

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成24年 4 月17日
【計算期間】	第14特定期間（自 平成23年7月20日 至 平成24年1月17日）
【ファンド名】	物価連動債組入世界債券ファンド
【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】

ファンドの目的

当ファンドは、毎決算時の安定した収益分配と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

信託金限度額

上限 5,000億円

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)
単 位 型	国 内	株 式
		債 券
	海 外	不動産投信
追 加 型	内 外	その他資産 ()
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

（用語の定義について）

当ファンドが該当する商品分類に係る用語の定義は以下のとおりです。

なお、これ以外の用語の定義につきましては、社団法人投資信託協会のホームページ

(<http://www.toushin.or.jp/>) にてご確認ください。

< 単位型投信・追加型投信 >

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

< 投資対象地域 >

- ・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） >

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

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(用語の定義について)

当ファンドが該当する属性区分に係る用語の定義は以下のとおりです。

なお、これ以外の用語の定義につきましては、社団法人投資信託協会のホームページ

(<http://www.toushin.or.jp/>) にてご確認いただけます。

<投資対象資産>

・その他資産（投資信託証券）

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

・債券 公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。

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

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

< 決算頻度 >

- ・年12回（毎月）…目論見書又は投資信託約款において、年12回（毎月）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。

ファンドの特色

A．日本を除く世界の主要国の公社債を主要な投資対象とする「外国債券マザーファンド」及びパークレイズ・キャピタル世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ベース）に含まれるインフレ連動国債（物価連動国債）を主要な投資対象とする「世界物価連動債マザーファンド」（以下、これらを「マザーファンド」といいます。）の各受益証券への投資を通じて、安定した収益の確保及び信託財産の着実な成長を目指します。

B．「外国債券マザーファンド」は、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）（ ）に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスに連動する投資成果を目標として運用を行います。

シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同インデックスに関する著作権・知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。

C．「世界物価連動債マザーファンド」は、パークレイズ・キャピタル世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ベース）（ 1 ）に含まれるインフレ連動国債（物価連動国債）（ 2 ）に分散投資し、同インデックスに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1：パークレイズ・キャピタル世界インフレ連動国債インデックスは、インフレ連動国債ポートフォリオのパフォーマンスを測る基準を提供すると同時に、ポートフォリオ構成、分析の基礎となるよう構築されています。同インデックスは、欧州アナリスト協会連合会(EFFAS)のガイドラインを基準とし、世界の主要インフレ連動国債市場の特性及びパフォーマンスを正確かつ包括的に提供することを目的としています。同インデックスに関する著作権・知的財産権その他一切の権利はパークレイズ・キャピタルに帰属します。

2：インフレ連動国債（物価連動国債）とは元本と利金が物価水準に連動する国債で、元本額面に物価上昇率を乗じて想定元本を計算し、想定元本に表面利率を乗じることにより利金が決定されます。

一般に金利が上昇した場合、固定利付国債の価格は下落します。一方、インフレ連動国債（物価連動国債）の想定元本は、物価が上昇した場合には増加しますので、物価上昇を伴う金利上昇局面では、インフレ連動国債（物価連動国債）の価格は上昇ないしは緩やかな下落に留まる傾向があります。

D．海外期待物価上昇率及び為替・金利市場等の動向予測に基づき、各マザーファンドへの投

資比率を機動的に調整することにより、将来の物価上昇リスクの軽減を図ります。

（２）【ファンドの沿革】

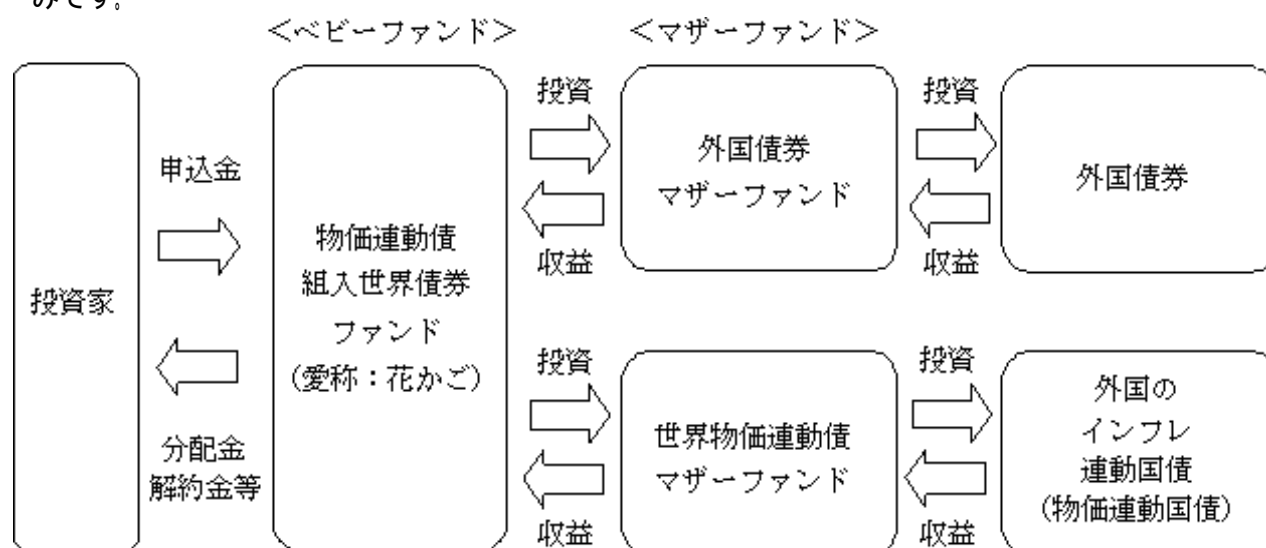
平成17年２月４日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

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
当ファンドの主要投資対象である中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンド、中央三井世界物価連動債マザーファンドの名称を世界物価連動債マザーファンドに変更

（３）【ファンドの仕組み】

ファミリーファンド方式での運用

ファミリーファンド方式とは投資家から投資された資金をまとめてベビーファンド（物価連動債組入世界債券ファンド）とし、その資金をマザーファンド（外国債券マザーファンド及び世界物価連動債マザーファンド）に投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



ファンドの関係法人

委託会社 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

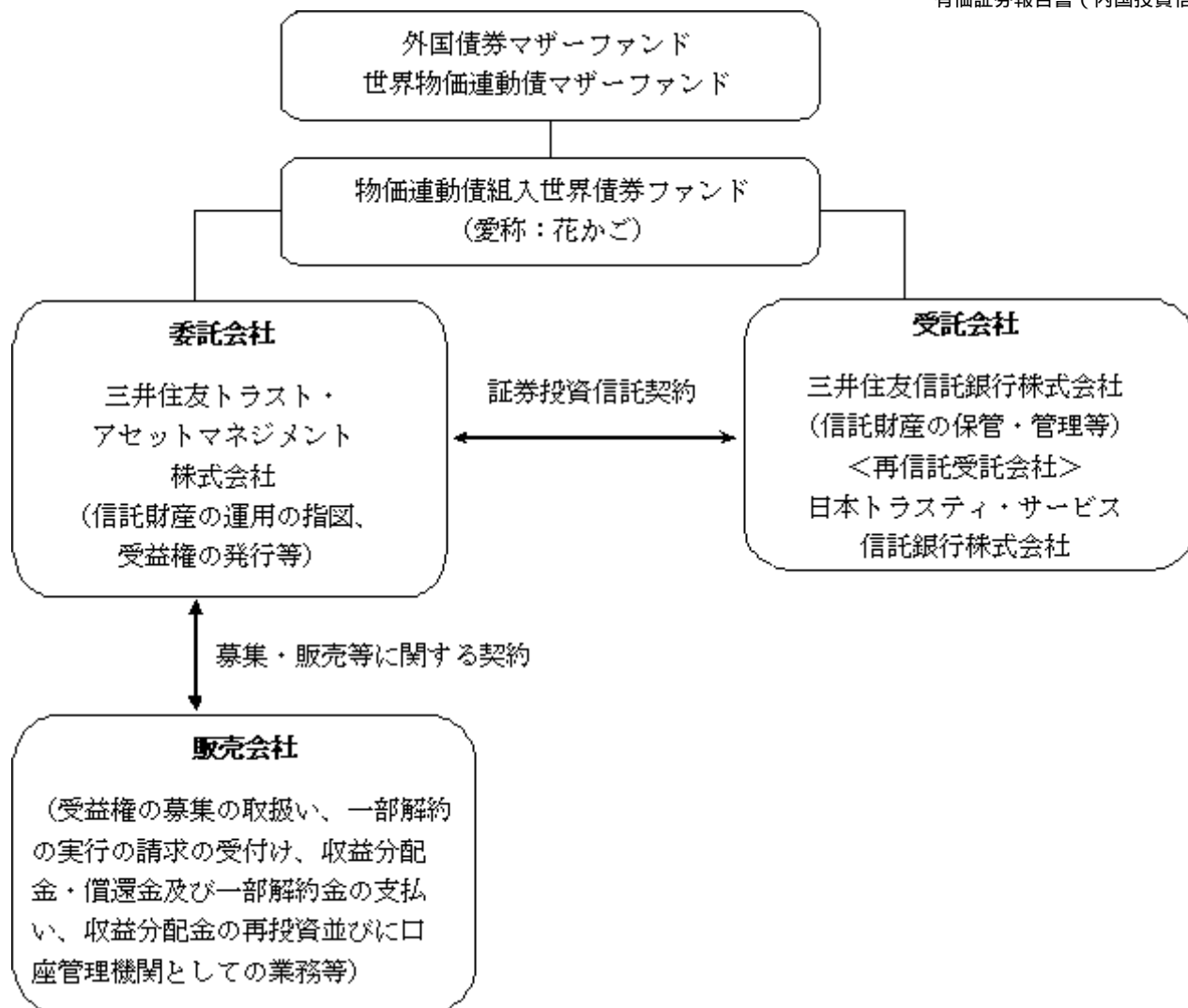
（再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

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。

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】

運用方針

「外国債券マザーファンド」及び「世界物価連動債マザーファンド」の各受益証券を主要投資対象とします。なお、公社債等に直接投資することもあります。

投資態度

- A．海外期待物価上昇率及び為替・金利市場等の動向予測に基づき、「外国債券マザーファンド」受益証券と「世界物価連動債マザーファンド」受益証券の組入比率を機動的に調整することにより、将来の物価上昇リスクの軽減を図りつつ、長期的に安定した収益の確保と信託財産の成長を目指します。
- B．マザーファンドの受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。
- C．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。
- D．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、為替予約取引等を活用する場合があります。
- E．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- F．わが国取引所（金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所）で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）を含む。以下同じ。）におけ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。
- 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。
- I．資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- A．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
- 1．有価証券
 - 2．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記（５） F．、G．及びH．に定めるものに限りません。）

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

４．約束手形（上記１．に掲げるものに該当するものを除きます。）

B．次に掲げる特定資産以外の資産

１．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・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「外国債券マザーファンド」及び親投資信託「世界物価連動債マザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．国債証券

２．地方債証券

３．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

６．転換社債の転換及び新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号及び第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得した株券

７．コマーシャル・ペーパー

８．外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記１．から７．までの証券又は証書の性質を有するもの

９．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。）

10．外国法人が発行する譲渡性預金証書

11．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。）

12．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。）

13．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

14．外国の者に対する権利で上記13．の有価証券の性質を有するもの

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

運用指図できる金融商品

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

１．預金

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

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

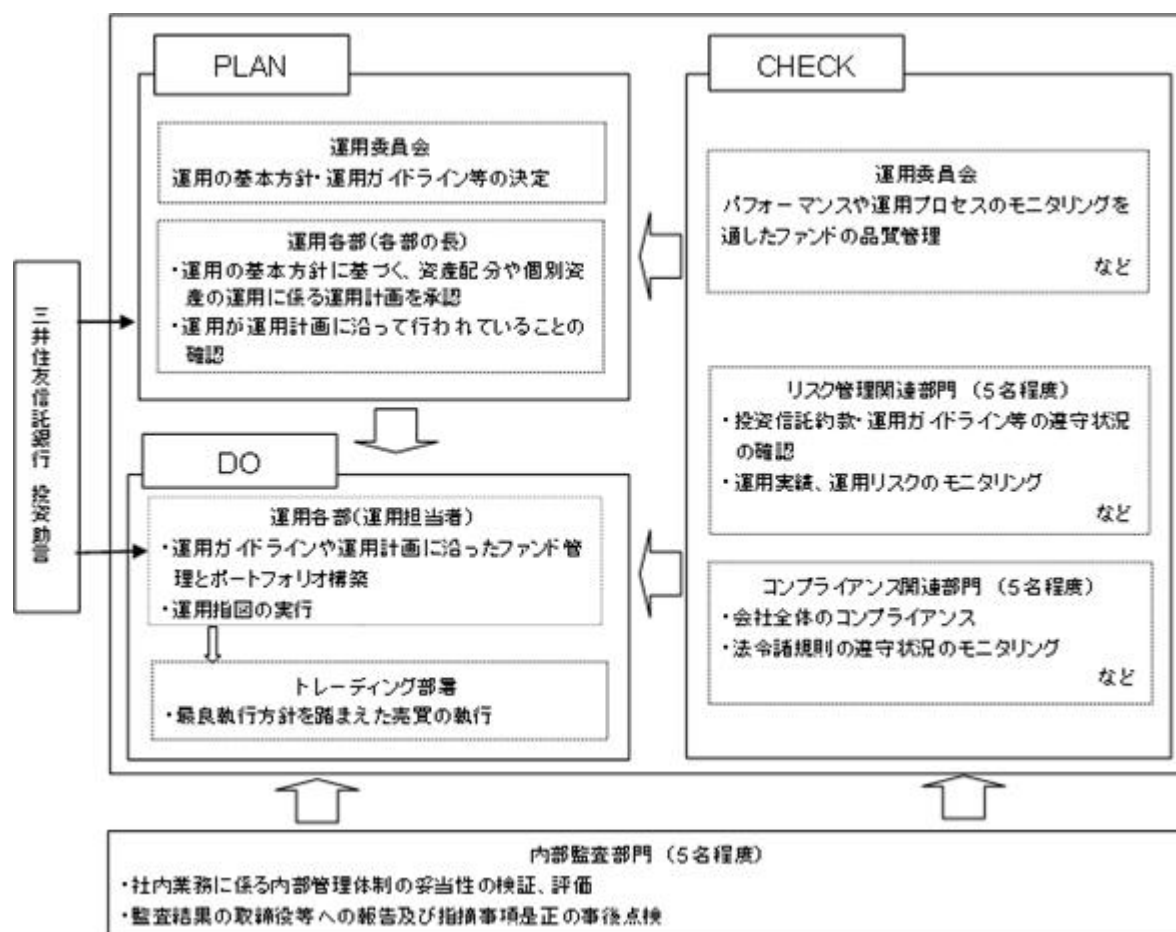
６．外国の者に対する権利で上記５．の権利の性質を有するもの

B．金融商品による運用の特例

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

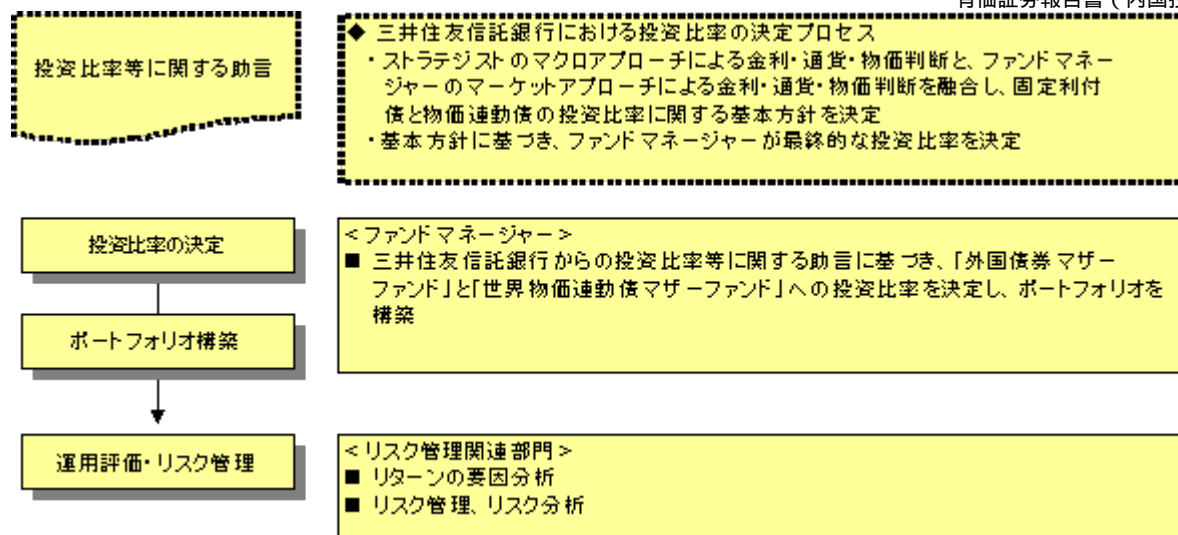
（３）【運用体制】

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。



< ポートフォリオ構築プロセス >

- 委託会社は、三井住友信託銀行からの投資助言に基づいて各マザーファンドへの投資比率を決定します。
- 投資助言者である三井住友信託銀行は、マクロアプローチとマーケットアプローチによる金利・通貨・物価判断を融合し、投資比率に関する基本方針を決定します。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】

分配方針

毎決算時（原則として毎月17日ですが、第1計算期間のみ異なります。ただし当日が休業日の場合は翌営業日とします。）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・配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。なお、前期から繰り越された分配準備積立金及び収益調整金、その他の調整金は、全額分配に使用することがあります。
- B．分配金額は、上記A．の範囲内で委託会社が基準価額水準や市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- C．収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。
- D．第1計算期及び第2計算期は無分配とし、第3計算期から分配を開始します。

分配収益の計算

- A．信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。
 - イ．配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費（後記「４ 手数料等及び税金（４）その他の手数料等」の記載をご参照ください。）、監査費用、当該監査費用に係る消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金に充てるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 - ロ．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配に充てるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

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

B．毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

A．支払時期と場所

イ．収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として計算期間終了日から起算して5営業日までの日）から、決算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決算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決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に対する支払いを開始します。なお、時効前の収益分配金に係る収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引換えに受益者に支払います。

ロ．上記イ．の規定にかかわらず、分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

ハ．収益分配金（上記ロ．の収益分配金の再投資の場合を除きます。）の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

B．時効

受益者が、収益分配金については上記A．イ．に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

将来の分配金の支払い及びその金額について示唆あるいは保証するものではありません。

（参考）

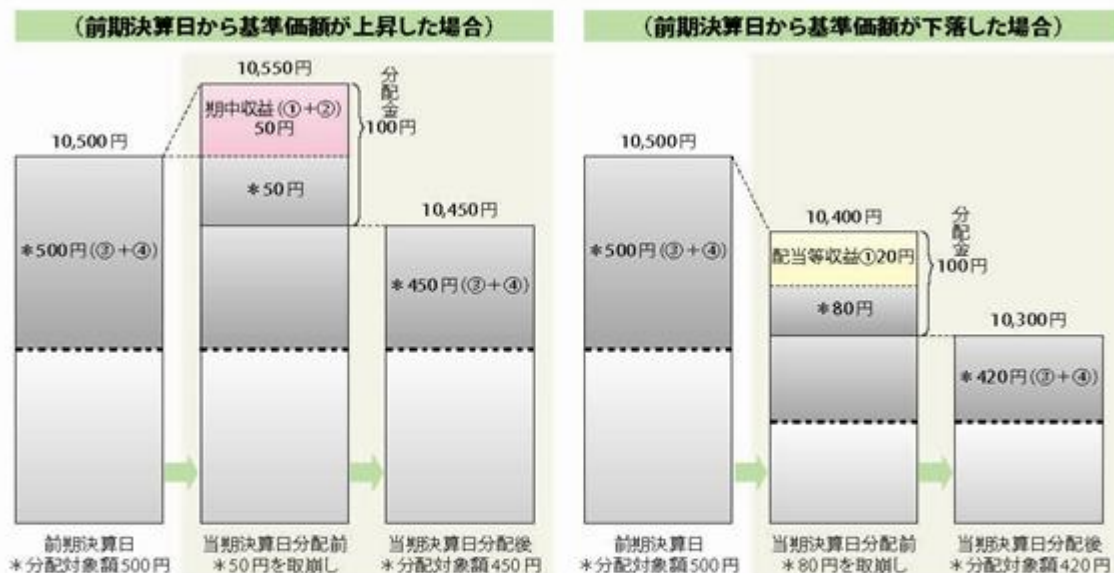
[収益分配金に関する留意事項]

- 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。

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）



(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益及び②経費控除後の評価益を含む売買益並びに③分配準備積立金及び④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆あるいは保証するものではありませんのでご注意ください。

● 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。

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）

（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



普通分配金：個別元本（投資者のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

（注）普通分配金に対する課税については、後掲「4 手数料等及び税金（5）課税上の取扱い」をご覧ください。

（５）【投資制限】

約款に定める投資制限

A．株式への投資割合

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

B．同一銘柄の株式への投資

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

C．同一銘柄の転換社債等への投資

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実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

D．外貨建資産への投資

外貨建資産への投資には制限を設けません。

E．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は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

ロ．上記イ．の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとし、

F．先物取引等の運用指図

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を

行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

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

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

G．スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

H．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を指図することができます。

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

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

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

I．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　．及び　．の範囲内で貸付の指図をすることができます。

．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。

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

ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たって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。

J．公社債の空売りの指図範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記K．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引き渡し又は買い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。

K．公社債の借入れ

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

ロ．上記イ．の指図は、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。

L．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。

M．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、信託財産に属する外貨建資産と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。）との合計額について、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．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。

N．一部解約の請求及び有価証券売却等の指図

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。

O．再投資の指図

委託会社は、上記N．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。

P．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。

二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

Q．受託会社による資金の立替え

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

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

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

関連法令に基づく投資制限

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

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

委託会社は、運用財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社等が定めた合理的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

「外国債券マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

（1）投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

（2）投資態度

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

運用に際しては、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。

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

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

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

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

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

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

3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

「世界物価連動債マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、中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

バークレイズ・キャピタル世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ベース）に含まれるインフレ連動国債（物価連動国債）を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

バークレイズ・キャピタル世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ベース）に含まれるインフレ連動国債（物価連動国債）に分散投資し、リスク分散を図ったうえで、中長期的な信託財産の成長を目指します。

バークレイズ・キャピタル世界インフレ連動国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行い、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指します。

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。

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、為替予約取引等を活用する場合があります。

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

わが国の取引所（金融商品取引所等を含む。以下同じ。）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、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の指図をすることができます。

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

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

資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。

３．投資制限

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

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

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10%以下とします。

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

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は帰属します。
- 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。

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。

金利変動リスク

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

物価変動リスク

物価の下落はインフレ連動国債（物価連動国債）の元本や利金を減少させるため、インフレ連動国債（物価連動国債）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。

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。

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。

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>

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。

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。

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。

（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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。）。

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。

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】

お申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.1%（税抜 2.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

「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、申込手数料はかかりません。

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

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

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

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

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

お申込受付日の翌営業日の基準価額に取得口数を乗じて得た額に、申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額を加えた総額をいいます。

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

（照会先）

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/>

（２）【換金（解約）手数料】

解約手数料はありませんが、下記 の信託財産留保額が控除されます。

一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.2%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。

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

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

マザーファンド名	A 欄	B 欄
----------	-----	-----

外国債券 マザーファンド	一部解約を行う日の前営業日の信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額を受益権総口数で除した金額	0.1%
世界物価連動債 マザーファンド	一部解約を行う日の一部解約又は追加信託の処理を行う前の信託財産の純資産総額を一部解約又は追加信託を行う前の受益権総口数で除した金額	0.3%

税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になる場合があります。

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

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

1.1025%（税抜 1.05%）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 0.525%	（税抜 0.5%）
販売会社	年率 0.525%	（税抜 0.5%）
受託会社	年率 0.0525%	（税抜 0.05%）

なお、マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

上記の信託報酬は、毎計算期末又は信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

（４）【その他の手数料等】

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、受益者の負担とし、毎計算期末又は信託終了のときに信託財産中から支弁します。

なお、マザーファンドにおいては、監査報酬はかかりません。

借入金の利息は、原則として借入金返済時に信託財産中から支弁します。

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

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。

個別元本について

- A．追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- B．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- C．ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については各販売会社毎に、個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」の両コースで取得する場合はコース別に、個別元本の算出が行われる場合があります。

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

一部解約時及び償還時の課税について

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

収益分配金の課税について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

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

個人の受益者に対する課税

A．収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金の源泉徴収の税率は以下のとおりです。

なお、配当控除の適用はありません。

	税 率（内 訳）
平成24年12月31日まで	10%（所得税7%、住民税3%）
平成25年 1 月 1 日から平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7.147%、住民税3%）
平成26年 1 月 1 日から平成49年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
平成50年 1 月 1 日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（平成25年 1 月 1 日から平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

B．一部解約時及び償還時の譲渡益が譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は上記 A と同じです。

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

詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めいたします。

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率（所得税のみ）
平成24年12月31日まで	7%
平成25年 1 月 1 日から平成25年12月31日まで	7.147%
平成26年 1 月 1 日から平成49年12月31日まで	15.315%

平成50年 1 月 1 日以降	15%
-----------------	-----

（平成25年 1 月 1 日から平成49年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

上記は、平成24年 2 月29日現在のものですので、税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

平成24年4月1日をもって「中央三井外国債券マザーファンド」は「外国債券マザーファンド」、「中央三井世界物価連動債マザーファンド」は「世界物価連動債マザーファンド」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	中央三井外国債券マザーファンド	日本	156,925,891	48.36
	中央三井世界物価連動債マザーファンド	日本	167,668,110	51.67
	親投資信託受益証券合計		324,594,001	100.04
その他の資産（負債控除後）			115,829	0.04
合計（純資産総額）			324,478,172	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。

（中央三井外国債券マザーファンド）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	168,826,793,927	39.85
	フランス	39,602,084,143	9.35
	イタリア	38,812,864,589	9.16
	ドイツ	38,588,399,906	9.11
	イギリス	35,460,510,904	8.37
	その他	91,705,566,301	21.65
	小計	412,996,219,770	97.49
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,613,754,807	2.51
合計（純資産総額）		423,609,974,577	100.00

（中央三井世界物価連動債マザーファンド）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	183,361,652	42.85
	イギリス	119,412,793	27.91
	フランス	58,346,433	13.64
	イタリア	30,155,150	7.05
	ドイツ	17,169,134	4.01
	カナダ	13,672,420	3.20
	小計	422,117,582	98.65
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,771,672	1.35
合計（純資産総額）		427,889,254	100.00

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

種類	銘柄	口数	簿価（円）		評価額（円）		投資 比率 （％）
			単価	金額	単価	金額	
親投資信託 受益証券	中央三井外国債券 マザーファンド	99,641,813	1.5131	150,768,074	1.5749	156,925,891	48.36
	中央三井 世界物価連動債 マザーファンド	147,764,264	1.0904	161,122,200	1.1347	167,668,110	51.67

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

< 参考 >

当ファンドが主要投資対象としている親投資信託の状況
 （中央三井外国債券マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄

A．主要銘柄の明細

順位	国 / 地域	銘柄名	利率 (%)	償還日	額面金額	簿価（円）		評価額（円）		投資 比率 (%)
						単価	金額	単価	金額	
1	アメリカ	US TREASURY N/B	1.500	2013/12/31	40,120,000	8,260.87	3,314,263,300	8,247.00	3,308,699,910	0.78
2	アメリカ	US TREASURY N/B	3.625	2021/2/15	31,230,000	9,353.83	2,921,203,451	9,346.27	2,918,841,291	0.69
3	アメリカ	US TREASURY N/B	3.000	2017/2/28	31,550,000	8,952.95	2,824,658,485	8,916.40	2,813,124,396	0.66
4	アメリカ	US TREASURY N/B	2.625	2014/7/31	32,650,000	8,535.69	2,786,903,396	8,509.84	2,778,465,731	0.66
5	アメリカ	US TREASURY N/B	0.500	2013/11/15	32,000,000	8,105.18	2,593,660,312	8,098.88	2,591,643,312	0.61
6	アメリカ	US TREASURY N/B	3.875	2040/8/15	26,910,000	9,345.01	2,514,743,031	9,399.22	2,529,330,102	0.60
7	アメリカ	US TREASURY N/B	3.500	2020/5/15	26,650,000	9,276.93	2,472,304,342	9,275.67	2,471,968,386	0.58
8	アメリカ	US TREASURY N/B	3.625	2020/2/15	25,030,000	9,352.57	2,340,949,991	9,352.57	2,340,949,991	0.55
9	アメリカ	US TREASURY N/B	3.375	2019/11/15	25,070,000	9,201.30	2,306,766,379	9,198.78	2,306,134,302	0.54
10	アメリカ	US TREASURY N/B	0.625	2013/2/28	27,450,000	8,103.92	2,224,528,194	8,102.66	2,224,182,153	0.53
11	アメリカ	US TREASURY N/B	2.625	2018/1/31	25,250,000	8,811.76	2,224,971,608	8,795.38	2,220,833,607	0.52
12	アメリカ	US TREASURY N/B	2.375	2014/8/31	26,000,000	8,496.61	2,209,119,250	8,470.76	2,202,400,129	0.52
13	アメリカ	US TREASURY N/B	5.125	2016/5/15	22,000,000	9,613.52	2,114,975,775	9,560.58	2,103,327,600	0.50
14	アメリカ	US TREASURY N/B	2.125	2021/8/15	25,400,000	8,259.61	2,097,942,210	8,264.65	2,099,223,005	0.50
15	アメリカ	US TREASURY N/B	1.375	2015/11/30	25,000,000	8,343.44	2,085,861,650	8,310.67	2,077,667,588	0.49
16	イギリス	TREASURY	4.500	2013/3/7	15,330,000	13,413.55	2,056,297,628	13,379.25	2,051,039,210	0.48
17	アメリカ	US TREASURY N/B	4.500	2039/8/15	19,450,000	10,347.21	2,012,532,345	10,379.98	2,018,907,325	0.48
18	アメリカ	US TREASURY N/B	1.875	2015/6/30	23,900,000	8,478.33	2,026,321,701	8,435.47	2,016,077,862	0.48
19	アメリカ	US TREASURY N/B	2.625	2016/2/29	22,900,000	8,752.51	2,004,326,936	8,708.39	1,994,223,027	0.47
20	アメリカ	US TREASURY N/B	2.000	2021/11/15	24,320,000	8,136.07	1,978,693,136	8,143.63	1,980,532,640	0.47
21	アメリカ	US TREASURY N/B	1.750	2013/4/15	24,000,000	8,215.49	1,971,718,350	8,204.77	1,969,146,684	0.46
22	フランス	FRANCE O.A.T.	3.750	2019/10/25	16,450,000	11,782.00	1,938,139,987	11,730.94	1,929,739,712	0.46

23	イギリス	TREASURY	3.750	2019/9/7	12,760,000	14,665.10	1,871,267,709	14,857.55	1,895,824,081	0.45
24	アメリカ	US TREASURY N/B	1.500	2016/6/30	21,960,000	8,377.48	1,839,695,371	8,345.96	1,832,774,540	0.43
25	アメリカ	US TREASURY N/B	1.250	2015/9/30	21,980,000	8,307.51	1,825,992,621	8,274.74	1,818,788,401	0.43
26	アメリカ	US TREASURY N/B	2.750	2013/10/31	21,600,000	8,416.56	1,817,977,575	8,400.80	1,814,573,880	0.43
27	フランス	BTAN-5YR ISSUE	3.000	2014/7/12	15,830,000	11,439.75	1,810,913,770	11,416.94	1,807,301,918	0.43
28	アメリカ	US TREASURY N/B	4.625	2017/2/15	18,500,000	9,600.92	1,776,170,200	9,550.49	1,766,841,575	0.42
29	イタリア	BTPS	3.000	2015/4/15	15,970,000	10,699.85	1,708,766,364	10,844.35	1,731,843,733	0.41
30	アメリカ	US TREASURY N/B	3.625	2019/8/15	18,400,000	9,347.53	1,719,946,325	9,341.23	1,718,786,550	0.41
合計							65,391,611,392		65,333,192,641	15.42

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

（注２）種類は全て国債証券です。

B．種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	97.49
合計	97.49

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

取引名	国／地域	資産名	種類	数量 （枚）	簿価 （円）	時価 （円）	投資比率 （％）
債券先物取引	アメリカ	US 5YR NOTE	買建	55	546,407,280	547,533,581	0.13
	アメリカ	US 10YR NOTE	買建	38	401,349,880	402,822,649	0.10
	アメリカ	US LONG BOND	買建	30	341,891,181	344,604,450	0.08
	ドイツ	EURO-SCHATZ	買建	39	467,718,693	467,845,813	0.11
	ドイツ	EURO-BOBL FU	買建	33	448,898,340	450,762,774	0.11
	ドイツ	EURO-BUND FU	買建	56	843,480,372	852,181,064	0.20

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

（注２）債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる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。

（中央三井世界物価連動債マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄

A．主要銘柄の明細

順位	国／ 地域	銘柄名	利率 （％）	償還日	額面金額	簿価（円）		評価額（円）		投資 比率 （％）
						単価	金額	単価	金額	
1	アメリカ	TSY INFL IX N/B	1.125	2021/1/15	200,000	9,075.69	18,780,333	9,256.45	19,101,804	4.46
2	アメリカ	TSY INFL IX N/B	2.125	2019/1/15	150,000	9,645.29	15,252,122	9,809.86	15,469,377	3.62
3	アメリカ	TSY INFL IX N/B	3.875	2029/4/15	80,000	12,733.72	14,025,451	12,864.04	14,129,766	3.30
4	アメリカ	TSY INFL IX N/B	1.625	2018/1/15	130,000	9,249.15	12,990,535	9,393.23	13,156,348	3.07
5	イギリス	TSY I/L	1.250	2055/11/22	50,000	21,165.43	13,117,805	19,794.65	12,324,648	2.88
6	アメリカ	TSY INFL IX N/B	2.375	2027/1/15	100,000	10,556.17	11,847,530	10,672.45	11,945,033	2.79
7	イギリス	TSY I/L	1.125	2037/11/22	60,000	17,346.01	12,260,165	16,667.69	11,834,931	2.77
8	アメリカ	TSY INFL IX N/B	1.375	2020/1/15	120,000	9,250.76	11,618,574	9,425.37	11,805,511	2.76
9	アメリカ	TSY INFL IX N/B	2.500	2016/7/15	110,000	9,382.27	11,566,588	9,526.54	11,712,074	2.74
10	アメリカ	TSY INFL IX N/B	2.125	2040/2/15	100,000	11,058.80	11,580,145	11,184.89	11,680,162	2.73
11	イギリス	TSY I/L	1.250	2032/11/22	60,000	16,991.44	11,186,685	16,436.45	10,870,444	2.54
12	アメリカ	TSY INFL IX N/B	2.375	2025/1/15	80,000	10,378.67	9,969,691	10,538.82	10,095,519	2.36
13	フランス	FRANCE O.A.T. I/L	2.250	2020/7/25	70,000	11,795.04	9,751,953	11,966.71	9,928,396	2.32
14	イギリス	TSY I/L	2.500	2020/4/16	20,000	47,050.85	9,410,170	47,170.32	9,434,065	2.20
15	フランス	FRANCE O.A.T. I/L	2.500	2013/7/25	70,000	11,519.07	9,385,336	11,467.46	9,390,006	2.19
16	アメリカ	TSY INFL IX N/B	1.250	2014/4/15	100,000	8,504.47	9,095,717	8,618.57	9,191,885	2.15
17	アメリカ	TSY INFL IX N/B	0.500	2015/4/15	100,000	8,488.34	8,865,378	8,611.32	8,968,871	2.10
18	イギリス	TSY I/L	2.500	2016/7/26	20,000	44,156.68	8,831,336	44,218.60	8,843,720	2.07
19	フランス	FRANCE O.A.T. I/L	1.000	2017/7/25	70,000	11,082.30	8,572,856	11,296.88	8,782,502	2.05
20	イギリス	TSY I/L	2.500	2024/7/17	20,000	42,761.62	8,552,324	42,469.61	8,493,922	1.99

21	イギリス	TSY I/L	4.125	2030/7/22	20,000	41,467.54	8,293,509	40,361.41	8,072,283	1.89
22	ドイツ	DEUTSCHLAND I/L	1.500	2016/4/15	60,000	11,883.05	8,020,701	11,904.23	8,063,001	1.88
23	イギリス	TSY I/L	2.000	2035/1/26	30,000	26,561.68	7,968,505	25,566.81	7,670,044	1.79
24	イギリス	TSY I/L	1.875	2022/11/22	40,000	16,462.14	7,628,281	16,383.77	7,626,779	1.78
25	イギリス	TSY I/L	1.250	2017/11/22	40,000	14,928.21	7,343,932	14,921.79	7,374,049	1.72
26	アメリカ	TSY INFL IX N/B	1.875	2013/7/15	70,000	8,473.01	7,309,357	8,558.06	7,362,086	1.72
27	アメリカ	TSY INFL IX N/B	1.625	2015/1/15	70,000	8,746.51	7,257,145	8,864.71	7,335,098	1.71
28	アメリカ	TSY INFL IX N/B	2.000	2016/1/15	70,000	9,064.39	7,236,022	9,207.92	7,329,936	1.71
29	イギリス	TSY I/L	2.500	2013/8/16	20,000	36,394.13	7,278,827	36,346.73	7,269,346	1.70
30	アメリカ	TSY INFL IX N/B	2.500	2029/1/15	60,000	10,890.18	6,888,222	11,021.95	6,952,298	1.62
合計							301,885,195		302,213,904	70.63

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

（注２）種類は全て国債証券です。

（注３）利率は当初発行時のクーポンレートを表示しています。

B．種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	98.65
合計	98.65

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

平成24年２月29日及び同日前１年以内における各月末並びに下記特定期間末の純資産の推移

は次のとおりです。

	純資産総額（円）		1万口当たりの基準価額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1特定期間（平成17年7月19日現在）	1,377,430,508	1,380,748,113	10,352	10,377
第2特定期間（平成18年1月17日現在）	1,851,159,846	1,855,440,738	10,811	10,836
第3特定期間（平成18年7月18日現在）	1,806,000,299	1,810,274,350	10,524	10,549
第4特定期間（平成19年1月17日現在）	1,560,487,288	1,564,049,689	10,951	10,976
第5特定期間（平成19年7月17日現在）	1,423,716,351	1,426,993,118	10,826	10,851
第6特定期間（平成20年1月17日現在）	1,347,561,038	1,350,817,319	10,346	10,371
第7特定期間（平成20年7月17日現在）	1,311,298,881	1,314,415,575	10,494	10,519
第8特定期間（平成21年1月19日現在）	959,282,728	962,290,132	7,974	7,999
第9特定期間（平成21年7月17日現在）	923,037,415	925,749,962	8,507	8,532
第10特定期間（平成22年1月18日現在）	776,581,697	778,881,553	8,442	8,467
第11特定期間（平成22年7月20日現在）	613,317,744	615,312,423	7,687	7,712
第12特定期間（平成23年1月17日現在）	476,820,680	478,432,231	7,397	7,422
第13特定期間（平成23年7月19日現在）	373,234,634	374,508,226	7,326	7,351
第14特定期間（平成24年1月17日現在）	314,113,218	315,234,758	7,002	7,027
平成23年2月末日	448,042,933	—	7,360	—
平成23年3月末日	423,465,757	—	7,567	—
平成23年4月末日	424,282,338	—	7,701	—
平成23年5月末日	411,576,767	—	7,580	—
平成23年6月末日	384,898,733	—	7,522	—
平成23年7月末日	367,413,091	—	7,296	—
平成23年8月末日	364,789,480	—	7,354	—
平成23年9月末日	344,225,832	—	7,090	—
平成23年10月末日	347,508,321	—	7,253	—
平成23年11月末日	335,888,123	—	7,117	—
平成23年12月末日	325,520,354	—	7,129	—
平成24年1月末日	317,956,037	—	7,109	—
平成24年2月末日	324,478,172	—	7,608	—

特定期間末日における分配付の純資産総額及び基準価額（1万口当たり）を表示しております。

【分配の推移】

特定期間	1万口当たりの収益分配金
第1特定期間（自 平成17年2月4日 至 平成17年7月19日）	75 円
第2特定期間（自 平成17年7月20日 至 平成18年1月17日）	150 円
第3特定期間（自 平成18年1月18日 至 平成18年7月18日）	400 円
第4特定期間（自 平成18年7月19日 至 平成19年1月17日）	300 円
第5特定期間（自 平成19年1月18日 至 平成19年7月17日）	550 円
第6特定期間（自 平成19年7月18日 至 平成20年1月17日）	150 円
第7特定期間（自 平成20年1月18日 至 平成20年7月17日）	150 円
第8特定期間（自 平成20年7月18日 至 平成21年1月19日）	200 円
第9特定期間（自 平成21年1月20日 至 平成21年7月17日）	150 円
第10特定期間（自 平成21年7月18日 至 平成22年1月18日）	150 円
第11特定期間（自 平成22年1月19日 至 平成22年7月20日）	150 円
第12特定期間（自 平成22年7月21日 至 平成23年1月17日）	150 円
第13特定期間（自 平成23年1月18日 至 平成23年7月19日）	150 円
第14特定期間（自 平成23年7月20日 至 平成24年1月17日）	150 円

（注）収益分配金は、各特定期間中の分配金の累計金額を表示しております。

【収益率の推移】

特定期間	収益率
第1特定期間（自 平成17年2月4日 至 平成17年7月19日）	4.27 %
第2特定期間（自 平成17年7月20日 至 平成18年1月17日）	5.88 %
第3特定期間（自 平成18年1月18日 至 平成18年7月18日）	1.05 %
第4特定期間（自 平成18年7月19日 至 平成19年1月17日）	6.91 %
第5特定期間（自 平成19年1月18日 至 平成19年7月17日）	3.88 %
第6特定期間（自 平成19年7月18日 至 平成20年1月17日）	3.05 %
第7特定期間（自 平成20年1月18日 至 平成20年7月17日）	2.88 %
第8特定期間（自 平成20年7月18日 至 平成21年1月19日）	22.11 %
第9特定期間（自 平成21年1月20日 至 平成21年7月17日）	8.57 %
第10特定期間（自 平成21年7月18日 至 平成22年1月18日）	1.00 %

第11特定期間（自 平成22年 1 月19日 至 平成22年 7 月20日）	7.17 %
第12特定期間（自 平成22年 7 月21日 至 平成23年 1 月17日）	1.82 %
第13特定期間（自 平成23年 1 月18日 至 平成23年 7 月19日）	1.07 %
第14特定期間（自 平成23年 7 月20日 至 平成24年 1 月17日）	2.38 %

（注）収益率とは、特定期間末の基準価額（分配落ちの基準価額に当該特定期間中の分配金を加算した額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（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特定期間については、前期末基準価額の代わりに当初募集時の発行価額（1万口当たり10,000円）を使用しております。

（４）【設定及び解約の実績】

特定期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1特定期間（自 平成17年 2 月 4 日 至 平成17年 7 月19日）	1,357,024,569	26,431,947	1,330,592,622
第2特定期間（自 平成17年 7 月20日 至 平成18年 1 月17日）	674,556,397	292,792,044	1,712,356,975
第3特定期間（自 平成18年 1 月18日 至 平成18年 7 月18日）	201,840,604	198,153,285	1,716,044,294
第4特定期間（自 平成18年 7 月19日 至 平成19年 1 月17日）	150,973,212	442,057,046	1,424,960,460
第5特定期間（自 平成19年 1 月18日 至 平成19年 7 月17日）	113,341,425	223,255,883	1,315,046,002
第6特定期間（自 平成19年 7 月18日 至 平成20年 1 月17日）	37,890,417	50,423,848	1,302,512,571
第7特定期間（自 平成20年 1 月18日 至 平成20年 7 月17日）	26,824,308	79,765,562	1,249,571,317
第8特定期間（自 平成20年 7 月18日 至 平成21年 1 月19日）	21,746,079	68,355,682	1,202,961,714
第9特定期間（自 平成21年 1 月20日 至 平成21年 7 月17日）	11,029,258	128,943,865	1,085,047,107
第10特定期間（自 平成21年 7 月18日 至 平成22年 1 月18日）	5,118,783	170,223,440	919,942,450
第11特定期間（自 平成22年 1 月19日 至 平成22年 7 月20日）	4,934,864	127,005,491	797,871,823
第12特定期間（自 平成22年 7 月21日 至 平成23年 1 月17日）	5,075,810	158,327,170	644,620,463
第13特定期間（自 平成23年 1 月18日 至 平成23年 7 月19日）	4,037,385	139,220,981	509,436,867
第14特定期間（自 平成23年 7 月20日 至 平成24年 1 月17日）	3,675,414	64,496,254	448,616,027

（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特定期間の設定口数には、当初募集期間中の募集に係る設定口数を含みます。

（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

〈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。

2012年2月29日 現在（基準日）

〈分配の推移〉

2012年2月	25円
2012年1月	25円
2011年12月	25円
2011年11月	25円
2011年10月	25円
直近1年間累計	300円
設定来累計	2,900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〉

組入ファンド

ファンド名	比率
中央三井外国債券マザーファンド	48.36%
中央三井世界物価連動債マザーファンド	51.67%

・比率とはファンドの純資産総額に対する当該組入ファンドの評価金額の比率をいいます。

組入上位銘柄（中央三井外国債券マザーファンド）

銘柄名	種類	償還日	利率	通貨	比率
US TREASURY N/B	国債証券	2013/12/31	1.500%	米ドル	0.78%
US TREASURY N/B	国債証券	2021/02/15	3.625%	米ドル	0.69%
US TREASURY N/B	国債証券	2017/02/28	3.000%	米ドル	0.66%
US TREASURY N/B	国債証券	2014/07/31	2.625%	米ドル	0.66%
US TREASURY N/B	国債証券	2013/11/15	0.500%	米ドル	0.61%

・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。

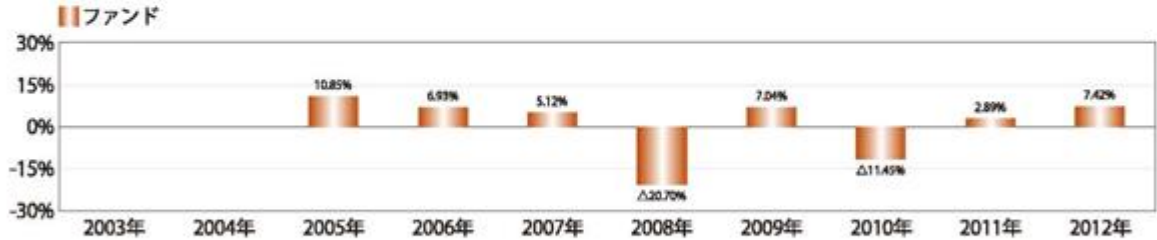
組入上位銘柄(中央三井世界物価連動債マザーファンド)

銘柄名	種類	償還日	利率	通貨	比率
TSY INFL IX N/B	国債証券	2021/01/15	1.125%	米ドル	4.46%
TSY INFL IX N/B	国債証券	2019/01/15	2.125%	米ドル	3.62%
TSY INFL IX N/B	国債証券	2029/04/15	3.875%	米ドル	3.30%
TSY INFL IX N/B	国債証券	2018/01/15	1.625%	米ドル	3.07%
TSY I/L	国債証券	2055/11/22	1.250%	英ポンド	2.88%

・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。

・利率は当初発行時のクーポンレートを表示しています。

〈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。
・2005年はファンドの設定日から年末までの分配金（税引前）を含む基準価額の騰落率を表示しています。
・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。
・ファンドにはベンチマークはありません。

・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

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（4））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け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ることができます。

（2）募集取扱いの単位

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

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

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

（3）販売価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、前記「第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金（1）申込手数料」に記載する申込手数料及び当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額とします。

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

（4）その他

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

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、自動引き落とし約款に従い分配金から税金を差引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資される、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

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

2【換金（解約）手続等】

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

（注）一部解約の実行の請求の受付けは、営業日の午後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。

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には、一部解約の実行の請求を受付けないものとします。

- （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。

なお、受益者の手取額は、当該解約価額から税額を差引いた金額となります。

販売会社の詳細につきましては、以下の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

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、上記（１）による一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。

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

- （７）一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、５営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

（８）解約に係る手数料については、徴収しません。

（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】

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又は一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。ただし、便宜上１万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出され、日々の基準価額は、販売会社へお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします（販売会社の詳細につきましては、前記「２ 換金（解約）手続等」に記載の照会先までお問い合わせください。）。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

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

A．親投資信託受益証券（外国債券マザーファンド及び世界物価連動債マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

B．公社債等

計算日（ ）における次のイ．からハ．までに掲げるいずれかの価額で評価します。

イ．日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

ロ．金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

ハ．価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

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17年２月４日）から無期限とします。ただし、委託会社は、下記（５）の事項に該当することとなった場合は、この信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎月18日から翌月17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17年２月４日から平成17年３月17日までとし、最終計算期間の終了日は、前記（３）に定める信託期間の終了日とします。

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

（５）【その他】

信託の終了

この信託契約を解約し信託を終了させる場合は下記のとおりです。

A．委託会社の所定の手続きを経て信託を終了させる場合

イ．受益権の口数が10億口を下回った場合

委託会社は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合は、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

ロ．受益者に有利な場合又はやむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

ハ．所定の手続き

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．の規定に基づき一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記イ．及びロ．の信託契約の解約をしません。

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

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

B．監督官庁の命令

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

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

C．委託会社の登録取消等に伴う取扱い

イ．委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、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き継ぐことを命じたときは、当ファンドは、下記 D．に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

D．受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い

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

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

委託会社の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い

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

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

信託約款の変更

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

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

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

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

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

反対者の買取り請求権

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。

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

信託財産の管理

A．保管業務の委任

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

B．有価証券の保管

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

C．混蔵寄託

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

D．信託財産の登記等及び記載等の留保等

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

ロ．上記イ．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。

運用報告書

委託会社は、毎年１月及び７月の決算時並びに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。

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。

信託事務処理の再信託

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

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

収益分配金は、毎計算期間終了日後１ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として計算期間終了日から起算して５営業日までの日）から、決算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決算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決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に対する支払いを開始します。なお、時効前の収益分配金に係る収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引換えに受益者に支払います。

上記の規定にかかわらず、分配金再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。再投資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。

収益分配金（上記に規定する収益分配金を除きます。）の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が、収益分配金については、上記に規定する支払開始日から５年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

（２）償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了日（償還日）後１ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日）から起算して５営業日までの日）から、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において

一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に対する支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

（３）一部解約請求権

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

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

一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

（４）投資信託約款等重要事項変更時の反対者の買取り請求権

前記「３ 資産管理等の概要（５）その他 反対者の買取り請求権」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。

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）当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。

- （３）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14特定期間（平成23年7月20日から平成24年1月17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。

- （４）当ファンドの主要投資対象である「中央三井外国債券マザーファンド」、「中央三井世界物価連動債マザーファンド」については、平成24年4月1日付にてそれぞれ「外国債券マザーファンド」、「世界物価連動債マザーファンド」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】

物価連動債組入世界債券ファンド

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第13特定期間 (平成23年 7 月19日現在)	第14特定期間 (平成24年 1 月17日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	374,879,972	315,521,208
未収入金	1,203,321	1,701,389
流動資産合計	376,083,293	317,222,597
資産合計	376,083,293	317,222,597
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,273,592	1,121,540
未払解約金	1,203,321	1,701,389
未払受託者報酬	17,620	13,578
未払委託者報酬	352,375	271,521
その他未払費用	1,751	1,351
流動負債合計	2,848,659	3,109,379
負債合計	2,848,659	3,109,379
純資産の部		
元本等		
元本	509,436,867	448,616,027
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	136,202,233	134,502,809
純資産合計	373,234,634	314,113,218
負債純資産合計	376,083,293	317,222,597

（２）【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13特定期間 (自 平成23年 1 月18日 至 平成23年 7 月19日)	第14特定期間 (自 平成23年 7 月20日 至 平成24年 1 月17日)
営業収益		
有価証券売買等損益	6,912,105	6,515,552
営業収益合計	6,912,105	6,515,552
営業費用		
受託者報酬	111,646	90,743
委託者報酬	2,232,917	1,814,764
その他費用	11,104	9,018
営業費用合計	2,355,667	1,914,525
営業利益又は営業損失（ ）	4,556,438	8,430,077
経常利益又は経常損失（ ）	4,556,438	8,430,077
当期純利益又は当期純損失（ ）	4,556,438	8,430,077
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（ ）	202,646	89,488
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	167,799,783	136,202,233
剰余金増加額又は欠損金減少額	36,675,996	18,242,705
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	36,675,996	18,242,705
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,031,684	1,032,382
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,031,684	1,032,382
分配金	8,400,554	7,170,310
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	136,202,233	134,502,809

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2．その他	ファンドの計算期間 第14特定期間（自 平成23年 7 月20日 至 平成24年 1 月17日） 第14特定期間は前特定期間末日が休業日のため、平成23年 7 月20日から平成24年 1 月17日までとなっております。

(追加情報)

当該特定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。

(貸借対照表に関する注記)

	第13特定期間 (平成23年 7 月19日現在)	第14特定期間 (平成24年 1 月17日現在)
1．当該特定期間の末日における受益権総数	509,436,867 口	448,616,027 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 136,202,233 円	元本の欠損 134,502,809 円
3．1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額)	0.7326 円 (7,326 円)	0.7002 円 (7,002 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13特定期間 自 平成23年 1 月18日 至 平成23年 7 月19日	第14特定期間 自 平成23年 7 月20日 至 平成24年 1 月17日
		第 72 期 自 平成23年 1 月18日 至 平成23年 2 月17日	第 78 期 自 平成23年 7 月20日 至 平成23年 8 月17日
費用控除後の配当等収益額	A	889,189 円 (1,062,069 円)	678,036 円 (748,614 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	26,207,198 円	19,814,089 円
分配準備積立金額	D	2,805,433 円	6,824 円

当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	29,901,820 円	20,498,949 円
当ファンドの期末残存口数	F	618,415,559 口	500,121,289 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	483.52 円	409.87 円
10,000口当たり分配金額	H	25 円	25 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,546,038 円	1,250,303 円
		第 73 期 自 平成23年 2 月18日 至 平成23年 3 月17日	第 79 期 自 平成23年 8 月18日 至 平成23年 9 月20日
費用控除後の配当等収益額	A	531,352 円 (916,730 円)	473,184 円 (847,655 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	25,676,397 円	19,053,405 円
分配準備積立金額	D	2,113,525 円	3,515 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	28,321,274 円	19,530,104 円
当ファンドの期末残存口数	F	605,796,860 口	495,035,867 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	467.50 円	394.51 円
10,000口当たり分配金額	H	25 円	25 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,514,492 円	1,237,589 円

		第 74 期 自 平成23年 3 月18日 至 平成23年 4 月18日	第 80 期 自 平成23年 9 月21日 至 平成23年10月17日
費用控除後の配当等収益額	A	961,513 円 (976,708 円)	416,990 円 (699,394 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	23,547,749 円	17,845,835 円
分配準備積立金額	D	1,100,525 円	9,985 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	25,609,787 円	18,272,810 円
当ファンドの期末残存口数	F	555,517,675 口	482,937,147 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	461.00 円	378.36 円
10,000口当たり分配金額	H	25 円	25 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,388,794 円	1,207,342 円
		第 75 期 自 平成23年 4 月19日 至 平成23年 5 月17日	第 81 期 自 平成23年10月18日 至 平成23年11月17日
費用控除後の配当等収益額	A	556,761 円 (924,417 円)	390,722 円 (712,674 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	23,217,929 円	16,724,591 円
分配準備積立金額	D	675,057 円	5,840 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	24,449,747 円	17,121,153 円
当ファンドの期末残存口数	F	547,695,660 口	473,280,421 口

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	446.41 円	361.75 円
10,000口当たり分配金額	H	25 円	25 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	1,369,239 円	1,183,201 円
		第 76 期 自 平成23年 5 月18日 至 平成23年 6 月17日	第 82 期 自 平成23年11月18日 至 平成23年12月19日
費用控除後の配当等収益額	A	812,880 円 (961,230 円)	642,613 円 (674,657 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	22,055,399 円	15,765,080 円
分配準備積立金額	D	702 円	3,038 円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	22,868,981 円	16,410,731 円
当ファンドの期末残存口数	F	523,359,791 口	468,134,336 口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	436.96 円	350.55 円
10,000口当たり分配金額	H	25 円	25 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	1,308,399 円	1,170,335 円

		第 77 期 自 平成23年 6 月18日 至 平成23年 7 月19日	第 83 期 自 平成23年12月20日 至 平成24年 1 月17日
費用控除後の配当等収益額	A	463,277 円 (835,023 円)	343,858 円 (630,308 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	20,987,627 円	14,605,288 円
分配準備積立金額	D	5,127 円	912 円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	21,456,031 円	14,950,058 円
当ファンドの期末残存口数	F	509,436,867 口	448,616,027 口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	421.17 円	333.24 円
10,000口当たり分配金額	H	25 円	25 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	1,273,592 円	1,121,540 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13特定期間 自 平成23年 1 月18日 至 平成23年 7 月19日	第14特定期間 自 平成23年 7 月20日 至 平成24年 1 月17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。	「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。

（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13特定期間 自 平成23年 1 月18日 至 平成23年 7 月19日	第14特定期間 自 平成23年 7 月20日 至 平成24年 1 月17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。	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク等に晒されております。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク等に晒されております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	委託会社においては、運用セクションから組織的に独立した業務管理室が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。 また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。	委託会社においては、運用セクションから組織的に独立した業務管理室が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。 また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第13特定期間 （平成23年 7 月19日現在）	第14特定期間 （平成24年 1 月17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。	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	(1) 親投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	(1) 親投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. 金銭債権の特定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。	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)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1. 本書における開示対象ファンドの当該特定期間における元本額の変動

	第13特定期間 自 平成23年 1 月18日 至 平成23年 7 月19日	第14特定期間 自 平成23年 7 月20日 至 平成24年 1 月17日
期首元本額	644,620,463 円	509,436,867 円
期中追加設定元本額	4,037,385 円	3,675,414 円
期中一部解約元本額	139,220,981 円	64,496,254 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第13特定期間 (平成23年 7 月19日現在)	第14特定期間 (平成24年 1 月17日現在)
	最終の計算期間 (自 平成23年 6 月18日 至 平成23年 7 月19日) の損益に含まれた評価差額 (円)	最終の計算期間 (自 平成23年12月20日 至 平成24年 1 月17日) の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	6,946,867	4,512,324

合計	6,946,867	4,512,324
----	-----------	-----------

３．デリバティブ取引関係

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

A．株式

該当事項はありません。

B．株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
親投資信託	中央三井外国債券マザーファンド	105,947,317	152,638,299	
受益証券	中央三井世界物価連動債マザーファンド	156,527,878	162,882,909	
合計		262,475,195	315,521,208	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

< 参考 >

「物価連動債組入世界債券ファンド」は、「中央三井外国債券マザーファンド」及び「中央三井世界物価連動債マザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。

各マザーファンドの平成24年1月17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。

「中央三井外国債券マザーファンド」の状況

（１）貸借対照表

項目	平成24年1月17日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	699,308,981
コール・ローン	5,956,333,165
国債証券	376,432,909,687
派生商品評価勘定	53,549,384
未収利息	4,148,475,061
前払費用	200,348,440
差入委託証拠金	263,786,005
流動資産合計	387,754,710,723
資産合計	387,754,710,723
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	23,584,250
未払解約金	230,166,107
流動負債合計	253,750,357
負債合計	253,750,357
純資産の部	
元本等	
元本	268,968,908,051
剰余金	
剰余金	118,532,052,315
純資産合計	387,500,960,366
負債・純資産合計	387,754,710,723

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成24年1月17日現在
--	--------------

1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。
2．デリバティブの評価基準及び評価方法	（１）債券先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる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	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 1月17日現在
1．計算日における受益権総数	268,968,908,051 口
2．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4407 円 (14,407 円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

平成24年 1月17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、為替変動リスク、金利変動リスク、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債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。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１月17日現在

１．貸借対照表計上額、時価及び差額

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

２．時価の算定方法

（１）国債証券

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

（２）デリバティブ取引

「（その他の注記）」の「３．デリバティブ取引関係」に記載しております。

（３）コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

３．金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

4．金銭債権の計算日後の償還予定額

金銭債権は全て１年以内に償還予定であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

平成24年 1 月17日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

平成24年 1 月17日現在
該当事項はありません。

（その他の注記）

1．元本の変動

平成24年 1 月17日現在	
特定期間の期首元本額	278,233,358,435 円
特定期間中の追加設定元本額	13,194,869,909 円
特定期間中の一部解約元本額	22,459,320,293 円
計算日の元本額	268,968,908,051 円
計算日の元本額の内訳	
中央三井外国債券インデックスファンド	5,876,928,567 円
中央三井D C 外国債券インデックスファンド	1,859,767,559 円
中央三井D C 外国債券インデックスファンドL	8,678,346,586 円
物価連動債組入世界債券ファンド	105,947,317 円
中央三井D C バランスファンド3 0	104,667,585 円
中央三井D C バランスファンド5 0	156,189,562 円
中央三井D C バランスファンド7 0	29,975,940 円
ベスタ・世界6 資産ファンド（毎月決算型）	140,300,656 円
ベスタ・世界6 資産ファンド（1 年決算型）	87,741,005 円
新生・4 分散ファンド	108,876,992 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	430,840,880 円
4 資産インデックスバランスオープン（分配型）	34,515,739 円
4 資産インデックスバランスオープン（成長型）	103,625,042 円
C M A M 外国債券インデックスe	591,576,807 円
中央三井インデックスコレクション（外国債券）	1,029,178,800 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式3 0）	107,722,158 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式5 0）	150,811,621 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式7 0）	44,799,650 円
中央三井外国債券インデックスファンドF（一般投資家私募）	449,124,825 円
中央三井外国債券インデックスファンドV A（適格機関投資家専用）	17,984,304,686 円
中央三井バランスV A 3 0（適格機関投資家専用）	8,044,842,907 円
中央三井バランスV A 5 0（適格機関投資家専用）	25,895,828,396 円
中央三井V A バランスファンド（株2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	90,373,441,969 円
中央三井V A バランスファンド（株5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	4,725,855,744 円
中央三井V A バランス株式3 0（適格機関投資家専用）	116,501,059 円
中央三井V A バランスファンド（株6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	9,575,442,346 円

中央三井バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	7,546,893,261 円
中央三井バランスV A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	2,148,521,122 円
中央三井バランスV A 5 0 L（適格機関投資家専用）	20,309,020,880 円
中央三井バランスV A 7 5（適格機関投資家専用）	725,923,333 円
中央三井V A バランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	33,668,676,404 円
中央三井V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	5,670,690,702 円
中央三井V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	531,273,551 円
中央三井バランスV A 4 0（適格機関投資家専用）	2,695,498,454 円
中央三井V A バランス株式 4 0（適格機関投資家専用）	2,743,158,799 円
中央三井V A バランスファンド 2（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	415,068,026 円
C M A M ・ V A バランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	162,891,409 円
中央三井バランスV A 2 0（適格機関投資家専用）	3,771,617,012 円
中央三井V A ファンド 2 5（適格機関投資家専用）	6,889,229,451 円
中央三井バランスV A 2 0 L（適格機関投資家専用）	48,838,174 円
中央三井バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	970,834,416 円
中央三井世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	309,970,483 円
C M A M ・ V A バランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	3,508,920,726 円
私募外国債券インデックスファンド A L（適格機関投資家専用）	42,919,245 円
中央三井世界バランスV A 2 0（適格機関投資家専用）	1,808,205 円

2．有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成24年 1 月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	19,583,303,462
合計	19,583,303,462

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「中央三井外国債券マザーファンド」の期首から計算日までの期間（平成23年 2 月 8 日から平成24年 1 月17日まで）に対応するものです。

3．デリバティブ取引関係

・ヘッジ会計が適用されていないもの

債券関連

区分	種類	平成24年 1 月17日現在			
		契約額等（円）		時価 （円）	評価損益 （円）
			うち 1 年超		
市場取引	債券先物取引 買 建	3,942,766,090	—	3,992,459,874	49,693,784
	合計	3,942,766,090	—	3,992,459,874	49,693,784

（注）1．時価の算定方法

債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる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．債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3．計算日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

	平成24年 1 月17日現在
--	----------------

区分	種類	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	2,472,106,700	—	2,474,892,000	2,785,300
	カナダドル	263,700,500	—	264,355,000	654,500
	ユーロ	2,518,976,000	—	2,495,488,000	23,488,000
	英ポンド	518,080,200	—	518,496,000	415,800
	計	5,772,863,400	—	5,753,231,000	19,632,400
	売 建				
	米ドル	38,406,500	—	38,430,000	23,500
	ユーロ	9,713,550	—	9,748,000	34,450
	英ポンド	11,745,700	—	11,784,000	38,300
	計	59,865,750	—	59,962,000	96,250
合計		5,832,729,150	—	5,813,193,000	19,728,650

（注）時価の算定方法

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

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

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

．ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年 1 月17日現在
該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表（平成24年 1 月17日現在）

有価証券明細表

A．株式

該当事項はありません。

B．株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B 0.625% 2012/12/31	1,120,000	1,124,550.00	
		US TREASURY N/B 0.625% 2013/01/31	6,570,000	6,601,310.18	
		US TREASURY N/B 2.875% 2013/01/31	17,740,000	18,250,025.00	
		US TREASURY N/B 1.375% 2013/02/15	1,000,000	1,012,890.63	
		US TREASURY N/B 3.875% 2013/02/15	9,650,000	10,034,492.18	
		US TREASURY N/B 0.625% 2013/02/28	27,450,000	27,585,105.60	
		US TREASURY N/B 2.750% 2013/02/28	15,630,000	16,080,583.67	
		US TREASURY N/B 1.375% 2013/03/15	9,880,000	10,015,850.00	
		US TREASURY N/B 0.750% 2013/03/31	8,200,000	8,255,093.75	
		US TREASURY N/B 1.750% 2013/04/15	24,000,000	24,470,625.12	
		US TREASURY N/B 0.625% 2013/04/30	13,700,000	13,780,273.50	
		US TREASURY N/B 3.125% 2013/04/30	12,700,000	13,184,187.50	
		US TREASURY N/B 1.375% 2013/05/15	10,000,000	10,157,031.30	
		US TREASURY N/B 3.625% 2013/05/15	10,000,000	10,457,812.50	
		US TREASURY N/B 0.500% 2013/05/31	14,970,000	15,035,493.75	
		US TREASURY N/B 1.125% 2013/06/15	11,410,000	11,559,756.25	
		US TREASURY N/B 0.375% 2013/06/30	1,000,000	1,002,656.25	
		US TREASURY N/B 1.000% 2013/07/15	17,030,000	17,234,892.18	
		US TREASURY N/B 0.375% 2013/07/31	5,000,000	5,014,062.50	
		US TREASURY N/B 3.375% 2013/07/31	17,810,000	18,683,803.12	
		US TREASURY N/B 0.750% 2013/08/15	15,000,000	15,131,250.00	
		US TREASURY N/B 4.250% 2013/08/15	6,930,000	7,372,870.31	
		US TREASURY N/B 0.125% 2013/08/31	9,600,000	9,588,000.00	
		US TREASURY N/B 3.125% 2013/08/31	3,210,000	3,361,973.43	
		US TREASURY N/B 0.750% 2013/09/15	15,000,000	15,134,765.70	
		US TREASURY N/B 0.125% 2013/09/30	21,000,000	20,970,468.75	
		US TREASURY N/B 0.500% 2013/10/15	13,700,000	13,758,867.25	
		US TREASURY N/B 0.250% 2013/10/31	10,000,000	10,006,250.00	
		US TREASURY N/B 2.750% 2013/10/31	21,600,000	22,575,375.00	
		US TREASURY N/B 0.500% 2013/11/15	32,000,000	32,160,000.00	
		US TREASURY N/B 4.250% 2013/11/15	2,140,000	2,297,825.00	
		US TREASURY N/B 0.250% 2013/11/30	12,400,000	12,406,781.31	
		US TREASURY N/B 2.000% 2013/11/30	6,500,000	6,715,312.50	
		US TREASURY N/B 0.750% 2013/12/15	2,000,000	2,019,531.26	
		US TREASURY N/B 1.500% 2013/12/31	40,120,000	41,116,731.25	
		US TREASURY N/B 1.750% 2014/01/31	18,900,000	19,478,812.50	
		US TREASURY N/B 4.000% 2014/02/15	4,000,000	4,312,500.00	
		US TREASURY N/B 1.875% 2014/02/28	2,000,000	2,067,968.76	
		US TREASURY N/B 1.250% 2014/03/15	15,100,000	15,424,414.13	
		US TREASURY N/B 1.750% 2014/03/31	13,000,000	13,426,562.50	
		US TREASURY N/B 1.250% 2014/04/15	5,110,000	5,221,781.25	
		US TREASURY N/B 1.875% 2014/04/30	6,880,000	7,130,475.00	
		US TREASURY N/B 1.000% 2014/05/15	4,900,000	4,978,093.75	
		US TREASURY N/B 4.750% 2014/05/15	9,300,000	10,263,421.87	
		US TREASURY N/B 2.250% 2014/05/31	5,000,000	5,232,031.25	
		US TREASURY N/B 0.750% 2014/06/15	10,000,000	10,110,937.50	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B 2.625% 2014/06/30	13,000,000	13,741,406.25	

		US TREASURY N/B	0.625%	2014/07/15	2,000,000	2,016,250.00	
		US TREASURY N/B	2.625%	2014/07/31	32,650,000	34,570,738.44	
		US TREASURY N/B	0.500%	2014/08/15	13,000,000	13,068,046.94	
		US TREASURY N/B	4.250%	2014/08/15	12,550,000	13,826,570.31	
		US TREASURY N/B	2.375%	2014/08/31	26,000,000	27,397,500.00	
		US TREASURY N/B	0.250%	2014/09/15	9,000,000	8,986,640.67	
		US TREASURY N/B	2.375%	2014/09/30	12,150,000	12,822,046.87	
		US TREASURY N/B	0.500%	2014/10/15	5,100,000	5,125,898.46	
		US TREASURY N/B	2.375%	2014/10/31	15,950,000	16,857,156.25	
		US TREASURY N/B	0.375%	2014/11/15	14,000,000	14,020,781.32	
		US TREASURY N/B	4.250%	2014/11/15	9,230,000	10,251,068.75	
		US TREASURY N/B	2.125%	2014/11/30	11,400,000	11,979,796.93	
		US TREASURY N/B	0.250%	2014/12/15	6,100,000	6,085,226.59	
		US TREASURY N/B	2.625%	2014/12/31	3,480,000	3,714,084.39	
		US TREASURY N/B	2.250%	2015/01/31	14,900,000	15,747,437.50	
		US TREASURY N/B	11.250%	2015/02/15	2,550,000	3,397,875.00	
		US TREASURY N/B	4.000%	2015/02/15	10,020,000	11,120,634.37	
		US TREASURY N/B	2.375%	2015/02/28	5,500,000	5,839,453.12	
		US TREASURY N/B	2.500%	2015/03/31	12,820,000	13,676,336.00	
		US TREASURY N/B	2.500%	2015/04/30	8,930,000	9,538,356.25	
		US TREASURY N/B	4.125%	2015/05/15	7,040,000	7,901,300.00	
		US TREASURY N/B	2.125%	2015/05/31	6,950,000	7,344,195.31	
		US TREASURY N/B	1.875%	2015/06/30	23,900,000	25,076,328.12	
		US TREASURY N/B	1.750%	2015/07/31	8,000,000	8,369,375.04	
		US TREASURY N/B	4.250%	2015/08/15	500,000	567,421.87	
		US TREASURY N/B	1.250%	2015/08/31	11,990,000	12,336,585.93	
		US TREASURY N/B	1.250%	2015/09/30	21,980,000	22,606,773.54	
		US TREASURY N/B	1.250%	2015/10/31	10,000,000	10,279,687.50	
		US TREASURY N/B	4.500%	2015/11/15	12,160,000	13,995,400.00	
		US TREASURY N/B	1.375%	2015/11/30	25,000,000	25,822,265.75	
		US TREASURY N/B	2.125%	2015/12/31	11,000,000	11,689,218.75	
		US TREASURY N/B	2.000%	2016/01/31	3,000,000	3,172,968.75	
		US TREASURY N/B	4.500%	2016/02/15	7,700,000	8,919,968.75	
		US TREASURY N/B	2.625%	2016/02/29	22,900,000	24,807,140.62	
		US TREASURY N/B	2.250%	2016/03/31	9,150,000	9,781,921.87	
		US TREASURY N/B	2.375%	2016/03/31	7,900,000	8,476,453.12	
		US TREASURY N/B	2.000%	2016/04/30	6,090,000	6,446,360.18	
		US TREASURY N/B	2.625%	2016/04/30	13,580,000	14,727,934.37	
		US TREASURY N/B	5.125%	2016/05/15	22,000,000	26,200,625.00	
		US TREASURY N/B	7.250%	2016/05/15	1,670,000	2,142,557.81	
		US TREASURY N/B	1.750%	2016/05/31	10,960,000	11,489,162.50	
		US TREASURY N/B	1.500%	2016/06/30	21,960,000	22,764,628.23	
		US TREASURY N/B	3.250%	2016/06/30	9,000,000	10,020,937.50	
		US TREASURY N/B	1.500%	2016/07/31	9,950,000	10,311,464.89	
		US TREASURY N/B	3.250%	2016/07/31	3,560,000	3,969,956.25	
		US TREASURY N/B	4.875%	2016/08/15	3,750,000	4,453,710.93	
		US TREASURY N/B	1.000%	2016/08/31	11,000,000	11,149,531.25	
		US TREASURY N/B	3.000%	2016/08/31	1,030,000	1,137,506.25	
		US TREASURY N/B	1.000%	2016/09/30	10,000,000	10,128,125.00	
		US TREASURY N/B	3.000%	2016/09/30	4,000,000	4,418,750.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B 3.125% 2016/10/31	5,400,000	6,002,437.50	
		US TREASURY N/B 4.625% 2016/11/15	2,450,000	2,897,890.62	
		US TREASURY N/B 7.500% 2016/11/15	8,250,000	10,890,000.00	
		US TREASURY N/B 0.875% 2016/11/30	2,000,000	2,010,000.00	

		US TREASURY N/B	2.750%	2016/11/30	15,500,000	16,960,390.62	
		US TREASURY N/B	3.250%	2016/12/31	9,800,000	10,965,281.25	
		US TREASURY N/B	3.125%	2017/01/31	5,000,000	5,568,750.00	
		US TREASURY N/B	4.625%	2017/02/15	18,500,000	21,988,984.37	
		US TREASURY N/B	3.000%	2017/02/28	31,550,000	34,951,484.37	
		US TREASURY N/B	3.250%	2017/03/31	15,300,000	17,157,515.62	
		US TREASURY N/B	3.125%	2017/04/30	4,900,000	5,465,031.25	
		US TREASURY N/B	4.500%	2017/05/15	15,530,000	18,458,860.93	
		US TREASURY N/B	8.750%	2017/05/15	2,700,000	3,812,062.50	
		US TREASURY N/B	2.750%	2017/05/31	9,900,000	10,859,062.50	
		US TREASURY N/B	2.500%	2017/06/30	2,200,000	2,383,218.75	
		US TREASURY N/B	2.375%	2017/07/31	2,000,000	2,152,812.50	
		US TREASURY N/B	1.875%	2017/08/31	2,000,000	2,097,812.50	
		US TREASURY N/B	1.875%	2017/09/30	1,210,000	1,268,042.18	
		US TREASURY N/B	1.875%	2017/10/31	4,900,000	5,133,515.62	
		US TREASURY N/B	4.250%	2017/11/15	4,350,000	5,147,953.12	
		US TREASURY N/B	2.250%	2017/11/30	2,000,000	2,137,187.50	
		US TREASURY N/B	2.750%	2017/12/31	11,000,000	12,075,937.50	
		US TREASURY N/B	2.625%	2018/01/31	25,250,000	27,546,171.87	
		US TREASURY N/B	3.500%	2018/02/15	4,000,000	4,569,375.00	
		US TREASURY N/B	2.750%	2018/02/28	290,000	318,546.87	
		US TREASURY N/B	2.875%	2018/03/31	4,800,000	5,311,500.00	
		US TREASURY N/B	2.625%	2018/04/30	5,600,000	6,106,625.00	
		US TREASURY N/B	3.875%	2018/05/15	2,040,000	2,384,568.75	
		US TREASURY N/B	2.375%	2018/05/31	1,100,000	1,182,328.12	
		US TREASURY N/B	2.375%	2018/06/30	4,960,000	5,328,125.00	
		US TREASURY N/B	2.250%	2018/07/31	15,000,000	15,998,437.50	
		US TREASURY N/B	1.500%	2018/08/31	6,500,000	6,614,765.62	
		US TREASURY N/B	1.375%	2018/09/30	10,520,000	10,610,406.25	
		US TREASURY N/B	1.750%	2018/10/31	16,630,000	17,170,475.00	
		US TREASURY N/B	3.750%	2018/11/15	5,040,000	5,876,325.00	
		US TREASURY N/B	1.375%	2018/11/30	9,000,000	9,059,062.50	
		US TREASURY N/B	2.750%	2019/02/15	2,000,000	2,197,187.50	
		US TREASURY N/B	3.125%	2019/05/15	15,520,000	17,443,025.00	
		US TREASURY N/B	3.625%	2019/08/15	18,400,000	21,358,375.00	
		US TREASURY N/B	8.125%	2019/08/15	3,600,000	5,365,125.00	
		US TREASURY N/B	3.375%	2019/11/15	25,070,000	28,665,978.12	
		US TREASURY N/B	3.625%	2020/02/15	25,030,000	29,109,107.81	
		US TREASURY N/B	3.500%	2020/05/15	26,650,000	30,764,093.75	
		US TREASURY N/B	2.625%	2020/08/15	15,000,000	16,221,093.75	
		US TREASURY N/B	8.750%	2020/08/15	1,800,000	2,845,968.75	
		US TREASURY N/B	2.625%	2020/11/15	15,000,000	16,200,000.00	
		US TREASURY N/B	3.625%	2021/02/15	31,230,000	36,319,514.06	
		US TREASURY N/B	3.125%	2021/05/15	9,190,000	10,279,876.56	
		US TREASURY N/B	2.125%	2021/08/15	25,400,000	26,102,468.74	
		US TREASURY N/B	2.000%	2021/11/15	19,520,000	19,773,150.00	
		US TREASURY N/B	8.000%	2021/11/15	6,100,000	9,545,546.87	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B 7.250% 2022/08/15	1,000,000	1,515,937.50	
		US TREASURY N/B 7.125% 2023/02/15	1,450,000	2,196,523.43	
		US TREASURY N/B 6.250% 2023/08/15	10,080,000	14,453,775.00	
		US TREASURY N/B 7.500% 2024/11/15	4,690,000	7,493,007.81	
		US TREASURY N/B 7.625% 2025/02/15	800,000	1,294,000.00	
		US TREASURY N/B 6.875% 2025/08/15	6,340,000	9,763,600.00	
		US TREASURY N/B 6.000% 2026/02/15	1,040,000	1,498,412.50	

		US TREASURY N/B	6.500%	2026/11/15	2,150,000	3,260,273.43	
		US TREASURY N/B	6.625%	2027/02/15	2,500,000	3,845,703.12	
		US TREASURY N/B	6.375%	2027/08/15	3,940,000	5,970,946.87	
		US TREASURY N/B	6.125%	2027/11/15	2,700,000	4,010,765.62	
		US TREASURY N/B	5.500%	2028/08/15	5,250,000	7,409,062.50	
		US TREASURY N/B	5.250%	2028/11/15	3,350,000	4,616,718.75	
		US TREASURY N/B	5.250%	2029/02/15	1,600,000	2,210,750.00	
		US TREASURY N/B	6.125%	2029/08/15	2,200,000	3,333,687.50	
		US TREASURY N/B	6.250%	2030/05/15	3,520,000	5,444,450.00	
		US TREASURY N/B	5.375%	2031/02/15	7,480,000	10,660,168.75	
		US TREASURY N/B	4.500%	2036/02/15	8,320,000	10,877,100.00	
		US TREASURY N/B	5.000%	2037/05/15	5,830,000	8,190,239.06	
		US TREASURY N/B	4.375%	2038/02/15	3,200,000	4,131,500.00	
		US TREASURY N/B	4.500%	2038/05/15	9,500,000	12,501,406.25	
		US TREASURY N/B	3.500%	2039/02/15	4,770,000	5,352,834.37	
		US TREASURY N/B	4.250%	2039/05/15	15,510,000	19,678,312.50	
		US TREASURY N/B	4.500%	2039/08/15	19,450,000	25,649,687.50	
		US TREASURY N/B	4.375%	2039/11/15	14,800,000	19,159,062.50	
		US TREASURY N/B	4.625%	2040/02/15	14,700,000	19,764,609.37	
		US TREASURY N/B	4.375%	2040/05/15	11,800,000	15,279,156.25	
		US TREASURY N/B	3.875%	2040/08/15	26,910,000	32,161,654.68	
		US TREASURY N/B	4.250%	2040/11/15	14,820,000	18,832,978.12	
		US TREASURY N/B	4.750%	2041/02/15	7,900,000	10,856,328.12	
		US TREASURY N/B	4.375%	2041/05/15	9,650,000	12,523,890.62	
		US TREASURY N/B	3.750%	2041/08/15	12,440,000	14,580,068.75	
		US TREASURY N/B	3.125%	2041/11/15	2,700,000	2,817,703.12	
		米ドル 小計			1,867,370,000	2,058,080,823.32 (158,245,834,505)	
カナダドル	国債証券	CANADA-GOV'T	1.750%	2013/03/01	6,900,000	6,959,409.00	
		CANADA-GOV'T	3.500%	2013/06/01	2,590,000	2,678,862.90	
		CANADA-GOV'T	5.250%	2013/06/01	5,760,000	6,094,310.40	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2013/08/01	4,120,000	4,184,601.60	
		CANADA-GOV'T	2.500%	2013/09/01	4,020,000	4,118,811.60	
		CANADA-GOV'T	1.500%	2013/11/01	2,150,000	2,170,489.50	
		CANADA-GOV'T	1.000%	2014/02/01	280,000	280,224.00	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2014/03/01	3,380,000	3,453,143.20	
		CANADA-GOV'T	3.000%	2014/06/01	8,100,000	8,482,077.00	
		CANADA-GOV'T	5.000%	2014/06/01	2,790,000	3,052,064.70	
		CANADA-GOV'T	2.250%	2014/08/01	3,800,000	3,919,206.00	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2014/12/01	8,010,000	8,230,114.80	
		CANADA-GOV'T	1.000%	2015/02/01	3,850,000	3,843,416.50	
		CANADA-GOV'T	2.500%	2015/06/01	4,530,000	4,740,327.90	
		CANADA-GOV'T	4.500%	2015/06/01	3,100,000	3,448,812.00	
		CANADA-GOV'T	3.000%	2015/12/01	2,210,000	2,361,031.40	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
カナダドル	国債証券	CANADA-GOV'T	2.000%	2016/06/01	1,200,000	1,237,968.00	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2016/06/01	6,470,000	7,222,784.50	
		CANADA-GOV'T	2.750%	2016/09/01	3,840,000	4,090,752.00	
		CANADA-GOV'T	1.500%	2017/03/01	2,410,000	2,426,629.00	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2017/06/01	4,950,000	5,618,794.50	
		CANADA-GOV'T	4.250%	2018/06/01	3,150,000	3,673,719.00	
		CANADA-GOV'T	3.750%	2019/06/01	8,670,000	9,935,820.00	
		CANADA-GOV'T	3.500%	2020/06/01	3,730,000	4,212,811.20	
		CANADA-GOV'T	3.250%	2021/06/01	3,560,000	3,958,720.00	
		CANADA-GOV'T	2.750%	2022/06/01	960,000	1,024,608.00	

		CANADA-GOV'T	8.000%	2023/06/01	2,000,000	3,195,740.00	
		CANADA-GOV'T	9.000%	2025/06/01	860,000	1,536,200.80	
		CANADA-GOV'T	8.000%	2027/06/01	2,050,000	3,557,303.50	
		CANADA-GOV'T	5.750%	2029/06/01	4,760,000	7,021,333.20	
		CANADA-GOV'T	5.750%	2033/06/01	4,870,000	7,473,307.20	
		CANADA-GOV'T	5.000%	2037/06/01	5,280,000	7,689,000.00	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2041/06/01	6,180,000	8,086,530.00	
		CANADA-GOV'T	3.500%	2045/12/01	1,200,000	1,465,260.00	
		カナダドル 小計				131,730,000	151,444,183.40 (11,450,694,706)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX I C A N B O N O S	9.000%	2013/06/20	44,110,000	46,725,723.00	
		MEX I C A N B O N O S	8.000%	2013/12/19	35,830,000	37,910,648.10	
		MEX I C A N B O N O S	7.000%	2014/06/19	23,670,000	24,786,513.90	
		MEX I C A N B O N O S	9.500%	2014/12/18	38,070,000	42,693,601.50	
		MEX I C A N B O N O S	6.000%	2015/06/18	26,600,000	27,337,884.00	
		MEX I C A N B O N O S	8.000%	2015/12/17	22,840,000	25,127,197.60	
		MEX I C A N B O N O S	6.250%	2016/06/16	7,500,000	7,782,525.00	
		MEX I C A N B O N O S	7.250%	2016/12/15	21,990,000	23,823,746.10	
		MEX I C A N B O N O S	7.750%	2017/12/14	22,600,000	25,241,940.00	
		MEX I C A N B O N O S	8.500%	2018/12/13	17,750,000	20,726,497.50	
		MEX I C A N B O N O S	8.000%	2020/06/11	38,260,000	43,195,540.00	
		MEX I C A N B O N O S	6.500%	2021/06/10	30,530,000	31,049,620.60	
		MEX I C A N B O N O S	8.000%	2023/12/07	10,140,000	11,447,248.80	
		MEX I C A N B O N O S	10.000%	2024/12/05	32,410,000	42,214,025.00	
		MEX I C A N B O N O S	7.500%	2027/06/03	36,430,000	38,121,080.60	
		MEX I C A N B O N O S	8.500%	2029/05/31	37,340,000	42,063,136.60	
		MEX I C A N B O N O S	7.750%	2031/05/29	8,000,000	8,255,680.00	
		MEX I C A N B O N O S	10.000%	2036/11/20	28,160,000	35,298,841.60	
	MEX I C A N B O N O S	8.500%	2038/11/18	29,940,000	32,572,025.40		
	メキシコペソ 小計				512,170,000	566,373,475.30 (3,222,665,074)	
ユーロ	国債証券 (ベルギー)	BELG I A N 0282	8.000%	2015/03/28	2,160,000	2,500,416.00	
		BELG I A N 0291	5.500%	2028/03/28	5,780,000	6,557,988.00	
		BELG I A N 0300	5.500%	2017/09/28	3,070,000	3,383,447.00	
		BELG I A N 0301	4.250%	2013/09/28	4,610,000	4,771,350.00	
		BELG I A N 0303	4.250%	2014/09/28	4,250,000	4,453,575.00	
		BELG I A N 0304	5.000%	2035/03/28	6,080,000	6,543,296.00	
		BELG I A N 0306	3.750%	2015/09/28	6,920,000	7,173,964.00	
		BELG I A N 0307	3.250%	2016/09/28	5,400,000	5,417,820.00	
		BELG I A N 0308	4.000%	2022/03/28	5,340,000	5,280,726.00	
		BELG I A N 0309	4.000%	2017/03/28	5,110,000	5,271,476.00	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券 (ベルギー)	BELG I A N 0310	4.000%	2013/03/28	5,770,000	5,941,946.00	
		BELG I A N 0312	4.000%	2018/03/28	4,330,000	4,439,982.00	
		BELG I A N 0314	4.000%	2014/03/28	5,930,000	6,153,561.00	
		BELG I A N 0315	4.000%	2019/03/28	4,200,000	4,276,440.00	
		BELG I A N 0316	3.500%	2015/03/28	1,930,000	1,980,566.00	
		BELG I A N 0318	3.750%	2020/09/28	7,610,000	7,551,403.00	
		BELG I A N 0319	2.750%	2016/03/28	2,600,000	2,584,530.00	
		BELG I A N 0320	4.250%	2041/03/28	3,630,000	3,541,428.00	
		BELG I A N 0321	4.250%	2021/09/28	4,060,000	4,116,840.00	
		BELG I A N 0323	3.500%	2017/06/28	1,750,000	1,758,925.00	
		BELG I A N 0324	4.500%	2026/03/28	1,790,000	1,841,015.00	
	国債証券 (イタリア)	BTPS	4.750%	2013/02/01	10,080,000	10,215,072.00	
		BTPS	4.250%	2013/04/15	4,760,000	4,794,272.00	

	BTPS	2.000%	2013/06/01	10,320,000	10,101,216.00	
	BTPS	4.250%	2013/08/01	10,360,000	10,420,088.00	
	BTPS	2.250%	2013/11/01	9,430,000	9,124,468.00	
	BTPS	3.750%	2013/12/15	8,210,000	8,159,508.50	
	BTPS	3.000%	2014/04/01	240,000	233,280.00	
	BTPS	3.500%	2014/06/01	12,020,000	11,760,368.00	
	BTPS	4.250%	2014/07/01	2,410,000	2,393,130.00	
	BTPS	4.250%	2014/08/01	4,170,000	4,148,316.00	
	BTPS	6.000%	2014/11/15	2,700,000	2,771,010.00	
	BTPS	4.250%	2015/02/01	12,230,000	12,035,543.00	
	BTPS	3.000%	2015/04/15	15,970,000	15,043,740.00	
	BTPS	3.000%	2015/06/15	1,880,000	1,760,808.00	
	BTPS	3.750%	2015/08/01	12,040,000	11,518,668.00	
	BTPS	3.000%	2015/11/01	4,200,000	3,900,540.00	
	BTPS	3.750%	2016/04/15	1,330,000	1,254,855.00	
	BTPS	3.750%	2016/08/01	8,430,000	7,876,992.00	
	BTPS	4.750%	2016/09/15	4,760,000	4,601,968.00	
	BTPS	4.000%	2017/02/01	9,060,000	8,444,826.00	
	BTPS	5.250%	2017/08/01	13,570,000	13,252,462.00	
	BTPS	4.500%	2018/02/01	6,360,000	5,933,880.00	
	BTPS	4.500%	2018/08/01	6,770,000	6,262,250.00	
	BTPS	4.250%	2019/02/01	1,820,000	1,647,282.00	
	BTPS	4.500%	2019/03/01	11,620,000	10,607,898.00	
	BTPS	4.250%	2019/09/01	15,790,000	14,059,416.00	
	BTPS	4.500%	2020/02/01	13,620,000	12,237,570.00	
	BTPS	4.250%	2020/03/01	6,310,000	5,574,885.00	
	BTPS	4.000%	2020/09/01	4,250,000	3,656,700.00	
	BTPS	3.750%	2021/03/01	5,240,000	4,394,264.00	
	BTPS	3.750%	2021/08/01	14,100,000	11,626,860.00	
	BTPS	4.750%	2021/09/01	9,980,000	8,892,180.00	
	BTPS	5.000%	2022/03/01	5,200,000	4,639,440.00	
	BTPS	4.750%	2023/08/01	6,830,000	5,827,356.00	
	BTPS	9.000%	2023/11/01	3,920,000	4,432,344.00	
	BTPS	5.000%	2025/03/01	8,470,000	7,148,680.00	
	BTPS	4.500%	2026/03/01	7,000,000	5,577,600.00	
	BTPS	7.250%	2026/11/01	4,000,000	4,098,000.00	
	BTPS	6.500%	2027/11/01	9,810,000	9,220,419.00	
	BTPS	5.250%	2029/11/01	9,480,000	7,764,120.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券 （イタリア）	BTPS	6.000% 2031/05/01	13,050,000	11,414,835.00
		BTPS	5.750% 2033/02/01	6,580,000	5,533,780.00
		BTPS	5.000% 2034/08/01	8,250,000	6,352,500.00
		BTPS	4.000% 2037/02/01	9,000,000	6,110,100.00
		BTPS	5.000% 2039/08/01	10,110,000	7,683,600.00
		BTPS	5.000% 2040/09/01	6,140,000	4,645,524.00
	国債証券 （ドイツ）	BUNDES OBL - 152	3.500% 2013/04/12	8,050,000	8,387,053.50
		BUNDES OBL - 153	4.000% 2013/10/11	10,750,000	11,470,250.00
		BUNDES OBL - 154	2.250% 2014/04/11	10,940,000	11,464,026.00
		BUNDES OBL - 155	2.500% 2014/10/10	4,000,000	4,245,200.00
		BUNDES OBL - 156	2.500% 2015/02/27	6,970,000	7,432,111.00
		BUNDES OBL - 157	2.250% 2015/04/10	10,150,000	10,759,507.50
		BUNDES OBL - 158	1.750% 2015/10/09	7,930,000	8,312,226.00
		BUNDES OBL - 159	2.000% 2016/02/26	6,180,000	6,550,491.00
		BUNDES OBL - 160	2.750% 2016/04/08	540,000	589,167.00
		BUNDES OBL - 161	1.250% 2016/10/14	5,620,000	5,764,153.00

	BUNDESSCHATZANW	1.500%	2013/03/15	5,640,000	5,732,496.00	
	BUNDESSCHATZANW	1.750%	2013/06/14	4,320,000	4,419,792.00	
	BUNDESSCHATZANW	0.750%	2013/09/13	1,370,000	1,384,453.50	
	BUNDESSCHATZANW	0.250%	2013/12/13	1,310,000	1,312,620.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.500%	2013/01/04	8,460,000	8,823,357.00	
	DEUTSCHLAND REP	3.750%	2013/07/04	10,450,000	11,004,581.50	
	DEUTSCHLAND REP	4.250%	2014/01/04	13,440,000	14,525,952.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.250%	2014/07/04	4,610,000	5,067,542.50	
	DEUTSCHLAND REP	3.750%	2015/01/04	11,840,000	13,037,024.00	
	DEUTSCHLAND REP	3.250%	2015/07/04	7,850,000	8,615,767.50	
	DEUTSCHLAND REP	3.500%	2016/01/04	11,440,000	12,783,628.00	
	DEUTSCHLAND REP	6.000%	2016/06/20	1,850,000	2,275,500.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.000%	2016/07/04	7,600,000	8,727,080.00	
	DEUTSCHLAND REP	3.750%	2017/01/04	7,400,000	8,478,920.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.250%	2017/07/04	7,010,000	8,269,697.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.000%	2018/01/04	6,320,000	7,420,944.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.250%	2018/07/04	9,340,000	11,172,508.00	
	DEUTSCHLAND REP	3.750%	2019/01/04	9,190,000	10,733,920.00	
	DEUTSCHLAND REP	3.500%	2019/07/04	10,400,000	11,987,040.00	
	DEUTSCHLAND REP	3.250%	2020/01/04	12,020,000	13,658,326.00	
	DEUTSCHLAND REP	3.000%	2020/07/04	6,720,000	7,507,584.00	
	DEUTSCHLAND REP	2.250%	2020/09/04	13,530,000	14,287,680.00	
	DEUTSCHLAND REP	2.500%	2021/01/04	5,000,000	5,375,500.00	
	DEUTSCHLAND REP	3.250%	2021/07/04	4,250,000	4,833,100.00	
	DEUTSCHLAND REP	2.250%	2021/09/04	1,620,000	1,697,436.00	
	DEUTSCHLAND REP	2.000%	2022/01/04	1,500,000	1,532,100.00	
	DEUTSCHLAND REP	6.250%	2024/01/04	3,930,000	5,698,500.00	
	DEUTSCHLAND REP	6.500%	2027/07/04	5,360,000	8,291,920.00	
	DEUTSCHLAND REP	5.625%	2028/01/04	2,870,000	4,119,311.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.750%	2028/07/04	7,140,000	9,411,234.00	
	DEUTSCHLAND REP	6.250%	2030/01/04	3,920,000	6,094,424.00	
	DEUTSCHLAND REP	5.500%	2031/01/04	5,330,000	7,804,719.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.750%	2034/07/04	8,380,000	11,725,296.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.000%	2037/01/04	8,200,000	10,647,700.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.250%	2039/07/04	6,240,000	8,580,000.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券 （ドイツ）	DEUTSCHLAND REP 4.750% 2040/07/04	5,770,000	8,578,836.00	
		DEUTSCHLAND REP 3.250% 2042/07/04	4,850,000	5,779,745.00	
	国債証券 （フィンランド）	FINNISH GOV'T 5.375% 2013/07/04	2,270,000	2,439,115.00	
		FINNISH GOV'T 3.125% 2014/09/15	2,530,000	2,707,353.00	
		FINNISH GOV'T 4.250% 2015/07/04	2,280,000	2,546,532.00	
		FINNISH GOV'T 1.750% 2016/04/15	2,010,000	2,080,350.00	
		FINNISH GOV'T 1.875% 2017/04/15	1,250,000	1,281,500.00	
		FINNISH GOV'T 3.875% 2017/09/15	2,450,000	2,760,415.00	
		FINNISH GOV'T 4.375% 2019/07/04	2,030,000	2,379,363.00	
		FINNISH GOV'T 3.375% 2020/04/15	2,680,000	2,956,308.00	
		FINNISH GOV'T 3.500% 2021/04/15	1,920,000	2,140,032.00	
		FINNISH GOV'T 4.000% 2025/07/04	2,410,000	2,826,448.00	
	国債証券 （フランス）	BTAN-2YR ISSUE 2.000% 2013/09/25	4,190,000	4,285,951.00	
		BTAN-5YR ISSUE 3.750% 2013/01/12	15,150,000	15,639,345.00	
		BTAN-5YR ISSUE 4.500% 2013/07/12	6,390,000	6,763,815.00	
		BTAN-5YR ISSUE 2.500% 2014/01/12	5,990,000	6,195,457.00	
		BTAN-5YR ISSUE 3.000% 2014/07/12	14,930,000	15,666,049.00	
		BTAN-5YR ISSUE 2.500% 2015/01/15	5,600,000	5,799,920.00	
		BTAN-5YR ISSUE 2.000% 2015/07/12	9,390,000	9,561,837.00	

		BTAN-5YR ISSUE	2.250%	2016/02/25	7,740,000	7,907,958.00	
		BTAN-5YR ISSUE	2.500%	2016/07/25	5,310,000	5,457,087.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2013/04/25	5,720,000	5,968,820.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2013/10/25	8,800,000	9,323,600.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2014/04/25	12,760,000	13,650,648.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2014/10/25	3,960,000	4,268,880.00	
		FRANCE O.A.T.	3.500%	2015/04/25	11,320,000	12,093,156.00	
		FRANCE O.A.T.	3.000%	2015/10/25	14,790,000	15,550,206.00	
		FRANCE O.A.T.	3.250%	2016/04/25	9,300,000	9,858,930.00	
		FRANCE O.A.T.	5.000%	2016/10/25	10,860,000	12,369,540.00	
		FRANCE O.A.T.	3.750%	2017/04/25	10,340,000	11,173,404.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250%	2017/10/25	9,550,000	10,561,345.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2018/04/25	8,780,000	9,578,102.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250%	2018/10/25	8,470,000	9,362,738.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250%	2019/04/25	11,300,000	12,459,380.00	
		FRANCE O.A.T.	3.750%	2019/10/25	16,450,000	17,576,825.00	
		FRANCE O.A.T.	8.500%	2019/10/25	4,010,000	5,619,614.00	
		FRANCE O.A.T.	3.500%	2020/04/25	9,960,000	10,408,200.00	
		FRANCE O.A.T.	2.500%	2020/10/25	11,690,000	11,305,399.00	
		FRANCE O.A.T.	3.750%	2021/04/25	12,220,000	12,921,428.00	
		FRANCE O.A.T.	3.250%	2021/10/25	1,320,000	1,343,496.00	
		FRANCE O.A.T.	8.500%	2023/04/25	4,090,000	6,102,280.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250%	2023/10/25	13,500,000	14,824,350.00	
		FRANCE O.A.T.	6.000%	2025/10/25	5,040,000	6,480,936.00	
		FRANCE O.A.T.	3.500%	2026/04/25	9,050,000	9,071,720.00	
		FRANCE O.A.T.	5.500%	2029/04/25	9,710,000	11,990,879.00	
		FRANCE O.A.T.	5.750%	2032/10/25	8,580,000	11,111,958.00	
		FRANCE O.A.T.	4.750%	2035/04/25	7,330,000	8,486,674.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2038/10/25	9,190,000	9,646,743.00	
		FRANCE O.A.T.	4.500%	2041/04/25	7,040,000	7,981,248.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2055/04/25	5,880,000	6,166,356.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2060/04/25	3,230,000	3,394,084.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券 （アイルランド）	IRISH GOVT 5.000% 2013/04/18	2,160,000	2,139,264.00	
		IRISH GOVT 4.000% 2014/01/15	4,550,000	4,373,915.00	
		IRISH GOVT 4.600% 2016/04/18	3,730,000	3,450,809.50	
		IRISH GOVT 4.500% 2018/10/18	3,550,000	2,978,450.00	
		IRISH GOVT 4.400% 2019/06/18	3,540,000	2,914,305.00	
		IRISH GOVT 5.900% 2019/10/18	2,570,000	2,298,736.50	
		IRISH GOVT 4.500% 2020/04/18	4,160,000	3,356,496.00	
		IRISH GOVT 5.000% 2020/10/18	2,600,000	2,140,060.00	
		IRISH GOVT 5.400% 2025/03/13	3,050,000	2,486,055.00	
	国債証券 （オランダ）	NETHERLANDS GOVT 1.750% 2013/01/15	5,810,000	5,905,865.00	
		NETHERLANDS GOVT 4.250% 2013/07/15	5,640,000	5,975,580.00	
		NETHERLANDS GOVT 1.000% 2014/01/15	5,690,000	5,767,953.00	
		NETHERLANDS GOVT 3.750% 2014/07/15	6,000,000	6,496,800.00	
		NETHERLANDS GOVT 2.750% 2015/01/15	5,740,000	6,108,508.00	
		NETHERLANDS GOVT 3.250% 2015/07/15	5,040,000	5,483,016.00	
		NETHERLANDS GOVT 4.000% 2016/07/15	6,170,000	6,982,589.00	
		NETHERLANDS GOVT 2.500% 2017/01/15	2,810,000	2,992,088.00	
		NETHERLANDS GOVT 4.500% 2017/07/15	6,180,000	7,236,780.00	
		NETHERLANDS GOVT 4.000% 2018/07/15	5,600,000	6,435,520.00	
		NETHERLANDS GOVT 4.000% 2019/07/15	8,030,000	9,277,059.00	
		NETHERLANDS GOVT 3.500% 2020/07/15	4,450,000	4,993,790.00	
		NETHERLANDS GOVT 3.250% 2021/07/15	4,210,000	4,641,104.00	

		NETHERLANDS GOVT	3.750%	2023/01/15	4,120,000	4,732,232.00	
		NETHERLANDS GOVT	7.500%	2023/01/15	1,120,000	1,702,400.00	
		NETHERLANDS GOVT	5.500%	2028/01/15	4,790,000	6,719,891.00	
		NETHERLANDS GOVT	4.000%	2037/01/15	4,770,000	6,118,956.00	
		NETHERLANDS GOVT	3.750%	2042/01/15	4,130,000	5,276,075.00	
	国債証券 （オーストリア）	REP OF AUSTRIA	3.800%	2013/10/20	4,570,000	4,817,694.00	
		REP OF AUSTRIA	4.300%	2014/07/15	4,030,000	4,347,564.00	
		REP OF AUSTRIA	3.400%	2014/10/20	4,310,000	4,579,375.00	
		REP OF AUSTRIA	3.500%	2015/07/15	4,930,000	5,252,915.00	
		REP OF AUSTRIA	4.000%	2016/09/15	4,360,000	4,743,244.00	
		REP OF AUSTRIA	3.200%	2017/02/20	3,170,000	3,317,088.00	
		REP OF AUSTRIA	4.300%	2017/09/15	2,530,000	2,771,109.00	
		REP OF AUSTRIA	4.650%	2018/01/15	4,580,000	5,097,998.00	
		REP OF AUSTRIA	4.350%	2019/03/15	4,670,000	5,110,848.00	
		REP OF AUSTRIA	3.900%	2020/07/15	4,410,000	4,695,327.00	
		REP OF AUSTRIA	3.500%	2021/09/15	5,490,000	5,712,345.00	
		REP OF AUSTRIA	3.650%	2022/04/20	2,300,000	2,392,690.00	
		REP OF AUSTRIA	4.850%	2026/03/15	3,350,000	3,863,220.00	
		REP OF AUSTRIA	6.250%	2027/07/15	2,730,000	3,609,879.00	
		REP OF AUSTRIA	4.150%	2037/03/15	4,580,000	5,040,290.00	
	国債証券 （スペイン）	SPANISH GOV'T	6.150%	2013/01/31	6,550,000	6,789,730.00	
		SPANISH GOV'T	2.300%	2013/04/30	9,610,000	9,571,560.00	
		SPANISH GOV'T	4.200%	2013/07/30	2,450,000	2,500,225.00	
		SPANISH GOV'T	2.500%	2013/10/31	3,990,000	3,957,681.00	
		SPANISH GOV'T	4.250%	2014/01/31	4,840,000	4,947,448.00	
		SPANISH GOV'T	3.400%	2014/04/30	2,610,000	2,623,050.00	
		SPANISH GOV'T	4.750%	2014/07/30	4,860,000	5,034,474.00	
		SPANISH GOV'T	3.300%	2014/10/31	11,170,000	11,206,861.00	
		SPANISH GOV'T	4.400%	2015/01/31	7,070,000	7,284,221.00	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券 （スペイン）	SPANISH GOV'T	3.000%	2015/04/30	5,360,000	5,289,248.00	
		SPANISH GOV'T	3.150%	2016/01/31	9,820,000	9,644,222.00	
		SPANISH GOV'T	3.250%	2016/04/30	4,310,000	4,206,991.00	
		SPANISH GOV'T	4.250%	2016/10/31	3,380,000	3,407,040.00	
		SPANISH GOV'T	3.800%	2017/01/31	4,780,000	4,713,558.00	
		SPANISH GOV'T	5.500%	2017/07/30	7,140,000	7,552,692.00	
		SPANISH GOV'T	4.100%	2018/07/30	6,420,000	6,303,156.00	
		SPANISH GOV'T	4.600%	2019/07/30	5,950,000	5,942,860.00	
		SPANISH GOV'T	4.300%	2019/10/31	4,550,000	4,433,520.00	
		SPANISH GOV'T	4.000%	2020/04/30	8,910,000	8,443,116.00	
		SPANISH GOV'T	4.850%	2020/10/31	6,810,000	6,747,348.00	
		SPANISH GOV'T	5.500%	2021/04/30	6,810,000	6,963,225.00	
		SPANISH GOV'T	5.850%	2022/01/31	760,000	777,860.00	
		SPANISH GOV'T	4.800%	2024/01/31	5,930,000	5,440,775.00	
		SPANISH GOV'T	4.650%	2025/07/30	5,950,000	5,264,560.00	
		SPANISH GOV'T	5.900%	2026/07/30	2,350,000	2,322,740.00	
		SPANISH GOV'T	6.000%	2029/01/31	7,160,000	7,042,576.00	
		SPANISH GOV'T	5.750%	2032/07/30	4,800,000	4,570,080.00	
		SPANISH GOV'T	4.200%	2037/01/31	5,890,000	4,449,895.00	
		SPANISH GOV'T	4.900%	2040/07/30	4,980,000	4,108,500.00	
		SPANISH GOV'T	4.700%	2041/07/30	4,520,000	3,635,888.00	
	ユーロ 小計				1,482,500,000	1,542,620,483.50 (150,420,923,346)	
英ポンド	国債証券	TREASURY	4.500%	2013/03/07	15,330,000	16,034,106.90	
		TREASURY	2.250%	2014/03/07	7,740,000	8,046,736.20	

	TREASURY	5.000%	2014/09/07	9,490,000	10,629,274.50	
	TREASURY	2.750%	2015/01/22	14,500,000	15,490,350.00	
	TREASURY	4.750%	2015/09/07	9,990,000	11,488,500.00	
	TREASURY	8.000%	2015/12/07	2,280,000	2,924,556.00	
	TREASURY	2.000%	2016/01/22	5,900,000	6,196,770.00	
	TREASURY	4.000%	2016/09/07	6,700,000	7,657,899.00	
	TREASURY	1.750%	2017/01/22	4,630,000	4,804,088.00	
	TREASURY	8.750%	2017/08/25	1,920,000	2,726,400.00	
	TREASURY	5.000%	2018/03/07	8,620,000	10,561,655.00	
	TREASURY	4.500%	2019/03/07	5,210,000	6,285,865.00	
	TREASURY	3.750%	2019/09/07	12,760,000	14,756,174.40	
	TREASURY	4.750%	2020/03/07	4,620,000	5,703,390.00	
	TREASURY	3.750%	2020/09/07	8,920,000	10,319,548.00	
	TREASURY	8.000%	2021/06/07	5,970,000	9,138,458.10	
	TREASURY	3.750%	2021/09/07	7,390,000	8,539,292.80	
	TREASURY	4.000%	2022/03/07	4,850,000	5,727,122.50	
	TREASURY	5.000%	2025/03/07	6,780,000	8,835,085.80	
	TREASURY	4.250%	2027/12/07	7,290,000	8,928,792.00	
	TREASURY	6.000%	2028/12/07	3,600,000	5,318,280.00	
	TREASURY	4.750%	2030/12/07	6,430,000	8,377,968.50	
	TREASURY	4.250%	2032/06/07	7,630,000	9,374,981.00	
	TREASURY	4.500%	2034/09/07	3,960,000	5,035,239.00	
	TREASURY	4.250%	2036/03/07	8,570,000	10,586,606.70	
	TREASURY	4.750%	2038/12/07	6,060,000	8,087,070.00	
	TREASURY	4.250%	2039/09/07	6,610,000	8,199,705.00	
	TREASURY	4.250%	2040/12/07	7,450,000	9,256,625.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
英ポンド	国債証券	TREASURY 4.500% 2042/12/07	5,070,000	6,588,465.00	
		TREASURY 4.250% 2046/12/07	6,860,000	8,674,058.40	
		TREASURY 4.250% 2049/12/07	7,220,000	9,216,330.00	
		TREASURY 3.750% 2052/07/22	1,110,000	1,291,263.00	
		TREASURY 4.250% 2055/12/07	6,220,000	8,050,546.00	
		TREASURY 4.000% 2060/01/22	4,540,000	5,674,092.00	
	英ポンド 小計		232,220,000	278,525,293.80 (32,843,702,644)	
スイスフラン	国債証券	SWISS (GOVT) 4.000% 2013/02/11	2,420,000	2,522,608.00	
		SWISS (GOVT) 4.250% 2014/01/06	1,910,000	2,069,867.00	
		SWISS (GOVT) 2.500% 2016/03/12	2,490,000	2,733,273.00	
		SWISS (GOVT) 4.250% 2017/06/05	2,350,000	2,849,140.00	
		SWISS (GOVT) 3.000% 2018/01/08	2,260,000	2,614,142.00	
		SWISS (GOVT) 3.000% 2019/05/12	2,160,000	2,547,936.00	
		SWISS (GOVT) 4.000% 2023/02/11	1,710,000	2,286,270.00	
		SWISS (GOVT) 4.000% 2028/04/08	2,100,000	3,038,070.00	
	スイスフラン 小計		17,400,000	20,661,306.00 (1,665,507,876)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDEN GOVT 6.750% 2014/05/05	32,150,000	36,448,455.00	
		SWEDEN GOVT 4.500% 2015/08/12	22,990,000	25,872,946.00	
		SWEDEN GOVT 3.000% 2016/07/12	18,050,000	19,623,960.00	
		SWEDEN GOVT 3.750% 2017/08/12	19,050,000	21,684,615.00	
		SWEDEN GOVT 4.250% 2019/03/12	21,000,000	25,063,500.00	
		SWEDEN GOVT 5.000% 2020/12/01	29,200,000	37,621,280.00	
		SWEDEN GOVT 3.500% 2022/06/01	21,000,000	24,815,280.00	
		SWEDEN GOVT 3.500% 2039/03/30	15,440,000	20,019,504.00	
	スウェーデンクローナ 小計		178,880,000	211,149,540.00 (2,326,867,930)	

ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOV'T	6.500%	2013/05/15	22,510,000	24,029,425.00	
		NORWEGIAN GOV'T	5.000%	2015/05/15	20,540,000	23,261,550.00	
		NORWEGIAN GOV'T	4.250%	2017/05/19	13,770,000	15,945,660.00	
		NORWEGIAN GOV'T	4.500%	2019/05/22	10,890,000	13,162,743.00	
		NORWEGIAN GOV'T	3.750%	2021/05/25	11,170,000	13,052,145.00	
	ノルウェークローネ 小計				78,880,000	89,451,523.00 (1,137,823,372)	
デンマーククローネ	国債証券	DENMARK - BULLET	5.000%	2013/11/15	32,050,000	34,906,616.50	
		DENMARK - BULLET	2.000%	2014/11/15	11,300,000	11,793,810.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2015/11/15	36,170,000	41,078,269.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2017/11/15	20,930,000	24,686,935.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2019/11/15	34,580,000	41,496,000.00	
		DENMARK - BULLET	3.000%	2021/11/15	16,200,000	18,214,470.00	
		DENMARK - BULLET	7.000%	2024/11/10	9,980,000	15,818,300.00	
	DENMARK - BULLET	4.500%	2039/11/15	39,550,000	58,593,325.00		
デンマーククローネ 小計				200,760,000	246,587,725.50 (3,235,230,958)		
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVT BOND	0.000%	2013/01/25	9,330,000	8,911,083.00	
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2013/04/25	8,480,000	8,535,968.00	
		POLAND GOVT BOND	0.000%	2013/07/25	4,560,000	4,254,252.00	
		POLAND GOVT BOND	5.000%	2013/10/24	9,650,000	9,685,705.00	
		POLAND GOVT BOND	0.000%	2014/01/25	350,000	318,115.00	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2014/04/25	12,190,000	12,418,562.50	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVT BOND	5.500%	2015/04/25	10,150,000	10,288,040.00	
		POLAND GOVT BOND	6.250%	2015/10/24	12,440,000	12,923,294.00	
		POLAND GOVT BOND	5.000%	2016/04/25	8,410,000	8,346,925.00	
		POLAND GOVT BOND	4.750%	2016/10/25	1,500,000	1,467,150.00	
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2017/10/25	10,570,000	10,484,911.50	
		POLAND GOVT BOND	5.500%	2019/10/25	9,740,000	9,669,872.00	
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2020/10/25	9,060,000	8,753,772.00	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2021/10/25	2,150,000	2,141,400.00	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2022/09/23	9,800,000	9,742,180.00	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2029/04/25	2,600,000	2,537,340.00	
		ポーランドズロチ 小計				120,980,000	120,478,570.00 (2,674,624,254)
オーストラ リアドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVT.	6.500%	2013/05/15	6,680,000	6,956,351.60	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2013/12/15	3,360,000	3,503,337.60	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.250%	2014/06/15	5,150,000	5,516,783.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.500%	2014/10/21	3,850,000	3,986,367.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.250%	2015/04/15	5,710,000	6,250,737.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.750%	2015/10/21	1,970,000	2,076,084.50	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.750%	2016/06/15	4,190,000	4,446,050.90	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.000%	2017/02/15	5,920,000	6,660,118.40	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.250%	2017/07/21	1,480,000	1,544,868.40	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2018/01/21	2,960,000	3,292,467.20	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.250%	2019/03/15	5,880,000	6,520,273.20	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.500%	2020/04/15	6,760,000	7,194,803.20	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.750%	2021/05/15	5,040,000	5,859,453.60	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.750%	2022/07/15	3,180,000	3,715,480.20	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2023/04/21	2,030,000	2,325,872.50	
	AUSTRALIAN GOVT.	4.750%	2027/04/21	1,350,000	1,454,044.50		
	オーストラリアドル 小計				65,510,000	71,303,092.80 (5,667,882,846)	
シンガポー	国債証券	SPR GOV'T	1.625%	2013/04/01	2,200,000	2,235,222.00	

米ドル		SPR GOV'T	2.250%	2013/07/01	2,360,000	2,427,732.00	
		SPR GOV'T	3.625%	2014/07/01	2,110,000	2,277,534.00	
		SPR GOV'T	1.375%	2014/10/01	700,000	718,172.00	
		SPR GOV'T	2.875%	2015/07/01	1,720,000	1,861,263.60	
		SPR GOV'T	1.125%	2016/04/01	780,000	799,913.40	
		SPR GOV'T	3.750%	2016/09/01	1,660,000	1,895,736.60	
		SPR GOV'T	2.375%	2017/04/01	710,000	771,947.50	
		SPR GOV'T	4.000%	2018/09/01	1,390,000	1,651,500.70	
		SPR GOV'T	2.500%	2019/06/01	620,000	673,468.80	
		SPR GOV'T	3.250%	2020/09/01	1,920,000	2,189,126.40	
		SPR GOV'T	2.250%	2021/06/01	1,270,000	1,345,387.20	
		SPR GOV'T	3.125%	2022/09/01	1,390,000	1,575,175.80	
		SPR GOV'T	3.000%	2024/09/01	1,150,000	1,284,308.50	
		SPR GOV'T	3.500%	2027/03/01	1,490,000	1,744,417.50	
		SPR GOV'T	2.875%	2030/09/01	1,060,000	1,166,858.60	
		シンガポールドル 小計			22,530,000	24,617,764.60 (1,469,680,546)	
マレーシア リングgit	国債証券	MALAYSIAN GOV'T	3.702%	2013/02/25	3,420,000	3,455,602.20	
		MALAYSIAN GOV'T	3.210%	2013/05/31	3,300,000	3,319,503.00	
		MALAYSIAN GOV'T	3.461%	2013/07/31	5,530,000	5,588,673.30	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
マレーシア リングgit	国債証券	MALAYSIAN GOV'T	5.094%	2014/04/30	9,680,000	10,140,768.00	
		MALAYSIAN GOV'T	3.434%	2014/08/15	2,280,000	2,303,210.40	
		MALAYSIAN GOV'T	3.741%	2015/02/27	5,790,000	5,894,914.80	
		MALAYSIAN GOV'T	3.835%	2015/08/12	5,630,000	5,755,605.30	
		MALAYSIAN GOV'T	4.262%	2016/09/15	8,060,000	8,419,556.60	
		MALAYSIAN GOV'T	3.814%	2017/02/15	4,280,000	4,385,544.80	
		MALAYSIAN GOV'T	4.240%	2018/02/07	9,470,000	9,924,844.10	
		MALAYSIAN GOV'T	3.580%	2018/09/28	2,800,000	2,830,996.00	
		MALAYSIAN GOV'T	4.378%	2019/11/29	9,560,000	10,174,612.40	
		MALAYSIAN GOV'T	4.160%	2021/07/15	4,610,000	4,818,648.60	
		MALAYSIAN GOV'T	4.392%	2026/04/15	3,680,000	3,889,134.40	
		MALAYSIAN GOV'T	3.502%	2027/05/31	1,680,000	1,592,631.60	
	MALAYSIAN GOV'T	5.248%	2028/09/15	1,910,000	2,193,883.30		
	マレーシアリングgit 小計				81,680,000	84,688,128.80 (2,071,471,630)	
国債証券 合計						376,432,909,687 (376,432,909,687)	
合計						376,432,909,687 (376,432,909,687)	

（注）有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券時価比率（注）	有価証券の合計金額 に対する比率
米ドル	181	100.0%	42.0%
カナダドル	34	100.0%	3.0%
メキシコペソ	19	100.0%	0.9%
ユーロ	235	100.0%	40.0%

英ポンド	34	100.0%	8.7%
スイスフラン	8	100.0%	0.4%
スウェーデンクローナ	8	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	5	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	8	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	16	100.0%	0.7%
オーストラリアドル	16	100.0%	1.5%
シンガポールドル	16	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	16	100.0%	0.6%
合計	596	100.0%	100.0%

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

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「中央三井世界物価連動債マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成24年 1 月17日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	10,049
コール・ローン	12,317,004
国債証券	387,697,293
派生商品評価勘定	9,979
未収利息	2,642,551
流動資産合計	402,676,876
資産合計	402,676,876
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	25,828
未払解約金	850,694
流動負債合計	876,522
負債合計	876,522
純資産の部	
元本等	
元本	386,133,277
剰余金	
剰余金	15,667,077
純資産合計	401,800,354
負債・純資産合計	402,676,876

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成24年 1 月17日現在
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。
2．デリバティブの評価基準及び評価方法	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	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 1 月17日現在
1．計算日における受益権総数	386,133,277 口
2．1 口当たり純資産額 （1 万口当たり純資産額）	1.0406 円 (10,406 円)

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

平成24年 1 月17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、為替変動リスク、金利変動リスク、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為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、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 1 月17日現在

１．貸借対照表計上額、時価及び差額

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

２．時価の算定方法

（１）国債証券

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

（２）デリバティブ取引

「（その他の注記）」の「３．デリバティブ取引関係」に記載しております。

（３）コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

３．金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

４．金銭債権の計算日後の償還予定額

金銭債権は全て１年以内に償還予定であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

平成24年 1 月17日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

平成24年 1 月17日現在

該当事項はありません。

（その他の注記）

１．元本の変動

平成24年 1 月17日現在

特定期間の期首元本額

513,778,603 円

特定期間中の追加設定元本額	1,268,342 円
特定期間中の一部解約元本額	128,913,668 円
計算日の元本額	386,133,277 円
計算日の元本額の内訳	
物価連動債組入世界債券ファンド	156,527,878 円
C M A M世界物価連動債ファンド（為替ヘッジなし）（適格機関投資家専用）	229,605,399 円

２．有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成24年 1 月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	40,420,521
合計	40,420,521

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「中央三井世界物価連動債マザーファンド」の期首から計算日までの期間（平成23年 1 月18日から平成24年 1 月17日まで）に対応するものです。

３．デリバティブ取引関係

・ヘッジ会計が適用されていないもの

通貨関連

区分	種類	平成24年 1 月17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	5,758,012	—	5,764,500	6,488
	カナダドル	678,087	—	679,770	1,683
	ユーロ	2,755,130	—	2,729,440	25,690
	英ポンド	2,237,164	—	2,238,960	1,796
	計	11,428,393	—	11,412,670	15,723
	売 建				
	ユーロ	194,972	—	194,960	12
	英ポンド	471,222	—	471,360	138
	計	666,194	—	666,320	126
合計		12,094,587	—	12,078,990	15,849

（注）時価の算定方法

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

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

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

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年 1 月17日現在
該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表（平成24年 1 月17日現在）

有価証券明細表

A．株式

該当事項はありません。

B．株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	TSY INFL IX N/B 1.875% 2013/07/15	70,000	90,596.90	
		TSY INFL IX N/B 2.000% 2014/01/15	50,000	65,208.64	
		TSY INFL IX N/B 1.250% 2014/04/15	100,000	112,738.19	
		TSY INFL IX N/B 1.625% 2015/01/15	70,000	89,949.74	
		TSY INFL IX N/B 0.500% 2015/04/15	100,000	109,883.22	
		TSY INFL IX N/B 2.000% 2016/01/15	70,000	89,687.94	
		TSY INFL IX N/B 2.500% 2016/07/15	110,000	143,363.76	
		TSY INFL IX N/B 1.625% 2018/01/15	130,000	161,013.08	
		TSY INFL IX N/B 2.125% 2019/01/15	150,000	189,044.65	
		TSY INFL IX N/B 1.375% 2020/01/15	120,000	144,008.11	
		TSY INFL IX N/B 1.125% 2021/01/15	200,000	232,775.58	
		TSY INFL IX N/B 2.375% 2025/01/15	80,000	123,570.79	
		TSY INFL IX N/B 2.000% 2026/01/15	60,000	85,069.65	
		TSY INFL IX N/B 2.375% 2027/01/15	100,000	146,845.94	
		TSY INFL IX N/B 2.500% 2029/01/15	60,000	85,377.07	
		TSY INFL IX N/B 3.875% 2029/04/15	80,000	173,840.50	
		TSY INFL IX N/B 3.375% 2032/04/15	30,000	59,728.00	
		TSY INFL IX N/B 2.125% 2040/02/15	100,000	143,531.80	
	米ドル 小計		1,680,000	2,246,233.56 (172,712,898)	
カナダドル	国債証券	CANADA-GOV'T I/L 4.250% 2021/12/01	20,000	41,762.71	
		CANADA-GOV'T I/L 4.250% 2026/12/01	10,000	22,497.32	
		CANADA-GOV'T I/L 4.000% 2031/12/01	10,000	23,316.38	
		CANADA-GOV'T I/L 3.000% 2036/12/01	20,000	38,911.15	
		CANADA-GOV'T I/L 2.000% 2041/12/01	20,000	31,670.62	
		CANADA-GOV'T I/L 1.500% 2044/12/01	10,000	13,864.09	
	カナダドル 小計		90,000	172,022.27 (13,006,603)	
ユーロ	国債証券	BTPS I/L 2.150% 2014/09/15	30,000	33,234.13	
		BTPS I/L 2.100% 2016/09/15	20,000	17,706.75	
		BTPS I/L 2.100% 2017/09/15	40,000	36,583.37	
		BTPS I/L 2.350% 2019/09/15	50,000	42,055.98	
		BTPS I/L 2.100% 2021/09/15	20,000	15,178.44	
		BTPS I/L 2.600% 2023/09/15	50,000	39,699.63	
		BTPS I/L 2.350% 2035/09/15	40,000	30,547.44	
		BTPS I/L 2.550% 2041/09/15	30,000	20,724.66	
		BUNDESOBL-I/L 2.250% 2013/04/15	30,000	34,493.45	
		DEUTSCHLAND I/L 1.500% 2016/04/15	60,000	73,821.46	
		DEUTSCHLAND I/L 1.750% 2020/04/15	40,000	49,008.25	
		FRANCE O.A.T.I/L 2.500% 2013/07/25	70,000	86,381.38	
		FRANCE O.A.T.I/L 1.600% 2015/07/25	50,000	60,785.59	
		FRANCE O.A.T.I/L 1.000% 2017/07/25	70,000	78,903.42	
		FRANCE O.A.T.I/L 1.300% 2019/07/25	20,000	21,227.66	
		FRANCE O.A.T.I/L 2.250% 2020/07/25	70,000	89,755.67	
		FRANCE O.A.T.I/L 1.100% 2022/07/25	20,000	20,249.91	
		FRANCE O.A.T.I/L 2.100% 2023/07/25	20,000	23,375.54	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券	FRANCE O.A.T.I/L 1.850% 2027/07/25	20,000	21,677.38	

		FRANCE O.A.T. I/L	3.400%	2029/07/25	30,000	46,274.29	
		FRANCE O.A.T. I/L	3.150%	2032/07/25	20,000	30,425.15	
		FRANCE O.A.T. I/L	1.800%	2040/07/25	40,000	47,223.80	
	ユーロ 小計				840,000	919,333.35 (89,644,194)	
英ポンド	国債証券	TSY I/L	2.500%	2013/08/16	20,000	56,657.80	
		TSY I/L	2.500%	2016/07/26	20,000	68,742.40	
		TSY I/L	1.250%	2017/11/22	40,000	57,164.57	
		TSY I/L	2.500%	2020/04/16	20,000	73,248.00	
		TSY I/L	1.875%	2022/11/22	40,000	59,377.92	
		TSY I/L	2.500%	2024/07/17	20,000	66,570.60	
		TSY I/L	1.250%	2027/11/22	30,000	46,491.33	
		TSY I/L	4.125%	2030/07/22	20,000	64,556.00	
		TSY I/L	1.250%	2032/11/22	60,000	87,076.25	
		TSY I/L	2.000%	2035/01/26	30,000	62,026.20	
		TSY I/L	1.125%	2037/11/22	60,000	95,432.13	
		TSY I/L	0.625%	2042/11/22	40,000	56,764.41	
		TSY I/L	0.500%	2050/03/22	40,000	56,409.96	
	TSY I/L	1.250%	2055/11/22	50,000	102,107.93		
英ポンド 小計				490,000	952,625.50 (112,333,598)		
国債証券 合計						387,697,293 (387,697,293)	
合計						387,697,293 (387,697,293)	

（注）有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券時価比率（注）	有価証券の合計金額 に対する比率
米ドル	18	100.0%	44.5%
カナダドル	6	100.0%	3.4%
ユーロ	22	100.0%	23.1%
英ポンド	14	100.0%	29.0%
合計	60	100.0%	100.0%

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

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】平成24年 2 月29日

資産総額	326,336,891 円
負債総額	1,858,719 円
純資産総額（ - ）	324,478,172 円
発行済口数	426,475,616 口
1 口当たり純資産額（ / ）	0.7608 円
1 万口当たり純資産額	7,608 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

（中央三井外国債券マザーファンド）

資産総額	424,030,832,196 円
負債総額	420,857,619 円
純資産総額（ - ）	423,609,974,577 円
発行済口数	268,979,419,217 口
1 口当たり純資産額（ / ）	1.5749 円
1 万口当たり純資産額	15,749 円

（中央三井世界物価連動債マザーファンド）

資産総額	428,911,965 円
負債総額	1,022,711 円
純資産総額（ - ）	427,889,254 円
発行済口数	377,103,502 口
1 口当たり純資産額（ / ）	1.1347 円
1 万口当たり純資産額	11,347 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。

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。

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。

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。

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。

償還金

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

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け、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

会社の意思決定機構

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

取締役及び監査役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、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發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役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。

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		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)
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	当事業年度
	(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	(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

項目	期別 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	其他有価証券 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ありま 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。	其他有価証券 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 <table> <tr> <td>建 物</td><td>38,352千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>96,447千円</td></tr> <tr> <td>計</td><td>134,799千円</td></tr> </table>	建 物	38,352千円	器具備品	96,447千円	計	134,799千円	1 有形固定資産の減価償却累計額 <table> <tr> <td>建 物</td><td>49,316千円</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>113,320千円</td></tr> <tr> <td>計</td><td>162,636千円</td></tr> </table>	建 物	49,316千円	器具備品	113,320千円	計	162,636千円
建 物	38,352千円												
器具備品	96,447千円												
計	134,799千円												
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。 <table> <tr> <td>預金</td><td>3,498,856千円</td></tr> <tr> <td>未払手数料</td><td>353,462千円</td></tr> <tr> <td>未払費用</td><td>119,557千円</td></tr> </table>	預金	3,498,856千円	未払手数料	353,462千円	未払費用	119,557千円	2 関係会社に対するものは次のとおりであります。 <table> <tr> <td>預金</td><td>3,477,508千円</td></tr> <tr> <td>未払手数料</td><td>333,570千円</td></tr> <tr> <td>未払費用</td><td>123,687千円</td></tr> </table>	預金	3,477,508千円	未払手数料	333,570千円	未払費用	123,687千円
預金	3,498,856千円												
未払手数料	353,462千円												
未払費用	119,557千円												
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。 <table> <tr> <td>支払手数料</td><td>4,065,257千円</td></tr> <tr> <td>受取利息</td><td>1,030千円</td></tr> </table>	支払手数料	4,065,257千円	受取利息	1,030千円	1 関係会社に対するものは次のとおりであります。 <table> <tr> <td>支払手数料</td><td>3,761,890千円</td></tr> <tr> <td>受取利息</td><td>6,579千円</td></tr> </table>	支払手数料	3,761,890千円	受取利息	6,579千円
支払手数料	4,065,257千円								
受取利息	1,030千円								
支払手数料	3,761,890千円								
受取利息	6,579千円								
2 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。 <table> <tr> <td>器具備品</td><td>1,136千円</td></tr> </table>	器具備品	1,136千円							
器具備品	1,136千円								

（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－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

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。

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。

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 其他有価証券	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

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。

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。

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 其他有価証券	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 其他有価証券」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．其他有価証券

（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 (自 平成21年4月1日	当事業年度 (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。 2. 退職給付債務及びその他に関する事項 <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>122,901千円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>122,901千円</td></tr> </table> (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。 3. 退職給付費用に関する事項 <table> <tr> <td>退職給付費用</td><td>52,327千円</td></tr> </table> (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。 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。	退職給付債務	122,901千円	退職給付引当金	122,901千円	退職給付費用	52,327千円	1. 採用している退職給付制度の概要 同左 2. 退職給付債務及びその他に関する事項 <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>171,115千円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>171,115千円</td></tr> </table> (1) 同左 (2) 同左 3. 退職給付費用に関する事項 <table> <tr> <td>退職給付費用</td><td>63,772千円</td></tr> </table> (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 同左	退職給付債務	171,115千円	退職給付引当金	171,115千円	退職給付費用	63,772千円
退職給付債務	122,901千円												
退職給付引当金	122,901千円												
退職給付費用	52,327千円												
退職給付債務	171,115千円												
退職給付引当金	171,115千円												
退職給付費用	63,772千円												

(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主な原因別の内訳 (繰延税金資産) <table> <tr> <td>未払事業税</td><td>15,392千円</td></tr> <tr> <td>賞与引当金損金算入限度超過額</td><td>28,726千円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金損金算入限度超過額</td><td>50,008千円</td></tr> <tr> <td>有価証券評価差額</td><td>4,321千円</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>1,025千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産 合計</td><td>99,475千円</td></tr> </table> 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との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。	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主な原因別の内訳 (繰延税金資産) <table> <tr> <td>未払事業税</td><td>17,667千円</td></tr> <tr> <td>賞与引当金損金算入限度超過額</td><td>32,484千円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金損金算入限度超過額</td><td>69,626千円</td></tr> <tr> <td>有価証券評価差額</td><td>5,832千円</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>4,558千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産 合計</td><td>130,169千円</td></tr> </table> 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳 同左	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
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																								
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																								

（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

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。

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せん。

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

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。

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・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 其他有価証券	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 其他有価証券」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）

其他有価証券

（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		第25期 平成23年 3 月31日	
	金額（千円）		金額（千円）	
(資産の部)				
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
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		第25期 平成23年 3 月31日	
	金額（千円）		金額（千円）	
（負債の部）				
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
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）				
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
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)		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）	
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
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
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）	
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
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
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
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」として計上していましたが、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

項目	期別	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 器具備品	28,053千円 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。 <table><tr><th>用途</th><th>場所</th><th>種類</th><th>金額</th></tr><tr><td>処分予定 資産</td><td>本社事務所 (東京都港区)</td><td>建物、器具備品</td><td>17,622千円</td></tr></table> (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。	用途	場所	種類	金額	処分予定 資産	本社事務所 (東京都港区)	建物、器具備品	17,622千円
用途	場所	種類	金額						
処分予定 資産	本社事務所 (東京都港区)	建物、器具備品	17,622千円						

３．株主資本等変動計算書関係

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)				
１．発行済株式に関する事項	株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末
	普通株式（株）	5,050	-	-	5,050
２．自己株式に関する事項	該当事項はありません。				
３．新株予約権等に関する事項	該当事項はありません。				
４．配当に関する事項	(1) 配当金支払額 該当事項はありません。 (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの 該当事項はありません。				

期別 項目	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)				
１．発行済株式に関する事項	株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末
	普通株式（株）	5,050	-	-	5,050
２．自己株式に関する事項	該当事項はありません。				
３．新株予約権等に関する事項	該当事項はありません。				
４．配当に関する事項	(1) 配当金支払額 該当事項はありません。 (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの 該当事項はありません。				

４．リース取引関係

第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での報告体制を敷いております。

２．金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（＊）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び（４）未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	65,000

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

（追加情報）

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

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			
其他有価証券	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
その他	千円 9,897	千円 10,000	千円 103
計	9,897	10,000	103
2. 当事業年度中に売却したその他有価証券			
区分	売却額	売却益の 合計額	売却損の 合計額
その他	千円 64,901	千円 2,918	千円 17
計	64,901	2,918	17
3. 時価評価されていない有価証券			
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
その他	千円 58,149	千円 56,200	千円 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
その他	千円 986	千円 1,000	千円 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
その他	千円 128,650	千円 67,194	千円 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。 2. 退職給付債務に関する事項（平成22年3月31日現在） <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>22,905千円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>22,905千円</td></tr> </table> （注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。 3. 退職給付費用に関する事項 （平成21年4月1日から平成22年3月31日まで） <table> <tr> <td>勤務費用</td><td>6,497千円</td></tr> <tr> <td>退職給付費用</td><td>6,497千円</td></tr> </table> （注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。	退職給付債務	22,905千円	退職給付引当金	22,905千円	勤務費用	6,497千円	退職給付費用	6,497千円	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23年3月31日現在） <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>18,693千円</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>18,693千円</td></tr> </table> （注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。 3. 退職給付費用に関する事項 （平成22年4月1日から平成23年3月31日まで） <table> <tr> <td>勤務費用</td><td>7,250千円</td></tr> <tr> <td>退職給付費用</td><td>7,250千円</td></tr> </table> （注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。	退職給付債務	18,693千円	退職給付引当金	18,693千円	勤務費用	7,250千円	退職給付費用	7,250千円
退職給付債務	22,905千円																
退職給付引当金	22,905千円																
勤務費用	6,497千円																
退職給付費用	6,497千円																
退職給付債務	18,693千円																
退職給付引当金	18,693千円																
勤務費用	7,250千円																
退職給付費用	7,250千円																

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	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	繰延税金資産
貸倒引当金繰入超過額 16,271千円	貸倒引当金繰入超過額 15,294千円
賞与引当金繰入超過額 18,883千円	賞与引当金繰入超過額 20,418千円
未払事業税 9,168千円	資産除去債務 6,650千円
その他 25,501千円	移転による除却予定資産減損 7,170千円
繰延税金資産小計 69,823千円	未払事業税 6,824千円
評価性引当額 39,576千円	その他 19,740千円
繰延税金資産合計 30,247千円	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	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。	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	<u>16,345千円</u>

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V A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

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。

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 hands 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、記載していません。	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、記載していません。

１株当たり当期純損益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

項目	第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)		
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
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）		
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
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）		
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
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）	
営業収益		
1. 委託者報酬		5,398,191
営業収益 計		5,398,191
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
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）	
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
営業外費用		
１．雑損失		85
営業外費用 計		85
経常利益		143,961
特別利益		
１．投資有価証券売却益		153
特別利益 計		153
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)				
	株式の種類	当事業 年度期首	増加	減少	当中間 会計期間末
1. 発行済株式に関する事項	普通株式(株)	5,050	-	-	5,050
2. 自己株式に関する事項	該当事項はありません。				
3. 新株予約権等に関する事項	該当事項はありません。				
4. 配当に関する事項	該当事項はありません。				

リース取引関係

第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

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成24年4月1日現在）

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

（2）販売会社

名称	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。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	「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S B I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。

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、当特定期間中に、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7月28日	臨時報告書
平成23年10月19日	有価証券報告書
平成23年10月19日	有価証券届出書の訂正届出書
平成23年10月26日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成24年3月16日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

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」に掲げられている物価連動債組入世界債券ファンドの平成23年7月20日から平成24年1月17日までの特定期間の財務諸表、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。

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企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に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財務諸表を作成し適正に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監査に基づいて、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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、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の手続が実施される。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財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、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監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、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全体としての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、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。

監査意見

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、物価連動債組入世界債券ファンドの平成24年1月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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。

利害関係

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X B R L データ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成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 公認会計士 羽 太 典 明 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 石 井 勝 也 印
業務執行社員

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な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 公認会計士 壁 谷 恵 嗣 印
業務執行社員

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。