43,300	9,100	394,030,000	
協和発酵キリン	282,000	1,032	291,024,000	
武田薬品工業	826,700	4,000	3,306,800,000	代用有価証券で 200,000株 担保差入
アステラス製薬	465,100	3,390	1,576,689,000	
大日本住友製薬	166,600	834	138,944,400	
塩野義製薬	318,600	1,744	555,638,400	
田辺三菱製薬	196,000	1,269	248,724,000	

わかもと製薬	24,000	330	7,920,000	
あすか製薬	26,000	651	16,926,000	
日本新薬	54,000	1,091	58,914,000	
中外製薬	234,400	1,761	412,778,400	
科研製薬	100,000	763	76,300,000	
エーザイ	269,100	3,260	877,266,000	
ロート製薬	99,000	1,055	104,445,000	
小野薬品工業	109,600	4,075	446,620,000	
久光製薬	66,400	3,520	233,728,000	
有機合成薬品工業	20,000	247	4,940,000	
持田製薬	88,000	900	79,200,000	
大正製薬	189,000	1,719	324,891,000	
参天製薬	66,800	2,990	199,732,000	
扶桑薬品工業	79,000	300	23,700,000	
日本ケミファ	35,000	285	9,975,000	
ツムラ	64,200	2,761	177,256,200	
キッセイ薬品工業	44,000	2,102	92,488,000	
生化学工業	40,900	965	39,468,500	
栄研化学	16,700	883	14,746,100	
日水製薬	8,200	691	5,666,200	
鳥居薬品	14,100	1,751	24,689,100	
東和薬品	10,800	5,470	59,076,000	
沢井製薬	14,200	7,230	102,666,000	
ゼリア新薬工業	34,000	939	31,926,000	
第一三共	692,800	1,650	1,143,120,000	
キョーリン	58,000	1,355	78,590,000	
昭和シェル石油	210,400	673	141,599,200	
コスモ石油	592,000	270	159,840,000	
ニチレキ	34,000	457	15,538,000	
東燃ゼネラル石油	316,000	818	258,488,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ユシロ化学工業	12,700	1,251	15,887,700	
ビーピー・カストロール	13,100	360	4,716,000	
AOCホールディングス	56,600	643	36,393,800	
出光興産	25,100	7,880	197,788,000	
JXホールディングス	2,293,200	536	1,229,155,200	
横浜ゴム	239,000	427	102,053,000	
東洋ゴム工業	213,000	210	44,730,000	
ブリヂストン	681,000	1,563	1,064,403,000	
住友ゴム工業	165,200	816	134,803,200	
藤倉ゴム工業	15,000	367	5,505,000	
オカモト	90,000	390	35,100,000	
フコク	9,900	800	7,920,000	
ニッタ	21,200	1,530	32,436,000	
東海ゴム工業	36,400	1,123	40,877,200	
三ツ星ベルト	61,000	445	27,145,000	
バンドー化学	85,000	309	26,265,000	
日東紡績	191,000	213	40,683,000	
旭硝子	1,077,000	1,107	1,192,239,000	
日本板硝子	654,000	291	190,314,000	
石塚硝子	32,000	222	7,104,000	
日本山村硝子	94,000	320	30,080,000	
日本電気硝子	382,000	1,333	509,206,000	
オハラ	9,000	1,534	13,806,000	
住友大阪セメント	389,000	185	71,965,000	

太平洋セメント	862,000	135	116,370,000	
デイ・シイ	25,200	216	5,443,200	
日本ヒューム	24,000	299	7,176,000	
日本コンクリート工業	49,000	152	7,448,000	
東海カーボン	220,000	549	120,780,000	
日本カーボン	116,000	331	38,396,000	
東洋炭素	10,400	5,130	53,352,000	
ノリタケカンパニーリミテド	123,000	313	38,499,000	
TOTO	337,000	660	222,420,000	
日本碍子	259,000	1,843	477,337,000	
日本特殊陶業	192,000	1,268	243,456,000	
MARUWA	6,200	1,991	12,344,200	
品川リフラクトリーズ	60,000	294	17,640,000	
黒崎播磨	51,000	431	21,981,000	
東京窯業	30,000	218	6,540,000	
ニッカトー	8,800	480	4,224,000	
フジミインコーポレーテッド	21,600	1,621	35,013,600	
ニチアス	128,000	411	52,608,000	
ニチハ	33,500	860	28,810,000	
新日本製鐵	6,176,000	347	2,143,072,000	
住友金属工業	4,025,000	274	1,102,850,000	
神戸製鋼所	3,044,000	216	657,504,000	
日新製鋼	833,000	206	171,598,000	
中山製鋼所	114,000	158	18,012,000	
合同製鐵	123,000	243	29,889,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	471,700	3,455	1,629,723,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価 (円)	金額 (円)	
東京製鐵	108,200	1,272	137,630,400	
共英製鋼	22,300	1,852	41,299,600	
大和工業	55,200	3,185	175,812,000	
東京鐵鋼	47,000	295	13,865,000	
大阪製鐵	15,200	1,605	24,396,000	
淀川製鋼所	169,000	441	74,529,000	
東洋鋼鈑	50,000	571	28,550,000	
住友鋼管	14,500	640	9,280,000	
丸一鋼管	65,600	1,872	122,803,200	
モリ工業	41,000	317	12,997,000	
大同特殊鋼	364,000	377	137,228,000	
日本高周波鋼業	97,000	119	11,543,000	
日本金属工業	165,000	153	25,245,000	
日本冶金工業	131,500	363	47,734,500	
山陽特殊製鋼	118,000	400	47,200,000	
愛知製鋼	126,000	422	53,172,000	
日立金属	128,000	950	121,600,000	
日本金属	64,000	175	11,200,000	
大平洋金属	164,000	818	134,152,000	
日本電工	101,000	689	69,589,000	
日本鑄鉄管	26,000	155	4,030,000	
三菱製鋼	145,000	241	34,945,000	
日亜鋼業	34,000	279	9,486,000	
日本精線	20,000	371	7,420,000	
シンニッタン	20,700	358	7,410,600	
新家工業	88,000	132	11,616,000	
日本軽金属	537,000	138	74,106,000	
大紀アルミニウム工業所	39,000	282	10,998,000	

三井金属鉱業	640,000	266	170,240,000	
東邦亜鉛	115,000	462	53,130,000	
三菱マテリアル	1,303,000	284	370,052,000	
住友金属鉱山	568,000	1,434	814,512,000	
DOWAホールディングス	260,000	551	143,260,000	
古河機械金属	401,000	121	48,521,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,300	4,120	95,996,000	
東邦チタニウム	38,500	2,284	87,934,000	
住友軽金属工業	338,000	103	34,814,000	
古河スカイ	98,000	229	22,442,000	
古河電気工業	690,000	478	329,820,000	
住友電気工業	720,300	1,175	846,352,500	
フジクラ	327,000	518	169,386,000	
東京特殊電線	32,000	109	3,488,000	
タツタ電線	54,000	231	12,474,000	
日立電線	191,000	272	51,952,000	
沖電線	24,000	136	3,264,000	
カナレ電気	2,600	1,198	3,114,800	
平河ヒューテック	4,900	781	3,826,900	
リョービ	132,000	327	43,164,000	
アサヒホールディングス	33,300	1,664	55,411,200	
稲葉製作所	12,000	956	11,472,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
トーカロ	12,500	1,988	24,850,000	
アルファC o	7,900	914	7,220,600	
SUMCO	125,900	2,010	253,059,000	
川田テクノロジーズ	6,700	1,656	11,095,200	
東洋製罐	166,300	1,698	282,377,400	
ホッカンホールディングス	57,000	277	15,789,000	
コロナ	11,300	1,220	13,786,000	
横河ブリッジホールディングス	48,000	699	33,552,000	
駒井鉄工	45,000	224	10,080,000	
ハルテック	38,000	141	5,358,000	
高田機工	32,000	247	7,904,000	
三和ホールディングス	236,000	358	84,488,000	
文化シャッター	77,000	277	21,329,000	
東洋シャッター	12,700	529	6,718,300	
住生活グループ	288,400	1,844	531,809,600	
日本ファイルコン	17,300	530	9,169,000	
ノーリツ	39,700	1,482	58,835,400	
長府製作所	26,200	2,182	57,168,400	
リンナイ	37,800	4,745	179,361,000	
ダイニチ工業	13,100	710	9,301,000	
日東精工	31,000	320	9,920,000	
三洋工業	69,000	138	9,522,000	
岡部	62,100	356	22,107,600	
中国工業	33,000	109	3,597,000	
東プレ	45,400	808	36,683,200	
高周波熱錬	34,500	765	26,392,500	
東京製綱	157,000	251	39,407,000	
パイオラックス	10,100	2,056	20,765,600	
日本発條	153,000	888	135,864,000	
中央発條	31,000	370	11,470,000	
三益半導体工業	17,300	1,417	24,514,100	
アタカ大機	15,000	276	4,140,000	

日本製鋼所	337,000	1,027	346,099,000	
日立ツール	14,100	988	13,930,800	
三浦工業	32,100	2,344	75,242,400	
タクマ	86,000	235	20,210,000	
ツガミ	67,000	546	36,582,000	
オークマ	154,000	689	106,106,000	
東芝機械	118,000	418	49,324,000	
アマダ	360,000	775	279,000,000	
アイダエンジニアリング	56,900	387	22,020,300	
牧野フライス製作所	110,000	687	75,570,000	
オーエスジー	96,700	1,076	104,049,200	
ダイジェット工業	31,000	138	4,278,000	
旭ダイヤモンド工業	58,000	948	54,984,000	
森精機製作所	107,500	1,152	123,840,000	
ディスコ	21,400	6,540	139,956,000	
日東工器	14,000	2,076	29,064,000	
豊和工業	133,000	87	11,571,000	
大阪機工	79,000	143	11,297,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
東洋機械金属	18,700	296	5,535,200	
オーエム製作所	20,000	367	7,340,000	
津田駒工業	61,000	177	10,797,000	
島精機製作所	28,400	2,347	66,654,800	
日本スピンドル製造	35,000	167	5,845,000	
日阪製作所	26,000	1,014	26,364,000	
やまびこ	9,200	1,098	10,101,600	
ペガサスミシン製造	23,900	285	6,811,500	
ナブテスコ	89,000	1,187	105,643,000	
三井海洋開発	15,700	1,774	27,851,800	
レオン自動機	26,000	251	6,526,000	
SMC	70,200	12,680	890,136,000	
新川	18,200	1,587	28,883,400	
ホソカワミクロン	38,000	401	15,238,000	
ユニオンツール	14,800	2,783	41,188,400	
オイレス工業	26,100	1,525	39,802,500	
サトー	26,300	1,271	33,427,300	
日本エアーテック	7,900	521	4,115,900	
日精樹脂工業	19,100	331	6,322,100	
ワイエイシイ	10,100	951	9,605,100	
小松製作所	975,900	1,882	1,836,643,800	
住友重機械工業	465,000	587	272,955,000	
日立建機	96,100	2,137	205,365,700	
日工	32,000	246	7,872,000	
巴工業	8,900	1,400	12,460,000	
井関農機	225,000	307	69,075,000	
TOWA	24,400	805	19,642,000	
丸山製作所	53,000	201	10,653,000	
北川鉄工所	106,000	171	18,126,000	
クボタ	897,000	839	752,583,000	
荏原実業	5,100	1,304	6,650,400	
三菱化工機	66,000	255	16,830,000	
月島機械	38,000	697	26,486,000	
帝国電機製作所	8,200	1,856	15,219,200	
東京機械製作所	75,000	122	9,150,000	
新東工業	44,200	802	35,448,400	

澁谷工業	13,800	764	10,543,200	
アイチ コーポレーション	38,800	459	17,809,200	
小森コーポレーション	62,500	1,283	80,187,500	
鶴見製作所	18,000	663	11,934,000	
住友精密工業	35,000	303	10,605,000	
酒井重工業	42,000	172	7,224,000	
荏原製作所	443,000	466	206,438,000	
石井鐵工所	34,000	184	6,256,000	
西島製作所	21,200	1,951	41,361,200	
ダイキン工業	245,500	3,760	923,080,000	
オルガノ	40,000	699	27,960,000	
トーヨーカネツ	116,000	206	23,896,000	
栗田工業	120,500	2,719	327,639,500	
椿本チエイン	120,000	435	52,200,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
大同工業	46,000	166	7,636,000	
日本コンベヤ	72,000	95	6,840,000	
木村化工機	20,100	864	17,366,400	
アネスト岩田	44,000	324	14,256,000	
ダイフク	87,500	730	63,875,000	
加藤製作所	49,000	225	11,025,000	
油研工業	42,000	214	8,988,000	
タダノ	99,000	499	49,401,000	
フジテック	59,000	593	34,987,000	
シーケーディ	58,300	739	43,083,700	
キトー	71	113,900	8,086,900	
平和	42,500	926	39,355,000	
理想科学工業	20,300	1,174	23,832,200	
SANKYO	61,300	4,510	276,463,000	
日本金銭機械	22,700	875	19,862,500	
マースエンジニアリング	9,900	1,903	18,839,700	
福島工業	6,200	837	5,189,400	
キヤノンファインテック	19,200	1,659	31,852,800	
オーイズミ	11,000	223	2,453,000	
ダイコク電機	7,600	1,705	12,958,000	
アマノ	65,000	877	57,005,000	
サンデン	128,000	360	46,080,000	
マックス	39,000	1,070	41,730,000	
グローリー	63,400	2,379	150,828,600	
大和冷機工業	29,000	492	14,268,000	
セガサミーホールディングス	237,200	1,229	291,518,800	
日本ピストンリング	83,000	125	10,375,000	
リケン	89,000	369	32,841,000	
帝国ピストンリング	27,400	771	21,125,400	
ホシザキ電機	45,300	1,399	63,374,700	
大豊工業	15,900	924	14,691,600	
日本精工	423,000	724	306,252,000	
NTN	483,000	415	200,445,000	
ジェイテクト	201,900	1,111	224,310,900	
不二越	228,000	288	65,664,000	
日本トムソン	72,000	657	47,304,000	
THK	140,100	1,973	276,417,300	
ユーシン精機	10,300	1,596	16,438,800	
前澤給装工業	12,200	1,268	15,469,600	
イーグル工業	24,000	700	16,800,000	

前澤工業	15,000	214	3,210,000	
日本ピラー工業	25,000	660	16,500,000	
キット	101,000	542	54,742,000	
日立工機	60,800	1,018	61,894,400	
マキタ	136,800	2,980	407,664,000	
日立造船	944,500	133	125,618,500	
三菱重工業	3,532,000	386	1,363,352,000	
I H I	1,536,000	172	264,192,000	
イビデン	147,400	3,600	530,640,000	
コニカミノルタホールディングス	482,500	1,168	563,560,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ブラザー工業	290,500	1,163	337,851,500	
ミネベア	306,000	563	172,278,000	
日立製作所	4,788,000	405	1,939,140,000	
東芝	4,732,000	545	2,578,940,000	
三菱電機	1,948,000	837	1,630,476,000	
富士電機ホールディングス	573,000	290	166,170,000	
東洋電機製造	36,000	634	22,824,000	
安川電機	247,000	825	203,775,000	
シンフォニアテクノロジー	125,000	209	26,125,000	
明電舎	207,000	434	89,838,000	
オリジン電気	30,000	382	11,460,000	
デンヨー	21,200	750	15,900,000	
東芝テック	147,000	412	60,564,000	
芝浦メカトロニクス	33,000	414	13,662,000	
マブチモーター	30,600	5,330	163,098,000	
日本電産	101,300	9,850	997,805,000	
高岳製作所	89,000	369	32,841,000	
ダイヘン	113,000	443	50,059,000	
日新電機	38,000	499	18,962,000	
大崎電気工業	32,000	927	29,664,000	
オムロン	250,300	2,181	545,904,300	
日東工業	33,800	1,054	35,625,200	
I D E C	29,500	933	27,523,500	
エルピーダメモリ	219,500	2,071	454,584,500	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	404,000	666	269,064,000	
サクサホールディングス	58,000	180	10,440,000	
メルコホールディングス	10,900	2,545	27,740,500	
テクノメディカ	15	276,300	4,144,500	
日本電気	2,727,000	303	826,281,000	
富士通	2,167,000	671	1,454,057,000	
沖電気工業	718,000	95	68,210,000	
岩崎通信機	91,000	90	8,190,000	
電気興業	59,000	525	30,975,000	
サンケン電気	123,000	384	47,232,000	
ナカヨ通信機	23,000	209	4,807,000	
アイホン	15,600	1,630	25,428,000	
ルネサスエレクトロニクス	81,400	1,200	97,680,000	
セイコーエプソン	167,300	1,672	279,725,600	
ワコム	412	150,300	61,923,600	
アルバック	36,900	2,236	82,508,400	
ナナオ	17,500	2,327	40,722,500	
日本信号	52,300	817	42,729,100	
京三製作所	48,000	498	23,904,000	
能美防災	25,000	601	15,025,000	

ホーチキ	22,000	523	11,506,000	
マスプロ電工	15,800	934	14,757,200	
日本無線	78,000	223	17,394,000	
パナソニック	2,054,400	1,385	2,845,344,000	
シャープ	1,008,000	1,230	1,239,840,000	
アンリツ	107,000	466	49,862,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
富士通ゼネラル	59,000	419	24,721,000	
日立国際電気	52,000	1,018	52,936,000	
ソニー	1,121,700	3,295	3,696,001,500	
TDK	108,500	6,190	671,615,000	
帝国通信工業	50,000	240	12,000,000	
三洋電機	2,235,000	150	335,250,000	
ミツミ電機	67,200	2,114	142,060,800	
タムラ製作所	58,000	320	18,560,000	
アルプス電気	177,400	704	124,889,600	
池上通信機	68,000	88	5,984,000	
パイオニア	263,000	376	98,888,000	
日本電波工業	14,500	2,033	29,478,500	
日本トリム	3,300	1,926	6,355,800	
ローランド ディー．ジー．	8,800	1,458	12,830,400	
フォスター電機	18,500	2,619	48,451,500	
クラリオン	128,000	194	24,832,000	
SMK	66,000	504	33,264,000	
ヨコオ	17,600	638	11,228,800	
東光	95,000	175	16,625,000	
ティアック	141,000	53	7,473,000	
ホシデン	55,800	1,209	67,462,200	
ヒロセ電機	36,300	10,340	375,342,000	
日本航空電子工業	45,000	739	33,255,000	
TOA	27,000	547	14,769,000	
ユニデン	67,000	319	21,373,000	
アルパイン	45,800	1,361	62,333,800	
スミダコーポレーション	15,300	1,087	16,631,100	
アイコム	11,500	2,583	29,704,500	
船井電機	18,200	3,885	70,707,000	
横河電機	225,000	823	185,175,000	
新電元工業	72,000	326	23,472,000	
山武	57,700	2,370	136,749,000	
日本光電工業	38,300	1,824	69,859,200	
チノー	40,000	238	9,520,000	
共和電業	22,000	291	6,402,000	
日本電子材料	8,100	657	5,321,700	
堀場製作所	35,700	2,817	100,566,900	
アドバンテスト	153,200	2,476	379,323,200	
小野測器	27,000	365	9,855,000	
エスベック	21,600	784	16,934,400	
サンクス	19,600	487	9,545,200	
キーエンス	42,400	22,600	958,240,000	
日置電機	10,800	1,907	20,595,600	
シスメックス	39,400	5,760	226,944,000	
メガチップス	17,000	1,424	24,208,000	
OBARA	16,600	1,139	18,907,400	
日本電産コパル電子	23,200	700	16,240,000	
ミヤチテクノス	11,900	819	9,746,100	

東京電波	6,600	720	4,752,000	
澤藤電機	12,000	158	1,896,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
コーセル	29,900	1,340	40,066,000	
日立メディコ	14,000	816	11,424,000	
新日本無線	14,000	315	4,410,000	
オプテックス	15,400	1,185	18,249,000	
千代田インテグレ	11,800	1,560	18,408,000	
東光電気	14,000	655	9,170,000	
スタンレー電気	139,900	1,832	256,296,800	
岩崎電気	76,000	215	16,340,000	
ウシオ電機	126,700	1,614	204,493,800	
岡谷電機産業	12,200	334	4,074,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	17,900	301	5,387,900	
日本セラミック	14,700	1,169	17,184,300	
新神戸電機	18,000	1,040	18,720,000	
日本デジタル研究所	19,900	1,178	23,442,200	
古河電池	14,000	751	10,514,000	
双信電機	10,900	444	4,839,600	
山一電機	18,600	392	7,291,200	
図研	15,800	744	11,755,200	
日本電子	83,000	356	29,548,000	
カシオ計算機	233,700	741	173,171,700	
ファナック	217,300	10,470	2,275,131,000	
日本シイエムケイ	44,000	683	30,052,000	
エンプラス	11,700	1,739	20,346,300	
ローム	104,600	7,000	732,200,000	
浜松ホトニクス	81,800	2,709	221,596,200	
三井ハイテック	29,600	835	24,716,000	
新光電気工業	56,600	1,605	90,843,000	
京セラ	173,600	9,490	1,647,464,000	
日本インター	24,200	236	5,711,200	
太陽誘電	84,000	1,470	123,480,000	
村田製作所	235,800	5,390	1,270,962,000	
ユーシン	24,700	930	22,971,000	
双葉電子工業	38,800	1,972	76,513,600	
北陸電気工業	84,000	192	16,128,000	
パナソニック電工	367,000	1,213	445,171,000	
ニチコン	70,800	1,292	91,473,600	
日本ケミコン	108,000	390	42,120,000	
KOA	28,300	1,057	29,913,100	
市光工業	54,000	164	8,856,000	
小糸製作所	101,000	1,479	149,379,000	
ミツバ	38,000	625	23,750,000	
アロカ	11,900	780	9,282,000	
スター精密	43,400	1,158	50,257,200	
大日本スクリーン製造	230,000	529	121,670,000	
キャノン電子	20,300	2,426	49,247,800	
キャノン	1,303,200	4,395	5,727,564,000	
リコー	624,000	1,647	1,027,728,000	
日本電産サンキョー	53,000	903	47,859,000	
MUTOHホールディングス	36,000	155	5,580,000	
東京エレクトロン	176,500	6,450	1,138,425,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
トヨタ紡織	65,500	1,636	107,158,000	
鬼怒川ゴム工業	47,000	405	19,035,000	
ユニプレス	31,400	1,318	41,385,200	
豊田自動織機	181,900	2,709	492,767,100	
モリタホールディングス	33,000	460	15,180,000	
三櫻工業	26,000	747	19,422,000	
デンソー	493,600	2,679	1,322,354,400	
東海理化電機製作所	52,600	1,918	100,886,800	
三井造船	870,000	245	213,150,000	
佐世保重工業	147,000	202	29,694,000	
川崎重工業	1,631,000	290	472,990,000	
日本車輛製造	82,000	573	46,986,000	
日本輸送機	26,000	221	5,746,000	
近畿車輛	34,000	640	21,760,000	
日産自動車	2,524,100	815	2,057,141,500	
いすゞ自動車	1,421,000	296	420,616,000	
トヨタ自動車	2,887,700	3,690	10,655,613,000	代用有価証券で 500,000株 担保差入
日野自動車	281,000	439	123,359,000	
三菱自動車工業	4,638,000	132	612,216,000	
エフテック	7,800	1,586	12,370,800	
武蔵精密工業	21,800	2,184	47,611,200	
トヨタ車体	40,900	1,569	64,172,100	
日産車体	88,000	723	63,624,000	
関東自動車工業	34,200	744	25,444,800	
新明和工業	92,000	400	36,800,000	
極東開発工業	38,800	361	14,006,800	
日信工業	36,600	1,538	56,290,800	
トピー工業	185,000	223	41,255,000	
ティラド	68,000	261	17,748,000	
曙ブレーキ工業	85,600	489	41,858,400	
タチエス	29,400	1,098	32,281,200	
NOK	108,800	1,613	175,494,400	
フタバ産業	68,600	759	52,067,400	
カヤバ工業	140,000	361	50,540,000	
シロキ工業	44,000	251	11,044,000	
大同メタル工業	32,000	351	11,232,000	
プレス工業	104,000	281	29,224,000	
カルソニックカンセイ	153,000	299	45,747,000	
太平洋工業	46,000	519	23,874,000	
ケーヒン	41,400	1,873	77,542,200	
河西工業	28,000	382	10,696,000	
アイシン精機	185,100	2,738	506,803,800	
富士機工	26,000	307	7,982,000	
マツダ	1,367,000	277	378,659,000	
ダイハツ工業	209,000	907	189,563,000	
愛知機械工業	51,000	399	20,349,000	
今仙電機製作所	16,400	1,591	26,092,400	
本田技研工業	1,792,800	3,310	5,934,168,000	
スズキ	416,600	2,014	839,032,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
富士重工業	710,000	507	359,970,000	
ヤマハ発動機	309,300	1,345	416,008,500	

ショーワ	47,900	694	33,242,600	
TBK	23,000	327	7,521,000	
エクセディ	27,200	2,297	62,478,400	
豊田合成	63,500	2,607	165,544,500	
愛三工業	23,400	856	20,030,400	
ヨロズ	13,600	1,470	19,992,000	
エフ・シー・シー	29,400	1,770	52,038,000	
シマノ	86,100	4,010	345,261,000	
タカタ	34,600	2,361	81,690,600	
テイ・エス テック	42,800	1,760	75,328,000	
日本電産トーソク	6,800	1,417	9,635,600	
テルモ	161,900	4,950	801,405,000	
クリエートメディック	6,700	910	6,097,000	
日機装	67,000	673	45,091,000	
島津製作所	248,000	777	192,696,000	
JMS	34,000	385	13,090,000	
クボテック	48	26,690	1,281,120	
モリテックス	4,900	287	1,406,300	
長野計器	13,400	679	9,098,600	
東京計器	77,000	164	12,628,000	
愛知時計電機	43,000	306	13,158,000	
東京精密	43,200	1,629	70,372,800	
ニコン	391,700	2,120	830,404,000	
トプコン	45,300	516	23,374,800	
オリンパス	246,100	2,872	706,799,200	
理研計器	18,200	650	11,830,000	
タムロン	19,700	1,633	32,170,100	
HOYA	485,800	2,590	1,258,222,000	
ノーリツ銅機	20,200	772	15,594,400	
エー・アンド・デイ	17,100	407	6,959,700	
日本電産コパル	22,000	1,557	34,254,000	
シチズンホールディングス	244,500	674	164,793,000	
リズム時計工業	109,000	159	17,331,000	
セイコーホールディングス	81,000	226	18,306,000	
ニプロ	44,600	1,798	80,190,800	
SRIスポーツ	130	97,500	12,675,000	
バンダイナムコホールディングス	244,300	975	238,192,500	
共立印刷	24,200	177	4,283,400	
フランスベッドホールディングス	156,000	142	22,152,000	
パイロットコーポレーション	196	137,600	26,969,600	
トッパン・フォームズ	40,700	1,037	42,205,900	
フジシールインターナショナル	21,000	1,956	41,076,000	
タカラトミー	68,200	715	48,763,000	
廣済堂	20,600	199	4,099,400	
タカノ	8,800	618	5,438,400	
プロネクス	25,800	573	14,783,400	
ウッドワン	63,000	306	19,278,000	
大建工業	114,000	258	29,412,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
凸版印刷	635,000	880	558,800,000	
大日本印刷	636,000	1,339	851,604,000	
図書印刷	40,000	186	7,440,000	
共同印刷	71,000	279	19,809,000	
日本写真印刷	34,600	3,375	116,775,000	
光村印刷	23,000	323	7,429,000	

宝印刷	9,800	781	7,653,800	
コンビ	13,500	740	9,990,000	
アシックス	195,000	919	179,205,000	
ツツミ	10,200	2,170	22,134,000	
ローランド	16,700	1,344	22,444,800	
小松ウオール工業	8,300	1,000	8,300,000	
ヤマハ	151,400	1,191	180,317,400	
河合楽器製作所	87,000	188	16,356,000	
クリナップ	31,300	756	23,662,800	
ピジョン	12,700	3,535	44,894,500	
パラマウントベッド	22,500	1,792	40,320,000	
キングジム	19,500	738	14,391,000	
リンテック	48,100	1,815	87,301,500	
イトーキ	50,500	296	14,948,000	
任天堂	118,600	31,600	3,747,760,000	
三菱鉛筆	19,000	1,442	27,398,000	
タカラスタンダード	114,000	627	71,478,000	
コクヨ	116,800	913	106,638,400	
ナカバヤシ	47,000	200	9,400,000	
グローブライド	118,000	118	13,924,000	
岡村製作所	88,000	566	49,808,000	
美津濃	113,000	429	48,477,000	
アデランスホールディングス	26,300	1,167	30,692,100	
東京電力	1,321,900	2,413	3,189,744,700	代用有価証券で 300,000株 担保差入
中部電力	706,800	2,233	1,578,284,400	
関西電力	858,600	2,110	1,811,646,000	
中国電力	310,800	1,813	563,480,400	
北陸電力	215,300	1,973	424,786,900	
東北電力	526,500	1,925	1,013,512,500	
四国電力	232,600	2,555	594,293,000	
九州電力	463,300	1,940	898,802,000	
北海道電力	195,300	1,805	352,516,500	
沖縄電力	14,700	5,210	76,587,000	
電源開発	139,500	2,903	404,968,500	
東京瓦斯	2,642,000	393	1,038,306,000	
大阪瓦斯	2,260,000	334	754,840,000	
東邦瓦斯	586,000	475	278,350,000	
北海道瓦斯	40,000	252	10,080,000	
西部瓦斯	254,000	262	66,548,000	
静岡瓦斯	64,000	543	34,752,000	
東武鉄道	899,000	511	459,389,000	
相鉄ホールディングス	338,000	391	132,158,000	
東京急行電鉄	1,146,000	401	459,546,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
京浜急行電鉄	577,000	786	453,522,000	
小田急電鉄	669,000	796	532,524,000	
京王電鉄	583,000	621	362,043,000	
京成電鉄	313,000	578	180,914,000	
富士急行	61,000	445	27,145,000	
新京成電鉄	29,000	370	10,730,000	
東日本旅客鉄道	390,800	6,680	2,610,544,000	
西日本旅客鉄道	1,815	345,000	626,175,000	
東海旅客鉄道	1,801	754,000	1,357,954,000	
アートコーポレーション	5,300	1,499	7,944,700	

西日本鉄道	294,000	361	106,134,000	
ハマキョウレックス	6,400	2,548	16,307,200	
サカイ引越センター	4,100	1,983	8,130,300	
近畿日本鉄道	1,911,000	303	579,033,000	
阪急阪神ホールディングス	1,420,000	448	636,160,000	
南海電気鉄道	441,000	367	161,847,000	
京阪電気鉄道	474,000	387	183,438,000	
名糖運輸	8,400	803	6,745,200	
名古屋鉄道	738,000	267	197,046,000	
日本通運	890,000	434	386,260,000	
ヤマトホールディングス	424,700	1,365	579,715,500	
山九	250,000	432	108,000,000	
丸運	12,100	243	2,940,300	
丸全昭和運輸	69,000	349	24,081,000	
センコー	70,000	359	25,130,000	
トナミホールディングス	52,000	214	11,128,000	
日本梱包運輸倉庫	62,000	1,111	68,882,000	
日本石油輸送	26,000	209	5,434,000	
福山通運	156,000	483	75,348,000	
セイノーホールディングス	159,000	683	108,597,000	
神奈川中央交通	26,000	500	13,000,000	
日立物流	39,000	1,304	50,856,000	
日本郵船	1,543,000	383	590,969,000	
商船三井	1,010,000	709	716,090,000	
川崎汽船	627,000	399	250,173,000	
新和海運	79,000	296	23,384,000	
乾汽船	24,600	696	17,121,600	
明治海運	20,100	483	9,708,300	
飯野海運	100,800	581	58,564,800	
共栄タンカー	16,000	229	3,664,000	
第一中央汽船	147,000	305	44,835,000	
全日本空輸	2,996,000	296	886,816,000	
パスコ	30,000	190	5,700,000	
国際航業ホールディングス	29,000	237	6,873,000	
日新	85,000	216	18,360,000	
三菱倉庫	160,000	1,185	189,600,000	
三井倉庫	78,000	359	28,002,000	
住友倉庫	150,000	432	64,800,000	
澁澤倉庫	58,000	350	20,300,000	
東陽倉庫	36,000	202	7,272,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日本トランスシティ	47,000	306	14,382,000	
ケイヒン	41,000	115	4,715,000	
安田倉庫	17,400	588	10,231,200	
東洋埠頭	65,000	165	10,725,000	
宇徳	14,200	288	4,089,600	
上組	249,000	772	192,228,000	
サンリツ	5,900	615	3,628,500	
キムラユニティー	5,100	777	3,962,700	
キューソー流通システム	6,200	888	5,505,600	
郵船航空サービス	17,700	1,387	24,549,900	
近鉄エクスプレス	17,600	2,207	38,843,200	
東海運	14,100	220	3,102,000	
バンテック	103	124,500	12,823,500	
シスプロカテナ	164	70,100	11,496,400	

新日鉄ソリューションズ	19,100	1,933	36,920,300	
コア	9,400	738	6,937,200	
I Tホールディングス	67,100	1,365	91,591,500	
ユーエーテックモホールディングス	44,800	757	33,913,600	
ドワンゴ	125	177,600	22,200,000	
ベリサーブ	16	209,500	3,352,000	
マクロミル	109	149,000	16,241,000	
ティーガイア	181	153,500	27,783,500	
GMOペイメントゲートウェイ	53	174,300	9,237,900	
ザッパラス	72	164,000	11,808,000	
インターネットイニシアティブ	130	243,900	31,707,000	
ソネットエンタテインメント	108	253,400	27,367,200	
S R Aホールディングス	11,700	912	10,670,400	
J B I Sホールディングス	25,400	316	8,026,400	
朝日ネット	16,000	288	4,608,000	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	4,800	2,500	12,000,000	
フェイス	765	11,490	8,789,850	
野村総合研究所	125,600	2,365	297,044,000	
サイバネットシステム	202	39,900	8,059,800	
インテージ	6,900	1,681	11,598,900	
シンプレクス・テクノロジー	308	54,800	16,878,400	
クレスコ	7,000	484	3,388,000	
フジ・メディア・ホールディングス	2,310	156,700	361,977,000	
オービック	6,950	18,690	129,895,500	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	5,700	768	4,377,600	
ヤフー	12,168	36,950	449,607,600	
トレンドマイクロ	88,100	3,360	296,016,000	
日本オラクル	35,500	4,675	165,962,500	
アルファシステムズ	6,600	1,930	12,738,000	
フューチャーアーキテクト	255	37,400	9,537,000	
シーエーシー	14,800	755	11,174,000	
ソフトバンク・テクノロジー	5,300	874	4,632,200	
トーセ	6,400	670	4,288,000	
オービックビジネスコンサルタント	5,850	4,840	28,314,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日立ビジネスソリューション	8,100	654	5,297,400	
伊藤忠テクノソリューションズ	31,500	3,495	110,092,500	
アイティフォー	27,200	337	9,166,400	
東計電算	4,500	1,214	5,463,000	
エクスネット	22	137,000	3,014,000	
大塚商会	17,700	7,050	124,785,000	
サイボウズ	319	41,100	13,110,900	
アグレックス	5,300	779	4,128,700	
電通国際情報サービス	15,200	667	10,138,400	
ウェザーニューズ	5,500	1,357	7,463,500	
C I J	23,600	310	7,316,000	
ネットワンシステムズ	425	142,700	60,647,500	
アルゴグラフィックス	8,200	1,108	9,085,600	
エイベックス・グループ・ホールディングス	33,700	847	28,543,900	
日本ユニシス	55,100	727	40,057,700	
兼松エレクトロニクス	12,200	859	10,479,800	
東京放送ホールディングス	119,600	1,673	200,090,800	
日本テレビ放送網	19,470	14,480	281,925,600	

テレビ朝日	562	162,000	91,044,000	
テレビ東京	8,700	2,000	17,400,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,687	39,100	65,961,700	
アイ・ティー・シーネットワーク	18,600	513	9,541,800	
イー・アクセス	1,113	75,500	84,031,500	
NECモバイルリング	7,200	2,405	17,316,000	
日本電信電話	874,100	3,930	3,435,213,000	
KDDI	3,443	467,000	1,607,881,000	
光通信	29,200	1,917	55,976,400	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	18,404	149,100	2,744,036,400	
GMOインターネット	63,200	393	24,837,600	
学研ホールディングス	97,000	209	20,273,000	
ゼンリン	29,500	1,315	38,792,500	
昭文社	12,300	690	8,487,000	
角川グループホールディングス	19,100	2,158	41,217,800	
インプレスホールディングス	18,700	220	4,114,000	
アイネット	12,100	483	5,844,300	
松竹	124,000	820	101,680,000	
東宝	167,900	1,662	279,049,800	
東映	85,000	499	42,415,000	
葵プロモーション	9,500	527	5,006,500	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,370	348,500	477,445,000	
D T S	22,100	1,143	25,260,300	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	56,400	2,026	114,266,400	
シーイーシー	13,500	509	6,871,500	
カプコン	47,300	1,898	89,775,400	
ジャステック	14,400	539	7,761,600	
住商情報システム	23,500	1,584	37,224,000	
日本システムウエア	10,600	403	4,271,800	
アイネス	28,200	767	21,629,400	
T K C	21,100	1,694	35,743,400	
富士ソフト	28,100	1,716	48,219,600	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日本システムディベロップメント	47,300	1,173	55,482,900	
コナミ	90,100	1,867	168,216,700	
福井コンピュータ	7,000	364	2,548,000	
J B C Cホールディングス	18,500	598	11,063,000	
ソフトバンク	906,600	2,189	1,984,547,400	
ハウスイ	19,000	130	2,470,000	
インターニックス	8,300	388	3,220,400	
高千穂交易	8,500	949	8,066,500	
伊藤忠食品	5,500	3,020	16,610,000	
エレマテック	14,800	1,204	17,819,200	
J A L U X	7,300	700	5,110,000	
トーメンデバイス	2,800	1,895	5,306,000	
双日	1,484,800	176	261,324,800	
アルフレッサ ホールディングス	54,100	4,755	257,245,500	
横浜冷凍	48,000	689	33,072,000	
神栄	29,000	179	5,191,000	
山下医科器械	1,600	1,351	2,161,600	
ラサ商事	12,700	351	4,457,700	
あい ホールディングス	54,700	338	18,488,600	
ダイワボウホールディングス	169,000	249	42,081,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	29,100	585	17,023,500	
U K Cホールディングス	12,100	1,482	17,932,200	

日本コークス工業	198,500	189	37,516,500	
ミタチ産業	4,700	519	2,439,300	
J F E商事ホールディングス	155,000	449	69,595,000	
シップヘルスケアホールディングス	259	61,300	15,876,700	
協栄産業	25,000	217	5,425,000	
小野建	18,500	885	16,372,500	
佐島電機	15,000	916	13,740,000	
エコートレーディング	5,100	1,032	5,263,200	
伯東	13,500	984	13,284,000	
中山福	13,900	593	8,242,700	
ナガイレーベン	13,700	2,114	28,961,800	
菱食	21,500	2,267	48,740,500	
松田産業	15,000	1,714	25,710,000	
メディパルホールディングス	221,900	1,188	263,617,200	
アドヴァン	22,100	680	15,028,000	
S P K	4,900	1,356	6,644,400	
アズワン	13,400	1,655	22,177,000	
スズデン	8,200	555	4,551,000	
尾家産業	7,300	859	6,270,700	
シモジマ	15,200	1,307	19,866,400	
ドウシシャ	11,100	2,422	26,884,200	
高速	13,200	707	9,332,400	
黒田電気	29,600	1,458	43,156,800	
丸文	17,600	680	11,968,000	
ハピネット	6,400	1,209	7,737,600	
トーメンエレクトロニクス	6,800	1,334	9,071,200	
エクセル	9,500	1,327	12,606,500	
マルカキカイ	8,000	723	5,784,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ガリバーインターナショナル	5,250	3,430	18,007,500	
日本エム・ディ・エム	18,500	288	5,328,000	
進和	12,600	1,105	13,923,000	
エスケイジャパン	6,600	309	2,039,400	
ダイトエレクトロン	9,300	592	5,505,600	
シークス	14,100	1,196	16,863,600	
田中商事	20,400	393	8,017,200	
オーハシテクニカ	13,000	638	8,294,000	
マクニカ	8,800	2,104	18,515,200	
白銅	7,800	887	6,918,600	
伊藤忠商事	1,438,000	852	1,225,176,000	
丸紅	1,698,000	574	974,652,000	
高島	77,000	164	12,628,000	
F & Aアクアホールディングス	18,400	1,009	18,565,600	
長瀬産業	117,000	1,197	140,049,000	
蝶理	158,000	119	18,802,000	
豊田通商	197,700	1,459	288,444,300	
三共生興	40,500	284	11,502,000	
ツカモトコーポレーション	48,000	95	4,560,000	
三井物産	1,787,200	1,504	2,687,948,800	
日本紙パルプ商事	118,000	359	42,362,000	
日立ハイテクノロジーズ	67,300	2,181	146,781,300	
カメイ	29,000	471	13,659,000	
東都水産	38,000	170	6,460,000	
スターゼン	74,000	247	18,278,000	
山善	90,200	405	36,531,000	

椿本興業	25,000	219	5,475,000	
住友商事	1,134,700	1,155	1,310,578,500	
内田洋行	49,000	304	14,896,000	
三菱商事	1,657,600	2,310	3,829,056,000	
第一実業	53,000	277	14,681,000	
キヤノンマーケティングジャパン	73,800	1,500	110,700,000	
西華産業	83,000	212	17,596,000	
佐藤商事	20,700	602	12,461,400	
菱洋エレクトロ	24,600	992	24,403,200	
東京産業	20,000	284	5,680,000	
神鋼商事	63,000	226	14,238,000	
阪和興業	227,000	403	91,481,000	
カナデン	24,000	535	12,840,000	
菱電商事	35,000	571	19,985,000	
フルサト工業	13,000	661	8,593,000	
岩谷産業	237,000	281	66,597,000	
すてきナイスグループ	117,000	208	24,336,000	
昭光通商	89,000	144	12,816,000	
ニチモウ	39,000	165	6,435,000	
極東貿易	34,000	168	5,712,000	
イワキ	24,000	255	6,120,000	
三愛石油	56,000	429	24,024,000	
稲畑産業	58,800	500	29,400,000	
G S I クレオス	63,000	138	8,694,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
明和産業	23,500	228	5,358,000	
東邦ホールディングス	57,300	1,505	86,236,500	
サンゲツ	38,300	2,131	81,617,300	
ミツウロコ	37,900	691	26,188,900	
シナネン	56,000	420	23,520,000	
伊藤忠エネクス	48,900	486	23,765,400	
ザ・トーカイ	53,000	511	27,083,000	
サンリオ	62,400	993	61,963,200	
サンワテクノス	10,800	525	5,670,000	
リョーサン	33,700	2,592	87,350,400	
新光商事	20,800	1,004	20,883,200	
トーヨー	43,000	339	14,577,000	
三信電気	23,200	909	21,088,800	
東陽テクニカ	34,200	1,029	35,191,800	
モスフードサービス	29,200	1,530	44,676,000	
加賀電子	22,000	1,038	22,836,000	
ソーダニッカ	25,000	362	9,050,000	
立花エレテック	14,300	783	11,196,900	
ヤマタネ	104,000	159	16,536,000	
丸紅建材リース	27,000	124	3,348,000	
トラスコ中山	26,700	1,606	42,880,200	
オートバックスセブン	26,100	3,400	88,740,000	
加藤産業	32,100	1,517	48,695,700	
イエローハット	21,300	666	14,185,800	
富士エレクトロニクス	12,500	1,198	14,975,000	
J Kホールディングス	31,500	355	11,182,500	
ユニダックス	12,500	503	6,287,500	
日伝	9,200	2,726	25,079,200	
北沢産業	42,500	203	8,627,500	
杉本商事	11,900	930	11,067,000	

因幡電機産業	22,900	2,382	54,547,800	
住金物産	111,000	244	27,084,000	
ミスミグループ本社	74,600	1,884	140,546,400	
江守商事	5,200	790	4,108,000	
アルテック	10,800	342	3,693,600	
タキヒヨー	38,000	494	18,772,000	
スズケン	78,700	3,700	291,190,000	
ジェコス	27,600	385	10,626,000	
ローソン	62,600	4,180	261,668,000	
サンエー	7,600	3,920	29,792,000	
麒麟堂	9,000	430	3,870,000	
ダイユーエイト	3,300	576	1,900,800	
カワチ薬品	13,800	1,855	25,599,000	
エービーシー・マート	23,400	3,340	78,156,000	
ハードオフコーポレーション	9,200	429	3,946,800	
アスクル	16,100	1,990	32,039,000	
ゲオ	370	101,900	37,703,000	
ポイント	19,950	6,090	121,495,500	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	15,000	137	2,055,000	
くらコーポレーション	58	336,500	19,517,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
キャンドゥ	102	97,400	9,934,800	
パル	5,800	3,055	17,719,000	
エディオン	88,700	915	81,160,500	
サーラコーポレーション	21,500	563	12,104,500	
バルス	95	98,400	9,348,000	
あみやき亭	39	263,800	10,288,200	
ハニーズ	16,120	934	15,056,080	
アルペン	17,100	1,666	28,488,600	
ビックカメラ	554	34,050	18,863,700	
DCM Japanホールディングス	111,700	647	72,269,900	
MonotaRO	1,500	1,792	2,688,000	
ユニバース	3,000	1,330	3,990,000	
J. フロント リテイリング	524,000	563	295,012,000	
ドトール・日レスホールディングス	35,500	1,388	49,274,000	
マツモトキヨシホールディングス	37,400	2,128	79,587,200	
ココカラファイン ホールディングス	16,800	1,848	31,046,400	
三越伊勢丹ホールディングス	385,500	1,109	427,519,500	
クリエイトSDホールディングス	7,900	1,882	14,867,800	
CHIグループ	11,500	393	4,519,500	
ブックオフコーポレーション	9,800	922	9,035,600	
あさひ	9,300	1,425	13,252,500	
サークルKサンクス	42,200	1,325	55,915,000	
日本調剤	3,230	2,852	9,211,960	
コスモス薬品	8,600	1,987	17,088,200	
セブン&アイ・ホールディングス	885,700	2,445	2,165,536,500	
ツルハホールディングス	16,600	3,415	56,689,000	
サンマルクホールディングス	6,400	3,635	23,264,000	
フェリシモ	5,800	1,358	7,876,400	
トリドール	56	188,000	10,528,000	
総合メディカル	4,900	2,603	12,754,700	
はるやま商事	10,800	448	4,838,400	
カップ・クリエイト	14,800	1,938	28,682,400	
ライトオン	16,900	756	12,776,400	
ジーンズメイト	7,400	400	2,960,000	

良品計画	23,500	4,365	102,577,500	
三城ホールディングス	27,700	941	26,065,700	
コナカ	26,800	371	9,942,800	
ハウス オブ ローゼ	2,300	1,279	2,941,700	
G-7ホールディングス	6,800	624	4,243,200	
イオン北海道	14,400	276	3,974,400	
コジマ	30,200	794	23,978,800	
コーナン商事	19,700	1,228	24,191,600	
エコス	7,700	591	4,550,700	
ワタミ	23,400	1,686	39,452,400	
マルシェ	5,600	721	4,037,600	
ドン・キホーテ	35,200	2,609	91,836,800	
メガネトップ	19,400	828	16,063,200	
西松屋チェーン	48,800	1,043	50,898,400	
ゼンショー	84,300	718	60,527,400	
幸楽苑	12,700	1,249	15,862,300	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価 (円)	金額 (円)	
ユニマットライフ	9,400	1,347	12,661,800	
ハークスレイ	5,600	644	3,606,400	
サイゼリヤ	33,000	1,855	61,215,000	
ポプラ	6,600	581	3,834,600	
ユナイテッドアローズ	24,100	1,110	26,751,000	
ハイデイ日高	9,200	1,119	10,294,800	
京都きもの友禅	13,200	876	11,563,200	
コロワイド	51,000	460	23,460,000	
壱番屋	7,900	2,330	18,407,000	
トップカルチャー	7,500	380	2,850,000	
スギホールディングス	31,000	2,153	66,743,000	
スクロール	22,600	435	9,831,000	
ファミリーマート	68,200	3,275	223,355,000	
木曽路	23,600	1,914	45,170,400	
千趣会	40,400	535	21,614,000	
タカキュー	18,000	169	3,042,000	
ケーヨー	42,000	476	19,992,000	
上新電機	49,000	916	44,884,000	
日本瓦斯	23,800	1,332	31,701,600	
マルエツ	45,000	399	17,955,000	
ロイヤルホールディングス	34,400	938	32,267,200	
東天紅	17,000	158	2,686,000	
いなげや	25,000	964	24,100,000	
島忠	50,200	1,961	98,442,200	
チヨダ	29,300	1,208	35,394,400	
鈴丹	5,900	212	1,250,800	
ライフコーポレーション	14,300	1,605	22,951,500	
カスミ	45,700	489	22,347,300	
リンガーハット	15,500	1,052	16,306,000	
さが美	18,000	137	2,466,000	
MrMax	22,700	420	9,534,000	
テンアライド	15,500	312	4,836,000	
AOKIホールディングス	20,800	1,371	28,516,800	
オークワ	29,000	1,086	31,494,000	
コメリ	26,700	2,561	68,378,700	
青山商事	51,700	1,571	81,220,700	
しまむら	23,200	9,260	214,832,000	
CFSコーポレーション	18,500	574	10,619,000	

高島屋	277,000	905	250,685,000	
松屋	41,100	1,020	41,922,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	116,000	664	77,024,000	
丸栄	33,000	143	4,719,000	
ニッセンホールディングス	44,900	394	17,690,600	
パルコ	57,700	849	48,987,300	
丸井グループ	244,600	781	191,032,600	
原信ナルスホールディングス	12,500	1,099	13,737,500	
ダイエー	94,500	437	41,296,500	
イズミヤ	72,000	507	36,504,000	
イオン	726,200	1,113	808,260,600	
ユニー	166,300	876	145,678,800	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
イズミ	60,100	1,368	82,216,800	
東武ストア	30,000	275	8,250,000	
平和堂	41,000	1,267	51,947,000	
フジ	26,900	1,704	45,837,600	
ヤオコー	9,800	2,718	26,636,400	
ゼビオ	23,500	2,025	47,587,500	
ケーズホールディングス	42,500	2,426	103,105,000	
O l y m p i c	14,900	660	9,834,000	
東日カーライフグループ	33,000	117	3,861,000	
元気寿司	6,400	1,167	7,468,800	
ヤマダ電機	101,180	6,630	670,823,400	
アークランドサカモト	13,200	1,182	15,602,400	
ニトリ	39,950	7,400	295,630,000	
グルメ杵屋	15,000	516	7,740,000	
愛眼	16,700	491	8,199,700	
吉野家ホールディングス	603	98,600	59,455,800	
松屋フーズ	10,800	1,367	14,763,600	
サガミチェーン	25,000	583	14,575,000	
プレナス	25,000	1,286	32,150,000	
ミニストップ	16,500	1,378	22,737,000	
イマージュホールディングス	7,900	306	2,417,400	
アークス	26,400	1,301	34,346,400	
バロー	40,600	802	32,561,200	
ベルク	8,900	901	8,018,900	
大庄	13,500	1,152	15,552,000	
ファーストリテイリング	44,400	14,480	642,912,000	
サンドラッグ	42,200	2,218	93,599,600	
ヤマザワ	5,900	1,275	7,522,500	
やまや	4,300	840	3,612,000	
ベルーナ	28,250	549	15,509,250	
新生銀行	1,007,000	128	128,896,000	
あおぞら銀行	691,000	141	97,431,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	15,799,000	510	8,057,490,000	
りそなホールディングス	593,600	1,202	713,507,200	
中央三井トラスト・ホールディングス	1,171,000	372	435,612,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,579,000	3,285	5,187,015,000	
第四銀行	289,000	335	96,815,000	
北越銀行	231,000	155	35,805,000	
西日本シティ銀行	723,000	275	198,825,000	
札幌北洋ホールディングス	306,600	448	137,356,800	
千葉銀行	812,000	612	496,944,000	
横浜銀行	1,425,000	502	715,350,000	

常陽銀行	803,000	403	323,609,000	
群馬銀行	518,000	529	274,022,000	
武蔵野銀行	33,700	2,824	95,168,800	
千葉興業銀行	42,500	690	29,325,000	
筑波銀行	67,500	298	20,115,000	
東京都民銀行	39,100	1,248	48,796,800	
七十七銀行	348,000	554	192,792,000	
青森銀行	156,000	220	34,320,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
秋田銀行	152,000	377	57,304,000	
山形銀行	127,000	416	52,832,000	
岩手銀行	14,900	5,330	79,417,000	
東邦銀行	189,000	305	57,645,000	
東北銀行	113,000	144	16,272,000	
みちのく銀行	112,000	191	21,392,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	840,000	418	351,120,000	
静岡銀行	644,000	807	519,708,000	
十六銀行	271,000	369	99,999,000	
スルガ銀行	216,000	937	202,392,000	
八十二銀行	419,000	550	230,450,000	
山梨中央銀行	140,000	414	57,960,000	
大垣共立銀行	296,000	311	92,056,000	
福井銀行	190,000	296	56,240,000	
北國銀行	237,000	341	80,817,000	
清水銀行	7,500	3,575	26,812,500	
滋賀銀行	207,000	584	120,888,000	
南都銀行	208,000	516	107,328,000	
百五銀行	204,000	445	90,780,000	
京都銀行	371,000	848	314,608,000	
三重銀行	92,000	267	24,564,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,457,000	192	279,744,000	
広島銀行	611,000	393	240,123,000	
山陰合同銀行	134,000	760	101,840,000	
中国銀行	182,000	1,250	227,500,000	
鳥取銀行	71,000	253	17,963,000	
伊予銀行	253,000	896	226,688,000	
百十四銀行	242,000	392	94,864,000	
四国銀行	162,000	300	48,600,000	
阿波銀行	184,000	534	98,256,000	
鹿児島銀行	144,000	640	92,160,000	
大分銀行	144,000	338	48,672,000	
宮崎銀行	120,000	281	33,720,000	
肥後銀行	176,000	525	92,400,000	
佐賀銀行	128,000	277	35,456,000	
十八銀行	141,000	273	38,493,000	
沖縄銀行	17,100	3,930	67,203,000	
琉球銀行	43,900	1,048	46,007,200	
住友信託銀行	1,871,000	585	1,094,535,000	
みずほ信託銀行	1,754,000	96	168,384,000	
八千代銀行	11,700	2,074	24,265,800	
みずほフィナンシャルグループ	18,219,700	185	3,370,644,500	
紀陽ホールディングス	828,000	127	105,156,000	
山口フィナンシャルグループ	207,000	982	203,274,000	
長野銀行	77,000	192	14,784,000	
名古屋銀行	200,000	373	74,600,000	

愛知銀行	8,100	7,130	57,753,000	
第三銀行	136,000	264	35,904,000	
中京銀行	91,000	271	24,661,000	
東日本銀行	116,000	182	21,112,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
愛媛銀行	139,000	270	37,530,000	
トマト銀行	86,000	189	16,254,000	
みなと銀行	229,000	128	29,312,000	
京葉銀行	183,000	450	82,350,000	
関西アーバン銀行	227,000	151	34,277,000	
栃木銀行	111,000	409	45,399,000	
北日本銀行	6,900	2,578	17,788,200	
東和銀行	224,000	75	16,800,000	
福島銀行	273,000	60	16,380,000	
大東銀行	141,000	75	10,575,000	
トモニホールディングス	136,000	342	46,512,000	
フィデアホールディングス	106,100	160	16,976,000	
池田泉州ホールディングス	875,100	166	145,266,600	
SBIホールディングス	19,911	21,110	420,321,210	
ジャフコ	30,300	2,900	87,870,000	
大和証券グループ本社	1,953,000	511	997,983,000	
野村ホールディングス	4,153,000	676	2,807,428,000	
みずほ証券	568,000	273	155,064,000	
みずほインベスターズ証券	517,000	101	52,217,000	
岡三証券グループ	189,000	446	84,294,000	
丸三証券	68,600	579	39,719,400	
東洋証券	84,000	189	15,876,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	235,000	371	87,185,000	
光世証券	54,000	105	5,670,000	
水戸証券	60,000	224	13,440,000	
いちよし証券	46,700	690	32,223,000	
松井証券	131,500	723	95,074,500	
だいがう証券ビジネス	11,000	425	4,675,000	
マネックスグループ	1,673	46,500	77,794,500	
カブドットコム証券	68,400	484	33,105,600	
極東証券	27,600	828	22,852,800	
岩井証券	19,400	669	12,978,600	
NK S Jホールディングス	1,662,000	720	1,196,640,000	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	618,300	2,795	1,728,148,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	719	323,000	232,237,000	
東京海上ホールディングス	844,600	2,868	2,422,312,800	
T&Dホールディングス	382,000	2,423	925,586,000	
クレディセゾン	155,300	1,441	223,787,300	
セディナ	180,200	172	30,994,400	
芙蓉総合リース	20,000	2,725	54,500,000	
興銀リース	32,200	1,981	63,788,200	
東京センチュリーリース	54,400	1,248	67,891,200	
日本証券金融	95,400	708	67,543,200	
大阪証券金融	31,400	207	6,499,800	
ポケットカード	25,600	262	6,707,200	
リコーリース	16,200	2,454	39,754,800	
イオンクレジットサービス	98,600	1,081	106,586,600	
アコム	55,700	1,527	85,053,900	
プロミス	101,600	967	98,247,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ジャックス	143,000	246	35,178,000	
日立キャピタル	54,500	1,386	75,537,000	
オリックス	107,690	8,410	905,672,900	
三菱UFJリース	56,270	3,700	208,199,000	
アサックス	45	103,100	4,639,500	
NECキャピタルソリューション	8,500	1,245	10,582,500	
昭栄	43,200	749	32,356,800	
東京建物不動産販売	23,400	310	7,254,000	
野村不動産ホールディングス	116,300	1,613	187,591,900	
ヒューリック	67,200	683	45,897,600	
パーク24	124,700	1,056	131,683,200	
三井不動産	923,000	1,677	1,547,871,000	
三菱地所	1,456,000	1,629	2,371,824,000	
平和不動産	171,000	292	49,932,000	
東京建物	451,000	418	188,518,000	
ダイビル	62,300	900	56,070,000	
サンケイビル	45,200	664	30,012,800	
東急不動産	449,000	403	180,947,000	
京阪神不動産	35,200	477	16,790,400	
住友不動産	498,000	1,907	949,686,000	
東宝不動産	31,100	564	17,540,400	
大京	333,000	214	71,262,000	
テオーシー	97,900	411	40,236,900	
東京楽天地	47,000	368	17,296,000	
レオパレス21	175,400	609	106,818,600	
フジ住宅	37,600	360	13,536,000	
空港施設	30,800	503	15,492,400	
住友不動産販売	8,970	4,680	41,979,600	
ゴールドクレスト	16,670	2,620	43,675,400	
東栄住宅	17,800	1,012	18,013,600	
東急リバブル	25,000	1,004	25,100,000	
飯田産業	11,300	1,854	20,950,200	
アーネストワン	41,300	962	39,730,600	
サンヨーハウジング名古屋	153	88,800	13,586,400	
イオンモール	108,900	1,972	214,750,800	
タクトホーム	156	77,200	12,043,200	
エス・ティ・ティ都市開発	1,563	86,300	134,886,900	
日本空港ビルデング	56,000	1,566	87,696,000	
日本工営	81,000	283	22,923,000	
日本M&Aセンター	44	348,000	15,312,000	
アコーディア・ゴルフ	600	104,800	62,880,000	
パソナグループ	213	64,700	13,781,100	
リンクアンドモチベーション	61	41,450	2,528,450	
テンプホールディングス	32,800	807	26,469,600	
学情	9,600	332	3,187,200	
スタジオアリス	12,300	862	10,602,600	
シミック	400	28,000	11,200,000	
NECフィールディング	19,800	1,384	27,403,200	
総合警備保障	78,300	1,084	84,877,200	
カカクコム	141	369,500	52,099,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ルネサンス	14,100	323	4,554,300	

新日本科学	13,000	642	8,346,000	
エムスリー	92	356,000	32,752,000	
ディー・エヌ・エー	272	748,000	203,456,000	
博報堂DYホールディングス	29,830	5,340	159,292,200	
ぐるなび	130	171,600	22,308,000	
一休	149	51,300	7,643,700	
ジャパンベストレスクューシステム	52	71,700	3,728,400	
ジェイコムホールディングス	27	104,500	2,821,500	
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	515	68,100	35,071,500	
イーピーエス	129	231,700	29,889,300	
アミューズ	7,100	961	6,823,100	
ドリームインキュベータ	84	80,500	6,762,000	
TAC	14,800	384	5,683,200	
電通	213,600	2,642	564,331,200	
イオンファンタジー	8,700	1,222	10,631,400	
みらかホールディングス	44,900	2,994	134,430,600	
アルプス技研	10,300	762	7,848,600	
ダイオーズ	5,500	507	2,788,500	
日本空調サービス	6,100	777	4,739,700	
オリエンタルランド	57,100	6,750	385,425,000	
ダスキン	65,900	1,667	109,855,300	
明光ネットワークジャパン	21,400	667	14,273,800	
ファルコSDホールディングス	12,900	949	12,242,100	
秀英予備校	6,400	620	3,968,000	
田谷	4,900	695	3,405,500	
ラウンドワン	33,600	775	26,040,000	
リゾートトラスト	35,400	1,410	49,914,000	
ビー・エム・エル	12,500	2,347	29,337,500	
ワタベウェディング	7,300	1,170	8,541,000	
もしもしホットライン	14,900	1,938	28,876,200	
東急コミュニティー	5,600	2,372	13,283,200	
リソー教育	2,632	5,340	14,054,880	
ウェアハウス	8,200	357	2,927,400	
ユー・エス・エス	29,660	6,610	196,052,600	
東京個別指導学院	21,000	174	3,654,000	
カルチュア・コンビニエンス・クラブ	84,000	518	43,512,000	
テー・オー・ダブリュー	6,300	545	3,433,500	
セントラルスポーツ	7,800	874	6,817,200	
リゾートソリューション	26,000	175	4,550,000	
エイチ・アイ・エス	22,200	1,931	42,868,200	
共立メンテナンス	10,400	1,565	16,276,000	
イチネンホールディングス	24,300	439	10,667,700	
建設技術研究所	13,100	511	6,694,100	
燦ホールディングス	5,400	1,588	8,575,200	
スバル興業	25,000	270	6,750,000	
東京テアトル	105,000	153	16,065,000	
ホリプロ	8,900	736	6,550,400	
よみうりランド	50,000	324	16,200,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
東京都競馬	170,000	140	23,800,000	
カナモト	28,000	491	13,748,000	
東京ドーム	165,000	281	46,365,000	
トランス・コスモス	28,500	865	24,652,500	
乃村工芸社	48,000	365	17,520,000	

藤田観光	63,000	392	24,696,000	
日本管財	9,000	1,529	13,761,000	
白洋舎	29,000	277	8,033,000	
セコム	211,700	4,115	871,145,500	
セントラル警備保障	10,000	893	8,930,000	
丹青社	46,000	217	9,982,000	
メイテック	32,200	1,968	63,369,600	
アサツー ディ・ケイ	41,000	2,553	104,673,000	
応用地質	24,600	813	19,999,800	
船井総合研究所	24,000	555	13,320,000	
進学会	16,400	334	5,477,600	
ベネッセホールディングス	74,200	4,345	322,399,000	
イオンディライト	17,800	1,785	31,773,000	
ナック	9,700	888	8,613,600	
ニチイ学館	47,300	931	44,036,300	
ダイセキ	38,100	2,070	78,867,000	
合計	307,630,532	—	278,364,142,500	

（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。

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 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。

⑦ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表

該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】平成22年５月31日

I 資産総額	1,094,852,135 円
II 負債総額	5,545,902 円
III 純資産総額（I－II）	1,089,306,233 円
IV 発行済口数	1,112,222,988 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.9794 円
1万口当たり純資産額	9,794 円

<参考>

マザーファンドの現況（平成22年５月31日）

純資産額計算書

（中央三井日本債券マザーファンド）

I 資産総額	318,709,284,840 円
II 負債総額	9,878,479,732 円
III 純資産総額（I－II）	308,830,805,108 円
IV 発行済口数	266,268,921,373 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.1598 円
1万口当たり純資産額	11,598 円

（中央三井日本株式マザーファンド）

I 資産総額	256,953,576,787 円
II 負債総額	2,038,788,776 円
III 純資産総額（I－II）	254,914,788,011 円
IV 発行済口数	330,614,003,694 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.7710 円
1万口当たり純資産額	7,710 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）投資信託受益証券の名義書換等

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

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限

該当事項はありません。

（4）振替受益権に関する記載

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

① 受益証券の不発行

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

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

② 受益権の譲渡

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

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

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

③ 受益権の譲渡の対抗要件

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

④ 受益権の再分割

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

⑤ 償還金

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

⑥ 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額

本書提出日現在の資本金の額：3億円

会社の発行可能株式総数：16,000株

発行済株式総数：5,050株

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

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

（2）委託会社の機構

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

取締役の任期は、選任後1年以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年以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。

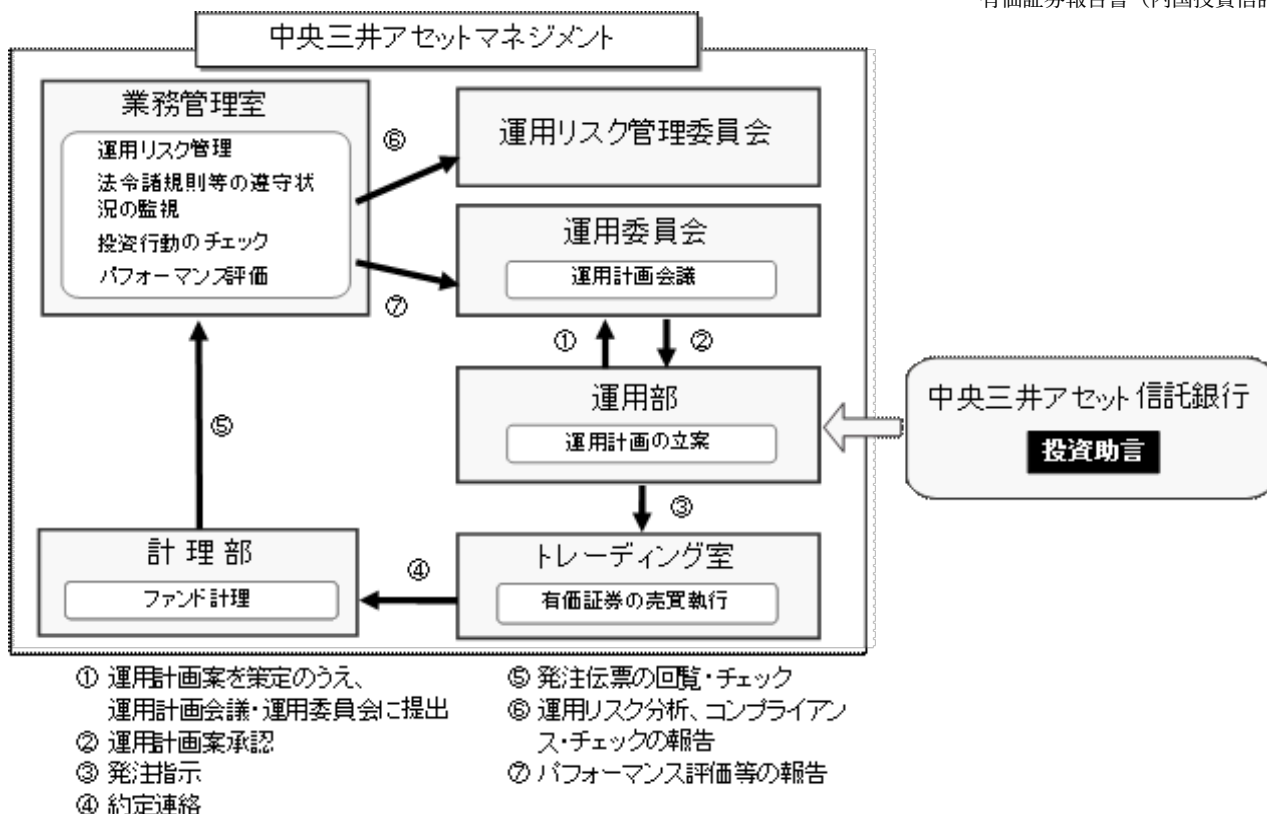
取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

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発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

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

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



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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成22年5月31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	58	397,469
追加型公社債投資信託	—	—
単位型株式投資信託	22	117,326
単位型公社債投資信託	—	—
合計	80	514,796

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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23期事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）の財務諸表については、監査法人トーマツによる監査を受け、第24期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表については、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) 【貸借対照表】

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

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

(2) 【損益計算書】

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

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

重要な会計方針

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

注記事項

1. 貸借対照表関係

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

2. 損益計算書関係

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

3. 株主資本等変動計算書関係

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

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

4. リース取引関係

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

5. 金融商品関係

第24期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（※）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び(4) 未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	65,000

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

（追加情報）

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

6. 有価証券関係

第23期 (平成21年3月31日)	第24期 (平成22年3月31日)												
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 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの <table><tr><th>区分</th><th>貸借対照表 計上額</th><th>取得原価</th><th>差額</th></tr><tr><td>その他</td><td>千円 9,897</td><td>千円 10,000</td><td>千円 △103</td></tr><tr><td>計</td><td>9,897</td><td>10,000</td><td>△103</td></tr></table>	区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額	その他	千円 9,897	千円 10,000	千円 △103	計	9,897	10,000	△103
区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額										
その他	千円 9,897	千円 10,000	千円 △103										
計	9,897	10,000	△103										
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 <table><tr><th>区分</th><th>売却額</th><th>売却益の 合計額</th><th>売却損の 合計額</th></tr><tr><td>その他</td><td>千円 64,901</td><td>千円 2,918</td><td>千円 17</td></tr><tr><td>計</td><td>64,901</td><td>2,918</td><td>17</td></tr></table>	区分	売却額	売却益の 合計額	売却損の 合計額	その他	千円 64,901	千円 2,918	千円 17	計	64,901	2,918	17
区分	売却額	売却益の 合計額	売却損の 合計額										
その他	千円 64,901	千円 2,918	千円 17										
計	64,901	2,918	17										
3. 時価評価されていない有価証券 <table><tr><th>内容</th><th>貸借対照表計上額（千円）</th></tr><tr><td>その他有価証券 非上場株式</td><td>65,000</td></tr></table>	内容	貸借対照表計上額（千円）	その他有価証券 非上場株式	65,000	3. 時価評価されていない有価証券 <table><tr><th>内容</th><th>貸借対照表計上額（千円）</th></tr><tr><td>その他有価証券 非上場株式</td><td>65,000</td></tr></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。												

7. デリバティブ関係

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

8. 退職給付関係

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

9. 税効果会計関係

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

10. 関連当事者との取引関係

I 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。

Ⅱ 第24期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）

1. 関連当事者との取引

当社と同一の親会社を持つ会社等

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

（注2）取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

11. 1株当たり情報

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

1株当たり当期純損益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

12. 重要な後発事象

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

4【利害関係人との取引制限】

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

（１）自己又はその役員との取引

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

（２）運用財産相互間の取引

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

（３）通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

（４）親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

（５）その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

（１）定款の変更

当会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

（２）訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（1）受託会社

- ① 名称：中央三井アセット信託銀行株式会社
- ② 資本金の額：11,000百万円（平成22年3月末日現在）
- ③ 事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、「金融機関の信託業務の兼営等に関する法律」に基づき信託業務を営んでいます。

＜再信託受託会社＞

- ① 名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ② 資本金の額：51,000百万円（平成22年3月末日現在）
- ③ 事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、「金融機関の信託業務の兼営等に関する法律」に基づき信託業務を営んでいます。

（2）販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成22年3月末日現在）	事業の内容
中央三井信託銀行株式会社	399,697	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。
楽天証券株式会社※	7,477	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

※楽天証券株式会社は、平成22年7月30日より募集・販売等の取扱いを行います。

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項各号に掲げる書類は提出しておりません。

独立監査人の監査報告書

平成21年6月12日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

監査法人 トーマツ

指定社員
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

指定社員
業務執行社員 公認会計士 平木達也 印

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

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

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

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成22年6月25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」に掲げられている日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）の平成21年10月30日から平成22年4月26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、日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）の平成22年4月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月10日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 松崎 雅 則

印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 平 木 達 也

印

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

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

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

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

以 上

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