【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5月7日
【計算期間】	第10期（自 平成23年2月8日 至 平成24年2月7日）
【ファンド名】	ＤＣ外国株式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
		債　券	
	海　外	不動産投信	
追 加 型	内　外	その他資産 （　　）	特 殊 型
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

（用語の定義について）

当ファンドが該当する商品分類に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

＜単位型投信・追加型投信＞

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

＜投資対象地域＞

・海 外…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海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

＜投資対象資産（収益の源泉）＞

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

＜補足分類＞

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	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 （株式 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 （日本を除く） 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	あり （　） なし	日経２２５ ＴＯＰＩＸ その他 （ＭＳＣＩコクサイ指数 （円ベース））

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

（用語の定義について）

当ファンドが該当する属性区分に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

＜投資対象資産＞

・その他資産（投資信託証券）

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

・株式 一般…大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。

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

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

そのもの（形式基準）を記載することとなっているためです。

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

＜投資対象地域＞
・グローバル（日本を除く）
…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産（日本を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

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

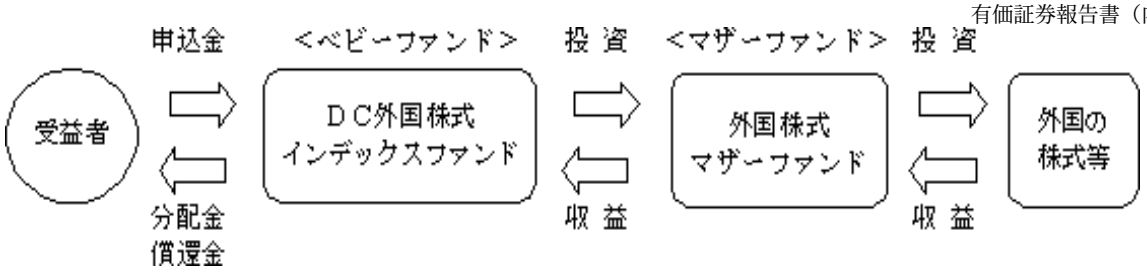
＜為替ヘッジ＞
・なし…目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

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

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、「ＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）」と連動する投資成果を目標として運用を行います。

（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外国株式インデックスファンドからＤＣ外国株式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外国株式マザーファンドの名称を外国株式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外国株式インデックスファンド）とし、その資金をマザーファンド（外国株式マザーファンド）に投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



② ファンドの関係法人

委託会社 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

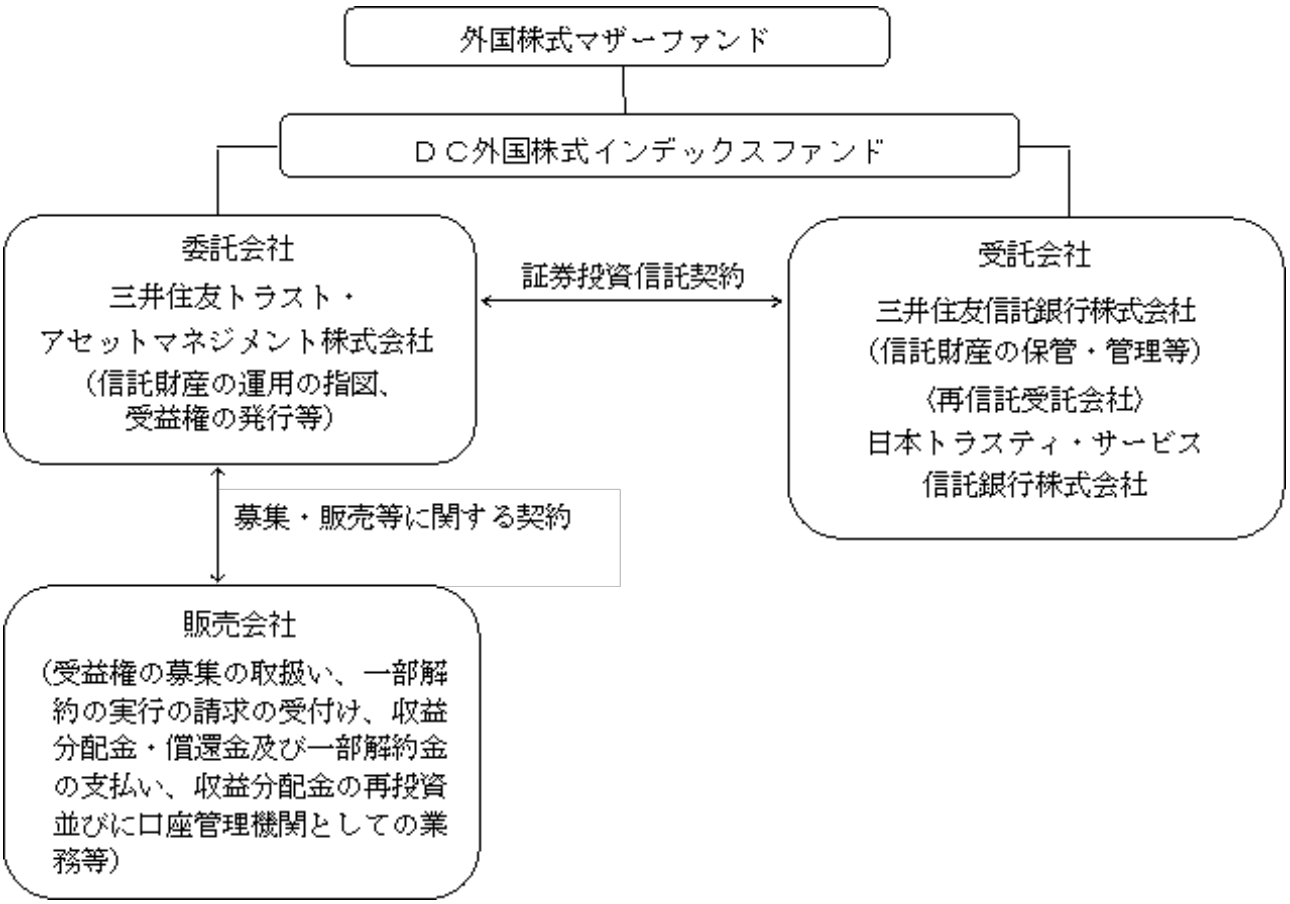
（再信託受託会社 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

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、日本を除く世界の主要国の株式等に投資する外国株式マザーファンド（以下「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券を主要投資対象とし、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。なお、株式等に直接投資することもあります。

② 投資態度

Ａ．株式への実質投資は、日本を除く世界の主要国の株式に分散投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

Ｂ．株式の実質投資割合は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

Ｅ．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。

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

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

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

（２）【投資対象】

① 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

Ａ．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）

１．有価証券

２．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、後記（５）①Ｊ．、Ｋ．及びＬ．に定めるものに限ります。）

３．金銭債権（上記１．、２．及び下記４．に掲げるものに該当するものを除きます。）

４．約束手形（上記１．に掲げるものに該当するものを除きます。）

Ｂ．次に掲げる特定資産以外の資産

１．為替手形

② 運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・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「外国株式マザーファンド」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。）に投資することを指図します。

１．株券又は新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

６．資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）

７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）

８．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証書

９．資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券

12．外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記１．から11．までの証券又は証書の性質を有するもの

13．投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）

14．投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）

15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）

16．オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

17．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）

18．外国法人が発行する譲渡性預金証書

19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

20．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます。）

21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22．外国の者に対する権利で上記21．の有価証券の性質を有するもの

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

③ 運用指図できる金融商品

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

１．預金

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

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

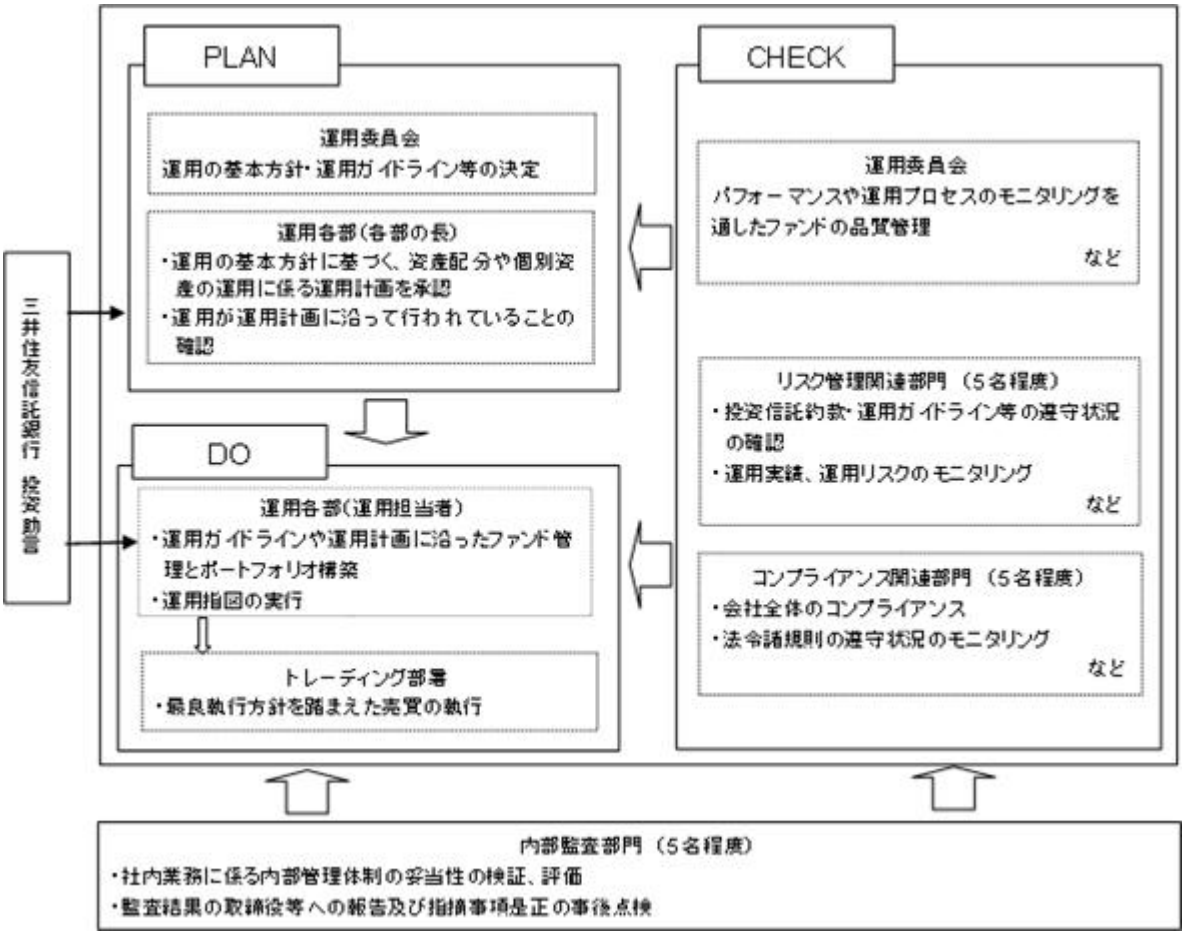
６．外国の者に対する権利で上記５．の権利の性質を有するもの

Ｂ．金融商品による運用の特例

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

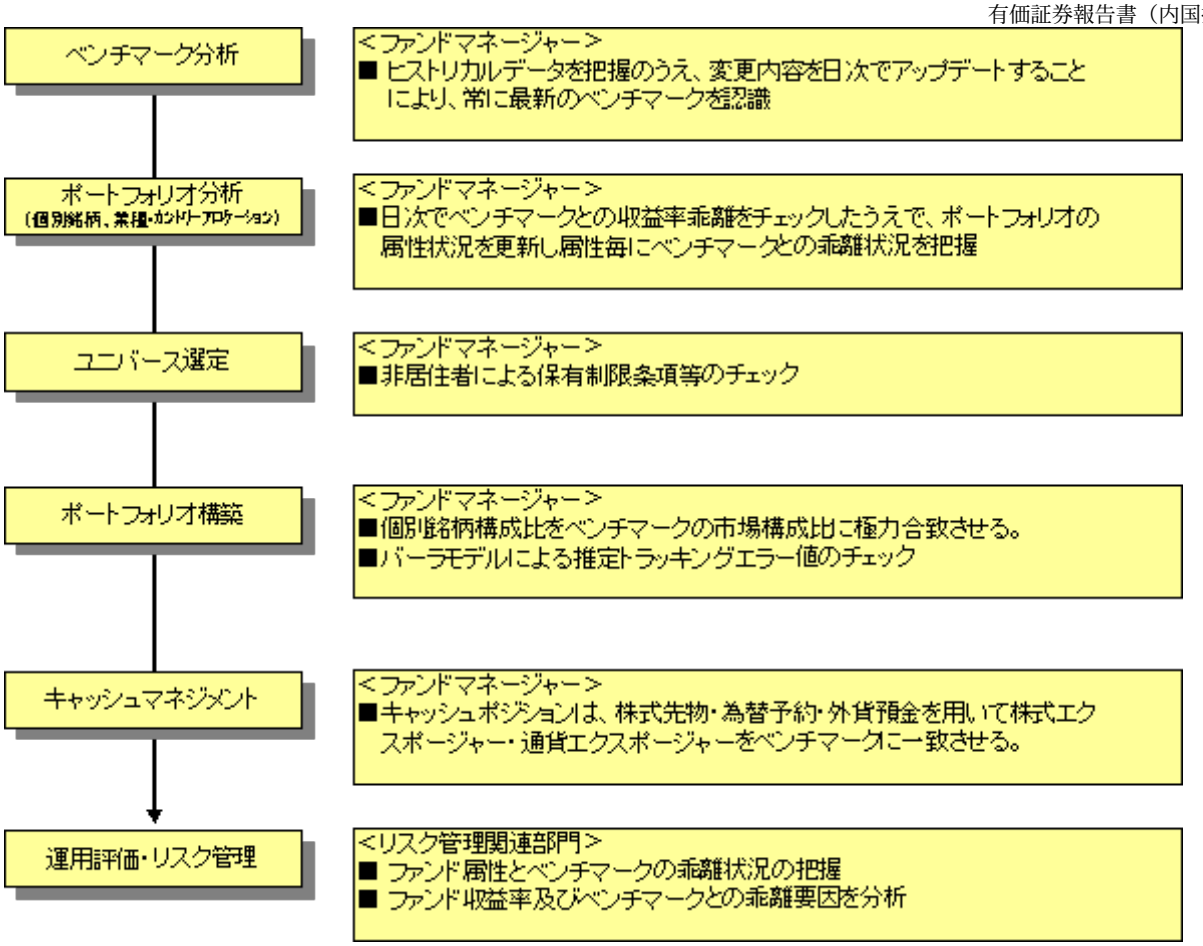
（３）【運用体制】

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２月７日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

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

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

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

② 分配収益の計算

A．信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

イ．配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額は、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あてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

ハ．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．外貨建資産への投資割合

委託会社は、外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

B．株式への投資割合

委託会社は、株式への実質投資割合には、制限を設けません。

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．投資信託証券への投資割合

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。

E．同一銘柄の株式への投資割合

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10％以下とします。

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

G．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

H．投資する株式等の範囲

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

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

Ｉ．信用取引の指図範囲

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

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

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

Ｊ．先物取引等の運用指図

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

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

K．スワップ取引の運用指図

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

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

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

するものとします。

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

L．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

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

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

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

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

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次のａ．及びｂ．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

ａ．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

ｂ．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．ａ．及びｂ．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

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

N．公社債の空売りの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産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。

O．公社債の借入れの指図及び範囲

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

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

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

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

P．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

Q．外国為替予約取引の指図

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

ロ．上記イ．の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

R．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

S．再投資の指図

委託会社は、上記R．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。

T．資金の借入れ

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券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。

U．受託会社による資金の立替え

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

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

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

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

「外国株式マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法

（１）投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

（２）投資態度

① ＭＳＣＩコクサイ指数に採用されている国の株式に投資を行い、同指数（円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

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 株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

④ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

⑤ 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

⑥ 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。

⑦ 国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

⑧ 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。

⑨ 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

３．投資制限

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

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 株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

② 為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

③ 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。

④ カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

⑤ 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、ＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、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翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

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

（3）【信託報酬等】

信託報酬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 0.84%（税抜※ 0.8%）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 0.399%	（税抜 0.38%）
販売会社	年率 0.3675%	（税抜 0.35%）
受託会社	年率 0.0735%	（税抜 0.07%）

※「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「中央三井外国株式マザーファンド」は「外国株式マザーファンド」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	中央三井外国株式マザーファンド	日本	3,879,140,324	100.05
	親投資信託受益証券合計		3,879,140,324	100.05
その他の資産（負債控除後）			△1,862,468	△0.05
合計（純資産総額）			3,877,277,856	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。
（中央三井外国株式マザーファンド）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	146,757,928,687	52.28
	イギリス	27,654,169,627	9.85
	カナダ	15,413,692,158	5.49
	スイス	11,678,581,422	4.16
	フランス	10,941,284,056	3.90
	その他	53,497,959,035	19.06
	小計	265,943,614,985	94.73
投資信託受益証券	オーストラリア	101,416,027	0.04
	シンガポール	49,652,085	0.02
	香港	773,401	0.00
	小計	151,841,513	0.05
投資証券	アメリカ	3,465,707,096	1.23
	オーストラリア	726,282,903	0.26
	その他	909,310,863	0.32
	小計	5,101,300,862	1.82
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		9,538,355,704	3.40
合計（純資産総額）		280,735,113,064	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	中央三井外国株式マザーファンド	3,823,696,722	0.9402	3,595,242,845	1.0145	3,879,140,324	100.05

（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
（中央三井外国株式マザーファンド）
① 投資有価証券の主要銘柄
A．主要銘柄の明細

順位	国／地域	銘柄名	業種	株数	簿価（円）		評価額（円）		投資比率（%）
					単価	金額	単価	金額	
1	アメリカ	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	138,800	37,433.09	5,195,714,224	43,196.87	5,995,726,777	2.14
2	アメリカ	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	715,502	6,918.30	4,950,064,641	7,030.45	5,030,304,756	1.79
3	アメリカ	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1,130,091	2,436.53	2,753,507,404	2,571.27	2,905,770,893	1.04
4	アメリカ	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE	ソフトウェア・サービス	175,978	15,556.71	2,737,640,049	15,973.02	2,810,901,239	1.00
5	アメリカ	CHEVRON CORP	エネルギー	297,342	8,606.13	2,558,965,571	8,843.33	2,629,494,856	0.94
6	スイス	NESTLE SA-REGISTERD	食品・飲料・タバコ	492,556	4,790.15	2,359,417,615	5,002.14	2,463,836,286	0.88
7	アメリカ	GENERAL ELECTRIC	資本財	1,575,845	1,536.95	2,422,001,276	1,545.82	2,435,986,585	0.87
8	アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	410,715	5,123.98	2,104,498,238	5,437.02	2,233,067,805	0.80
9	アメリカ	AT&T INC	電気通信サービス	884,552	2,417.97	2,138,828,691	2,463.16	2,178,793,458	0.78
10	アメリカ	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	407,670	5,259.52	2,144,152,268	5,258.72	2,143,823,360	0.76
11	アメリカ	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,147,372	1,690.24	1,939,340,933	1,712.02	1,964,334,826	0.70
12	イギリス	HSBC HLDGS PLC	銀行	2,666,938	715.57	1,908,401,893	718.53	1,916,282,188	0.68
13	アメリカ	GOOGLE INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	38,300	49,141.38	1,882,114,899	49,891.70	1,910,852,309	0.68
14	アメリカ	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	747,820	2,436.53	1,822,090,351	2,530.93	1,892,681,269	0.67
15	イギリス	BP PLC	エネルギー	2,830,448	628.21	1,778,139,230	641.45	1,815,592,878	0.65
16	アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	567,187	3,077.13	1,745,311,082	3,163.46	1,794,274,975	0.64
17	アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	259,275	6,200.25	1,607,571,892	6,765.82	1,754,209,225	0.62
18	アメリカ	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	305,134	5,488.66	1,674,776,902	5,554.81	1,694,963,835	0.60
19	アメリカ	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	760,065	2,155.76	1,638,525,021	2,197.72	1,670,412,484	0.60
20	イギリス	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	7,504,059	227.39	1,706,362,233	221.41	1,661,534,072	0.59
21	イギリス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	543,494	2,899.56	1,575,897,756	2,981.14	1,620,235,154	0.58
22	スイス	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	348,338	4,663.85	1,624,598,619	4,459.98	1,553,581,349	0.55
23	スイス	ROCHE HLDGS AG GENUSSCHINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	104,864	14,253.17	1,494,645,467	14,271.22	1,496,537,423	0.53
24	オーストラリア	BHP BILLITON LTD	素材	479,346	3,331.14	1,596,772,373	3,116.68	1,493,970,488	0.53
25	フランス	TOTAL SA	エネルギー	316,831	4,443.78	1,407,928,845	4,556.23	1,443,557,362	0.51
26	アメリカ	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	602,376	2,339.71	1,409,391,174	2,371.18	1,428,345,056	0.51
27	アメリカ	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	455,019	3,098.11	1,409,699,824	3,096.49	1,408,965,605	0.50

28	イギリス	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	753,464	1,822.98	1,373,556,809	1,803.71	1,359,037,181	0.48
29	アメリカ	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	283,026	4,992.47	1,413,001,191	4,754.47	1,345,639,305	0.48
30	アメリカ	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	802,413	1,628.92	1,307,073,966	1,629.73	1,307,721,352	0.47
合計						61,679,990,437		63,360,434,351	22.57

（注１）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。
（注２）種類は全て株式です。

B．種類別及び業種別の投資比率

種類	業種	投資比率（%）
株式	エネルギー	12.19
	素材	7.34
	資本財	7.33
	商業・専門サービス	0.79
	運輸	1.71
	自動車・自動車部品	1.36
	耐久消費財・アパレル	1.24
	消費者サービス	1.64
	メディア	2.45
	小売	2.65
	食品・生活必需品小売り	2.15
	食品・飲料・タバコ	6.55
	家庭用品・パーソナル用品	1.70
	ヘルスケア機器・サービス	2.60
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.34
	銀行	7.19
	各種金融	4.47
	保険	3.86
	不動産	0.71
	ソフトウェア・サービス	5.75
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.73
	電気通信サービス	3.82
	公益事業	3.52
	半導体・半導体製造装置	1.65
	小計	94.73
投資信託受益証券	—	0.05
投資証券	—	1.82
合計		96.60

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

② 投資不動産物件
該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

取引名	国／地域	資産名	種類	数量（枚）	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）

株価指数先物取引	アメリカ	S&P 500 FUTU	買建	175	4,766,895,909	4,840,699,150	1.72
	カナダ	S&P/TSX60 IX	買建	35	407,844,833	410,915,008	0.15
	ドイツ	SWISS MKT IX	買建	113	621,177,670	621,511,718	0.22
	ドイツ	DJ EURO STOX	買建	374	1,022,229,939	1,024,410,871	0.36
	オーストラリア	ASX SPI 200	買建	68	632,940,748	630,912,942	0.22
	イギリス	FTSE 100 IDX	買建	167	1,261,151,288	1,266,780,362	0.45

（注１）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。
（注２）株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

（３）【運用実績】
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２月７日現在）	15,200,264	6,826
第２期計算期間（平成16年２月９日現在）	150,696,208	8,525
第３期計算期間（平成17年２月７日現在）	432,368,811	9,182
第４期計算期間（平成18年２月７日現在）	875,975,131	11,667
第５期計算期間（平成19年２月７日現在）	1,643,718,730	14,167
第６期計算期間（平成20年２月７日現在）	1,920,798,353	12,035
第７期計算期間（平成21年２月９日現在）	1,315,880,340	6,405
第８期計算期間（平成22年２月８日現在）	2,213,864,531	8,011
第９期計算期間（平成23年２月７日現在）	3,161,655,895	9,179
第10期計算期間（平成24年２月７日現在）	3,528,251,808	8,399
平成23年２月末日	3,203,945,525	9,180
平成23年３月末日	3,375,154,092	9,432
平成23年４月末日	3,531,667,013	9,657
平成23年５月末日	3,430,738,349	9,275
平成23年６月末日	3,463,090,944	9,060
平成23年７月末日	3,359,454,552	8,675
平成23年８月末日	3,053,348,272	7,810
平成23年９月末日	2,917,561,984	7,328
平成23年10月末日	3,354,271,398	8,323
平成23年11月末日	3,122,778,881	7,621
平成23年12月末日	3,277,867,856	7,886
平成24年１月末日	3,420,234,913	8,144
平成24年２月末日	3,877,277,856	9,063

（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	△31.74 %
第２期計算期間	24.89 %
第３期計算期間	7.71 %
第４期計算期間	27.06 %
第５期計算期間	21.43 %
第６期計算期間	△15.05 %
第７期計算期間	△46.78 %
第８期計算期間	25.07 %
第９期計算期間	14.58 %
第10期計算期間	△8.50 %

（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	23,266,772	1,000,000	22,266,772
第２期計算期間	173,513,031	19,009,097	176,770,706
第３期計算期間	339,841,437	45,737,218	470,874,925
第４期計算期間	449,853,638	169,893,412	750,835,151
第５期計算期間	549,720,867	140,290,307	1,160,265,711
第６期計算期間	963,599,515	527,887,458	1,595,977,768
第７期計算期間	809,123,746	350,709,691	2,054,391,823
第８期計算期間	1,045,119,050	336,025,578	2,763,485,295
第９期計算期間	1,087,563,934	406,622,916	3,444,426,313
第10期計算期間	1,355,760,169	599,214,229	4,200,972,253

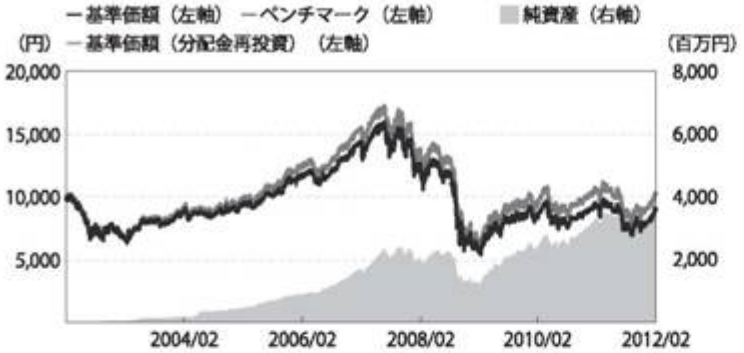
（注１）設定及び解約の実績は、全て本邦内における実績です。
（注２）第１期計算期間の設定口数には、当初自己設定の設定口数を含みます。

（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（MSCIコクサイ指数（円ベース））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2月	0円
2011年2月	0円
2010年2月	0円
2009年2月	0円
2008年2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
株式	94.78%
その他資産	5.22%
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。

業種別投資比率（中央三井外国株式マザーファンド）

業種	比率
エネルギー	12.19%
素材	7.34%
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.34%
資本財	7.33%
銀行	7.19%
その他	53.33%
合計	94.73%

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

国／地域別投資比率（上位）（中央三井外国株式マザーファンド）

国／地域	比率
アメリカ	53.51%
イギリス	9.96%
カナダ	5.51%
スイス	4.16%
フランス	4.02%
オーストラリア	3.87%

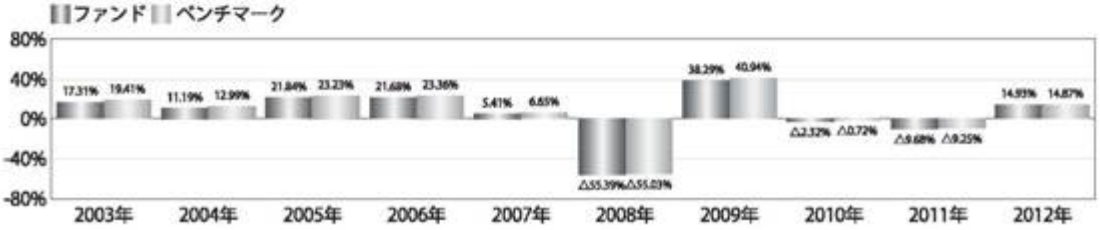
・比率とはマザーファンドの純資産総額に対する当該国／地域の評価金額の比率をいいます。

組入上位銘柄（中央三井外国株式マザーファンド）

銘柄名	国	業種	比率
APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.14%
EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	エネルギー	1.79%
MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.04%
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.00%
CHEVRON CORP	アメリカ	エネルギー	0.94%
NESTLE SA-REGISTERD	スイス	食品・飲料・タバコ	0.88%
GENERAL ELECTRIC	アメリカ	資本財	0.87%
PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	家庭用品・パーソナル用品	0.80%
AT&T INC	アメリカ	電気通信サービス	0.78%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.76%
		合計	10.98%

・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３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、ニューヨーク証券取引所又はロンドン証券取引所が休業日の場合は、受益権の取得申込みを受付けないものとし、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付けを中止すること、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

取得申込受付日の翌営業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き換え

に、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。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。

ただし、ニューヨーク証券取引所又はロンドン証券取引所が休業日の場合は、一部解約の実行の請求を受付けないものとします。

（注）一部解約の実行の請求の受付けは、営業日の午後３時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。なお、一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

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

解約価額は委託会社の営業日において日々算出され、日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（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、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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（外国株式マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

Ｂ．外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みます。）

原則として計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

当ファンドの信託期間は、信託契約締結日（平成14年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２月８日から翌年２月７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２月７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、後記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、後記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、後記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．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がないときは、自動的に１年間延長され、その後も同様とします。

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

⑨ 信託事務処理の再委託

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２月９日から平成23年２月７日まで）及び第10期計算期間（平成23年２月８日から平成24年２月７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外国株式インデックスファンド」から「ＤＣ外国株式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「中央三井外国株式マザーファンド」については、平成24年４月１日付にて「外国株式マザーファンド」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外国株式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２月７日現在）	第10期 （平成24年２月７日現在）
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	3,173,422,490	3,541,531,249
未収入金	1,906,417	1,013,494
流動資産合計	3,175,328,907	3,542,544,743
資産合計	3,175,328,907	3,542,544,743
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,906,417	1,013,494
未払受託者報酬	1,029,581	1,161,951
未払委託者報酬	10,737,014	12,117,490
流動負債合計	13,673,012	14,292,935
負債合計	13,673,012	14,292,935
純資産の部		
元本等		
元本	3,444,426,313	4,200,972,253
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△282,770,418	△672,720,445
純資産合計	3,161,655,895	3,528,251,808
負債純資産合計	3,175,328,907	3,542,544,743

（２）【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第９期 (自 平成22年２月９日 至 平成23年２月７日)	第10期 (自 平成23年２月８日 至 平成24年２月７日)
営業収益		
有価証券売買等損益	388,486,278	△258,891,571
営業収益合計	388,486,278	△258,891,571
営業費用		
受託者報酬	1,949,295	2,386,589
委託者報酬	20,328,238	24,888,634
営業費用合計	22,277,533	27,275,223
営業利益又は営業損失（△）	366,208,745	△286,166,794
経常利益又は経常損失（△）	366,208,745	△286,166,794
当期純利益又は当期純損失（△）	366,208,745	△286,166,794
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（△）	12,162,773	△47,667,593
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△549,620,764	△282,770,418
剰余金増加額又は欠損金減少額	77,901,380	53,467,530
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	77,901,380	53,467,530
剰余金減少額又は欠損金増加額	165,097,006	204,918,356
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	165,097,006	204,918,356
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△282,770,418	△672,720,445

（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２月９日 至 平成23年２月７日	第 10 期 自 平成23年２月８日 至 平成24年２月７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２月８日から翌年２月７日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第９期計算期間は平成22年２月９日から平成23年２月７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２月７日現在）	第 10 期 （平成24年２月７日現在）
１．当該計算期間の末日における受益権総数	3,444,426,313 口	4,200,972,253 口
２．「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第55条の６第10号に規定する額	元本の欠損 282,770,418 円	元本の欠損 672,720,445 円
３．１口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	0.9179 円 (9,179 円)	0.8399 円 (8,399 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２月９日 至 平成23年２月７日	第 10 期 自 平成23年２月８日 至 平成24年２月７日
費用控除後の配当等収益額	A	57,730,849 円 (61,364,315 円)	53,814,773 円 (81,089,996 円)
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	― 円	― 円
収益調整金額	C	1,822,331,006 円	2,342,308,631 円
分配準備積立金額	D	263,746,980 円	275,734,859 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,143,808,835 円	2,671,858,263 円
当ファンドの期末残存口数	F	3,444,426,313 口	4,200,972,253 口

10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	6,223.99 円	6,360.09 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２月９日 至 平成23年２月７日	第 10 期 自 平成23年２月８日 至 平成24年２月７日
２．剰余金増加額・減少額又は欠損金減少額・増加額	「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ欠損金増加額と減少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２月９日 至 平成23年２月７日	第 10 期 自 平成23年２月８日 至 平成24年２月７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２月７日現在）	第 10 期 （平成24年２月７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２月９日 至 平成23年２月７日	第 10 期 自 平成23年２月８日 至 平成24年２月７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２月９日 至 平成23年２月７日	第 10 期 自 平成23年２月８日 至 平成24年２月７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２月９日 至 平成23年２月７日	第 10 期 自 平成23年２月８日 至 平成24年２月７日
期首元本額	2,763,485,295 円	3,444,426,313 円
期中追加設定元本額	1,087,563,934 円	1,355,760,169 円
期中一部解約元本額	406,622,916 円	599,214,229 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２月７日現在） 最終の計算期間（自 平成22年２月９日 至 平成23年２月７日）の損益に含まれた評価差額（円）	第 10 期 （平成24年２月７日現在） 最終の計算期間（自 平成23年２月８日 至 平成24年２月７日）の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	398,536,656	△170,711,476
合計	398,536,656	△170,711,476

３．デリバティブ取引関係

第 9 期 （平成23年２月７日現在）	第 10 期 （平成24年２月７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	中央三井外国株式マザーファンド	3,768,789,241	3,541,531,249	
合計		3,768,789,241	3,541,531,249	

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

同マザーファンドの平成24年２月７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。

「中央三井外国株式マザーファンド」の状況

（１）貸借対照表

項目	平成24年２月７日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,126,252,097
コール・ローン	1,935,385,726
株式	250,346,407,224
投資信託受益証券	111,484,161
投資証券	4,954,539,318
派生商品評価勘定	362,714,157
未収入金	75,578,518
未収配当金	243,845,721
未収利息	3,856
差入委託証拠金	1,117,923,084
流動資産合計	263,274,133,862
資産合計	263,274,133,862
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,303,152
未払解約金	153,846,136
流動負債合計	158,149,288
負債合計	158,149,288
純資産の部	
元本等	
元本	279,997,095,818
剰余金	
欠損金	16,881,111,244
純資産合計	263,115,984,574
負債・純資産合計	263,274,133,862

（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２月７日現在

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

（貸借対照表に関する注記）

	平成24年２月７日現在
１．計算日における受益権総数	279,997,095,818 口

２．「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第55条の６第10号に規定する額	元本の欠損 16,881,111,244 円
３．１口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	0.9397 円 （ 9,397 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２月７日現在
１．金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、株価変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、カントリーリスク及び流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。 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２月７日現在
１．貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

２．時価の算定方法
（１）株式、投資信託受益証券及び投資証券
「（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）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２月７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２月７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２月７日現在	
計算期間の期首元本額	279,654,208,209 円
計算期間中の追加設定元本額	54,145,116,105 円
計算期間中の一部解約元本額	53,802,228,496 円
計算日の元本額	279,997,095,818 円
計算日の元本額の内訳	
中央三井外国株式インデックスファンド	4,632,959,101 円
中央三井ＤＣ外国株式インデックスファンド	3,768,789,241 円
中央三井ＤＣ外国株式インデックスファンドＬ	18,105,777,094 円
中央三井ＤＣバランスファンド３０	178,975,366 円
中央三井ＤＣバランスファンド５０	531,237,647 円
中央三井ＤＣバランスファンド７０	313,967,749 円
ベスタ・世界６資産ファンド（毎月決算型）	219,781,239 円
ベスタ・世界６資産ファンド（１年決算型）	138,563,312 円
新生・４分散ファンド	178,341,011 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	717,525,916 円

４資産インデックスバランスオープン（分配型）	57,869,733 円
４資産インデックスバランスオープン（成長型）	170,004,476 円
ＣＭＡＭ外国株式インデックスｅ	3,939,623,899 円
中央三井インデックスコレクション（外国株式）	2,072,802,727 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式３０）	186,912,373 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式５０）	512,670,507 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式７０）	449,829,023 円
中央三井外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	21,051,766,621 円
中央三井バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	5,724,208,052 円
中央三井バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	41,574,651,229 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）	29,941,730,066 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）	4,751,549,818 円
中央三井ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	429,164,946 円
為替ヘッジ付外国株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,939,376,026 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）	30,932,756,482 円
中央三井バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	3,562,130,944 円
中央三井バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	1,878,101,785 円
中央三井バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	32,037,160,576 円
中央三井バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	2,441,969,721 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）	46,199,669,902 円
中央三井ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	6,068,702,699 円
中央三井ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	210,446,451 円
中央三井バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	2,896,229,809 円
中央三井ＶＡバランス株式４０（適格機関投資家専用）	2,305,899,597 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）	985,667,423 円
ＣＭＡＭ・ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	2,358,687,925 円
中央三井バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	1,569,975,330 円
中央三井ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	2,746,551,020 円
中央三井バランスＶＡ２０Ｌ（適格機関投資家専用）	117,107,340 円
中央三井バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	731,040,519 円
ＣＭＡＭ・ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	1,318,464,888 円
私募外国株式インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	48,456,235 円

２．有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成24年２月７日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△4,193,444,885
投資信託受益証券	△17,343,791
投資証券	288,550,042
合計	△3,922,238,634

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「中央三井外国株式マザーファンド」の期首から計算日までの期間（平成23年２月８日から平成24年２月７日まで）に対応するものです。

３．デリバティブ取引関係

Ｉ．ヘッジ会計が適用されていないもの

株式関連

区分	種類	平成24年２月７日現在			
		契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち１年超		
市場取引	株価指数先物取引 買 建	7,146,559,984	—	7,496,698,570	350,138,586
合計		7,146,559,984	—	7,496,698,570	350,138,586

（注）１．時価の算定方法
株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
２．株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
３．計算日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

区分	種類	平成24年２月７日現在			
		契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち１年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買 建				
	米ドル	1,331,947,940	—	1,328,045,540	△3,902,400
	ユーロ	277,776,142	—	283,457,430	5,681,288
	英ポンド	234,313,545	—	240,949,200	6,635,655
	計	1,844,037,627	—	1,852,452,170	8,414,543
	売 建				
	米ドル	78,070,800	—	78,070,800	—
	ユーロ	17,570,350	—	17,571,750	△1,400
	英ポンド	85,598,952	—	85,731,720	△132,768
	スイスフラン	12,983,724	—	12,991,680	△7,956
	計	194,223,826	—	194,365,950	△142,124
合計		2,038,261,453	—	2,046,818,120	8,272,419

（注）時価の算定方法
わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。
① 計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。
② 計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年２月７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２月７日現在）

① 有価証券明細表

A．株式

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	34,800	23.54	819,192.00	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	75,200	82.87	6,231,824.00	
	APACHE CORP	58,012	102.92	5,970,595.04	
	ARCH COAL INC	33,200	15.71	521,572.00	
	BAKER HUGHES INC	65,859	52.09	3,430,595.31	
	CABOT OIL & GAS CORP	32,200	33.54	1,079,988.00	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	37,000	57.26	2,118,620.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	99,800	22.65	2,260,470.00	
	CHEVRON CORP	302,242	106.67	32,240,154.14	
	CIMAREX ENERGY CO	13,100	63.90	837,090.00	
	CONCHO RESOURCES INC	14,900	109.73	1,634,977.00	
	CONOCOPHILLIPS	196,900	71.32	14,042,908.00	
	CONSOL ENERGY INC	34,800	37.37	1,300,476.00	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,100	80.99	575,029.00	
	DENBURY RESOURCES INC	61,700	19.20	1,184,640.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	59,800	64.46	3,854,708.00	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	10,700	63.35	677,845.00	
	EL PASO CORP	116,300	27.18	3,161,034.00	
	ENERGEN CORP	11,100	49.19	546,009.00	
	EOG RESOURCES INC	40,600	110.06	4,468,436.00	
	EQT CORP	21,800	50.81	1,107,658.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	733,702	85.75	62,914,946.50	
	FMC TECHNOLOGIES INC	36,300	54.32	1,971,816.00	
	HALLIBURTON CO	138,800	37.40	5,191,120.00	
	HELMERICH & PAYNE	16,400	60.95	999,580.00	
	HESS CORP	46,200	61.12	2,823,744.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	31,600	32.81	1,036,796.00	
	KINDER MORGAN INC	17,000	32.26	548,420.00	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	13,561	77.86	1,055,859.46	
	MARATHON OIL CORP	107,800	32.90	3,546,620.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	53,800	44.42	2,389,796.00	
	MURPHY OIL CORP	27,800	61.74	1,716,372.00	
	NABORS INDUSTRIES INC	44,100	19.69	868,329.00	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	64,021	83.65	5,355,356.65	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	20,600	38.80	799,280.00	
	NOBLE CORP	39,500	37.76	1,491,520.00	
	NOBLE ENERGY INC	26,700	103.77	2,770,659.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	122,680	104.00	12,758,720.00	
	PEABODY ENERGY CORP	40,900	38.90	1,591,010.00	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	15,900	105.74	1,681,266.00	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION CO	21,600	39.44	851,904.00	
	QEP RESOURCES INC	27,100	29.89	810,019.00	
	RANGE RESOURCES CORP	24,400	60.81	1,483,764.00	
	ROWAN COMPANIES INC	19,600	36.73	719,908.00	
	SCHLUMBERGER LIMITED	203,634	79.64	16,217,411.76	
	SOUTHWESTERN ENERGY CO	52,600	31.74	1,669,524.00	
	SPECTRA ENERGY CORP	98,178	30.75	3,018,973.50	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考

米ドル	SUNOCO INC	18,600	39.79	740,094.00	
	ULTRA PETROLEUM CORP	23,500	24.44	574,340.00	
	VALERO ENERGY CORP	86,364	24.86	2,147,009.04	
	WEATHERFORD INTL LTD	114,448	17.81	2,038,318.88	
	WHITING PETROLEUM CORP	18,000	50.51	909,180.00	
	WILLIAMS COS INC	88,920	29.41	2,615,137.20	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	32,200	89.93	2,895,746.00	
	AIRGAS INC	10,900	78.36	854,124.00	
	ALCOA INC	160,600	10.74	1,724,844.00	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	15,500	48.40	750,200.00	
	BALL CORP	23,500	40.00	940,000.00	
	CELANESE CORP-SERIES A	23,600	52.22	1,232,392.00	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,900	187.42	2,042,878.00	
	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	22,100	74.99	1,657,279.00	
	CROWN HOLDINGS INC	22,900	36.73	841,117.00	
	DOW CHEMICAL COMPANY	178,302	33.98	6,058,701.96	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	140,746	51.78	7,287,827.88	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	21,200	54.30	1,151,160.00	
	ECOLAB INC	45,300	61.29	2,776,437.00	
	FMC CORP	11,000	93.78	1,031,580.00	
	FREEPORT-MCMORAN COPPER-B	143,076	46.73	6,685,941.48	
	INTERNATIONAL PAPER CO	62,700	31.47	1,973,169.00	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	12,336	56.29	694,393.44	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	43,200	44.75	1,933,200.00	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,900	85.58	590,502.00	
	MEADWESTVACO CORP	26,000	30.02	780,520.00	
	MONSANTO CO	80,700	79.65	6,427,755.00	
	MOSAIC CO/THE	46,200	57.37	2,650,494.00	
	NEWMONT MINING CORP HOLDING CO	74,650	60.89	4,545,438.50	
	NUCOR CORP	47,800	45.13	2,157,214.00	
	OWENS-ILLINOIS INC	24,800	24.73	613,304.00	
	PPG INDUSTRIES INC.	23,800	90.88	2,162,944.00	
	PRAXAIR INC	45,614	108.33	4,941,364.62	
	ROCK-TENN COMPANY-CL A	10,900	66.90	729,210.00	
	SEALED AIR CORP	25,200	20.57	518,364.00	
	SHERWIN-WILLIAMS CO	13,700	97.74	1,339,038.00	
	SIGMA-ALDRICH	18,500	70.97	1,312,945.00	
	UNITED STATES STEEL CORP	22,100	31.87	704,327.00	
	VULCAN MATERIALS COMPANY	19,800	45.20	894,960.00	
	WALTER ENERGY INC	9,600	76.28	732,288.00	
	3M COMPANY	101,738	87.56	8,908,179.28	
	AGCO CORP	14,900	53.73	800,577.00	
	AMETEK INC	24,700	48.22	1,191,034.00	
	BOEING COMPANY	106,295	75.46	8,021,020.70	
	CATERPILLAR INC	97,500	113.78	11,093,550.00	
	COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	24,900	61.36	1,527,864.00	
	CUMMINS INC	28,000	119.80	3,354,400.00	
	DANAHER CORP	88,004	52.82	4,648,371.28	
	DEERE & CO	62,526	87.82	5,491,033.32	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	DOVER CORP	28,100	65.06	1,828,186.00	
	EATON CORP	48,900	51.09	2,498,301.00	
	EMERSON ELECTRIC CO	112,400	53.37	5,998,788.00	
	FASTENAL CO	42,400	48.06	2,037,744.00	

	FLOWSERVE CORP	8,600	114.95	988,570.00	
	FLUOR CORP	26,300	59.40	1,562,220.00	
	GENERAL DYNAMICS CORPORATION	46,400	71.15	3,301,360.00	
	GENERAL ELECTRIC	1,599,545	19.05	30,471,332.25	
	GOODRICH CORP	18,900	125.54	2,372,706.00	
	GRAINGER (W.W.) INC	9,000	202.81	1,825,290.00	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	112,200	60.31	6,766,782.00	
	ILLINOIS TOOL WORKS	66,776	55.58	3,711,410.08	
	INGERSOLL-RAND PLC	49,968	37.35	1,866,304.80	
	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	19,500	46.53	907,335.00	
	JOY GLOBAL INC	15,900	95.58	1,519,722.00	
	KBR INC	23,300	33.63	783,579.00	
	L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	16,200	70.07	1,135,134.00	
	LOCKHEED MARTIN CORPORATION	43,100	85.25	3,674,275.00	
	MASCO CORP	54,400	12.90	701,760.00	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	39,900	58.80	2,346,120.00	
	PACCAR INC	49,675	43.81	2,176,261.75	
	PALL CORP	17,800	62.33	1,109,474.00	
	PARKER HANNIFIN CORP	23,450	86.68	2,032,646.00	
	PENTAIR INC	15,500	38.07	590,085.00	
	PRECISION CASTPARTS CORP	21,800	169.73	3,700,114.00	
	QUANTA SERVICES INC	31,300	22.44	702,372.00	
	RAYTHEON COMPANY	53,400	49.30	2,632,620.00	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	21,700	81.27	1,763,559.00	
	ROCKWELL COLLONS	23,200	58.63	1,360,216.00	
	ROPER INDUSTRIES INC	14,500	94.31	1,367,495.00	
	SPX CORP	8,000	73.42	587,360.00	
	STANLEY BLACK AND DECKER INC	24,137	74.10	1,788,551.70	
	TEXTRON INC	41,900	25.93	1,086,467.00	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	70,132	50.76	3,559,900.32	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	130,300	80.57	10,498,271.00	
	URS CORP	11,900	42.39	504,441.00	
	XYLEM INC	26,400	26.78	706,992.00	
	AVERY DENNISON CORP	15,200	28.84	438,368.00	
	CINTAS CORP	17,900	37.94	679,126.00	
	DUN & BRADSTREET CORP	7,500	84.26	631,950.00	
	EQUIFAX INC	18,500	39.72	734,820.00	
	IHS INC-CLASS A	6,500	91.69	595,985.00	
	IRON MOUNTAIN INC	27,600	30.61	844,836.00	
	MANPOWERGROUP	12,400	46.78	580,072.00	
	NIELSEN HOLDINGS NV	14,100	28.85	406,785.00	
	PITNEY BOWES INC	31,306	19.22	601,701.32	
	REPUBLIC SERVICES INC	45,470	29.98	1,363,190.60	
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	21,400	29.48	630,872.00	
	RR DONNELLEY & SONS CO	29,300	12.31	360,683.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	STERICYCLE INC	12,400	86.14	1,068,136.00	
	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	19,900	41.10	817,890.00	
	WASTE MANAGEMENT INC	67,700	35.37	2,394,549.00	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	24,900	64.03	1,594,471.50	
	CSX CORP	165,300	22.32	3,689,496.00	
	DELTA AIR LINES INC	33,200	10.99	364,868.00	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	32,100	43.47	1,395,387.00	
	FEDEX CORP	45,495	95.25	4,333,398.75	

	HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	40,900	14.43	590,187.00	
	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	14,800	51.91	768,268.00	
	KANSAS CITY SOUTHERN	16,600	69.77	1,158,182.00	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	52,500	72.14	3,787,350.00	
	SOUTHWEST AIRLINES	31,100	9.75	303,225.00	
	UNION PACIFIC CORPORATION	73,660	115.05	8,474,583.00	
	UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	13,000	24.23	314,990.00	
	UNITED PARCEL SERVICE -CL B	111,220	76.92	8,555,042.40	
	AUTOLIV INC	13,700	65.78	901,186.00	
	BORGWARNER INC	16,600	79.26	1,315,716.00	
	FORD MOTOR CO	534,570	12.96	6,928,027.20	
	GENERAL MOTORS CO	117,900	26.70	3,147,930.00	
	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	38,400	13.98	536,832.00	
	HARLEY-DAVIDSON INC	35,700	45.32	1,617,924.00	
	JOHNSON CONTROLS INC	102,642	33.54	3,442,612.68	
	TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	15,900	42.27	672,093.00	
	COACH INC	43,700	72.57	3,171,309.00	
	DR HORTON INC	43,000	14.45	621,350.00	
	FOSSIL INC	8,300	100.49	834,067.00	
	GARMIN LTD	17,900	43.72	782,588.00	
	HASBRO INC	18,800	36.66	689,208.00	
	LEGGETT & PLATT INC	21,400	23.39	500,546.00	
	LULULEMON ATHLETICA INC	15,200	64.94	987,088.00	
	MATTEL INC	51,800	31.75	1,644,650.00	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	9,200	65.75	604,900.00	
	NEWELL RUBBERMAID INC	44,700	18.90	844,830.00	
	NIKE INC. CLASS B	54,100	103.46	5,597,186.00	
	RALPH LAUREN CORP	9,500	157.41	1,495,395.00	
	TOLL BROTHERS INC	23,600	23.28	549,408.00	
	VF CORP	13,300	132.76	1,765,708.00	
	WHIRLPOOL CORP	11,700	70.74	827,658.00	
	APOLLO GROUP INC-CL A	18,700	52.53	982,311.00	
	CARNIVAL CORP	68,900	31.97	2,202,733.00	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,800	371.63	1,783,824.00	
	DARDEN RESTAURANTS INC	20,700	48.34	1,000,638.00	
	DEVRY INC	10,300	38.43	395,829.00	
	H&R BLOCK INC	46,800	17.19	804,492.00	
	INTL GAME TECHNOLOGY	46,000	15.47	711,620.00	
	LAS VEGAS SANDS CORP	55,100	51.48	2,836,548.00	
	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	42,674	36.15	1,542,665.10	
	MC DONALD'S CORPORATION	155,756	99.49	15,496,164.44	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	MGM RESORTS INTERNATIONAL	51,700	14.02	724,834.00	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	21,300	30.56	650,928.00	
	STARBUCKS CORP	112,600	48.29	5,437,454.00	
	STARWOOD HOTELS & RESORTS	29,520	57.29	1,691,200.80	
	WYNN RESORTS LTD	12,300	112.83	1,387,809.00	
	YUM BRANDS INC	70,100	63.19	4,429,619.00	
	CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	32,300	14.91	481,593.00	
	CBS CORP-CL B	94,570	29.63	2,802,109.10	
	COMCAST CORP-CL A	315,323	27.09	8,542,100.07	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	98,150	25.91	2,543,066.50	
	DIRECTV-CLASS A	111,469	45.44	5,065,151.36	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	21,384	44.63	954,367.92	

	DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	19,084	39.78	759,161.52	
	DISH NETWORK CORP-A	31,700	28.58	905,986.00	
	INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES	73,460	10.88	799,244.80	
	LIBERTY GLOBAL INC-A	21,653	47.97	1,038,694.41	
	LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	17,900	46.01	823,579.00	
	LIBERTY MEDIA CORP - LIBER-A	16,400	84.03	1,378,092.00	
	MCGRAW-HILL INC	45,500	45.95	2,090,725.00	
	NEWS CORP INC CLASS A	275,905	19.56	5,396,701.80	
	NEWS CORP INC CLASS B	67,365	20.20	1,360,773.00	
	OMNICOM GROUP	42,200	47.38	1,999,436.00	
	SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	13,900	43.73	607,847.00	
	SIRIUS XM RADIO INC	566,100	2.15	1,217,115.00	
	THE WALT DISNEY CO.	266,058	40.46	10,764,706.68	
	TIME WARNER CABLE	49,141	75.02	3,686,557.82	
	TIME WARNER INC	157,662	37.97	5,986,426.14	
	VIACOM INC-CLASS B	78,970	48.72	3,847,418.40	
	VIRGIN MEDIA INC	45,850	24.49	1,122,866.50	
	WASHINGTON POST -CL B	800	384.00	307,200.00	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	13,500	44.35	598,725.00	
	ADVANCE AUTO PARTS	11,150	76.84	856,766.00	
	AMAZON.COM INC	54,800	183.14	10,036,072.00	
	AUTOZONE INC	3,800	350.76	1,332,888.00	
	BED BATH & BEYOND INC	37,700	61.99	2,337,023.00	
	BEST BUY CO INC	48,050	24.67	1,185,393.50	
	CARMAX INC	34,700	30.32	1,052,104.00	
	DOLLAR GENERAL CORP	25,900	42.02	1,088,318.00	
	DOLLAR TREE INC	18,450	85.83	1,583,563.50	
	EXPEDIA INC	15,225	33.57	511,103.25	
	FAMILY DOLLAR STORES	18,500	57.53	1,064,305.00	
	GAMESTOP CORP-CLASS A	22,100	23.41	517,361.00	
	GAP INC/THE	58,200	21.67	1,261,194.00	
	GENUINE PARTS CO	23,700	64.50	1,528,650.00	
	HOME DEPOT INC	236,104	45.20	10,671,900.80	
	J.C. PENNEY CO INC (HLDG CO)	24,200	41.27	998,734.00	
	KOHLS CORP	40,320	48.80	1,967,616.00	
	LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	86,447	18.17	1,570,741.99	
	LIMITED BRANDS	38,330	44.39	1,701,468.70	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	LOWE'S COS INC	190,296	27.01	5,139,894.96	
	MACY'S INC	64,452	35.72	2,302,225.44	
	NETFLIX INC	8,200	129.25	1,059,850.00	
	NORDSTROM INC	25,900	49.79	1,289,561.00	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	20,600	82.36	1,696,616.00	
	PETSMART INC	17,100	53.01	906,471.00	
	PRICELINE.COM INC	7,600	536.73	4,079,148.00	
	ROSS STORES INC	35,300	51.32	1,811,596.00	
	SEARS HOLDING CORP	6,385	44.55	284,451.75	
	STAPLES INC	107,050	14.88	1,592,904.00	
	TARGET CORP	96,820	52.05	5,039,481.00	
	TIFFANY & CO	18,300	65.16	1,192,428.00	
	TJX COMPANIES INC	115,000	34.32	3,946,800.00	
	URBAN OUTFITTERS INC	19,100	27.48	524,868.00	
	COSTCO WHOLESALE CORP	66,100	85.04	5,621,144.00	
	CVS CAREMARK CORP	202,983	43.27	8,783,074.41	

	KROGER CO	86,800	24.06	2,088,408.00	
	SAFEWAY INC	53,700	21.70	1,165,290.00	
	SYSCO CORP	89,490	29.79	2,665,907.10	
	WAL-MART STORES	286,126	61.88	17,705,476.88	
	WALGREEN CO	136,706	34.28	4,686,281.68	
	WHOLE FOODS MARKET INC	22,800	76.41	1,742,148.00	
	ALTRIA GROUP INC	312,575	28.64	8,952,148.00	
	ARCHER DANIELS MIDLAND COMPANY	102,010	29.60	3,019,496.00	
	BEAM INC	21,300	54.00	1,150,200.00	
	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,880	83.37	1,073,805.60	
	BUNGE LIMITED	22,300	58.15	1,296,745.00	
	CAMPBELL SOUP	29,100	31.85	926,835.00	
	COCA-COLA CO/THE	311,834	68.03	21,214,067.02	
	COCA-COLA ENTERPRISES	48,200	27.10	1,306,220.00	
	CONAGRA FOODS INC	62,650	26.78	1,677,767.00	
	CONSTELLATION BRANDS INC-A	28,800	21.82	628,416.00	
	DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	32,786	38.33	1,256,687.38	
	GENERAL MILLS INC	97,580	39.67	3,870,998.60	
	GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	20,100	69.01	1,387,201.50	
	HEINZ (H.J.) CO	48,500	52.16	2,529,760.00	
	HERSHEY CO/THE	25,200	61.01	1,537,452.00	
	HORMEL FOODS CORP	22,500	29.05	653,625.00	
	JM SMUCKER CO/THE	17,300	79.52	1,375,696.00	
	KELLOGG CO	38,300	50.68	1,941,044.00	
	KRAFT FOODS INC-A	253,218	38.70	9,799,536.60	
	LORILLARD INC	20,987	112.19	2,354,531.53	
	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,100	51.15	925,815.00	
	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	30,800	75.74	2,332,792.00	
	MOLSON COORS BREWING CO -B	24,700	43.61	1,077,167.00	
	MONSTER BEVERAGE CORP	11,400	105.39	1,201,446.00	
	PEPSICO INC	238,821	66.52	15,886,372.92	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	265,075	76.85	20,371,013.75	
	POST HOLDINGS INC	4,200	26.89	112,938.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	RALCORP HOLDINGS INC	8,400	75.63	635,292.00	
	REYNOLDS AMERICAN INC	52,800	40.00	2,112,000.00	
	SARA LEE CORP	84,500	19.94	1,684,930.00	
	TYSON FOODS INC-CL A	46,100	19.15	882,815.00	
	AVON PRODUCTS,INC	66,140	18.46	1,220,944.40	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	21,900	45.24	990,756.00	
	CLOROX COMPANY	19,900	69.41	1,381,259.00	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	73,500	91.24	6,706,140.00	
	ENERGIZER HOLDINGS INC	10,600	75.43	799,558.00	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	36,000	57.41	2,066,760.00	
	HERBALIFE LTD	17,900	59.19	1,059,501.00	
	KIMBERLY-CLARK CORP	59,147	72.20	4,270,413.40	
	PROCTER & GAMBLE CO	414,715	63.51	26,338,549.65	
	AETNA INC	56,300	43.76	2,463,688.00	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	40,700	38.98	1,586,486.00	
	BARD (C.R.) INC	13,100	93.23	1,221,313.00	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	85,810	57.11	4,900,609.10	
	BECTON DICKINSON & CO	32,900	80.53	2,649,437.00	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	230,986	6.02	1,390,535.72	
	CARDINAL HEALTH INC	52,054	41.80	2,175,857.20	

	CAREFUSION CORP	34,277	25.13	861,381.01	
	CERNER CORP	22,000	62.78	1,381,160.00	
	CIGNA CORP	43,100	42.92	1,849,852.00	
	COVENTRY HEALTH CARE INC	22,750	30.55	695,012.50	
	COVIDIEN PLC	74,532	52.62	3,921,873.84	
	DAVITA INC	14,100	84.23	1,187,643.00	
	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	21,600	38.17	824,472.00	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17,400	72.52	1,261,848.00	
	EXPRESS SCRIPTS INC	70,000	49.66	3,476,550.00	
	HCA HOLDINGS INC	26,400	28.40	749,760.00	
	HENRY SCHEIN INC	14,200	72.99	1,036,458.00	
	HOLOGIC INC	40,144	20.79	834,593.76	
	HUMANA INC	25,200	85.25	2,148,300.00	
	INTUITIVE SURGICAL INC	5,900	491.39	2,899,201.00	
	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	15,300	91.00	1,392,300.00	
	MCKESSON CORP	37,200	82.30	3,061,560.00	
	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	58,210	58.47	3,403,538.70	
	MEDTRONIC,INCORPORATED	160,145	40.56	6,495,481.20	
	OMNICARE INC	17,500	32.51	568,925.00	
	PATTERSON COS INC	14,500	32.36	469,220.00	
	QUEST DIAGNOSTICS INC	23,900	57.93	1,384,527.00	
	ST JUDE MEDICAL INC	49,800	43.32	2,157,336.00	
	STRYKER CORP	44,000	55.67	2,449,480.00	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	162,468	51.29	8,332,983.72	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	17,700	67.71	1,198,467.00	
	WELLPOINT INC	54,498	64.37	3,508,036.26	
	ZIMMER HOLDINGS INC	28,800	62.59	1,802,592.00	
	ABBOTT LABORATORIES	234,953	55.39	13,014,046.67	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	52,600	44.66	2,349,116.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	27,900	79.75	2,225,025.00	
	ALLERGAN INC	46,500	86.49	4,021,785.00	
	AMGEN INC	119,762	69.13	8,279,745.87	
	BIOGEN IDEC INC	34,857	122.09	4,255,691.13	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	257,375	32.13	8,269,458.75	
	CELGENE CORP	69,300	73.52	5,095,282.50	
	COVANCE INC	9,400	45.79	430,426.00	
	ELI LILLY & CO	157,233	39.64	6,232,716.12	
	FOREST LABORATORIES INC	41,500	31.94	1,325,510.00	
	GILEAD SCIENCES INC	116,500	56.02	6,526,912.50	
	HOSPIRA INC	25,315	35.47	897,923.05	
	ILLUMINA INC	18,800	51.97	977,036.00	
	JOHNSON & JOHNSON	413,570	65.19	26,960,628.30	
	LIFE TECHNOLOGIES CORP	27,300	49.24	1,344,252.00	
	MERCK & CO. INC.	464,919	38.40	17,852,889.60	
	MYLAN INC	64,400	22.32	1,437,730.00	
	PERRIGO CO	12,700	94.01	1,193,927.00	
	PFIZER	1,177,272	20.95	24,663,848.40	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	57,700	55.74	3,216,198.00	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	31,700	38.24	1,212,366.50	
	WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	22,000	16.79	369,380.00	
	WATERS CORPORATION	13,800	89.26	1,231,788.00	
	WATSON PHARMACEUTICALS INC	20,300	57.75	1,172,325.00	
	BB&T CORPORATION	105,200	28.82	3,031,864.00	

	CIT GROUP INC	28,800	40.91	1,178,208.00	
	COMERICA INC	30,800	29.78	917,224.00	
	FIFTH THIRD BANCORP	138,843	13.49	1,872,992.07	
	HUDSON CITY BANCORP INC	74,500	7.09	528,205.00	
	KEYCORP	145,940	8.13	1,186,492.20	
	M & T BANK CORP	17,300	80.99	1,401,127.00	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP	67,100	12.48	837,408.00	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN	57,800	12.50	722,500.00	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	79,488	61.07	4,854,332.16	
	REGIONS FINANCIAL CORP	192,837	5.59	1,077,958.83	
	SUNTRUST BANKS INC	81,108	22.10	1,792,486.80	
	US BANCORP	289,857	29.16	8,452,230.12	
	WELLS FARGO & COMPANY	756,920	30.20	22,858,984.00	
	AMERICAN EXPRESS COMPANY	162,201	51.81	8,403,633.81	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	35,680	54.33	1,938,494.40	
	BANK OF AMERICA CORP	1,529,200	7.97	12,187,724.00	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	186,092	21.95	4,084,719.40	
	BLACKROCK INC	14,300	190.18	2,719,574.00	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	69,384	47.90	3,323,493.60	
	CITIGROUP INC	440,376	33.30	14,664,520.80	
	CME GROUP INC	9,600	275.32	2,643,072.00	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	82,357	28.28	2,329,055.96	
	EATON VANCE CORP	17,900	27.41	490,639.00	
	FRANKLIN RESOURCES INC	23,300	116.22	2,707,926.00	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	72,600	117.39	8,522,514.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	11,100	122.76	1,362,636.00	
	INVESCO LTD	68,111	23.89	1,627,171.79	
	JPMORGAN CHASE & CO	588,387	38.14	22,441,080.18	
	LEGG MASON INC	21,200	27.28	578,336.00	
	LEUCADIA NATIONAL CORP	31,900	29.54	942,326.00	
	MOODY'S CORP	31,500	38.64	1,217,160.00	
	MORGAN STANLEY	218,214	20.51	4,475,569.14	
	NASDAQ OMX GROUP	19,400	25.35	491,790.00	
	NORTHERN TRUST CORP	32,800	44.15	1,448,120.00	
	NYSE GROUP INC	40,200	27.72	1,114,344.00	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	162,600	12.70	2,065,020.00	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	22,100	19.47	430,287.00	
	SLM CORP	77,700	15.87	1,233,487.50	
	STATE STREET CORP	76,073	41.83	3,182,133.59	
	T ROWE PRICE GROUP INC	38,778	58.76	2,278,595.28	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	35,100	17.51	614,601.00	
	ACE LTD	51,000	72.98	3,721,980.00	
	AFLAC INC	70,510	49.60	3,497,296.00	
	ALLSTATE CORP	77,960	30.63	2,387,914.80	
	AMERICAN INT'L GROUP	71,613	26.80	1,919,228.40	
	AON CORP	44,400	47.98	2,130,312.00	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,700	37.27	771,489.00	
	ASSURANT INC	14,300	41.54	594,022.00	
	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	18,900	31.49	595,161.00	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	136,900	79.85	10,931,465.00	
	CHUBB CORP	43,218	67.81	2,930,612.58	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	23,771	33.10	786,820.10	
	EVEREST RE GROUP LTD	8,500	87.75	745,875.00	

	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC CL-A	32,065	18.25	585,186.25	
	GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	75,300	8.94	673,182.00	
	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GR	63,900	19.33	1,235,187.00	
	LINCOLN NATIONAL CORP	46,607	23.65	1,102,255.55	
	LOEWS CORP	48,790	38.38	1,872,560.20	
	MARSH & MCLENNAN COS	81,739	32.24	2,635,265.36	
	METLIFE INC	159,640	37.68	6,015,235.20	
	PARTNERRE LTD	9,800	68.18	668,164.00	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	47,400	26.95	1,277,430.00	
	PROGRESSIVE CORP	91,600	21.15	1,937,340.00	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	73,086	59.99	4,384,429.14	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	7,900	74.92	591,868.00	
	TORCHMARK CORP	15,900	47.36	753,024.00	
	TRAVELERS COS INC/THE	63,213	59.33	3,750,427.29	
	UNUM GROUP	46,600	23.65	1,102,090.00	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	24,900	39.27	977,823.00	
	WR BERKLEY CORP	18,050	36.04	650,522.00	
	XL GROUP PLC	45,000	20.98	944,100.00	
	CBRE GROUP INC	44,900	19.60	880,040.00	
	WEYERHAEUSER CO	81,312	20.70	1,683,158.40	
	ACCENTURE PLC-CL A	97,300	57.66	5,610,318.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	ACTIVISION BLIZZARD INC	77,600	12.32	956,032.00	
	ADOBE SYSTEMS INC	74,600	31.85	2,376,383.00	
	AKAMAI TECHNOLOGIES	28,300	33.37	944,371.00	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	7,700	115.97	892,969.00	
	AUTODESK INC	35,100	37.75	1,325,200.50	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	73,900	55.12	4,073,737.50	
	BMC SOFTWARE INC	27,000	38.01	1,026,270.00	
	CA INC	61,000	26.42	1,611,620.00	
	CITRIX SYSTEMS INC	28,500	69.44	1,979,182.50	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	45,900	72.37	3,321,783.00	
	COMPUTER SCIENCES CORP	23,800	27.45	653,310.00	
	EBAY INC	175,072	32.64	5,714,350.08	
	ELECTRONIC ARTS INC	50,610	19.00	961,590.00	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION	37,523	29.26	1,097,922.98	
	FISERV INC	21,400	65.21	1,395,494.00	
	GOOGLE INC-CLASS A	38,400	609.09	23,389,056.00	
	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE	180,278	192.82	34,761,203.96	
	INTUIT INC	43,600	57.90	2,524,440.00	
	MASTERCARD INC-CLASS A	16,400	391.31	6,417,484.00	
	MICROSOFT CORP	1,137,791	30.20	34,361,288.20	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	37,200	29.31	1,090,332.00	
	ORACLE CORP	610,676	29.00	17,709,604.00	
	PAYCHEX INC	49,300	31.74	1,564,782.00	
	RED HAT INC	29,200	48.25	1,408,900.00	
	SAIC INC	42,600	12.69	540,594.00	
	SALESFORCE.COM INC	19,200	123.23	2,366,016.00	
	SYMANTEC CORP	111,900	17.53	1,961,607.00	
	SYNOPSYS INC	22,100	29.74	657,254.00	
	TERADATA CORP	25,400	56.87	1,444,498.00	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	24,775	21.69	537,369.75	
	VERISIGN INC	23,900	36.60	874,740.00	

	VISA INC-CLASS A SHARES	78,700	107.36	8,449,232.00	
	VMWARE INC-CLASS A	13,200	94.91	1,252,812.00	
	WESTERN UNION CO	94,748	19.49	1,846,638.52	
	YAHOO! INC	181,000	15.82	2,863,420.00	
	AMPHENOL CORP-CL A	25,700	54.85	1,409,645.00	
	APPLE INC	139,900	463.97	64,909,403.00	
	ARROW ELECTRONICS INC	17,400	41.90	729,060.00	
	AVNET INC	23,400	36.09	844,506.00	
	CISCO SYSTEMS INC	830,013	20.19	16,757,962.47	
	CORNING INC	237,100	13.73	3,255,383.00	
	DELL INC	247,758	17.65	4,372,928.70	
	DOLBY LABORATORIES INC-CL A	7,600	37.81	287,356.00	
	EMC CORP/MASS	311,600	26.26	8,182,616.00	
	F5 NETWORKS INC	12,200	125.00	1,525,000.00	
	FLEXTRONICS INTL LTD	110,400	7.12	786,048.00	
	FLIR SYSTEMS INC	24,500	26.05	638,225.00	
	HARRIS CORP	18,500	41.83	773,855.00	
	HEWLETT-PACKARD CO	313,000	28.76	9,001,880.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	JUNIPER NETWORKS INC	80,500	22.72	1,828,960.00	
	MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS I	42,762	38.83	1,660,448.46	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	46,671	46.70	2,179,535.70	
	NETAPP INC	55,660	39.93	2,222,503.80	
	QUALCOMM INC	253,138	61.05	15,454,074.90	
	SANDISK CORP	36,100	47.56	1,716,916.00	
	SEAGATE TECHNOLOGY	64,400	26.39	1,699,838.00	
	TE CONNECTIVITY LTD	65,432	35.15	2,299,934.80	
	WESTERN DIGITAL CORP	35,200	38.72	1,362,944.00	
	XEROX CORP	211,812	7.94	1,681,787.28	
	AT&T INC	894,252	29.97	26,800,732.44	
	CENTURYLINK INC	93,067	37.11	3,453,716.37	
	CROWN CASTLE INTL CORP	43,300	49.28	2,133,824.00	
	FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	150,185	4.34	651,802.90	
	LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	23,920	19.80	473,616.00	
	METROPCS COMMUNICATIONS INC	39,500	9.61	379,595.00	
	NII HOLDINGS INC	26,100	22.99	600,039.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	16,900	45.45	768,105.00	
	SPRINT NEXTEL CORP	459,738	2.46	1,130,955.48	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	427,248	38.14	16,295,238.72	
	WINDSTREAM CORP	80,200	12.29	985,658.00	
	AES CORP	100,400	12.78	1,283,112.00	
	ALLIANT ENERGY CORP	17,000	43.06	732,020.00	
	AMEREN CORPORATION	36,500	31.54	1,151,210.00	
	AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY	72,800	39.61	2,883,608.00	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	26,900	33.87	911,103.00	
	CALPINE CORP	48,600	14.82	720,252.00	
	CENTERPOINT ENERGY INC	62,100	18.77	1,165,617.00	
	CONSOLIDATED EDISON INC	44,200	58.80	2,598,960.00	
	CONSTELLATION ENERGY GROUP	28,900	36.46	1,053,694.00	
	DOMINION RESOURCES INC	85,900	50.27	4,318,193.00	
	DTE ENERGY COMPANY	25,600	53.17	1,361,152.00	
	DUKE ENERGY CORP	200,956	21.27	4,274,334.12	
	EDISON INTERNATIONAL	46,800	40.93	1,915,524.00	
	ENTERGY CORP	26,700	68.76	1,835,892.00	

	EXELON CORP	100,000	39.86	3,986,000.00	
	FIRSTENERGY CORP	63,175	43.25	2,732,318.75	
	INTEGRYS ENERGY GROUP INC	11,900	52.95	630,105.00	
	MDU RESOURCES GROUP INC	28,500	21.46	611,610.00	
	NEXTERA ENERGY INC	60,594	59.97	3,633,822.18	
	NISOURCE INC	42,400	22.97	973,928.00	
	NORTHEAST UTILITIES	26,700	35.27	941,709.00	
	NRG ENERGY INC	36,500	16.95	618,675.00	
	NSTAR	15,900	45.82	728,538.00	
	ONEOK INC	14,900	81.73	1,217,777.00	
	P G & E CORP	60,700	41.15	2,497,805.00	
	PEPCO HOLDINGS INC	34,700	19.77	686,019.00	
	PINNACLE WEST CAPITAL	16,700	47.31	790,077.00	
	PPL CORPORATION	87,200	27.49	2,397,128.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	PROGRESS ENERGY INC	44,500	54.07	2,406,115.00	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	76,400	30.23	2,309,572.00	
	SCANA CORP	18,700	45.20	845,240.00	
	SEMPRA ENERGY	34,400	57.46	1,976,624.00	
	SOUTHERN COMPANY	129,432	44.20	5,720,894.40	
	WISCONSIN ENERGY CORP	35,300	34.67	1,223,851.00	
	XCEL ENERGY INC	73,200	26.41	1,933,212.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES	89,692	6.92	620,668.64	
	ALTERA CORPORATION	48,900	40.32	1,971,648.00	
	ANALOG DEVICES	45,200	39.57	1,788,564.00	
	APPLIED MATERIALS INC	198,900	12.61	2,508,129.00	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	33,400	34.30	1,145,620.00	
	BROADCOM CORP-CL A	72,635	37.14	2,697,663.90	
	CREE INC	16,800	28.18	473,424.00	
	FIRST SOLAR INC	8,600	46.49	399,857.00	
	INTEL CORP	792,365	26.72	21,171,992.80	
	KLA-TENCOR CORPORATION	25,661	50.83	1,304,348.63	
	LAM RESEARCH CORP	19,100	43.23	825,693.00	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	34,425	34.13	1,174,925.25	
	LSI CORP	89,300	8.05	718,865.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	79,700	16.34	1,302,298.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	45,200	27.27	1,232,830.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	28,800	38.02	1,094,976.00	
	MICRON TECHNOLOGY INC	136,400	7.72	1,053,690.00	
	NVIDIA CORP	91,100	15.70	1,430,270.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	174,327	33.61	5,859,130.47	
	XILINX INC	40,100	36.31	1,456,031.00	
米ドル 小計		45,733,491	—	1,874,985,109.41 (143,530,110,125)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	43,900	24.28	1,065,892.00	
	ATHABASCA OIL SANDS CORP	46,100	12.52	577,172.00	
	BAYTEX ENERGY CORP	17,700	57.00	1,008,900.00	
	BONAVISTA ENERGY CORP	21,900	22.93	502,167.00	
	CAMECO CORP	59,600	23.54	1,402,984.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	165,640	40.28	6,671,979.20	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	73,200	24.24	1,774,368.00	
	CENOVUS ENERGY INC	113,840	38.11	4,338,442.40	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	37,300	45.97	1,714,681.00	
	ENBRIDGE INC	111,040	38.42	4,266,156.80	

	ENCANA CORP	111,140	20.20	2,245,028.00	
	ENERPLUS CORP	27,500	23.80	654,500.00	
	HUSKY ENERGY INC	50,200	24.94	1,251,988.00	
	IMPERIAL OIL LTD	44,800	47.05	2,107,840.00	
	MEG ENERGY CORP	19,100	45.61	871,151.00	
	NEXEN INC	79,600	18.03	1,435,188.00	
	NIKO RESOURCES LTD	7,300	48.92	357,116.00	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	39,100	25.65	1,002,915.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	25,300	27.97	707,641.00	
	PENGROWTH ENERGY CORP	56,000	9.99	559,440.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
カナダドル	PENN WEST PETROLEUM LTD	70,878	21.80	1,545,140.40	
	PRECISION DRILLING CORP	36,000	11.01	396,360.00	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	29,000	10.90	316,100.00	
	SUNCOR ENERGY INC	237,532	34.92	8,294,617.44	
	TALISMAN ENERGY INC	155,600	12.62	1,963,672.00	
	TOURMALINE OIL CORP	18,600	25.07	466,302.00	
	TRANSCANADA CORP	106,050	41.38	4,388,349.00	
	VERMILION ENERGY INC	14,200	45.36	644,112.00	
	AGNICO-EAGLE MINES	25,600	36.44	932,864.00	
	AGRIUM INC	23,800	82.68	1,967,784.00	
	BARRICK GOLD CORP	150,900	48.90	7,379,010.00	
	CENTERRA GOLD INC	26,000	18.72	486,720.00	
	ELDORADO GOLD CORPORATION	82,900	14.53	1,204,537.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	71,900	22.64	1,627,816.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	19,400	43.44	842,736.00	
	GOLDCORP INC	121,940	47.27	5,764,103.80	
	IAMGOLD CORP	56,700	17.12	970,704.00	
	INMET MINING CORPORATION	8,200	69.50	569,900.00	
	IVANHOE MINES LTD	42,900	17.04	731,016.00	
	KINROSS GOLD CORP	171,520	11.09	1,902,156.80	
	NEW GOLD INC	65,600	11.97	785,232.00	
	OSISKO MINING CORP	52,800	12.06	636,768.00	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	16,100	23.78	382,858.00	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	129,200	46.33	5,985,836.00	
	SILVER WHEATON CORP	53,400	35.83	1,913,322.00	
	SINO-FOREST CORPORATION	34,700	0.01	347.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	87,745	42.50	3,729,162.50	
	YAMANA GOLD INC	112,500	16.87	1,897,875.00	
	BOMBARDIER INC CL B	220,540	4.66	1,027,716.40	
	CAE INC	40,400	10.99	443,996.00	
	FINNING INTERNATIONAL INC	26,300	27.69	728,247.00	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	22,800	53.76	1,225,728.00	
	RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	14,000	24.68	345,520.00	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	68,000	77.14	5,245,520.00	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	25,610	74.34	1,903,847.40	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	32,900	43.17	1,420,293.00	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	18,200	21.46	390,572.00	
	TIM HORTONS INC	24,203	48.90	1,183,526.70	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	56,240	19.71	1,108,490.40	
	THOMSON REUTERS CORP	56,853	27.37	1,556,066.61	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	12,000	63.94	767,280.00	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	18,700	30.22	565,114.00	
	EMPIRE CO LTD 'A'	4,200	55.90	234,780.00	

	LOBLAW COMPANIES LTD	17,300	36.34	628,682.00	
	METRO INC	15,300	52.50	803,250.00	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	32,900	40.41	1,329,489.00	
	WESTON (GEORGE) LTD	8,100	64.58	523,098.00	
	SAPUTO INC	21,900	40.92	896,148.00	
	VITERRA INC	57,000	10.48	597,360.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
カナダドル	VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	43,100	49.94	2,152,414.00	
	BANK OF MONTREAL	96,062	58.47	5,616,745.14	
	BANK OF NOVA SCOTIA	163,900	51.78	8,486,742.00	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	60,200	76.40	4,599,280.00	
	NATIONAL BANK OF CANADA	24,500	76.06	1,863,470.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	216,800	53.47	11,592,296.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	134,150	78.98	10,595,167.00	
	CI FINANCIAL CORP	24,900	22.12	550,788.00	
	IGM FINANCIAL INC	17,800	44.82	797,796.00	
	ONEX CORPORATION	14,300	35.99	514,657.00	
	TMX GROUP INC	11,600	42.25	490,100.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,000	401.01	1,203,030.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	43,700	22.62	988,494.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	13,200	26.20	345,840.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	19,600	59.53	1,166,788.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	269,800	12.27	3,310,446.00	
	POWER CO OF CANADA	52,800	25.21	1,331,088.00	
	POWER FINANCIAL CORP	37,400	27.32	1,021,768.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	87,600	20.89	1,829,964.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT-CL A	84,425	31.45	2,655,166.25	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	38,625	17.94	692,932.50	
	CGI GROUP INC	34,700	20.41	708,227.00	
	OPEN TEXT CORP	8,800	60.38	531,344.00	
	RESEARCH IN MOTION	71,200	16.53	1,176,936.00	
	BCE INC	38,792	40.54	1,572,627.68	
	BELL ALIANT INC	11,800	27.90	329,220.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	62,300	38.07	2,371,761.00	
	TELUS CORP	7,300	56.83	414,859.00	
	TELUS CORPORATION -NON VOTE	24,600	54.16	1,332,336.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	13,400	61.81	828,254.00	
	FORTIS INC	28,200	33.95	957,390.00	
	TRANSALTA CORP	32,000	20.51	656,320.00	
カナダドル 小計		5,755,925	—	187,849,921.42 (14,432,509,462)	
ユーロ	CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	21,767	22.16	482,356.72	
	ENI SPA	362,619	17.18	6,229,794.42	
	FUGRO NV-CVA	10,472	52.64	551,246.08	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	35,508	13.00	461,604.00	
	NESTE OIL OYJ	18,111	9.45	171,148.95	
	OMV AG	25,115	27.05	679,486.32	
	REPSOL YPF SA	119,740	20.28	2,428,327.20	
	SAIPEM	39,951	36.19	1,445,826.69	
	SBM OFFSHORE NV	26,520	13.66	362,263.20	
	TECHNIP S.A.	14,972	74.83	1,120,354.76	
	TENARIS SA	71,253	14.43	1,028,180.79	
	TOTAL SA	320,291	40.90	13,101,503.35	
	ACERINOX SA	14,331	11.15	159,862.30	

	AIR LIQUIDE	42,809	97.66	4,180,726.94	
	AKZO NOBEL	34,956	41.26	1,442,459.34	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	ARCELORMITTAL	129,539	16.16	2,093,350.24	
	ARKEMA	8,494	64.76	550,071.44	
	BASF SE	138,589	61.35	8,502,435.15	
	CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	28,479	5.08	144,701.79	
	CRH PLC	108,106	15.61	1,688,075.19	
	HEIDELBERGCEMENT AG	21,583	38.78	837,096.65	
	IMERYS SA	5,421	43.77	237,277.17	
	K+S AG	25,993	40.00	1,039,720.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	23,642	41.00	969,322.00	
	LAFARGE SA	30,340	31.83	965,722.20	
	LANXESS	12,770	53.74	686,259.80	
	LINDE AG	25,766	124.45	3,206,578.70	
	SALZGITTER AG	6,046	47.22	285,492.12	
	SOLVAY SA	9,100	79.37	722,267.00	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	87,783	5.65	496,412.86	
	THYSSENKRUPP AG	58,224	22.39	1,303,635.36	
	UMICORE	17,497	38.00	664,886.00	
	UPM-KYMMENE OYJ	79,805	10.44	833,164.20	
	VOESTALPINE AG	16,865	27.81	469,099.97	
	WACKER CHEMIE AG	2,460	75.77	186,394.20	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,733	25.09	545,280.97	
	ALSTOM	31,107	30.71	955,451.50	
	BEKAERT NV	6,120	26.51	162,271.80	
	BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	10,410	31.08	323,594.85	
	BOUYGUES SA	28,507	25.30	721,227.10	
	BRENNTAG AG	5,138	85.25	438,014.50	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	60,608	35.63	2,159,463.04	
	EIFFAGE	5,821	25.39	147,824.29	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	61,866	27.23	1,684,611.18	
	FERROVIAL SA	56,290	9.49	534,642.42	
	FIAT INDUSTRIAL	115,375	7.76	895,310.00	
	FINMECCANICA SPA	63,634	3.48	221,955.39	
	FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	7,217	18.92	136,545.64	
	GEA GROUP AG	26,800	25.81	691,708.00	
	HOCHTIEF AG	6,659	53.37	355,390.83	
	KONE OYJ-B	23,871	43.04	1,027,407.84	
	LEGRAND SA	33,768	26.69	901,436.76	
	MAN SE	9,737	82.98	807,976.26	
	METSO OYJ	19,614	34.66	679,821.24	
	PHILIPS ELECTRONICS NV	152,244	15.87	2,416,112.28	
	PRYSMIAN SPA	32,021	12.01	384,572.21	
	SAFRAN S.A.	25,602	24.45	626,096.91	
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	73,865	48.75	3,600,918.75	
	SIEMENS AG-REG	124,149	75.79	9,409,252.71	
	THALES SA	15,278	27.40	418,617.20	
	VALLOUREC	17,071	50.74	866,182.54	
	VINCI S.A.	68,103	36.96	2,517,427.39	
	WARTSILA OYJ	25,732	26.30	676,751.60	
	WENDEL	5,161	60.94	314,511.34	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	ZARDOYA OTIS SA	22,525	10.81	243,495.25	
	BIC	4,472	71.68	320,552.96	
	BUREAU VERITAS SA	8,385	58.54	490,857.90	
	EDENRED	24,270	19.28	468,046.95	
	RANDSTAD HOLDING NV	18,359	28.71	527,178.68	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	59,549	12.84	764,609.16	
	ADP	5,446	56.00	304,976.00	
	ATLANTIA SPA	48,370	12.77	617,684.90	
	DEUTSCHE POST AG-REG	127,700	12.97	1,656,907.50	
	FRAPORT AG	5,777	45.37	262,102.49	
	GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	81,054	6.46	523,933.05	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	145,865	2.25	328,196.25	
	LUFTHANSA (REGD)	35,142	11.18	392,887.56	
	TNT EXPRESS NV - W/I	54,083	6.32	342,183.14	
	VOPAK (KON)	10,609	41.67	442,130.07	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	49,959	70.76	3,535,098.84	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	8,207	45.47	373,172.29	
	CONTINENTAL AG	12,279	66.07	811,273.53	
	DAIMLER AG	136,675	45.47	6,214,612.25	
	FIAT SPA	117,392	4.56	536,246.65	
	MICHELIN CLASS B (BROWN BDS)	27,160	54.34	1,475,874.40	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	16,891	29.77	502,845.07	
	PEUGEOT SA	23,920	15.93	381,165.20	
	PIRELLI & CO SPA	37,402	7.49	280,140.98	
	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PFD	23,105	48.45	1,119,552.77	
	RENAULT SA	29,004	37.07	1,075,323.30	
	VOLKSWAGEN AG	4,528	128.35	581,168.80	
	VOLKSWAGEN AG (PREF)	21,822	143.45	3,130,365.90	
	ADIDAS-SALOMON AG	31,569	58.50	1,846,786.50	
	CHRISTIAN DIOR	8,227	114.45	941,580.15	
	LUXOTTICA GROUP SPA	17,618	25.47	448,730.46	
	LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	38,343	128.65	4,932,826.95	
	ACCOR SA	22,636	25.40	575,067.58	
	AUTOGRILL SPA	16,968	8.14	138,204.36	
	OPAP SA	35,111	7.28	255,608.08	
	SODEXO	14,226	56.91	809,601.66	
	AXEL SPRINGER AG	6,399	37.68	241,114.32	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	15,202	28.84	438,501.69	
	JC DECAUX SA	10,079	20.26	204,200.54	
	KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	13,813	38.00	524,894.00	
	LAGARDERE S.C.A.	18,114	23.14	419,248.53	
	MEDIASET SPA	111,438	2.52	281,492.38	
	PROSIEBEN SAT1 MEDIA AG-PFD	11,005	18.65	205,243.25	
	PUBLICIS GROUPE	21,705	39.82	864,401.62	
	REED ELSEVIER NV	103,790	9.07	941,375.30	
	SANOMAWSOY OYJ	11,628	11.46	133,256.88	
	SES	45,944	18.09	831,126.96	
	TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	17,287	8.90	153,906.16	
	WOLTERS KLUWER	45,838	14.04	643,794.71	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	INDITEX	32,919	67.45	2,220,386.55	
	PPR	11,483	126.55	1,453,173.65	

	CARREFOUR SA	87,129	18.34	1,598,381.50	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	8,494	68.78	584,217.32	
	COLRUYT SA	11,623	29.58	343,866.45	
	DELHAIZE GROUP	15,587	42.67	665,175.22	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	90,793	3.64	331,031.27	
	JERONIMO MARTINS	33,804	12.84	434,043.36	
	KESKO OYJ-B SHS	10,520	23.77	250,060.40	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	175,317	10.29	1,804,011.93	
	METRO AG	19,898	30.02	597,337.96	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	121,136	48.85	5,917,493.60	
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	28,125	14.70	413,437.50	
	DANONE	88,116	48.41	4,265,695.56	
	HEINEKEN HOLDING NV	17,683	31.40	555,246.20	
	HEINEKEN NV	39,111	36.76	1,437,915.91	
	KERRY GROUP PLC-A	21,551	29.00	624,979.00	
	PERNOD-RICARD	29,958	75.77	2,269,917.66	
	SUEDZUCKER AG	10,421	22.96	239,318.26	
	UNILEVER NV-CVA	245,797	25.33	6,226,038.01	
	BEIERSDORF AG	15,471	46.58	720,639.18	
	HENKEL AG & CO KGAA	19,937	40.16	800,769.60	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	26,883	47.40	1,274,388.61	
	L'OREAL	36,274	81.68	2,962,860.32	
	CELESIO AG	12,054	15.25	183,883.77	
	ESSILOR INTERNATIONAL	30,340	56.30	1,708,142.00	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	31,514	54.96	1,732,009.44	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	17,159	77.54	1,330,508.86	
	BAYER AG	124,778	55.25	6,893,984.50	
	ELAN CORP PLC	75,477	10.80	815,151.60	
	GRIFOLS SA	21,776	15.00	326,640.00	
	MERCK KGAA	9,918	81.29	806,234.22	
	ORION OYJ	14,834	15.11	224,141.74	
	QIAGEN N.V.	35,866	12.11	434,516.59	
	SANOFI	172,935	55.80	9,649,773.00	
	UCB SA	15,479	30.80	476,753.20	
	BANCA CARIGE SPA	91,616	1.54	141,363.48	
	BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	760,546	0.34	260,030.67	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	691,609	7.22	4,994,108.58	
	BANCO DE SABADELL SA	174,845	2.90	507,225.34	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	75,447	1.35	101,853.45	
	BANCO POPOLARE SPA	270,667	1.46	395,173.82	
	BANCO POPULAR ESPANOL	149,046	3.53	526,132.38	
	BANCO SANTANDER SA	1,277,064	6.50	8,300,916.00	
	BANKIA SAU	132,958	3.51	467,480.32	
	BANKINTER SA	30,197	5.37	162,157.89	
	BNP PARIBAS	145,788	34.99	5,101,122.12	
	CAIXABANK	113,827	3.95	449,616.65	
	COMMERZBANK AG	540,093	1.89	1,021,855.95	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	CREDIT AGRICOLE SA	151,050	5.18	782,439.00	
	ERSTE GROUP BANK AG	29,021	18.48	536,453.18	
	INTESA SANPAOLO	1,520,334	1.52	2,321,550.01	
	INTESA SANPAOLO-RNC	134,006	1.25	167,909.51	
	IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	126,938	0.01	1,269.38	
	KBC GROUP	24,721	17.54	433,606.34	

	NATIONAL BANK OF GREECE	146,741	2.84	416,744.44	
	NATIXIS	137,179	2.41	331,836.00	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	7,024	29.05	204,047.20	
	SOCIETE GENERALE	99,537	23.55	2,344,096.35	
	UNICREDIT SPA	610,738	4.18	2,555,327.79	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	124,903	3.93	491,368.40	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	140,252	33.65	4,719,479.80	
	DEUTSCHE BOERSE AG-NEW	29,424	48.52	1,427,652.48	
	EURAZEO	4,301	35.78	153,889.78	
	EXOR SPA	9,213	18.50	170,440.50	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,383	57.00	705,831.00	
	ING GROEP NV-CVA	577,940	7.30	4,224,163.46	
	MEDIOBANCA SPA	79,300	4.96	393,645.20	
	POHJOLA BANK PLC	21,721	8.66	188,103.86	
	AEGON NV	259,332	3.85	998,428.20	
	AGEAS	333,850	1.66	555,860.25	
	ALLIANZ SE-REG	68,580	88.19	6,048,070.20	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	176,187	12.33	2,172,385.71	
	AXA	262,598	12.65	3,323,177.69	
	CNP ASSURANCES	21,876	11.06	242,057.94	
	DELTA LLOYD NV	15,951	14.64	233,602.39	
	HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	9,481	41.28	391,375.68	
	MAPFRE SA	118,404	2.59	307,613.59	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	27,061	105.40	2,852,229.40	
	SAMPO OYJ-A SHS	63,383	20.63	1,307,591.29	
	SCOR SE	25,931	19.50	505,784.15	
	VIENNA INSURANCE GROUP AG	5,519	34.69	191,454.11	
	IMMOFINANZ AG	142,559	2.68	382,058.12	
	AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	47,275	14.20	671,305.00	
	ATOS	7,779	41.10	319,716.90	
	CAP GEMINI SA	22,712	29.47	669,322.64	
	DASSAULT SYSTEMS SA	9,275	64.07	594,249.25	
	INDRA SISTEMAS SA	14,343	10.93	156,840.70	
	SAP AG	138,837	48.08	6,675,977.14	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,952	14.64	248,262.04	
	ALCATEL-LUCENT	350,104	1.45	510,801.73	
	NEOPOST SA	5,071	55.12	279,513.52	
	NOKIA OYJ	565,074	3.81	2,155,192.23	
	BELGACOM SA	23,346	23.98	559,953.81	
	DEUTSCHE TELEKOM AG (REGD)	423,826	8.87	3,760,608.09	
	ELISA CORPORATION-A SHS	22,229	16.78	373,002.62	
	FRANCE TELECOM SA	279,779	11.52	3,223,054.08	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	34,621	2.80	96,938.80	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	ILIAD SA	3,010	94.05	283,090.50	
	KONINKLIJKE KPN NV	222,943	8.28	1,847,528.64	
	MOBISTAR SA	4,718	40.22	189,781.55	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA (REGD	103,197	4.11	425,068.44	
	TELECOM ITALIA SPA	1,417,119	0.78	1,115,981.21	
	TELECOM ITALIA-RNC	924,889	0.63	591,466.51	
	TELEFONICA S.A.	619,792	13.41	8,314,509.68	
	TELEKOM AUSTRIA AG	50,994	8.96	457,059.22	
	VIVENDI SA	188,162	16.16	3,041,638.73	
	A2A SPA	157,578	0.74	117,553.18	

	ACCIONA S.A.	3,744	64.15	240,177.60	
	E.ON AG	271,737	17.11	4,649,420.07	
	EDP RENOVAVEIS SA	31,340	4.37	137,206.52	
	ELECTRICITE DE FRANCE	36,501	18.47	674,173.47	
	ENAGAS	27,481	15.20	417,711.20	
	ENEL GREEN POWER SPA	268,590	1.51	405,570.90	
	ENEL SPA	993,206	3.09	3,069,006.54	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	292,923	2.18	640,036.75	
	FORTUM OYJ	67,023	18.21	1,220,488.83	
	GAS NATURAL SDG SA	52,372	12.80	670,361.60	
	GDF SUEZ	186,831	21.31	3,982,302.76	
	IBERDROLA SA	576,943	4.68	2,702,977.95	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	16,609	35.43	588,456.87	
	RWE AG	73,843	32.40	2,392,882.41	
	RWE AG-NON VTG PFD	5,510	30.26	166,732.60	
	SNAM SPA	246,917	3.54	875,073.84	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	43,606	10.17	443,691.05	
	TERNA SPA	184,046	2.75	507,598.86	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	56,686	9.61	544,752.46	
	VERBUND AG	10,707	22.43	240,158.01	
	ASML HOLDING NV	65,076	34.41	2,239,265.16	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	163,978	7.65	1,254,759.65	
	STMICROELECTRONICS NV	97,805	5.24	512,596.00	
ユーロ 小計		26,063,708	—	330,217,543.86 (33,160,445,754)	
英ポンド	AMEC PLC	50,945	10.63	541,545.35	
	BG GROUP PLC	511,494	14.30	7,314,364.20	
	BP PLC	2,858,308	4.89	13,992,846.81	
	ESSAR ENERGY PLC	46,829	1.31	61,767.45	
	PETROFAC LTD	39,795	14.75	586,976.25	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	546,069	22.57	12,324,777.33	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	405,040	22.92	9,285,542.00	
	TULLOW OIL PLC	136,393	14.66	1,999,521.38	
	ANGLO AMERICAN PLC	199,652	28.87	5,763,953.24	
	ANTOFAGASTA PLC	59,503	13.63	811,025.89	
	BHP BILLITON PLC	318,689	22.00	7,011,158.00	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES	37,931	7.21	273,672.16	
	FRESNILLO PLC	27,519	18.17	500,020.23	
	GLENCORE INTERNATIONAL-W/I	127,500	4.60	587,456.25	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
英ポンド	JOHNSON MATTHEY PLC	32,948	22.55	742,977.40	
	KAZAKHMYS PLC	32,859	11.90	391,022.10	
	LONMIN PLC	25,471	10.80	275,086.80	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	13,805	75.65	1,044,348.25	
	REXAM PLC	134,595	3.81	512,941.54	
	RIO TINTO PLC	211,080	39.46	8,329,216.80	
	VEDANTA RESOURCES PLC	18,803	13.17	247,635.51	
	XSTRATA PLC	313,138	12.61	3,950,235.87	
	BAE SYSTEMS PLC	507,373	3.17	1,612,938.76	
	BALFOUR BEATTY PLC	107,944	2.84	306,884.79	
	BUNZL PLC	50,702	8.73	442,628.46	
	COBHAM PLC	166,630	1.88	314,764.07	
	INVENSYS PLC	124,280	2.15	267,574.84	
	MEGGITT PLC	117,278	3.70	434,163.15	

	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	282,499	7.85	2,219,029.64	
	SMITHS GROUP PLC	60,193	10.00	601,930.00	
	WEIR GROUP PLC/THE	32,433	20.47	663,903.51	
	WOLSELEY PLC	42,991	22.88	983,634.08	
	AGGREKO PLC	40,136	21.59	866,536.24	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	55,104	7.40	408,045.12	
	CAPITA PLC	92,542	6.34	587,178.99	
	EXPERIAN PLC	151,434	9.06	1,371,992.04	
	G4S PLC	216,502	2.74	594,514.49	
	INTERTEK GROUP PLC	24,577	22.07	542,414.39	
	SERCO GROUP PLC	75,727	5.22	395,294.94	
	GKN PLC	238,368	2.24	535,374.52	
	BURBERRY GROUP PLC	66,970	14.46	968,386.20	
	CARNIVAL PLC	28,116	19.92	560,070.72	
	COMPASS GROUP PLC	286,257	6.29	1,800,556.53	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	44,550	13.67	608,998.50	
	TUI TRABEL PLC	75,914	2.06	156,762.41	
	WHITBREAD PLC	27,191	17.06	463,878.46	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	171,916	6.89	1,184,501.24	
	ITV PLC	557,486	0.77	433,166.62	
	PEARSON PLC	122,912	12.06	1,482,318.72	
	REED ELSEVIER PLC	183,553	5.28	969,159.84	
	WPP PLC	190,307	7.76	1,476,782.32	
	KINGFISHER PLC	356,729	2.71	969,946.15	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	239,209	3.45	827,184.72	
	NEXT PLC	26,440	27.68	731,859.20	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	330,345	2.95	974,517.75	
	SAINSBURY (J) PLC	187,029	2.95	551,922.57	
	TESCO PLC	1,209,514	3.24	3,928,501.47	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	53,755	11.75	631,621.25	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	298,296	30.69	9,154,704.24	
	DIAGEO PLC	377,830	14.74	5,569,214.20	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	152,897	24.08	3,681,759.76	
	SABMILLER PLC	143,824	24.94	3,586,970.56	
	TATE & LYLE PLC	70,524	6.87	484,852.50	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
英ポンド	UNILEVER PLC	193,660	20.21	3,913,868.60	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	93,430	34.11	3,186,897.30	
	SMITH & NEPHEW PLC	134,708	6.42	865,498.90	
	ASTRAZENECA PLC	202,780	29.97	6,077,316.60	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	765,660	14.19	10,868,543.70	
	SHIRE PLC	84,870	21.29	1,806,882.30	
	BARCLAYS PLC	1,747,607	2.31	4,043,962.59	
	HSBC HLDGS PLC	2,692,847	5.57	15,012,622.02	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,222,060	0.35	2,196,387.18	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,680,981	0.28	771,854.42	
	STANDARD CHARTERED PLC	358,989	15.88	5,702,540.26	
	3I GROUP PLC	148,984	2.04	304,225.32	
	ICAP PLC	86,118	3.83	329,831.94	
	INVESTEC PLC	76,017	3.96	301,635.45	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	23,445	9.44	221,438.02	
	MAN GROUP PLC	284,541	1.37	389,821.17	
	SCHRODERS PLC	17,769	16.09	285,903.21	
	ADMIRAL GROUP PLC	31,120	9.98	310,733.20	

	AVIVA PLC	432,000	3.74	1,616,544.00	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	885,946	1.20	1,067,564.93	
	OLD MUTUAL PLC	834,105	1.54	1,290,360.43	
	PRUDENTIAL PLC	384,437	7.27	2,796,779.17	
	RESOLUTION LTD	215,117	2.78	599,961.31	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	531,852	1.12	595,674.24	
	STANDARD LIFE PLC	356,927	2.26	809,867.36	
	SAGE GROUP PLC	202,986	3.03	615,453.55	
	BT GROUP PLC	1,172,943	2.16	2,533,556.88	
	INMARSAT PLC	70,871	4.22	299,075.62	
	VODAFONE GROUP PLC	7,669,823	1.77	13,640,780.20	
	CENTRICA PLC	780,334	3.00	2,344,123.33	
	INTERNATIONAL POWER PLC	230,583	3.41	787,902.11	
	NATIONAL GRID PLC	537,044	6.37	3,420,970.28	
	SEVERN TRENT PLC	36,449	15.14	551,837.86	
	SSE PLC	141,377	12.47	1,762,971.19	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	102,873	6.01	618,266.73	
	ARM HOLDINGS PLC	203,509	5.77	1,174,246.93	
英ポンド 小計		44,371,405	—	224,010,427.07 (27,127,662,718)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	49,844	45.30	2,257,933.20	
	GIVAUDAN-REG	1,275	877.50	1,118,812.50	
	HOLCIM LTD-REG	37,016	56.75	2,100,658.00	
	SIKA AG-BR	314	1,991.00	625,174.00	
	SYNGENTA AG	14,275	290.10	4,141,177.50	
	ABB LTD	330,767	19.96	6,602,109.32	
	GEBERIT AG-REG	5,908	195.00	1,152,060.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,386	107.90	365,349.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,461	107.30	800,565.30	
	SULZER AG-REG	3,771	120.10	452,897.10	
	ADECCO SA-REG	20,334	47.55	966,881.70	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
スイスフラン	SGS SA	827	1,693.00	1,400,111.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	8,149	119.20	971,360.80	
	CIE FINANC RICHEMONT-BR A	78,765	55.30	4,355,704.50	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,654	414.70	1,930,013.80	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	6,826	72.55	495,226.30	
	ARYZTA AG	12,968	43.95	569,943.60	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	282	867.50	244,635.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	141	2,689.00	379,149.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	17	32,000.00	544,000.00	
	NESTLE SA-REGISTERD	497,935	53.10	26,440,348.50	
	SONOVA HOLDING AG	7,541	98.70	744,296.70	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,124	173.80	195,351.20	
	SYNTHES INC	9,853	156.90	1,545,935.70	
	ACTELION LTD-REG	16,984	36.42	618,557.28	
	LONZA GROUP AG-REG	7,905	49.76	393,352.80	
	NOVARTIS AG-REG SHS	352,142	51.70	18,205,741.40	
	ROCHE HLDGS AG GENUSSCHINE	106,010	158.00	16,749,580.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	172,162	25.16	4,331,595.92	
	GAM HOLDING LTD	29,620	12.20	361,364.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	31,179	36.40	1,134,915.60	
	PARGESA HOLDING SA-BR	4,249	66.10	280,858.90	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,081	166.90	347,318.90	

	UBS AG REG	549,144	13.21	7,254,192.24	
	BALOISE HOLDING AG-REG	7,186	71.30	512,361.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	4,678	96.65	452,128.70	
	SWISS RE LTD	52,097	52.80	2,750,721.60	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	21,975	227.50	4,999,312.50	
	SWISSCOM AG (REG)	3,518	373.80	1,315,028.40	
スイスフラン 小計		2,464,363	—	120,106,724.16 (10,002,487,988)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	33,579	162.30	5,449,871.70	
	BOLIDEN AB	41,978	122.00	5,121,316.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,461	188.10	1,403,414.10	
	SSAB AB-A SHARES	25,509	75.55	1,927,204.95	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	87,176	114.40	9,972,934.40	
	ALFA LAVAL AB	51,820	146.00	7,565,720.00	
	ASSA ABLOY AB B	48,164	187.00	9,006,668.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	101,325	168.90	17,113,792.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	59,824	150.20	8,985,564.80	
	SANDVIK AB	151,551	103.90	15,746,148.90	
	SCANIA AB-B SHS	49,114	118.80	5,834,743.20	
	SKANSKA AB-B SHS	61,378	124.90	7,666,112.20	
	SKF AB-B SHS	59,062	166.00	9,804,292.00	
	VOLVO AB-B SHS	209,553	95.55	20,022,789.15	
	SECURITAS AB-B SHS	49,234	65.90	3,244,520.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	36,879	142.30	5,247,881.70	
	HUSQVARNA AB-B SHS	69,587	37.73	2,625,517.51	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	7,294	364.60	2,659,392.40	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	154,280	231.60	35,731,248.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
スウェーデンクローナ	SWEDISH MATCH AB	32,655	239.40	7,817,607.00	
	GETINGE AB-B SHS	30,718	189.10	5,808,773.80	
	NORDEA BANK AB	396,949	59.85	23,757,397.65	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK-A	212,831	45.22	9,624,217.82	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	73,913	211.10	15,603,034.30	
	SWEDBANK AB - A SHARES	122,142	103.20	12,605,054.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,631	102.40	1,703,014.40	
	INVESTOR AB-B SHS	68,728	142.90	9,821,231.20	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	31,030	145.70	4,521,071.00	
	RATOS AB-B SHS	29,254	87.30	2,553,874.20	
	ERICSSON(L.M.)TEL CLASS B	454,418	63.35	28,787,380.30	
	HEXAGON AB-B SHS	38,895	125.40	4,877,433.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	11,521	666.50	7,678,746.50	
	TELE2 AB -B SHS	48,657	134.30	6,534,635.10	
	TELIASONERA AB	326,682	45.60	14,896,699.20	
スウェーデンクローナ 小計		3,199,792	—	331,719,301.98 (3,778,282,849)	
ノルウェークローネ	AKER SOLUTIONS ASA	23,626	79.70	1,882,992.20	
	SEADRILL LTD	49,564	221.40	10,973,469.60	
	STATOIL ASA	168,397	150.70	25,377,427.90	
	SUBSEA 7 SA	43,195	126.90	5,481,445.50	
	NORSK HYDRO ASA	142,897	31.49	4,499,826.53	
	YARA INTERNATIONAL ASA	28,329	257.50	7,294,717.50	
	ORKLA ASA	116,441	48.23	5,615,949.43	
	DNB ASA	147,461	64.95	9,577,591.95	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	31,447	68.50	2,154,119.50	

	TELENOR ASA	109,197	93.90	10,253,598.30	
ノルウェークローネ 小計		860,554	—	83,111,138.41 (1,092,911,470)	
デンマーク クローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	35,348	163.20	5,768,793.60	
	VESTAS WIND SYSTEM AS	31,264	68.70	2,147,836.80	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	84	42,280.00	3,551,520.00	
	A P MOLLER MAERSK A/S	199	44,280.00	8,811,720.00	
	DSV A/S	31,310	118.90	3,722,759.00	
	CARLSBERG AS-B	16,400	422.90	6,935,560.00	
	COLOPLAST-B	3,436	865.00	2,972,140.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,438	490.90	1,687,714.20	
	NOVO NORDISK AS-B	64,168	736.00	47,227,648.00	
	DANSKE BANK AS	98,413	84.80	8,345,422.40	
	TRYG A/S	3,675	318.60	1,170,855.00	
	TDC A/S	56,979	44.40	2,529,867.60	
デンマーククローネ 小計		344,714	—	94,871,836.60 (1,281,718,512)	
オーストラリ アドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	19,071	12.10	230,759.10	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	160,694	13.27	2,132,409.38	
	SANTOS	142,262	13.66	1,943,298.92	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	95,752	34.41	3,294,826.32	
	WORLEYPARSONS LTD	29,673	28.57	847,757.61	
	ALUMINA LTD	374,521	1.32	494,367.72	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
オーストラリ アドル	AMCOR LTD	185,228	6.98	1,292,891.44	
	BHP BILLITON LTD	484,580	38.21	18,515,801.80	
	BORAL LIMITED	114,770	4.25	487,772.50	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	191,144	5.36	1,024,531.84	
	ILUKA RESOURCES LIMITED	63,178	18.15	1,146,680.70	
	INCITEC PIVOT LTD	249,977	3.23	807,425.71	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	65,986	7.46	492,255.56	
	LYNAS CORP LTD	261,311	1.44	376,287.84	
	NEWCREST MINING LIMITED	115,431	33.92	3,915,419.52	
	ONESTEEL LIMITED	191,804	0.73	140,016.92	
	ORICA LIMITED	54,919	24.85	1,364,737.15	
	OZ MINERALS LTD	49,705	11.28	560,672.40	
	RIO TINTO LTD	65,752	72.30	4,753,869.60	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	25,836	15.32	395,807.52	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	23,242	24.25	563,618.50	
	BRAMBLES LTD	223,339	7.24	1,616,974.36	
	CAMPBELL BROTHERS LTD	10,521	53.96	567,713.16	
	ASCIANO LTD	149,699	4.69	702,088.31	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	159,503	1.62	258,394.86	
	QR NATIONAL LTD	262,144	3.75	983,040.00	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	101,794	5.21	530,346.74	
	TRANSURBAN GROUP	197,024	5.52	1,087,572.48	
	CROWN LTD	71,548	8.39	600,287.72	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	107,693	3.67	395,233.31	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	107,693	2.87	309,078.91	
	TATTS GROUP LTD	202,391	2.47	499,905.77	
	FAIRFAX MEDIA LTD	351,320	0.77	270,516.40	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	76,332	2.07	158,007.24	
	METCASH LTD	116,059	4.01	465,396.59	
	WESFARMERS LTD	151,763	29.46	4,470,937.98	

	WOOLWORTHS LIMITED	183,570	24.34	4,468,093.80	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	87,188	11.58	1,009,637.04	
	COCHLEAR LIMITED	8,709	58.11	506,079.99	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	20,653	18.68	385,798.04	
	SONIC HEALTHCARE LTD	56,635	11.25	637,143.75	
	CSL LIMITED	79,196	30.00	2,375,880.00	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	396,673	21.33	8,461,035.09	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	56,379	8.06	454,414.74	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	235,193	50.84	11,957,212.12	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	332,130	24.17	8,027,582.10	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	457,225	21.03	9,615,441.75	
	ASX LTD	26,880	30.33	815,270.40	
	MACQUARIE GROUP LTD	53,293	26.10	1,390,947.30	
	AMP LIMITED	424,254	4.27	1,811,564.58	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	318,730	2.90	924,317.00	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	164,870	12.13	1,999,873.10	
	SUNCORP GROUP LTD	194,134	8.23	1,597,722.82	
	COMPUTERSHARE LTD	68,227	7.89	538,311.03	
	TELSTRA CORPORATION LTD	657,134	3.38	2,221,112.92	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
オーストラリアドル	AGL ENERGY LTD	70,723	14.14	1,000,023.22	
	SP AUSNET	219,745	0.98	216,448.82	
オーストラリアドル 小計		9,365,200	—	118,110,611.49 (9,690,975,672)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	104,147	6.41	667,582.27	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	145,568	2.45	356,641.60	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	87,272	3.48	303,706.56	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	295,397	2.18	643,965.46	
	CONTACT ENERGY LIMITED	56,144	4.82	270,614.08	
ニュージーランドドル 小計		688,528	—	2,242,509.97 (143,184,261)	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA LTD	322,000	76.30	24,568,600.00	
	NWS HOLDINGS LTD	213,500	12.62	2,694,370.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	186,000	15.68	2,916,480.00	
	MTR CORPORATION	222,000	26.05	5,783,100.00	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	31,500	47.80	1,505,700.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	116,500	24.25	2,825,125.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	190,000	18.36	3,488,400.00	
	SANDS CHINA LTD	364,400	28.65	10,440,060.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	222,000	16.06	3,565,320.00	
	SJM HOLDINGS LTD	254,000	14.14	3,591,560.00	
	WYNN MACAU LTD	238,800	19.72	4,709,136.00	
	LI & FUNG LTD	856,400	17.48	14,969,872.00	
	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	89,500	18.40	1,646,800.00	
	BANK OF EAST ASIA LIMITED	237,020	30.60	7,252,812.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	558,500	20.70	11,560,950.00	
	HANG SENG BANK LTD	115,400	100.60	11,609,240.00	
	WING HANG BANK LIMITED	27,000	71.70	1,935,900.00	
	FIRST PACIFIC CO	332,000	8.91	2,958,120.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	154,700	137.70	21,302,190.00	
	AIA GROUP LTD	1,272,200	25.80	32,822,760.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	210,000	104.00	21,840,000.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	135,000	49.90	6,736,500.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	378,000	27.80	10,508,400.00	

	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	144,585	43.45	6,282,218.25	
	HOPEWELL HOLDINGS	82,000	20.65	1,693,300.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	99,000	30.25	2,994,750.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	106,000	30.80	3,264,800.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	560,000	8.78	4,916,800.00	
	SINO LAND CO	446,600	12.66	5,653,956.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	214,000	108.20	23,154,800.00	
	SWIRE PACIFIC CL A	111,500	84.05	9,371,575.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	229,000	46.05	10,545,450.00	
	WHEELOCK & CO LTD	144,000	25.55	3,679,200.00	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	309,000	5.11	1,578,990.00	
	PCCW LTD	622,000	2.57	1,598,540.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	71,000	43.50	3,088,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	290,500	63.00	18,301,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	715,973	18.22	13,045,028.06	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
香港ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	209,500	56.10	11,752,950.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	31,100	99.70	3,100,670.00	
香港ドル 小計		11,112,178	—	335,254,422.31 (3,308,961,148)	
シンガポールドル	COSCO CORP SINGAPORE LTD	143,000	1.19	170,170.00	
	FRASER & NEAVE LTD	139,500	6.65	927,675.00	
	KEPPEL CORP LTD	215,500	10.72	2,310,160.00	
	NOBLE GROUP LTD	590,145	1.44	849,808.80	
	SEMBCORP INDUSTRIES LIMITED	151,000	4.87	735,370.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	131,400	4.96	651,744.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	240,000	2.94	705,600.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	272,000	1.19	323,680.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	296,000	1.46	432,160.00	
	NEPTUNE ORIENT LINES LTD	140,000	1.42	199,500.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	82,600	10.80	892,080.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	935,400	1.64	1,534,056.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	235,250	3.67	863,367.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	17,000	50.81	863,770.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	228,800	2.63	601,744.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,007,720	0.76	765,867.20	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	290,000	5.67	1,644,300.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	266,000	13.43	3,572,380.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	384,000	8.64	3,317,760.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	190,000	17.47	3,319,300.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	132,000	6.92	913,440.00	
	CAPITALAND LIMITED	393,000	2.70	1,061,100.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	196,000	1.37	268,520.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	77,000	10.26	790,020.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	289,000	2.02	583,780.00	
	KEPPEL LAND LTD	105,000	2.89	303,450.00	
	UOL GROUP LTD	67,400	4.52	304,648.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,202,880	3.12	3,752,985.60	
	STARHUB LTD	87,000	2.84	247,080.00	
シンガポールドル 小計		8,504,595	—	32,905,516.10 (2,017,437,192)	
イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	68,212	40.35	2,752,354.20	
	ISRAEL CORP LTD	327	2,380.00	778,260.00	
	DELEK GROUP LTD	633	770.00	487,410.00	

	ELBIT SYSTEMS LTD	3,688	145.80	537,710.40	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	141,901	169.20	24,009,649.20	
	BANK HAPOALIM BM	162,589	13.12	2,133,167.68	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	180,928	12.00	2,171,136.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	112,026	5.34	599,003.02	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	19,485	32.75	638,133.75	
	NICE SYSTEMS LTD	9,047	135.30	1,224,059.10	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	269,518	6.48	1,747,285.19	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
イスラエル シェケル	CELLCOM ISRAEL LTD	7,107	55.80	396,570.60	
	PARTNER COMMUNICATIONS CO	12,263	32.14	394,132.82	
イスラエルシェケル 小計		987,724	—	37,868,871.96 (779,720,073)	
合計		159,452,177	—	250,346,407,224 (250,346,407,224)	

B．株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託 受益証券	米ドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	789,000	615,420.00	
	米ドル 小計		789,000	615,420.00 (47,110,401)	
	オーストラリ アドル	LEND LEASE GROUP	83,243	615,998.20	
		SYDNEY AIRPORT	61,192	160,323.04	
	オーストラリアドル 小計		144,435	776,321.24 (63,697,157)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	13,521	68,551.47	
	香港ドル 小計		13,521	68,551.47 (676,603)	
投資信託受益証券 合計			946,956	111,484,161 (111,484,161)	
投資証券	米ドル	AMERICAN TOWER CORP	59,800	3,775,174.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	146,300	2,498,804.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,229	1,966,163.22	
		BOSTON PROPERTIES INC	22,200	2,380,950.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,000	1,068,450.00	
		DUKE REALTY CORP	39,700	557,388.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	44,800	2,677,696.00	
		FED REALTY INVS TRUST	9,600	927,744.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	66,797	1,106,826.29	
		HCP INC	61,500	2,562,705.00	
		HEALTH CARE REIT INC	28,700	1,633,317.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	106,581	1,838,522.25	
		KIMCO REALTY CORP	62,400	1,170,624.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	17,700	596,490.00	
		MACERICH CO	20,000	1,104,000.00	
		PLUM CREEK TIMBER CO	24,900	993,012.00	
		PROLOGIS INC	69,340	2,286,833.20	
		PUBLIC STORAGE INC	21,900	3,042,129.00	
		RAYONIER INC	18,400	830,392.00	
		REGENCY CENTERS CORP	13,800	600,162.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	44,365	6,101,074.80	
		VENTAS INC	42,100	2,474,638.00	
		VORNADO REALTY TRUST	25,049	2,154,214.00	

	米ドル 小計	975,161	44,347,308.76 (3,394,786,485)	

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	カナダドル	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	12,000	280,200.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	20,000	521,000.00	
	カナダドル 小計		32,000	801,200.00 (61,556,196)	
	ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	0.00	
		CORIO NV	9,207	339,738.30	
		FONCIERE DES REGIONS	4,215	223,985.10	
		GECINA SA	3,446	263,308.86	
		ICADE	3,666	235,393.86	
		KLEPIERRE	16,009	372,369.34	
		UNIBAIL	13,871	2,020,311.15	
	ユーロ 小計		1,655,998	3,455,106.61 (346,961,805)	
	英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	127,416	644,087.88	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	85,721	291,708.56	
		HAMMERSON PLC	101,570	387,286.41	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	118,733	816,289.37	
		SEGRO PLC	106,565	242,435.37	
	英ポンド 小計		540,005	2,381,807.59 (288,436,899)	
	オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	282,061	487,965.53	
		DEXUS PROPERTY GROUP	742,693	657,283.30	
		GOODMAN GROUP	1,078,178	722,379.26	
		GPT GROUP	263,865	799,510.95	
		MIRVAC GROUP	524,429	650,291.96	
		STOCKLAND	359,575	1,208,172.00	
		WESTFIELD GROUP	330,982	2,909,331.78	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	444,813	1,116,480.63	
	オーストラリアドル 小計		4,026,596	8,551,415.41 (701,643,634)	
	香港ドル	LINK REIT	339,500	9,455,075.00	
	香港ドル 小計		339,500	9,455,075.00 (93,321,590)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	271,000	518,965.00	
		CAPITAMALL TRUST	337,600	587,424.00	
	シンガポールドル 小計		608,600	1,106,389.00 (67,832,709)	
投資証券 合計			8,177,860	4,954,539,318 (4,954,539,318)	
合計			—	5,066,023,479 (5,066,023,479)	

（注）有価証券明細表注記

1．通貨ごとの小計の欄における（ ）内は、邦貨換算額であります。

2．合計金額欄の記載は、邦貨額であります。（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3．通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。

4．外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率（注１）	組入投資信託受益証券時価比率（注２）	組入投資証券時価比率（注３）	有価証券の合計金額に対する比率

米ドル	588	97.7%	0.0%	2.3%	57.5%
カナダドル	103	99.6%	―	0.4%	5.7%
ユーロ	251	99.0%	―	1.0%	13.1%
英ポンド	104	98.9%	―	1.1%	10.7%
スイスフラン	39	100.0%	―	―	3.9%
スウェーデンクローナ	34	100.0%	―	―	1.5%
ノルウェークローネ	10	100.0%	―	―	0.4%
デンマーククローネ	12	100.0%	―	―	0.5%
オーストラリアドル	67	92.7%	0.6%	6.7%	4.1%
ニュージーランドドル	5	100.0%	―	―	0.1%
香港ドル	42	97.2%	0.0%	2.7%	1.3%
シンガポールドル	31	96.7%	―	3.3%	0.8%
イスラエルシェケル	13	100.0%	―	―	0.3%
合計	1,299	98.0%	0.0%	1.9%	100.0%

（注１）組入株式時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する株式の比率であります。
（注２）組入投資信託受益証券時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する投資信託受益証券の比率であります。
（注３）組入投資証券時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する投資証券の比率であります。

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	3,884,826,473 円
Ⅱ 負債総額	7,548,617 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,877,277,856 円
Ⅳ 発行済口数	4,278,270,997 口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9063 円
１万口当たり純資産額	9,063 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
（中央三井外国株式マザーファンド）

Ⅰ 資産総額	280,968,183,955 円
Ⅱ 負債総額	233,070,891 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	280,735,113,064 円
Ⅳ 発行済口数	276,711,283,523 口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0145 円
１万口当たり純資産額	10,145 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

名称	資本金の額（百万円）（平成23年９月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社※	342,037※	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。
株式会社みずほコーポレート銀行	1,404,065	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	47,937	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社北陸銀行	140,409	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

※資本金の額は平成24年４月１日現在です。

２【関係業務の概要】

（１）受託会社

当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

（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２月28日	有価証券届出書の訂正届出書
平成23年５月６日	有価証券報告書
平成23年５月６日	有価証券届出書
平成23年11月７日	半期報告書
平成23年11月７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４月６日

三井住友トラスト・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外国株式インデックスファンドの平成２３年２月８日から平成２４年２月７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外国株式インデックスファンドの平成２４年２月７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。

三井住友トラスト・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４月７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外国株式インデックスファンドの平成２２年２月９日から平成２３年２月７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外国株式インデックスファンドの平成２３年２月７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。