【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24年4月23日
【計算期間】	第10期（自 平成23年1月25日 至 平成24年1月23日）
【ファンド名】	ＤＣ日本債券インデックスファンド
【発行者名】	三井住友トラスト・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 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都中央区八重洲2丁目3番1号 （平成24年5月21日より、東京都港区芝3丁目33番1号（予定））
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポーティング部長 橋詰 廣志
【連絡場所】	東京都中央区八重洲2丁目3番1号 （平成24年5月21日より、東京都港区芝3丁目33番1号（予定））
【電話番号】	03-6259-3801
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① ファンドの目的

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

② 信託金限度額

上限 3,000億円

③ 基本的性格

当ファンドは、委託会社である三井住友トラスト・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、三井住友信託銀行株式会社がその受託会社となることを引受けたものです。

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

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

（用語の定義について）

当ファンドが該当する商品分類に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

＜単位型投信・追加型投信＞

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

＜投資対象地域＞

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

＜投資対象資産（収益の源泉）＞

・債 券…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債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

＜補足分類＞

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

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

（用語の定義について）

当ファンドが該当する属性区分に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

＜投資対象資産＞

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

・債券 一般…公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。

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

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

＜決算頻度＞

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

＜投資対象地域＞

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

＜投資形態＞

・ファミリーファンド

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

＜インデックスファンドにおける対象インデックス＞

・その他（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合）

…「その他」とは、日経２２５、ＴＯＰＩＸ以外の指数をいいます。

なお、当ファンドの対象インデックスは「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」です。

※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。

④ ファンドの特色

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行い、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）【ファンドの沿革】

平成14年１月25日　信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

平成24年４月１日　当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継

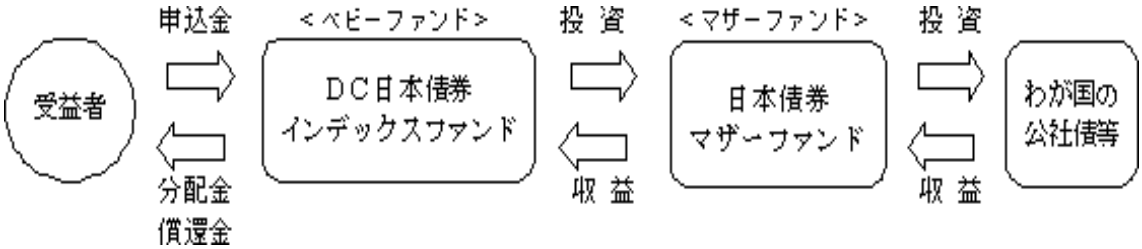
当ファンドの名称を中央三井ＤＣ日本債券インデックスファンドからＤＣ日本債券インデックスファンドに変更

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の名称を日本債券マザーファンドに変更

（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（ＤＣ日本債券インデックスファンド）とし、その資金をマザーファンド（日本債券マザーファンド）に投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



② ファンドの関係法人

委託会社　三井住友トラスト・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。

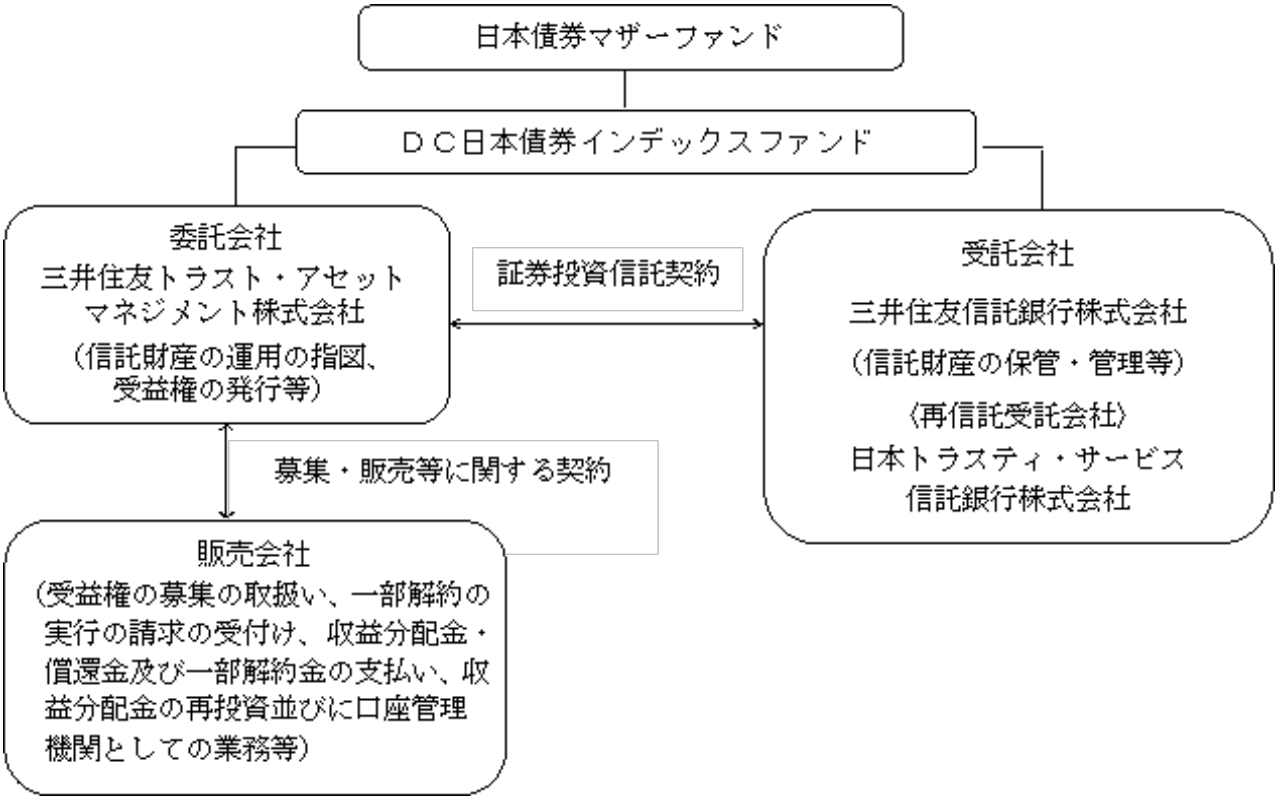
受託会社　三井住友信託銀行株式会社

（再信託受託会社 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）
当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

販売会社

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

ファンドの関係法人



委託会社と関係法人との契約の概要

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

③ 委託会社の概況

A．資本金の額：３億円（平成24年４月１日現在）

B．委託会社の沿革

昭和61年11月１日：住信キャピタルマネジメント株式会社設立
昭和62年２月20日：投資顧問業の登録
昭和62年９月９日：投資一任契約に係る業務の認可
平成２年10月１日：住信投資顧問株式会社に商号変更
平成11年２月15日：住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
平成11年３月25日：証券投資信託委託業の認可

平成19年９月30日：金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）

平成24年４月１日：中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

Ｃ．大株主の状況（平成24年４月１日現在）

株 主 名	住　所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目４番１号	3,000株	100%

２【投資方針】

（１）【投資方針】

① 運用方針

当ファンドは、わが国の公社債に投資する日本債券マザーファンドを主要投資対象とし、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。なお、公社債等に直接投資することもあります。

② 投資態度

Ａ．公社債への実質投資は、わが国で発行された公社債に分散投資を行い、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。

Ｂ．公社債等の実質投資割合は、原則として高位を保ちます。

Ｃ．運用の効率化を図るため、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。

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

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

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

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

（２）【投資対象】

① 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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）①Ｇ．、Ｈ．及びＩ．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、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友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「日本債券マザーファンド」（以下「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券及び次に掲げる有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）（本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

１．国債証券

２．地方債証券

３．特別の法律により法人の発行する債券

４．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）

５．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。）
６．転換社債の転換及び新株予約権（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。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得した株券
７．コマーシャル・ペーパー
８．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７．までの証券又は証書の性質を有するもの
９．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。）
10．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。）
11．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。）
12．外国法人が発行する譲渡性預金証書
13．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。）
14．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。）
15．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
16．外国の者に対する権利で上記15．の有価証券の性質を有するもの

なお、上記６．の証券及び上記８．の証券又は証書のうち上記６．の証券の性質を有するものを以下「株式」といい、上記１．から５．までの証券及び上記８．の証券又は証書のうち上記１．から５．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９．の証券及び上記10．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。

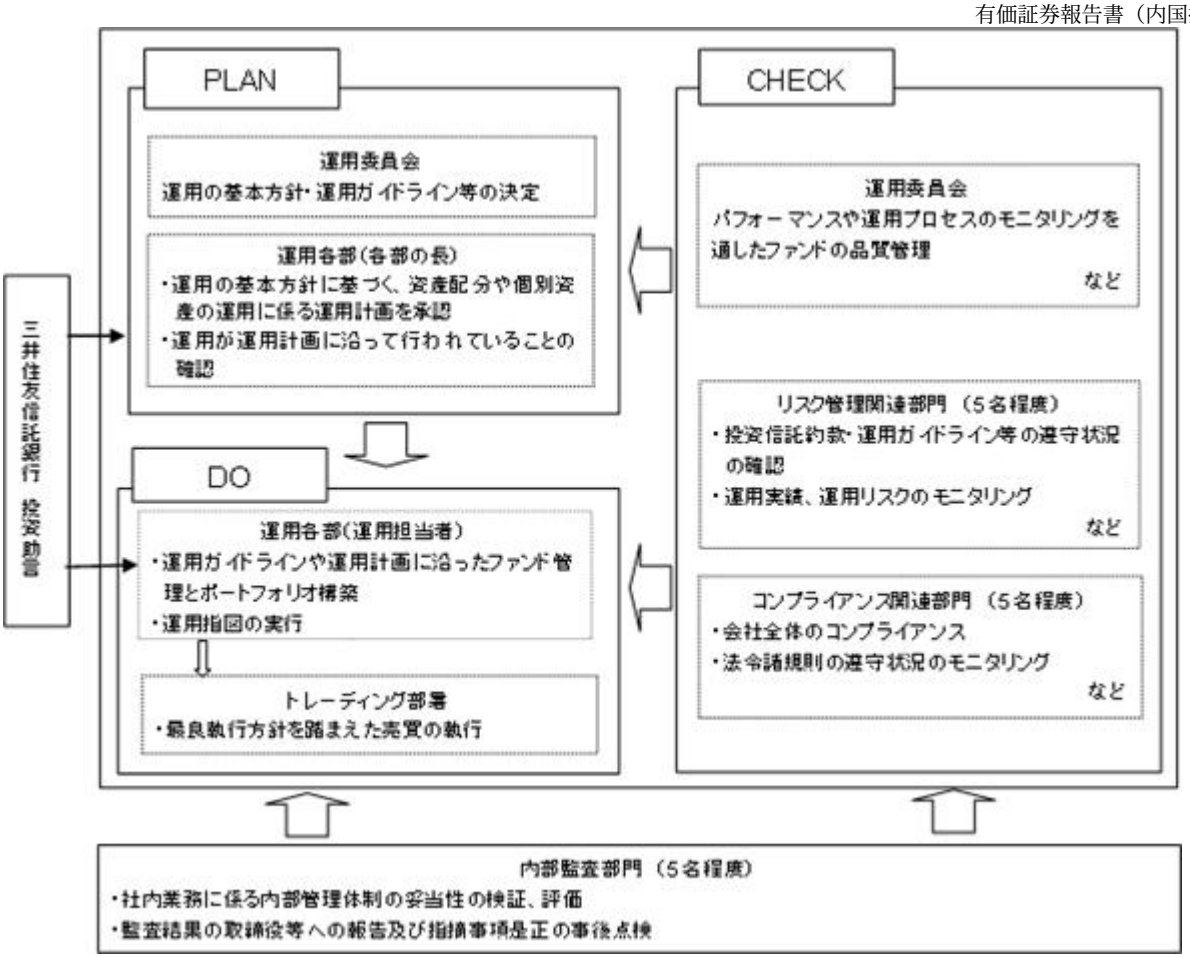
１．預金
２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３．コール・ローン
４．手形割引市場において売買される手形
５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
６．外国の者に対する権利で上記５．の権利の性質を有するもの

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。

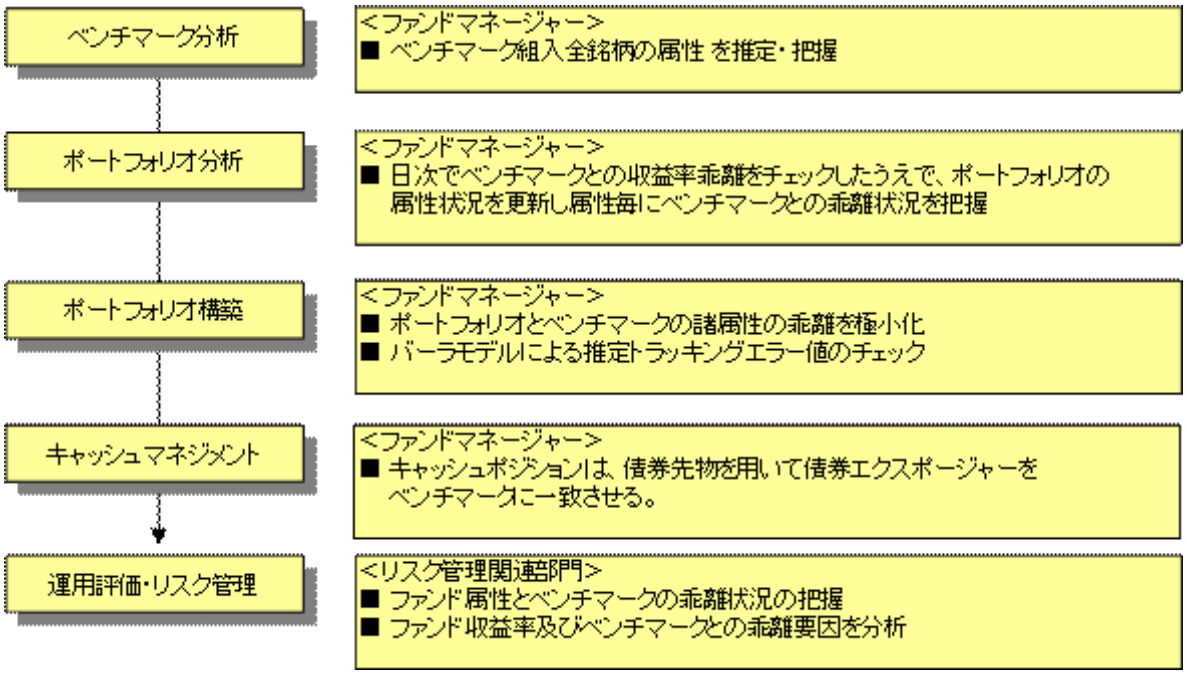
（３）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、本書提出日現在のものであり、今後変更されることがあります。



＜マザーファンドのポートフォリオ構築プロセス＞

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



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用

等に係る業務規則を定めています。

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、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再信託受託会社より受け取っております。

（４）【分配方針】

① 分配方針

年１回の毎決算時（決算日は１月22日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

Ａ．分配対象額は、経費控除後の利子等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の合計額とします。

Ｂ．分配金額については、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は分配を行わないことがあります。

Ｃ．収益分配に充てず信託財産に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

② 分配収益の計算

Ａ．信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

イ．配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額は、諸経費（後記「４ 手数料等及び税金 （４）その他の手数料等 ①」の記載をご参照ください。）、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金に充てるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

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

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

Ｂ．毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③ 収益分配金の再投資等

収益分配金は、自動的に当ファンドの受益権に再投資されます。

Ａ．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。

Ｂ．販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、毎計算期間終了日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（上記Ａ．の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、上記Ａ．の収益分配金に係る計算期間終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

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

益権に係る受益者に支払います。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

① 約款に定める投資制限

A．株式への投資制限

委託会社は、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ます。）を行使したものに限ることとし、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。

B．同一銘柄の株式への投資制限

委託会社は、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５％以下とします。

C．転換社債等への投資制限

委託会社は、転換社債並びに転換社債型新株予約権付社債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．外貨建資産への投資制限

委託会社は、外貨建資産への投資は行いません。

E．投資信託証券への投資制限

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

F．投資する株式の範囲

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

G．先物取引等の運用指図

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

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

H．スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

Ｉ．金利先渡取引の運用指図

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

ロ．金利先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

J．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、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。ただし、当該貸付は、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．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

K．公社債の空売りの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算において信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

L．公社債の借入れの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

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

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

M．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。

N．再投資の指図

委託会社は、上記M．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。

O．資金の借入れ

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市

場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10％以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

Ｐ．受託会社による資金の立替え

イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。

ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。

② 関連法令に基づく投資制限

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

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

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

Ｂ．同一の法人の発行する株式への投資制限

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

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

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

ロ．当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数

（参考）マザーファンドの概要

「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、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友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ます。）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。

３【投資リスク】

（１）ファンドのリスク

●当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 金利変動リスク

債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

② 信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

③ 流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

＜その他の留意点＞

① ファンドは、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が、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。

② 同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

③ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

④ ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

⑤ 確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

① 委託会社では、運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行います（運用を外部委託しているファンドも含みます。）。

② モニタリング結果は、原則月1回（必要に応じ随時）開催される運用リスクの管理、コンプライアンスに関する委員会等に報告され、委員会等は適切な運用リスク管理・法令遵守に必要な措置を講じます。

③ 内部監査部門は、独立した立場でリスク管理体制の適切性・有効性を検証し、評価を行います。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

申込手数料はありません。

（2）【換金（解約）手数料】

① 解約手数料はありませんが、下記②の信託財産留保額が控除されます。

② 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

マザーファンド名	A 欄	B 欄
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%

（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率 0.4095%（税抜※ 0.39%）を乗じて得た額とします。その配分は以下のとおりです。

委託会社	年率 0.1785%	（税抜 0.17%）
販売会社	年率 0.1785%	（税抜 0.17%）
受託会社	年率 0.0525%	（税抜 0.05%）

※「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。

なお、マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

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

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。なお、信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、信託財産から収受する信託報酬中より委託会社が支弁します。

なお、マザーファンドにおいては、監査報酬はかかりません。

② 借入金の利息は、原則として借入金返済時に信託財産中から支弁します。

③ 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。

手数料等の合計額については、ファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

（5）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

確定拠出年金の運用段階における課税上の取扱いは、次のとおりとなります。

① 企業型年金

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

② 個人型年金

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

（注）企業型年金及び個人型年金の確定拠出年金資産は、特別法人税の課税対象とされていますが、平成26年３月までは課税が凍結されています。

上記は、平成24年２月29日現在のものですので、税法及び確定拠出年金法等が改正された場合等は、上記の内容が変更されることがあります。

５【運用状況】

※平成24年４月１日をもって「中央三井日本債券マザーファンド」は「日本債券マザーファンド」にファンド名称を変更しております（以下同じ。）。

以下の記載事項は、平成24年２月29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	2,431,115,522	100.04
	親投資信託受益証券合計		2,431,115,522	100.04
その他の資産（負債控除後）			△1,007,184	△0.04
合計（純資産総額）			2,430,108,338	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	360,890,375,270	98.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,935,330,222	1.89
合計（純資産総額）		367,825,705,492	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	2,022,558,671	1.1979	2,422,828,053	1.2020	2,431,115,522	100.04

（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８７回	0.5	2014/12/20	5,500,000,000	100.91	5,550,445,000	101.03	5,556,650,000	1.51

2	利付国庫債券（１０年）第２８９回	1.5	2017/12/20	3,800,000,000	106.11	4,032,480,000	106.28	4,038,982,000	1.10
3	利付国庫債券（１０年）第２８５回	1.7	2017/3/20	3,400,000,000	106.76	3,630,146,000	106.89	3,634,566,000	0.99
4	利付国庫債券（２年）第３１３回	0.1	2014/2/15	3,500,000,000	99.98	3,499,580,000	99.99	3,499,650,000	0.95
5	利付国庫債券（１０年）第３１２回	1.2	2020/12/20	3,300,000,000	102.85	3,394,050,000	103.20	3,405,633,000	0.93
6	利付国庫債券（１０年）第２８８回	1.7	2017/9/20	3,000,000,000	107.09	3,212,790,000	107.28	3,218,550,000	0.88
7	利付国庫債券（１０年）第２８４回	1.7	2016/12/20	2,950,000,000	106.55	3,143,284,000	106.66	3,146,676,500	0.86
8	利付国庫債券（５年）第１００回	0.3	2016/9/20	3,000,000,000	99.92	2,997,850,000	100.08	3,002,670,000	0.82
9	利付国庫債券（１０年）第３１３回	1.3	2021/3/20	2,800,000,000	103.46	2,897,076,000	103.82	2,906,988,000	0.79
10	利付国庫債券（２年）第３０９回	0.1	2013/10/15	2,900,000,000	99.96	2,898,985,000	99.99	2,899,739,000	0.79
11	利付国庫債券（１０年）第３０５回	1.3	2019/12/20	2,700,000,000	104.49	2,821,230,000	104.86	2,831,247,000	0.77
12	利付国庫債券（５年）第８８回	0.5	2015/3/20	2,800,000,000	100.89	2,824,920,000	101.07	2,830,072,000	0.77
13	利付国庫債券（１０年）第３１８回	1.0	2021/9/20	2,700,000,000	100.26	2,707,128,000	100.61	2,716,551,000	0.74
14	利付国庫債券（１０年）第３１５回	1.2	2021/6/20	2,600,000,000	102.33	2,660,658,000	102.70	2,670,304,000	0.73
15	利付国庫債券（１０年）第３１７回	1.1	2021/9/20	2,500,000,000	101.28	2,532,022,000	101.53	2,538,350,000	0.69
16	利付国庫債券（５年）第９６回	0.5	2016/3/20	2,400,000,000	100.81	2,419,632,000	101.06	2,425,440,000	0.66
17	利付国庫債券（５年）第８９回	0.4	2015/6/20	2,400,000,000	100.53	2,412,936,000	100.76	2,418,456,000	0.66
18	利付国庫債券（５年）第９９回	0.4	2016/9/20	2,400,000,000	100.29	2,407,128,000	100.53	2,412,912,000	0.66
19	利付国庫債券（２年）第３０７回	0.2	2013/8/15	2,400,000,000	100.12	2,402,952,000	100.13	2,403,288,000	0.65
20	利付国庫債券（５年）第９３回	0.5	2015/12/20	2,300,000,000	100.84	2,319,504,000	101.09	2,325,093,000	0.63
21	利付国庫債券（１０年）第３０７回	1.3	2020/3/20	2,200,000,000	104.34	2,295,524,000	104.68	2,303,114,000	0.63
22	利付国庫債券（２年）第３０３回	0.2	2013/4/15	2,300,000,000	100.09	2,302,231,000	100.10	2,302,415,000	0.63
23	利付国庫債券（５年）第１０２回	0.3	2016/12/20	2,200,000,000	99.92	2,198,442,000	100.02	2,200,506,000	0.60
24	利付国庫債券（５年）第８２回	0.9	2014/3/20	2,100,000,000	101.63	2,134,356,000	101.61	2,133,999,000	0.58
25	利付国庫債券（５年）第８５回	0.7	2014/9/20	2,100,000,000	101.39	2,129,337,000	101.47	2,130,891,000	0.58
26	利付国庫債券（５年）第８６回	0.6	2014/9/20	2,100,000,000	101.13	2,123,734,000	101.21	2,125,557,000	0.58
27	利付国庫債券（５年）第８３回	0.9	2014/6/20	2,000,000,000	101.79	2,035,820,000	101.80	2,036,140,000	0.55
28	利付国庫債券（５年）第９４回	0.6	2015/12/20	2,000,000,000	101.23	2,024,680,000	101.46	2,029,360,000	0.55
29	利付国庫債券（５年）第９２回	0.3	2015/9/20	2,000,000,000	100.14	2,002,880,000	100.40	2,008,100,000	0.55
30	利付国庫債券（１０年）第３２０回	1.0	2021/12/20	2,000,000,000	100.35	2,007,123,000	100.40	2,008,060,000	0.55
合計				80,350,000,000		82,018,923,000		82,159,959,500	22.34

（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	75.04
地方債証券	6.50
特殊債券	9.64
社債券	6.93
合計	98.11

（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	23	3,281,443,810	3,282,790,000	0.89

（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。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

	純資産総額（円）	１万口当たりの基準価額（円）
第１期計算期間（平成15年１月22日現在）	49,053,978	10,385
第２期計算期間（平成16年１月22日現在）	571,180,326	10,253
第３期計算期間（平成17年１月24日現在）	827,883,905	10,346
第４期計算期間（平成18年１月23日現在）	993,920,748	10,360
第５期計算期間（平成19年１月22日現在）	1,341,201,596	10,334
第６期計算期間（平成20年１月22日現在）	1,554,144,386	10,644
第７期計算期間（平成21年１月22日現在）	1,896,319,277	10,823
第８期計算期間（平成22年１月22日現在）	2,099,953,945	10,929
第９期計算期間（平成23年１月24日現在）	2,315,434,459	11,089
第10期計算期間（平成24年１月23日現在）	2,423,953,715	11,328
平成23年２月末日	2,318,434,804	11,081
平成23年３月末日	2,348,553,852	11,080
平成23年４月末日	2,365,210,683	11,118
平成23年５月末日	2,277,929,569	11,160
平成23年６月末日	2,296,655,639	11,191
平成23年７月末日	2,321,230,740	11,229
平成23年８月末日	2,345,658,477	11,259
平成23年９月末日	2,375,339,351	11,298
平成23年10月末日	2,361,820,393	11,274
平成23年11月末日	2,388,517,571	11,268
平成23年12月末日	2,432,644,642	11,334
平成24年１月末日	2,440,744,544	11,351
平成24年２月末日	2,430,108,338	11,360

（注）決算日における基準価額は、分配付、分配落とも同一です。

②【分配の推移】

	１万口当たりの収益分配金
第１期計算期間	０ 円
第２期計算期間	０ 円

第３期計算期間	0 円
第４期計算期間	0 円
第５期計算期間	0 円
第６期計算期間	0 円
第７期計算期間	0 円
第８期計算期間	0 円
第９期計算期間	0 円
第10期計算期間	0 円

③【収益率の推移】

	収益率
第１期計算期間	3.9 %
第２期計算期間	△1.3 %
第３期計算期間	0.9 %
第４期計算期間	0.1 %
第５期計算期間	△0.3 %
第６期計算期間	3.0 %
第７期計算期間	1.7 %
第８期計算期間	1.0 %
第９期計算期間	1.5 %
第10期計算期間	2.2 %

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済み口数
第１期計算期間	47,724,893	488,455	47,236,438
第２期計算期間	552,580,725	42,752,356	557,064,807
第３期計算期間	308,497,735	65,338,259	800,224,283
第４期計算期間	340,028,654	180,864,920	959,388,017
第５期計算期間	529,694,539	191,273,949	1,297,808,607
第６期計算期間	367,967,874	205,686,107	1,460,090,374
第７期計算期間	692,259,343	400,217,086	1,752,132,631
第８期計算期間	368,111,938	198,870,287	1,921,374,282
第９期計算期間	370,981,762	204,274,189	2,088,081,855
第10期計算期間	310,427,755	258,638,682	2,139,870,928

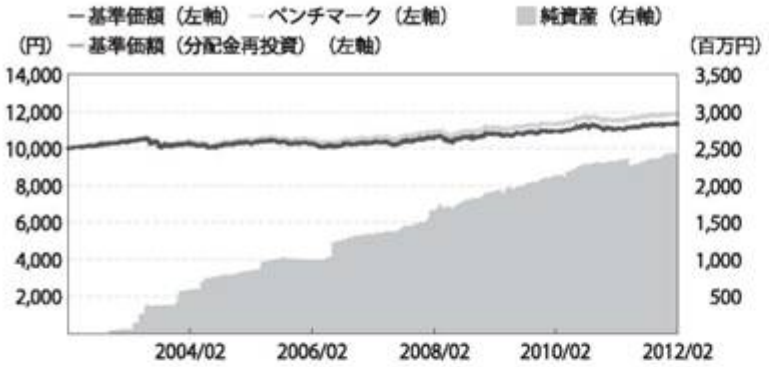
（注１）設定及び解約の実績は、全て本邦内における実績です。
（注２）第１期計算期間の設定口数には、当初自己設定の設定口数を含みます。

（参考情報）交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

2012年2月29日 現在（基準日）

〈基準価額・純資産の推移〉



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

〈分配の推移〉

2012年1月	0円
2011年1月	0円
2010年1月	0円
2009年1月	0円
2008年1月	0円
設定来累計	0円

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

〈主な資産の状況〉

資産別投資比率

資産	比率
債券	98.15%
その他資産	1.85%
合計	100.00%

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

種類別投資比率（中央三井日本債券マザーファンド）

種類	比率
国債証券	75.04%
地方債証券	6.50%
特殊債券	9.64%
社債券	6.93%
合計	98.11%

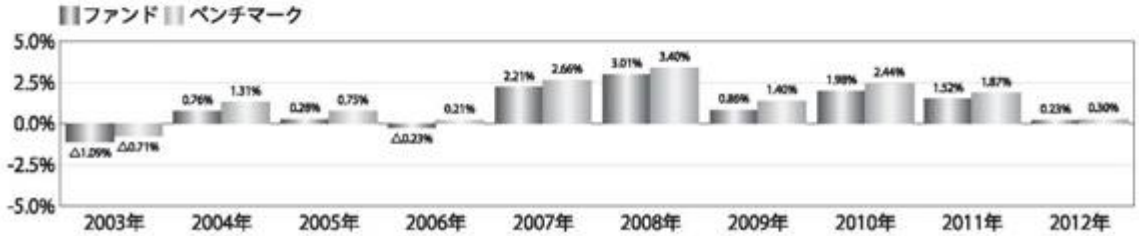
・比率とはマザーファンドの純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率をいいます。

組入上位銘柄（中央三井日本債券マザーファンド）

銘柄名	種類	償還日	利率	比率
利付国庫債券（５年）第８７回	国債証券	2014/12/20	0.500%	1.51%
利付国庫債券（１０年）第２８９回	国債証券	2017/12/20	1.500%	1.10%
利付国庫債券（１０年）第２８５回	国債証券	2017/03/20	1.700%	0.99%
利付国庫債券（２年）第３１３回	国債証券	2014/02/15	0.100%	0.95%
利付国庫債券（１０年）第３１２回	国債証券	2020/12/20	1.200%	0.93%
利付国庫債券（１０年）第２８８回	国債証券	2017/09/20	1.700%	0.88%
利付国庫債券（１０年）第２８４回	国債証券	2016/12/20	1.700%	0.86%
利付国庫債券（５年）第１００回	国債証券	2016/09/20	0.300%	0.82%
利付国庫債券（１０年）第３１３回	国債証券	2021/03/20	1.300%	0.79%
利付国庫債券（２年）第３０９回	国債証券	2013/10/15	0.100%	0.79%
			合計	9.60%

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

〈年間収益率の推移〉



・年間収益率は［期間中の基準価額増減＋分配金（税引前）］/前年末の基準価額で算出しています。
・2012年（直近年）は年初から基準日までの分配金（税引前）を含む基準価額の騰落率を表示しています。ベンチマークの騰落率も同様です。
・ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しているものであり、ファンドの運用実績ではありません。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

（１）申込みの受付け

申込期間中において、毎営業日お申込みいただけます。

（注）お申込みの取扱いは、営業日の午後２時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）③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消すことができます。

（２）取得申込者

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

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

（３）募集取扱いの単位

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

（４）販売価額

継続募集期間における受益権の販売価額は、取得申込受付日の基準価額とします。

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

（５）その他

① 確定拠出年金制度の加入者等は、当ファンドの受益者に該当しておらず、確定拠出年金制度の運営管理機関（記録関連業務を行う事業主を含みます。）に対して資産配分の指図を行い、その指図の通知を受けた資産管理機関等が当ファンドの取得申込み及び後記「２ 換金（解約）手続等」に記載する一部解約の実行の請求を行うこととなります。

② 受益権の取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。このため販売会社は総合約款を取得申込者に交付し、取得申込者は総合約款に基づく取引口座の設定を申込む旨の申込書を提出していただきます。

③ 当ファンドは、収益の分配がなされた場合、自動的に無手数料で再投資がなされる「分配金再投資コース」専用ファンドです。このため受益権の取得申込者は、申込みの際に販売会社との間で、自動けいぞく約款に従い自動的に無手数料で再投資される、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

④ 取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、追加

信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

２【換金（解約）手続等】

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

（注）一部解約の実行の請求の受付けは、営業日の午後２時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ます。

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

（４）一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の基準価額から、当該基準価額に0.1%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.smtam.jp/）でご覧いただけます。

販売会社の詳細につきましては、以下の照会先にお問い合わせください。

（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
・お問い合わせ窓口
電　話：０１２０－６６８００１（フリーダイヤル）
受付時間：営業日の午前９時から午後５時まで
・ホームページ アドレス：http://www.smtam.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、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。

（６）上記（５）により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして上記（４）の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います。

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠ることとなります。

（８）解約に係る手数料については、徴収しません。

（９）当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換

金には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。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、上記（４）に記載の照会先までお問い合わせください。

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１万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出され、日々の基準価額は、販売会社へお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします（販売会社の詳細につきましては、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.smtam.jp/）でご覧いただけます。

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（日本債券マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

Ｂ．公社債等

計算日における次のイ．からハ．までに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（売気配相場を除きます。）

ハ．価格情報会社の提供する価額

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

当ファンドの信託期間は、信託契約締結日（平成14年１月25日）から無期限とします。ただし、委託会社は、下記（５）①の事項に該当することとなった場合は、この信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

① 当ファンドの計算期間は、毎年１月23日から翌年１月22日までとすることを原則とします。ただし、第１計算期間は平成14年１月25日から平成15年１月22日までとし、最終計算期間の終了日は、上記（３）に定める信託期間の終了日とします。

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。

（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５億口を下回った場合

委託会社は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が５億口を下回ることとなった場合は、受託会社と協議のうえ、あらかじめ、監督官庁に届け出ることにより、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。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

ハ．所定の手続き

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

ｂ．上記ａ．の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

ｃ．上記ｂ．の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記イ．及びロ．の信託契約の解約をしません。

ｄ．委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

ｅ．上記ｂ．からｄ．までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記ｂ．の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

Ｂ．監督官庁の命令

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

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

Ｃ．委託会社の登録取消等に伴う取扱い

イ．委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ．上記イ．の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、下記③Ｄ．に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

Ｄ．受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い

イ．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、下記③の規定に従い、新受託会社を選任します。

ロ．委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 委託会社の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い

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

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

③ 信託約款の変更

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

B．委託会社は、上記A．の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

C．上記B．の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

D．上記C．の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記A．の信託約款の変更をしません。

E．委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

④ 反対者の買取請求権

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

⑤ 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥ 信託財産の管理

A．保管業務の委任

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

B．有価証券の保管

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

C．混蔵寄託

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

D．信託財産の登記等及び記載等の留保等

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

ロ．上記イ．のただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、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、毎決算時及び償還時に運用報告書を作成し、販売会社を通じて知れてい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募集・販売等に関する契約の有効期間は、有効期間満了日の

３ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に１年間延長され、その後も同様とします。

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

⑨ 信託事務処理の再委託

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

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、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付されます。

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

（２）償還金に対する請求権

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ます。）に対する支払いを開始します。

③ 償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

（３）一部解約請求権

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

② 一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、５営業日目から当該受益者に支払います。

③ 一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

（４）投資信託約款等重要事項変更時の反対者の買取請求権

前記「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。

（参考）

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

第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９期計算期間（平成22年１月23日から平成23年１月24日まで）及び第10期計算期間（平成23年１月25日から平成24年１月23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。

（３）当ファンドは、平成24年４月１日付にてファンドの名称を「中央三井ＤＣ日本債券インデックスファンド」から「ＤＣ日本債券インデックスファンド」に変更しました。また、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」については、平成24年４月１日付にて「日本債券マザーファンド」に名称を変更しました。以下では、変更前の名称で表示しています。

１【財務諸表】

中央三井ＤＣ日本債券インデックスファンド

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第９期 （平成23年１月24日現在）	第10期 （平成24年１月23日現在）
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	2,320,232,020	2,428,822,543
未収入金	1,746,218	1,036,927
流動資産合計	2,321,978,238	2,429,859,470
資産合計	2,321,978,238	2,429,859,470
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,746,218	1,036,927
未払受託者報酬	615,082	624,216
未払委託者報酬	4,182,479	4,244,612
流動負債合計	6,543,779	5,905,755
負債合計	6,543,779	5,905,755
純資産の部		
元本等		
元本	2,088,081,855	2,139,870,928
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	227,352,604	284,082,787
純資産合計	2,315,434,459	2,423,953,715
負債純資産合計	2,321,978,238	2,429,859,470

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第９期 自 平成22年１月23日 至 平成23年１月24日	第10期 自 平成23年１月25日 至 平成24年１月23日
営業収益		
有価証券売買等損益	39,301,167	59,136,811
営業収益合計	39,301,167	59,136,811
営業費用		
受託者報酬	1,178,827	1,227,425
委託者報酬	8,015,897	8,346,406
営業費用合計	9,194,724	9,573,831
営業利益又は営業損失（△）	30,106,443	49,562,980
経常利益又は経常損失（△）	30,106,443	49,562,980
当期純利益又は当期純損失（△）	30,106,443	49,562,980
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	2,726,100	2,610,920
期首剰余金又は期首欠損金（△）	178,579,663	227,352,604
剰余金増加額又は欠損金減少額	40,413,440	37,823,262
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	40,413,440	37,823,262
剰余金減少額又は欠損金増加額	19,020,842	28,045,139
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	19,020,842	28,045,139
期末剰余金又は期末欠損金（△）	227,352,604	284,082,787

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	第 9 期 自 平成22年１月23日 至 平成23年１月24日	第 10 期 自 平成23年１月25日 至 平成24年１月23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。	親投資信託受益証券 同左
２．その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年１月23日から翌年１月22日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第９期計算期間は平成22年１月23日から平成23年１月24日までとなっております。	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年１月23日から翌年１月22日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第10期計算期間は平成23年１月25日から平成24年１月23日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第 9 期 （平成23年１月24日現在）	第 10 期 （平成24年１月23日現在）
１．当該計算期間の末日における受益権総数	2,088,081,855 口	2,139,870,928 口
２．１口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	1.1089 円 (11,089 円)	1.1328 円 (11,328 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 9 期 自 平成22年１月23日 至 平成23年１月24日	第 10 期 自 平成23年１月25日 至 平成24年１月23日
費用控除後の配当等収益額	A	23,422,435 円 (31,288,521 円)	26,724,304 円 (32,173,729 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	3,608,825 円	20,227,756 円
収益調整金額	C	122,637,557 円	144,413,565 円
分配準備積立金額	D	77,683,787 円	92,717,162 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	227,352,604 円	284,082,787 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,088,081,855 口	2,139,870,928 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,088.81 円	1,327.56 円
10,000口当たり分配金額	H	－ 円	－ 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	－ 円	－ 円

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

であります。

	第 9 期 自 平成22年１月23日 至 平成23年１月24日	第 10 期 自 平成23年１月25日 至 平成24年１月23日
２．剰余金増加額・減少額又は欠損金減少額・増加額	「当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ剰余金減少額と増加額との純額を表示しております。	同左

（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 9 期 自 平成22年１月23日 至 平成23年１月24日	第 10 期 自 平成23年１月25日 至 平成24年１月23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。	同左
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。	同左

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。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

	第 9 期 （平成23年１月24日現在）	第 10 期 （平成24年１月23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。	同左
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。	（１）親投資信託受益証券 同左 （２）コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
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。	同左

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。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第 9 期 自 平成22年１月23日 至 平成23年１月24日	第 10 期 自 平成23年１月25日 至 平成24年１月23日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

第 9 期 自 平成22年１月23日 至 平成23年１月24日	第 10 期 自 平成23年１月25日 至 平成24年１月23日
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

１．本書における開示対象ファンドの当該計算期間における元本額の変動

	第 9 期 自 平成22年１月23日 至 平成23年１月24日	第 10 期 自 平成23年１月25日 至 平成24年１月23日
期首元本額	1,921,374,282 円	2,088,081,855 円
期中追加設定元本額	370,981,762 円	310,427,755 円
期中一部解約元本額	204,274,189 円	258,638,682 円

２．有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 9 期 （平成23年１月24日現在） 最終の計算期間（自 平成22年１月23日 至 平成23年１月24日）の損益に含まれた評価差額（円）	第 10 期 （平成24年１月23日現在） 最終の計算期間（自 平成23年１月25日 至 平成24年１月23日）の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	39,685,204	61,222,301
合計	39,685,204	61,222,301

３．デリバティブ取引関係

第 9 期 （平成23年１月24日現在）	第 10 期 （平成24年１月23日現在）
当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。	同左

（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	2,027,228,565	2,428,822,543	
合計		2,027,228,565	2,428,822,543	

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＞

「中央三井ＤＣ日本債券インデックスファンド」は、「中央三井日本債券マザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、全て同マザーファンドの受益証券であります。

同マザーファンドの平成24年１月23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24年１月23日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,317,401,245
国債証券	269,731,649,300
地方債証券	23,080,088,702
特殊債券	36,159,208,465
社債券	24,780,385,000
派生商品評価勘定	8,530
未収利息	1,123,025,065
前払費用	45,617,662
流動資産合計	360,237,383,969
資産合計	360,237,383,969
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,845,280
前受金	1,550,000
未払解約金	370,210,560
流動負債合計	373,605,840
負債合計	373,605,840
純資産の部	
元本等	
元本	300,354,009,418
剰余金	
剰余金	59,509,768,711
純資産合計	359,863,778,129
負債・純資産合計	360,237,383,969

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成24年１月23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、最初の利払日までは個別法）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24年１月23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　51,760,500 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	300,354,009,418 口
３．１口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	1.1981 円 （ 11,981 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24年１月23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24年１月23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

「（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24年１月23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24年１月23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24年１月23日現在	
計算期間の期首元本額	301,364,840,277 円
計算期間中の追加設定元本額	64,446,692,702 円
計算期間中の一部解約元本額	65,457,523,561 円
計算日の元本額	300,354,009,418 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	7,883,340,385 円
中央三井ＤＣ日本債券インデックスファンド	2,027,228,565 円
中央三井ＤＣ日本債券インデックスファンドＬ	21,232,111,260 円
中央三井ＤＣバランスファンド３０	772,761,957 円
中央三井ＤＣバランスファンド５０	766,485,302 円
中央三井ＤＣバランスファンド７０	189,237,800 円
ベスタ・世界６資産ファンド（毎月決算型）	168,529,348 円
ベスタ・世界６資産ファンド（１年決算型）	103,495,389 円
中央三井日本債券インデックスファンド（ＳＭＡ専用）	4,754,366,437 円
新生・４分散ファンド	131,143,118 円
４資産インデックスバランスオープン（分配型）	43,865,646 円
４資産インデックスバランスオープン（成長型）	129,982,460 円
日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）	406,062,540 円
ＣＭＡＭ日本債券インデックスｅ	439,469,242 円
中央三井インデックスコレクション（国内債券）	1,745,911,592 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式３０）	800,314,055 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式５０）	742,796,215 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式７０）	278,375,822 円
中央三井バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	9,898,419,719 円
中央三井バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	31,220,731,146 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）	27,665,833,684 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）	1,447,155,048 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）	7,030,893,155 円
中央三井バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	10,733,952,604 円
中央三井バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	2,369,926,084 円
中央三井バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	24,373,356,208 円
中央三井バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	244,899,795 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）	29,448,059,053 円
中央三井ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	6,950,519,920 円
中央三井ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	648,659,342 円
中央三井バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	3,230,038,181 円
中央三井ＶＡバランス株式４０（適格機関投資家専用）	1,688,186,344 円
ＣＭＡＭ・バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	4,841,606,083 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）	1,012,070,666 円
ＣＭＡＭ・ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	1,794,721,950 円

中央三井バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	4,730,154,250 円
中央三井ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	4,223,450,673 円
ＣＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	6,445,687,612 円
中央三井バランスＶＡ２０Ｌ（適格機関投資家専用）	624,023,625 円
中央三井バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	3,942,965,313 円
ＣＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	47,234,427,498 円
中央三井世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	1,246,038,647 円
中央三井国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	339,582,634 円
中央三井国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	138,811,241 円
ＣＭＡＭ・ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	992,303,932 円
私募日本債券インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	7,961,529 円
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）	23,191,829,497 円
中央三井世界バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	22,266,852 円

２．有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成24年１月23日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	3,589,569,700
地方債証券	247,400,343
特殊債券	297,954,105
社債券	△400,168,000
合計	3,734,756,148

（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23年１月25日から平成24年１月23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24年１月23日現在			
		契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引 買 建	3,557,836,750	―	3,556,000,000	△1,836,750
合計		3,557,836,750	―	3,556,000,000	△1,836,750

（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24年１月23日現在
該当事項はありません。

次へ

（３）附属明細表（平成24年１月23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３０１回	1,500,000,000	1,501,260,000	
	利付国庫債券（２年）第３０２回	1,500,000,000	1,501,350,000	
	利付国庫債券（２年）第３０３回	2,300,000,000	2,302,231,000	
	利付国庫債券（２年）第３０４回	500,000,000	500,515,000	
	利付国庫債券（２年）第３０５回	1,800,000,000	1,801,980,000	
	利付国庫債券（２年）第３０６回	600,000,000	600,702,000	
	利付国庫債券（２年）第３０７回	2,400,000,000	2,402,952,000	
	利付国庫債券（２年）第３０８回	600,000,000	599,802,000	
	利付国庫債券（２年）第３０９回	2,900,000,000	2,898,985,000	
	利付国庫債券（２年）第３１０回	1,200,000,000	1,201,716,000	
	利付国庫債券（２年）第３１１回	1,300,000,000	1,301,950,000	
	利付国庫債券（５年）第７０回	1,700,000,000	1,713,209,000	
	利付国庫債券（５年）第７１回	2,100,000,000	2,128,329,000	
	利付国庫債券（５年）第７２回	1,200,000,000	1,223,088,000	
	利付国庫債券（５年）第７３回	1,200,000,000	1,219,752,000	
	利付国庫債券（５年）第７４回	1,300,000,000	1,315,951,000	
	利付国庫債券（５年）第７５回	600,000,000	609,678,000	
	利付国庫債券（５年）第７６回	1,800,000,000	1,831,986,000	
	利付国庫債券（５年）第７７回	1,100,000,000	1,115,928,000	
	利付国庫債券（５年）第７８回	700,000,000	710,269,000	
	利付国庫債券（５年）第７９回	1,700,000,000	1,718,513,000	
	利付国庫債券（５年）第８０回	1,300,000,000	1,316,614,000	
	利付国庫債券（５年）第８１回	1,700,000,000	1,724,174,000	
	利付国庫債券（５年）第８２回	2,100,000,000	2,134,356,000	
	利付国庫債券（５年）第８３回	2,000,000,000	2,035,820,000	
	利付国庫債券（５年）第８４回	1,800,000,000	1,823,634,000	
	利付国庫債券（５年）第８５回	2,100,000,000	2,129,337,000	
	利付国庫債券（５年）第８６回	2,500,000,000	2,528,350,000	
	利付国庫債券（５年）第８７回	4,100,000,000	4,136,039,000	
	利付国庫債券（５年）第８８回	2,800,000,000	2,824,920,000	
	利付国庫債券（５年）第８９回	2,400,000,000	2,412,936,000	
	利付国庫債券（５年）第９０回	1,900,000,000	1,903,838,000	
	利付国庫債券（５年）第９１回	1,000,000,000	1,005,060,000	
	利付国庫債券（５年）第９２回	2,000,000,000	2,002,880,000	
	利付国庫債券（５年）第９３回	2,300,000,000	2,319,504,000	
	利付国庫債券（５年）第９４回	2,000,000,000	2,024,680,000	
	利付国庫債券（５年）第９５回	1,900,000,000	1,923,731,000	
	利付国庫債券（５年）第９６回	2,400,000,000	2,419,632,000	
	利付国庫債券（５年）第９７回	1,600,000,000	1,605,888,000	
	利付国庫債券（５年）第９８回	2,000,000,000	1,998,680,000	
	利付国庫債券（５年）第９９回	2,400,000,000	2,407,128,000	
	利付国庫債券（５年）第１００回	2,000,000,000	1,996,780,000	
	利付国庫債券（５年）第１０１回	1,800,000,000	1,804,320,000	
	利付国庫債券（４０年）第１回	400,000,000	433,564,000	
	利付国庫債券（４０年）第２回	600,000,000	617,676,000	
	利付国庫債券（４０年）第３回	600,000,000	615,312,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考

国債証券	利付国庫債券（４０年）第４回	600,000,000	612,228,000	
	利付国庫債券（１０年）第２４７回	910,000,000	917,070,700	
	利付国庫債券（１０年）第２４８回	170,000,000	171,127,100	
	利付国庫債券（１０年）第２４９回	760,000,000	764,164,800	
	利付国庫債券（１０年）第２５０回	600,000,000	603,180,000	
	利付国庫債券（１０年）第２５１回	770,000,000	778,377,600	
	利付国庫債券（１０年）第２５２回	730,000,000	738,957,100	
	利付国庫債券（１０年）第２５３回	1,350,000,000	1,382,886,000	
	利付国庫債券（１０年）第２５４回	520,000,000	530,951,200	
	利付国庫債券（１０年）第２５５回	710,000,000	726,124,100	
	利付国庫債券（１０年）第２５６回	1,040,000,000	1,065,116,000	
	利付国庫債券（１０年）第２５７回	400,000,000	408,900,000	
	利付国庫債券（１０年）第２５８回	480,000,000	491,956,800	
	利付国庫債券（１０年）第２５９回	1,180,000,000	1,214,444,200	
	利付国庫債券（１０年）第２６０回	860,000,000	889,781,800	
	利付国庫債券（１０年）第２６１回	790,000,000	821,133,900	
	利付国庫債券（１０年）第２６２回	730,000,000	760,514,000	
	利付国庫債券（１０年）第２６３回	750,000,000	778,387,500	
	利付国庫債券（１０年）第２６４回	1,330,000,000	1,376,829,300	（注）
	利付国庫債券（１０年）第２６５回	730,000,000	757,455,300	
	利付国庫債券（１０年）第２６６回	560,000,000	579,448,800	
	利付国庫債券（１０年）第２６７回	410,000,000	423,054,400	
	利付国庫債券（１０年）第２６８回	900,000,000	936,270,000	
	利付国庫債券（１０年）第２６９回	1,740,000,000	1,799,247,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７０回	1,600,000,000	1,657,136,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７１回	1,400,000,000	1,445,528,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７２回	1,500,000,000	1,562,085,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７３回	1,000,000,000	1,045,010,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７４回	900,000,000	942,525,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７５回	1,200,000,000	1,252,068,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７６回	800,000,000	840,880,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７７回	1,600,000,000	1,685,504,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７８回	700,000,000	743,141,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７９回	700,000,000	749,028,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８０回	1,500,000,000	1,603,800,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８１回	1,000,000,000	1,073,540,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８２回	1,800,000,000	1,913,346,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８３回	1,400,000,000	1,494,570,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８４回	2,950,000,000	3,143,284,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８５回	3,400,000,000	3,630,146,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８６回	1,700,000,000	1,827,177,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８７回	1,700,000,000	1,836,170,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８８回	3,000,000,000	3,212,790,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８９回	2,700,000,000	2,863,701,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９０回	600,000,000	633,138,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９１回	1,300,000,000	1,363,622,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９２回	800,000,000	858,768,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９３回	2,200,000,000	2,378,024,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９４回	1,200,000,000	1,289,664,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９５回	700,000,000	743,386,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９６回	1,800,000,000	1,912,140,000	

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２９７回	1,200,000,000	1,266,948,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９８回	1,300,000,000	1,363,440,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９９回	1,100,000,000	1,153,537,000	

	利付国庫債券（１０年）第３００回	1,400,000,000	1,487,850,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０１回	900,000,000	956,016,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０２回	1,800,000,000	1,899,288,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０３回	1,200,000,000	1,264,656,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０４回	1,400,000,000	1,465,240,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０５回	3,300,000,000	3,448,170,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０６回	1,900,000,000	1,997,090,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０７回	2,200,000,000	2,295,524,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０８回	1,400,000,000	1,457,946,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０９回	1,700,000,000	1,742,177,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１０回	1,300,000,000	1,318,356,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１１回	2,000,000,000	1,995,140,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１２回	3,700,000,000	3,805,524,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１３回	2,800,000,000	2,897,076,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１４回	1,900,000,000	1,932,908,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１５回	2,600,000,000	2,660,658,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１６回	1,400,000,000	1,419,950,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１７回	1,800,000,000	1,821,438,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１８回	2,700,000,000	2,707,128,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１９回	800,000,000	807,928,000	
	利付国庫債券（３０年）第１回	50,000,000	58,539,500	
	利付国庫債券（３０年）第２回	100,000,000	110,902,000	
	利付国庫債券（３０年）第３回	330,000,000	360,416,100	
	利付国庫債券（３０年）第４回	190,000,000	225,721,900	
	利付国庫債券（３０年）第５回	180,000,000	193,365,000	
	利付国庫債券（３０年）第６回	270,000,000	299,122,200	
	利付国庫債券（３０年）第７回	190,000,000	207,212,100	
	利付国庫債券（３０年）第８回	270,000,000	271,026,000	
	利付国庫債券（３０年）第９回	180,000,000	168,044,400	
	利付国庫債券（３０年）第１０回	170,000,000	149,370,500	
	利付国庫債券（３０年）第１１回	310,000,000	304,739,300	
	利付国庫債券（３０年）第１２回	370,000,000	389,413,900	
	利付国庫債券（３０年）第１３回	250,000,000	258,462,500	
	利付国庫債券（３０年）第１４回	350,000,000	387,544,500	
	利付国庫債券（３０年）第１５回	440,000,000	495,488,400	
	利付国庫債券（３０年）第１６回	250,000,000	281,552,500	
	利付国庫債券（３０年）第１７回	430,000,000	476,078,800	
	利付国庫債券（３０年）第１８回	660,000,000	718,020,600	
	利付国庫債券（３０年）第１９回	270,000,000	293,676,300	
	利付国庫債券（３０年）第２０回	140,000,000	157,563,000	
	利付国庫債券（３０年）第２１回	420,000,000	456,233,400	
	利付国庫債券（３０年）第２２回	300,000,000	337,614,000	
	利付国庫債券（３０年）第２３回	400,000,000	450,136,000	
	利付国庫債券（３０年）第２４回	200,000,000	225,056,000	
	利付国庫債券（３０年）第２５回	700,000,000	759,521,000	
	利付国庫債券（３０年）第２６回	700,000,000	773,367,000	
	利付国庫債券（３０年）第２７回	900,000,000	1,013,211,000	
	利付国庫債券（３０年）第２８回	900,000,000	1,013,805,000	

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２９回	900,000,000	995,454,000	
	利付国庫債券（３０年）第３０回	900,000,000	976,707,000	
	利付国庫債券（３０年）第３１回	1,400,000,000	1,488,270,000	
	利付国庫債券（３０年）第３２回	1,200,000,000	1,299,936,000	
	利付国庫債券（３０年）第３３回	1,500,000,000	1,524,990,000	
	利付国庫債券（３０年）第３４回	1,400,000,000	1,481,550,000	

	利付国庫債券（３０年）第３５回	1,200,000,000	1,214,688,000	
	利付国庫債券（２０年）第２１回	40,000,000	42,552,400	
	利付国庫債券（２０年）第２２回	170,000,000	180,070,800	
	利付国庫債券（２０年）第２３回	130,000,000	141,511,500	
	利付国庫債券（２０年）第２４回	160,000,000	175,641,600	
	利付国庫債券（２０年）第２５回	80,000,000	86,793,600	
	利付国庫債券（２０年）第２６回	50,000,000	55,721,500	
	利付国庫債券（２０年）第２７回	410,000,000	462,336,500	
	利付国庫債券（２０年）第２８回	110,000,000	126,482,400	
	利付国庫債券（２０年）第２９回	100,000,000	114,315,000	
	利付国庫債券（２０年）第３０回	200,000,000	225,010,000	
	利付国庫債券（２０年）第３１回	280,000,000	316,901,200	
	利付国庫債券（２０年）第３２回	80,000,000	91,199,200	
	利付国庫債券（２０年）第３３回	430,000,000	498,778,500	
	利付国庫債券（２０年）第３４回	70,000,000	81,225,900	
	利付国庫債券（２０年）第３５回	270,000,000	310,491,900	
	利付国庫債券（２０年）第３７回	410,000,000	471,155,600	
	利付国庫債券（２０年）第３９回	640,000,000	722,060,800	
	利付国庫債券（２０年）第４０回	450,000,000	501,318,000	
	利付国庫債券（２０年）第４１回	620,000,000	658,905,000	
	利付国庫債券（２０年）第４２回	380,000,000	433,257,000	
	利付国庫債券（２０年）第４３回	340,000,000	396,467,200	
	利付国庫債券（２０年）第４４回	370,000,000	420,834,300	
	利付国庫債券（２０年）第４５回	470,000,000	531,363,200	
	利付国庫債券（２０年）第４６回	290,000,000	322,981,700	
	利付国庫債券（２０年）第４７回	470,000,000	523,453,100	
	利付国庫債券（２０年）第４８回	230,000,000	262,055,100	
	利付国庫債券（２０年）第４９回	280,000,000	309,453,200	
	利付国庫債券（２０年）第５０回	590,000,000	641,507,000	
	利付国庫債券（２０年）第５１回	240,000,000	262,879,200	
	利付国庫債券（２０年）第５２回	430,000,000	474,767,300	
	利付国庫債券（２０年）第５３回	350,000,000	386,242,500	
	利付国庫債券（２０年）第５４回	280,000,000	311,665,200	
	利付国庫債券（２０年）第５５回	490,000,000	536,128,600	
	利付国庫債券（２０年）第５６回	410,000,000	448,400,600	
	利付国庫債券（２０年）第５７回	460,000,000	498,520,400	
	利付国庫債券（２０年）第５８回	350,000,000	379,039,500	
	利付国庫債券（２０年）第５９回	440,000,000	467,055,600	
	利付国庫債券（２０年）第６０回	570,000,000	587,208,300	
	利付国庫債券（２０年）第６１回	390,000,000	384,980,700	
	利付国庫債券（２０年）第６２回	250,000,000	240,575,000	
	利付国庫債券（２０年）第６３回	770,000,000	823,330,200	
	利付国庫債券（２０年）第６４回	410,000,000	442,041,500	
	利付国庫債券（２０年）第６５回	370,000,000	398,626,900	
	利付国庫債券（２０年）第６６回	540,000,000	575,829,000	

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６７回	560,000,000	602,190,400	
	利付国庫債券（２０年）第６８回	230,000,000	254,920,500	
	利付国庫債券（２０年）第６９回	260,000,000	285,407,200	
	利付国庫債券（２０年）第７０回	400,000,000	452,044,000	
	利付国庫債券（２０年）第７１回	700,000,000	775,537,000	
	利付国庫債券（２０年）第７２回	1,120,000,000	1,226,657,600	
	利付国庫債券（２０年）第７３回	440,000,000	476,124,000	
	利付国庫債券（２０年）第７４回	310,000,000	339,078,000	
	利付国庫債券（２０年）第７５回	360,000,000	393,213,600	

	利付国庫債券（２０年）第７６回	630,000,000	672,808,500	
	利付国庫債券（２０年）第７７回	310,000,000	334,924,000	
	利付国庫債券（２０年）第７８回	200,000,000	213,084,000	
	利付国庫債券（２０年）第７９回	300,000,000	323,589,000	
	利付国庫債券（２０年）第８０回	350,000,000	381,727,500	
	利付国庫債券（２０年）第８１回	920,000,000	990,628,400	
	利付国庫債券（２０年）第８２回	510,000,000	555,364,500	
	利付国庫債券（２０年）第８３回	530,000,000	576,178,900	
	利付国庫債券（２０年）第８４回	600,000,000	644,886,000	
	利付国庫債券（２０年）第８５回	750,000,000	814,387,500	
	利付国庫債券（２０年）第８６回	270,000,000	299,929,500	
	利付国庫債券（２０年）第８７回	500,000,000	548,845,000	
	利付国庫債券（２０年）第８８回	400,000,000	443,664,000	
	利付国庫債券（２０年）第８９回	1,000,000,000	1,097,170,000	
	利付国庫債券（２０年）第９０回	900,000,000	986,319,000	
	利付国庫債券（２０年）第９１回	600,000,000	664,830,000	
	利付国庫債券（２０年）第９２回	1,100,000,000	1,188,319,000	
	利付国庫債券（２０年）第９３回	700,000,000	745,493,000	
	利付国庫債券（２０年）第９４回	800,000,000	862,960,000	
	利付国庫債券（２０年）第９５回	500,000,000	552,105,000	
	利付国庫債券（２０年）第９６回	400,000,000	430,828,000	
	利付国庫債券（２０年）第９７回	700,000,000	762,580,000	
	利付国庫債券（２０年）第９８回	600,000,000	645,216,000	
	利付国庫債券（２０年）第９９回	1,400,000,000	1,502,998,000	
	利付国庫債券（２０年）第１００回	900,000,000	977,436,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０１回	500,000,000	557,400,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０２回	400,000,000	445,616,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０３回	400,000,000	440,084,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０４回	700,000,000	749,840,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０５回	1,100,000,000	1,176,164,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０６回	300,000,000	325,158,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０７回	500,000,000	533,965,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０８回	1,300,000,000	1,350,076,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０９回	700,000,000	725,809,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１０回	700,000,000	746,585,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１１回	600,000,000	648,108,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１２回	1,100,000,000	1,171,654,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１３回	1,100,000,000	1,170,059,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１４回	1,500,000,000	1,593,270,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１５回	900,000,000	969,732,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１６回	600,000,000	646,080,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１７回	1,500,000,000	1,592,025,000	

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１１８回	800,000,000	835,384,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１９回	400,000,000	405,320,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２０回	600,000,000	589,110,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２１回	600,000,000	616,554,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２２回	1,400,000,000	1,415,806,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２３回	1,100,000,000	1,164,592,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２４回	600,000,000	625,296,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２５回	900,000,000	966,393,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２６回	700,000,000	729,274,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２７回	800,000,000	820,736,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２８回	900,000,000	922,221,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２９回	700,000,000	706,090,000	

	利付国庫債券（２０年）第１３０回	1,100,000,000	1,108,041,000	
	利付国庫債券（２０年）第１３１回	500,000,000	495,255,000	
	利付国庫債券（２０年）第１３２回	600,000,000	593,814,000	
国債証券 小計		258,810,000,000	269,731,649,300	
地方債証券	東京都公募公債第５９８回	103,000,000	103,473,800	
	東京都公募公債第６０２回	200,000,000	204,264,000	
	東京都公募公債第６０５回	100,000,000	102,414,000	
	東京都公募公債第６０８回	100,000,000	102,981,000	
	東京都公募公債第６０９回	200,000,000	205,704,000	
	東京都公募公債第６１３回	100,000,000	103,523,000	
	東京都公募公債第６１６回	100,000,000	103,329,000	
	東京都公募公債第６１７回	100,000,000	103,301,000	
	東京都公募公債第６１９回	100,000,000	103,939,000	
	東京都公募公債第６２４回	100,000,000	104,060,000	
	東京都公募公債第６２５回	100,000,000	103,953,000	
	東京都公募公債第６２６回	100,000,000	104,640,000	
	東京都公募公債第６２７回	100,000,000	104,351,000	
	東京都公募公債第６２８回	100,000,000	104,852,000	
	東京都公募公債第６３７回	180,000,000	191,781,000	
	東京都公募公債第６４２回	100,000,000	106,956,000	
	東京都公募公債第６４６回	100,000,000	108,185,000	
	東京都公募公債第６４７回	100,000,000	108,079,000	
	東京都公募公債第６５６回	100,000,000	105,841,000	
	東京都公募公債第６５７回	100,000,000	107,661,000	
	東京都公募公債第６５９回	100,000,000	106,589,000	
	東京都公募公債第６６８回	100,000,000	106,189,000	
	東京都公募公債第６８１回	100,000,000	104,670,000	
	東京都公募公債第６８２回	100,000,000	104,017,000	
	東京都公募公債第６９２回	100,000,000	103,620,000	
	東京都公募公債（２０年）第３回	100,000,000	110,651,000	
	東京都公募公債（２０年）第１１回	200,000,000	216,700,000	
	東京都公募公債（２０年）第１８回	200,000,000	214,388,000	
	東京都公募公債（２０年）第２０回	100,000,000	104,942,000	
	東京都公募公債（２０年）第２１回	100,000,000	106,284,000	
	北海道平成１７年度第１回公募公債	100,000,000	103,327,000	
	北海道平成１９年度第１４回公募公債（１０年）	100,000,000	106,322,000	
	北海道平成２０年度第１４回公募公債	100,000,000	106,955,000	
	北海道平成２０年度第１５回公募公債（５年）	100,000,000	101,979,000	
	北海道平成２１年度第６回公募公債	100,000,000	105,841,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
地方債証券	北海道平成２２年度第１回公募公債	100,000,000	104,424,000	
	神奈川県第１２６回公募公債	100,000,000	102,908,000	
	神奈川県第１２７回公募公債	100,000,000	103,938,000	
	神奈川県第１３０回公募公債	100,000,000	103,378,000	
	神奈川県第１３４回公募公債	100,000,000	103,832,000	
	神奈川県第１３５回公募公債	100,000,000	104,718,000	
	神奈川県第１４３回公募公債	150,000,000	159,852,000	
	神奈川県第１４４回公募公債	100,000,000	106,857,000	
	神奈川県第１６２回公募公債	100,000,000	106,628,000	
	神奈川県第１６８回公募公債	100,000,000	104,435,000	
	神奈川県第１７３回公募公債	100,000,000	103,568,000	
	神奈川県第１７４回公募公債	100,000,000	102,507,000	
	神奈川県第１７５回公募公債	100,000,000	101,879,000	
	神奈川県第１６回２０年公募公債	100,000,000	104,178,000	
	第２５４回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	100,469,000	

	第２６７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,178,000	
	第２７５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,936,000	
	第２８５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	104,225,000	
	第２８６回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	104,286,000	
	第２９３回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	107,436,000	
	第２９８回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	106,986,000	
	第３０５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	107,593,000	
	第３０９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	106,156,000	
	第３２４回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	106,349,000	
	第３３１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	104,382,000	
	第３３４回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	104,690,000	
	第３３５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	104,728,000	
	第３３９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,559,000	
	第５０回大阪府公募公債（５年）	100,000,000	101,529,000	
	京都府平成１７年度第３回公募公債	100,000,000	104,477,000	
	京都府平成２０年度第６回公募公債	100,000,000	105,681,000	
	京都府平成２１年度第４回公募公債	100,000,000	100,939,000	
	京都府平成２１年度第５回公募公債	100,000,000	104,327,000	
	京都府平成２２年度第４回公募公債	100,000,000	100,557,000	
	兵庫県平成１６年度第１０回公募公債	100,000,000	103,352,000	
	兵庫県平成１７年度第３回公募公債	100,000,000	103,121,000	
	兵庫県平成１８年度第３回公募公債	110,000,000	117,372,200	
	兵庫県平成１８年度第８回公募公債	100,000,000	107,458,000	
	兵庫県平成１８年度第１０回公募公債	100,000,000	107,351,000	
	兵庫県平成２１年度第１回公募公債	100,000,000	106,270,000	
	兵庫県平成２１年度第３５回公募公債	100,000,000	104,723,000	
	静岡県平成１５年度第３回公募公債	100,000,000	102,124,000	
	静岡県平成１７年度第７回公募公債	100,000,000	105,512,000	
	静岡県平成１９年度第４回公募公債	100,000,000	107,993,000	
	静岡県平成１９年度第７回公募公債	100,000,000	107,438,000	
	静岡県平成２１年度第５回公募公債	100,000,000	104,461,000	
	静岡県平成２２年度第３回公募公債	100,000,000	104,278,000	
	静岡県平成２３年度１回公募公債	100,000,000	103,604,000	
	愛知県平成１７年度第１回公募公債（１０年）	100,000,000	103,575,000	
	愛知県平成１８年度第４回公募公債（１０年）	129,000,000	137,418,540	
	愛知県平成２０年度第６回公募公債（１０年）	100,000,000	107,192,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
地方債証券	愛知県平成２０年度第１０回公募公債（１０年）	100,000,000	105,685,000	
	愛知県平成２１年度第１回公募公債（１０年）	100,000,000	106,585,000	
	愛知県平成２２年度第１回公募公債（１０年）	100,000,000	104,620,000	
	愛知県平成２２年度第５回公募公債（１０年）	100,000,000	103,208,000	
	愛知県平成２２年度第１４回公募公債（２０年）	100,000,000	104,192,000	
	愛知県平成２３年度第４回公募公債（１０年）	100,000,000	101,607,000	
	広島県平成１６年度第１回公募公債	100,000,000	103,109,000	
	広島県平成２０年度第６回公募公債	100,000,000	105,608,000	
	埼玉県平成１５年度第５回公募公債	100,000,000	102,420,000	
	埼玉県平成１９年度第２回公募公債	100,000,000	107,840,000	
	埼玉県平成１９年度第５回公募公債	100,000,000	107,442,000	
	埼玉県平成１９年度第７回公募公債	100,000,000	106,613,000	
	埼玉県平成２０年度第５回公募公債	100,000,000	107,321,000	
	埼玉県平成２１年度第１回公募公債	200,000,000	212,030,000	
	埼玉県平成２１年度第２回公募公債	100,000,000	106,296,000	
	埼玉県平成２２年度第４回公募公債	100,000,000	102,414,000	
	福岡県平成１４年度第３回公募公債	100,000,000	100,679,000	
	福岡県平成２０年度第５回公募公債	100,000,000	106,923,000	

	福岡県平成２１年度第５回公募公債	100,000,000	104,585,000	
	福岡県平成２２年度第２回１５年公募公債	100,000,000	103,363,000	
	福岡県平成１９年度第１回３０年公募公債	100,000,000	111,181,000	
	福岡県平成２０年度第１回３０年公募公債	200,000,000	208,618,000	
	千葉県平成１５年度第１回公募公債	100,000,000	100,439,000	
	千葉県平成１７年度第７回公募公債	100,000,000	104,467,000	
	千葉県平成１８年度第６回公募公債	175,000,000	185,916,500	
	千葉県平成１８年度第７回公募公債	100,000,000	106,875,000	
	千葉県平成２１年度第１回公募公債	100,000,000	106,019,000	
	千葉県平成２１年度第３回公募公債	100,000,000	106,781,000	
	千葉県平成２２年度第４回公募公債	100,000,000	102,412,000	
	千葉県第８回２０年公募公債	100,000,000	105,868,000	
	新潟県平成１７年度第１回公募公債	100,000,000	103,368,000	
	新潟県平成２０年度第２回公募公債	100,000,000	105,862,000	
	岐阜県平成１８年度第１回公募公債	100,000,000	106,503,000	
	第１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,643,000	
	第５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,127,000	
	第６回共同発行市場公募地方債	155,700,000	159,357,393	
	第９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,992,000	
	第１１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,289,000	
	第１５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,333,000	
	第１６回共同発行市場公募地方債	127,000,000	131,991,100	
	第１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,036,000	
	第１８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,622,000	
	第１９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,697,000	
	第２０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,512,000	
	第２２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,362,000	
	第２３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,141,000	
	第２４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,829,000	
	第２６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,306,000	
	第２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,367,000	
	第２９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,829,000	
	第３０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,518,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
地方債証券	第３１回共同発行市場公募地方債	150,000,000	156,496,500	
	第３４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,147,000	
	第３５回共同発行市場公募地方債	160,000,000	168,030,400	
	第３８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,952,000	
	第４１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,278,000	
	第４３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,556,000	
	第４８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,444,000	
	第５３回共同発行市場公募地方債	200,000,000	214,440,000	
	第５４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,707,000	
	第５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,915,000	
	第５７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,547,000	
	第６３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,181,000	
	第６５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,562,000	
	第６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,772,000	
	第７４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,289,000	
	第７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,781,000	
	第７７回共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,942,000	
	第７８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,794,000	
	第７９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,360,000	
	第８０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,848,000	
	第８２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,820,000	

	第８３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,942,000	
	第８４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,405,000	
	第８５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,830,000	
	第８７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,455,000	
	第８８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,412,000	
	第９３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,675,000	
	第９４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,487,000	
	第９５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,758,000	
	第９６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,777,000	
	第９７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,520,000	
	第９８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,662,000	
	第９９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,502,000	
	静岡市平成１８年度第１回公募公債	100,000,000	107,103,000	
	大阪市平成１４年度第１１回公募公債	100,000,000	100,636,000	
	大阪市平成１６年度第５回公募公債	100,000,000	103,512,000	
	大阪市平成１７年度第１回公募公債	100,000,000	103,100,000	
	大阪市平成１８年度第３回公募公債	200,000,000	214,528,000	
	大阪市平成２１年度第７回公募公債	100,000,000	104,609,000	
	名古屋市第１２回し号公募公債	100,000,000	103,823,000	
	名古屋市第１２回せ号公募公債	100,000,000	103,890,000	
	名古屋市第１２回ゆ号公募公債	100,000,000	102,575,000	
	名古屋市第１２回す号公募公債	100,000,000	105,470,000	
	名古屋市第４５５回１０年公募公債	186,700,000	199,035,269	
	名古屋市第４６３回１０年公募公債	100,000,000	108,783,000	
	名古屋市第４６４回１０年公募公債	100,000,000	106,501,000	
	名古屋市第１回２０年公募公債	100,000,000	107,670,000	
	京都市平成１９年度第２回公募公債	100,000,000	106,917,000	
	京都市平成２１年度第５回公募公債	100,000,000	104,818,000	
	京都市平成２２年度第３回公募公債	100,000,000	100,072,000	
	京都市第２回２０年公募公債	100,000,000	107,764,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
地方債証券	横浜市平成２０年度第１回公募公債	100,000,000	108,020,000	
	横浜市平成２０年度第６回公募公債	100,000,000	105,876,000	
	横浜市平成２１年度第６回公募公債	100,000,000	104,435,000	
	横浜市平成２２年度第１回公募公債	100,000,000	104,130,000	
	横浜市平成２２年度第３回公募公債	100,000,000	102,230,000	
	横浜市平成２３年度第１回公募公債	100,000,000	101,782,000	
	横浜市平成１５年度第２回公募公債	100,000,000	100,558,000	
	横浜市平成１７年度第３回公募公債	100,000,000	104,615,000	
	横浜市第５回２０年公募公債	100,000,000	108,811,000	
	横浜市第２４回５年公募公債	100,000,000	101,381,000	
	札幌市平成１８年度第４回公募公債	100,000,000	106,402,000	
	札幌市平成２３年度第４回公募公債（１０年）	100,000,000	100,080,000	
	第７９回川崎市公募公債	100,000,000	107,543,000	
	福岡市平成１９年度第３回公募公債	100,000,000	107,627,000	
	福岡市平成１９年度第５回公募公債	100,000,000	105,583,000	
	福岡市平成２０年度第５回公募公債	100,000,000	106,155,000	
	広島市平成１７年度第１回公募公債	100,000,000	104,377,000	
地方債証券 小計		22,026,400,000	23,080,088,702	
特殊債券	政府保証第６回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,745,000	
	政府保証第７回日本政策投資銀行債券	102,000,000	104,384,760	
	政府保証第８回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,098,000	
	政府保証第１０回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,906,000	
	政府保証第１５回日本政策投資銀行債券	210,000,000	228,637,500	
	政府保証第１６回日本政策投資銀行債券	200,000,000	213,992,000	

	政府保証第２１回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,421,000	
	第７回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,601,000	
	第１３回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,815,000	
	第１６回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,186,000	
	第１９回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,259,000	
	第２４回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,499,000	
	第２９回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,616,000	
	第４１回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,446,000	
	第４３回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,969,000	
	第４７回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,772,000	
	第１６回道路債券	200,000,000	201,666,000	
	政府保証第３１９回道路債券	100,000,000	101,165,000	
	政府保証第３２３回道路債券	100,000,000	102,527,000	
	政府保証第３２５回道路債券	101,000,000	103,363,400	
	政府保証第３２７回道路債券	100,000,000	102,960,000	
	政府保証第３２８回道路債券	100,000,000	103,067,000	
	政府保証第３２９回道路債券	150,000,000	155,085,000	
	政府保証第３３０回道路債券	100,000,000	103,999,000	
	政府保証第３３３回道路債券	100,000,000	103,782,000	
	政府保証第３３４回道路債券	100,000,000	103,580,000	
	政府保証第３３５回道路債券	100,000,000	103,361,000	
	政府保証第３３６回道路債券	131,000,000	135,526,050	
	政府保証第３３８回道路債券	100,000,000	103,917,000	
	政府保証第３４３回道路債券	100,000,000	103,450,000	
	政府保証第３４６回道路債券	115,000,000	119,512,600	
	第１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,662,000	
	第３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,702,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊債券	第６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,740,000	
	第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	164,991,000	
	第２２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,014,000	
	第２５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,940,000	
	第２７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,603,000	
	第３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,561,000	
	第３２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,931,000	
	第３５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,169,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,401,000	
	第３８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,603,000	
	第３９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,508,000	
	第４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,058,000	
	第４５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,460,000	
	第４８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,732,000	
	第４９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,427,000	
	第５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,184,000	
	第５６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,373,000	
	第５９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,572,000	
	第６１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,453,000	
	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	104,568,000	
	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	101,579,000	
	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	167,567,670	
	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	108,374,010	
	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	106,766,000	
	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	133,682,500	
	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	106,633,000	
	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	106,682,000	

	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	215,864,000	
	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	109,356,000	
	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	213,882,000	
	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	105,843,000	
	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	105,286,000	
	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	105,286,000	
	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	214,374,000	
	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	107,237,000	
	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	105,950,000	
	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	213,218,000	
	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	106,610,000	
	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	210,554,000	
	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	104,618,000	
	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	104,616,000	
	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	210,548,000	
	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	105,963,000	
	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	103,972,000	
	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	104,299,000	
	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	103,492,000	
	政府保証第９３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,973,000	
	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	103,365,000	
	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	104,081,000	
	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	104,802,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊債券	政府保証第１０３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,983,000	
	政府保証第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,691,000	
	政府保証第１０７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,656,000	
	政府保証第１１０回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,743,000	
	政府保証第１１１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,484,000	
	政府保証第１３３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,109,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	110,506,000	
	第２６回道路債券	100,000,000	102,684,000	
	第２７回道路債券	100,000,000	110,994,000	
	第３０回道路債券	100,000,000	103,178,000	
	第３３回道路債券	100,000,000	112,762,000	
	第３７回道路債券	100,000,000	103,562,000	
	第３８回道路債券	100,000,000	108,948,000	
	第４１回道路債券	100,000,000	103,633,000	
	第４２回道路債券	100,000,000	108,205,000	
	政府保証第８２５回公営企業債券	100,000,000	100,758,000	
	政府保証第８２６回公営企業債券	200,000,000	201,342,000	
	政府保証第８２９回公営企業債券	100,000,000	101,398,000	
	政府保証第８３０回公営企業債券	100,000,000	101,156,000	
	政府保証第８３２回公営企業債券	100,000,000	102,155,000	
	政府保証第８３３回公営企業債券	100,000,000	102,432,000	
	政府保証第８３８回公営企業債券	100,000,000	102,949,000	
	政府保証第８３９回公営企業債券	100,000,000	103,047,000	
	政府保証第８４１回公営企業債券	100,000,000	103,982,000	
	政府保証第８４３回公営企業債券	100,000,000	103,425,000	
	政府保証第８４７回公営企業債券	100,000,000	103,452,000	
	政府保証第８４８回公営企業債券	100,000,000	103,217,000	
	政府保証第８５０回公営企業債券	100,000,000	103,641,000	
	政府保証第８５１回公営企業債券	100,000,000	103,391,000	
	政府保証第８５２回公営企業債券	100,000,000	103,448,000	

	政府保証第８５５回公営企業債券	100,000,000	103,594,000	
	政府保証第８５７回公営企業債券	100,000,000	104,899,000	
	政府保証第８５９回公営企業債券	100,000,000	104,645,000	
	政府保証第８６０回公営企業債券	100,000,000	105,105,000	
	政府保証第８６２回公営企業債券	100,000,000	106,100,000	
	政府保証第８６４回公営企業債券	100,000,000	106,708,000	
	政府保証第８７１回公営企業債券	100,000,000	106,923,000	
	政府保証第８７４回公営企業債券	100,000,000	106,613,000	
	政府保証第８７６回公営企業債券	200,000,000	215,590,000	
	政府保証第８７７回公営企業債券	200,000,000	215,674,000	
	政府保証第８７９回公営企業債券	200,000,000	213,730,000	
	政府保証第８８４回公営企業債券	100,000,000	105,279,000	
	政府保証第８８５回公営企業債券	100,000,000	107,163,000	
	政府保証第８８６回公営企業債券	100,000,000	107,833,000	
	政府保証１５年第２回公営企業債券	100,000,000	110,084,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊債券	政府保証第２回地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	213,230,000	
	第１回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,299,000	
	政府保証第３回地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	210,580,000	
	政府保証第４回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,592,000	
	第２回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,140,000	
	第３回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,594,000	
	２０年第２回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,368,000	
	政府保証第８回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,985,000	
	第４回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,198,000	
	第１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,581,000	
	政府保証第３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,859,000	
	政府保証第５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,515,000	
	政府保証第６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,994,000	
	２０年第４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,401,000	
	政府保証第８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,106,000	
	政府保証第１０回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,016,000	
	政府保証第１１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,713,000	
	２０年第７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,593,000	
	第１２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,965,000	
	政府保証第１３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,804,000	
	政府保証第１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,095,000	
	２０年第１２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,609,000	
	２０年第５回公営企業債券	100,000,000	108,636,000	
	２０年第９回公営企業債券	100,000,000	110,658,000	
	２０年第１１回公営企業債券	100,000,000	107,769,000	
	２０年第１５回公営企業債券	100,000,000	107,867,000	
	２０年第１７回公営企業債券	200,000,000	220,918,000	
	２０年第２４回公営企業債券	100,000,000	107,975,000	
	第５回公営企業債券	200,000,000	201,282,000	
	第６回公営企業債券	100,000,000	100,490,000	
	第１２回公営企業債券	200,000,000	206,674,000	
	第１３回公営企業債券	100,000,000	103,900,000	
	第１７回公営企業債券	200,000,000	208,762,000	
	第１９回公営企業債券	200,000,000	213,316,000	
	第２３回公営企業債券	100,000,000	107,061,000	
	第２４回公営企業債券	100,000,000	107,205,000	
	政府保証第１８７回首都高速道路債券	200,000,000	205,028,000	
	政府保証第１８９回首都高速道路債券	100,000,000	102,311,000	
	政府保証第１９０回首都高速道路債券	100,000,000	102,597,000	

	政府保証第１９７回首都高速道路債券	100,000,000	103,888,000	
	首都高速道路株式会社第５回社債	100,000,000	100,891,000	
	第９回首都高速道路債券	100,000,000	103,350,000	
	政府保証第１４４回阪神高速道路債券	100,000,000	103,868,000	
	政府保証第１４８回阪神高速道路債券	100,000,000	103,607,000	
	第６回阪神高速道路債券	100,000,000	103,508,000	
	政府保証第１７６回中小企業債券	100,000,000	102,352,000	
	政府保証第１７８回中小企業債券	100,000,000	102,507,000	
	政府保証第１８４回中小企業債券	100,000,000	103,361,000	
	政府保証第１８７回中小企業債券	100,000,000	104,536,000	
	政府保証第１９１回中小企業債券	200,000,000	213,648,000	
	株式会社日本政策金融公庫第７回社債（一般担保付）	100,000,000	100,828,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊債券	政府保証第１回日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,421,000	
	政府保証第４回日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,778,000	
	第２３回中小企業債券	100,000,000	101,279,000	
	第８回国際協力銀行債券	100,000,000	100,464,000	
	第１２回国際協力銀行債券	100,000,000	102,858,000	
	第１５回国際協力銀行債券	100,000,000	103,488,000	
	第１６回国際協力銀行債券	100,000,000	109,362,000	
	第１９回国際協力銀行債券	100,000,000	106,169,000	
	第２１回国際協力銀行債券	100,000,000	104,285,000	
	第２５回国際協力銀行債券	100,000,000	106,605,000	
	第２７回国際協力銀行債券	100,000,000	106,451,000	
	第２９回国際協力銀行債券	100,000,000	106,779,000	
	政府保証第１６回都市再生債券	100,000,000	100,458,000	
	第１６回都市再生債券	100,000,000	106,319,000	
	第２４回都市再生債券	100,000,000	107,640,000	
	第３４回都市再生債券	100,000,000	103,881,000	
	第３５回都市再生債券	100,000,000	100,809,000	
	第４３回都市再生債券	100,000,000	102,224,000	
	政府保証第２７回本州四国連絡橋債券	100,000,000	103,902,000	
	第２回本州四国連絡橋債券	100,000,000	102,988,000	
	第３２２回東京交通債券	100,000,000	111,073,000	
	第３２３回東京交通債券	100,000,000	114,244,000	
	第３２４回東京交通債券	100,000,000	114,346,000	
	第３４４回東京交通債券	100,000,000	104,035,000	
	政府保証第１７４回預金保険機構債券	100,000,000	100,459,000	
	政府保証第１７７回預金保険機構債券	100,000,000	100,249,000	
	貸付債権担保第１８回住宅金融公庫債券	45,029,000	46,768,920	
	貸付債権担保Ｓ種第１回住宅金融支援機構債券	96,484,000	101,547,480	
	貸付債権担保第１回住宅金融支援機構債券	323,285,000	339,271,443	
	貸付債権担保Ｓ種第２回住宅金融支援機構債券	50,010,000	52,912,580	
	貸付債権担保第８回住宅金融支援機構債券	134,532,000	140,589,975	
	貸付債権担保Ｓ種第１２回住宅金融支援機構債券	68,902,000	72,443,562	
	貸付債権担保第２４回住宅金融支援機構債券	77,520,000	82,760,352	
	貸付債権担保第２５回住宅金融支援機構債券	76,442,000	81,377,859	
	貸付債権担保第２６回住宅金融支援機構債券	153,844,000	162,342,342	
	貸付債権担保Ｓ種第１７回住宅金融支援機構債券	216,843,000	226,017,627	
	貸付債権担保Ｓ種第１８回住宅金融支援機構債券	72,507,000	75,104,925	
	貸付債権担保第３４回住宅金融支援機構債券	87,210,000	90,563,224	
	貸付債権担保第３５回住宅金融支援機構債券	90,268,000	93,688,254	
	貸付債権担保第３６回住宅金融支援機構債券	90,814,000	93,802,688	
	貸付債権担保第３９回住宅金融支援機構債券	185,962,000	187,929,477	
	貸付債権担保第４２回住宅金融支援機構債券	94,635,000	95,089,248	

	貸付債権担保第４３回住宅金融支援機構債券	95,095,000	96,857,110	
	貸付債権担保第４５回住宅金融支援機構債券	95,695,000	98,775,422	
	貸付債権担保第４９回住宅金融支援機構債券	97,413,000	100,147,382	
	貸付債権担保第５０回住宅金融支援機構債券	97,933,000	99,944,543	
	貸付債権担保第５１回住宅金融支援機構債券	98,223,000	100,066,645	
	貸付債権担保第５３回住宅金融支援機構債券	99,130,000	99,651,423	
	貸付債権担保Ｓ種第１回住宅金融公庫債券	35,535,000	36,437,589	
	貸付債権担保Ｓ種第３回住宅金融公庫債券	110,085,000	114,546,745	
	貸付債権担保Ｓ種第５回住宅金融公庫債券	38,799,000	40,290,821	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊債券	貸付債権担保Ｓ種第６回住宅金融公庫債券	41,546,000	44,099,832	
	貸付債権担保Ｓ種第７回住宅金融公庫債券	169,084,000	179,152,952	
	貸付債権担保Ｓ種第８回住宅金融公庫債券	43,129,000	45,491,175	
	貸付債権担保Ｓ種第９回住宅金融公庫債券	43,038,000	45,578,102	
	貸付債権担保Ｓ種第１０回住宅金融公庫債券	44,516,000	47,072,999	
	貸付債権担保第７回住宅金融公庫債券	31,568,000	32,779,579	
	貸付債権担保第１０回住宅金融公庫債券	71,830,000	73,188,305	
	貸付債権担保第１１回住宅金融公庫債券	39,154,000	38,728,787	
	貸付債権担保第１２回住宅金融公庫債券	41,723,000	42,947,152	
	貸付債権担保第２０回住宅金融公庫債券	94,326,000	99,123,420	
	貸付債権担保第２５回住宅金融公庫債券	50,721,000	52,287,771	
	貸付債権担保第２８回住宅金融公庫債券	54,524,000	56,269,858	
	貸付債権担保第２９回住宅金融公庫債券	175,992,000	181,908,851	
	貸付債権担保第３１回住宅金融公庫債券	62,133,000	63,769,583	
	貸付債権担保第３２回住宅金融公庫債券	190,611,000	195,702,219	
	貸付債権担保第３４回住宅金融公庫債券	65,137,000	67,408,327	
	貸付債権担保第３６回住宅金融公庫債券	61,984,000	64,344,350	
	貸付債権担保第３７回住宅金融公庫債券	62,647,000	65,024,453	
	貸付債権担保第３９回住宅金融公庫債券	187,653,000	194,157,052	
	貸付債権担保第４０回住宅金融公庫債券	124,644,000	129,563,698	
	貸付債権担保第４１回住宅金融公庫債券	64,067,000	67,229,987	
	貸付債権担保第４２回住宅金融公庫債券	61,718,000	65,758,060	
	貸付債権担保第４７回住宅金融公庫債券	59,572,000	62,886,586	
	貸付債権担保第５１回住宅金融公庫債券	190,224,000	200,560,772	
	貸付債権担保第５３回住宅金融公庫債券	64,338,000	67,316,849	
	政府保証第９回国民生活債券	200,000,000	202,764,000	
	政府保証第１２回国民生活債券	100,000,000	102,613,000	
	政府保証第１５回国民生活債券	100,000,000	103,871,000	
	政府保証第１９回国民生活債券	125,000,000	132,912,500	
	政府保証第２０回国民生活債券	100,000,000	103,124,000	
	第３６回国民生活債券	200,000,000	202,030,000	
	第１１回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	106,501,000	
	い第６９４号商工債	100,000,000	101,069,000	
	い第７０４号商工債	200,000,000	204,402,000	
	い第７０５号商工債	100,000,000	102,387,000	
	い第７０７号商工債	200,000,000	204,880,000	
	い第７１０号商工債	200,000,000	203,328,000	
	い第７１３号商工債	100,000,000	101,362,000	
	い第７１４号商工債	100,000,000	101,666,000	
	い第７１５号商工債	100,000,000	101,100,000	
	い第７１６号商工債	100,000,000	101,118,000	
	い第７１７号商工債	100,000,000	101,118,000	
	い第７２６号商工債	100,000,000	100,188,000	
	い第６９５号農林債	100,000,000	101,100,000	
	い第６９７号農林債	100,000,000	101,746,000	

	い第７０１号農林債	100,000,000	102,050,000	
	い第７０４号農林債	100,000,000	102,039,000	
	い第７０８号農林債	100,000,000	101,974,000	
	い第７１５号農林債	200,000,000	202,024,000	
	い第７１７号農林債	100,000,000	101,178,000	
	い第７１８号農林債	100,000,000	101,033,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊債券	い第７２０号農林債	100,000,000	100,861,000	
	い第７２１号農林債	100,000,000	100,691,000	
	い第７２４号農林債	100,000,000	100,288,000	
	い第７２５号農林債	100,000,000	99,906,000	
	い第７２８号農林債	100,000,000	100,432,000	
	い第７２９号農林債	100,000,000	101,225,000	
	い第７３０号農林債	100,000,000	101,022,000	
	第２１９回信金中金債（５年）	100,000,000	101,043,000	
	第２２２回信金中金債（５年）	100,000,000	101,535,000	
	第２２３回信金中金債（５年）	100,000,000	101,774,000	
	第２２４回信金中金債（５年）	100,000,000	101,798,000	
	第２２５回信金中金債（５年）	100,000,000	101,664,000	
	第２２８回信金中金債（５年）	100,000,000	102,193,000	
	第２３０回信金中金債（５年）	200,000,000	203,960,000	
	第２３１回信金中金債（５年）	100,000,000	102,261,000	
	第２３４回信金中金債（５年）	100,000,000	102,022,000	
	第２３７回信金中金債（５年）	100,000,000	101,813,000	
	第２３８回信金中金債（５年）	100,000,000	101,444,000	
	第２４３回信金中金債（５年）	100,000,000	101,087,000	
	第２４６回信金中金債（５年）	100,000,000	100,927,000	
	第２４８回信金中金債（５年）	100,000,000	100,570,000	
	第２５１回信金中金債（５年）	100,000,000	99,795,000	
	第１２２号商工債（３年）	100,000,000	100,128,000	
	第１２４号商工債（３年）	100,000,000	100,147,000	
	政府保証第５回東日本高速道路債券	100,000,000	107,375,000	
	政府保証第８回中日本高速道路債券	100,000,000	107,318,000	
	政府保証第１０回中日本高速道路債券	172,000,000	183,560,120	
	政府保証第２０回中日本高速道路債券	100,000,000	105,238,000	
	中日本高速道路株式会社第２回社債	100,000,000	103,579,000	
	中日本高速道路株式会社第５回社債	100,000,000	107,482,000	
	中日本高速道路株式会社第６回社債	100,000,000	106,678,000	
	中日本高速道路株式会社第１４回社債	100,000,000	100,757,000	
	政府保証第３回西日本高速道路債券	100,000,000	106,733,000	
	政府保証第２０回西日本高速道路債券	100,000,000	105,146,000	
特殊債券 小計		34,667,074,000	36,159,208,465	
社債券	フランス電力第１回円貨社債（２００９）	100,000,000	99,128,000	
	ジーディーエフ・スエズ第１回円貨社債（２００９）	100,000,000	98,172,000	
	第１回スウェーデン輸出信用銀行円貨債券（２００９）	100,000,000	100,517,000	
	一般担保第２回住宅金融支援機構債券	200,000,000	213,096,000	
	一般担保第６回住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,010,000	
	一般担保第１１回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,132,000	
	一般担保第１４回住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,415,000	
	一般担保第１７回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,497,000	
	一般担保第２１回住宅金融支援機構債券	200,000,000	216,004,000	
	一般担保第２３回住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,393,000	
	一般担保第２５回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,387,000	
	一般担保第２９回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,255,000	
	一般担保第３０回住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,294,000	

	一般担保第４１回住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,892,000	
	一般担保第４３回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,169,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	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	202,980,000	
	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	102,520,000	
	第１１回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	99,308,000	
	第１７回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	93,800,000	
	第２２回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	100,933,000	
	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	94,809,000	
	ナショナル・オーストラリア銀行第４回円貨社債（２０１０）	100,000,000	99,839,000	
	ナショナル・オーストラリア銀行第６回円貨社債（２０１１）	100,000,000	98,852,000	
	ウエストパック・バンキング・コーポ・第２回円貨社債２００９	100,000,000	102,584,000	
	ウエストパック・バンキング・コーポ・第５回円貨社債２０１０	200,000,000	200,410,000	
	ウエストパック・バンキング・コーポ・第７回円貨社債２０１０	100,000,000	99,572,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行第１回円貨社債２００８	100,000,000	101,216,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行第１回円貨社債２００９	100,000,000	102,402,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行第５回円貨社債２０１０	100,000,000	100,112,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行第６回円貨社債２０１１	100,000,000	98,986,000	
	ウォルマート・ストアーズ・インク第３回円貨社債（２００９）	100,000,000	102,167,000	
	ウォルマート・ストアーズ・インク第４回円貨社債（２０１０）	100,000,000	100,805,000	
	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	99,307,000	
	キリンホールディングス株式会社第１回無担保社債	100,000,000	100,956,000	
	キリンホールディングス株式会社第３回無担保社債	100,000,000	106,186,000	
	味の素株式会社第１７回無担保社債	100,000,000	100,494,000	
	日本たばこ産業株式会社第５回社債	100,000,000	101,939,000	
	株式会社セブン＆アイ・ホールディングス第５回無担保社債	100,000,000	101,087,000	
	住友化学株式会社第２３回無担保社債	100,000,000	101,147,000	
	住友化学株式会社第４３回無担保社債	100,000,000	104,214,000	
	三菱化学株式会社第３７回無担保社債	100,000,000	107,920,000	
	三井化学株式会社第３１回無担保社債	100,000,000	100,673,000	
	花王株式会社第２回無担保社債	100,000,000	102,280,000	
	エーザイ株式会社第６回無担保社債	100,000,000	101,850,000	
	エーザイ株式会社第７回無担保社債	100,000,000	104,748,000	
	第一三共株式会社第２回無担保社債	100,000,000	107,019,000	
	新日本石油株式会社第２６回無担保社債	100,000,000	107,357,000	
	株式会社ブリヂストン第４回無担保社債	100,000,000	100,808,000	
	新日本製鐵株式会社第５２回無担保社債	100,000,000	102,959,000	
	新日本製鐵株式会社第５６回無担保社債	100,000,000	102,702,000	
	新日本製鐵株式会社第６２回無担保社債	100,000,000	102,054,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	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	101,497,000	
	株式会社豊田自動織機第１５回無担保社債	100,000,000	104,498,000	
	株式会社東芝第５０回無担保社債	100,000,000	100,657,000	
	三菱電機株式会社第４２回無担保社債	100,000,000	102,083,000	
	パナソニック株式会社第７回無担保社債	100,000,000	102,302,000	
	シャープ株式会社第２２回無担保社債	100,000,000	102,318,000	
	シャープ株式会社第２４回無担保社債	100,000,000	101,186,000	
	ソニー株式会社第１７回無担保社債	100,000,000	103,719,000	
	ソニー株式会社第２５回無担保社債	100,000,000	102,236,000	
	ソニー株式会社第２６回無担保社債	100,000,000	108,185,000	
	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	104,090,000	
	三菱重工業株式会社第１７回無担保社債	100,000,000	100,607,000	
	三菱重工業株式会社第２２回無担保社債	100,000,000	107,740,000	
	トヨタ自動車株式会社第７回無担保社債	200,000,000	204,078,000	
	トヨタ自動車株式会社第９回無担保社債	100,000,000	101,858,000	
	トヨタ自動車株式会社第１０回無担保社債	100,000,000	106,945,000	
	アイシン精機株式会社第５回無担保社債	100,000,000	102,955,000	
	大日本印刷株式会社第１回無担保社債	200,000,000	204,648,000	
	伊藤忠商事株式会社第６２回無担保社債	100,000,000	100,472,000	
	三井物産株式会社第５８回無担保社債	100,000,000	106,616,000	
	住友商事株式会社第２９回無担保社債	100,000,000	101,200,000	
	三菱商事株式会社第４６回無担保社債	100,000,000	102,433,000	
	三菱商事株式会社第５３回無担保社債	100,000,000	101,524,000	
	三菱商事株式会社第７０回無担保社債	100,000,000	107,197,000	
	三菱商事株式会社第７６回無担保社債	100,000,000	101,578,000	
	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	101,261,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第１３回無担保社債	100,000,000	101,586,000	
	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	102,056,000	
	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	306,192,000	
	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	101,480,000	
	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	101,219,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第１９回無担保社債	200,000,000	201,820,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第２１回無担保社債	100,000,000	100,411,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第２３回無担保社債	100,000,000	99,867,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第５７回無担保社債	200,000,000	218,604,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第８３回無担保社債	200,000,000	213,554,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第８７回無担保社債	100,000,000	106,912,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第９８回無担保社債	100,000,000	101,129,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第１００回無担保社債	100,000,000	101,648,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第１０４回無担保社債	200,000,000	204,738,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第１０６回無担保社債	300,000,000	304,539,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第１０７回無担保社債	100,000,000	105,581,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第１０９回無担保社債	100,000,000	101,268,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第１１６回無担保社債	100,000,000	100,377,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第３回２号無担保社債	200,000,000	202,288,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第２８回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,231,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第３２回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,271,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	株式会社三井住友銀行第４４回無担保社債	100,000,000	101,625,000	

	株式会社三井住友銀行第４５回無担保社債	200,000,000	203,796,000	
	株式会社三井住友銀行第４７回無担保社債	100,000,000	101,508,000	
	株式会社三井住友銀行第４８回無担保社債	100,000,000	101,213,000	
	株式会社三井住友銀行第５０回無担保社債	100,000,000	100,394,000	
	株式会社三井住友銀行第５１回無担保社債	100,000,000	99,793,000	
	株式会社三井住友銀行第５２回無担保社債	100,000,000	100,522,000	
	株式会社三井住友銀行第２２回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	100,378,000	
	株式会社三井住友銀行第２３回無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	203,304,000	
	株式会社三井住友銀行第２４回無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	201,946,000	
	株式会社みずほ銀行第３回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,316,000	
	ＮＴＴファイナンス株式会社第３７回無担保社債	100,000,000	101,095,000	
	トヨタファイナンス株式会社第２１回無担保社債	100,000,000	106,904,000	
	トヨタファイナンス株式会社第２５回無担保社債	100,000,000	102,879,000	
	野村ホールディングス株式会社第２２回無担保社債	100,000,000	99,956,000	
	野村ホールディングス株式会社第２３回無担保社債	100,000,000	100,823,000	
	大和証券キャピタル・マーケッツ株式会社第２回無担保社債	100,000,000	99,227,000	
	三菱地所株式会社第４８回無担保社債	100,000,000	112,494,000	
	三菱地所株式会社第７０回無担保社債	100,000,000	103,014,000	
	三菱地所株式会社第７９回無担保社債	100,000,000	106,453,000	
	三菱地所株式会社第８３回無担保社債	100,000,000	108,435,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第７回社債（一般担保付）	200,000,000	229,958,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第１３回社債（一般担保付）	100,000,000	113,293,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第１５回社債（一般担保付）	100,000,000	113,770,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第２１回無担保社債	100,000,000	107,796,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第２７回無担保普通社債	100,000,000	101,963,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第３３回無担保普通社債	100,000,000	103,749,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第３７回無担保普通社債	100,000,000	103,292,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第４３回無担保普通社債	100,000,000	107,160,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第５０回無担保普通社債	100,000,000	107,130,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第５２回無担保普通社債	100,000,000	105,943,000	
	西日本旅客鉄道株式会社第７回社債（一般担保付）	100,000,000	111,323,000	
	西日本旅客鉄道株式会社第１１回無担保社債	100,000,000	109,145,000	
	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	113,260,000	
	東海旅客鉄道株式会社第１０回無担保普通社債	100,000,000	104,659,000	
	東海旅客鉄道株式会社第２０回無担保普通社債	200,000,000	213,214,000	
	東海旅客鉄道株式会社第２５回無担保普通社債	100,000,000	106,648,000	
	東海旅客鉄道株式会社第５１回無担保普通社債	100,000,000	105,221,000	
	東京地下鉄株式会社第３回社債（一般担保付）	100,000,000	106,542,000	
	東京地下鉄株式会社第８回社債（一般担保付）	100,000,000	107,759,000	
	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	106,983,000	
	日本電信電話株式会社第４７回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	100,708,000	
	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	103,423,000	
	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	104,247,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	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	213,906,000	
	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	106,398,000	
	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	105,447,000	

	日本電信電話株式会社第５９回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	106,595,000	
	株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第１５回無担保社債	100,000,000	108,158,000	
	株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第１６回無担保社債	100,000,000	101,923,000	
	東京電力株式会社第４５７回社債	100,000,000	72,790,000	
	東京電力株式会社第５０７回社債	100,000,000	90,784,000	
	東京電力株式会社第５１１回社債	100,000,000	88,246,000	
	東京電力株式会社第５１３回社債	100,000,000	87,990,000	
	東京電力株式会社第５１４回社債	100,000,000	86,137,000	
	東京電力株式会社第５１５回社債	100,000,000	84,440,000	
	東京電力株式会社第５１６回社債	100,000,000	83,396,000	
	東京電力株式会社第５１８回社債	100,000,000	81,823,000	
	東京電力株式会社第５１９回社債	100,000,000	80,841,000	
	東京電力株式会社第５２１回社債	100,000,000	80,074,000	
	東京電力株式会社第５２２回社債	100,000,000	79,712,000	
	東京電力株式会社第５３９回社債	100,000,000	72,886,000	
	東京電力株式会社第５４１回社債	100,000,000	92,900,000	
	東京電力株式会社第５４２回社債	100,000,000	72,633,000	
	東京電力株式会社第５４４回社債	100,000,000	73,882,000	
	中部電力株式会社第４０５回社債	100,000,000	111,025,000	
	中部電力株式会社第４０６回社債	200,000,000	220,370,000	
	中部電力株式会社第４２６回社債	100,000,000	110,983,000	
	中部電力株式会社第４６６回社債	100,000,000	102,533,000	
	中部電力株式会社第４７８回社債	100,000,000	104,714,000	
	中部電力株式会社第４８０回社債	100,000,000	104,438,000	
	中部電力株式会社第４８４回社債	100,000,000	101,994,000	
	関西電力株式会社第４３３回社債（一般担保付）	100,000,000	101,787,000	
	関西電力株式会社第４３５回社債（一般担保付）	100,000,000	101,792,000	
	関西電力株式会社第４４３回社債（一般担保付）	100,000,000	102,345,000	
	関西電力株式会社第４４８回社債（一般担保付）	100,000,000	106,758,000	
	関西電力株式会社第４５４回社債（一般担保付）	100,000,000	101,999,000	
	関西電力株式会社第４６３回社債（一般担保付）	100,000,000	103,582,000	
	関西電力株式会社第４６６回社債（一般担保付）	100,000,000	101,354,000	
	中国電力株式会社第２９８回社債（一般担保付）	100,000,000	111,156,000	
	中国電力株式会社第３０６回社債（一般担保付）	100,000,000	112,772,000	
	中国電力株式会社第３１１回社債（一般担保付）	100,000,000	110,758,000	
	中国電力株式会社第３５０回社債（一般担保付）	100,000,000	102,494,000	
	中国電力株式会社第３５４回社債（一般担保付）	100,000,000	105,296,000	
	北陸電力株式会社第２７７回社債（一般担保付）	100,000,000	102,306,000	
	北陸電力株式会社第２８３回社債（一般担保付）	100,000,000	105,701,000	
	北陸電力株式会社第２８８回社債（一般担保付）	100,000,000	105,125,000	
	東北電力株式会社第３８３回社債（一般担保付）	100,000,000	110,462,000	
	東北電力株式会社第４１４回社債（一般担保付）	100,000,000	100,231,000	
	東北電力株式会社第４１６回社債（一般担保付）	100,000,000	98,171,000	
	東北電力株式会社第４２０回社債（一般担保付）	100,000,000	101,391,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	東北電力株式会社第４３５回社債（一般担保付）	100,000,000	104,300,000	
	四国電力株式会社第２５３回社債（一般担保付）	100,000,000	92,725,000	
	四国電力株式会社第２５７回社債（一般担保付）	100,000,000	102,149,000	
	九州電力株式会社第３７１回社債（一般担保付）	100,000,000	97,462,000	
	九州電力株式会社第３７２回社債（一般担保付）	100,000,000	100,344,000	
	九州電力株式会社第３７６回社債（一般担保付）	100,000,000	101,814,000	
	九州電力株式会社第３８４回社債（一般担保付）	100,000,000	102,941,000	
	九州電力株式会社第３８７回社債（一般担保付）	100,000,000	103,630,000	
	九州電力株式会社第３９１回社債（一般担保付）	100,000,000	104,632,000	

	九州電力株式会社第３９９回社債（一般担保付）	100,000,000	101,534,000	
	九州電力株式会社第４０５回社債（一般担保付）	100,000,000	104,558,000	
	北海道電力株式会社第２５７回社債（一般担保付）	100,000,000	112,635,000	
	北海道電力株式会社第２８２回社債（一般担保付）	100,000,000	101,662,000	
	北海道電力株式会社第２８４回社債（一般担保付）	100,000,000	102,733,000	
	北海道電力株式会社第２８５回社債（一般担保付）	100,000,000	103,705,000	
	沖縄電力株式会社第９回社債（一般担保付）	100,000,000	100,496,000	
	電源開発株式会社第１４回無担保社債	100,000,000	102,748,000	
	電源開発株式会社第１６回無担保社債	100,000,000	104,786,000	
	電源開発株式会社第１７回無担保社債	100,000,000	105,036,000	
	電源開発株式会社第１９回無担保社債	100,000,000	104,773,000	
	電源開発株式会社第２１回無担保社債	100,000,000	103,478,000	
	電源開発株式会社第２９回無担保社債	100,000,000	100,561,000	
	電源開発株式会社第３０回無担保社債	100,000,000	99,910,000	
	東京瓦斯株式会社第３０回無担保社債	100,000,000	104,243,000	
	大阪瓦斯株式会社第７回無担保社債	100,000,000	114,601,000	
	大阪瓦斯株式会社第９回無担保社債	100,000,000	113,494,000	
	大阪瓦斯株式会社第２５回無担保社債	100,000,000	102,707,000	
	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	202,324,000	
	株式会社エヌ・ティ・ティ・データ第２１回無担保社債	100,000,000	105,746,000	
	株式会社エヌ・ティ・ティ・データ第２４回無担保社債	100,000,000	100,889,000	
社債券 小計		24,200,000,000	24,780,385,000	
合計		339,703,474,000	353,751,331,467	

（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。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】平成24年２月29日

Ⅰ 資産総額	2,446,789,085 円
Ⅱ 負債総額	16,680,747 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,430,108,338 円
Ⅳ 発行済口数	2,139,231,842 口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1360 円
１万口当たり純資産額	11,360 円

＜参考＞
マザーファンドの現況（平成24年２月29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	383,519,906,948 円
Ⅱ 負債総額	15,694,201,456 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	367,825,705,492 円
Ⅳ 発行済口数	306,012,204,937 口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2020 円
１万口当たり純資産額	12,020 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： 12,000株
発行済株式総数： 3,000株
最近５年間における資本金の額の増減：なし

（２）委託会社の機構

① 会社の意思決定機構

会社に取締役3名以上、監査役1名以上をおきます。取締役及び監査役は、株主総会において選任され、又は解任されます。

取締役及び監査役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、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、会長1名及び副社長、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。

社長にさしつかえあるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位に従い、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに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、取締役及び監査役の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行います。

② 投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

運用担当役員を委員長とする運用委員会において、ファンドの運用の基本方針や運用ガイドラインなどを決定します。運用委員会で決定された運用の基本方針等に基づいて、運用各部において資産配分や個別資産の運用に係る運用計画を策定し、運用各部の長が承認します。

［DO（実行）］

運用各部の運用担当者は、運用ガイドラインや運用計画に沿って、ポートフォリオ構築及びファンド管理、運用の指図を行います。売買の執行は、運用各部から独立したトレーディング部署が行います。

［CHECK（検証・評価）］

運用各部の長は、運用が運用計画に沿って行われているかの確認を行います。

毎月開催される運用委員会では、パフォーマンスや運用プロセスのモニタリングを通じて、ファンドの品質管理を行います。
また、運用に関するリスク管理と法令遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理関連部門及びコンプライアンス関連部門が担当し、これを運用部門及び取締役等にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持するよう努めます。
さらに、内部監査部門は、委託会社の業務全般について内部管理体制の妥当性を検証、評価します。その評価結果を取締役等へ報告するとともに、指摘事項の是正状況の事後点検を行います。

委託会社の機構は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

平成24年２月29日現在、住信アセットマネジメント株式会社が運用の指図を行っている証券投資信託は次のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	167	1,334,466
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	167	1,334,466

（ご参考）平成24年２月29日現在、中央三井アセットマネジメント株式会社が運用の指図を行っている証券投資信託は次のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	133	2,511,956
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	701
単位型公社債投資信託	0	0
合計	138	2,512,657

3【委託会社等の経理状況】

（イ）委託者の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）第2条に基づき、同規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

なお、前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）は、改正前の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき、当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）は、改正後の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）第38条及び第57条に基づき、同規則並びに、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表および中間財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

（ロ）委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）の財務諸表については、あずさ監査法人により監査を受け、また、当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。また、委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期事業年度の中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により、平成22年7月1日をもって有限責任 あずさ監査法人となっております。

(1)【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 （平成22年3月31日現在）		当事業年度 （平成23年3月31日現在）	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金	※2	5,642,056	※2	6,223,302
前払金		6,819		―
前払費用		35,081		34,720
未収委託者報酬		942,664		953,916
未収運用受託報酬		48,083		42,516
繰延税金資産		44,119		50,152
その他		129		34
流動資産合計		6,718,954		7,304,641
固定資産				
有形固定資産				
建物		49,765		38,802
器具備品		26,485		27,919

有形固定資産合計	※1	76,250	※1	66,721
無形固定資産				
ソフトウェア		95,682		91,774
その他無形固定資産		126		1,415
無形固定資産合計		95,808		93,189
投資その他の資産				
投資有価証券		245,516		239,090
敷金・保証金		238,033		228,451
長期前払費用		449		409
繰延税金資産		55,356		80,017
その他の投資		225		195
投資その他の資産合計		539,579		548,164
固定資産合計		711,639		708,076
資産合計		7,430,593		8,012,717

（単位：千円）

	前事業年度 （平成22年3月31日現在）		当事業年度 （平成23年3月31日現在）	
負債の部				
流動負債				
預り金		16,838		18,485
未払金		520,453		495,343
未払収益分配金		130		130
未払手数料	※2	454,590	※2	452,781
その他未払金		65,733		42,432
未払費用	※2	126,959	※2	135,706
未払法人税等		174,433		220,711
未払消費税等		11,758		25,316
賞与引当金		70,599		79,835
流動負債合計		921,042		975,399
固定負債				
退職給付引当金		122,901		171,115
固定負債合計		122,901		171,115
負債合計		1,043,943		1,146,514
純資産の部				
株主資本				

資本金	300,000	300,000
利益剰余金		
利益準備金	50,500	53,500
その他利益剰余金		
別途積立金	5,100,000	5,100,000
繰越利益剰余金	942,449	1,421,205
利益剰余金合計	6,092,949	6,574,705
株主資本合計	6,392,949	6,874,705
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△ 6,299	△ 8,501
評価・換算差額等合計	△ 6,299	△ 8,501
純資産合計	6,386,650	6,866,203
負債・純資産合計	7,430,593	8,012,717

(2)【損益計算書】

（単位：千円）

		前事業年度 (自　平成21年4月1日 至　平成22年3月31日)		当事業年度 (自　平成22年4月1日 至　平成23年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		8,637,673		8,619,288
運用受託報酬		108,227		126,038
営業収益合計		8,745,901		8,745,326
営業費用				
支払手数料	※1	4,414,750	※1	4,301,606
広告宣伝費		123,104		67,247
公告費		2,520		2,744
受益証券発行費		95		―
調査費		835,300		898,998
調査費		85,751		87,937
委託調査費		747,629		809,173
図書費		1,918		1,887
営業雑経費		650,397		640,623
通信費		10,735		11,303
印刷費		164,695		152,354
協会費		9,726		10,102
諸会費		594		594
情報機器関連費		429,265		433,365

その他営業雑経費	35,380	32,903
営業費用合計	6,026,169	5,911,221
一般管理費		
給料	1,313,847	1,315,974
役員報酬	34,470	38,295
給料・手当	1,098,871	1,062,048
賞与	180,505	215,631
退職給付費用	52,327	63,772
役員退職慰労金	1,980	―
福利費	148,136	156,648
交際費	1,771	1,350
旅費交通費	43,688	31,880
租税公課	17,962	17,981
不動産賃借料	238,033	238,033
寄付金	3,745	7,972
減価償却費	58,878	57,385
敷金償却	―	2,804
諸経費	101,459	91,394
一般管理費合計	1,981,829	1,985,197
営業利益	737,901	848,907

（単位：千円）

		前事業年度 (自　平成21年4月1日 至　平成22年3月31日)		当事業年度 (自　平成22年4月1日 至　平成23年3月31日)
営業外収益				
受取配当金		1,046		1,280
有価証券利息		257		―
受取利息	※1	6,564	※1	14,783
投資有価証券売却益		1,179		756
その他		3,344		1,877
営業外収益合計		12,393		18,697
営業外費用				
投資有価証券売却損		12,836		480
固定資産除却損	※2	1,136		―
その他		820		242
営業外費用合計		14,794		722
経常利益		735,501		866,883

特別損失		
資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額	－	6,776
特別損失合計	－	6,776
税引前当期純利益	735,501	860,106
法人税、住民税及び事業税	333,431	377,534
法人税等調整額	△ 30,837	△ 29,183
法人税等合計	302,594	348,350
当期純利益	432,906	511,755

(3)【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）	当事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）
株主資本		
資本金		
前期末残高	300,000	300,000
当期変動額		
当期変動額合計	－	－
当期末残高	300,000	300,000
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	47,500	50,500
当期変動額		
剰余金の配当に伴う積立	3,000	3,000
当期変動額合計	3,000	3,000
当期末残高	50,500	53,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	4,100,000	5,100,000
当期変動額		
別途積立金の積立	1,000,000	－
当期変動額合計	1,000,000	－
当期末残高	5,100,000	5,100,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	1,542,542	942,449
当期変動額		

剰余金の配当	△ 33,000	△ 33,000
当期純利益	432,906	511,755
別途積立金の積立	△ 1,000,000	－
当期変動額合計	△ 600,093	478,755
当期末残高	942,449	1,421,205
利益剰余金合計		
前期末残高	5,690,042	6,092,949
当期変動額		
剰余金の配当	△ 30,000	△ 30,000
当期純利益	432,906	511,755
当期変動額合計	402,906	481,755
当期末残高	6,092,949	6,574,705
株主資本合計		
前期末残高	5,990,042	6,392,949
当期変動額		
剰余金の配当	△ 30,000	△ 30,000
当期純利益	432,906	511,755
当期変動額合計	402,906	481,755
当期末残高	6,392,949	6,874,705

（単位：千円）

	前事業年度 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）	当事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	△ 24,962	△ 6,299
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	18,662	△ 2,202
当期変動額合計	18,662	△ 2,202
当期末残高	△ 6,299	△ 8,501
評価・換算差額等合計		
前期末残高	△ 24,962	△ 6,299
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	18,662	△ 2,202
当期変動額合計	18,662	△ 2,202
当期末残高	△ 6,299	△ 8,501
純資産合計		

前期末残高	5,965,080	6,386,650
当期変動額		
剰余金の配当	△ 30,000	△ 30,000
当期純利益	432,906	511,755
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	18,662	△ 2,202
当期変動額合計	421,569	479,553
当期末残高	6,386,650	6,866,203

重要な会計方針

期別 項目	前事業年度 (自　平成21年4月 1日 至　平成22年3月31日)	当事業年度 (自　平成22年4月 1日 至　平成23年3月31日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	その他有価証券 時価のあるもの 決算末日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、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しております。） 時価のないもの 移動平均法による原価法によっております。	その他有価証券 時価のあるもの 同 左 時価のないもの 同 左
2 固定資産の減価償却の方法	有形固定資産 定率法によっております。 無形固定資産 定額法によっております。 ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。	有形固定資産 同 左 無形固定資産 同 左
3 引当金の計上基準	（1）賞与引当金 従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。 （2）退職給付引当金 従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当期末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しております。	（1）賞与引当金 同 左 （2）退職給付引当金 同 左
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。	同 左

会計方針の変更

前事業年度 (自　平成21年4月 1日 至　平成22年3月31日)	当事業年度 (自　平成22年4月 1日 至　平成23年3月31日)
	資産除去債務に関する会計基準等の適用

―	当事業年度より、「資産除去債務に関する会計基準」（企業会計基準第18号 平成20年3月31日）及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日）を適用しております。 これにより、当事業年度の営業利益及び経常利益が2,804千円減少し、税引前当期純利益が9,581千円減少しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 （平成22年3月31日現在）	当事業年度 （平成23年3月31日現在）
※1　有形固定資産の減価償却累計額 建　　物　38,352千円 器具備品　96,447千円 計　134,799千円 ※2　関係会社に対するものは次のとおりであります。 預金　3,498,856千円 未払手数料　353,462千円 未払費用　119,557千円	※1　有形固定資産の減価償却累計額 建　　物　49,316千円 器具備品　113,320千円 計　162,636千円 ※2　関係会社に対するものは次のとおりであります。 預金　3,477,508千円 未払手数料　333,570千円 未払費用　123,687千円

（損益計算書関係）

前事業年度 （自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）	当事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）
※1　関係会社に対するものは次のとおりであります。 支払手数料　4,065,257千円 受取利息　1,030千円 ※2　固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。 器具備品　1,136千円	※1　関係会社に対するものは次のとおりであります。 支払手数料　3,761,890千円 受取利息　6,579千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

株式の種類	前事業年度末	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	6,000	―	―	6,000

２．自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

３．当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

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21年6月29日定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成21年3月31日	平成21年6月29日

４．基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	配当金の原資	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成22年6月29日定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	5,000	平成22年3月31日	平成22年6月29日

当事業年度（自　平成22年4月1日　至　平成23年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

株式の種類	前事業年度末	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	6,000	－	－	6,000

２．自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

３．当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

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22年6月29日定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成22年3月31日	平成22年6月29日

４．基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成23年6月29日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

（1）配当金の総額　30,000千円

（2）配当金の原資　利益剰余金

（3）１株当たり配当額　5,000円

（4）基準日　平成23年3月31日

（5）効力発生日　平成23年6月29日

（リース取引関係）

前事業年度（自　平成21年4月1日　至　平成22年3月31日）	当事業年度（自　平成22年4月1日　至　平成23年3月31日）
該当事項はありません。	同左

（金融商品関係）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

（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。

１．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用し、必要な資金については内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクはきわめて低いものと考えております。また、投資有価証券は非上場株式と投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

売上債権の管理については、社内規程を定め、随時確認を行うなどの管理を行っております。なお、未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスクはきわめて低いものと考えております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

２．金融商品の時価に関する事項

平成22年3月31日（当社の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、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ものは、次表には含めておりません（（注２）を参照ください）。

（単位:千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	5,642,056	5,642,056	－
(2)未収委託者報酬	942,664	942,664	－
(3)投資有価証券 その他有価証券	46,016	46,016	－
(4)未払金	(520,453)	(520,453)	－

(*)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及び有価証券取引に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(4)未払金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額199,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	5,642,056	－	－	－
未収委託者報酬	942,664	－	－	－

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

１．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用し、必要な資金については内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクはきわめて低いものと考えております。また、投資有価証券は非上場株式と投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

売上債権の管理については、社内規程を定め、随時確認を行うなどの管理を行っております。なお、未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスクはきわめて低いものと考えております。

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

２．金融商品の時価に関する事項

平成23年3月31日（当社の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、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ものは、次表には含めておりません（（注２）を参照ください）。

（単位:千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	6,223,302	6,223,302	―
(2)未収委託者報酬	953,916	953,916	―
(3)投資有価証券 その他有価証券	39,590	39,590	―
(4)未払金	(495,343)	(495,343)	―

(*)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及び有価証券取引に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(4)未払金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額199,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位:千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	6,223,302	―	―	―
未収委託者報酬	953,916	―	―	―

（有価証券関係）

前事業年度（平成22年3月31日現在）

１．その他有価証券

（単位:千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの その他	5,362	6,387	1,025
小計	5,362	6,387	1,025
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	51,275	39,628	△ 11,646

小計	51,275	39,628	△ 11,646
計	56,637	46,016	△ 10,621

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 199,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

２．当事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
74,035	1,179	12,836

当事業年度（平成23年3月31日現在）

１．その他有価証券

（単位：千円）

区分	取得原価	貸借対照表計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	3,000	3,075	75
小計	3,000	3,075	75
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	50,925	36,515	△ 14,409
小計	50,925	36,515	△ 14,409
計	53,925	39,590	△ 14,334

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 199,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

２．当事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
7,639	756	480

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）
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。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）
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。

（退職給付関係）

前事業年度	当事業年度
（自　平成21年4月1日	（自　平成22年4月1日

至　平成22年3月31日）	至　平成23年3月31日）
1．採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。	1．採用している退職給付制度の概要 同左
2．退職給付債務及びその他に関する事項 退職給付債務　122,901千円 退職給付引当金　122,901千円 （1）当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。 （2）当社の退職給付債務は退職一時金のみです。	2．退職給付債務及びその他に関する事項 退職給付債務　171,115千円 退職給付引当金　171,115千円 （1）同左 （2）同左
3．退職給付費用に関する事項 退職給付費用　52,327千円 （1）当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。 （2）金額には確定拠出年金への掛金支払額13,326千円を含んでおります。	3．退職給付費用に関する事項 退職給付費用　63,772千円 （1）同左 （2）金額には確定拠出年金への掛金支払額13,307千円を含んでおります。
4．退職給付債務等の計算基礎 当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。	4．退職給付債務等の計算基礎 同左

（税効果会計関係）

前事業年度 （平成22年3月31日現在）	当事業年度 （平成23年3月31日現在）
1．繰延税金資産の発生の主な原因別の内訳 （繰延税金資産） 未払事業税　15,392千円 賞与引当金損金算入限度超過額　28,726千円 退職給付引当金損金算入限度超過額　50,008千円 有価証券評価差額　4,321千円 その他　1,025千円 繰延税金資産 合計　99,475千円	1．繰延税金資産の発生の主な原因別の内訳 （繰延税金資産） 未払事業税　17,667千円 賞与引当金損金算入限度超過額　32,484千円 退職給付引当金損金算入限度超過額　69,626千円 有価証券評価差額　5,832千円 その他　4,558千円 繰延税金資産 合計　130,169千円
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、注記を省略しております。	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差異の原因となった主な項目別の内訳 同左

（持分法損益等）

前事業年度 （平成22年3月31日現在）	当事業年度 （平成23年3月31日現在）
該当事項はありません。	同左

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

（関連情報）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

１．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

２．地域ごとの情報

（1）売上高

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

（追加情報）

当事業年度より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）

及び「セグメント情報の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。

（関連当事者情報）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	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）
親会社	住友信託銀行(株)	大阪市中央区	342,037	信託業務及び銀行業務	直接30%,間接70%	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料	4,065,257	未払手数料	353,462
							投資助言費用の支払	609,879	未払費用	119,557

（注）1．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

② 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

該当事項はありません。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

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

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所及び大阪証券取引所に上場）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	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）

親会社	住友信託銀行(株)	大阪市中央区	342,037	信託業務及び銀行業務	直接30%,間接70%	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料	3,761,890	未払手数料	333,570
							投資助言費用の支払	692,451	未払費用	123,687

（注）１．上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

② 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

該当事項はありません。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

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

住友信託銀行株式会社（非上場）

（１株当たり情報）

前事業年度 (自　平成21年4月1日 至　平成22年3月31日)	当事業年度 (自　平成22年4月1日 至　平成23年3月31日)
1株当たり純資産額　1,064,441円67銭	1株当たり純資産額　1,144,367円30銭
1株当たり当期純利益　72,151円14銭	1株当たり当期純利益　85,292円63銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	同左

（注）1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自　平成21年4月1日 至　平成22年3月31日)	当事業年度 (自　平成22年4月1日 至　平成23年3月31日)
当期純利益	432,906千円	511,755千円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	432,906千円	511,755千円

期中平均株式数	6,000株	6,000株

（重要な後発事象）

前事業年度 （自　平成21年4月1日 至　平成22年3月31日）	当事業年度 （自　平成22年4月1日 至　平成23年3月31日）
該当事項はありません。	同左

中間貸借対照表

（単位：千円）

		第26期中間会計期間末 （平成23年9月30日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		6,348,503
未収委託者報酬		931,255
未収運用受託報酬		30,340
繰延税金資産		42,883
その他		46,838
流動資産合計		7,399,822
固定資産		
有形固定資産		
建物		25,631
器具備品		22,797
有形固定資産合計	※1	48,428
無形固定資産		80,075
投資その他の資産		
投資有価証券		230,782
敷金・保証金		222,422
繰延税金資産		95,717
その他		754
投資その他の資産合計		549,677
固定資産合計		678,181
資産合計		8,078,003

負債の部		
流動負債		
未払金		489,894
未払費用		119,669
未払法人税等		143,080
賞与引当金		76,075
その他	※2	32,182
流動負債合計		860,902
固定負債		
退職給付引当金		188,834
固定負債合計		188,834
負債合計		1,049,736

（単位：千円）

	第26期中間会計期間末 （平成23年9月30日）
純資産の部	
株主資本	
資本金	300,000
利益剰余金	
利益準備金	56,500
その他利益剰余金	
別途積立金	5,100,000
繰越利益剰余金	1,583,847
利益剰余金合計	6,740,347
株主資本合計	7,040,347
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△ 12,079
評価・換算差額等合計	△ 12,079
純資産合計	7,028,267
負債純資産合計	8,078,003

中間損益計算書

（単位：千円）

	第26期中間会計期間 （自　平成23年4月1日 至　平成23年9月30日）

営業収益		
委託者報酬		4,032,339
運用受託報酬		51,906
営業収益合計		4,084,245
営業費用		2,765,368
一般管理費	※1	987,887
営業利益		330,990
営業外収益	※2	14,771
営業外費用		75
経常利益		345,686
特別損失	※1	16,061
税引前中間純利益		329,624
法人税、住民税及び事業税		139,960
法人税等調整額		△ 5,977
法人税等合計		133,982
中間純利益		195,641

中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

	第26期中間会計期間 （自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）
株主資本	
資本金	
当期首残高	300,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	－
当中間期末残高	300,000
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	53,500
当中間期変動額	
剰余金の配当に伴う積立	3,000
当中間期変動額合計	3,000
当中間期末残高	56,500
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	5,100,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	－
当中間期末残高	5,100,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	1,421,205

当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 33,000
中間純利益	195,641
当中間期変動額合計	162,641
当中間期末残高	1,583,847
利益剰余金合計	
当期首残高	6,574,705
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 30,000
中間純利益	195,641
当中間期変動額合計	165,641
当中間期末残高	6,740,347
株主資本合計	
当期首残高	6,874,705
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 30,000
中間純利益	195,641
当中間期変動額合計	165,641
当中間期末残高	7,040,347
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	△ 8,501
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 3,578
当中間期変動額合計	△ 3,578
当中間期末残高	△ 12,079
評価・換算差額等合計	
当期首残高	△ 8,501
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 3,578
当中間期変動額合計	△ 3,578
当中間期末残高	△ 12,079
純資産合計	
当期首残高	6,866,203
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 30,000
中間純利益	195,641
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 3,578
当中間期変動額合計	162,063
当中間期末残高	7,028,267

重要な会計方針

第26期中間会計期間
（自　平成23年4月1日

至　平成23年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

（評価差額は、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しております。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定率法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

3．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

（2）退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当期末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

追加情報

第26期中間会計期間

（自　平成23年4月1日

至　平成23年9月30日）

当中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第26期中間会計期間末
（平成23年9月30日）

※1　有形固定資産の減価償却累計額

建　　物	62,486千円
器具備品	119,721千円
計	182,208千円

※2　仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

第26期中間会計期間
（自　平成23年4月1日
至　平成23年9月30日）

※1　減価償却実施額

有形固定資産	20,670千円
無形固定資産	15,864千円

※2　営業外収益の主要項目

受取利息	10,373千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当期首	当期増加	当期減少	当中間会計期間末
普通株式　（株）	6,000	－	－	6,000

２．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成23年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成23年 3月31日	平成23年 6月29日

（リース取引関係）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

平成23年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、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ものは、次表には含めておりません（（注２）を参照ください）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	6,348,503	6,348,503	―
(2)未収委託者報酬	931,255	931,255	―
(3)投資有価証券 その他有価証券	31,282	31,282	―
(4)未払金	(489,894)	(489,894)	―

(*)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及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(4)未払金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額199,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

（有価証券関係）

第26期中間会計期間末（平成23年9月30日）

その他有価証券

（単位:千円）

区分	取得原価	貸借対照表計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	1,000	1,031	31
小計	1,000	1,031	31
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	50,650	30,251	△ 20,398
小計	50,650	30,251	△ 20,398
計	51,650	31,282	△ 20,367

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 199,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

（関連情報）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

１．製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

２．地域ごとの情報

(1)売上高

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2)有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第26期中間会計期間（自　平成23年4月1日　至　平成23年9月30日）
　該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）
第26期中間会計期間（自　平成23年4月1日　至　平成23年9月30日）
　該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）
第26期中間会計期間（自　平成23年4月1日　至　平成23年9月30日）
　該当事項はありません。

（１株当たり情報）

第26期中間会計期間 （自　平成23年4月1日 至　平成23年9月30日）
1株当たり純資産額　1,171,377円87銭 1株当たり中間純利益　32,606円94銭 なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第26期中間会計期間 （自　平成23年4月1日 至　平成23年9月30日）
中間純利益	195,641千円
普通株式に係る中間純利益	195,641千円
普通株主に帰属しない金額	―
普通株式の期中平均株式数	6,000株

（重要な後発事象）
　該当事項はありません。

次へ

＜参考＞中央三井アセットマネジメント株式会社の経理状況

（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25期事業年度（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）は、改正後の財務諸表等規則及び業府令に基づいて作成しております。

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

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

（２）委託会社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第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）、第25期事業年度（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）の財務諸表及び第26期中間会計期間（平成23年４月１日から平成23年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査及び中間監査を受けております。

次へ

独立監査人の監査報告書

平成２２年６月１０日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　　御中

有限責任監査法人 ト ー マ ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　松 崎 雅 則　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　平 木 達 也　印

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

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

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

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

以 上

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

次へ

独立監査人の監査報告書

平成２３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２２年４月１日から平成２３年３月３１日までの第２５期事業年度の財務諸表、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２３年３月３１日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

次へ

（１）貸借対照表

科目	第24期 平成22年３月31日 金額（千円）	第25期 平成23年３月31日 金額（千円）
（資産の部）		
Ⅰ 流動資産		
１．現金・預金	1,823,012	2,336,337
２．前払費用	92,464	56,149
３．未収委託者報酬	1,023,412	967,198
４．未収収益	102	53
５．繰延税金資産	30,247	43,658
６．その他	4,463	6,108
流動資産 計	2,973,703	3,409,505
Ⅱ 固定資産		
１．有形固定資産※１		
(1) 建物	24,815	7,448
(2) 器具備品	36,727	23,068
有形固定資産 計	61,543	30,517
２．無形固定資産		
(1) ソフトウェア	114,197	78,445
(2) 電話加入権	1,847	1,847
(3) 電話施設利用権	57	37
無形固定資産 計	116,102	80,330
３．投資その他の資産		
(1) 投資有価証券	74,897	69,135
(2) 長期貸付金	39,988	37,588
(3) 長期差入保証金	88,736	90,141
(4) 長期前払費用	4,915	2,216
(5) 会員権	25,000	25,000
(6) 貸倒引当金	△39,988	△37,588
投資その他の資産 計	193,549	186,494
固定資産 計	371,195	297,342
資 産 合 計	3,344,898	3,706,847

科目	第24期 平成22年３月31日 金額（千円）		第25期 平成23年３月31日 金額（千円）	
（負債の部）				
Ⅰ 流動負債				
１．預り金		3,792		3,682
２．未払金				
(1) 未払手数料	327,341		298,465	
(2) その他未払金	56,890	384,231	109,112	407,578
３．未払費用		279,266		365,151
４．未払法人税等		114,387		82,266
５．賞与引当金		46,407		50,180
６．資産除去債務		－		16,345
流動負債 計		828,085		925,203
Ⅱ 固定負債				
１．退職給付引当金		22,905		18,693
２．役員退職慰労引当金		31,800		－
３．繰延税金負債		－		1,600
４．その他		－		20,700
固定負債 計		54,705		40,993
負 債 合 計		882,791		966,197
（純資産の部）				
Ⅰ 株主資本				
１．資本金		300,000		300,000
２．資本剰余金				
(1) 資本準備金		50,000		50,000
資本剰余金 計		50,000		50,000
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		2,086,808		2,364,106
利益剰余金 計		2,112,210		2,389,507
株主資本計		2,462,210		2,739,507
Ⅱ 評価・換算差額等				
１．その他有価証券評価差額金		△103		1,142
評価・換算差額等計		△103		1,142
純資産合計		2,462,107		2,740,649
負債・純資産合計		3,344,898		3,706,847

（２）損益計算書

科目	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）		第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで) 金額（千円）	
Ⅰ 営業収益				
１．委託者報酬		9,668,856		9,561,211
営業収益 計		9,668,856		9,561,211
Ⅱ 営業費用				
１．支払手数料		3,855,512		3,634,705
２．広告宣伝費		89,996		83,750
３．調査費				
(1) 調査費	234,896		232,183	
(2) 委託調査費	2,921,144	3,156,040	3,098,589	3,330,773
４．営業雑経費				
(1) 通信費	14,562		14,141	
(2) 印刷費	192,040		206,247	
(3) 協会費	11,699		12,069	
(4) 諸会費	389	218,692	507	232,966
営業費用 計		7,320,241		7,282,194
Ⅲ 一般管理費				
１．給料				
(1) 役員報酬	57,119		62,111	
(2) 給料・手当	609,618		633,310	
(3) 賞与	132,613	799,351	158,866	854,287
２．福利厚生費		211,448		232,228
３．交際費		1,056		770
４．旅費交通費		20,394		21,590
５．租税公課		11,448		11,095
６．不動産賃借料		112,953		116,174
７．退職給付費用		6,497		7,250
８．役員退職慰労引当金繰入		12,900		8,250
９．賞与引当金繰入		46,407		50,180
10．減価償却費		56,560		53,926
11．諸経費		520,606		540,822
一般管理費 計		1,799,626		1,896,577
営業利益		548,988		382,439

科目	第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)		第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)	
	金額（千円）		金額（千円）	
Ⅳ 営業外収益				
１．受取配当金		3,000		63,400
２．受取利息		1,101		787
３．雑収入		333		4,513
営業外収益 計		4,435		68,700
Ⅴ 営業外費用				
１．雑損失※1		5,057		573
営業外費用 計		5,057		573
経常利益		548,366		450,566
Ⅵ 特別利益				
１．投資有価証券売却益		2,918		67,194
２．投資有価証券償還益		―		584
３．貸倒引当金戻入		2,400		2,400
特別利益 計		5,318		70,179
Ⅶ 特別損失				
１．投資有価証券売却損		17		344
２．固定資産除却損		―		980
３．資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額		―		12,305
４．減損損失※2		―		17,622
５．統合関連費用※1		9,577		51,394
特別損失 計		9,594		82,648
税引前当期純利益		544,090		438,098
法人税、住民税及び事業税	230,069		173,405	
法人税等調整額	△1,078	228,991	△12,604	160,801
当期純利益		315,099		277,297

（３）株主資本等変動計算書

		第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23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	1,771,709	2,086,808
	当期変動額　当期純利益	315,099	277,297
	当期末残高	2,086,808	2,364,106
利益剰余金合計	前期末残高	1,797,110	2,112,210
	当期変動額	315,099	277,297
	当期末残高	2,112,210	2,389,507
株主資本合計	前期末残高	2,147,110	2,462,210
	当期変動額	315,099	277,297
	当期末残高	2,462,210	2,739,507
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金	前期末残高	－	△103
	当期変動額　（純額）	△103	1,245
	当期末残高	△103	1,142
評価・換算差額等合計	前期末残高	－	△103
	当期変動額	△103	1,245
	当期末残高	△103	1,142
純資産合計	前期末残高	2,147,110	2,462,107
	当期変動額	314,996	278,542
	当期末残高	2,462,107	2,740,649

重要な会計方針

期別 項目	第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23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。 (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。	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 同左
２．固定資産の減価償却の方法		
(1) 有形固定資産	定率法を採用しております。 なお、耐用年数は、建物については主として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。	―
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

会計方針の変更

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
―	資産除去債務に関する会計基準の適用 当事業年度より、「資産除去債務に関する会計基準」（企業会計基準第18号 平成20年３月31日）及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第21号 平成20年３月31日）を適用しております。 これにより、営業利益及び経常利益は2,056千円、税引前当期純利益は14,362千円減少しております。

追加情報

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
―	当社は、役員への退職慰労金の支払に備えるため、役員に対する退職慰労金の支給見積額のうち、当事業年度末までに発生していると認められる額を「役員退職慰労引当金」として計上しておりましたが、役員に対する退職慰労金制度を廃止し、退職慰労金を打切り支給することとしました。 これに伴い、「役員退職慰労引当金」を全額取崩し、打切り支給額分13,950千円を固定負債の「その他」に含めて表示しております。

注記事項

１．貸借対照表関係

期別 項目	第24期 (平成22年３月31日)	第25期 (平成23年３月31日)
※１．有形固定資産の減価償却累計額	建物　28,053千円 器具備品　177,074千円	建物　33,765千円 器具備品　142,605千円

２．損益計算書関係

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23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	※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。 統合関連費用　51,394千円 ※２　当事業年度において、以下の資産グループについて減損損失を計上しました。 用途：処分予定資産／場所：本社事務所(東京都港区)／種類：建物、器具備品／金額：17,622千円 (経緯) 上記の資産グループについては、当社グループの経営統合に伴い、将来の使用見込みがなく除却される可能性が高い資産について、除去予定時の帳簿価額を減損損失として特別損失に計上しました。 (減損損失の金額) 建物　15,615千円 器具備品　2,007千円 合計　17,622千円 (グルーピングの方法) 当社は、基本的に全ての資産が一体となってキャッシュ・フローを生成しておりますが、将来使用見込みがなく処分される可能性が高いものについては、処分予定資産としてグルーピングしております。

３．株主資本等変動計算書関係

<table>
<tr><th>期別
項目</th><th>第24期
(平成21年４月１日から
平成22年３月31日まで)</th></tr>
<tr><td>１．発行済株式に関する事項</td><td><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></td></tr>
<tr><td>２．自己株式に関する事項</td><td>該当事項はありません。</td></tr>
<tr><td>３．新株予約権等に関する事項</td><td>該当事項はありません。</td></tr>
<tr><td>４．配当に関する事項</td><td>(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。</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>期別
項目</th><th>第25期
(平成22年４月１日から
平成23年３月31日まで)</th></tr>
<tr><td>１．発行済株式に関する事項</td><td><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></td></tr>
<tr><td>２．自己株式に関する事項</td><td>該当事項はありません。</td></tr>
<tr><td>３．新株予約権等に関する事項</td><td>該当事項はありません。</td></tr>
<tr><td>４．配当に関する事項</td><td>(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。</td></tr>
</table>

４．リース取引関係

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23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。	当社はリース取引を全く行っていないため、該当事項はありません。

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。

	貸借対照表上計上額（＊）	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。

第25期（平成22年４月１日から平成23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23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。

	貸借対照表上計上額（＊）	時価（＊）	差額
	千円	千円	千円
(1) 現金・預金	2,336,337	2,336,337	―
(2) 未収委託者報酬	967,198	967,198	―
(3) 投資有価証券			
その他有価証券	59,135	59,135	―
(4) 未払金	(407,578)	(407,578)	―

（＊）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	10,000

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

６．有価証券関係

第24期（平成22年３月31日）

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

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円
その他	9,897	10,000	△103
計	9,897	10,000	△103

２．当事業年度中に売却したその他有価証券

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
	千円	千円	千円
その他	64,901	2,918	17
計	64,901	2,918	17

３．時価評価されていない有価証券

内容	貸借対照表計上額（千円）
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。

第25期（平成23年３月31日）

１．その他有価証券

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円
その他	58,149	56,200	1,949
計	58,149	56,200	1,949

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円
その他	986	1,000	△13
計	986	1,000	△13

２．当事業年度中に売却したその他有価証券

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
	千円	千円	千円
その他	128,650	67,194	344
計	128,650	67,194	344

３．時価評価されていない有価証券

内容	貸借対照表計上額（千円）
その他有価証券	
非上場株式	10,000

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。

７．デリバティブ関係

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23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24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23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。	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） 退職給付債務 △22,905千円 退職給付引当金 △22,905千円 （注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。	２．退職給付債務に関する事項（平成23年３月31日現在） 退職給付債務 △18,693千円 退職給付引当金 △18,693千円 （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） 勤務費用 6,497千円 退職給付費用 6,497千円 （注）退職給付費用は、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22年４月１日から平成23年３月31日まで） 勤務費用 7,250千円 退職給付費用 7,250千円 （注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。

９．税効果会計関係

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23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 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	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 繰延税金資産 貸倒引当金繰入超過額　15,294千円 賞与引当金繰入超過額　20,418千円 資産除去債務　6,650千円 移転による除却予定資産減損　7,170千円 未払事業税　6,824千円 その他　19,740千円 繰延税金資産小計　76,099千円 評価性引当額　△32,440千円 繰延税金資産合計　43,658千円 繰延税金負債 その他有価証券評価差額金　△793千円 その他　△806千円 繰延税金負債合計　△1,600千円
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。	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　40.7% （調整） 受取配当金等永久に益金に算入されない項目　△2.9% 評価性引当額の減少　△1.6% 住民税均等割　0.1% その他　0.4% 税効果会計適用後の法人税等の負担率　36.7%

10. 資産除去債務関係

第25期 平成23年３月31日
資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの １．当該資産除去債務の概要 事業用に賃借している事務所等の不動産賃貸借契約に基づく原状回復義務であります。 ２．当該資産除去債務の金額の算定方法 物件の耐用年数等を参考に使用期間を見積り、対応する期間の割引率を使用して、金額を算定しております。 ３．当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減 期首残高（注）　5,776千円 時の経過による調整額　79千円 見積りの変更による増加額※　10,489千円 期末残高　16,345千円 ※当社グループの経営統合に伴い、当事業年度末において見積りの見直しを行ったもの （注）当事業年度より「資産除去債務に関する会計基準」（企業会計基準第18号 平成20年３月31日）及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第21号 平成20年３月31日）を適用したことによる期首時点における残高であります。

11. セグメント情報等

第25期
(平成22年４月１日から
平成23年３月31日まで)

（セグメント情報）

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、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

第25期（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

（関連情報）

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
中央三井高金利ソブリンオープン	1,336,886千円
中央三井ＶＡバランスファンド（株25／100）	1,150,446千円

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

当事業年度において、17,622千円の減損損失を計上しておりますが、当社は投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

（追加情報）

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

12. 関連当事者との取引関係

Ⅰ 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。

Ⅱ 第25期（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）

１．関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）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）
親会社	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	261,608	グループの業務執行管理	（被所有）直接100%	持株会社経営指導	統合関連費用の支払 統合関連費用	51,394	未払金	15,680

(2) 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	3,100,880	未払手数料	243,621
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）	2,425,966 ―	未払費用 前払費用 長期差入保証金	201,863 11,088 72,681

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。

13. １株当たり情報

項目	第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
１．１株当たり純資産額	487,545円94銭	542,702円95銭
２．１株当たり当期純利益	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、記載しておりません。	54,910円36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、記載しておりません。

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24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
当期純利益（千円）	315,099	277,297
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）	315,099	277,297
普通株式の期中平均株式数（株）	5,050	5,050

14. 重要な後発事象

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
該当事項はありません。	同左

次へ

独立監査人の中間監査報告書

平成２３年１２月１４日

中央三井アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御中

有限責任監査法人 ト ー マ ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　木 村 充 男　　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　松 崎 雅 則　　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２３年４月１日から平成２４年３月３１日までの第２６期事業年度の中間会計期間（平成２３年４月１日から平成２３年９月３０日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、中央三井アセットマネジメント株式会社の平成２３年９月３０日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成２３年４月１日から平成２３年９月３０日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

次へ

（４）中間貸借対照表

科目	第26期中間会計期間末 平成23年９月30日 金額（千円）	
（資産の部）		
Ⅰ 流動資産		
１．現金・預金		2,380,387
２．前払費用		64,463
３．未収委託者報酬		912,743
４．未収収益		50
５．繰延税金資産		43,804
６．１年内回収予定の差入保証金		91,552
７．その他		1,135
流動資産 計		3,494,136
Ⅱ 固定資産		
１．有形固定資産※１		
(1) 建物		4,874
(2) 器具備品		23,552
有形固定資産 計		28,426
２．無形固定資産		
(1) ソフトウェア		64,361
(2) 電話加入権		1,847
(3) 電話施設利用権		27
無形固定資産 計		66,235
３．投資その他の資産		
(1) 投資有価証券		58,718
(2) 長期貸付金		36,338
(3) 長期前払費用		1,808
(4) 会員権		25,000
(5) 貸倒引当金		△36,338
投資その他の資産 計		85,526
固定資産 計		180,189
資産合計		3,674,325

科目	第26期中間会計期間末 平成23年９月30日 金額（千円）	
（負債の部）		
Ⅰ 流動負債		
１．預り金		3,425
２．未払金		
（1）未払手数料	310,451	
（2）その他未払金※２	81,207	391,659
３．未払費用		302,029
４．未払法人税等		55,232
５．賞与引当金		52,320
６．役員賞与引当金		2,356
７．資産除去債務		16,385
流動負債 計		823,409
Ⅱ 固定負債		
１．退職給付引当金		19,861
２．繰延税金負債		403
３．その他		15,475
固定負債 計		35,740
負債合計		859,149
（純資産の部）		
Ⅰ 株主資本		
１．資本金		300,000
２．資本剰余金		
（1）資本準備金		50,000
資本剰余金 計		50,000
３．利益剰余金		
（1）利益準備金		25,401
（2）その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		2,441,256
利益剰余金 計		2,466,658
株主資本 計		2,816,658
Ⅱ 評価・換算差額等		
１．その他有価証券評価差額金		△1,481
評価・換算差額等 計		△1,481
純資産合計		2,815,176
負債・純資産合計		3,674,325

（５）中間損益計算書

科目	第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで） 金額（千円）	
Ⅰ 営業収益		
１．委託者報酬		5,398,191
営業収益 計		5,398,191
Ⅱ 営業費用		
１．支払手数料		2,281,099
２．広告宣伝費		52,806
３．調査費		
（1）調査費	113,633	
（2）委託調査費	1,699,582	1,813,215
４．営業雑経費		
（1）通信費	5,849	
（2）印刷費	105,715	
（3）協会費	6,167	
（4）諸会費	561	118,293
営業費用 計		4,265,414
Ⅲ 一般管理費		
１．給料		
（1）役員報酬	44,415	
（2）給料・手当	323,432	
（3）賞与	56,367	424,216
２．福利厚生費		127,354
３．交際費		397
４．旅費交通費		9,674
５．租税公課		6,980
６．不動産賃借料		59,038
７．退職給付費用		3,434
８．賞与引当金繰入		52,320
９．役員賞与引当金繰入		2,356
10．減価償却費※１		24,737
11．諸経費		279,843
一般管理費 計		990,353
営業利益		142,423

科目	第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで） 金額（千円）	
Ⅳ 営業外収益		
１．受取利息		369
２．貸倒引当金戻入		1,250
３．雑収入		3
営業外収益 計		1,623
Ⅴ 営業外費用		
１．雑損失		85
営業外費用 計		85
経常利益		143,961
Ⅵ 特別利益		
１．投資有価証券売却益		153
特別利益 計		153
Ⅶ 特別損失		
１．投資有価証券売却損		2
２．統合関連費用		15,235
特別損失 計		15,238
税引前中間純利益		128,876
法人税、住民税及び事業税	52,275	
法人税等調整額	△549	51,725
中間純利益		77,150

（６）中間株主資本等変動計算書

第26期中間会計期間（平成23年４月１日から平成23年９月30日まで）

（単位：千円）

株主資本			
	資本金	当期首残高	300,000
		当中間期変動額	―
		当中間期末残高	300,000
	資本剰余金		
	資本準備金	当期首残高	50,000
		当中間期変動額	―
		当中間期末残高	50,000
	資本剰余金合計	当期首残高	50,000
		当中間期変動額	―
		当中間期末残高	50,000
	利益剰余金		
	利益準備金	当期首残高	25,401
		当中間期変動額	―
		当中間期末残高	25,401
	その他利益剰余金		
	繰越利益剰余金	当期首残高	2,364,106
		当中間期変動額　中間純利益	77,150
		当中間期末残高	2,441,256
	利益剰余金合計	当期首残高	2,389,507
		当中間期変動額	77,150
		当中間期末残高	2,466,658
	株主資本合計	当期首残高	2,739,507
		当中間期変動額	77,150
		当中間期末残高	2,816,658
評価・換算差額等			
	その他有価証券評価差額金	当期首残高	1,142
		当中間期変動額（純額）	△2,624
		当中間期末残高	△1,481
	評価・換算差額等合計	当期首残高	1,142
		当中間期変動額	△2,624
		当中間期末残高	△1,481
純資産合計		当期首残高	2,740,649
		当中間期変動額	74,526
		当中間期末残高	2,815,176

重要な会計方針

項目	第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）
１．有価証券の評価基準及び評価方法	その他有価証券 （1）時価のあるもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額については全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。 （2）時価のないもの 移動平均法に基づく原価法を採用しております。
２．固定資産の減価償却の方法	
（1）有形固定資産	定率法を採用しております。 なお、耐用年数は、建物については主として15年～18年、器具備品については主として５年～20年であります。
（2）無形固定資産	定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（５年）を耐用年数としております。
３．引当金の計上基準	
（1）貸倒引当金	一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。
（2）賞与引当金	従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間負担分を計上しております。
（3）役員賞与引当金	役員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間負担分を計上しております。
（4）退職給付引当金	従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による中間期末退職給付債務相当額を計上しております。
４．その他中間財務諸表作成の基本となる重要な事項	消費税等の会計処理は税抜方式を採用しております。

追加情報

項目	第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）
１．会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用	中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月４日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月４日）を適用しております。
２．役員賞与引当金	役員賞与制度新設に伴い、「役員賞与に関する会計基準」（企業会計基準第４号 平成17年11月29日）を適用し、当中間会計期間から役員賞与引当金を計上しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第26期中間会計期間末 （平成23年９月30日）
※１．有形固定資産の減価償却累計額	建物　35,117千円 器具備品　143,248千円
※２．消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

項目	第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）
※１．減価償却実施額	有形固定資産　8,010千円 無形固定資産　16,727千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

項目	第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）
１．発行済株式に関する事項	株式の種類：普通株式（株） 当事業年度期首：5,050 増加：－ 減少：－ 当中間会計期間末：5,050
２．自己株式に関する事項	該当事項はありません。
３．新株予約権等に関する事項	該当事項はありません。
４．配当に関する事項	該当事項はありません。

リース取引関係

第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）
当社はリース取引を全く行っていないため、該当事項はありません。

金融商品関係

第26期中間会計期間
（平成23年４月１日から
平成23年９月30日まで）

金融商品の時価等に関する事項

平成23年９月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品は次表には含めておりません。

	中間貸借対照表計上額 (*)	時価 (*)	差額
	千円	千円	千円
(1) 現金・預金	2,380,387	2,380,387	―
(2) 未収委託者報酬	912,743	912,743	―
(3) 投資有価証券			
その他有価証券	48,718	48,718	―
(4) 未払金	(391,659)	(391,659)	―

（＊）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び（4）未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内　　容	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

有価証券関係

第26期中間会計期間末
（平成23年９月30日）

１．その他有価証券

中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの

区分	中間貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
投資信託受益証券	200	200	0
計	200	200	0

中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの

区分	中間貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
投資信託受益証券	48,518	50,000	△1,482
計	48,518	50,000	△1,482

非上場株式（中間貸借対照表計上額 10,000千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

デリバティブ関係

第26期中間会計期間
（平成23年４月１日から
平成23年９月30日まで）

当社はデリバティブ取引を全く行っていないため、該当事項はありません。

資産除去債務関係

第26期中間会計期間末
（平成23年９月30日）

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減

	千円
期首残高	16,345
時の経過による調整額	40
中間期末残高	16,385

セグメント情報等

第26期中間会計期間
（平成23年４月１日から
平成23年９月30日まで）

（セグメント情報）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

（関連情報）

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
ＰＩＭＣＯ 米国ハイイールド債券通貨選択型ファンド（ブラジル・レアルコース）	1,201,868千円
中央三井高金利ソブリンオープン	535,464千円

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

１株当たり情報

第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）	
１株当たり純資産額	557,460円63銭
１株当たり中間純利益	15,277円38銭
（注）潜在株式調整後１株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

（注）１株当たり中間純利益算定上の基礎は以下のとおりであります。

第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）	
中間純利益（千円）	77,150
普通株主に帰属しない金額（千円）	－
普通株式に係る中間純利益（千円）	77,150
普通株式の期中平均株式数（株）	5,050

重要な後発事象

第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）
該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

（1）自己又はその役員との取引

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

（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。）。

（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金融商品取引業者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金融商品取引業者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。

（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。

（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。

5 【その他】

（1）定款の変更

当社は、平成24年4月1日に中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、商号を三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に変更しました。

（2）訴訟事件その他の重要事項

本書提出日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

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　　：三井住友信託銀行株式会社

② 資本金の額：342,037百万円（平成24年４月１日現在）

③ 事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、「金融機関の信託業務の兼営等に関する法律」に基づき信託業務を営んでいます。

（２）販売会社

（１）受託会社に同じ。

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。

（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。

（２）販売会社

該当事項はありません。

＜再信託受託会社の概要＞

名称　　：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年６月20日

資本金の額：51,000百万円（平成23年９月末日現在）

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

第３【参考情報】

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

提出日	書類名
平成23年４月22日	有価証券報告書
平成23年４月22日	有価証券届出書
平成23年10月24日	半期報告書
平成23年10月24日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成２４年３月２３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　山 田 信 之　　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている中央三井ＤＣ日本債券インデックスファンドの平成２３年１月２５日から平成２４年１月２３日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、中央三井ＤＣ日本債券インデックスファンドの平成２４年１月２３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23年６月27日

住信アセットマネジメント株式会社
　取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	羽 太 典 明　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	石 井 勝 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、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている住信アセットマネジメント株式会社の平成22年４月１日から平成23年３月31日までの第25期事業年度の財務諸表、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、住信アセットマネジメント株式会社の平成23年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

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

次へ

独立監査人の中間監査報告書

平成23年12月14日

住信アセットマネジメント株式会社
　取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	羽 太 典 明　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	石 井 勝 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、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている住信アセットマネジメント株式会社の平成23年４月１日から平成24年３月31日までの第26期事業年度の中間会計期間（平成23年４月１日から平成23年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、住信アセットマネジメント株式会社の平成23年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成23年４月１日から平成23年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成２３年３月２４日

中央三井アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御中

有限責任監査法人 ト ー マ ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　松 崎 雅 則　　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　平 木 達 也　　印

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

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

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

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

以 上

※ １．上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
２．財務諸表の範囲には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29日

住信アセットマネジメント株式会社
　取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員
業務執行社員　公認会計士　　壁 谷　惠 嗣　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、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている住信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、住信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、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。