

【表紙】

- 【提出書類】** 有価証券届出書
- 【提出先】** 関東財務局長
- 【提出日】** 平成24年3月16日
- 【発行者名】** 住信アセットマネジメント株式会社
（平成24年4月1日より、三井住友トラスト・アセットマ
ネジメント株式会社（予定））
- 【代表者の役職氏名】** 取締役社長 平田 誠一
（平成24年4月1日より、取締役社長 鈴木 郁也（予
定））
- 【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】** 投信業務部長 橋詰 廣志
（平成24年4月1日より、ファンド・レポートイング部長
橋詰 廣志（予定））
- 【電話番号】** 03-6259-3801
- 【届出の対象とした募集内国投資信託
受益証券に係るファンドの名称】** ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）
- 【届出の対象とした募集内国投資信託
受益証券の金額】** 継続募集額 上限 10兆円
- 【縦覧に供する場所】** 該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)
(以下「当ファンド」といいます。)

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託受益権(以下「受益権」といいます。)です。

1口当たりの元本は1円です。

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(以下「委託会社」といいます。)の依頼により、信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。)の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります(以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3)【発行(売出)価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額()とします。

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

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出され、日々の基準価額は、販売会社へお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします(販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」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。

(5)【申込手数料】

お申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.15%(税抜 3.0%)の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税(以下「消費税等」といいます。)をいいます。

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」(1))

販売会社によっては、スイッチング(2)による取得申込を取扱う場合があります。スイッチングによる申込手数料、その他詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。

1：「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。

2：スイッチングとは、同一販売会社において、現在保有しているファンドを売却すると同時に、当該販売会社が指定する他のファンドの取得申込を行う取引のことをいい、ファンドの売却代金がそのまま取得申込代金に充当されることをいいます。

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 及び の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（8）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

（6）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（8）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

（7）【申込期間】

平成24年4月1日から平成24年9月11日までとします。

（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、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は有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）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は有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取消すことができます。

なお、継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（8）【申込取扱場所】

申込取扱場所（以下「販売会社」といいます。）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/>

(9) 【払込期日】

申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込金額を販売会社に支払うものとします。

継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受付けた販売会社とします。（販売会社の詳細につきましては、上記「(8) 申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。）

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

申込証拠金

該当事項はありません。

日本以外の地域における発行

該当事項はありません。

振替受益権について

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。

信託金限度額

上限 1兆円

基本的性格

当ファンドは、委託会社である三井住友トラスト・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。

当ファンドの受託会社である中央三井アセット信託銀行株式会社は、平成24年4月1日に中央三井信託銀行株式会社及び住友信託銀行株式会社と合併し、権利義務の一切を住友信託銀行株式会社に承継して解散します。住友信託銀行株式会社は同日付にて三井住友信託銀行株式会社に商号変更します。

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/>) にてご確認いただけます。

< 単位型投信・追加型投信 >

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

< 投資対象地域 >

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

源泉とする旨の記載があるものをいいます。

< 投資対象資産（収益の源泉） >

- ・ 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(用語の定義について)

当ファンドが該当する属性区分に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

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

< 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。

- ・ 資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分固定型

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

当ファンドでは株式、債券、不動産投信以外の資産である投資信託証券を主要投資対象と

し、当該投資信託証券を通じて複数資産（株式、債券、不動産投信）に投資します。

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

< 決算頻度 >

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

< 投資形態 >

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

< 為替ヘッジ >

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

ファンドの特色

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行い、日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド、外国債券マザーファンド、Jリートマザーファンド（M）及び海外リートマザーファンド（以下これらを「マザーファンド」又は「親投資信託」といいます。）の各受益証券への投資を通じて、国内外の株式・債券・不動産投資信託証券（金融商品取引法第2条第1項第10号に掲げる投資信託の受益証券（振替受益権を含みます。）又は同項第11号に掲げる投資証券であって、投資者の資金を主として不動産関連資産に対する投資として運用することを目的とするものをいいます。以下同じ。）へ分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。

各マザーファンドの特色は次のとおりです。

A．日本株式マザーファンド

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

TOPIX（東証株価指数）について

TOPIX（東証株価指数）は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）が算出、公表する、東証市場第一部の全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、東証の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関する全ての権利及びTOPIXの商標に関する全ての権利は東証が有しています。東証は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。東証は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

B．日本債券マザーファンド

日本の公社債に分散投資を行い、NOMURA - BPI総合（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

NOMURA - B P I 総合について

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

C . 外国株式マザーファンド

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

MSCIコクサイ指数について

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

D . 外国債券マザーファンド

日本を除く世界主要国の国債等に分散投資を行い、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）（ ）と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について

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・マーケット・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。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・マーケット・インクに帰属します。

E . リートマザーファンド（M）

日本の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）（ ）を上回る投資成果を目標として運用を行います。

東証REIT指数について

東証REIT指数は、東証市場に上場するREIT全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。東証REIT指数は、東証の知的財産であり、これらの指数の算出、数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は東証が有しています。

東証REIT指数の算出において、電子計算機の障害又は天災地変その他やむを得ない事由が発生した場合は、その算出を延期又は中止することがあります。また、東証は、東証REIT指数がいかなる場合においても真正であることを保証するものではなく、同指数の算出において、数値に誤謬が発生しても、東証は一切その賠償の責めを負いません。

F . 海外リートマザーファンド

海外の金融商品取引所等（金融商品取引所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号口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。）などに上場等されている（上場等の前の新規募集等を含みます。）不動産投資信託証券に投資することにより、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）（ ）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

S & P先進国REIT指数について

S & P先進国REIT指数は、S & P（スタンダード・アンド・プアーズ社）が公表する指数で、世界主要国に上場するリート及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時

価総額に基づいて算出されています。

S & P 先進国 REIT 指数の所有権及びその他一切の権利は、S & P が有しています。
S & P は、同指数等の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うもの
ではありません。

（２）【ファンドの沿革】

平成19年8月31日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

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（予
定）

当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称
を日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンドの名称を日
本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株
式マザーファンド、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Jリートマザーファンドの名称をJリートマザー
ファンド（M）に変更（予定）

（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（ベス
タ・世界6資産ファンド（毎月決算型））とし、その資金をマザーファンド（日本株式マザー
ファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド、外国債券マザーファンド、Jリ
ートマザーファンド（M）及び海外リートマザーファンド）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

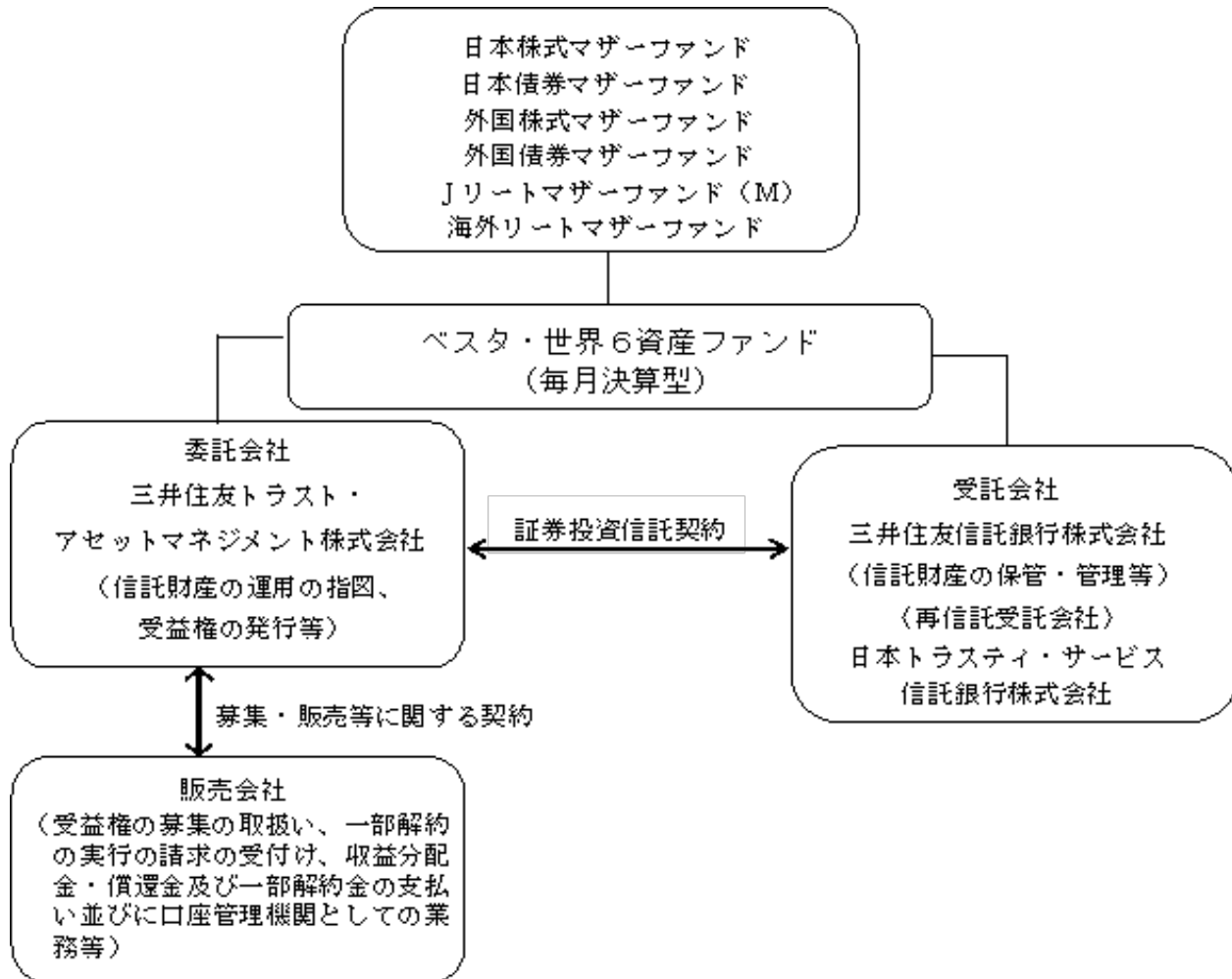
（再信託受託会社 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

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（予定））

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（予定）

C．大株主の状況（平成24年4月1日現在（予定））

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】

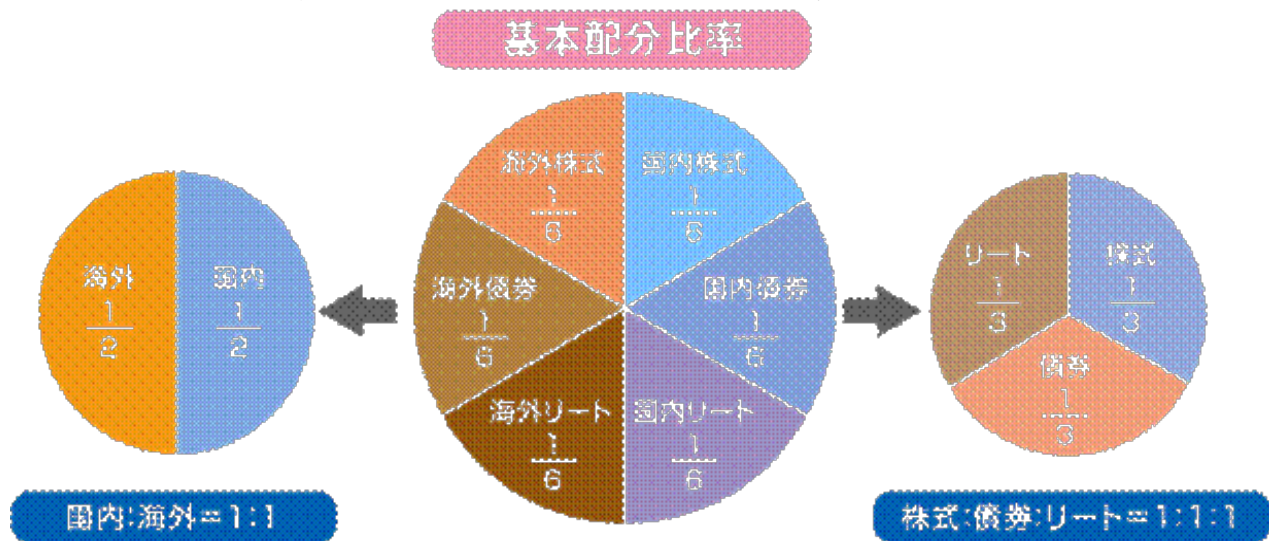
(1)【投資方針】

運用方針

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

投資態度

- A．主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の株式・債券・不動産投資信託証券（以下これらを「各資産」といいます。）へ分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。
- B．各資産への配分は、6つの資産への均等配分を基本とします。



- C．上記の基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設け、一定以上乖離した場合には、リバランスを行います。また、市況動向等の変化に応じて、当該基本配分比率の見直しを行う場合があります。
- D．実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては原則為替ヘッジを行いません。
- E．信託財産の効率的な運用に資するため、株価指数先物取引及び債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式及び債券の組入総額と株価指数先物取引及び債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- F．ただし、資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- G．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- H．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、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。
- I．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行

うことができます。

(2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 1．有価証券
- 2．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記（5）I．、J．及びK．に定めるものに限り、）
- 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「日本株式マザーファンド」、「日本債券マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「Jリートマザーファンド（M）」及び「海外リートマザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 22. 外国の者に対する権利で上記21.の有価証券の性質を有するもの
- なお、上記1.の証券又は証書並びに上記12.及び17.の証券又は証書のうち上記1.の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2.から6.までの証券並びに上記12.及び17.の証券又は証書のうち上記2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記13.の証券及び上記14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。
- 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には、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。

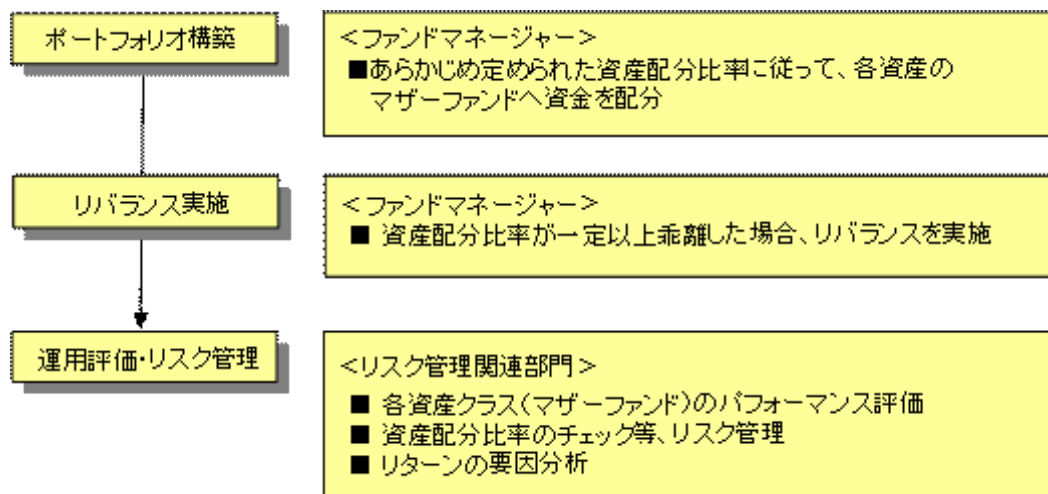
(3) 【運用体制】

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、平成24年4月1日現在（予定）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>

- 当ファンドはファンドマネージャーが基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、当該配分比率が値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。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10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．分配金額については、安定した分配を継続的に行うことを目指して、上記A．の範囲内で委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- C．収益分配に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計算期は無分配とし、第2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（「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った後、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。
- 八．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、上記八．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

当ファンドは「分配金受取りコース」専用ファンドです。

- A．支払時期と場所
 - イ．収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として計算期間終了日から起算して5営業日までの日）から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末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）に対する支払いを開始します。
 - ロ．収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

B. 時効

受益者が、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。

投資信託で分配金が支払われるイメージ

投資信託の純資産

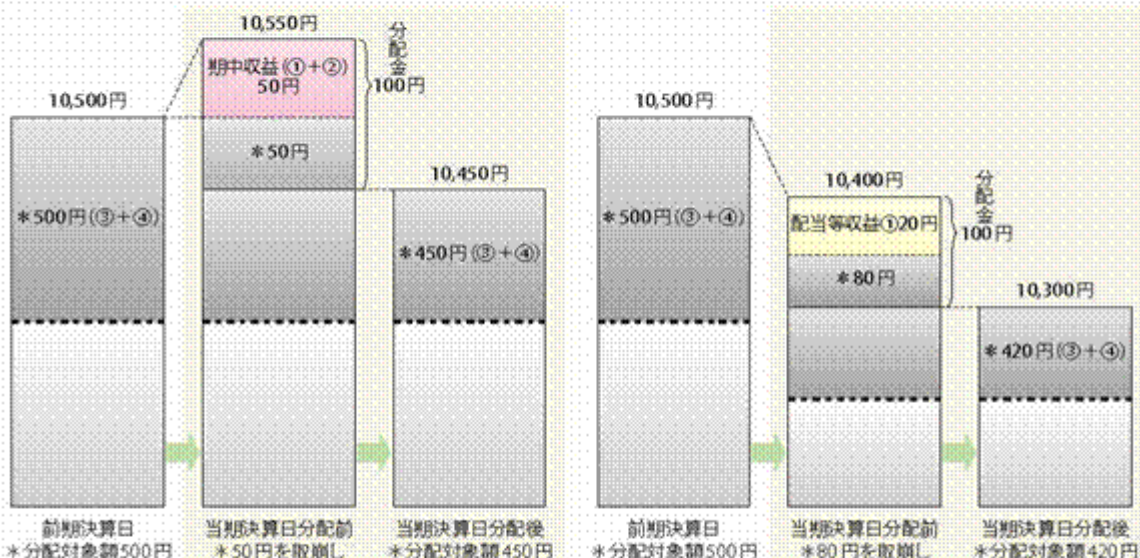
分配金

- 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）

（前期決算日から基準価額が上昇した場合）

（前期決算日から基準価額が下落した場合）



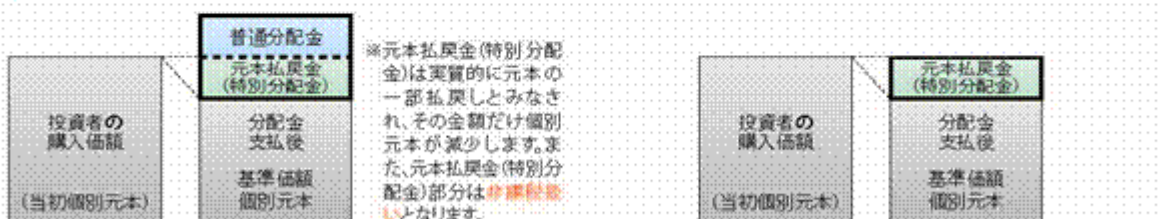
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益及び②経費控除後の評価益を含む売買益並びに③分配率備積金及び④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※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50%以下とします。

B . 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

C . 新株引受権証券等への投資割合

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

D . 同一銘柄の株式への投資制限

同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

E . 同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限

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

F . 同一銘柄の転換社債等への投資制限

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

G . 投資する株式等の範囲

イ . 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

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

H . 信用取引の運用指図

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

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

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

I . 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。
- Ｊ．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。
- Ｋ．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引及び為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 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。
- Ｌ．有価証券の貸付の指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の a．及び b．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
- a．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- b．公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ． a．及び b．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- Ｍ．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は、下記 N．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- Ｎ．公社債の借入れの指図及び範囲

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 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。
- 〇．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。
- Ｐ．外国為替予約取引の指図
イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
ロ．上記イ．の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
ハ．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。
- Ｑ．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。
- Ｒ．再投資の指図
委託会社は、上記Ｑ．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。
- Ｓ．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、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．借入金の利息は信託財産中から支弁します。
- Ｔ．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。

ウ．受託会社の自己又は利害関係人等との取引

イ．受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項において同じ。）、信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記（2）に定める資産への投資等を行うことができます。

ロ．上記イ．の取扱いは、上記H．からN．まで、及びP．からR．までにおける委託会社の指図による取引についても同様とします。

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

「日本株式マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

（1）投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

（２）投資態度

株式への投資は、原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、「ＴＯＰＩＸ」（東証株価指数、配当込み）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。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

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

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

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

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

「日本債券マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

（１）投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

（２）投資態度

わが国の公社債に投資を行い、NOMURA - B P I 総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用に際しては、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。

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

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

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

3. 投資制限

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

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

外貨建資産への投資は、行いません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

「外国株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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。

株式の組入比率は、原則として高位(90%以上)とします。

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

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

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオ

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

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

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

3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

3. 投資制限

株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権(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。)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。

「Jリートマザーファンド(M)」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

わが国の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として、わが国の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)の不動産投資信託証券に投資します。なお、不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。

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。

東証REIT指数(配当込み)を上回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。

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

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

「海外リートマザーファンド」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

海外の金融商品取引所等上場（ 1 ）の不動産投資信託証券（以下「REIT」といいます。）

（ 2 ）を主要投資対象とします。

1：上場に準ずるものを含みます。

2：社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。

(2) 投資態度

主として、REITへの投資を通じて、ベンチマークであるS & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用に際しては、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。

REITへの投資割合は、原則として高位を維持します。

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。

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

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、ベンチマークにおける時価の構成割合が30%を超えるREITがある場合には、ベンチマークとの連動性を維持するために、当該REITをベンチマークの構成割合の範囲で組入れることができるものとします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

株式への直接投資は行いません。

デリバティブの直接利用は行いません。

3【投資リスク】

(1) 当ファンドのリスク

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、投資者の皆様は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とおりです。

株価変動リスク

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

金利変動リスク

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

リートの価格変動リスク

リートの価格変動リスクとは、不動産市況（賃料相場、空室率、不動産価格）、金利変動、経済情勢の変化等によりリートの価格が変動するリスクをいいます。一般に、不動産市況が悪化（改善）した場合には、リートの価格は下落（上昇）し、基準価額の下落（上昇）要因となる可能性があります。また、金利が上昇（低下）した場合にはリートに対する投資価値の相対的な低下（上昇）や借入金返済負担の増大（減少）等からリートの価格が下落（上昇）し、基準価額の下落（上昇）要因となる可能性があります。火災・自然災害、不動産老朽化や立地環境の変化、リートに関する法制度（税制、会計制度等）や不動産に対する各種規制の変更等もリートの価格に影響を与え、基準価額の変動要因となる可能性があります。

信用リスク

信用リスクとは、有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなるリスクをいいます。一般に、このような事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

カントリーリスク

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

為替変動リスク

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

流動性リスク

流動性リスクとは、短期間に相当金額の解約申込みがあった場合等、当ファンドの保有資産を大量に売却せざるを得ない場合に、市況動向や取引量等の状況により基準価額が大きく変動するリスクをいいます。一般に、売却資産の市場における流動性が低いときには、期待する価格での取引ができないことや、取引に相応の時間を要することがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

- (2) 当ファンドはファミリーファンド方式(前記「1 ファンドの性格 (3) ファンドの仕組み ファミリーファンド方式での運用」をご参照ください。)で運用を行います。そのため、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、ファンドの基準価額に影響を与えることがあります。
- (3) 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。
- (4) 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まれます。)
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。
- (5) 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。

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、3.15%（税抜 3.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を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。

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」（

1））

販売会社によっては、スイッチング（ 2 ）による取得申込を取扱う場合があります。スイッチングによる申込手数料、その他詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。

1：「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。

2：スイッチングとは、同一販売会社において、現在保有しているファンドを売却すると同時に、当該販売会社が指定する他のファンドの取得申込を行う取引のことをいい、ファンドの売却代金がそのまま取得申込代金に充当されることをいいます。

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 及び の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、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】

当ファンドには、解約手数料はありません。また当ファンドには、信託財産留保額はありません。

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
----------	-----	-----

日本株式マザーファンド		0.2%
日本債券マザーファンド	一部解約を行う日の前営業日の信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額を受益権総口数で除した金額	0.1%
外国株式マザーファンド		0.2%
外国債券マザーファンド		0.1%
海外リートマザーファンド		0.3%
Jリートマザーファンド（M）		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資産総額から負債総額を控除した金額を、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

（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0.987%（税抜0.94%）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 0.1575%	（税抜 0.15%）
販売会社	年率 0.7875%	（税抜 0.75%）
受託会社	年率 0.042%	（税抜 0.04%）

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せん。）

上記は、平成24年1月31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「中央三井日本株式マザーファンド」は「日本株式マザーファンド」、「中央三井日本債券マザーファンド」は「日本債券マザーファンド」、「中央三井外国株式マザーファンド」は「外国株式マザーファンド」、「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Jリートマザーファンド」は「Jリートマザーファンド（M）」にファンド名称を変更します（以下同じ。）。

以下の記載事項は、平成24年1月31日現在の状況について記載してあります。

（１）【投資状況】

資産の種類		国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託 受益証券	中央三井日本株式マザーファンド	日本	190,400,263	15.94
	中央三井日本債券マザーファンド	日本	200,563,712	16.79
	中央三井外国株式マザーファンド	日本	201,573,966	16.88
	中央三井外国債券マザーファンド	日本	202,896,725	16.99
	中央三井Jリートマザーファンド	日本	189,734,625	15.89
	海外リートマザーファンド	日本	209,927,395	17.58
	親投資信託受益証券合計			1,195,096,686
その他の資産（負債控除後）			680,058	0.06
合計（純資産総額）			1,194,416,628	100.00

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

<参考>

当ファンドが主要投資対象としている親投資信託の状況は次のとおりです。

（中央三井日本株式マザーファンド）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	233,970,557,440	98.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,397,610,391	1.84
合計（純資産総額）		238,368,167,831	100.00

（中央三井日本債券マザーファンド）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
公社債	日本	355,977,053,712	97.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,286,904,659	2.01
合計（純資産総額）		363,263,958,371	100.00

（中央三井外国株式マザーファンド）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	135,154,076,978	52.93
	イギリス	25,134,942,023	9.84
	カナダ	14,229,177,166	5.57
	スイス	10,600,009,523	4.15
	フランス	9,632,070,736	3.77
	その他	48,094,762,559	18.83
	小計	242,845,038,985	95.10
投資信託受益証券	オーストラリア	64,099,132	0.03
	シンガポール	43,992,588	0.02
	香港	653,922	0.00
	小計	108,745,642	0.04
投資証券	アメリカ	3,315,987,261	1.30
	オーストラリア	687,211,181	0.27
	その他	845,757,820	0.33
	小計	4,848,956,262	1.90
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,562,579,524	2.96
合計（純資産総額）		255,365,320,413	100.00

（中央三井外国債券マザーファンド）

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

国債証券	アメリカ	157,120,089,714	39.62
	フランス	36,955,149,847	9.32
	ドイツ	36,574,650,642	9.22
	イタリア	34,202,712,579	8.63
	イギリス	33,245,808,252	8.38
	その他	84,476,261,374	21.30
	小計	382,574,672,408	96.48
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		13,954,017,652	3.52
合計（純資産総額）		396,528,690,060	100.00

（中央三井リートマザーファンド）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	14,329,009,800	96.65
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		496,660,093	3.35
合計（純資産総額）		14,825,669,893	100.00

（海外リートマザーファンド）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	681,988,815	64.22
	オーストラリア	122,250,243	11.51
	イギリス	58,350,622	5.49
	フランス	53,889,296	5.07
	シンガポール	35,843,767	3.38
	その他	81,060,807	7.63
	小計	1,033,383,550	97.31
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		28,552,840	2.69
合計（純資産総額）		1,061,936,390	100.00

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

種類	銘柄	口数	簿価（円）		評価額（円）		投資比率（％）
			単価	金額	単価	金額	
親投資信託 受益証券	中央三井日本株式 マザーファンド	278,159,625	0.6632	184,475,464	0.6845	190,400,263	15.94
	中央三井日本債券 マザーファンド	167,038,988	1.1993	200,329,859	1.2007	200,563,712	16.79
	中央三井外国株式 マザーファンド	221,218,137	0.8821	195,136,519	0.9112	201,573,966	16.88
	中央三井外国債券 マザーファンド	138,401,586	1.4307	198,011,150	1.4660	202,896,725	16.99
	中央三井Jリート マザーファンド	195,320,800	0.9610	187,703,289	0.9714	189,734,625	15.89
	海外リート マザーファンド	402,854,338	0.4916	198,043,193	0.5211	209,927,395	17.58

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

<参考>

当ファンドが主要投資対象としている親投資信託の状況

（中央三井日本株式マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄

A．主要銘柄の明細

順位	銘柄名	業種	株数	簿価（円）		評価額（円）		投資比率（％）
				単価	金額	単価	金額	
1	トヨタ自動車	輸送用機器	2,943,100	2,720.00	8,005,232,000	2,810.00	8,270,111,000	3.47

2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	16,958,100	355.00	6,020,125,500	349.00	5,918,376,900	2.48
3	本田技研工業	輸送用機器	1,914,900	2,673.00	5,118,527,700	2,666.00	5,105,123,400	2.14
4	キヤノン	電気機器	1,409,900	3,390.00	4,779,561,000	3,290.00	4,638,571,000	1.95
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,694,100	2,397.00	4,060,757,700	2,425.00	4,108,192,500	1.72
6	日本電信電話	情報・通信業	1,031,600	3,835.00	3,956,186,000	3,810.00	3,930,396,000	1.65
7	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	28,775,400	117.00	3,366,721,800	115.00	3,309,171,000	1.39
8	ファナック	電気機器	236,300	12,950.00	3,060,085,000	12,810.00	3,027,003,000	1.27
9	武田薬品工業	医薬品	890,400	3,245.00	2,889,348,000	3,310.00	2,947,224,000	1.24
10	三菱商事	卸売業	1,631,400	1,698.00	2,770,117,200	1,739.00	2,837,004,600	1.19
11	三井物産	卸売業	1,933,600	1,267.00	2,449,871,200	1,294.00	2,502,078,400	1.05
12	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	18,457	138,000.00	2,547,066,000	135,400.00	2,499,077,800	1.05
13	小松製作所	機械	1,126,200	2,093.00	2,357,136,600	2,149.00	2,420,203,800	1.02
14	日立製作所	電気機器	5,097,000	430.00	2,191,710,000	426.00	2,171,322,000	0.91
15	ソフトバンク	情報・通信業	1,014,900	2,239.00	2,272,361,100	2,123.00	2,154,632,700	0.90
16	日本たばこ産業	食料品	5,638	380,000.00	2,142,440,000	375,000.00	2,114,250,000	0.89
17	日産自動車	輸送用機器	2,867,400	717.00	2,055,925,800	719.00	2,061,660,600	0.86
18	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	937,100	2,114.00	1,981,029,400	2,146.00	2,011,016,600	0.84
19	ソニー	電気機器	1,416,000	1,422.00	2,013,552,000	1,391.00	1,969,656,000	0.83
20	東日本旅客鉄道	陸運業	394,700	4,670.00	1,843,249,000	4,935.00	1,947,844,500	0.82
21	三菱地所	不動産業	1,568,000	1,276.00	2,000,768,000	1,217.00	1,908,256,000	0.80
22	信越化学工業	化学	426,300	3,970.00	1,692,411,000	3,960.00	1,688,148,000	0.71
23	KDDI	情報・通信業	3,477	482,500.00	1,677,652,500	483,000.00	1,679,391,000	0.70
24	アステラス製薬	医薬品	527,700	3,015.00	1,591,015,500	3,130.00	1,651,701,000	0.69
25	東京海上ホールディングス	保険業	850,500	1,860.00	1,581,930,000	1,909.00	1,623,604,500	0.68
26	国際石油開発帝石	鉱業	3,092	506,000.00	1,564,552,000	520,000.00	1,607,840,000	0.67
27	パナソニック	電気機器	2,593,200	644.00	1,670,020,800	617.00	1,600,004,400	0.67
28	三菱電機	電気機器	2,270,000	771.00	1,750,170,000	684.00	1,552,680,000	0.65
29	東芝	電気機器	4,778,000	341.00	1,629,298,000	323.00	1,543,294,000	0.65

30	伊藤忠商事	卸売業	1,787,100	805.00	1,438,615,500	829.00	1,481,505,900	0.62
合計			87,103,564		82,477,436,300		82,279,340,600	34.52

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

（注2）国／地域は全て日本、種類は全て株式です。

B．種類別及び業種別の投資比率

種類	業種	投資比率（％）
----	----	---------

株式	水産・農林業	0.11
	鉱業	0.76
	建設業	2.45
	食料品	3.52
	繊維製品	0.93
	パルプ・紙	0.39
	化学	5.90
	医薬品	4.84
	石油・石炭製品	0.86
	ゴム製品	0.75
	ガラス・土石製品	1.14
	鉄鋼	1.79
	非鉄金属	1.18
	金属製品	0.68
	機械	5.19
	電気機器	13.25
	輸送用機器	9.81
	精密機器	1.36
	その他製品	1.59
	電気・ガス業	3.07
	陸運業	4.05
	海運業	0.37
	空運業	0.29
	倉庫・運輸関連業	0.24
	情報・通信業	6.28
	卸売業	5.64
	小売業	4.17
	銀行業	9.37
	証券、商品先物取引業	1.02
	保険業	2.23
	その他金融業	0.80
不動産業	2.24	
サービス業	1.88	

合計	98.16
----	-------

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

銘柄名	国/地域	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引 買建 TOPIX先物取引	日本	567	4,294,286,800	4,289,355,000	1.80

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

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

(中央三井日本債券マザーファンド)

投資有価証券の主要銘柄

A. 主要銘柄の明細

順位	銘柄名	利率 (%)	償還日	額面金額 (円)	簿価(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
1	利付国庫債券(5年)第87回	0.5	2014/12/20	4,100,000,000	100.87	4,136,039,000	100.88	4,136,326,000	1.14
2	利付国庫債券(10年)第312回	1.2	2020/12/20	3,700,000,000	102.85	3,805,524,000	103.14	3,816,328,000	1.05
3	利付国庫債券(10年)第285回	1.7	2017/3/20	3,400,000,000	106.76	3,630,146,000	106.84	3,632,832,000	1.00
4	利付国庫債券(10年)第305回	1.3	2019/12/20	3,300,000,000	104.49	3,448,170,000	104.79	3,458,103,000	0.95
5	利付国庫債券(10年)第288回	1.7	2017/9/20	3,000,000,000	107.09	3,212,790,000	107.21	3,216,390,000	0.89
6	利付国庫債券(10年)第284回	1.7	2016/12/20	2,950,000,000	106.55	3,143,284,000	106.60	3,144,700,000	0.87
7	利付国庫債券(10年)第289回	1.5	2017/12/20	2,900,000,000	106.07	3,076,149,000	106.22	3,080,496,000	0.85
8	利付国庫債券(10年)第313回	1.3	2021/3/20	2,800,000,000	103.46	2,897,076,000	103.76	2,905,448,000	0.80

9	利付国庫債券（2年）第309回	0.1	2013/10/15	2,900,000,000	99.96	2,898,985,000	99.96	2,899,014,000	0.80
10	利付国庫債券（5年）第88回	0.5	2015/3/20	2,800,000,000	100.89	2,824,920,000	100.89	2,825,172,000	0.78
11	利付国庫債券（10年）第318回	1.0	2021/9/20	2,700,000,000	100.26	2,707,128,000	100.61	2,716,686,000	0.75
12	利付国庫債券（10年）第315回	1.2	2021/6/20	2,600,000,000	102.33	2,660,658,000	102.68	2,669,732,000	0.73
13	利付国庫債券（5年）第96回	0.5	2016/3/20	2,400,000,000	100.81	2,419,632,000	100.87	2,421,024,000	0.67
14	利付国庫債券（5年）第89回	0.4	2015/6/20	2,400,000,000	100.53	2,412,936,000	100.56	2,413,656,000	0.66
15	利付国庫債券（5年）第99回	0.4	2016/9/20	2,400,000,000	100.29	2,407,128,000	100.36	2,408,736,000	0.66
16	利付国庫債券（2年）第307回	0.2	2013/8/15	2,400,000,000	100.12	2,402,952,000	100.12	2,402,928,000	0.66
17	利付国庫債券（5年）第93回	0.5	2015/12/20	2,300,000,000	100.84	2,319,504,000	100.90	2,320,723,000	0.64
18	利付国庫債券（2年）第303回	0.2	2013/4/15	2,300,000,000	100.09	2,302,231,000	100.09	2,302,185,000	0.63
19	利付国庫債券（10年）第307回	1.3	2020/3/20	2,200,000,000	104.34	2,295,524,000	104.61	2,301,442,000	0.63
20	利付国庫債券（5年）第82回	0.9	2014/3/20	2,100,000,000	101.63	2,134,356,000	101.61	2,133,999,000	0.59
21	利付国庫債券（5年）第85回	0.7	2014/9/20	2,100,000,000	101.39	2,129,337,000	101.39	2,129,379,000	0.59
22	利付国庫債券（5年）第71回	1.3	2013/3/20	2,100,000,000	101.34	2,128,329,000	101.32	2,127,783,000	0.59
23	利付国庫債券（5年）第86回	0.6	2014/9/20	2,100,000,000	101.13	2,123,734,000	101.13	2,123,877,000	0.58
24	利付国庫債券（5年）第83回	0.9	2014/6/20	2,000,000,000	101.79	2,035,820,000	101.77	2,035,500,000	0.56
25	利付国庫債券（5年）第94回	0.6	2015/12/20	2,000,000,000	101.23	2,024,680,000	101.28	2,025,700,000	0.56
26	利付国庫債券（5年）第92回	0.3	2015/9/20	2,000,000,000	100.14	2,002,880,000	100.17	2,003,580,000	0.55
27	利付国庫債券（10年）第306回	1.4	2020/3/20	1,900,000,000	105.11	1,997,090,000	105.38	2,002,220,000	0.55
28	利付国庫債券（10年）第311回	0.8	2020/9/20	2,000,000,000	99.75	1,995,140,000	100.04	2,000,800,000	0.55
29	利付国庫債券（5年）第98回	0.3	2016/6/20	2,000,000,000	99.93	1,998,680,000	99.97	1,999,560,000	0.55
30	利付国庫債券（5年）第100回	0.3	2016/9/20	2,000,000,000	99.83	1,996,780,000	99.90	1,998,160,000	0.55
合計				75,850,000,000		77,567,602,000		77,652,479,000	21.38

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

（注2）国/地域は全て日本、種類は全て国債証券です。

B. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
----	---------

国債証券	74.91
地方債証券	6.33
特殊債券	9.91
社債券	6.84
合計	97.99

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

銘柄名	国/地域	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引 買建 長期国債先物	日本	16	2,281,280,580	2,281,440,000	0.63

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

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

（中央三井外国株式マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄

A. 主要銘柄の明細

順位	国/地域	銘柄名	業種	株数	簿価(円)		評価額(円)		投資比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
1	アメリカ	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	139,900	26,698.62	3,735,138,197	34,600.90	4,840,666,441	1.90
2	アメリカ	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	733,702	6,299.82	4,622,192,294	6,529.72	4,790,873,172	1.88
3	アメリカ	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE	ソフトウェア・サービス	180,278	12,582.07	2,268,271,749	14,703.14	2,650,654,475	1.04
4	アメリカ	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1,137,791	2,099.68	2,389,004,061	2,261.61	2,573,241,551	1.01
5	アメリカ	CHEVRON CORP	エネルギー	302,242	7,417.26	2,241,808,040	7,898.45	2,387,245,077	0.93
6	アメリカ	GENERAL ELECTRIC	資本財	1,599,545	1,532.94	2,452,017,069	1,443.58	2,309,074,370	0.90

7	スイス	NESTLE SA-REGISTERD	食品・飲料・タバコ	497,935	4,314.71	2,148,446,916	4,434.75	2,208,218,237	0.86
8	アメリカ	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	413,570	4,676.74	1,934,162,422	5,018.92	2,075,678,797	0.81
9	アメリカ	AT&T INC	電気通信サービス	894,252	2,147.80	1,920,679,453	2,240.98	2,004,009,074	0.78
10	アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	414,715	4,853.18	2,012,688,700	4,827.97	2,002,235,642	0.78
11	アメリカ	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,177,272	1,470.31	1,730,960,680	1,648.28	1,940,474,363	0.76
12	イギリス	HSBC HLDGS PLC	銀行	2,692,847	820.07	2,208,344,851	633.36	1,705,566,484	0.67
13	アメリカ	GOOGLE INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	38,400	45,819.59	1,759,472,570	44,123.96	1,694,360,148	0.66
14	アメリカ	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	756,920	2,434.99	1,843,095,961	2,234.11	1,691,046,325	0.66
15	アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	588,387	3,339.33	1,964,820,478	2,826.82	1,663,266,375	0.65
16	アメリカ	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	792,365	1,653.62	1,310,276,157	2,042.40	1,618,327,226	0.63
17	アメリカ	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	311,834	4,821.86	1,503,622,822	5,152.59	1,606,754,246	0.63
18	イギリス	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	7,669,823	211.32	1,620,811,539	206.28	1,582,133,082	0.62
19	イギリス	BP PLC	エネルギー	2,858,308	560.72	1,602,730,184	550.46	1,573,386,836	0.62
20	アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	265,075	4,538.49	1,203,042,781	5,720.86	1,516,457,494	0.59
21	オーストラリア	BHP BILLITON LTD	素材	484,580	3,709.72	1,797,656,505	3,056.54	1,481,139,994	0.58
22	スイス	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	352,142	4,426.41	1,558,726,983	4,152.99	1,462,444,035	0.57
23	イギリス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	546,069	2,569.49	1,403,123,203	2,676.36	1,461,477,392	0.57
24	アメリカ	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	464,919	2,512.90	1,168,295,884	2,970.41	1,381,003,859	0.54
25	スイス	ROCHE HLDGS AG GENUSSCHINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	106,010	11,726.25	1,243,099,889	12,945.80	1,372,385,106	0.54
26	アメリカ	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	286,126	4,258.94	1,218,595,984	4,682.09	1,339,668,827	0.52
27	アメリカ	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	610,676	2,460.96	1,502,851,407	2,184.46	1,334,002,180	0.52
28	イギリス	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	765,660	1,421.62	1,088,484,307	1,713.99	1,312,340,665	0.51
29	フランス	TOTAL SA	エネルギー	320,291	4,265.80	1,366,297,507	4,000.50	1,281,326,355	0.50
30	アメリカ	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	830,013	1,632.24	1,354,780,917	1,493.22	1,239,399,481	0.49
合計						56,173,499,510		58,098,857,309	22.75

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

（注2）種類は全て株式です。

B．種類別及び業種別の投資比率

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	12.11
	素材	7.48
	資本財	7.40
	商業・専門サービス	0.80
	運輸	1.78
	自動車・自動車部品	1.32
	耐久消費財・アパレル	1.20
	消費者サービス	1.70
	メディア	2.48
	小売	2.67
	食品・生活必需品小売り	2.25
	食品・飲料・タバコ	6.58
	家庭用品・パーソナル用品	1.70
	ヘルスケア機器・サービス	2.65
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.64
	銀行	7.11
	各種金融	4.33
	保険	3.85
	不動産	0.68
	ソフトウェア・サービス	5.67
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.51
電気通信サービス	3.88	
公益事業	3.60	
半導体・半導体製造装置	1.69	
	小計	95.10
投資信託受益証券		0.04
投資証券		1.90

合計

97.04

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

取引名	国/地域	資産名	種類	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
株価指数 先物取引	アメリカ	S&P 500 FUTU	買建	166	4,048,149,318	4,148,911,953	1.62
	カナダ	S&P/TSX60 IX	買建	33	344,799,488	356,552,625	0.14
	ドイツ	SWISS MKT IX	買建	107	520,150,478	526,697,656	0.21
	ドイツ	DJ EURO STOXX	買建	357	828,563,815	863,509,565	0.34
	オーストラリア	ASX SPI 200	買建	59	500,713,966	508,047,967	0.20
	イギリス	FTSE 100 IDX	買建	158	1,048,705,488	1,067,027,269	0.42

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

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

(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	7,698.26	3,088,545,374	7,826.56	3,140,017,125	0.79
2	アメリカ	US TREASURY N/B	3.625	2021/2/15	31,230,000	7,801.63	2,436,450,274	8,895.88	2,778,184,299	0.70
3	アメリカ	US TREASURY N/B	3.000	2017/2/28	31,550,000	7,807.03	2,463,121,036	8,488.92	2,678,254,555	0.68
4	アメリカ	US TREASURY N/B	2.625	2014/7/31	32,650,000	7,925.02	2,587,519,603	8,087.92	2,640,707,818	0.67
5	アメリカ	US TREASURY N/B	0.500	2013/11/15	32,000,000	7,589.82	2,428,743,770	7,677.98	2,456,953,662	0.62
6	アメリカ	US TREASURY N/B	3.875	2040/8/15	26,910,000	6,666.44	1,793,940,726	9,006.87	2,423,749,473	0.61

7	アメリカ	US TREASURY N/B	3.500	2020/5/15	26,650,000	7,690.75	2,049,587,484	8,835.01	2,354,532,246	0.59	
8	アメリカ	US TREASURY N/B	3.625	2020/2/15	25,030,000	7,733.47	1,935,688,792	8,903.04	2,228,431,850	0.56	
9	アメリカ	US TREASURY N/B	3.375	2019/11/15	25,070,000	7,612.79	1,908,527,606	8,752.67	2,194,294,525	0.55	
10	アメリカ	US TREASURY N/B	2.625	2018/1/31	25,250,000	7,562.38	1,909,501,909	8,361.22	2,111,208,838	0.53	
11	アメリカ	US TREASURY N/B	0.625	2013/2/28	27,450,000	7,626.06	2,093,355,014	7,674.69	2,106,704,661	0.53	
12	アメリカ	US TREASURY N/B	2.375	2014/8/31	26,000,000	7,850.43	2,041,112,287	8,047.94	2,092,465,913	0.53	
13	アメリカ	US TREASURY N/B	5.125	2016/5/15	22,000,000	8,688.22	1,911,409,500	9,113.08	2,004,879,525	0.51	
14	アメリカ	US TREASURY N/B	2.125	2021/8/15	25,400,000	7,646.15	1,942,122,614	7,859.97	1,996,434,761	0.50	
15	アメリカ	US TREASURY N/B	1.375	2015/11/30	25,000,000	7,343.22	1,835,805,234	7,907.71	1,976,929,218	0.50	
16	アメリカ	US TREASURY N/B	4.500	2039/8/15	19,450,000	7,375.44	1,434,523,809	9,956.84	1,936,607,142	0.49	
17	イギリス	TREASURY	4.500	2013/3/7	15,330,000	12,738.22	1,952,770,091	12,545.15	1,923,172,068	0.49	
18	アメリカ	US TREASURY N/B	1.875	2015/6/30	23,900,000	7,668.44	1,832,757,195	8,024.07	1,917,754,419	0.48	
19	アメリカ	US TREASURY N/B	2.625	2016/2/29	22,900,000	7,753.33	1,775,513,440	8,286.03	1,897,502,372	0.48	
20	アメリカ	US TREASURY N/B	1.750	2013/4/15	24,000,000	7,777.63	1,866,631,725	7,783.00	1,867,920,646	0.47	
21	イギリス	TREASURY	2.750	2015/1/22	14,500,000	12,159.86	1,763,181,098	12,799.46	1,855,921,990	0.47	
22	フランス	FRANCE O.A.T.	3.750	2019/10/25	16,450,000	10,286.15	1,692,072,727	10,784.58	1,774,064,528	0.45	
23	イギリス	TREASURY	3.750	2019/9/7	12,760,000	11,992.59	1,530,254,688	13,844.07	1,766,503,459	0.45	
24	アメリカ	US TREASURY N/B	1.500	2016/6/30	21,960,000	7,646.05	1,679,073,832	7,939.34	1,743,479,723	0.44	
25	アメリカ	US TREASURY N/B	1.250	2015/9/30	21,980,000	7,333.67	1,611,941,421	7,865.34	1,728,803,903	0.44	
26	アメリカ	US TREASURY N/B	2.750	2013/10/31	21,600,000	7,968.58	1,721,213,752	7,980.51	1,723,791,577	0.43	
27	アメリカ	US TREASURY N/B	4.625	2017/2/15	18,500,000	8,474.36	1,567,756,785	9,101.15	1,683,713,559	0.42	
28	アメリカ	US TREASURY N/B	3.625	2019/8/15	18,400,000	7,796.72	1,434,597,802	8,882.75	1,634,426,977	0.41	
29	アメリカ	US TREASURY N/B	0.125	2013/9/30	21,000,000	7,615.02	1,599,155,529	7,628.45	1,601,975,025	0.40	
30	フランス	BTAN-5YR ISSUE	3.000	2014/7/12	14,930,000	10,406.56	1,553,700,108	10,524.31	1,571,280,632	0.40	
合計								57,440,575,225		61,810,666,489	15.59

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

(注2) 種類は全て国債証券です。

B．種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	96.48
合計	96.48

（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	109	1,026,449,832	1,032,091,910	0.26
	アメリカ	US 10YR NOTE	買建	79	789,666,838	796,679,203	0.20
	アメリカ	US LONG BOND	買建	59	647,147,575	651,740,992	0.16
	ドイツ	EURO-SCHATZ	買建	70	775,661,207	776,657,063	0.20
	ドイツ	EURO-BOBL FU	買建	64	800,778,280	807,007,052	0.20
	ドイツ	EURO-BUND FU	買建	103	1,422,785,856	1,445,650,144	0.36

（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。

（中央三井リートマザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄

A．主要銘柄の明細

順位	銘柄名	数量 (口)	簿価（円）		評価額（円）		投資 比率 (％)
			単価	金額	単価	金額	
1	日本ビルファンド投資法人	3,228	770,854	2,488,316,808	684,000	2,207,952,000	14.89
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,590	750,000	1,942,500,000	667,000	1,727,530,000	11.65
3	日本リテールファンド投資法人	8,969	108,026	968,891,023	110,500	991,074,500	6.68
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	10,476	89,241	934,888,820	83,000	869,508,000	5.86

5	森トラスト総合リート投資法人	1,208	772,582	933,279,490	656,000	792,448,000	5.35
6	アドバンス・レジデンス投資法人	5,739	156,447	897,854,879	137,500	789,112,500	5.32
7	フロンティア不動産投資法人	1,082	678,000	733,596,000	609,000	658,938,000	4.44
8	日本プライムリアルティ投資法人	3,489	200,700	700,242,300	181,900	634,649,100	4.28
9	野村不動産オフィスファンド投資法人	1,387	489,500	678,936,500	407,500	565,202,500	3.81
10	日本アコモデーションファンド投資法人	983	607,000	596,681,000	502,000	493,466,000	3.33
11	日本ロジスティクスファンド投資法人	760	694,000	527,440,000	617,000	468,920,000	3.16
12	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	885	487,701	431,615,570	487,500	431,437,500	2.91
13	オリックス不動産投資法人	1,235	395,000	487,825,000	325,000	401,375,000	2.71
14	東急リアル・エステート投資法人	826	439,000	362,614,000	381,000	314,706,000	2.12
15	森ヒルズリート投資法人	1,157	268,300	310,423,100	252,200	291,795,400	1.97
16	ジャパンエクセレント投資法人	911	382,000	348,002,000	318,500	290,153,500	1.96
17	福岡リート投資法人	550	567,000	311,850,000	505,000	277,750,000	1.87
18	ケネディクス不動産投資法人	1,194	266,900	318,678,600	224,000	267,456,000	1.80
19	プレミア投資法人	997	301,065	300,162,453	252,800	252,041,600	1.70
20	野村不動産レジデンシャル投資法人	714	388,846	277,636,408	347,000	247,758,000	1.67
21	トップリート投資法人	693	433,000	300,069,000	350,500	242,896,500	1.64
22	産業ファンド投資法人	587	410,000	240,670,000	391,500	229,810,500	1.55
23	大和証券オフィス投資法人	1,308	239,088	312,727,274	172,000	224,976,000	1.52
24	グローバル・ワン不動産投資法人	423	671,000	283,833,000	526,000	222,498,000	1.50
25	積水ハウス・S I 投資法人	728	323,728	235,674,493	301,000	219,128,000	1.48
26	阪急リート投資法人	290	378,000	109,620,000	332,500	96,425,000	0.65
27	ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	448	170,089	76,200,225	176,400	79,027,200	0.53
28	アドバンス・レジデンス投資法人	298	133,770	39,863,460	137,500	40,975,000	0.28
	合計	53,155		16,150,091,403		14,329,009,800	96.65

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

(注2) 国/地域は全て日本、種類は全て投資証券です。

B．種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	96.65
合計	96.65

（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。

（海外リートマザーファンド）

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	数量 (口)	簿価（円）		評価額（円）		投資 比率 (%)
				単価	金額	単価	金額	
1	アメリカ	SIMON PROPERTY GROUP INC	6,700	8,847.85	59,280,656	10,350.25	69,346,700	6.53
2	オーストラリア	WESTFIELD GROUP	48,124	629.64	30,301,103	699.42	33,659,215	3.17
3	アメリカ	PUBLIC STORAGE INC	3,200	9,216.01	29,491,234	10,476.28	33,524,098	3.16
4	フランス	UNIBAIL	2,075	14,164.06	29,390,435	14,772.02	30,651,962	2.89
5	アメリカ	EQUITY RESIDENTIAL	6,700	4,568.28	30,607,528	4,529.33	30,346,537	2.86
6	アメリカ	HCP INC	9,300	2,668.71	24,819,069	3,180.46	29,578,307	2.79
7	アメリカ	VENTAS INC	6,500	3,893.08	25,305,075	4,434.62	28,825,048	2.71
8	アメリカ	BOSTON PROPERTIES INC	3,400	7,657.85	26,036,719	7,832.76	26,631,414	2.51
9	アメリカ	VORNADO REALTY TRUST	4,200	6,251.70	26,257,152	6,095.88	25,602,728	2.41
10	アメリカ	PROLOGIS INC	10,400	1,959.91	20,383,072	2,413.60	25,101,523	2.36
11	アメリカ	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,200	10,106.60	22,234,523	10,302.13	22,664,695	2.13
12	アメリカ	HOST HOTELS & RESORTS INC	16,100	816.50	13,145,685	1,247.28	20,081,294	1.89
13	アメリカ	HEALTH CARE REIT INC	4,300	3,764.77	16,188,511	4,339.91	18,661,619	1.76

14	アメリカ	GENERAL GROWTH PROPERTIES	13,400	921.14	12,343,313	1,204.51	16,140,468	1.52
15	オーストラリア	STOCKLAND	54,161	236.11	12,788,354	271.81	14,721,988	1.39
16	イギリス	LAND SECURITIES GROUP PLC	17,673	854.89	15,108,619	818.27	14,461,409	1.36
17	香港	LINK REIT	51,000	268.90	13,714,155	275.80	14,065,800	1.32
18	オーストラリア	WESTFIELD RETAIL TRUST	63,854	194.73	12,434,672	205.28	13,108,217	1.23
19	アメリカ	KIMCO REALTY CORP	9,200	1,236.59	11,376,648	1,396.99	12,852,309	1.21
20	アメリカ	DIGITAL REALTY TRUST INC	2,400	4,357.47	10,457,949	5,316.04	12,758,515	1.20
21	アメリカ	MACERICH CO	3,000	3,441.68	10,325,048	4,157.36	12,472,090	1.17
22	イギリス	BRITISH LAND CO PLC	20,203	615.95	12,444,221	587.86	11,876,589	1.12
23	アメリカ	SL GRENN REALTY CORP	2,000	5,113.64	10,227,282	5,556.64	11,113,290	1.05
24	アメリカ	FED REALTY INVS TRUST	1,400	6,611.45	9,256,033	7,255.33	10,157,470	0.96
25	アメリカ	UDR INC	5,000	1,969.84	9,849,201	1,971.36	9,856,839	0.93
26	オーストラリア	GPT GROUP	38,890	252.34	9,813,712	249.09	9,687,491	0.91
27	アメリカ	ESSEX PROPERTY TRUST INC	800	10,730.62	8,584,500	10,965.87	8,772,701	0.83
28	アメリカ	REALTY INCOME CORP	3,000	2,569.42	7,708,269	2,775.64	8,326,947	0.78
29	オーストラリア	DEXUS PROPERTY GROUP	109,979	70.59	7,763,615	71.40	7,852,852	0.74
30	オーストラリア	GOODMAN GROUP	149,591	50.30	7,525,444	52.33	7,828,889	0.74
合計					535,161,797		590,729,004	55.63

(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) 種類は全て投資証券です。

B. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.31
合計	97.31

(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1月31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19年12月10日現在）	3,586,283,463	3,589,844,188	9,957	9,967
第2特定期間（平成20年6月10日現在）	3,192,838,387	3,196,433,746	8,877	8,887
第3特定期間（平成20年12月10日現在）	2,013,785,577	2,017,176,994	5,938	5,948
第4特定期間（平成21年6月10日現在）	2,100,580,982	2,103,869,774	6,387	6,397
第5特定期間（平成21年12月10日現在）	2,016,006,579	2,022,240,837	6,467	6,487
第6特定期間（平成22年6月10日現在）	1,808,286,497	1,813,977,919	6,354	6,374
第7特定期間（平成22年12月10日現在）	1,702,409,568	1,710,097,724	6,643	6,673
第8特定期間（平成23年6月10日現在）	1,531,647,646	1,538,702,069	6,514	6,544
第9特定期間（平成23年12月12日現在）	1,212,675,791	1,218,975,235	5,775	5,805
平成23年1月末日	1,691,334,130		6,736	
平成23年2月末日	1,696,699,890		6,812	
平成23年3月末日	1,663,635,286		6,737	
平成23年4月末日	1,662,744,062		6,806	
平成23年5月末日	1,606,658,371		6,680	
平成23年6月末日	1,525,585,491		6,576	
平成23年7月末日	1,464,402,058		6,397	
平成23年8月末日	1,369,896,420		6,099	
平成23年9月末日	1,289,730,640		5,836	
平成23年10月末日	1,303,472,406		6,042	
平成23年11月末日	1,211,561,558		5,715	
平成23年12月末日	1,197,576,342		5,769	

平成24年1月末日	1,194,416,628	5,864
-----------	---------------	-------

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19年8月31日至平成19年12月10日）	20円
第2特定期間（自平成19年12月11日至平成20年6月10日）	60円
第3特定期間（自平成20年6月11日至平成20年12月10日）	60円
第4特定期間（自平成20年12月11日至平成21年6月10日）	60円
第5特定期間（自平成21年6月11日至平成21年12月10日）	90円
第6特定期間（自平成21年12月11日至平成22年6月10日）	120円
第7特定期間（自平成22年6月11日至平成22年12月10日）	140円
第8特定期間（自平成22年12月11日至平成23年6月10日）	180円
第9特定期間（自平成23年6月11日至平成23年12月12日）	180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19年8月31日至平成19年12月10日）	0.2%
第2特定期間（自平成19年12月11日至平成20年6月10日）	10.2%
第3特定期間（自平成20年6月11日至平成20年12月10日）	32.4%
第4特定期間（自平成20年12月11日至平成21年6月10日）	8.6%
第5特定期間（自平成21年6月11日至平成21年12月10日）	2.7%
第6特定期間（自平成21年12月11日至平成22年6月10日）	0.1%
第7特定期間（自平成22年6月11日至平成22年12月10日）	6.8%
第8特定期間（自平成22年12月11日至平成23年6月10日）	0.8%
第9特定期間（自平成23年6月11日至平成23年12月12日）	8.6%

（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19年8月31日至平成19年12月10日)	3,613,938,221	12,188,903	3,601,749,318
第2特定期間(自平成19年12月11日至平成20年6月10日)	137,066,455	141,987,767	3,596,828,006
第3特定期間(自平成20年6月11日至平成20年12月10日)	20,837,684	226,248,338	3,391,417,352
第4特定期間(自平成20年12月11日至平成21年6月10日)	1,444,362	103,953,055	3,288,908,659
第5特定期間(自平成21年6月11日至平成21年12月10日)	7,833,268	179,383,448	3,117,358,479
第6特定期間(自平成21年12月11日至平成22年6月10日)	7,973,109	279,620,527	2,845,711,061
第7特定期間(自平成22年6月11日至平成22年12月10日)	154,462	283,146,803	2,562,718,720
第8特定期間(自平成22年12月11日至平成23年6月10日)	1,801,557	213,045,766	2,351,474,511
第9特定期間(自平成23年6月11日至平成23年12月12日)	1,457,958	253,117,712	2,099,814,757

(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

2012年1月31日 現在（基準日）

〈基準価額・純資産の推移〉



・基準価額及び基準価額（分配金再投資）は、信託報酬控除後の値です。
 ・基準価額（分配金再投資）は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして算出した値です。

〈分配の推移〉

2012年1月	30円
2011年12月	30円
2011年11月	30円
2011年10月	30円
2011年9月	30円
直近1年間累計	360円
設定来累計	940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。

〈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。
 ・2007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。

〈主な資産の状況〉

組入ファンド

ファンド名	比率
中央三井日本株式マザーファンド	15.94%
中央三井日本債券マザーファンド	16.79%
中央三井外国株式マザーファンド	54/308 16.88%
中央三井外国債券マザーファンド	16.99%

運用実績

組入上位銘柄(中央三井日本株式マザーファンド)

銘柄名	業種	比率
トヨタ自動車	輸送用機器	3.47%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.48%
本田技研工業	輸送用機器	2.14%
キヤノン	電気機器	1.95%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.72%

組入上位銘柄(中央三井日本債券マザーファンド)

銘柄名	種類	償還日	利率	比率
利付国庫債券(5年)第87回	国債証券	2014/12/20	0.500%	1.14%
利付国庫債券(10年)第312回	国債証券	2020/12/20	1.200%	1.05%
利付国庫債券(10年)第285回	国債証券	2017/03/20	1.700%	1.00%
利付国庫債券(10年)第305回	国債証券	2019/12/20	1.300%	0.95%
利付国庫債券(10年)第288回	国債証券	2017/09/20	1.700%	0.89%

組入上位銘柄(中央三井外国株式マザーファンド)

銘柄名	国	業種	比率
APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.90%
EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	エネルギー	1.88%
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.04%
MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.01%
CHEVRON CORP	アメリカ	エネルギー	0.93%

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	0.79%
US TREASURY N/B	国債証券	2021/02/15	3.625%	米ドル	0.70%
US TREASURY N/B	国債証券	2017/02/28	3.000%	米ドル	0.68%
US TREASURY N/B	国債証券	2014/07/31	2.625%	米ドル	0.67%
US TREASURY N/B	国債証券	2013/11/15	0.500%	米ドル	0.62%

組入上位銘柄(中央三井リートマザーファンド)

銘柄名	比率
日本ビルファンド投資法人	14.89%
ジャパンリアルエステイト投資法人	11.65%
日本リートールファンド投資法人	6.68%
ユナイテッド・アーバン投資法人	5.86%
森トラスト総合リート投資法人	5.35%

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、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

（2）募集取扱いの単位

販売会社が定める単位とします。

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。

（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。

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

2【換金（解約）手続等】

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

（注）一部解約の実行の請求の受付は、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は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

（2）受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとし、

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

なお、一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解

約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。

- (4) 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額(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け付けを中止することができます。

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

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

- (8) 解約に係る手数料については、徴収しません。

- (9) 当ファンドの規模及び商品性格などにに基づき、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(日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド、外国債券マザーファンド、Jリートマザーファンド(M)及び海外リートマザーファンド)

計算日の基準価額で評価します。

B. 国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

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

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

D. 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19年8月31日)から無期限とします。ただし、委託会社は、下記(5)の事項に該当することとなった場合は、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11日から翌月10日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成19年8月31日から平成19年10月10日までとし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

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

(5)【その他】

信託の終了

この信託契約を解約し信託を終了させる場合は下記のとおりです。

A. 委託会社の所定の手続きを経て信託を終了させる場合

イ. 受益権の口数が10億口を下回った場合

委託会社は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合は、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。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。
- 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。

反対者の買取請求権

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

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

信託財産の管理

A．信託業務の委託等

イ．受託会社は、委託会社と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準の全てに適合するもの（受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下八．及びにおいて同じ。）を含みません。）を委託先として選定します。

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

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

ハ．上記イ．及びロ．にかかわらず、受託会社は、次のa．からd．までに掲げる業務（裁量性のないものに限ります。）を、受託会社及び委託会社が適当と認める者（受託会社の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

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

B．混蔵寄託

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

当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

C．信託財産の登記等及び記載等の留保等

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

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

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

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できます。

運用報告書

委託会社は、毎年6月及び12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。
信託事務処理の再委託

A．受託会社は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託会社の利害関係人を含みます。）と信託契約を締結し、これを再委託することができます。

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

C．受託会社は、当ファンドに係る信託事務の処理の一部について、受託会社の利害関係人である日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することができます。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、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末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。

収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

（２）償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が、信託終了による償還金については、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われます。

一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

（４）投資信託約款等重要事項変更時の反対者の買取請求権

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

（５）受益権均等分割

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

（６）帳簿閲覧権

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

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9特定期間（平成23年6月11日から平成23年12月12日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8特定期間 (平成23年6月10日現在)	第9特定期間 (平成23年12月12日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,540,041,940	1,220,030,878
未収入金	8,536,359	1,422,529
流動資産合計	1,548,578,299	1,221,453,407
資産合計	1,548,578,299	1,221,453,407
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	7,054,423	6,299,444
未払解約金	8,536,359	1,422,529
未払受託者報酬	56,714	44,683
未払委託者報酬	1,276,079	1,005,385
その他未払費用	7,078	5,575
流動負債合計	16,930,653	8,777,616
負債合計	16,930,653	8,777,616
純資産の部		
元本等		
元本	2,351,474,511	2,099,814,757
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	819,826,865	887,138,966
純資産合計	1,531,647,646	1,212,675,791
負債純資産合計	1,548,578,299	1,221,453,407

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第 8 特定期間 自 平成22年12月11日 至 平成23年 6 月10日	第 9 特定期間 自 平成23年 6 月11日 至 平成23年12月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	23,444,582	120,189,862
営業収益合計	23,444,582	120,189,862
営業費用		
受託者報酬	348,862	287,962
委託者報酬	7,849,225	6,479,187
その他費用	43,547	35,937
営業費用合計	8,241,634	6,803,086
営業利益又は営業損失（ ）	15,202,948	126,992,948
経常利益又は経常損失（ ）	15,202,948	126,992,948
当期純利益又は当期純損失（ ）	15,202,948	126,992,948
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（ ）	60,501	188,185
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	860,309,152	819,826,865
剰余金増加額又は欠損金減少額	70,123,064	99,770,481
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	70,123,064	99,770,481
剰余金減少額又は欠損金増加額	584,117	522,811
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	584,117	522,811
分配金	44,320,109	39,755,008
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	819,826,865	887,138,966

(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9特定期間（自平成23年6月11日 至平成23年12月12日） 第9特定期間は当特定期間末日が休業日のため、平成23年6月11日から平成23年12月12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8特定期間 （平成23年6月10日現在）	第9特定期間 （平成23年12月12日現在）
1. 当該特定期間の末日における受益権総数	2,351,474,511 口	2,099,814,757 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 819,826,865 円	元本の欠損 887,138,966 円
3. 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.6514 円 （6,514 円）	0.5775 円 （5,775 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8特定期間 自平成22年12月11日 至平成23年6月10日	第9特定期間 自平成23年6月11日 至平成23年12月12日
		第40期 自平成22年12月11日 至平成23年1月11日	第46期 自平成23年6月11日 至平成23年7月11日
費用控除後の配当等収益額	A	4,436,927 円 (4,650,783 円)	4,121,092 円 (4,308,335 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	41,031,831 円	37,367,236 円
分配準備積立金額	D	98,821,091 円	67,718,493 円

当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	144,289,849 円	109,206,821 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,535,263,296 口	2,304,913,193 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	569.13 円	473.80 円
10,000口当たり分配金額	H	30 円	30 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	7,605,789 円	6,914,739 円
		第 41 期 自 平成23年 1月12日 至 平成23年 2月10日	第 47 期 自 平成23年 7月12日 至 平成23年 8月10日
費用控除後の配当等収益額	A	3,025,224 円 (3,194,575 円)	1,260,756 円 (2,454,710 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	40,640,891 円	37,057,659 円
分配準備積立金額	D	94,608,971 円	64,290,707 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	138,275,086 円	102,609,122 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,508,652,884 口	2,283,619,414 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	551.19 円	449.32 円
10,000口当たり分配金額	H	30 円	30 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	7,525,958 円	6,850,858 円

		第 42 期 自 平成23年 2月11日 至 平成23年 3月10日	第 48 期 自 平成23年 8月11日 至 平成23年 9月12日
費用控除後の配当等収益額	A	2,927,381 円 (3,655,279 円)	2,349,330 円 (3,567,779 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	40,188,034 円	36,235,625 円
分配準備積立金額	D	89,101,893 円	57,387,597 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	132,217,308 円	95,972,552 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,480,636,469 口	2,232,696,815 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	532.99 円	429.85 円
10,000口当たり分配金額	H	30 円	30 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	7,441,909 円	6,698,090 円
		第 43 期 自 平成23年 3月11日 至 平成23年 4月11日	第 49 期 自 平成23年 9月13日 至 平成23年10月11日
費用控除後の配当等収益額	A	5,488,064 円 (6,913,028 円)	4,126,358 円 (5,143,127 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	39,853,275 円	35,649,937 円
分配準備積立金額	D	83,849,655 円	52,177,965 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	129,190,994 円	91,954,260 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,459,298,278 口	2,196,514,554 口

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	525.31 円	418.63 円
10,000口当たり分配金額	H	30 円	30 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	7,377,894 円	6,589,543 円
		第 44 期 自 平成23年 4月12日 至 平成23年 5月10日	第 50 期 自 平成23年10月12日 至 平成23年11月10日
費用控除後の配当等収益額	A	1,857,919 円 (3,154,688 円)	1,887,057 円 (2,120,908 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	39,523,231 円	34,637,123 円
分配準備積立金額	D	81,237,143 円	48,302,382 円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	122,618,293 円	84,826,562 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,438,045,372 口	2,134,111,407 口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	502.93 円	397.47 円
10,000口当たり分配金額	H	30 円	30 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	7,314,136 円	6,402,334 円

		第 45 期 自 平成23年 5月11日 至 平成23年 6月10日	第 51 期 自 平成23年11月11日 至 平成23年12月12日
費用控除後の配当等収益額	A	3,052,078 円 (4,391,949 円)	1,595,704 円 (2,651,347 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	38,121,609 円	34,080,496 円
分配準備積立金額	D	73,089,238 円	43,083,435 円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	114,262,925 円	78,759,635 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,351,474,511 口	2,099,814,757 口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	485.92 円	375.07 円
10,000口当たり分配金額	H	30 円	30 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	7,054,423 円	6,299,444 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 8 特定期間 自 平成22年12月11日 至 平成23年 6月10日	第 9 特定期間 自 平成23年 6月11日 至 平成23年12月12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8 特定期間 自 平成22年12月11日 至 平成23年 6月10日	第9 特定期間 自 平成23年 6月11日 至 平成23年12月12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8 特定期間 (平成23年 6月10日現在)	第9 特定期間 (平成23年12月12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	<p>(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。</p> <p>(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。</p>	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>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。</p>	<p>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。</p>
4. 金銭債権の特定期間末日後の償還予定額	<p>金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。</p>	<p>金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。</p>

(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8特定期間 自 平成22年12月11日 至 平成23年6月10日	第9特定期間 自 平成23年6月11日 至 平成23年12月12日
期首元本額	2,562,718,720 円	2,351,474,511 円
期中追加設定元本額	1,801,557 円	1,457,958 円
期中一部解約元本額	213,045,766 円	253,117,712 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第8特定期間 (平成23年6月10日現在)	第9特定期間 (平成23年12月12日現在)
	最終の計算期間(自 平成23年5月11日 至 平成23年6月10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11月11日 至 平成23年12月12日)の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	23,547,831	507,417

合計	23,547,831	507,417
----	------------	---------

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 受益証券	中央三井日本株式マザーファンド	290,837,243	196,547,808	
	中央三井日本債券マザーファンド	174,143,676	208,258,422	
	中央三井外国株式マザーファンド	230,785,884	204,268,585	
	中央三井外国債券マザーファンド	144,250,151	211,413,021	
	中央三井Jリートマザーファンド	204,269,677	194,240,035	
	海外リートマザーファンド	419,928,427	205,303,007	
合計		1,464,215,058	1,220,030,878	

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 >

「ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）」は、「中央三井日本株式マザーファンド」、「中央三井日本債券マザーファンド」、「中央三井外国株式マザーファンド」、「中央三井外国債券マザーファンド」、「中央三井Jリートマザーファンド」及び「海外リートマザーファンド」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23年12月12日現在（以下、「計算日」といいます。）の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

「中央三井日本株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成23年12月12日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,276,630,641
株式	227,745,481,044
未収配当金	71,738,800
未収利息	16,566
前払金	90,289,000
流動資産合計	236,184,156,051
資産合計	236,184,156,051
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,079,000
未払金	4,725
未払解約金	111,543,411
流動負債合計	123,627,136
負債合計	123,627,136
純資産の部	
元本等	
元本	349,310,796,680
剰余金	
欠損金	113,250,267,765
純資産合計	236,060,528,915
負債・純資産合計	236,184,156,051

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成23年12月12日現在
--	---------------

1．有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2．デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3．収益及び費用の計上基準	<p>（1）受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。</p> <p>（2）派生商品取引等損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

平成23年12月12日現在	
1．担保に供している資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。</p> <p style="text-align: right;">株式 2,025,300,000 円</p> <p>なお、上記の金額には、約定未受渡株式を含んでおりません。</p>
2．計算日における受益権総数	349,310,796,680 口
3．「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第55条の6第10号に規定する額	<p>元本の欠損</p> <p>113,250,267,765 円</p>
4．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	<p>0.6758 円</p> <p>（ 6,758 円）</p>

（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23年12月12日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

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

3. 金融商品に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23年12月12日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

(1) 株式

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

(2) デリバティブ取引

「（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23年12月12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23年12月12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23年12月12日現在	
特定期間の期首元本額	327,432,073,619 円
特定期間中の追加設定元本額	41,519,359,142 円
特定期間中の一部解約元本額	19,640,636,081 円
計算日の元本額	349,310,796,680 円
計算日の元本額の内訳	
中央三井日本株式インデックスファンド	2,507,704,061 円
中央三井DC日本株式インデックスファンド	357,151,178 円
中央三井DC日本株式インデックスファンドL	45,400,721,923 円
中央三井DC日本株式インデックスファンドA	1,616,229,373 円
中央三井DCバランスファンド30	459,979,134 円
中央三井DCバランスファンド50	1,029,747,235 円
中央三井DCバランスファンド70	540,291,090 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	290,837,243 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	185,700,745 円
新生・4分散ファンド	231,027,076 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	908,029,294 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	115,455,401 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	219,297,009 円
日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)	104,194,282 円
CMAM日本株式インデックスe	823,634,163 円
中央三井インデックスコレクション(国内株式)	2,992,158,048 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式30)	486,313,556 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式50)	1,002,782,041 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式70)	797,900,837 円
中央三井日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	33,411,383,115 円
中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)	6,979,375,456 円
中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)	53,251,480,423 円
中央三井VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	42,253,745,537 円
中央三井VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	6,552,268,344 円
中央三井VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	1,015,373,789 円
中央三井VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	8,345,664,224 円
中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)	6,917,438,712 円
中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,783,454,203 円
中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)	40,910,380,327 円
中央三井バランスVA75(適格機関投資家専用)	2,713,687,756 円

中央三井VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	21,279,017,884 円
中央三井VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	8,441,718,430 円
中央三井VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	295,785,169 円
中央三井バランスVA40（適格機関投資家専用）	3,664,094,524 円
中央三井VAバランス株式40（適格機関投資家専用）	2,806,133,630 円
CMAM・バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	8,572,220,621 円
中央三井VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	462,142,546 円
CMAM私募日本株式インデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,218,932,484 円
CMAM・VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	357,892,002 円
中央三井バランスVA20（適格機関投資家専用）	1,852,621,306 円
中央三井VAファンド25（適格機関投資家専用）	3,840,062,461 円
CMAM・バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	3,327,567,567 円
中央三井バランスVA20L（適格機関投資家専用）	143,985,671 円
中央三井バランスVA25L（適格機関投資家専用）	2,224,692,935 円
CMAM・バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	24,027,010,387 円
中央三井世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	667,086,459 円
中央三井国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	252,325,896 円
中央三井国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	82,225,705 円
CMAM・VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	572,231,570 円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	14,327,138 円
中央三井世界バランスVA20（適格機関投資家専用）	5,316,720 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成23年12月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	47,357,070,988
合計	47,357,070,988

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「中央三井日本株式マザーファンド」の期首から計算日までの期間（平成23年1月25日から平成23年12月12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

株式関連

区分	種類	平成23年12月12日現在			
		契約額等（円）		時価 （円）	評価損益 （円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	8,231,554,000		8,219,475,000	12,079,000
	合計	8,231,554,000		8,219,475,000	12,079,000

（注）1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

ヘッジ会計が適用されているもの

平成23年12月12日現在

該当事項はありません。

[次△](#)

(3) 附属明細表（平成23年12月12日現在）

有価証券明細表

A . 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
極洋	100,000	179	17,900,000	
日本水産	289,000	256	73,984,000	
マルハニチロホールディングス	496,000	138	68,448,000	
サカタのタネ	37,100	1,094	40,587,400	
ホクト	25,600	1,715	43,904,000	
住石ホールディングス	79,900	72	5,752,800	
日鉄鉱業	65,000	310	20,150,000	
三井松島産業	167,000	146	24,382,000	
国際石油開発帝石	3,049	502,000	1,530,598,000	
日本海洋掘削	6,400	2,393	15,315,200	
関東天然瓦斯開発	26,000	399	10,374,000	
石油資源開発	35,800	3,220	115,276,000	
ショーボンドホールディングス	23,400	1,698	39,733,200	
ミライト・ホールディングス	74,400	602	44,788,800	
ダイセキ環境ソリューション	22	165,100	3,632,200	
間組	123,000	206	25,338,000	
東急建設	113,900	197	22,438,300	
コムシスホールディングス	121,800	822	100,119,600	
ミサワホーム	33,700	529	17,827,300	
高松コンストラクショングループ	23,000	1,254	28,842,000	
東建コーポレーション	9,770	2,561	25,020,970	
ヤマウラ	15,500	212	3,286,000	
大成建設	1,268,000	203	257,404,000	
大林組	752,000	343	257,936,000	
清水建設	767,000	324	248,508,000	
長谷工コーポレーション	1,568,000	54	84,672,000	
松井建設	43,000	314	13,502,000	
鹿島建設	1,176,000	240	282,240,000	
鉄建建設	164,000	93	15,252,000	
太平工業	48,000	422	20,256,000	
前田建設工業	172,000	280	48,160,000	
ナカノフドー建設	47,500	162	7,695,000	
奥村組	238,000	312	74,256,000	
大和小田急建設	35,500	202	7,171,000	
東鉄工業	36,000	610	21,960,000	
戸田建設	269,000	279	75,051,000	
青木あすなろ建設	21,500	406	8,729,000	
北野建設	82,000	174	14,268,000	
植木組	43,000	168	7,224,000	
三井ホーム	44,000	387	17,028,000	
矢作建設工業	33,800	377	12,742,600	
ピーエス三菱	24,600	234	5,756,400	
大東建託	95,300	6,580	627,074,000	
新日本建設	35,400	200	7,080,000	
N I P P O	60,000	669	40,140,000	
東亜道路工業	61,000	152	9,272,000	
前田道路	75,000	756	56,700,000	
日本道路	85,000	202	17,170,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
東亜建設工業	233,000	134	31,222,000	
五洋建設	318,000	239	76,002,000	
大林道路	40,000	183	7,320,000	
住友林業	172,600	656	113,225,600	
日本基礎技術	36,200	249	9,013,800	
日成ビルド工業	107,000	207	22,149,000	
バコーボレーション	38,500	276	10,626,000	
パナホーム	96,000	551	52,896,000	
大和ハウス工業	625,000	931	581,875,000	
ライト工業	57,500	407	23,402,500	
積水ハウス	706,000	699	493,494,000	
日特建設	81,000	114	9,234,000	
北陸電気工事	22,000	216	4,752,000	
ユアテック	39,000	367	14,313,000	
西部電気工業	27,000	345	9,315,000	
四電工	27,000	314	8,478,000	
中電工	38,400	837	32,140,800	
関電工	120,000	372	44,640,000	
きんでん	166,000	638	105,908,000	
東京エネシス	26,000	448	11,648,000	
トーエネック	41,000	374	15,334,000	
住友電設	21,800	430	9,374,000	
日本電設工業	48,000	710	34,080,000	
協和エクシオ	84,500	751	63,459,500	
新日本空調	24,100	418	10,073,800	
日本電話施設	49,000	254	12,446,000	
九電工	50,000	495	24,750,000	
三機工業	62,000	391	24,242,000	
日揮	234,000	1,906	446,004,000	
中外炉工業	81,000	273	22,113,000	
ヤマト	29,000	308	8,932,000	
太平電業	33,000	593	19,569,000	
高砂熱学工業	74,500	645	48,052,500	
三晃金属工業	36,000	248	8,928,000	
朝日工業社	32,000	332	10,624,000	
大気社	39,400	1,667	65,679,800	
ダイダン	38,000	520	19,760,000	
日比谷総合設備	33,100	791	26,182,100	
東芝プラントシステム	41,000	809	33,169,000	
東洋エンジニアリング	134,000	285	38,190,000	
千代田化工建設	199,000	877	174,523,000	
新興ブランテック	51,500	685	35,277,500	
日本製粉	158,000	336	53,088,000	
日清製粉グループ本社	227,500	940	213,850,000	
日東富士製粉	20,000	300	6,000,000	
昭和産業	104,000	241	25,064,000	
鳥越製粉	21,900	698	15,286,200	
協同飼料	88,000	95	8,360,000	
中部飼料	22,400	478	10,707,200	
日本配合飼料	78,000	114	8,892,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
東洋精糖	40,000	99	3,960,000	

日本甜菜製糖	139,000	154	21,406,000	
三井製糖	89,000	288	25,632,000	
森永製菓	246,000	181	44,526,000	
中村屋	59,000	403	23,777,000	
江崎グリコ	91,000	875	79,625,000	
名糖産業	11,200	993	11,121,600	
不二家	144,000	169	24,336,000	
山崎製パン	184,000	1,032	189,888,000	
モロゾフ	39,000	274	10,686,000	
カルビー	13,500	3,735	50,422,500	
森永乳業	212,000	295	62,540,000	
ヤクルト本社	134,500	2,364	317,958,000	
明治ホールディングス	74,300	3,150	234,045,000	
雪印メグミルク	54,100	1,518	82,123,800	
プリマハム	142,000	130	18,460,000	
日本ハム	191,000	964	184,124,000	
伊藤ハム	138,000	307	42,366,000	
丸大食品	120,000	274	32,880,000	
米久	22,200	704	15,628,800	
S Foods	16,000	631	10,096,000	
サッポロホールディングス	411,000	304	124,944,000	
アサヒグループホールディングス	470,600	1,700	800,020,000	
キリンホールディングス	1,006,000	950	955,700,000	
宝ホールディングス	212,000	488	103,456,000	
オエノンホールディングス	65,000	193	12,545,000	
養命酒製造	19,000	723	13,737,000	
三国コカ・コーラボトリング	26,300	693	18,225,900	
コカ・コーラウエスト	85,000	1,364	115,940,000	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	28,300	1,015	28,724,500	
ダイドードリンコ	11,600	3,055	35,438,000	
伊藤園	76,100	1,319	100,375,900	
キーコーヒー	22,000	1,390	30,580,000	
ユニカフェ	6,200	341	2,114,200	
ジャパンフーズ	3,400	772	2,624,800	
日清オイリオグループ	97,000	329	31,913,000	
不二製油	60,900	1,116	67,964,400	
J - オイルミルズ	94,000	220	20,680,000	
キッコーマン	205,000	870	178,350,000	
味の素	661,000	937	619,357,000	
キューピー	127,600	1,081	137,935,600	
ハウス食品	89,100	1,462	130,264,200	
カゴメ	96,900	1,514	146,706,600	
焼津水産化学工業	11,900	714	8,496,600	
アリアケジャパン	22,900	1,431	32,769,900	
ニチレイ	281,000	372	104,532,000	
東洋水産	108,000	1,923	207,684,000	
日清食品ホールディングス	98,000	3,010	294,980,000	
永谷園	24,000	869	20,856,000	
フジッコ	27,000	951	25,677,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ロック・フィールド	12,200	1,273	15,530,600	
日本たばこ産業	5,561	371,500	2,065,911,500	
わらべや日洋	14,000	968	13,552,000	
なとり	11,700	826	9,664,200	

ミヨシ油脂	80,000	108	8,640,000	
片倉工業	29,500	704	20,768,000	
グンゼ	175,000	226	39,550,000	
東洋紡績	990,000	107	105,930,000	
ユニチカ	520,000	44	22,880,000	
富士紡ホールディングス	98,000	163	15,974,000	
日清紡ホールディングス	149,000	696	103,704,000	
倉敷紡績	241,000	147	35,427,000	
シキボウ	152,000	116	17,632,000	
日本毛織	80,000	554	44,320,000	
トーア紡コーポレーション	101,000	56	5,656,000	
ダイドーリミテッド	28,900	681	19,680,900	
帝国繊維	25,000	510	12,750,000	
帝人	958,000	252	241,416,000	
東レ	1,701,000	566	962,766,000	
サカイオーベックス	67,000	120	8,040,000	
住江織物	65,000	141	9,165,000	
日本フェルト	13,000	385	5,005,000	
イチカワ	16,000	145	2,320,000	
日本バイリーン	30,000	330	9,900,000	
日東製網	30,000	160	4,800,000	
芦森工業	55,000	112	6,160,000	
アツギ	184,000	94	17,296,000	
ダイニック	48,000	141	6,768,000	
セーレン	58,600	451	26,428,600	
東海染工	34,000	88	2,992,000	
小松精練	36,000	338	12,168,000	
ワコールホールディングス	140,000	1,053	147,420,000	
ホギメディカル	14,800	3,240	47,952,000	
レナウン	51,200	152	7,782,400	
クラウドディア	3,200	1,015	3,248,000	
T S Iホールディングス	104,800	382	40,033,600	
三陽商会	115,000	198	22,770,000	
オンワードホールディングス	144,000	557	80,208,000	
ルック	39,000	227	8,853,000	
ゴールドウイン	55,000	289	15,895,000	
デサント	59,000	394	23,246,000	
ヤマトインターナショナル	14,300	357	5,105,100	
特種東海製紙	148,000	186	27,528,000	
王子製紙	1,036,000	387	400,932,000	
三菱製紙	333,000	72	23,976,000	
北越紀州製紙	145,500	518	75,369,000	
中越パルプ工業	89,000	136	12,104,000	
巴川製紙所	41,000	170	6,970,000	
大王製紙	97,000	559	54,223,000	
日本製紙グループ本社	113,100	1,674	189,329,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
レンゴー	188,000	565	106,220,000	
トーモク	74,000	203	15,022,000	
ザ・バック	13,800	1,150	15,870,000	
クラレ	372,600	1,119	416,939,400	
旭化成	1,365,000	462	630,630,000	
共和レザー	13,900	261	3,627,900	
コープケミカル	43,000	104	4,472,000	

昭和電工	1,457,000	159	231,663,000	
住友化学	1,611,000	301	484,911,000	
日本化成	49,000	142	6,958,000	
住友精化	46,000	338	15,548,000	
日産化学工業	178,300	760	135,508,000	
ラサ工業	99,000	126	12,474,000	
クレハ	153,000	365	55,845,000	
テイカ	42,000	294	12,348,000	
片倉チッカリン	20,000	192	3,840,000	
日本曹達	142,000	348	49,416,000	
東ソー	627,000	226	141,702,000	
トクヤマ	365,000	273	99,645,000	
セントラル硝子	224,000	357	79,968,000	
東亜合成	294,000	331	97,314,000	
ダイソー	96,000	247	23,712,000	
関東電化工業	54,000	312	16,848,000	
電気化学工業	492,000	309	152,028,000	
信越化学工業	420,500	3,740	1,572,670,000	
日本カーバイド工業	81,000	124	10,044,000	
堺化学工業	75,000	300	22,500,000	
エア・ウォーター	191,000	1,022	195,202,000	
大陽日酸	308,000	565	174,020,000	
日本化学工業	99,000	138	13,662,000	
日本パーカライジング	56,000	981	54,936,000	
高压ガス工業	36,000	486	17,496,000	
チタン工業	27,000	401	10,827,000	
四国化成工業	35,000	412	14,420,000	
戸田工業	31,000	661	20,491,000	
ステラ ケミファ	11,400	2,455	27,987,000	
保土谷化学工業	50,000	245	12,250,000	
日本触媒	177,000	858	151,866,000	
大日精化工業	86,000	338	29,068,000	
カネカ	292,000	428	124,976,000	
三菱瓦斯化学	403,000	477	192,231,000	
三井化学	995,000	258	256,710,000	
J S R	213,400	1,481	316,045,400	
東京応化工業	42,100	1,601	67,402,100	
三菱ケミカルホールディングス	1,466,000	460	674,360,000	
日本合成化学工業	49,000	440	21,560,000	
ダイセル	304,000	451	137,104,000	
住友ベークライト	201,000	447	89,847,000	
積水化学工業	487,000	627	305,349,000	
日本ゼオン	219,000	661	144,759,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
アイカ工業	63,200	1,048	66,233,600	
宇部興産	982,000	212	208,184,000	
積水樹脂	36,000	728	26,208,000	
タキロン	55,000	267	14,685,000	
旭有機材工業	83,000	200	16,600,000	
日立化成工業	101,400	1,457	147,739,800	
ニチバン	23,000	250	5,750,000	
リケンテクノス	41,000	217	8,897,000	
大倉工業	56,000	238	13,328,000	
積水化成品工業	60,000	301	18,060,000	

群栄化学工業	67,000	190	12,730,000	
タイガースポリマー	12,000	298	3,576,000	
日本カーリット	20,300	399	8,099,700	
日本化薬	165,000	786	129,690,000	
日本精化	20,800	529	11,003,200	
A D E K A	100,900	756	76,280,400	
日油	187,000	387	72,369,000	
ハリマ化成	21,000	634	13,314,000	
花王	621,800	1,975	1,228,055,000	
第一工業製薬	45,000	226	10,170,000	
三洋化成工業	75,000	528	39,600,000	
大日本塗料	143,000	85	12,155,000	
日本ペイント	221,000	563	124,423,000	
関西ペイント	265,000	735	194,775,000	
中国塗料	73,000	511	37,303,000	
日本特殊塗料	18,300	324	5,929,200	
藤倉化成	31,500	376	11,844,000	
太陽ホールディングス	19,400	1,953	37,888,200	
D I C	895,000	139	124,405,000	
サカタインクス	46,000	341	15,686,000	
東洋インキ S C ホールディングス	213,000	301	64,113,000	
富士フイルムホールディングス	538,200	1,907	1,026,347,400	
資生堂	389,200	1,380	537,096,000	
ライオン	270,000	452	122,040,000	
高砂香料工業	79,000	379	29,941,000	
マンダム	23,500	1,964	46,154,000	
ミルボン	12,500	2,478	30,975,000	
ファンケル	58,900	1,082	63,729,800	
コーセー	37,900	1,837	69,622,300	
ドクターシーラボ	141	384,500	54,214,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	23,900	1,971	47,106,900	
エステー	14,400	1,000	14,400,000	
コニシ	17,700	1,039	18,390,300	
長谷川香料	30,300	1,185	35,905,500	
小林製薬	32,500	3,910	127,075,000	
荒川化学工業	19,300	677	13,066,100	
メック	19,600	270	5,292,000	
日本高純度化学	69	221,000	15,249,000	
荏原ユーザライト	3,500	1,946	6,811,000	
アース製薬	16,800	2,937	49,341,600	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
イハラケミカル工業	42,000	283	11,886,000	
北興化学工業	26,000	219	5,694,000	
大成ラミック	6,800	2,436	16,564,800	
クミアイ化学工業	57,000	282	16,074,000	
日本農薬	56,000	338	18,928,000	
アキレス	195,000	107	20,865,000	
有沢製作所	38,900	309	12,020,100	
日東電工	193,200	3,155	609,546,000	
レック	7,000	1,064	7,448,000	
きもと	19,200	542	10,406,400	
藤森工業	17,500	1,102	19,285,000	
前澤化成工業	22,100	780	17,238,000	
J S P	15,800	1,095	17,301,000	

エフピコ	10,400	5,180	53,872,000	
天馬	18,800	713	13,404,400	
信越ポリマー	45,900	335	15,376,500	
東リ	95,000	149	14,155,000	
ニフコ	52,300	2,141	111,974,300	
日本バルカー工業	92,000	201	18,492,000	
ユニ・チャーム	129,500	3,660	473,970,000	
協和発酵キリン	321,000	934	299,814,000	
武田薬品工業	878,200	3,230	2,836,586,000	代用有価証券で 200,000株 担保差入
アステラス製薬	520,400	3,050	1,587,220,000	
大日本住友製薬	165,900	833	138,194,700	
塩野義製薬	366,100	979	358,411,900	
田辺三菱製薬	234,100	1,240	290,284,000	
わかもと製薬	27,000	240	6,480,000	
あすか製薬	28,000	483	13,524,000	
日本新薬	49,000	950	46,550,000	
中外製薬	272,300	1,251	340,647,300	
科研製薬	92,000	1,010	92,920,000	
エーザイ	288,600	3,070	886,002,000	
ロート製薬	98,000	976	95,648,000	
小野薬品工業	114,700	4,100	470,270,000	
久光製薬	72,800	3,180	231,504,000	
有機合成薬品工業	21,000	168	3,528,000	
持田製薬	83,000	851	70,633,000	
参天製薬	78,700	2,993	235,549,100	
扶桑薬品工業	79,000	196	15,484,000	
日本ケミファ	36,000	293	10,548,000	
ツムラ	63,900	2,249	143,711,100	
日医工	39,600	1,891	74,883,600	
キッセイ薬品工業	43,500	1,551	67,468,500	
生化学工業	44,800	848	37,990,400	
栄研化学	18,200	1,025	18,655,000	
日水製薬	9,400	684	6,429,600	
鳥居薬品	16,000	1,404	22,464,000	
東和薬品	11,900	3,340	39,746,000	
沢井製薬	15,400	8,000	123,200,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ゼリア新薬工業	34,000	1,302	44,268,000	
第一三共	788,500	1,462	1,152,787,000	
キョーリン製薬ホールディングス	57,000	1,354	77,178,000	
大幸薬品	10,800	848	9,158,400	
ダイト	6,500	1,210	7,865,000	
大塚ホールディングス	465,300	2,133	992,484,900	
大正製薬ホールディングス	56,400	5,520	311,328,000	
日本コークス工業	193,500	106	20,511,000	
昭和シェル石油	209,500	569	119,205,500	
コスモ石油	648,000	212	137,376,000	
ニチレキ	36,000	375	13,500,000	
東燃ゼネラル石油	354,000	888	314,352,000	
ユシロ化学工業	13,200	866	11,431,200	
ビービー・カストロール	10,800	346	3,736,800	
AOCホールディングス	55,200	511	28,207,200	
MORESCO	5,900	716	4,224,400	

出光興産	27,800	8,700	241,860,000	
JXホールディングス	2,601,800	483	1,256,669,400	
横浜ゴム	286,000	432	123,552,000	
東洋ゴム工業	177,000	183	32,391,000	
ブリヂストン	734,700	1,741	1,279,112,700	
住友ゴム工業	182,800	937	171,283,600	
藤倉ゴム工業	15,100	295	4,454,500	
オカモト	86,000	317	27,262,000	
フコク	9,900	668	6,613,200	
ニッタ	23,200	1,428	33,129,600	
東海ゴム工業	43,500	902	39,237,000	
三ツ星ベルト	62,000	408	25,296,000	
パンドー化学	84,000	312	26,208,000	
日東紡績	173,000	327	56,571,000	
旭硝子	1,155,000	666	769,230,000	
日本板硝子	1,005,000	149	149,745,000	
石塚硝子	32,000	147	4,704,000	
日本山村硝子	94,000	193	18,142,000	
日本電気硝子	450,000	795	357,750,000	
オハラ	9,200	785	7,222,000	
住友大阪セメント	475,000	239	113,525,000	
太平洋セメント	1,377,000	152	209,304,000	
デイ・シイ	22,800	222	5,061,600	
日本ヒューム	29,000	292	8,468,000	
日本コンクリート工業	47,000	184	8,648,000	
東海カーボン	203,000	418	84,854,000	
日本カーボン	108,000	225	24,300,000	
東洋炭素	13,000	3,625	47,125,000	
ノリタケカンパニーリミテド	122,000	237	28,914,000	
TOTO	362,000	609	220,458,000	
日本碍子	305,000	884	269,620,000	
日本特殊陶業	202,000	974	196,748,000	
MARUWA	6,900	3,590	24,771,000	
品川リフラクトリーズ	60,000	221	13,260,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
黒崎播磨	52,000	260	13,520,000	
東京窯業	30,000	186	5,580,000	
ニッカトー	8,800	473	4,162,400	
フジインコーポレーテッド	21,600	894	19,310,400	
ニチアス	116,000	423	49,068,000	
ニチハ	31,300	880	27,544,000	
新日本製鐵	6,151,000	198	1,217,898,000	
住友金属工業	4,343,000	143	621,049,000	
神戸製鋼所	3,248,000	133	431,984,000	
日新製鋼	829,000	118	97,822,000	
中山製鋼所	119,000	77	9,163,000	
合同製鐵	131,000	196	25,676,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	555,200	1,525	846,680,000	
東京製鐵	118,600	681	80,766,600	
共英製鋼	25,000	1,526	38,150,000	
大和工業	53,600	2,164	115,990,400	
東京鐵鋼	46,000	238	10,948,000	
大阪製鐵	14,700	1,346	19,786,200	
淀川製鋼所	166,000	345	57,270,000	

東洋鋼鈹	56,000	278	15,568,000	
住友鋼管	13,600	591	8,037,600	
丸一鋼管	71,900	1,756	126,256,400	
モリ工業	35,000	272	9,520,000	
大同特殊鋼	393,000	500	196,500,000	
日本高周波鋼業	92,000	91	8,372,000	
日本金属工業	181,000	69	12,489,000	
日本冶金工業	172,500	136	23,460,000	
山陽特殊製鋼	116,000	431	49,996,000	
愛知製鋼	124,000	400	49,600,000	
日立金属	153,000	878	134,334,000	
日本金属	56,000	153	8,568,000	
大平洋金属	163,000	404	65,852,000	
日本電工	84,000	378	31,752,000	
栗本鐵工所	112,000	160	17,920,000	
日本鑄鉄管	25,000	158	3,950,000	
三菱製鋼	141,000	214	30,174,000	
日亜鋼業	36,000	204	7,344,000	
日本精線	16,000	400	6,400,000	
シンニッタン	20,600	341	7,024,600	
新家工業	93,000	124	11,532,000	
日本軽金属	530,000	109	57,770,000	
大紀アルミニウム工業所	36,000	357	12,852,000	
三井金属鉱業	637,000	209	133,133,000	
東邦亜鉛	132,000	307	40,524,000	
三菱マテリアル	1,462,000	224	327,488,000	
住友金属鉱山	606,000	1,032	625,392,000	
DOWAホールディングス	280,000	501	140,280,000	
古河機械金属	394,000	68	26,792,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,000	3,640	83,720,000	
東邦チタニウム	38,000	1,393	52,934,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
住友軽金属工業	566,000	75	42,450,000	
古河スカイ	95,000	188	17,860,000	
古河電気工業	737,000	190	140,030,000	
住友電気工業	827,800	863	714,391,400	
フジクラ	351,000	238	83,538,000	
昭和電線ホールディングス	327,000	75	24,525,000	
タツタ電線	50,000	347	17,350,000	
日立電線	193,000	168	32,424,000	
沖電線	24,000	166	3,984,000	
カナレ電気	2,900	1,294	3,752,600	
平河ヒューテック	4,500	729	3,280,500	
リョービ	131,000	299	39,169,000	
アサヒホールディングス	32,800	1,588	52,086,400	
稲葉製作所	11,700	926	10,834,200	
トーカロ	13,200	1,672	22,070,400	
アルファC o	7,900	833	6,580,700	
SUMCO	143,300	647	92,715,100	
川田テクノロジーズ	6,900	1,074	7,410,600	
東洋製罐	165,600	1,065	176,364,000	
ホッカンホールディングス	57,000	224	12,768,000	
コロナ	11,100	1,297	14,396,700	
横河ブリッジホールディングス	52,000	522	27,144,000	

駒井ハルテック	56,000	192	10,752,000	
高田機工	32,000	185	5,920,000	
三和ホールディングス	253,000	243	61,479,000	
文化シャッター	79,000	243	19,197,000	
東洋シャッター	20,500	360	7,380,000	
住生活グループ	304,600	1,477	449,894,200	
日本ファイルコン	17,300	395	6,833,500	
ノーリツ	45,900	1,418	65,086,200	
長府製作所	24,900	2,003	49,874,700	
リンナイ	37,700	5,620	211,874,000	
ダイニチ工業	12,500	750	9,375,000	
日東精工	31,000	208	6,448,000	
三洋工業	63,000	158	9,954,000	
岡部	58,100	393	22,833,300	
東プレ	45,200	775	35,030,000	
高周波熱錬	31,300	591	18,498,300	
東京製綱	159,000	170	27,030,000	
パイオラックス	10,100	1,670	16,867,000	
日本発條	169,600	713	120,924,800	
中央発條	30,000	270	8,100,000	
三益半導体工業	19,700	670	13,199,000	
アタカ大機	15,000	244	3,660,000	
日本製鋼所	361,000	534	192,774,000	
日立ツール	14,300	832	11,897,600	
三浦工業	34,800	2,231	77,638,800	
タクマ	79,000	319	25,201,000	
ツガミ	58,000	525	30,450,000	
オークマ	142,000	581	82,502,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
東芝機械	129,000	418	53,922,000	
アマダ	331,000	496	164,176,000	
アイダエンジニアリング	62,400	385	24,024,000	
牧野フライス製作所	118,000	558	65,844,000	
オーエスジー	103,200	965	99,588,000	
ダイジェット工業	32,000	145	4,640,000	
旭ダイヤモンド工業	58,300	1,057	61,623,100	
森精機製作所	123,500	746	92,131,000	
ディスコ	23,600	4,265	100,654,000	
日東工器	14,000	1,785	24,990,000	
豊和工業	134,000	70	9,380,000	
大阪機工	99,000	95	9,405,000	
東洋機械金属	21,300	198	4,217,400	
津田駒工業	62,000	176	10,912,000	
島精機製作所	31,100	1,307	40,647,700	
日阪製作所	30,000	871	26,130,000	
やまびこ	9,200	862	7,930,400	
ベガサスミシン製造	25,300	204	5,161,200	
ナブテスコ	97,300	1,619	157,528,700	
三井海洋開発	19,400	1,319	25,588,600	
レオン自動機	26,000	187	4,862,000	
S M C	69,900	12,850	898,215,000	
新川	18,100	438	7,927,800	
ホソカワミクロン	38,000	395	15,010,000	
ユニオンツール	13,400	1,431	19,175,400	

オイレス工業	26,000	1,470	38,220,000	
サトーホールディングス	24,600	976	24,009,600	
日本エアーテック	9,000	355	3,195,000	
日精樹脂工業	21,300	315	6,709,500	
ワイエイシー	9,400	715	6,721,000	
小松製作所	1,110,700	1,999	2,220,289,300	
住友重機械工業	598,000	454	271,492,000	
日立建機	119,600	1,407	168,277,200	
日工	32,000	286	9,152,000	
巴工業	8,900	1,372	12,210,800	
井関農機	240,000	175	42,000,000	
TOWA	20,900	404	8,443,600	
丸山製作所	52,000	182	9,464,000	
北川鉄工所	107,000	142	15,194,000	
クボタ	1,073,000	667	715,691,000	
荏原実業	5,500	1,235	6,792,500	
三菱化工機	77,000	140	10,780,000	
月島機械	35,000	629	22,015,000	
帝国電機製作所	8,400	1,411	11,852,400	
新東工業	52,200	687	35,861,400	
澁谷工業	14,200	776	11,019,200	
アイチ コーポレーション	38,700	307	11,880,900	
小森コーポレーション	68,200	517	35,259,400	
鶴見製作所	19,000	550	10,450,000	
住友精密工業	35,000	510	17,850,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
酒井重工業	44,000	139	6,116,000	
荏原製作所	382,000	286	109,252,000	
石井鐵工所	34,000	153	5,202,000	
西島製作所	27,800	1,052	29,245,600	
ダイキン工業	285,200	2,261	644,837,200	
オルガノ	44,000	599	26,356,000	
トヨーカネツ	125,000	153	19,125,000	
栗田工業	129,200	2,020	260,984,000	
椿本チエイン	120,000	419	50,280,000	
大同工業	52,000	133	6,916,000	
日本コンベヤ	72,000	79	5,688,000	
木村化工機	21,500	328	7,052,000	
アネスト岩田	39,000	326	12,714,000	
ダイフク	102,500	429	43,972,500	
加藤製作所	53,000	227	12,031,000	
油研工業	45,000	157	7,065,000	
タダノ	108,000	494	53,352,000	
フジテック	65,000	429	27,885,000	
シーケーディ	63,000	581	36,603,000	
キトー	108	57,100	6,166,800	
平和	48,600	1,321	64,200,600	
理想科学工業	16,200	1,185	19,197,000	
SANKYO	67,800	3,875	262,725,000	
日本金銭機械	20,600	611	12,586,600	
マースエンジニアリング	12,600	1,297	16,342,200	
福島工業	6,100	921	5,618,100	
オーイズミ	7,800	269	2,098,200	
ダイコク電機	10,300	751	7,735,300	

アマノ	67,900	706	47,937,400	
サンデン	117,000	238	27,846,000	
マックス	36,000	941	33,876,000	
グローリー	66,800	1,640	109,552,000	
大和冷機工業	32,000	399	12,768,000	
セガサミーホールディングス	240,600	1,561	375,576,600	
日本ピストンリング	82,000	157	12,874,000	
リケン	82,000	293	24,026,000	
T P R	24,900	874	21,762,600	
ホシザキ電機	45,100	1,884	84,968,400	
大豊工業	15,800	686	10,838,800	
日本精工	498,000	521	259,458,000	
N T N	518,000	318	164,724,000	
ジェイテクト	214,100	772	165,285,200	
不二越	225,000	357	80,325,000	
日本トムソン	72,000	465	33,480,000	
T H K	148,900	1,600	238,240,000	
ユースン精機	11,700	1,386	16,216,200	
前澤給装工業	12,800	1,075	13,760,000	
イーグル工業	28,000	637	17,836,000	
前澤工業	16,400	190	3,116,000	
日本ピラー工業	23,000	538	12,374,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
キッツ	92,500	328	30,340,000	
日立工機	61,200	589	36,046,800	
マキタ	146,000	2,682	391,572,000	
日立造船	885,500	102	90,321,000	
三菱重工業	3,752,000	333	1,249,416,000	
I H I	1,530,000	187	286,110,000	
イビデン	146,800	1,775	260,570,000	
コニカミノルタホールディングス	591,500	596	352,534,000	
ブラザー工業	289,400	1,019	294,898,600	
ミネベア	333,000	343	114,219,000	
日立製作所	5,027,000	428	2,151,556,000	
東芝	4,713,000	348	1,640,124,000	
三菱電機	2,239,000	759	1,699,401,000	
富士電機	675,000	227	153,225,000	
東洋電機製造	39,000	304	11,856,000	
安川電機	263,000	696	183,048,000	
シンフォニアテクノロジー	135,000	173	23,355,000	
明電舎	222,000	274	60,828,000	
オリジン電気	33,000	257	8,481,000	
デンヨー	21,200	1,071	22,705,200	
東芝テック	141,000	280	39,480,000	
芝浦メカトロニクス	40,000	215	8,600,000	
マブチモーター	30,500	3,535	107,817,500	
日本電産	121,000	6,800	822,800,000	
高岳製作所	89,000	187	16,643,000	
ダイヘン	132,000	287	37,884,000	
J V Cケンウッド	135,500	299	40,514,500	
第一精工	5,200	2,358	12,261,600	
日新電機	45,000	457	20,565,000	
大崎電気工業	32,000	755	24,160,000	
オムロン	249,300	1,744	434,779,200	

日東工業	33,600	884	29,702,400
I D E C	29,400	798	23,461,200
エルピーダメモリ	302,300	419	126,663,700
ジーエス・ユアサ コーポレーション	431,000	441	190,071,000
サクサホールディングス	59,000	121	7,139,000
メルコホールディングス	12,500	2,145	26,812,500
テクノメディカ	17	298,800	5,079,600
日本電気	3,078,000	170	523,260,000
富士通	2,158,000	426	919,308,000
沖電気工業	869,000	72	62,568,000
岩崎通信機	103,000	74	7,622,000
電気興業	70,000	315	22,050,000
サンケン電気	113,000	286	32,318,000
ナカヨ通信機	23,000	238	5,474,000
アイホン	13,000	1,424	18,512,000
ルネサスエレクトロニクス	58,000	539	31,262,000
セイコーエプソン	152,800	1,100	168,080,000
ワコム	443	126,000	55,818,000
アルバック	41,900	1,120	46,928,000

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
アクセル	10,300	1,565	16,119,500	
ナナオ	19,000	1,546	29,374,000	
日本信号	52,100	432	22,507,200	
京三製作所	48,000	319	15,312,000	
能美防災	30,000	527	15,810,000	
ホーチキ	20,000	370	7,400,000	
日本無線	50,000	188	9,400,000	
パナソニック	2,557,600	706	1,805,665,600	
シャープ	1,081,000	732	791,292,000	
アンリツ	107,000	833	89,131,000	
富士通ゼネラル	53,000	449	23,797,000	
日立国際電気	51,000	639	32,589,000	
ソニー	1,396,600	1,423	1,987,361,800	
T D K	117,100	3,605	422,145,500	
帝国通信工業	53,000	130	6,890,000	
ミツミ電機	79,200	612	48,470,400	
タムラ製作所	75,000	201	15,075,000	
アルプス電気	176,700	558	98,598,600	
パイオニア	317,300	366	116,131,800	
日本電波工業	17,300	1,085	18,770,500	
日本トリム	2,850	1,857	5,292,450	
ローランド ディー . ジー .	10,300	870	8,961,000	
フォスター電機	21,200	1,138	24,125,600	
クラリオン	138,000	139	19,182,000	
S M K	71,000	267	18,957,000	
ヨコオ	17,600	417	7,339,200	
東光	102,000	147	14,994,000	
ティアック	124,000	29	3,596,000	
ホシデン	60,600	567	34,360,200	
ヒロセ電機	38,900	6,990	271,911,000	
日本航空電子工業	51,000	576	29,376,000	
T O A	25,000	481	12,025,000	
ユニデン	67,000	279	18,693,000	
アルパイン	43,800	881	38,587,800	

スミダコーポレーション	13,900	555	7,714,500	
アイコム	12,600	1,980	24,948,000	
船井電機	20,100	1,748	35,134,800	
横河電機	242,700	743	180,326,100	
新電元工業	79,000	332	26,228,000	
山武	57,500	1,665	95,737,500	
日本光電工業	44,500	1,786	79,477,000	
チノー	40,000	192	7,680,000	
共和電業	23,000	244	5,612,000	
日本電子材料	8,800	374	3,291,200	
堀場製作所	41,400	2,327	96,337,800	
アドバンテスト	166,500	821	136,696,500	
小野測器	24,000	213	5,112,000	
エスベック	23,100	475	10,972,500	
パナソニック電工SUNX	19,600	397	7,781,200	
キーエンス	53,400	19,640	1,048,776,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日置電機	10,700	1,359	14,541,300	
シスメックス	78,700	2,584	203,360,800	
メガチップス	18,400	1,257	23,128,800	
OBARA GROUP	16,800	904	15,187,200	
日本電産コバル電子	23,100	477	11,018,700	
ミヤチテクノス	12,100	639	7,731,900	
東京電波	6,500	367	2,385,500	
澤藤電機	12,000	228	2,736,000	
コーセル	32,500	1,044	33,930,000	
日立メディコ	16,000	773	12,368,000	
新日本無線	14,000	122	1,708,000	
オブテックス	15,300	1,002	15,330,600	
千代田インテグレ	10,800	992	10,713,600	
東光電気	14,000	320	4,480,000	
スタンレー電気	150,100	1,149	172,464,900	
岩崎電気	82,000	173	14,186,000	
ウシオ電機	135,900	1,193	162,128,700	
岡谷電機産業	11,900	335	3,986,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	24,200	146	3,533,200	
日本セラミック	14,600	1,438	20,994,800	
新神戸電機	17,000	1,703	28,951,000	
日本デジタル研究所	19,000	791	15,029,000	
古河電池	16,000	378	6,048,000	
双信電機	10,800	350	3,780,000	
山一電機	22,700	178	4,040,600	
図研	15,200	553	8,405,600	
日本電子	83,000	205	17,015,000	
カシオ計算機	213,300	494	105,370,200	
ファナック	233,100	12,780	2,979,018,000	
日本シイエムケイ	48,200	270	13,014,000	
エンプラス	11,300	1,390	15,707,000	
ローム	110,300	3,655	403,146,500	
浜松ホトニクス	87,300	2,752	240,249,600	
三井ハイテック	29,500	357	10,531,500	
新光電気工業	75,200	584	43,916,800	
京セラ	186,200	6,710	1,249,402,000	
太陽誘電	100,500	653	65,626,500	

村田製作所	234,900	4,225	992,452,500	
ユーシン	31,300	624	19,531,200	
双葉電子工業	38,800	1,246	48,344,800	
北陸電気工業	90,000	115	10,350,000	
ニチコン	70,500	877	61,828,500	
日本ケミコン	129,000	304	39,216,000	
K O A	28,100	730	20,513,000	
市光工業	54,000	139	7,506,000	
小糸製作所	112,000	1,062	118,944,000	
ミツバ	41,000	546	22,386,000	
スター精密	37,000	723	26,751,000	
大日本スクリーン製造	212,000	636	134,832,000	
キャノン電子	20,500	2,013	41,266,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
キャノン	1,390,600	3,500	4,867,100,000	
リコー	673,000	695	467,735,000	
日本電産サンキョー	53,000	505	26,765,000	
MUTOHホールディングス	24,000	229	5,496,000	
東京エレクトロン	188,300	4,170	785,211,000	
トヨタ紡織	78,300	853	66,789,900	
鬼怒川ゴム工業	52,000	681	35,412,000	
ユニプレス	35,600	2,148	76,468,800	
豊田自動織機	203,800	2,115	431,037,000	
モリタホールディングス	36,000	428	15,408,000	
三櫻工業	28,500	523	14,905,500	
デンソー	553,000	2,181	1,206,093,000	
東海理化電機製作所	52,400	1,189	62,303,600	
三井造船	866,000	127	109,982,000	
佐世保重工業	146,000	143	20,878,000	
川崎重工業	1,627,000	214	348,178,000	
日本車輛製造	82,000	300	24,600,000	
日本輸送機	29,000	212	6,148,000	
近畿車輛	34,000	241	8,194,000	
日産自動車	2,828,000	697	1,971,116,000	
いすゞ自動車	1,415,000	349	493,835,000	
トヨタ自動車	2,875,900	2,617	7,526,230,300	代用有価証券で 500,000株 担保差入
日野自動車	319,000	472	150,568,000	
三菱自動車工業	5,004,000	92	460,368,000	
エフテック	7,800	920	7,176,000	
武蔵精密工業	21,700	1,737	37,692,900	
トヨタ車体	40,700	1,172	47,700,400	
日産車体	66,000	753	49,698,000	
関東自動車工業	34,100	651	22,199,100	
新明和工業	100,000	293	29,300,000	
極東開発工業	38,600	488	18,836,800	
日信工業	41,000	1,085	44,485,000	
トピー工業	168,000	196	32,928,000	
ティラド	82,000	261	21,402,000	
曙ブレーキ工業	113,700	347	39,453,900	
タチエス	29,300	1,287	37,709,100	
N O K	108,300	1,355	146,746,500	
フタバ産業	63,500	464	29,464,000	
カヤバ工業	155,000	380	58,900,000	

シロキ工業	50,000	216	10,800,000	
大同メタル工業	34,000	846	28,764,000	
プレス工業	103,000	379	39,037,000	
カルソニックカンセイ	133,000	455	60,515,000	
太平洋工業	46,000	364	16,744,000	
ケーヒン	46,300	1,307	60,514,100	
河西工業	28,000	424	11,872,000	
アイシン精機	184,300	2,274	419,098,200	
富士機工	26,000	222	5,772,000	
マツダ	1,856,000	146	270,976,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ダイハツ工業	208,000	1,390	289,120,000	
愛知機械工業	51,000	222	11,322,000	
今仙電機製作所	16,500	903	14,899,500	
本田技研工業	1,888,600	2,455	4,636,513,000	
スズキ	468,000	1,642	768,456,000	
富士重工業	707,000	455	321,685,000	
ヤマハ発動機	364,700	1,026	374,182,200	
ショーワ	47,700	448	21,369,600	
T B K	23,000	364	8,372,000	
エクセディ	30,400	2,295	69,768,000	
豊田合成	63,300	1,304	82,543,200	
愛三工業	23,300	621	14,469,300	
ヨロズ	13,500	1,761	23,773,500	
エフ・シー・シー	36,600	1,625	59,475,000	
シマノ	84,800	3,670	311,216,000	
タカタ	40,500	1,608	65,124,000	
テイ・エス テック	47,300	1,139	53,874,700	
日本電産トーソク	10,800	880	9,504,000	
テルモ	194,000	3,775	732,350,000	
クリエートメディック	6,700	817	5,473,900	
日機装	73,000	697	50,881,000	
島津製作所	268,000	649	173,932,000	
J M S	34,000	238	8,092,000	
クボテック	48	27,660	1,327,680	
モリテックス	4,800	370	1,776,000	
長野計器	15,700	758	11,900,600	
バイ・テクノロジ	30	383,500	11,505,000	
東京計器	77,000	149	11,473,000	
愛知時計電機	44,000	258	11,352,000	
東京精密	40,100	1,559	62,515,900	
ニコン	390,100	1,729	674,482,900	
トプコン	51,500	371	19,106,500	
理研計器	18,100	558	10,099,800	
タムロン	19,900	2,033	40,456,700	
H O Y A	585,600	1,655	969,168,000	
ノーリツ鋼機	20,400	367	7,486,800	
エー・アンド・デイ	21,800	307	6,692,600	
日本電産コバル	17,500	863	15,102,500	
シチズンホールディングス	267,900	454	121,626,600	
リズム時計工業	105,000	140	14,700,000	
大研医器	2,800	847	2,371,600	
セイコーホールディングス	133,000	177	23,541,000	
ニプロ	88,800	651	57,808,800	

パラマウントベッドホールディングス	19,400	2,169	42,078,600	
SHO - B I	4,100	447	1,832,700	
S R I スポーツ	14,700	850	12,495,000	
バンダイナムコホールディングス	239,800	1,096	262,820,800	
共立印刷	27,200	168	4,569,600	
フランスベッドホールディングス	154,000	129	19,866,000	
パイロットコーポレーション	195	154,900	30,205,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
トッパン・フォームズ	48,300	597	28,835,100	
フジシールインターナショナル	25,100	1,366	34,286,600	
タカラトミー	74,500	556	41,422,000	
廣済堂	20,000	199	3,980,000	
タカノ	10,000	423	4,230,000	
プロネクサス	25,000	390	9,750,000	
ウッドワン	56,000	268	15,008,000	
大建工業	113,000	224	25,312,000	
凸版印刷	681,000	578	393,618,000	
大日本印刷	682,000	776	529,232,000	
図書印刷	37,000	134	4,958,000	
共同印刷	76,000	184	13,984,000	
日本写真印刷	37,700	1,035	39,019,500	
光村印刷	22,000	243	5,346,000	
宝印刷	12,900	566	7,301,400	
アシックス	208,500	936	195,156,000	
ツツミ	11,400	1,822	20,770,800	
ローランド	23,900	697	16,658,300	
小松ウオール工業	8,900	826	7,351,400	
ヤマハ	164,500	719	118,275,500	
河合楽器製作所	87,000	152	13,224,000	
クリナップ	36,400	520	18,928,000	
ビジョン	19,700	3,040	59,888,000	
キングジム	18,800	580	10,904,000	
リンテック	42,700	1,470	62,769,000	
イトーキ	50,000	173	8,650,000	
任天堂	128,000	11,070	1,416,960,000	
三菱鉛筆	19,000	1,347	25,593,000	
タカラスタANDARD	110,000	612	67,320,000	
コクヨ	116,300	551	64,081,300	
ナカバヤシ	47,000	185	8,695,000	
グローブライド	114,000	90	10,260,000	
岡村製作所	79,000	551	43,529,000	
美津濃	112,000	397	44,464,000	
アデランス	28,600	904	25,854,400	
東京電力	1,787,200	236	421,779,200	代用有価証券で 300,000株 担保差入
中部電力	737,600	1,444	1,065,094,400	
関西電力	913,500	1,105	1,009,417,500	
中国電力	309,500	1,312	406,064,000	
北陸電力	219,300	1,388	304,388,400	
東北電力	559,300	773	432,338,900	
四国電力	206,100	2,111	435,077,100	
九州電力	494,400	1,067	527,524,800	
北海道電力	209,500	1,077	225,631,500	
沖縄電力	13,400	3,365	45,091,000	

電源開発	138,900	1,895	263,215,500	
東京瓦斯	2,701,000	351	948,051,000	
大阪瓦斯	2,172,000	305	662,460,000	
東邦瓦斯	569,000	472	268,568,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
北海道瓦斯	40,000	264	10,560,000	
西部瓦斯	252,000	210	52,920,000	
静岡瓦斯	58,500	498	29,133,000	
東武鉄道	1,271,000	385	489,335,000	
相鉄ホールディングス	358,000	238	85,204,000	
東京急行電鉄	1,317,000	378	497,826,000	
京浜急行電鉄	575,000	677	389,275,000	
小田急電鉄	717,000	728	521,976,000	
京王電鉄	625,000	534	333,750,000	
京成電鉄	360,000	548	197,280,000	
富士急行	61,000	476	29,036,000	
新京成電鉄	29,000	345	10,005,000	
東日本旅客鉄道	389,200	4,795	1,866,214,000	
西日本旅客鉄道	194,600	3,285	639,261,000	
東海旅客鉄道	1,943	642,000	1,247,406,000	
西日本鉄道	290,000	366	106,140,000	
ハマキョウレックス	6,400	2,428	15,539,200	
サカイ引越センター	4,100	1,596	6,543,600	
近畿日本鉄道	2,022,000	287	580,314,000	
阪急阪神ホールディングス	1,502,000	325	488,150,000	
南海電気鉄道	467,000	335	156,445,000	
京阪電気鉄道	502,000	368	184,736,000	
名糖運輸	9,200	610	5,612,000	
名古屋鉄道	781,000	206	160,886,000	
日本通運	886,000	295	261,370,000	
ヤマトホールディングス	455,500	1,268	577,574,000	
山九	272,000	297	80,784,000	
丸運	12,100	189	2,286,900	
丸全昭和運輸	75,000	242	18,150,000	
センコー	90,000	311	27,990,000	
トナミホールディングス	46,000	150	6,900,000	
日本梱包運輸倉庫	67,100	788	52,874,800	
日本石油輸送	25,000	185	4,625,000	
福山通運	136,000	447	60,792,000	
セイノーホールディングス	173,000	562	97,226,000	
神奈川中央交通	26,000	414	10,764,000	
日立物流	46,600	1,325	61,745,000	
日本郵船	1,773,000	195	345,735,000	
商船三井	1,174,000	299	351,026,000	
川崎汽船	692,000	144	99,648,000	
NSユナイテッド海運	96,000	123	11,808,000	
乾汽船	24,500	304	7,448,000	
明治海運	20,000	227	4,540,000	
飯野海運	108,100	375	40,537,500	
共栄タンカー	19,000	136	2,584,000	
第一中央汽船	147,000	113	16,611,000	
全日本空輸	2,984,000	227	677,368,000	
パスコ	21,000	261	5,481,000	
国際航業ホールディングス	19,000	211	4,009,000	

日新	85,000	184	15,640,000	
----	--------	-----	------------	--

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
三菱倉庫	159,000	847	134,673,000	
三井倉庫	104,000	286	29,744,000	
住友倉庫	163,000	360	58,680,000	
澁澤倉庫	53,000	214	11,342,000	
東陽倉庫	36,000	166	5,976,000	
日本トランスシティ	47,000	244	11,468,000	
ケイヒン	41,000	94	3,854,000	
安田倉庫	17,400	467	8,125,800	
東洋埠頭	65,000	127	8,255,000	
宇徳	15,100	249	3,759,900	
上組	248,000	669	165,912,000	
サンリツ	5,800	510	2,958,000	
キムラユニティー	5,000	661	3,305,000	
キューソー流通システム	7,000	861	6,027,000	
郵船ロジスティクス	17,600	998	17,564,800	
近鉄エクスプレス	20,000	2,317	46,340,000	
東海運	14,100	188	2,650,800	
パンテック	26	142,400	3,702,400	
NEC ネットエスアイ	22,400	1,203	26,947,200	
システナ	265	54,100	14,336,500	
新日鉄ソリューションズ	14,800	1,645	24,346,000	
コア	8,400	642	5,392,800	
ソフトクリエイト	2,400	1,053	2,527,200	
デジタルハーツ	19	157,000	2,983,000	
ITホールディングス	67,200	930	62,496,000	
グリー	96,600	2,693	260,143,800	
コーエーテクモホールディングス	43,700	627	27,399,900	
三菱総合研究所	8,600	1,367	11,756,200	
ボルテージ	2,100	1,059	2,223,900	
ネクソン	30,500	1,300	39,650,000	
ダウンゴ	111	135,500	15,040,500	
ベリサーブ	13	134,900	1,753,700	
マクロミル	25,700	816	20,971,200	
ティーガイア	144	149,600	21,542,400	
GMO ペイメントゲートウェイ	48	348,000	16,704,000	
ザッパラス	122	78,000	9,516,000	
インターネットイニシアティブ	129	282,100	36,390,900	
ソネットエンタテインメント	125	296,200	37,025,000	
SRAホールディングス	11,700	778	9,102,600	
JBI Sホールディングス	23,100	236	5,451,600	
朝日ネット	18,000	368	6,624,000	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	5,200	1,999	10,394,800	
フェイス	759	8,460	6,421,140	
野村総合研究所	125,100	1,738	217,423,800	
サイバネットシステム	184	19,760	3,635,840	
インテージ	6,600	1,429	9,431,400	
シンプレクス・ホールディングス	375	28,350	10,631,250	
クレスコ	5,600	642	3,595,200	
フジ・メディア・ホールディングス	2,301	113,500	261,163,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
オービック	6,920	14,400	99,648,000	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	4,500	794	3,573,000	
ヤフー	16,175	25,070	405,507,250	
トレンドマイクロ	97,500	2,455	239,362,500	
日本オラクル	35,300	2,693	95,062,900	
アルファシステムズ	6,100	1,123	6,850,300	
フューチャーアーキテクト	267	30,900	8,250,300	
シーエーシー	15,100	636	9,603,600	
ソフトバンク・テクノロジー	5,300	616	3,264,800	
トーセ	5,400	508	2,743,200	
オービックビジネスコンサルタント	5,650	3,665	20,707,250	
日立ビジネスソリューション	7,000	1,000	7,000,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	26,100	3,465	90,436,500	
アイティフォー	24,800	269	6,671,200	
東計電算	4,000	1,124	4,496,000	
エクスネット	21	114,600	2,406,600	
大塚商会	17,600	5,360	94,336,000	
サイボウズ	406	23,920	9,711,520	
アグレックス	5,900	733	4,324,700	
電通国際情報サービス	13,700	783	10,727,100	
ウェザーニューズ	6,700	2,235	14,974,500	
C I J	22,200	299	6,637,800	
WOWOW	68	183,400	12,471,200	
ネットワンシステムズ	499	195,000	97,305,000	
アルゴグラフィックス	8,300	1,005	8,341,500	
エイベックス・グループ・ホールディングス	42,300	905	38,281,500	
日本ユニシス	53,500	520	27,820,000	
兼松エレクトロニクス	14,300	790	11,297,000	
東京放送ホールディングス	132,400	967	128,030,800	
日本テレビ放送網	19,390	11,350	220,076,500	
テレビ朝日	559	123,400	68,980,600	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,677	39,500	66,241,500	
テレビ東京ホールディングス	14,100	1,040	14,664,000	
アイ・ティー・シーネットワーク	18,700	490	9,163,000	
イー・アクセス	1,691	19,590	33,126,690	
NECモバイリング	8,200	2,639	21,639,800	
日本電信電話	1,017,300	3,880	3,947,124,000	
K D D I	3,429	493,500	1,692,211,500	
光通信	20,300	1,989	40,376,700	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	18,204	136,700	2,488,486,800	
GMOインターネット	65,800	300	19,740,000	
学研ホールディングス	67,000	151	10,117,000	
ゼンリン	32,000	698	22,336,000	
昭文社	12,200	583	7,112,600	
角川グループホールディングス	20,900	2,719	56,827,100	
インプレスホールディングス	19,200	106	2,035,200	
アイネット	9,700	460	4,462,000	
松竹	145,000	716	103,820,000	
東宝	157,600	1,347	212,287,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
東映	94,000	352	33,088,000	

葵プロモーション	10,500	403	4,231,500	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,365	246,100	335,926,500	
D T S	22,900	901	20,632,900	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	72,200	1,529	110,393,800	
シーイーシー	13,300	367	4,881,100	
カブコン	42,400	1,892	80,220,800	
ジャステック	14,100	442	6,232,200	
S C S K	45,100	1,240	55,924,000	
日本システムウエア	7,500	299	2,242,500	
アイネス	26,800	551	14,766,800	
T K C	18,600	1,507	28,030,200	
富士ソフト	29,900	1,373	41,052,700	
N S D	42,800	624	26,707,200	
コナミ	99,700	2,236	222,929,200	
福井コンピュータ	3,200	350	1,120,000	
J B C Cホールディングス	17,400	521	9,065,400	
ソフトバンク	1,000,900	2,424	2,426,181,600	
ハウスイ	19,000	123	2,337,000	
インターニックス	8,900	364	3,239,600	
高千穂交易	9,200	824	7,580,800	
伊藤忠食品	5,500	2,742	15,081,000	
エレマテック	17,600	1,276	22,457,600	
J A L U X	8,400	715	6,006,000	
トーメンデバイス	3,300	1,662	5,484,600	
東京エレクトロン デバイス	44	143,600	6,318,400	
双日	1,478,800	125	184,850,000	
アルフレッサ ホールディングス	57,800	3,090	178,602,000	
横浜冷凍	51,300	609	31,241,700	
神栄	28,000	177	4,956,000	
山下医科器械	1,800	942	1,695,600	
ラサ商事	14,300	345	4,933,500	
アルコニックス	6,800	1,635	11,118,000	
あい ホールディングス	39,600	341	13,503,600	
ダイワボウホールディングス	216,000	188	40,608,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	41,500	572	23,738,000	
U K Cホールディングス	13,100	722	9,458,200	
T O K A Iホールディングス	107,900	398	42,944,200	
ミタチ産業	5,100	369	1,881,900	
J F E 商事ホールディングス	153,000	333	50,949,000	
シップヘルスケアホールディングス	28,700	1,792	51,430,400	
協栄産業	27,000	157	4,239,000	
小野建	19,200	613	11,769,600	
佐島電機	16,200	472	7,646,400	
エコートレーディング	5,500	702	3,861,000	
伯東	13,400	748	10,023,200	
コンドーテック	13,200	901	11,893,200	
中山福	13,500	587	7,924,500	
ナガイレーベン	29,300	995	29,153,500	
三菱食品	20,300	2,050	41,615,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
松田産業	17,500	1,216	21,280,000	
メディバルホールディングス	237,900	782	186,037,800	
アドヴァン	19,800	652	12,909,600	
S P K	5,200	1,331	6,921,200	

アズワン	14,500	1,566	22,707,000	
スズデン	8,600	494	4,248,400	
尾家産業	7,300	831	6,066,300	
シモジマ	13,500	942	12,717,000	
ドウシシャ	11,200	2,075	23,240,000	
高速	13,100	593	7,768,300	
黒田電気	27,200	812	22,086,400	
丸文	17,500	309	5,407,500	
ハビネット	17,500	700	12,250,000	
トーメンエレクトロニクス	10,100	928	9,372,800	
エクセル	10,100	738	7,453,800	
マルカキカイ	8,200	665	5,453,000	
ガリパーインターナショナル	6,710	3,140	21,069,400	
日本エム・ディ・エム	18,400	170	3,128,000	
進和	13,900	892	12,398,800	
エスケイジャパン	7,300	245	1,788,500	
ダイトエレクトロン	10,100	465	4,696,500	
シークス	14,000	1,013	14,182,000	
田中商事	18,800	403	7,576,400	
オーハシテクニカ	12,400	560	6,944,000	
マクニカ	11,300	1,697	19,176,100	
白銅	7,100	773	5,488,300	
伊藤忠商事	1,762,600	799	1,408,317,400	
丸紅	1,933,000	483	933,639,000	
高島	39,000	215	8,385,000	
F & A アクアホールディングス	16,900	746	12,607,400	
長瀬産業	125,100	852	106,585,200	
蝶理	134,000	90	12,060,000	
豊田通商	246,100	1,365	335,926,500	
三共生興	37,900	265	10,043,500	
ツカモトコーポレーション	41,000	93	3,813,000	
三井物産	1,907,100	1,207	2,301,869,700	
日本紙パルプ商事	115,000	289	33,235,000	
日立ハイテクノロジーズ	67,000	1,730	115,910,000	
カメイ	29,000	735	21,315,000	
東都水産	37,000	151	5,587,000	
スターゼン	74,000	235	17,390,000	
山善	87,800	575	50,485,000	
椿本興業	23,000	205	4,715,000	
住友商事	1,303,900	1,066	1,389,957,400	
内田洋行	51,000	213	10,863,000	
三菱商事	1,609,000	1,606	2,584,054,000	
第一実業	52,000	319	16,588,000	
キヤノンマーケティングジャパン	73,500	914	67,179,000	
西華産業	82,000	218	17,876,000	
佐藤商事	19,700	446	8,786,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
菱洋エレクトロ	24,900	841	20,940,900	
東京産業	22,000	250	5,500,000	
ユアサ商事	241,000	117	28,197,000	
神鋼商事	65,000	182	11,830,000	
阪和興業	221,000	341	75,361,000	
カナデン	25,000	536	13,400,000	
菱電商事	35,000	447	15,645,000	

フルサト工業	14,200	597	8,477,400	
岩谷産業	251,000	263	66,013,000	
すてきナイスグループ	103,000	176	18,128,000	
昭光通商	92,000	132	12,144,000	
ニチモウ	43,000	193	8,299,000	
極東貿易	34,000	203	6,902,000	
イワキ	33,000	195	6,435,000	
三愛石油	54,000	324	17,496,000	
稲畑産業	62,500	465	29,062,500	
G S I クレオス	55,000	109	5,995,000	
明和産業	25,200	217	5,468,400	
東邦ホールディングス	70,700	1,041	73,598,700	
サンゲツ	39,100	1,997	78,082,700	
ミツウロコグループホールディングス	36,400	446	16,234,400	
シナネン	49,000	348	17,052,000	
伊藤忠エネクス	49,700	445	22,116,500	
サンリオ	55,700	3,950	220,015,000	
サンワテクノス	10,700	712	7,618,400	
リョーサン	36,000	1,677	60,372,000	
新光商事	24,200	620	15,004,000	
トーホー	46,000	308	14,168,000	
三信電気	31,600	639	20,192,400	
東陽テクニカ	31,900	795	25,360,500	
モスフードサービス	29,100	1,510	43,941,000	
加賀電子	23,900	800	19,120,000	
ソーダニッカ	25,000	338	8,450,000	
立花エレテック	14,600	698	10,190,800	
P a l t a c	15,500	1,480	22,940,000	
ヤマタネ	112,000	120	13,440,000	
丸紅建材リース	23,000	162	3,726,000	
日鐵商事	49,000	202	9,898,000	
トラスコ中山	28,700	1,446	41,500,200	
オートバックスセブン	26,200	3,555	93,141,000	
加藤産業	31,900	1,500	47,850,000	
イノテック	13,300	526	6,995,800	
イエローハット	21,000	1,301	27,321,000	
富士エレクトロニクス	11,300	1,063	12,011,900	
J Kホールディングス	31,800	368	11,702,400	
日伝	9,200	2,634	24,232,800	
北沢産業	48,500	177	8,584,500	
杉本商事	13,000	695	9,035,000	
因幡電機産業	26,000	2,206	57,356,000	
住金物産	112,000	196	21,952,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ミスミグループ本社	81,700	1,768	144,445,600	
江守商事	5,200	900	4,680,000	
アルテック	14,700	211	3,101,700	
タキヒヨー	34,000	427	14,518,000	
スズケン	84,900	2,112	179,308,800	
ジェコス	30,600	307	9,394,200	
ローソン	69,700	4,535	316,089,500	
サンエー	7,500	3,005	22,537,500	
キリン堂	9,700	484	4,694,800	
ダイユーエイト	3,700	687	2,541,900	

カワチ薬品	15,500	1,525	23,637,500	
エービーシー・マート	31,400	2,956	92,818,400	
ハードオフコーポレーション	11,200	518	5,801,600	
アスクル	17,600	1,105	19,448,000	
ゲオホールディングス	369	82,400	30,405,600	
ポイント	18,660	3,340	62,324,400	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	15,000	118	1,770,000	
くらコーポレーション	11,700	978	11,442,600	
キャンドウ	118	84,700	9,994,600	
パル	6,500	3,075	19,987,500	
エディオン	88,500	640	56,640,000	
サーラコーポレーション	19,000	483	9,177,000	
あみやき亭	35	188,300	6,590,500	
ひらまつ	96	64,800	6,220,800	
ゲンキー	1,700	1,723	2,929,100	
ハニーズ	19,630	1,173	23,025,990	
アルペン	14,200	1,350	19,170,000	
ビックカメラ	844	41,700	35,194,800	
D C Mホールディングス	114,400	611	69,898,400	
MonotaRO	12,700	851	10,807,700	
J・フロントリテイリング	522,000	368	192,096,000	
ドトール・日レスホールディングス	35,400	1,000	35,400,000	
マツモトキヨシホールディングス	41,100	1,585	65,143,500	
物語コーポレーション	2,500	1,296	3,240,000	
ココカラファイン	23,100	2,018	46,615,800	
三越伊勢丹ホールディングス	439,000	785	344,615,000	
クリエイトSDホールディングス	9,400	1,606	15,096,400	
丸善CHIホールディングス	7,600	263	1,998,800	
ブックオフコーポレーション	12,500	683	8,537,500	
あさひ	12,900	1,582	20,407,800	
サークルKサンクス	48,000	1,247	59,856,000	
日本調剤	2,990	2,683	8,022,170	
コスモス薬品	11,200	3,905	43,736,000	
セブン&アイ・ホールディングス	924,200	2,146	1,983,333,200	
ツルハホールディングス	19,800	4,200	83,160,000	
サンマルクホールディングス	6,400	2,954	18,905,600	
フェリシモ	6,500	974	6,331,000	
トリドール	19,400	749	14,530,600	
クスリのアオキ	3,300	1,290	4,257,000	
メディカルシステムネットワーク	4,400	790	3,476,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
総合メディカル	5,400	2,594	14,007,600	
はるやま商事	9,800	362	3,547,600	
カップ・クリエイト	16,350	1,807	29,544,450	
ライトオン	16,900	571	9,649,900	
良品計画	23,400	3,575	83,655,000	
三城ホールディングス	27,600	613	16,918,800	
コナカ	26,500	510	13,515,000	
ハウスオブローゼ	2,600	1,220	3,172,000	
G-7ホールディングス	7,100	372	2,641,200	
イオン北海道	14,300	343	4,904,900	
コジマ	30,200	503	15,190,600	
コーナン商事	23,900	1,252	29,922,800	
エコス	7,800	455	3,549,000	

ワタミ	26,400	1,845	48,708,000	
マルシェ	5,700	693	3,950,100	
ドン・キホーテ	42,800	2,626	112,392,800	
メガネトップ	31,900	901	28,741,900	
西松屋チェーン	48,800	601	29,328,800	
ゼンショーホールディングス	84,200	1,021	85,968,200	
幸楽苑	13,800	1,168	16,118,400	
ハークスレイ	5,800	527	3,056,600	
サイゼリヤ	32,900	1,296	42,638,400	
ポブラ	5,900	445	2,625,500	
ユナイテッドアローズ	24,000	1,460	35,040,000	
ハイデイ日高	9,900	1,225	12,127,500	
京都きもの友禅	15,700	907	14,239,900	
コロワイド	73,500	520	38,220,000	
壱番屋	9,000	2,300	20,700,000	
トップカルチャー	8,600	355	3,053,000	
スギホールディングス	39,600	2,196	86,961,600	
スクロール	29,500	272	8,024,000	
ファミリーマート	67,900	3,005	204,039,500	
木曽路	25,400	1,408	35,763,200	
千趣会	40,200	521	20,944,200	
タカキュー	19,000	133	2,527,000	
ケーヨー	41,800	479	20,022,200	
上新電機	48,000	848	40,704,000	
日本瓦斯	21,100	1,250	26,375,000	
マルエツ	45,000	285	12,825,000	
ロイヤルホールディングス	37,100	934	34,651,400	
東天紅	18,000	116	2,088,000	
いなげや	24,700	906	22,378,200	
島忠	50,000	1,750	87,500,000	
チヨダ	29,100	1,324	38,528,400	
ライフコーポレーション	14,000	1,482	20,748,000	
カスミ	45,500	484	22,022,000	
リンガーハット	20,200	1,058	21,371,600	
さが美	20,000	101	2,020,000	
MrMax	22,800	301	6,862,800	
デンアライド	17,500	269	4,707,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
AOKIホールディングス	21,000	1,199	25,179,000	
オークワ	32,000	1,298	41,536,000	
コメリ	30,300	2,333	70,689,900	
青山商事	60,900	1,281	78,012,900	
しまむら	25,700	7,550	194,035,000	
CFSコーポレーション	15,000	337	5,055,000	
高島屋	299,000	580	173,420,000	
松屋	44,800	465	20,832,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	115,000	592	68,080,000	
丸栄	38,000	89	3,382,000	
ニッセンホールディングス	44,600	425	18,955,000	
パルコ	40,400	581	23,472,400	
丸井グループ	287,900	583	167,845,700	
原信ナルスホールディングス	12,300	1,281	15,756,300	
ダイエー	136,850	284	38,865,400	
イズミヤ	77,000	428	32,956,000	

イオン	778,900	1,062	827,191,800	
ユニー	165,600	708	117,244,800	
イズミ	66,200	1,288	85,265,600	
東武ストア	30,000	260	7,800,000	
平和堂	40,800	977	39,861,600	
フジ	25,200	1,823	45,939,600	
ヤオコー	9,800	2,610	25,578,000	
ゼビオ	26,800	1,813	48,588,400	
ケーズホールディングス	55,100	3,115	171,636,500	
Olympic	14,800	722	10,685,600	
日産東京販売ホールディングス	33,000	151	4,983,000	
アインファーマシーズ	12,300	3,580	44,034,000	
元気寿司	7,000	955	6,685,000	
ヤマダ電機	107,480	5,500	591,140,000	
アークランドサカモト	14,600	1,441	21,038,600	
ニトリホールディングス	43,750	7,280	318,500,000	
グルメ杵屋	16,000	409	6,544,000	
愛眼	18,200	386	7,025,200	
吉野家ホールディングス	601	102,900	61,842,900	
松屋フーズ	10,800	1,500	16,200,000	
サガミチェーン	26,000	519	13,494,000	
プレナス	24,900	1,265	31,498,500	
ミニストップ	16,400	1,415	23,206,000	
アークス	30,499	1,496	45,626,504	
パロー	44,000	1,207	53,108,000	
ベルク	11,000	1,140	12,540,000	
大庄	10,600	978	10,366,800	
ファーストリテイリング	51,600	13,030	672,348,000	
サンドラッグ	42,000	2,425	101,850,000	
ヤマザワ	5,800	1,265	7,337,000	
やまや	3,700	964	3,566,800	
ペルーナ	27,950	570	15,931,500	
新生銀行	1,721,000	80	137,680,000	
あおぞら銀行	688,000	220	151,360,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	16,725,200	348	5,820,369,600	
りそなホールディングス	1,922,900	351	674,937,900	
三井住友トラスト・ホールディングス	4,330,000	251	1,086,830,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,670,900	2,273	3,797,955,700	
第四銀行	287,000	255	73,185,000	
北越銀行	230,000	162	37,260,000	
西日本シティ銀行	775,000	224	173,600,000	
札幌北洋ホールディングス	333,100	283	94,267,300	
千葉銀行	871,000	498	433,758,000	
横浜銀行	1,419,000	373	529,287,000	
常陽銀行	851,000	340	289,340,000	
群馬銀行	505,000	420	212,100,000	
武蔵野銀行	35,600	2,624	93,414,400	
千葉興業銀行	42,300	422	17,850,600	
筑波銀行	91,800	267	24,510,600	
東京都民銀行	41,800	930	38,874,000	
七十七銀行	346,000	329	113,834,000	
青森銀行	165,000	234	38,610,000	
秋田銀行	152,000	227	34,504,000	

山形銀行	134,000	379	50,786,000	
岩手銀行	14,900	3,480	51,852,000	
東邦銀行	186,000	218	40,548,000	
東北銀行	119,000	120	14,280,000	
みちのく銀行	110,000	150	16,500,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	896,000	325	291,200,000	
静岡銀行	667,000	796	530,932,000	
十六銀行	277,000	248	68,696,000	
スルガ銀行	215,000	700	150,500,000	
八十二銀行	407,000	455	185,185,000	
山梨中央銀行	135,000	337	45,495,000	
大垣共立銀行	295,000	250	73,750,000	
福井銀行	190,000	239	45,410,000	
北國銀行	264,000	276	72,864,000	
清水銀行	7,500	3,100	23,250,000	
滋賀銀行	208,000	527	109,616,000	
南都銀行	206,000	443	91,258,000	
百五銀行	200,000	306	61,200,000	
京都銀行	395,000	681	268,995,000	
三重銀行	91,000	177	16,107,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,548,000	150	232,200,000	
広島銀行	652,000	361	235,372,000	
山陰合同銀行	131,000	581	76,111,000	
中国銀行	181,000	1,063	192,403,000	
鳥取銀行	70,000	153	10,710,000	
伊予銀行	236,000	749	176,764,000	
百十四銀行	242,000	361	87,362,000	
四国銀行	159,000	293	46,587,000	
阿波銀行	195,000	519	101,205,000	
鹿児島銀行	143,000	537	76,791,000	
大分銀行	143,000	233	33,319,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
宮崎銀行	147,000	191	28,077,000	
肥後銀行	171,000	456	77,976,000	
佐賀銀行	134,000	197	26,398,000	
十八銀行	141,000	193	27,213,000	
沖縄銀行	16,700	3,515	58,700,500	
琉球銀行	46,400	938	43,523,200	
八千代銀行	11,500	1,890	21,735,000	
みずほフィナンシャルグループ	28,379,900	105	2,979,889,500	
紀陽ホールディングス	880,000	120	105,600,000	
山口フィナンシャルグループ	220,000	746	164,120,000	
長野銀行	72,000	163	11,736,000	
名古屋銀行	200,000	248	49,600,000	
愛知銀行	8,000	4,405	35,240,000	
第三銀行	125,000	161	20,125,000	
中京銀行	91,000	201	18,291,000	
東日本銀行	106,000	164	17,384,000	
大光銀行	78,000	241	18,798,000	
愛媛銀行	139,000	225	31,275,000	
トマト銀行	85,000	131	11,135,000	
みなと銀行	200,000	146	29,200,000	
京葉銀行	182,000	378	68,796,000	
関西アーバン銀行	308,000	128	39,424,000	

栃木銀行	111,000	276	30,636,000	
北日本銀行	6,900	1,801	12,426,900	
東和銀行	222,000	95	21,090,000	
福島銀行	256,000	39	9,984,000	
大東銀行	140,000	62	8,680,000	
トモニホールディングス	170,000	326	55,420,000	
フィデアホールディングス	127,100	199	25,292,900	
池田泉州ホールディングス	911,600	117	106,657,200	
S B Iホールディングス	23,330	6,360	148,378,800	
ジャフコ	28,700	1,421	40,782,700	
大和証券グループ本社	2,189,000	258	564,762,000	
野村ホールディングス	4,782,500	266	1,272,145,000	
岡三証券グループ	188,000	246	46,248,000	
丸三証券	74,800	249	18,625,200	
東洋証券	83,000	111	9,213,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	254,000	223	56,642,000	
光世証券	54,000	58	3,132,000	
水戸証券	65,000	100	6,500,000	
いちよし証券	49,600	393	19,492,800	
松井証券	131,200	384	50,380,800	
だいこう証券ビジネス	12,800	245	3,136,000	
マネックスグループ	1,784	12,900	23,013,600	
カブドットコム証券	90,400	234	21,153,600	
極東証券	29,800	421	12,545,800	
岩井コスモホールディングス	21,200	247	5,236,400	
N K S Jホールディングス	461,900	1,532	707,630,800	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	660,300	1,459	963,377,700	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ソニーフィナンシャルホールディングス	211,600	1,204	254,766,400	
第一生命保険	11,816	83,200	983,091,200	
東京海上ホールディングス	838,800	1,789	1,500,613,200	
T & Dホールディングス	805,200	769	619,198,800	
クレディセゾン	180,500	1,484	267,862,000	
芙蓉総合リース	22,000	2,748	60,456,000	
興銀リース	32,300	1,697	54,813,100	
東京センチュリーリース	59,300	1,510	89,543,000	
日本証券金融	98,300	359	35,289,700	
大阪証券金融	42,800	163	6,976,400	
ポケットカード	31,500	267	8,410,500	
リコーリース	16,600	1,727	28,668,200	
イオンクレジットサービス	98,200	1,153	113,224,600	
アコム	46,340	1,365	63,254,100	
ジャックス	145,000	235	34,075,000	
オリエントコーポレーション	356,000	72	25,632,000	
日立キャピタル	45,800	1,052	48,181,600	
オリックス	114,950	6,620	760,969,000	
三菱UFJリース	56,040	3,075	172,323,000	
アサックス	58	86,400	5,011,200	
N E Cキャピタルソリューション	9,800	1,114	10,917,200	
日本駐車場開発	2,710	3,525	9,552,750	
昭栄	42,200	565	23,843,000	
東京建物不動産販売	14,000	219	3,066,000	
野村不動産ホールディングス	105,900	1,196	126,656,400	

常和ホールディングス	4,800	1,238	5,942,400	
ヒューリック	73,000	867	63,291,000	
パーク24	113,900	967	110,141,300	
三井不動産	980,000	1,220	1,195,600,000	
三菱地所	1,546,000	1,293	1,998,978,000	
平和不動産	216,000	160	34,560,000	
東京建物	421,000	227	95,567,000	
ダイビル	67,200	513	34,473,600	
サンケイビル	41,600	309	12,854,400	
東急不動産	445,000	304	135,280,000	
京阪神ビルディング	29,600	345	10,212,000	
住友不動産	529,000	1,495	790,855,000	
東宝不動産	25,800	406	10,474,800	
大京	348,000	160	55,680,000	
テーオーシー	88,900	350	31,115,000	
東京楽天地	40,000	272	10,880,000	
フジ住宅	31,200	369	11,512,800	
空港施設	26,600	306	8,139,600	
明和地所	14,200	341	4,842,200	
住友不動産販売	8,330	3,105	25,864,650	
ゴールドクレスト	20,790	1,280	26,611,200	
東栄住宅	16,500	773	12,754,500	
日本エスリード	10,300	673	6,931,900	
東急リバブル	22,000	598	13,156,000	
飯田産業	26,900	602	16,193,800	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日神不動産	15,700	449	7,049,300	
アーネストワン	38,000	811	30,818,000	
タカラレーベン	28,200	474	13,366,800	
サンヨーハウジング名古屋	108	72,700	7,851,600	
イオンモール	100,700	1,720	173,204,000	
フージャースコーポレーション	381	29,430	11,212,830	
タクトホーム	134	63,800	8,549,200	
トーセイ	275	20,370	5,601,750	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,373	54,000	74,142,000	
ランドビジネス	223	15,340	3,420,820	
日本空港ビルディング	70,500	1,019	71,839,500	
日本工営	79,000	277	21,883,000	
ネクスト	9,400	296	2,782,400	
日本M&Aセンター	47	407,000	19,129,000	
ノバレーゼ	55	51,200	2,816,000	
アコーディア・ゴルフ	961	57,800	55,545,800	
パソナグループ	234	76,800	17,971,200	
リンクアンドモチベーション	51	40,550	2,068,050	
テンプホールディングス	32,100	722	23,176,200	
学情	8,300	243	2,016,900	
スタジオアリス	11,200	1,226	13,731,200	
シミック	7,700	1,283	9,879,100	
NECフィールディング	19,000	1,010	19,190,000	
総合警備保障	85,100	822	69,952,200	
カクコム	36,300	2,951	107,121,300	
ルネサンス	11,800	376	4,436,800	
新日本科学	15,200	199	3,024,800	
エムスリー	184	340,000	62,560,000	

ベストブライダル	58	71,500	4,147,000	
ディー・エヌ・エー	104,800	2,413	252,882,400	
博報堂D Yホールディングス	29,710	4,295	127,604,450	
ぐるなび	16,800	886	14,884,800	
一休	168	32,600	5,476,800	
ジャパンベストレスキューシステム	36	70,500	2,538,000	
ジェイコムホールディングス	4,300	711	3,057,300	
P G Mホールディングス	288	51,600	14,860,800	
イーピーエス	127	155,100	19,697,700	
アミューズ	7,000	950	6,650,000	
ドリームインキュベータ	76	57,800	4,392,800	
T A C	15,900	173	2,750,700	
ケネディクス	2,649	12,460	33,006,540	
電通	212,700	2,338	497,292,600	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,117	4,885	5,456,545	
イオンファンタジー	8,000	1,223	9,784,000	
みらかホールディングス	61,000	3,035	185,135,000	
アルプス技研	10,400	748	7,779,200	
サニックス	36,200	263	9,520,600	
ダイオーズ	4,600	479	2,203,400	
日本空調サービス	6,000	701	4,206,000	
オリエンタルランド	63,200	8,000	505,600,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
ダスキン	70,300	1,508	106,012,400	
明光ネットワークジャパン	22,000	657	14,454,000	
ファルコS Dホールディングス	13,200	896	11,827,200	
秀英予備校	5,900	297	1,752,300	
田谷	4,300	653	2,807,900	
ラウンドワン	74,100	481	35,642,100	
リゾートトラスト	37,000	1,142	42,254,000	
ビー・エム・エル	15,400	1,885	29,029,000	
ワタベウェディング	7,700	660	5,082,000	
もしもしホットライン	38,900	699	27,191,100	
東急コミュニティー	6,200	2,401	14,886,200	
リソー教育	2,491	4,555	11,346,505	
ウェアハウス	6,100	235	1,433,500	
ユー・エス・エス	30,480	6,780	206,654,400	
東京個別指導学院	15,300	143	2,187,900	
テー・オー・ダブリュー	7,400	465	3,441,000	
セントラルスポーツ	7,700	973	7,492,100	
リゾートソリューション	23,000	141	3,243,000	
エイチ・アイ・エス	24,100	1,972	47,525,200	
共立メンテナンス	12,000	1,407	16,884,000	
イチネンホールディングス	24,900	391	9,735,900	
建設技術研究所	13,100	520	6,812,000	
燦ホールディングス	5,500	1,360	7,480,000	
スバル興業	25,000	242	6,050,000	
東京テアトル	99,000	106	10,494,000	
ホリプロ	8,700	629	5,472,300	
よみうりランド	49,000	244	11,956,000	
東京都競馬	185,000	108	19,980,000	
カナモト	30,000	544	16,320,000	
東京ドーム	190,000	179	34,010,000	
トランス・コスモス	30,600	901	27,570,600	

乃村工藝社	47,000	239	11,233,000	
藤田観光	61,000	273	16,653,000	
日本管財	8,700	1,398	12,162,600	
トーカイ	9,700	1,666	16,160,200	
白洋舎	27,000	216	5,832,000	
セコム	227,000	3,485	791,095,000	
セントラル警備保障	10,500	780	8,190,000	
丹青社	45,000	207	9,315,000	
メイテック	36,700	1,459	53,545,300	
アサツー ディ・ケイ	40,800	2,046	83,476,800	
応用地質	24,500	765	18,742,500	
船井総合研究所	24,200	542	13,116,400	
進学会	13,000	279	3,627,000	
ベネッセホールディングス	72,400	3,630	262,812,000	
イオンディライト	26,500	1,566	41,499,000	
ナック	6,600	1,453	9,589,800	
ニチイ学館	46,300	892	41,299,600	
ダイセキ	37,800	1,382	52,239,600	
合計	337,642,338		227,745,481,044	

（注）代用有価証券の担保差入株数には、約定未受渡株数を含んでおります。

B．株式以外の有価証券

該当事項はありません。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「中央三井日本債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成23年12月12日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,535,673,930
国債証券	261,780,519,700
地方債証券	22,881,626,016
特殊債券	35,138,442,582
社債券	24,705,007,000
派生商品評価勘定	7,781,780
未収利息	1,423,520,531
前払費用	66,244,254
流動資産合計	351,538,815,793
資産合計	351,538,815,793
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	41,470
前受金	9,070,000
未払解約金	226,778,365
流動負債合計	235,889,835
負債合計	235,889,835
純資産の部	
元本等	
元本	293,753,774,081
剰余金	
剰余金	57,549,151,877
純資産合計	351,302,925,958
負債・純資産合計	351,538,815,793

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成23年12月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法（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。</p> <p>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。</p>

2．デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3．収益及び費用の計上基準	<p>派生商品取引等損益の計上基準</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成23年12月12日現在	
1．担保に供している資産	<p>先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。</p> <p style="text-align: right;">国債証券 51,815,000 円</p> <p>なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおりません。</p>
2．計算日における受益権総数	293,753,774,081 口
3．1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1959 円 (11,959 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23年12月12日現在	
1．金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスク、信用リスク及び流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。</p>

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23年12月12日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

(1) 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

(2) デリバティブ取引

「（その他の注記）」の「3. デリバティブ取引関係」に記載しております。

(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

4. 金銭債権の計算日後の償還予定額

金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

平成23年12月12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23年12月12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23年12月12日現在

特定期間の期首元本額

300,428,271,266 円

特定期間中の追加設定元本額	34,420,450,571 円
特定期間中の一部解約元本額	41,094,947,756 円
計算日の元本額	293,753,774,081 円
計算日の元本額の内訳	
中央三井日本債券インデックスファンド	6,408,683,429 円
中央三井DC日本債券インデックスファンド	2,018,732,045 円
中央三井DC日本債券インデックスファンドL	20,846,775,191 円
中央三井DCバランスファンド30	741,464,004 円
中央三井DCバランスファンド50	738,140,641 円
中央三井DCバランスファンド70	184,338,773 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	174,143,676 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	107,903,212 円
中央三井日本債券インデックスファンド(SMA専用)	4,568,331,706 円
新生・4分散ファンド	132,799,250 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	67,951,291 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	133,318,541 円
日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)	452,255,968 円
CMAM日本債券インデックスe	337,989,862 円
中央三井インデックスコレクション(国内債券)	1,722,316,362 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式30)	801,648,706 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式50)	744,582,732 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式70)	282,820,331 円
中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)	9,961,438,941 円
中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)	31,402,172,205 円
中央三井VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	27,199,174,599 円
中央三井VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	1,405,242,909 円
中央三井VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	6,713,640,605 円
中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)	10,770,622,777 円
中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,387,456,937 円
中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)	24,547,246,744 円
中央三井バランスVA75(適格機関投資家専用)	246,015,300 円
中央三井VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	28,537,333,682 円
中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	6,793,384,822 円
中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	635,165,072 円
中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)	3,245,536,074 円
中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	1,689,731,343 円
CMAM・バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	4,841,606,083 円
中央三井VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	991,506,004 円
CMAM・VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	1,727,934,724 円
中央三井バランスVA20(適格機関投資家専用)	4,751,457,894 円
中央三井VAファンド25(適格機関投資家専用)	4,122,823,455 円
CMAM・バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	6,445,687,612 円
中央三井バランスVA20L(適格機関投資家専用)	624,023,625 円
中央三井バランスVA25L(適格機関投資家専用)	3,966,819,766 円
CMAM・バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	44,420,848,263 円
中央三井世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	1,256,030,992 円
中央三井国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	323,206,262 円

中央三井国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	138,923,255 円
CMAM・VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	922,490,538 円
私募日本債券インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	7,961,529 円
CMAM私募日本債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	23,191,829,497 円
中央三井世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	22,266,852 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成23年12月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,606,858,100
地方債証券	266,734,657
特殊債券	286,106,672
社債券	514,662,000
合計	3,645,037,429

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「中央三井日本債券マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成23年1月25日から平成23年12月12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23年12月12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	3,825,449,690		3,833,190,000	7,740,310
	合計	3,825,449,690		3,833,190,000	7,740,310

(注) 1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

. ヘッジ会計が適用されているもの

平成23年12月12日現在
該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表（平成23年12月12日現在）

有価証券明細表

A．株式

該当事項はありません。

B．株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債 証券	利付国庫債券（2年）第300回	1,300,000,000	1,301,118,000	
	利付国庫債券（2年）第301回	1,500,000,000	1,501,305,000	
	利付国庫債券（2年）第302回	1,500,000,000	1,501,395,000	
	利付国庫債券（2年）第303回	2,300,000,000	2,302,277,000	
	利付国庫債券（2年）第304回	500,000,000	500,525,000	
	利付国庫債券（2年）第305回	1,800,000,000	1,802,016,000	
	利付国庫債券（2年）第306回	600,000,000	600,708,000	
	利付国庫債券（2年）第307回	2,400,000,000	2,402,976,000	
	利付国庫債券（2年）第308回	600,000,000	599,736,000	
	利付国庫債券（2年）第309回	2,900,000,000	2,898,666,000	
	利付国庫債券（2年）第310回	1,200,000,000	1,201,716,000	
	利付国庫債券（5年）第70回	1,700,000,000	1,714,535,000	
	利付国庫債券（5年）第71回	2,100,000,000	2,131,164,000	
	利付国庫債券（5年）第72回	1,200,000,000	1,224,996,000	
	利付国庫債券（5年）第73回	1,200,000,000	1,221,372,000	
	利付国庫債券（5年）第74回	1,300,000,000	1,317,264,000	
	利付国庫債券（5年）第75回	600,000,000	610,296,000	
	利付国庫債券（5年）第76回	1,800,000,000	1,834,056,000	
	利付国庫債券（5年）第77回	1,100,000,000	1,116,940,000	
	利付国庫債券（5年）第78回	700,000,000	710,752,000	
	利付国庫債券（5年）第79回	1,700,000,000	1,719,278,000	
	利付国庫債券（5年）第80回	1,300,000,000	1,317,355,000	
	利付国庫債券（5年）第81回	1,700,000,000	1,724,888,000	
	利付国庫債券（5年）第82回	2,100,000,000	2,135,469,000	
	利付国庫債券（5年）第83回	2,000,000,000	2,036,760,000	
	利付国庫債券（5年）第84回	1,800,000,000	1,824,084,000	
	利付国庫債券（5年）第85回	2,100,000,000	2,129,442,000	
	利付国庫債券（5年）第86回	2,500,000,000	2,528,525,000	
	利付国庫債券（5年）第87回	4,100,000,000	4,135,588,000	
	利付国庫債券（5年）第88回	2,800,000,000	2,823,996,000	
利付国庫債券（5年）第89回	2,400,000,000	2,412,096,000		
利付国庫債券（5年）第90回	1,900,000,000	1,902,964,000		

利付国庫債券（5年）第91回	1,000,000,000	1,004,650,000	
利付国庫債券（5年）第92回	2,000,000,000	2,001,860,000	
利付国庫債券（5年）第93回	2,300,000,000	2,319,159,000	
利付国庫債券（5年）第94回	2,000,000,000	2,024,580,000	
利付国庫債券（5年）第95回	1,900,000,000	1,922,762,000	
利付国庫債券（5年）第96回	2,400,000,000	2,418,648,000	
利付国庫債券（5年）第97回	1,600,000,000	1,604,608,000	
利付国庫債券（5年）第98回	2,000,000,000	1,996,880,000	
利付国庫債券（5年）第99回	2,400,000,000	2,405,040,000	
利付国庫債券（5年）第100回	2,000,000,000	1,995,300,000	
利付国庫債券（40年）第1回	400,000,000	431,812,000	
利付国庫債券（40年）第2回	600,000,000	615,108,000	
利付国庫債券（40年）第3回	600,000,000	614,028,000	
利付国庫債券（40年）第4回	600,000,000	611,592,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債 証券	利付国庫債券（10年）第247回	910,000,000	917,780,500	
	利付国庫債券（10年）第248回	170,000,000	171,239,300	
	利付国庫債券（10年）第249回	760,000,000	764,590,400	
	利付国庫債券（10年）第250回	600,000,000	603,438,000	
	利付国庫債券（10年）第251回	770,000,000	779,062,900	
	利付国庫債券（10年）第252回	730,000,000	739,694,400	
	利付国庫債券（10年）第253回	1,350,000,000	1,385,046,000	
	利付国庫債券（10年）第254回	520,000,000	531,668,800	
	利付国庫債券（10年）第255回	710,000,000	727,182,000	
	利付国庫債券（10年）第256回	1,040,000,000	1,066,416,000	
	利付国庫債券（10年）第257回	400,000,000	409,356,000	
	利付国庫債券（10年）第258回	480,000,000	492,432,000	
	利付国庫債券（10年）第259回	1,180,000,000	1,215,883,800	
	利付国庫債券（10年）第260回	860,000,000	890,874,000	
	利付国庫債券（10年）第261回	790,000,000	822,311,000	
	利付国庫債券（10年）第262回	730,000,000	761,682,000	
	利付国庫債券（10年）第263回	750,000,000	779,287,500	
	利付国庫債券（10年）第264回	730,000,000	756,499,000	（注）
	利付国庫債券（10年）第265回	730,000,000	758,309,400	
	利付国庫債券（10年）第266回	560,000,000	580,042,400	
利付国庫債券（10年）第267回	410,000,000	423,443,900		

利付国庫債券（10年）第268回	900,000,000	936,981,000	
利付国庫債券（10年）第269回	1,740,000,000	1,800,238,800	
利付国庫債券（10年）第270回	700,000,000	725,585,000	
利付国庫債券（10年）第271回	1,400,000,000	1,446,550,000	
利付国庫債券（10年）第272回	1,500,000,000	1,563,150,000	
利付国庫債券（10年）第273回	1,000,000,000	1,046,030,000	
利付国庫債券（10年）第274回	900,000,000	943,200,000	
利付国庫債券（10年）第275回	1,200,000,000	1,252,836,000	
利付国庫債券（10年）第276回	800,000,000	841,744,000	
利付国庫債券（10年）第277回	1,600,000,000	1,686,784,000	
利付国庫債券（10年）第278回	700,000,000	743,855,000	
利付国庫債券（10年）第279回	700,000,000	749,896,000	
利付国庫債券（10年）第280回	1,500,000,000	1,605,060,000	
利付国庫債券（10年）第281回	1,000,000,000	1,074,480,000	
利付国庫債券（10年）第282回	1,800,000,000	1,914,318,000	
利付国庫債券（10年）第283回	1,400,000,000	1,495,480,000	
利付国庫債券（10年）第284回	2,950,000,000	3,143,903,500	
利付国庫債券（10年）第285回	3,400,000,000	3,631,438,000	
利付国庫債券（10年）第286回	1,700,000,000	1,828,350,000	
利付国庫債券（10年）第287回	900,000,000	972,810,000	
利付国庫債券（10年）第288回	3,000,000,000	3,214,290,000	
利付国庫債券（10年）第289回	2,700,000,000	2,864,295,000	
利付国庫債券（10年）第290回	600,000,000	633,162,000	
利付国庫債券（10年）第291回	1,300,000,000	1,363,947,000	
利付国庫債券（10年）第292回	800,000,000	859,056,000	
利付国庫債券（10年）第293回	2,200,000,000	2,378,112,000	
利付国庫債券（10年）第294回	1,200,000,000	1,289,592,000	
利付国庫債券（10年）第295回	700,000,000	743,211,000	
利付国庫債券（10年）第296回	1,800,000,000	1,911,510,000	
利付国庫債券（10年）第297回	1,200,000,000	1,266,312,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	利付国庫債券（10年）第298回	1,200,000,000	1,257,804,000	
	利付国庫債券（10年）第299回	1,100,000,000	1,152,767,000	
	利付国庫債券（10年）第300回	1,400,000,000	1,487,654,000	
	利付国庫債券（10年）第301回	900,000,000	955,818,000	
	利付国庫債券（10年）第302回	1,800,000,000	1,898,730,000	

利付国庫債券（10年）第303回	1,200,000,000	1,264,176,000	
利付国庫債券（10年）第304回	1,400,000,000	1,464,008,000	
利付国庫債券（10年）第305回	3,400,000,000	3,549,396,000	
利付国庫債券（10年）第306回	1,200,000,000	1,259,688,000	
利付国庫債券（10年）第307回	2,200,000,000	2,292,334,000	
利付国庫債券（10年）第308回	1,400,000,000	1,455,776,000	
利付国庫債券（10年）第309回	1,700,000,000	1,739,253,000	
利付国庫債券（10年）第310回	1,300,000,000	1,315,899,000	
利付国庫債券（10年）第311回	2,000,000,000	1,990,200,000	
利付国庫債券（10年）第312回	3,700,000,000	3,797,273,000	
利付国庫債券（10年）第313回	2,800,000,000	2,892,008,000	
利付国庫債券（10年）第314回	1,900,000,000	1,928,348,000	
利付国庫債券（10年）第315回	2,600,000,000	2,655,536,000	
利付国庫債券（10年）第316回	1,400,000,000	1,417,080,000	
利付国庫債券（10年）第317回	1,800,000,000	1,817,622,000	
利付国庫債券（10年）第318回	2,700,000,000	2,701,188,000	
利付国庫債券（30年）第1回	50,000,000	58,664,500	
利付国庫債券（30年）第2回	100,000,000	111,033,000	
利付国庫債券（30年）第3回	330,000,000	361,072,800	
利付国庫債券（30年）第4回	190,000,000	226,381,200	
利付国庫債券（30年）第5回	180,000,000	193,708,800	
利付国庫債券（30年）第6回	270,000,000	299,697,300	
利付国庫債券（30年）第7回	190,000,000	207,284,300	
利付国庫債券（30年）第8回	270,000,000	271,236,600	
利付国庫債券（30年）第9回	180,000,000	168,123,600	
利付国庫債券（30年）第10回	170,000,000	149,404,500	
利付国庫債券（30年）第11回	310,000,000	304,953,200	
利付国庫債券（30年）第12回	370,000,000	389,795,000	
利付国庫債券（30年）第13回	250,000,000	258,697,500	
利付国庫債券（30年）第14回	350,000,000	387,684,500	
利付国庫債券（30年）第15回	440,000,000	496,095,600	
利付国庫債券（30年）第16回	250,000,000	281,667,500	
利付国庫債券（30年）第17回	330,000,000	365,488,200	
利付国庫債券（30年）第18回	660,000,000	719,413,200	
利付国庫債券（30年）第19回	270,000,000	294,246,000	
利付国庫債券（30年）第20回	140,000,000	157,754,800	
利付国庫債券（30年）第21回	420,000,000	456,737,400	
利付国庫債券（30年）第22回	300,000,000	338,316,000	
利付国庫債券（30年）第23回	400,000,000	451,460,000	

利付国庫債券（30年）第24回	200,000,000	225,524,000	
利付国庫債券（30年）第25回	700,000,000	762,335,000	
利付国庫債券（30年）第26回	700,000,000	776,300,000	
利付国庫債券（30年）第27回	900,000,000	1,017,153,000	
利付国庫債券（30年）第28回	900,000,000	1,017,783,000	
利付国庫債券（30年）第29回	900,000,000	999,342,000	
利付国庫債券（30年）第30回	900,000,000	978,705,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債 証券	利付国庫債券（30年）第31回	1,400,000,000	1,489,866,000	
	利付国庫債券（30年）第32回	1,200,000,000	1,300,212,000	
	利付国庫債券（30年）第33回	1,500,000,000	1,525,050,000	
	利付国庫債券（30年）第34回	1,400,000,000	1,483,160,000	
	利付国庫債券（30年）第35回	700,000,000	709,261,000	
	利付国庫債券（20年）第21回	40,000,000	42,808,400	
	利付国庫債券（20年）第22回	170,000,000	181,080,600	
	利付国庫債券（20年）第23回	130,000,000	142,300,600	
	利付国庫債券（20年）第24回	160,000,000	176,417,600	
	利付国庫債券（20年）第25回	80,000,000	87,128,000	
	利付国庫債券（20年）第26回	50,000,000	55,937,500	
	利付国庫債券（20年）第27回	410,000,000	464,337,300	
	利付国庫債券（20年）第28回	110,000,000	127,061,000	
	利付国庫債券（20年）第29回	100,000,000	114,698,000	
	利付国庫債券（20年）第30回	200,000,000	225,666,000	
	利付国庫債券（20年）第31回	280,000,000	317,713,200	
	利付国庫債券（20年）第32回	80,000,000	91,448,800	
	利付国庫債券（20年）第33回	430,000,000	499,986,800	
	利付国庫債券（20年）第34回	70,000,000	81,368,000	
	利付国庫債券（20年）第35回	270,000,000	310,977,900	
	利付国庫債券（20年）第37回	410,000,000	471,971,500	
	利付国庫債券（20年）第39回	640,000,000	722,675,200	
	利付国庫債券（20年）第40回	450,000,000	501,520,500	
	利付国庫債券（20年）第41回	620,000,000	658,588,800	
	利付国庫債券（20年）第42回	380,000,000	433,325,400	
	利付国庫債券（20年）第43回	340,000,000	396,688,200	
	利付国庫債券（20年）第44回	370,000,000	420,690,000	
利付国庫債券（20年）第45回	470,000,000	531,147,000		

利付国庫債券（20年）第46回	290,000,000	322,630,800	
利付国庫債券（20年）第47回	470,000,000	523,048,900	
利付国庫債券（20年）第48回	230,000,000	261,999,900	
利付国庫債券（20年）第49回	280,000,000	309,131,200	
利付国庫債券（20年）第50回	590,000,000	640,728,200	
利付国庫債券（20年）第51回	240,000,000	262,792,800	
利付国庫債券（20年）第52回	430,000,000	474,621,100	
利付国庫債券（20年）第53回	350,000,000	385,920,500	
利付国庫債券（20年）第54回	280,000,000	311,432,800	
利付国庫債券（20年）第55回	490,000,000	535,604,300	
利付国庫債券（20年）第56回	410,000,000	447,933,200	
利付国庫債券（20年）第57回	260,000,000	281,455,200	
利付国庫債券（20年）第58回	350,000,000	378,406,000	
利付国庫債券（20年）第59回	440,000,000	466,162,400	
利付国庫債券（20年）第60回	570,000,000	586,222,200	
利付国庫債券（20年）第61回	390,000,000	383,974,500	
利付国庫債券（20年）第62回	250,000,000	239,885,000	
利付国庫債券（20年）第63回	770,000,000	821,713,200	
利付国庫債券（20年）第64回	410,000,000	441,406,000	
利付国庫債券（20年）第65回	370,000,000	398,027,500	
利付国庫債券（20年）第66回	540,000,000	574,921,800	
利付国庫債券（20年）第67回	560,000,000	601,249,600	
利付国庫債券（20年）第68回	230,000,000	254,718,100	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債 証券	利付国庫債券（20年）第69回	260,000,000	285,009,400	
	利付国庫債券（20年）第70回	400,000,000	451,724,000	
	利付国庫債券（20年）第71回	700,000,000	774,046,000	
	利付国庫債券（20年）第72回	1,120,000,000	1,224,787,200	
	利付国庫債券（20年）第73回	440,000,000	475,072,400	
	利付国庫債券（20年）第74回	310,000,000	338,544,800	
	利付国庫債券（20年）第75回	360,000,000	392,796,000	
	利付国庫債券（20年）第76回	630,000,000	671,989,500	
	利付国庫債券（20年）第77回	310,000,000	334,542,700	
	利付国庫債券（20年）第78回	200,000,000	212,934,000	
	利付国庫債券（20年）第79回	300,000,000	323,205,000	
	利付国庫債券（20年）第80回	350,000,000	381,304,000	

利付国庫債券（20年）第81回	920,000,000	989,984,400	
利付国庫債券（20年）第82回	510,000,000	555,038,100	
利付国庫債券（20年）第83回	530,000,000	575,823,800	
利付国庫債券（20年）第84回	600,000,000	644,436,000	
利付国庫債券（20年）第85回	750,000,000	813,855,000	
利付国庫債券（20年）第86回	270,000,000	299,953,800	
利付国庫債券（20年）第87回	500,000,000	548,850,000	
利付国庫債券（20年）第88回	400,000,000	443,688,000	
利付国庫債券（20年）第89回	800,000,000	877,192,000	
利付国庫債券（20年）第90回	900,000,000	985,680,000	
利付国庫債券（20年）第91回	600,000,000	664,848,000	
利付国庫債券（20年）第92回	1,100,000,000	1,188,154,000	
利付国庫債券（20年）第93回	700,000,000	745,311,000	
利付国庫債券（20年）第94回	700,000,000	754,964,000	
利付国庫債券（20年）第95回	500,000,000	552,070,000	
利付国庫債券（20年）第96回	400,000,000	430,472,000	
利付国庫債券（20年）第97回	700,000,000	761,985,000	
利付国庫債券（20年）第98回	600,000,000	645,072,000	
利付国庫債券（20年）第99回	1,400,000,000	1,502,634,000	
利付国庫債券（20年）第100回	900,000,000	977,238,000	
利付国庫債券（20年）第101回	400,000,000	445,892,000	
利付国庫債券（20年）第102回	400,000,000	445,576,000	
利付国庫債券（20年）第103回	400,000,000	440,020,000	
利付国庫債券（20年）第104回	700,000,000	749,140,000	
利付国庫債券（20年）第105回	1,100,000,000	1,176,582,000	
利付国庫債券（20年）第106回	200,000,000	216,864,000	
利付国庫債券（20年）第107回	500,000,000	534,145,000	
利付国庫債券（20年）第108回	1,300,000,000	1,350,349,000	
利付国庫債券（20年）第109回	700,000,000	725,942,000	
利付国庫債券（20年）第110回	700,000,000	746,830,000	
利付国庫債券（20年）第111回	600,000,000	648,354,000	
利付国庫債券（20年）第112回	1,100,000,000	1,172,028,000	
利付国庫債券（20年）第113回	1,100,000,000	1,170,411,000	
利付国庫債券（20年）第114回	1,500,000,000	1,593,720,000	
利付国庫債券（20年）第115回	800,000,000	862,896,000	
利付国庫債券（20年）第116回	600,000,000	646,302,000	
利付国庫債券（20年）第117回	1,500,000,000	1,592,475,000	
利付国庫債券（20年）第118回	800,000,000	835,552,000	
利付国庫債券（20年）第119回	400,000,000	405,344,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	利付国庫債券（20年）第120回	600,000,000	589,062,000	
	利付国庫債券（20年）第121回	600,000,000	616,632,000	
	利付国庫債券（20年）第122回	1,400,000,000	1,415,876,000	
	利付国庫債券（20年）第123回	1,100,000,000	1,165,736,000	
	利付国庫債券（20年）第124回	500,000,000	521,550,000	
	利付国庫債券（20年）第125回	900,000,000	967,392,000	
	利付国庫債券（20年）第126回	700,000,000	729,407,000	
	利付国庫債券（20年）第127回	800,000,000	821,424,000	
	利付国庫債券（20年）第128回	900,000,000	922,311,000	
	利付国庫債券（20年）第129回	700,000,000	706,629,000	
	利付国庫債券（20年）第130回	1,100,000,000	1,108,888,000	
	利付国庫債券（20年）第131回	500,000,000	495,600,000	
国債証券 小計		251,110,000,000	261,780,519,700	
地方債証券	東京都公募公債第598回	103,000,000	103,511,910	
	東京都公募公債第602回	200,000,000	204,516,000	
	東京都公募公債第605回	100,000,000	102,527,000	
	東京都公募公債第608回	100,000,000	103,106,000	
	東京都公募公債第609回	200,000,000	205,940,000	
	東京都公募公債第613回	100,000,000	103,617,000	
	東京都公募公債第616回	100,000,000	103,429,000	
	東京都公募公債第617回	100,000,000	103,399,000	
	東京都公募公債第619回	100,000,000	104,032,000	
	東京都公募公債第624回	100,000,000	104,149,000	
	東京都公募公債第625回	100,000,000	104,046,000	
	東京都公募公債第626回	100,000,000	104,753,000	
	東京都公募公債第627回	100,000,000	104,455,000	
	東京都公募公債第628回	100,000,000	104,951,000	
	東京都公募公債第637回	180,000,000	191,905,200	
	東京都公募公債第642回	100,000,000	106,984,000	
	東京都公募公債第646回	100,000,000	108,235,000	
	東京都公募公債第647回	100,000,000	108,127,000	
	東京都公募公債第656回	100,000,000	105,849,000	
	東京都公募公債第657回	100,000,000	107,700,000	
東京都公募公債第659回	100,000,000	106,565,000		
東京都公募公債第668回	100,000,000	106,103,000		

東京都公募公債第681回	100,000,000	104,489,000	
東京都公募公債第682回	100,000,000	103,870,000	
東京都公募公債第692回	100,000,000	103,450,000	
東京都公募公債（20年）第3回	100,000,000	110,505,000	
東京都公募公債（20年）第11回	200,000,000	216,676,000	
東京都公募公債（20年）第18回	200,000,000	214,454,000	
東京都公募公債（20年）第20回	100,000,000	104,965,000	
東京都公募公債（20年）第21回	100,000,000	106,319,000	
北海道平成17年度第1回公募公債	100,000,000	103,395,000	
北海道平成19年度第14回公募公債（10年）	100,000,000	106,342,000	
北海道平成20年度第14回公募公債	100,000,000	106,882,000	
北海道平成20年度第15回公募公債（5年）	100,000,000	102,057,000	
北海道平成21年度第6回公募公債	100,000,000	105,770,000	
北海道平成22年度第1回公募公債	100,000,000	104,278,000	
宮城県公募公債第28回1号	100,000,000	100,667,000	
神奈川県第126回公募公債	100,000,000	103,019,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
地方債 証券	神奈川県第127回公募公債	100,000,000	104,070,000	
	神奈川県第130回公募公債	100,000,000	103,474,000	
	神奈川県第134回公募公債	100,000,000	103,923,000	
	神奈川県第135回公募公債	100,000,000	104,814,000	
	神奈川県第143回公募公債	150,000,000	159,882,000	
	神奈川県第144回公募公債	100,000,000	106,883,000	
	神奈川県第162回公募公債	100,000,000	106,573,000	
	神奈川県第168回公募公債	100,000,000	104,339,000	
	神奈川県第173回公募公債	100,000,000	103,409,000	
	神奈川県第174回公募公債	100,000,000	102,337,000	
	神奈川県第175回公募公債	100,000,000	101,703,000	
	第254回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,509,000	
	第267回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,275,000	
	第275回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	102,995,000	
	第285回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,305,000	
	第286回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,364,000	
	第293回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	107,527,000	
	第298回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	107,021,000	
	第305回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	107,616,000	
	第309回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	106,152,000	

第324回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,264,000	
第331回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,327,000	
第334回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,554,000	
第335回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,591,000	
第339回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,400,000	
第50回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	101,548,000	
京都府平成17年度第3回公募公債	100,000,000	104,566,000	
京都府平成20年度第6回公募公債	100,000,000	105,624,000	
京都府平成21年度第4回公募公債	100,000,000	100,945,000	
京都府平成21年度第5回公募公債	100,000,000	104,229,000	
京都府平成22年度第4回公募公債	100,000,000	100,534,000	
兵庫県平成16年度第10回公募公債	100,000,000	103,448,000	
兵庫県平成17年度第3回公募公債	100,000,000	103,180,000	
兵庫県平成18年度第3回公募公債	110,000,000	117,488,800	
兵庫県平成18年度第8回公募公債	100,000,000	107,575,000	
兵庫県平成18年度第10回公募公債	100,000,000	107,397,000	
兵庫県平成21年度第1回公募公債	100,000,000	106,180,000	
兵庫県平成21年度第35回公募公債	100,000,000	104,589,000	
静岡県平成15年度第3回公募公債	100,000,000	102,249,000	
静岡県平成17年度第7回公募公債	100,000,000	105,617,000	
静岡県平成19年度第4回公募公債	100,000,000	108,053,000	
静岡県平成19年度第7回公募公債	100,000,000	107,459,000	
静岡県平成21年度第5回公募公債	100,000,000	104,370,000	
静岡県平成22年度第3回公募公債	100,000,000	104,128,000	
愛知県平成17年度第1回公募公債(10年)	100,000,000	103,651,000	
愛知県平成18年度第4回公募公債(10年)	129,000,000	137,498,520	
愛知県平成20年度第6回公募公債(10年)	100,000,000	107,167,000	
愛知県平成20年度第10回公募公債(10年)	100,000,000	105,591,000	
愛知県平成21年度第1回公募公債(10年)	100,000,000	106,536,000	
愛知県平成22年度第1回公募公債(10年)	100,000,000	104,476,000	
愛知県平成22年度第5回公募公債(10年)	100,000,000	103,045,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
地方債 証券	愛知県平成22年度第14回公募公債(20年)	100,000,000	104,285,000	
	広島県平成16年度第1回公募公債	100,000,000	103,175,000	
	広島県平成20年度第6回公募公債	100,000,000	105,551,000	
	埼玉県平成15年度第5回公募公債	100,000,000	102,531,000	
	埼玉県平成19年度第2回公募公債	100,000,000	107,855,000	

埼玉県平成19年度第5回公募公債	100,000,000	107,463,000	
埼玉県平成19年度第7回公募公債	100,000,000	106,638,000	
埼玉県平成20年度第5回公募公債	100,000,000	107,298,000	
埼玉県平成21年度第1回公募公債	200,000,000	211,918,000	
埼玉県平成21年度第2回公募公債	100,000,000	106,239,000	
埼玉県平成22年度第4回公募公債	100,000,000	102,241,000	
福岡県平成14年度第3回公募公債	100,000,000	100,744,000	
福岡県平成20年度第5回公募公債	100,000,000	106,895,000	
福岡県平成21年度第5回公募公債	100,000,000	104,533,000	
福岡県平成22年度第2回15年公募公債	100,000,000	103,268,000	
福岡県平成20年度第1回30年公募公債	200,000,000	209,592,000	
千葉県平成15年度第1回公募公債	100,000,000	100,474,000	
千葉県平成17年度第7回公募公債	100,000,000	104,554,000	
千葉県平成18年度第6回公募公債	175,000,000	185,939,250	
千葉県平成18年度第7回公募公債	100,000,000	106,910,000	
千葉県平成21年度第1回公募公債	100,000,000	105,963,000	
千葉県平成21年度第3回公募公債	100,000,000	106,727,000	
千葉県平成22年度第4回公募公債	100,000,000	102,239,000	
千葉県第8回20年公募公債	100,000,000	105,899,000	
新潟県平成17年度第1回公募公債	100,000,000	103,429,000	
新潟県平成20年度第2回公募公債	100,000,000	105,774,000	
岐阜県平成18年度第1回公募公債	100,000,000	106,535,000	
第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,702,000	
第5回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,200,000	
第6回共同発行市場公募地方債	155,700,000	159,592,500	
第9回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,248,000	
第11回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,385,000	
第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,437,000	
第16回共同発行市場公募地方債	127,000,000	132,143,500	
第17回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,162,000	
第18回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,721,000	
第19回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,802,000	
第20回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,615,000	
第22回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,443,000	
第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,208,000	
第24回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,916,000	
第26回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,371,000	
第27回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,432,000	
第29回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,920,000	

第30回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,597,000	
第31回共同発行市場公募地方債	150,000,000	156,622,500	
第34回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,222,000	
第35回共同発行市場公募地方債	160,000,000	168,184,000	
第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,065,000	
第41回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,366,000	
第43回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,591,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
地方債 証券	第48回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,473,000	
	第53回共同発行市場公募地方債	200,000,000	214,530,000	
	第54回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,718,000	
	第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,927,000	
	第57回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,550,000	
	第63回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,182,000	
	第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,534,000	
	第67回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,728,000	
	第74回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,232,000	
	第75回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,727,000	
	第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,804,000	
	第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,746,000	
	第79回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,305,000	
	第80回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,770,000	
	第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,725,000	
	第83回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,806,000	
	第84回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,261,000	
	第85回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,688,000	
	第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,294,000	
	第88回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,239,000	
	第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,495,000	
	第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,304,000	
	第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,575,000	
	第96回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,592,000	
	第97回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,340,000	
	静岡市平成18年度第1回公募公債	100,000,000	107,193,000	
	大阪市平成14年度第11回公募公債	100,000,000	100,693,000	
	大阪市平成16年度第5回公募公債	100,000,000	103,610,000	
	大阪市平成17年度第1回公募公債	100,000,000	103,157,000	

大阪市平成18年度第3回公募公債	200,000,000	214,756,000	
大阪市平成21年度第7回公募公債	100,000,000	104,513,000	
名古屋市第12回し号公募公債	100,000,000	103,910,000	
名古屋市第12回せ号公募公債	100,000,000	103,980,000	
名古屋市第12回ゆ号公募公債	100,000,000	102,677,000	
名古屋市第12回す号公募公債	100,000,000	105,575,000	
名古屋市第455回10年公募公債	186,700,000	199,223,836	
名古屋市第463回10年公募公債	100,000,000	108,794,000	
名古屋市第464回10年公募公債	100,000,000	106,469,000	
名古屋市第1回20年公募公債	100,000,000	107,451,000	
京都市平成19年度第2回公募公債	100,000,000	106,927,000	
京都市平成21年度第5回公募公債	100,000,000	104,682,000	
京都市平成22年度第3回公募公債	100,000,000	100,045,000	
京都市第2回20年公募公債	100,000,000	107,628,000	
横浜市平成20年度第1回公募公債	100,000,000	108,023,000	
横浜市平成20年度第6回公募公債	100,000,000	105,825,000	
横浜市平成21年度第6回公募公債	100,000,000	104,339,000	
横浜市平成22年度第1回公募公債	100,000,000	103,937,000	
横浜市平成22年度第3回公募公債	100,000,000	102,093,000	
横浜市平成15年度第2回公募公債	100,000,000	100,605,000	
横浜市平成17年度第3回公募公債	100,000,000	104,728,000	
横浜市第5回20年公募公債	100,000,000	108,636,000	

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
地方債 証券	横浜市第24回5年公募公債	100,000,000	101,494,000	
	札幌市平成18年度第4回公募公債	100,000,000	106,467,000	
	第79回川崎市公募公債	100,000,000	107,570,000	
	福岡市平成19年度第3回公募公債	100,000,000	107,654,000	
	福岡市平成19年度第5回公募公債	100,000,000	105,587,000	
	福岡市平成20年度第5回公募公債	100,000,000	106,116,000	
	広島市平成17年度第1回公募公債	100,000,000	104,462,000	
	第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,524,000	
	20年第4回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,500,000	
	20年第7回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,622,000	
	第12回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,812,000	
	20年第12回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,699,000	
	地方債証券 小計		21,826,400,000	22,881,626,016
特殊	政府保証第6回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,818,000	

債券	政府保証第7回日本政策投資銀行債券	102,000,000	104,484,720	
	政府保証第8回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,226,000	
	政府保証第10回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,980,000	
	政府保証第15回日本政策投資銀行債券	210,000,000	228,408,600	
	政府保証第16回日本政策投資銀行債券	200,000,000	214,070,000	
	政府保証第21回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,444,000	
	第7回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,656,000	
	第13回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,931,000	
	第16回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,265,000	
	第19回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,326,000	
	第24回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,608,000	
	第29回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,637,000	
	第41回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,453,000	
	第43回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,059,000	
	第47回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,886,000	
	第16回道路債券	200,000,000	201,820,000	
	政府保証第319回道路債券	100,000,000	101,241,000	
	政府保証第323回道路債券	100,000,000	102,659,000	
	政府保証第325回道路債券	101,000,000	103,462,380	
	政府保証第327回道路債券	100,000,000	103,063,000	
	政府保証第328回道路債券	100,000,000	103,166,000	
	政府保証第329回道路債券	150,000,000	155,244,000	
	政府保証第330回道路債券	100,000,000	104,121,000	
	政府保証第333回道路債券	100,000,000	103,891,000	
	政府保証第334回道路債券	100,000,000	103,686,000	
	政府保証第335回道路債券	100,000,000	103,461,000	
	政府保証第336回道路債券	131,000,000	135,655,740	
	政府保証第338回道路債券	100,000,000	104,007,000	
	政府保証第343回道路債券	100,000,000	103,536,000	
	政府保証第346回道路債券	115,000,000	119,620,700	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,560,000	
	第3回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,796,000	
	第6回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,836,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	165,000,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,418,000	
	第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,956,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,522,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊 債券	第3 1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,549,000	
	第3 2回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,942,000	
	第3 5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,183,000	
	第3 7回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,383,000	
	第3 8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,596,000	
	第3 9回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,551,000	
	第4 4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,015,000	
	第4 5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,414,000	
	第4 8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,690,000	
	第4 9回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,471,000	
	第5 3回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,091,000	
	第5 6回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,276,000	
	第5 9回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,421,000	
	第6 1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,284,000	
	政府保証第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,658,000	
	政府保証第1 0回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,728,000	
	政府保証第1 4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	157,000,000	167,730,950	
	政府保証第1 6回日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	108,465,920	
	政府保証第2 1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,821,000	
	政府保証第2 5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	133,723,750	
	政府保証第3 3回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,661,000	
	政府保証第3 4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,707,000	
	政府保証第4 0回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	215,924,000	
	政府保証第4 3回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,278,000	
	政府保証第4 4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,906,000	
	政府保証第4 9回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,828,000	
	政府保証第5 4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,285,000	
	政府保証第5 6回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,282,000	
	政府保証第5 8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	214,352,000	
	政府保証第6 2回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,221,000	
	政府保証第6 6回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,910,000	
	政府保証第6 7回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,152,000	
	政府保証第6 9回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,576,000	
	政府保証第7 1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,446,000	
政府保証第7 5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,513,000		
政府保証第7 7回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,509,000		
政府保証第7 8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,416,000		
政府保証第8 0回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,901,000		

政府保証第86回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,999,000	
政府保証第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,244,000	
政府保証第91回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,388,000	
政府保証第93回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,884,000	
政府保証第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,255,000	
政府保証第98回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,938,000	
政府保証第100回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,664,000	
政府保証第103回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,835,000	
政府保証第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,548,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊 債券	政府保証第107回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,346,000	
	政府保証第110回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,585,000	
	政府保証第111回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,499,000	
	政府保証第133回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,880,000	
	第21回道路債券	100,000,000	110,793,000	
	第26回道路債券	100,000,000	102,825,000	
	第27回道路債券	100,000,000	110,852,000	
	第30回道路債券	100,000,000	103,314,000	
	第33回道路債券	100,000,000	113,067,000	
	第37回道路債券	100,000,000	103,670,000	
	第38回道路債券	100,000,000	108,727,000	
	第41回道路債券	100,000,000	103,714,000	
	第42回道路債券	100,000,000	108,026,000	
	政府保証第825回公営企業債券	100,000,000	100,827,000	
	政府保証第826回公営企業債券	200,000,000	201,454,000	
	政府保証第829回公営企業債券	100,000,000	101,505,000	
	政府保証第830回公営企業債券	100,000,000	101,232,000	
	政府保証第832回公営企業債券	100,000,000	102,284,000	
	政府保証第833回公営企業債券	100,000,000	102,568,000	
	政府保証第838回公営企業債券	100,000,000	103,063,000	
	政府保証第839回公営企業債券	100,000,000	103,146,000	
	政府保証第841回公営企業債券	100,000,000	104,104,000	
	政府保証第843回公営企業債券	100,000,000	103,516,000	
	政府保証第847回公営企業債券	100,000,000	103,551,000	
	政府保証第848回公営企業債券	100,000,000	103,287,000	
	政府保証第850回公営企業債券	100,000,000	103,720,000	

政府保証第851回公営企業債券	100,000,000	103,459,000	
政府保証第852回公営企業債券	100,000,000	103,515,000	
政府保証第855回公営企業債券	100,000,000	103,675,000	
政府保証第857回公営企業債券	100,000,000	105,000,000	
政府保証第859回公営企業債券	100,000,000	104,734,000	
政府保証第860回公営企業債券	100,000,000	105,204,000	
政府保証第862回公営企業債券	100,000,000	106,195,000	
政府保証第864回公営企業債券	100,000,000	106,812,000	
政府保証第871回公営企業債券	100,000,000	106,956,000	
政府保証第874回公営企業債券	100,000,000	106,642,000	
政府保証第876回公営企業債券	200,000,000	215,674,000	
政府保証第877回公営企業債券	200,000,000	215,770,000	
政府保証第879回公営企業債券	200,000,000	213,760,000	
政府保証第884回公営企業債券	100,000,000	105,275,000	
政府保証第885回公営企業債券	100,000,000	107,152,000	
政府保証第886回公営企業債券	100,000,000	107,829,000	
政府保証15年第2回公営企業債券	100,000,000	109,962,000	
政府保証第2回地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	213,162,000	
第1回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,280,000	
政府保証第3回地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	210,474,000	
政府保証第4回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,525,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊 債券	第2回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,099,000	
	第3回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,546,000	
	20年第2回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,408,000	
	政府保証第8回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	105,924,000	
	第4回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,141,000	
	政府保証第3回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,828,000	
	政府保証第5回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,450,000	
	政府保証第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,906,000	
	政府保証第8回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,964,000	
	政府保証第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,828,000	
	政府保証第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,570,000	
	政府保証第13回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,648,000	
	政府保証第14回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,878,000	
	20年第5回公営企業債券	100,000,000	108,446,000	
	20年第9回公営企業債券	100,000,000	110,442,000	

20年第11回公営企業債券	100,000,000	107,526,000	
20年第15回公営企業債券	100,000,000	107,732,000	
20年第17回公営企業債券	200,000,000	220,932,000	
20年第24回公営企業債券	100,000,000	107,971,000	
第5回公営企業債券	200,000,000	201,396,000	
第6回公営企業債券	100,000,000	100,533,000	
第12回公営企業債券	200,000,000	206,846,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	103,990,000	
第17回公営企業債券	200,000,000	208,972,000	
第19回公営企業債券	200,000,000	213,588,000	
第23回公営企業債券	100,000,000	107,092,000	
第24回公営企業債券	100,000,000	107,239,000	
政府保証第187回首都高速道路債券	200,000,000	205,290,000	
政府保証第189回首都高速道路債券	100,000,000	102,410,000	
政府保証第190回首都高速道路債券	100,000,000	102,703,000	
政府保証第197回首都高速道路債券	100,000,000	103,978,000	
首都高速道路株式会社第5回社債	100,000,000	100,895,000	
第9回首都高速道路債券	100,000,000	103,494,000	
政府保証第144回阪神高速道路債券	100,000,000	103,958,000	
政府保証第148回阪神高速道路債券	100,000,000	103,688,000	
第6回阪神高速道路債券	100,000,000	103,584,000	
政府保証第176回中小企業債券	100,000,000	102,506,000	
政府保証第178回中小企業債券	100,000,000	102,638,000	
政府保証第184回中小企業債券	100,000,000	103,446,000	
政府保証第187回中小企業債券	100,000,000	104,626,000	
政府保証第191回中小企業債券	200,000,000	213,674,000	
株式会社日本政策金融公庫第7回社債（一般担保付）	100,000,000	100,830,000	
政府保証第1回日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,456,000	
政府保証第4回日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,804,000	
第23回中小企業債券	100,000,000	101,400,000	
第8回国際協力銀行債券	100,000,000	100,504,000	
第12回国際協力銀行債券	100,000,000	102,976,000	
第15回国際協力銀行債券	100,000,000	103,601,000	
第16回国際協力銀行債券	100,000,000	109,334,000	
第19回国際協力銀行債券	100,000,000	106,046,000	
第21回国際協力銀行債券	100,000,000	104,387,000	

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

特殊 債券	第 2 5 回国際協力銀行債券	100,000,000	106,740,000	
	第 2 7 回国際協力銀行債券	100,000,000	106,481,000	
	第 2 9 回国際協力銀行債券	100,000,000	106,792,000	
	政府保証第 1 6 回都市再生債券	100,000,000	100,508,000	
	第 1 6 回都市再生債券	100,000,000	106,324,000	
	第 2 4 回都市再生債券	100,000,000	107,622,000	
	第 3 4 回都市再生債券	100,000,000	103,785,000	
	第 3 5 回都市再生債券	100,000,000	100,789,000	
	第 4 3 回都市再生債券	100,000,000	102,048,000	
	政府保証第 2 7 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	103,995,000	
	第 2 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	103,146,000	
	政府保証第 1 7 4 回預金保険機構債券	100,000,000	100,460,000	
	政府保証第 1 7 7 回預金保険機構債券	100,000,000	100,210,000	
	貸付債権担保第 1 8 回住宅金融公庫債券	45,602,000	47,320,739	
	貸付債権担保 S 種第 1 回住宅金融支援機構債券	97,946,000	103,033,315	
	貸付債権担保第 1 回住宅金融支援機構債券	326,180,000	342,130,202	
	貸付債権担保 S 種第 2 回住宅金融支援機構債券	50,831,000	53,757,848	
	貸付債権担保第 8 回住宅金融支援機構債券	135,958,000	141,990,456	
	貸付債権担保 S 種第 1 2 回住宅金融支援機構債券	69,480,000	73,009,584	
	貸付債権担保第 2 4 回住宅金融支援機構債券	78,245,000	83,349,703	
	貸付債権担保第 2 5 回住宅金融支援機構債券	77,159,000	81,850,267	
	貸付債権担保第 2 6 回住宅金融支援機構債券	155,082,000	163,250,168	
	貸付債権担保 S 種第 1 7 回住宅金融支援機構債券	219,186,000	228,104,678	
	貸付債権担保 S 種第 1 8 回住宅金融支援機構債券	73,187,000	75,691,459	
	貸付債権担保第 3 4 回住宅金融支援機構債券	88,102,000	91,272,790	
	貸付債権担保第 3 5 回住宅金融支援機構債券	90,819,000	93,974,052	
	貸付債権担保第 3 6 回住宅金融支援機構債券	91,248,000	94,192,572	
	貸付債権担保第 3 9 回住宅金融支援機構債券	186,908,000	188,737,829	
	貸付債権担保第 4 2 回住宅金融支援機構債券	94,938,000	95,322,498	
	貸付債権担保第 4 3 回住宅金融支援機構債券	95,431,000	97,126,808	
	貸付債権担保第 4 5 回住宅金融支援機構債券	96,022,000	99,056,295	
	貸付債権担保第 4 9 回住宅金融支援機構債券	97,722,000	100,388,833	
	貸付債権担保第 5 0 回住宅金融支援機構債券	98,215,000	100,164,567	
	貸付債権担保 S 種第 1 回住宅金融公庫債券	35,857,000	36,733,703	
貸付債権担保 S 種第 3 回住宅金融公庫債券	111,348,000	115,769,629		
貸付債権担保 S 種第 5 回住宅金融公庫債券	39,237,000	40,712,311		
貸付債権担保 S 種第 6 回住宅金融公庫債券	42,390,000	44,975,790		
貸付債権担保 S 種第 7 回住宅金融公庫債券	172,028,000	182,187,973		
貸付債権担保 S 種第 8 回住宅金融公庫債券	43,989,000	46,370,564		

貸付債権担保5種第9回住宅金融公庫債券	43,878,000	46,444,424	
貸付債権担保5種第10回住宅金融公庫債券	45,456,000	48,039,264	
貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券	32,045,000	33,259,505	
貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券	72,962,000	74,241,753	
貸付債権担保第11回住宅金融公庫債券	39,880,000	39,357,572	
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	42,089,000	43,278,014	
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	95,804,000	100,523,305	
貸付債権担保第25回住宅金融公庫債券	51,165,000	52,554,129	
貸付債権担保第28回住宅金融公庫債券	55,023,000	56,630,221	
貸付債権担保第29回住宅金融公庫債券	178,002,000	183,391,900	
貸付債権担保第31回住宅金融公庫債券	62,543,000	63,924,574	
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	191,805,000	195,997,857	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊 債券	貸付債権担保第34回住宅金融公庫債券	65,426,000	67,456,823	
	貸付債権担保第36回住宅金融公庫債券	62,602,000	64,716,695	
	貸付債権担保第37回住宅金融公庫債券	63,227,000	65,352,691	
	貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	189,513,000	195,548,989	
	貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	125,744,000	130,421,676	
	貸付債権担保第41回住宅金融公庫債券	64,675,000	67,827,259	
	貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	62,364,000	66,416,412	
	貸付債権担保第47回住宅金融公庫債券	60,354,000	63,672,866	
	貸付債権担保第51回住宅金融公庫債券	192,879,000	203,253,961	
	貸付債権担保第53回住宅金融公庫債券	65,335,000	68,316,889	
	政府保証第9回国民生活債券	200,000,000	202,962,000	
	政府保証第12回国民生活債券	100,000,000	102,719,000	
	政府保証第15回国民生活債券	100,000,000	103,962,000	
政府保証第19回国民生活債券	125,000,000	132,931,250		
政府保証第20回国民生活債券	100,000,000	103,202,000		
第36回国民生活債券	200,000,000	202,220,000		
第11回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	106,532,000		
い第692号商工債	100,000,000	101,067,000		
い第694号商工債	100,000,000	101,168,000		
い第704号商工債	200,000,000	204,600,000		
い第705号商工債	100,000,000	102,487,000		
い第707号商工債	200,000,000	205,032,000		
い第710号商工債	200,000,000	203,388,000		
い第713号商工債	100,000,000	101,371,000		

い第714号商工債	100,000,000	101,696,000	
い第715号商工債	100,000,000	101,113,000	
い第716号商工債	100,000,000	101,113,000	
い第717号商工債	100,000,000	101,111,000	
い第726号商工債	100,000,000	100,171,000	
い第695号農林債	100,000,000	101,201,000	
い第697号農林債	100,000,000	101,886,000	
い第701号農林債	100,000,000	102,171,000	
い第704号農林債	100,000,000	102,130,000	
い第708号農林債	100,000,000	102,033,000	
い第715号農林債	200,000,000	202,042,000	
い第717号農林債	100,000,000	101,173,000	
い第718号農林債	100,000,000	101,021,000	
い第720号農林債	100,000,000	100,844,000	
い第721号農林債	100,000,000	100,669,000	
い第724号農林債	100,000,000	100,268,000	
い第725号農林債	100,000,000	99,877,000	
い第728号農林債	100,000,000	100,403,000	
い第729号農林債	100,000,000	101,217,000	
い第730号農林債	100,000,000	100,986,000	
第219回信金中金債（5年）	100,000,000	101,146,000	
第222回信金中金債（5年）	100,000,000	101,667,000	
第223回信金中金債（5年）	100,000,000	101,917,000	
第224回信金中金債（5年）	100,000,000	101,935,000	
第225回信金中金債（5年）	100,000,000	101,776,000	
第228回信金中金債（5年）	100,000,000	102,311,000	
第230回信金中金債（5年）	200,000,000	204,134,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊 債券	第231回信金中金債（5年）	100,000,000	102,354,000	
	第234回信金中金債（5年）	100,000,000	102,083,000	
	第237回信金中金債（5年）	100,000,000	101,840,000	
	第238回信金中金債（5年）	100,000,000	101,450,000	
	第243回信金中金債（5年）	100,000,000	101,079,000	
	第246回信金中金債（5年）	100,000,000	100,912,000	
	第248回信金中金債（5年）	100,000,000	100,560,000	
	第251回信金中金債（5年）	100,000,000	99,763,000	
	第122号商工債（3年）	100,000,000	100,134,000	

	第124号商工債（3年）	100,000,000	100,152,000	
	政府保証第5回東日本高速道路債券	100,000,000	107,465,000	
	政府保証第8回中日本高速道路債券	100,000,000	107,433,000	
	政府保証第10回中日本高速道路債券	172,000,000	183,615,160	
	政府保証第20回中日本高速道路債券	100,000,000	105,237,000	
	中日本高速道路株式会社第2回社債	100,000,000	103,688,000	
	中日本高速道路株式会社第5回社債	100,000,000	107,466,000	
	中日本高速道路株式会社第6回社債	100,000,000	106,644,000	
	中日本高速道路株式会社第14回社債	100,000,000	100,735,000	
	政府保証第3回西日本高速道路債券	100,000,000	106,788,000	
	政府保証第20回西日本高速道路債券	100,000,000	105,068,000	
	特殊債券 小計	33,714,881,000	35,138,442,582	
社債券	フランス電力第1回円貨社債（2009）	100,000,000	99,632,000	
	ジーディーエフ・スエズ第1回円貨社債（2009）	100,000,000	98,674,000	
	第1回スウェーデン輸出信用銀行円貨債券（2009）	100,000,000	100,508,000	
	第322回東京交通債券	100,000,000	111,390,000	
	第323回東京交通債券	100,000,000	114,581,000	
	第324回東京交通債券	100,000,000	114,537,000	
	第344回東京交通債券	100,000,000	103,813,000	
	一般担保第2回住宅金融支援機構債券	200,000,000	213,160,000	
	一般担保第6回住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,938,000	
	一般担保第11回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,130,000	
	一般担保第14回住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,450,000	
	一般担保第17回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,466,000	
	一般担保第21回住宅金融支援機構債券	200,000,000	215,986,000	
	一般担保第23回住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,455,000	
	一般担保第25回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,350,000	
	一般担保第29回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,208,000	
	一般担保第30回住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,070,000	
	一般担保第41回住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,802,000	
	一般担保第43回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,204,000	
	第9回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	200,000,000	203,062,000	
	第14回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	100,000,000	102,553,000	
	第11回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	98,577,000	
	第17回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	89,902,000	
	第22回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	100,075,000	

第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債	100,000,000	92,272,000	
ナショナル・オーストラリア銀行第4回円貨社債（2010）	100,000,000	99,800,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	ナショナル・オーストラリア銀行第6回円貨社債（2011）	100,000,000	98,632,000	
	ウエストパック・バンキング・コーポ・第2回円貨社債2009	100,000,000	102,698,000	
	ウエストパック・バンキング・コーポ・第5回円貨社債2010	200,000,000	200,362,000	
	ウエストパック・バンキング・コーポ・第7回円貨社債2010	100,000,000	99,522,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行第1回円貨社債2008	100,000,000	101,322,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行第1回円貨社債2009	100,000,000	102,505,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行第5回円貨社債2010	100,000,000	100,084,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行第6回円貨社債2011	100,000,000	98,992,000	
	ウォルマート・ストアーズ・インク第3回円貨社債（2009）	100,000,000	102,234,000	
	ウォルマート・ストアーズ・インク第4回円貨社債（2010）	100,000,000	100,796,000	
	エイチエスピーシー・バンク・ピーエルシー第1回円貨社債（2009）	100,000,000	99,106,000	
	麒麟ホールディングス株式会社第1回無担保社債	100,000,000	101,045,000	
	麒麟ホールディングス株式会社第3回無担保社債	100,000,000	106,172,000	
	味の素株式会社第17回無担保社債	100,000,000	100,535,000	
	日本たばこ産業株式会社第5回社債	100,000,000	101,982,000	
	株式会社セブン&アイ・ホールディングス第5回無担保社債	100,000,000	100,976,000	
	住友化学株式会社第23回無担保社債	100,000,000	101,158,000	
	住友化学株式会社第43回無担保社債	100,000,000	104,037,000	
	三菱化学株式会社第37回無担保社債	100,000,000	107,886,000	
	三井化学株式会社第31回無担保社債	100,000,000	100,729,000	

花王株式会社第2回無担保社債	100,000,000	102,465,000	
エーザイ株式会社第6回無担保社債	100,000,000	102,005,000	
エーザイ株式会社第7回無担保社債	100,000,000	104,879,000	
第一三共株式会社第2回無担保社債	100,000,000	106,938,000	
新日本石油株式会社第26回無担保社債	100,000,000	107,493,000	
株式会社ブリヂストン第4回無担保社債	100,000,000	100,880,000	
新日本製鐵株式会社第52回無担保社債	100,000,000	103,105,000	
新日本製鐵株式会社第56回無担保社債	100,000,000	102,835,000	
新日本製鐵株式会社第62回無担保社債	100,000,000	102,128,000	
ジェイエフイーホールディングス株式会社第13回無担保社債	100,000,000	101,542,000	
株式会社豊田自動織機第15回無担保社債	100,000,000	104,645,000	
株式会社東芝第50回無担保社債	100,000,000	100,648,000	
三菱電機株式会社第42回無担保社債	100,000,000	102,159,000	
パナソニック株式会社第7回無担保社債	100,000,000	102,413,000	
シャープ株式会社第22回無担保社債	100,000,000	102,430,000	
シャープ株式会社第24回無担保社債	100,000,000	101,226,000	
ソニー株式会社第17回無担保社債	100,000,000	103,796,000	
ソニー株式会社第25回無担保社債	100,000,000	102,291,000	
ソニー株式会社第26回無担保社債	100,000,000	108,151,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	松下電工株式会社第3回無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	104,198,000	
	三菱重工業株式会社第17回無担保社債	100,000,000	100,656,000	
	三菱重工業株式会社第22回無担保社債	100,000,000	107,799,000	
	トヨタ自動車株式会社第7回無担保社債	200,000,000	204,282,000	
	トヨタ自動車株式会社第9回無担保社債	100,000,000	101,894,000	
	トヨタ自動車株式会社第10回無担保社債	100,000,000	106,895,000	
	アイシン精機株式会社第5回無担保社債	100,000,000	103,119,000	
	大日本印刷株式会社第1回無担保社債	200,000,000	204,950,000	
	三井物産株式会社第58回無担保社債	100,000,000	106,637,000	
	住友商事株式会社第29回無担保社債	100,000,000	101,319,000	
	三菱商事株式会社第46回無担保社債	100,000,000	102,499,000	
	三菱商事株式会社第53回無担保社債	100,000,000	101,549,000	
	三菱商事株式会社第70回無担保社債	100,000,000	107,154,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第12回無担保社債	100,000,000	101,369,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第13回無担保社債	100,000,000	101,733,000	

株式会社みずほコーポレート銀行第15回無担保社債	100,000,000	102,202,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第16回無担保社債	300,000,000	306,573,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第17回無担保社債	100,000,000	101,589,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第18回無担保社債	100,000,000	101,317,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第19回無担保社債	200,000,000	201,964,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第21回無担保社債	100,000,000	100,468,000	
株式会社みずほコーポレート銀行第23回無担保社債	100,000,000	99,911,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第57回無担保社債	200,000,000	218,360,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第83回無担保社債	200,000,000	213,826,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第87回無担保社債	100,000,000	106,947,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第95回無担保社債	100,000,000	101,005,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第98回無担保社債	100,000,000	101,235,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第100回無担保社債	100,000,000	101,768,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第104回無担保社債	200,000,000	204,910,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第106回無担保社債	300,000,000	304,617,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第107回無担保社債	100,000,000	105,510,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第109回無担保社債	100,000,000	101,271,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第116回無担保社債	100,000,000	100,343,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第3回2号無担保社債	200,000,000	202,472,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第28回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,045,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第32回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,036,000	
株式会社三井住友銀行第44回無担保社債	100,000,000	101,750,000	
株式会社三井住友銀行第45回無担保社債	200,000,000	203,992,000	
株式会社三井住友銀行第47回無担保社債	100,000,000	101,554,000	
株式会社三井住友銀行第48回無担保社債	100,000,000	101,253,000	
株式会社三井住友銀行第50回無担保社債	100,000,000	100,379,000	
株式会社三井住友銀行第51回無担保社債	100,000,000	99,759,000	
株式会社三井住友銀行第52回無担保社債	100,000,000	100,510,000	
株式会社三井住友銀行第22回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	100,156,000	
株式会社三井住友銀行第23回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,437,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	株式会社三井住友銀行第24回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	100,702,000	
	NTTファイナンス株式会社第37回無担保社債	100,000,000	101,128,000	
	トヨタファイナンス株式会社第21回無担保社債	100,000,000	107,012,000	

トヨタファイナンス株式会社第25回無担保社債	100,000,000	102,998,000	
野村ホールディングス株式会社第22回無担保社債	100,000,000	99,928,000	
野村ホールディングス株式会社第23回無担保社債	100,000,000	100,618,000	
大和証券キャピタル・マーケット株式会社第2回無担保社債	100,000,000	99,159,000	
三菱地所株式会社第48回無担保社債	100,000,000	112,398,000	
三菱地所株式会社第70回無担保社債	100,000,000	103,163,000	
三菱地所株式会社第79回無担保社債	100,000,000	106,484,000	
三菱地所株式会社第83回無担保社債	100,000,000	108,289,000	
東日本旅客鉄道株式会社第7回社債（一般担保付）	200,000,000	230,278,000	
東日本旅客鉄道株式会社第13回社債（一般担保付）	100,000,000	113,250,000	
東日本旅客鉄道株式会社第15回社債（一般担保付）	100,000,000	113,755,000	
東日本旅客鉄道株式会社第21回無担保社債	100,000,000	107,667,000	
東日本旅客鉄道株式会社第27回無担保普通社債	100,000,000	102,090,000	
東日本旅客鉄道株式会社第33回無担保普通社債	100,000,000	103,875,000	
東日本旅客鉄道株式会社第37回無担保普通社債	100,000,000	103,390,000	
東日本旅客鉄道株式会社第43回無担保普通社債	100,000,000	107,024,000	
東日本旅客鉄道株式会社第50回無担保普通社債	100,000,000	107,150,000	
東日本旅客鉄道株式会社第52回無担保普通社債	100,000,000	105,918,000	
西日本旅客鉄道株式会社第7回社債（一般担保付）	100,000,000	111,355,000	
西日本旅客鉄道株式会社第11回無担保社債	100,000,000	108,935,000	
東海旅客鉄道株式会社第5回普通社債（一般担保付）	100,000,000	113,264,000	
東海旅客鉄道株式会社第10回無担保普通社債	100,000,000	104,633,000	
東海旅客鉄道株式会社第20回無担保普通社債	200,000,000	213,234,000	
東海旅客鉄道株式会社第25回無担保普通社債	100,000,000	106,749,000	
東海旅客鉄道株式会社第51回無担保普通社債	100,000,000	105,250,000	
東京地下鉄株式会社第3回社債（一般担保付）	100,000,000	106,611,000	
東京地下鉄株式会社第8回社債（一般担保付）	100,000,000	107,749,000	
日本郵船株式会社第27回無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	107,013,000	
日本電信電話株式会社第47回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	100,772,000	
日本電信電話株式会社第48回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	103,512,000	
日本電信電話株式会社第50回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	104,348,000	
日本電信電話株式会社第51回電信電話債券（一般担保付）	200,000,000	214,124,000	

日本電信電話株式会社第52回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	106,427,000	
日本電信電話株式会社第53回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	105,432,000	
日本電信電話株式会社第59回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	106,540,000	
株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第15回無担保社債	100,000,000	108,134,000	
株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第16回無担保社債	100,000,000	102,027,000	
東京電力株式会社第457回社債	100,000,000	63,621,000	
東京電力株式会社第507回社債	100,000,000	86,590,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	東京電力株式会社第511回社債	100,000,000	83,132,000	
	東京電力株式会社第513回社債	100,000,000	82,623,000	
	東京電力株式会社第514回社債	100,000,000	79,544,000	
	東京電力株式会社第515回社債	100,000,000	77,411,000	
	東京電力株式会社第516回社債	100,000,000	76,064,000	
	東京電力株式会社第518回社債	100,000,000	74,091,000	
	東京電力株式会社第519回社債	100,000,000	72,593,000	
	東京電力株式会社第521回社債	100,000,000	71,445,000	
	東京電力株式会社第522回社債	100,000,000	70,848,000	
	東京電力株式会社第539回社債	100,000,000	63,878,000	
	東京電力株式会社第541回社債	100,000,000	90,126,000	
	東京電力株式会社第542回社債	100,000,000	63,934,000	
	東京電力株式会社第544回社債	100,000,000	64,587,000	
	中部電力株式会社第405回社債	100,000,000	111,300,000	
	中部電力株式会社第406回社債	200,000,000	220,828,000	
	中部電力株式会社第426回社債	100,000,000	110,859,000	
	中部電力株式会社第466回社債	100,000,000	102,528,000	
	中部電力株式会社第478回社債	100,000,000	104,643,000	
	中部電力株式会社第480回社債	100,000,000	104,315,000	
	中部電力株式会社第484回社債	100,000,000	101,967,000	
	関西電力株式会社第433回社債（一般担保付）	100,000,000	101,761,000	
	関西電力株式会社第435回社債（一般担保付）	100,000,000	101,846,000	
	関西電力株式会社第443回社債（一般担保付）	100,000,000	102,312,000	
	関西電力株式会社第448回社債（一般担保付）	100,000,000	106,609,000	
	関西電力株式会社第454回社債（一般担保付）	100,000,000	102,017,000	
	関西電力株式会社第463回社債（一般担保付）	100,000,000	103,396,000	

関西電力株式会社第466回社債（一般担保付）	100,000,000	101,464,000	
中国電力株式会社第298回社債（一般担保付）	100,000,000	111,407,000	
中国電力株式会社第306回社債（一般担保付）	100,000,000	112,864,000	
中国電力株式会社第311回社債（一般担保付）	100,000,000	110,717,000	
中国電力株式会社第350回社債（一般担保付）	100,000,000	102,491,000	
中国電力株式会社第354回社債（一般担保付）	100,000,000	105,162,000	
北陸電力株式会社第277回社債（一般担保付）	100,000,000	102,303,000	
北陸電力株式会社第283回社債（一般担保付）	100,000,000	105,655,000	
北陸電力株式会社第288回社債（一般担保付）	100,000,000	104,991,000	
東北電力株式会社第383回社債（一般担保付）	100,000,000	110,407,000	
東北電力株式会社第414回社債（一般担保付）	100,000,000	100,110,000	
東北電力株式会社第416回社債（一般担保付）	100,000,000	97,873,000	
東北電力株式会社第420回社債（一般担保付）	100,000,000	101,393,000	
東北電力株式会社第435回社債（一般担保付）	100,000,000	104,212,000	
四国電力株式会社第253回社債（一般担保付）	100,000,000	92,228,000	
四国電力株式会社第257回社債（一般担保付）	100,000,000	102,115,000	
九州電力株式会社第371回社債（一般担保付）	100,000,000	97,037,000	
九州電力株式会社第372回社債（一般担保付）	100,000,000	100,373,000	
九州電力株式会社第376回社債（一般担保付）	100,000,000	101,859,000	
九州電力株式会社第384回社債（一般担保付）	100,000,000	102,782,000	
九州電力株式会社第387回社債（一般担保付）	100,000,000	103,599,000	
九州電力株式会社第391回社債（一般担保付）	100,000,000	104,513,000	
九州電力株式会社第399回社債（一般担保付）	100,000,000	101,473,000	
九州電力株式会社第405回社債（一般担保付）	100,000,000	104,329,000	
北海道電力株式会社第257回社債（一般担保付）	100,000,000	112,824,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	北海道電力株式会社第282回社債（一般担保付）	100,000,000	101,698,000	
	北海道電力株式会社第284回社債（一般担保付）	100,000,000	102,682,000	
	北海道電力株式会社第285回社債（一般担保付）	100,000,000	103,643,000	
	沖縄電力株式会社第9回社債（一般担保付）	100,000,000	100,536,000	
	電源開発株式会社第14回無担保社債	100,000,000	102,748,000	
	電源開発株式会社第16回無担保社債	100,000,000	104,673,000	
	電源開発株式会社第17回無担保社債	100,000,000	105,020,000	
	電源開発株式会社第19回無担保社債	100,000,000	104,926,000	
	電源開発株式会社第21回無担保社債	100,000,000	103,575,000	
	電源開発株式会社第29回無担保社債	100,000,000	100,613,000	
	電源開発株式会社第30回無担保社債	100,000,000	100,145,000	

東京瓦斯株式会社第30回無担保社債	100,000,000	104,339,000	
大阪瓦斯株式会社第7回無担保社債	100,000,000	114,829,000	
大阪瓦斯株式会社第9回無担保社債	100,000,000	113,643,000	
大阪瓦斯株式会社第25回無担保社債	100,000,000	102,753,000	
株式会社エヌ・ティ・ティ・データ第20回無担保社債 （社債間限定同順位特約付）	200,000,000	202,514,000	
株式会社エヌ・ティ・ティ・データ第21回無担保社債	100,000,000	105,754,000	
株式会社エヌ・ティ・ティ・データ第24回無担保社債	100,000,000	100,873,000	
社債券 小計	24,200,000,000	24,705,007,000	
合計	330,851,281,000	344,505,595,298	

（注）代用有価証券で額面 50,000,000円 担保差入

なお、代用有価証券の担保差入券面額には、約定未受渡券面額を含んでおります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「中央三井外国株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成23年12月12日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,037,439,455
コール・ローン	1,896,713,116
株式	244,159,869,575
投資信託受益証券	65,120,996
投資証券	4,263,602,246
派生商品評価勘定	297,258,556
未収入金	10,246,579
未収配当金	665,070,583
未収利息	3,796
差入委託証拠金	2,870,072,610
流動資産合計	258,265,397,512
資産合計	258,265,397,512
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,406,445
未払解約金	153,768,626
流動負債合計	175,175,071
負債合計	175,175,071
純資産の部	
元本等	
元本	291,582,705,391
剰余金	
欠損金	33,492,482,950
純資産合計	258,090,222,441
負債・純資産合計	258,265,397,512

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成23年12月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

	平成23年12月12日現在
<p>1 . 計算日における受益権総数</p>	<p>291,582,705,391 口</p>
<p>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</p>	<p>元本の欠損 33,492,482,950 円</p>
<p>3 . 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)</p>	<p>0.8851 円 (8,851 円)</p>

（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23年12月12日現在

1．金融商品に対する取組方針

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

2．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

3．金融商品に係るリスク管理体制

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

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

2．金融商品の時価等に関する事項

平成23年12月12日現在

1．貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2．時価の算定方法

(1) 株式、投資信託受益証券及び投資証券

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

(2) デリバティブ取引

「（その他の注記）」の「3．デリバティブ取引関係」に記載しております。

(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3．金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

4．金銭債権の計算日後の償還予定額

金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成23年12月12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23年12月12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23年12月12日現在

特定期間の期首元本額	268,408,266,709 円
特定期間中の追加設定元本額	45,601,520,393 円
特定期間中の一部解約元本額	22,427,081,711 円
計算日の元本額	291,582,705,391 円
計算日の元本額の内訳	
中央三井外国株式インデックスファンド	4,646,243,851 円
中央三井DC外国株式インデックスファンド	3,701,154,689 円
中央三井DC外国株式インデックスファンドL	17,868,270,970 円
中央三井DCバランスファンド30	181,327,363 円
中央三井DCバランスファンド50	541,148,124 円
中央三井DCバランスファンド70	319,179,183 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	230,785,884 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	145,641,929 円
新生・4分散ファンド	181,822,019 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	725,686,608 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	91,717,926 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	177,111,064 円
CMAA外国株式インデックスe	3,608,028,805 円
中央三井インデックスコレクション(外国株式)	2,068,270,808 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式30)	189,695,242 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式50)	515,663,977 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式70)	458,691,330 円
中央三井外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	21,372,763,242 円

中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)	5,774,597,710 円
中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)	41,943,814,082 円
中央三井VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	33,262,316,505 円
中央三井VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	5,158,636,099 円
中央三井VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	429,164,946 円
為替ヘッジ付外国株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,958,581,213 円
中央三井VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	32,851,433,334 円
中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)	3,585,076,979 円
中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	1,897,379,939 円
中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)	32,400,007,141 円
中央三井バランスVA75(適格機関投資家専用)	2,454,208,046 円
中央三井VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	50,252,616,090 円
中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	6,644,528,447 円
中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	232,761,521 円
中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)	2,914,480,751 円
中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	2,314,512,145 円
中央三井VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	1,091,515,513 円
CMAM・VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	2,535,303,180 円
中央三井バランスVA20(適格機関投資家専用)	1,582,764,353 円
中央三井VAファンド25(適格機関投資家専用)	3,022,256,627 円
中央三井バランスVA20L(適格機関投資家専用)	117,107,340 円
中央三井バランスVA25L(適格機関投資家専用)	737,076,421 円
CMAM・VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	1,349,910,763 円
私募外国株式インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	49,453,232 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成23年12月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	21,773,527,727
投資信託受益証券	7,010,590
投資証券	134,993,783
合計	21,915,532,100

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「中央三井外国株式マザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成23年2月8日から平成23年12月12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

株式関連

区分	種類	平成23年12月12日現在			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,275,655,457		9,555,711,027	280,055,570
	合計	9,275,655,457		9,555,711,027	280,055,570

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

- 2．株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。
- 3．計算日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

区分	種類	平成23年12月12日現在			
		契約額等（円）		時価 （円）	評価損益 （円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	米ドル	1,263,904,224		1,271,302,560	7,398,336
	ユーロ	292,778,148		285,962,560	6,815,588
	英ポンド	240,179,247		235,370,100	4,809,147
	計	1,796,861,619		1,792,635,220	4,226,399
	売建				
	米ドル	74,896,820		74,873,880	22,940
計	74,896,820		74,873,880	22,940	
合計		1,871,758,439		1,867,509,100	4,203,459

（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23年12月12日現在
該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表（平成23年12月12日現在）

有価証券明細表

A . 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	34,800	23.45	816,060.00	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	77,600	80.25	6,227,400.00	
	APACHE CORP	59,812	97.48	5,830,473.76	
	ARCH COAL INC	33,200	15.54	515,928.00	
	BAKER HUGHES INC	67,959	50.39	3,424,454.01	
	CABOT OIL & GAS CORP	16,400	81.18	1,331,352.00	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	37,700	53.02	1,998,854.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	103,000	24.66	2,539,980.00	
	CHEVRON CORP	312,142	104.25	32,540,803.50	
	CIMAREX ENERGY CO	13,100	68.23	893,813.00	
	CONCHO RESOURCES INC	15,400	100.58	1,548,932.00	
	CONOCOPHILLIPS	203,300	71.95	14,627,435.00	
	CONSOL ENERGY INC	35,600	39.88	1,419,728.00	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	7,100	69.66	494,586.00	
	DENBURY RESOURCES INC	61,700	16.44	1,014,348.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	61,800	66.56	4,113,408.00	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	10,700	59.03	631,621.00	
	EL PASO CORP	120,000	24.87	2,984,400.00	
	ENERGEN CORP	11,100	50.85	564,435.00	
	EOG RESOURCES INC	41,900	103.75	4,347,125.00	
	EQT CORP	22,300	56.64	1,263,072.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	757,802	81.34	61,639,614.68	
	FMC TECHNOLOGIES INC	37,000	51.86	1,918,820.00	
	HALLIBURTON CO	143,300	34.08	4,883,664.00	
	HELMERICH & PAYNE	16,400	60.58	993,512.00	
	HESS CORP	47,700	58.47	2,789,019.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	32,900	22.93	754,397.00	
	KINDER MORGAN INC	17,000	29.60	503,200.00	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	13,363	71.90	960,799.70	
	MARATHON OIL CORP	111,300	28.33	3,153,129.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	55,600	34.88	1,939,328.00		
MURPHY OIL CORP	28,300	54.55	1,543,765.00		
NABORS INDUSTRIES INC	44,100	17.98	792,918.00		

NATIONAL OILWELL VARCO INC	66,021	73.40	4,845,941.40	
NEWFIELD EXPLORATION CO	20,600	41.88	862,728.00	
NOBLE CORP	40,700	33.04	1,344,728.00	
NOBLE ENERGY INC	27,500	95.53	2,627,075.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	126,680	94.40	11,958,592.00	
PEABODY ENERGY CORP	41,600	36.72	1,527,552.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16,500	91.16	1,504,140.00	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION CO	21,600	35.94	776,304.00	
QEP RESOURCES INC	27,100	32.03	868,013.00	
RANGE RESOURCES CORP	25,100	68.13	1,710,063.00	
ROWAN COMPANIES INC	19,600	32.52	637,392.00	
SCHLUMBERGER LIMITED	210,334	74.15	15,596,266.10	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	53,500	36.79	1,968,265.00	
SPECTRA ENERGY CORP	101,378	29.52	2,992,678.56	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	SUNOCO INC	18,600	38.89	723,354.00	
	ULTRA PETROLEUM CORP	23,500	34.42	808,870.00	
	VALERO ENERGY CORP	89,164	21.15	1,885,818.60	
	WEATHERFORD INTL LTD	118,248	14.98	1,771,355.04	
	WHITING PETROLEUM CORP	18,000	48.04	864,720.00	
	WILLIAMS COS INC	91,820	31.65	2,906,103.00	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	33,200	83.22	2,762,904.00	
	AIRGAS INC	11,200	77.73	870,576.00	
	ALCOA INC	163,200	9.64	1,573,248.00	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	15,500	48.88	757,640.00	
	BALL CORP	24,300	34.92	848,556.00	
	CELANESE CORP-SERIES A	24,600	44.12	1,085,352.00	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11,200	141.56	1,585,472.00	
	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	22,700	69.35	1,574,245.00	
	CROWN HOLDINGS INC	23,600	32.56	768,416.00	
	DOW CHEMICAL COMPANY	184,102	27.10	4,989,164.20	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	145,346	45.04	6,546,383.84	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	21,800	38.50	839,300.00	
	ECOLAB INC	46,700	55.90	2,610,530.00	
	FMC CORP	11,000	84.77	932,470.00	
FREEMPORT-MCMORAN COPPER-B	147,776	39.73	5,871,140.48		

INTERNATIONAL PAPER CO	63,900	28.27	1,806,453.00	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	12,336	54.20	668,611.20	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	44,700	33.18	1,483,146.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7,200	73.37	528,264.00	
MEADWESTVACO CORP	26,000	29.42	764,920.00	
MONSANTO CO	83,300	71.23	5,933,459.00	
MOSAIC CO/THE	47,700	50.51	2,409,327.00	
NEWMONT MINING CORP HOLDING CO	77,050	66.94	5,157,727.00	
NUCOR CORP	48,600	40.61	1,973,646.00	
OWENS-ILLINOIS INC	25,800	20.21	521,418.00	
PPG INDUSTRIES INC.	24,300	83.94	2,039,742.00	
PRAXAIR INC	47,114	103.53	4,877,712.42	
ROCK-TENN COMPANY-CL A	10,900	57.70	628,930.00	
SEALED AIR CORP	25,200	18.15	457,380.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO	14,200	86.36	1,226,312.00	
SIGMA-ALDRICH	19,200	65.95	1,266,240.00	
UNITED STATES STEEL CORP	22,100	27.48	607,308.00	
VULCAN MATERIALS COMPANY	19,800	33.55	664,290.00	
WALTER ENERGY INC	9,600	67.14	644,544.00	
3M COMPANY	105,038	82.20	8,634,123.60	
AGCO CORP	14,900	45.12	672,288.00	
AMETEK INC	24,700	42.81	1,057,407.00	
BOEING COMPANY	109,695	71.93	7,890,361.35	
CATERPILLAR INC	100,700	95.97	9,664,179.00	
COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	25,900	55.05	1,425,795.00	
CUMMINS INC	28,700	95.11	2,729,657.00	
DANAHER CORP	90,804	46.92	4,260,523.68	
DEERE & CO	64,526	78.34	5,054,966.84	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	DOVER CORP	28,700	57.20	1,641,640.00	
	EATON CORP	49,900	44.35	2,213,065.00	
	EMERSON ELECTRIC CO	116,100	51.54	5,983,794.00	
	FASTENAL CO	43,100	42.05	1,812,355.00	
	FLOWSERVE CORP	8,600	103.51	890,186.00	
	FLUOR CORP	26,800	52.48	1,406,464.00	
	GENERAL DYNAMICS CORPORATION	48,000	65.07	3,123,360.00	

GENERAL ELECTRIC	1,652,145	16.84	27,822,121.80
GOODRICH CORP	19,500	122.87	2,395,965.00
GRAINGER (W.W.) INC	9,300	186.52	1,734,636.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	115,800	54.00	6,253,200.00
ILLINOIS TOOL WORKS	69,176	47.13	3,260,264.88
INGERSOLL-RAND PLC	50,968	33.18	1,691,118.24
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	19,500	42.53	829,335.00
JOY GLOBAL INC	16,500	89.04	1,469,160.00
KBR INC	23,300	27.06	630,498.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	16,700	66.16	1,104,872.00
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	44,500	77.42	3,445,190.00
MASCO CORP	56,600	9.39	531,474.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	41,200	56.40	2,323,680.00
PACCAR INC	51,275	40.10	2,056,127.50
PALL CORP	17,800	56.66	1,008,548.00
PARKER HANNIFIN CORP	24,250	81.02	1,964,735.00
PENTAIR INC	15,500	36.74	569,470.00
PRECISION CASTPARTS CORP	22,400	162.32	3,635,968.00
QUANTA SERVICES INC	32,500	20.89	678,925.00
RAYTHEON COMPANY	54,800	45.55	2,496,140.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	22,200	77.47	1,719,834.00
ROCKWELL COLLONS	24,200	53.94	1,305,348.00
ROPER INDUSTRIES INC	15,100	84.57	1,277,007.00
SPX CORP	8,000	62.36	498,880.00
STANLEY BLACK AND DECKER INC	24,637	64.81	1,596,723.97
TEXTRON INC	43,400	18.21	790,314.00
TYCO INTERNATIONAL LTD	72,132	47.08	3,395,974.56
UNITED TECHNOLOGIES CORP	134,500	76.31	10,263,695.00
URS CORP	11,900	36.20	430,780.00
XYLEM INC	27,500	24.35	669,625.00
AVERY DENNISON CORP	16,000	28.56	456,960.00
CINTAS CORP	18,500	30.43	562,955.00
DUN & BRADSTREET CORP	7,800	71.72	559,416.00
EQUIFAX INC	19,400	38.02	737,588.00
IHS INC-CLASS A	6,500	86.60	562,900.00
IRON MOUNTAIN INC	28,400	29.92	849,728.00
MANPOWERGROUP	12,900	37.45	483,105.00
NIELSEN HOLDINGS NV	14,100	28.71	404,811.00
PITNEY BOWES INC	31,306	18.83	589,491.98

REPUBLIC SERVICES INC	47,670	27.40	1,306,158.00	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	21,400	28.15	602,410.00	
RR DONNELLEY & SONS CO	29,300	14.58	427,194.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	STERICYCLE INC	12,800	79.18	1,013,504.00	
	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	19,900	38.91	774,309.00	
	WASTE MANAGEMENT INC	69,300	31.66	2,194,038.00	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	25,700	68.44	1,758,908.00	
	CSX CORP	169,500	21.32	3,613,740.00	
	DELTA AIR LINES INC	33,200	8.50	282,200.00	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	32,700	41.73	1,364,571.00	
	FEDEX CORP	46,995	83.24	3,911,863.80	
	HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	42,500	11.57	491,725.00	
	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	14,800	44.74	662,152.00	
	KANSAS CITY SOUTHERN	17,100	66.38	1,135,098.00	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	54,300	73.79	4,006,797.00	
	SOUTHWEST AIRLINES	31,100	8.44	262,484.00	
	UNION PACIFIC CORPORATION	76,060	101.75	7,739,105.00	
	UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	13,000	20.62	268,060.00	
	UNITED PARCEL SERVICE -CL B	114,820	72.45	8,318,709.00	
	AUTOLIV INC	13,700	54.13	741,581.00	
	BORGWARNER INC	17,200	69.15	1,189,380.00	
	FORD MOTOR CO	552,070	11.03	6,089,332.10	
	GENERAL MOTORS CO	121,700	21.15	2,573,955.00	
	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	38,400	14.55	558,720.00	
	HARLEY-DAVIDSON INC	37,200	38.64	1,437,408.00	
	JOHNSON CONTROLS INC	105,942	31.95	3,384,846.90	
	TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	16,500	33.55	553,575.00	
	COACH INC	45,200	62.45	2,822,740.00	
	DR HORTON INC	45,200	12.66	572,232.00	
	FOSSIL INC	8,300	86.36	716,788.00	
	GARMIN LTD	17,900	37.90	678,410.00	
	HASBRO INC	18,800	36.76	691,088.00	
	LEGGETT & PLATT INC	22,500	23.10	519,750.00	
	LULULEMON ATHLETICA INC	15,700	47.80	750,460.00	
	MATTEL INC	53,500	28.73	1,537,055.00	

MOHAWK INDUSTRIES INC	9,200	57.01	524,492.00
NEWELL RUBBERMAID INC	44,700	15.60	697,320.00
NIKE INC. CLASS B	56,100	97.68	5,479,848.00
RALPH LAUREN CORP	9,800	147.18	1,442,364.00
TOLL BROTHERS INC	23,600	20.77	490,172.00
VF CORP	13,500	136.65	1,844,775.00
WHIRLPOOL CORP	11,700	49.79	582,543.00
APOLLO GROUP INC-CL A	19,300	50.36	971,948.00
CARNIVAL CORP	71,100	34.00	2,417,400.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,900	338.60	1,659,140.00
DARDEN RESTAURANTS INC	21,500	43.21	929,015.00
DEVRY INC	10,300	34.79	358,337.00
H&R BLOCK INC	46,800	15.92	745,056.00
INTL GAME TECHNOLOGY	46,000	16.76	770,960.00
LAS VEGAS SANDS CORP	56,900	43.97	2,501,893.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	44,174	29.92	1,321,686.08
MC DONALD'S CORPORATION	160,756	98.03	15,758,910.68

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	MGM RESORTS INTERNATIONAL	53,800	10.03	539,614.00	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,200	27.04	600,288.00	
	STARBUCKS CORP	116,300	43.96	5,112,548.00	
	STARWOOD HOTELS & RESORTS	30,020	48.37	1,452,067.40	
	WYNN RESORTS LTD	12,500	110.86	1,385,750.00	
	YUM BRANDS INC	72,400	57.96	4,196,304.00	
	CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	32,300	14.23	459,629.00	
	CBS CORP-CL B	97,670	26.64	2,601,928.80	
	COMCAST CORP-CL A	325,723	22.68	7,387,397.64	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	101,350	22.54	2,284,429.00	
	DIRECTV-CLASS A	115,069	46.06	5,300,078.14	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	21,384	41.91	896,203.44	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	19,784	37.95	750,802.80	
	DISH NETWORK CORP-A	31,700	25.83	818,811.00	
	INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES	76,860	9.58	736,318.80	
	LIBERTY GLOBAL INC-A	22,353	39.76	888,755.28	
	LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	18,400	38.18	702,512.00	
LIBERTY MEDIA CORP - LIBER-A	16,900	75.24	1,271,556.00		

MCGRAW-HILL INC	46,900	43.21	2,026,549.00	
NEWS CORP INC CLASS A	285,005	17.56	5,004,687.80	
NEWS CORP INC CLASS B	69,065	17.96	1,240,407.40	
OMNICOM GROUP	43,200	44.61	1,927,152.00	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	13,900	42.21	586,719.00	
SIRIUS XM RADIO INC	589,500	1.75	1,031,625.00	
THE WALT DISNEY CO.	274,858	36.56	10,048,808.48	
TIME WARNER CABLE	50,741	62.47	3,169,790.27	
TIME WARNER INC	162,862	34.60	5,635,025.20	
VIACOM INC-CLASS B	81,570	44.12	3,598,868.40	
VIRGIN MEDIA INC	47,350	21.23	1,005,240.50	
WASHINGTON POST -CL B	800	345.00	276,000.00	
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	13,500	50.47	681,345.00	
ADVANCE AUTO PARTS	11,550	70.28	811,734.00	
AMAZON.COM INC	56,600	193.03	10,925,498.00	
AUTOZONE INC	3,900	329.82	1,286,298.00	
BED BATH & BEYOND INC	38,800	63.22	2,452,936.00	
BEST BUY CO INC	49,550	28.11	1,392,850.50	
CARMAX INC	34,700	31.15	1,080,905.00	
DOLLAR GENERAL CORP	21,500	40.44	869,460.00	
DOLLAR TREE INC	18,850	82.55	1,556,067.50	
EXPEDIA INC	30,450	28.50	867,825.00	
FAMILY DOLLAR STORES	19,200	57.86	1,110,912.00	
GAMESTOP CORP-CLASS A	22,100	24.20	534,820.00	
GAP INC/THE	60,100	18.85	1,132,885.00	
GENUINE PARTS CO	24,700	58.82	1,452,854.00	
HOME DEPOT INC	243,804	40.23	9,808,234.92	
J.C. PENNEY CO INC (HLDG CO)	25,200	33.58	846,216.00	
KOHL'S CORP	41,620	50.90	2,118,458.00	
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	87,947	16.01	1,408,031.47	
LIMITED BRANDS	39,530	40.83	1,614,009.90	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	LOWE'S COS INC	196,496	24.97	4,906,505.12	
	MACY'S INC	66,552	32.79	2,182,240.08	
	NETFLIX INC	8,200	70.89	581,298.00	
	NORDSTROM INC	26,800	48.20	1,291,760.00	

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	21,200	81.04	1,718,048.00
PETSMART INC	17,800	49.24	876,472.00
PRICELINE.COM INC	7,800	479.74	3,741,972.00
ROSS STORES INC	18,100	93.58	1,693,798.00
SEARS HOLDING CORP	6,385	56.96	363,689.60
STAPLES INC	109,650	14.67	1,608,565.50
TARGET CORP	100,020	53.50	5,351,070.00
TIFFANY & CO	18,700	67.88	1,269,356.00
TJX COMPANIES INC	59,400	63.25	3,757,050.00
URBAN OUTFITTERS INC	20,100	26.34	529,434.00
COSTCO WHOLESALE CORP	68,200	84.37	5,754,034.00
CVS CAREMARK CORP	209,583	38.37	8,041,699.71
KROGER CO	88,600	23.94	2,121,084.00
SAFEWAY INC	55,700	21.07	1,173,599.00
SYSCO CORP	92,390	29.47	2,722,733.30
WAL-MART STORES	295,426	58.32	17,229,244.32
WALGREEN CO	140,706	34.22	4,814,959.32
WHOLE FOODS MARKET INC	23,500	69.11	1,624,085.00
ALTRIA GROUP INC	322,775	28.78	9,289,464.50
ARCHER DANIELS MIDLAND COMPANY	105,310	29.12	3,066,627.20
BEAM INC	21,300	52.15	1,110,795.00
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	13,280	80.63	1,070,766.40
BUNGE LIMITED	23,200	61.79	1,433,528.00
CAMPBELL SOUP	30,200	32.84	991,768.00
COCA-COLA CO/THE	322,034	67.57	21,759,837.38
COCA-COLA ENTERPRISES	49,800	26.14	1,301,772.00
CONAGRA FOODS INC	64,650	25.70	1,661,505.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	29,800	19.79	589,742.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	33,886	37.82	1,281,568.52
GENERAL MILLS INC	100,780	40.42	4,073,527.60
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	20,100	58.44	1,174,644.00
HANSEN NATURAL CORPORATION	11,800	97.14	1,146,252.00
HEINZ (H.J.) CO	49,500	53.00	2,623,500.00
HERSHEY CO/THE	26,000	59.30	1,541,800.00
HORMEL FOODS CORP	22,500	29.58	665,550.00
JM SMUCKER CO/THE	18,200	77.42	1,409,044.00
KELLOGG CO	39,100	49.81	1,947,571.00
KRAFT FOODS INC-A	261,518	36.70	9,597,710.60
LORILLARD INC	21,587	109.30	2,359,459.10

MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,900	49.79	941,031.00	
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	31,800	75.12	2,388,816.00	
MOLSON COORS BREWING CO -B	25,700	41.40	1,063,980.00	
PEPSICO INC	246,621	65.19	16,077,222.99	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	273,775	75.58	20,691,914.50	
RALCORP HOLDINGS INC	8,700	83.83	729,321.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	REYNOLDS AMERICAN INC	54,500	40.54	2,209,430.00	
	SARA LEE CORP	87,200	18.84	1,642,848.00	
	TYSON FOODS INC-CL A	47,500	20.53	975,175.00	
	AVON PRODUCTS, INC	66,140	16.58	1,096,601.20	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	21,900	44.93	983,967.00	
	CLOROX COMPANY	20,500	65.03	1,333,115.00	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	75,800	90.46	6,856,868.00	
	ENERGIZER HOLDINGS INC	11,000	73.96	813,560.00	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	18,500	109.25	2,021,125.00	
	HERBALIFE LTD	18,400	55.17	1,015,128.00	
	KIMBERLY-CLARK CORP	61,047	70.14	4,281,836.58	
	PROCTER & GAMBLE CO	428,315	64.97	27,827,625.55	
	AETNA INC	58,400	40.91	2,389,144.00	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	42,100	36.37	1,531,177.00	
	BARD (C.R.) INC	13,500	85.70	1,156,950.00	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	88,610	50.37	4,463,285.70	
	BECTON DICKINSON & CO	33,700	72.92	2,457,404.00	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	234,886	5.34	1,254,291.24	
	CARDINAL HEALTH INC	53,954	41.89	2,260,133.06	
	CAREFUSION CORP	34,277	24.81	850,412.37	
	CERNER CORP	22,000	60.71	1,335,620.00	
	CIGNA CORP	44,500	42.61	1,896,145.00	
	COVENTRY HEALTH CARE INC	22,750	31.69	720,947.50	
	COVIDIEN PLC	76,932	44.36	3,412,703.52	
	DAVITA INC	14,700	74.61	1,096,767.00	
	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	21,600	36.13	780,408.00	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	18,000	64.53	1,161,540.00	
	EXPRESS SCRIPTS INC	72,300	45.99	3,325,077.00	
	HCA HOLDINGS INC	27,400	21.18	580,332.00	

HENRY SCHEIN INC	14,200	63.48	901,416.00	
HOLOGIC INC	40,144	17.20	690,476.80	
HUMANA INC	25,900	86.85	2,249,415.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	6,100	440.40	2,686,440.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	15,800	83.43	1,318,194.00	
MCKESSON CORP	38,400	79.74	3,062,016.00	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	60,110	57.13	3,434,084.30	
MEDTRONIC, INCORPORATED	165,345	35.92	5,939,192.40	
OMNICARE INC	18,200	33.41	608,062.00	
PATTERSON COS INC	15,500	29.34	454,770.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	24,700	57.16	1,411,852.00	
ST JUDE MEDICAL INC	51,400	35.17	1,807,738.00	
STRYKER CORP	45,400	47.85	2,172,390.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	167,768	48.91	8,205,532.88	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	18,400	64.42	1,185,328.00	
WELLPOINT INC	56,498	66.50	3,757,117.00	
ZIMMER HOLDINGS INC	29,500	49.26	1,453,170.00	
ABBOTT LABORATORIES	242,553	54.57	13,236,117.21	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	54,200	35.33	1,914,886.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	28,800	65.06	1,873,728.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	ALLERGAN INC	47,900	83.49	3,999,171.00	
	AMGEN INC	142,862	58.59	8,370,284.58	
	BIOGEN IDEC INC	35,957	112.95	4,061,343.15	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	265,875	33.54	8,917,447.50	
	CELGENE CORP	71,200	63.58	4,526,896.00	
	COVANCE INC	9,400	44.81	421,214.00	
	ELI LILLY & CO	162,433	39.27	6,378,743.91	
	FOREST LABORATORIES INC	42,800	29.66	1,269,448.00	
	GILEAD SCIENCES INC	120,300	39.01	4,692,903.00	
	HOSPIRA INC	26,415	28.07	741,469.05	
	ILLUMINA INC	19,400	28.37	550,378.00	
	JOHNSON & JOHNSON	427,070	64.53	27,558,827.10	
	LIFE TECHNOLOGIES CORP	28,100	39.56	1,111,636.00	
	MERCK & CO. INC.	480,119	35.68	17,130,645.92	
	MYLAN INC	66,500	20.00	1,330,000.00	

PERRIGO CO	13,100	99.63	1,305,153.00	
PFIZER	1,215,972	20.56	25,000,384.32	
PHARMASSET INC	10,600	129.00	1,367,400.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	59,500	45.64	2,715,580.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	31,700	29.37	931,029.00	
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	22,000	15.34	337,480.00	
WATERS CORPORATION	14,400	74.82	1,077,408.00	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	20,900	61.52	1,285,768.00	
BB&T CORPORATION	108,600	23.79	2,583,594.00	
CIT GROUP INC	30,000	34.15	1,024,500.00	
COMERICA INC	30,800	26.50	816,200.00	
FIFTH THIRD BANCORP	141,243	12.51	1,766,949.93	
HUDSON CITY BANCORP INC	74,500	5.93	441,785.00	
KEYCORP	145,940	7.38	1,077,037.20	
M & T BANK CORP	17,300	73.01	1,263,073.00	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	67,100	12.03	807,213.00	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN	57,800	12.50	722,500.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	81,988	55.91	4,583,949.08	
REGIONS FINANCIAL CORP	192,837	4.12	794,488.44	
SUNTRUST BANKS INC	82,508	17.22	1,420,787.76	
US BANCORP	299,357	26.29	7,870,095.53	
WELLS FARGO & COMPANY	781,720	26.91	21,036,085.20	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	167,401	48.80	8,169,168.80	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	37,280	47.10	1,755,888.00	
BANK OF AMERICA CORP	1,579,500	5.72	9,034,740.00	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	190,792	19.60	3,739,523.20	
BLACKROCK INC	14,700	172.68	2,538,396.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	71,584	46.07	3,297,874.88	
CITIGROUP INC	454,776	28.77	13,083,905.52	
CME GROUP INC	9,800	248.06	2,430,988.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	85,057	24.74	2,104,310.18	
EATON VANCE CORP	18,700	24.27	453,849.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,900	99.93	2,388,327.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	74,900	101.45	7,598,605.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	11,300	122.89	1,388,657.00	

INVESCO LTD	71,011	20.78	1,475,608.58
JPMORGAN CHASE & CO	607,687	33.18	20,163,054.66
LEGG MASON INC	22,000	26.12	574,640.00
LEUCADIA NATIONAL CORP	31,900	23.26	741,994.00
MOODY'S CORP	31,500	35.42	1,115,730.00
MORGAN STANLEY	225,314	16.38	3,690,643.32
NASDAQ OMX GROUP	19,400	25.52	495,088.00
NORTHERN TRUST CORP	34,200	39.74	1,359,108.00
NYSE GROUP INC	41,200	27.25	1,122,700.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	165,600	11.97	1,982,232.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	23,300	16.78	390,974.00
SLM CORP	80,200	13.08	1,049,016.00
STATE STREET CORP	78,573	40.93	3,215,992.89
T ROWE PRICE GROUP INC	39,978	57.96	2,317,124.88
TD AMERITRADE HOLDING CORP	35,100	16.32	572,832.00
ACE LTD	52,700	69.37	3,655,799.00
AFLAC INC	72,810	43.78	3,187,621.80
ALLSTATE CORP	80,260	26.93	2,161,401.80
AMERICAN INT'L GROUP	72,913	24.11	1,757,932.43
AON CORP	45,800	46.29	2,120,082.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,700	37.41	774,387.00
ASSURANT INC	14,900	39.95	595,255.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	18,900	31.20	589,680.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	141,300	77.61	10,966,293.00
CHUBB CORP	45,018	68.82	3,098,138.76
CINCINNATI FINANCIAL CORP	23,771	29.67	705,285.57
EVEREST RE GROUP LTD	8,500	83.24	707,540.00
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC CL-A	33,365	16.04	535,174.60
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	75,300	6.75	508,275.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GR	66,500	17.49	1,163,085.00
LINCOLN NATIONAL CORP	48,107	20.04	964,064.28
LOEWS CORP	50,290	38.58	1,940,188.20
MARSH & MCLENNAN COS	84,239	31.06	2,616,463.34
METLIFE INC	164,840	31.79	5,240,263.60
PARTNERRE LTD	9,800	63.92	626,416.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	48,900	24.53	1,199,517.00
PROGRESSIVE CORP	95,500	18.32	1,749,560.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	75,386	50.39	3,798,700.54
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	7,900	73.12	577,648.00

TORCHMARK CORP	16,400	43.16	707,824.00	
TRAVELERS COS INC/THE	65,213	56.02	3,653,232.26	
UNUM GROUP	48,400	21.47	1,039,148.00	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	25,700	37.98	976,086.00	
WR BERKLEY CORP	18,850	33.46	630,721.00	
XL GROUP PLC	46,500	20.56	956,040.00	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	151,000	16.12	2,434,120.00	
CBRE GROUP INC	44,900	15.48	695,052.00	
RAYONIER INC	19,100	41.50	792,650.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	WEYERHAEUSER CO	82,812	17.23	1,426,850.76	
	ACCENTURE PLC-CL A	100,400	58.71	5,894,484.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	81,000	12.24	991,440.00	
	ADOBE SYSTEMS INC	77,600	28.04	2,175,904.00	
	AKAMA I TECHNOLOGIES	29,400	28.21	829,374.00	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	8,000	103.70	829,600.00	
	AUTODESK INC	36,100	34.39	1,241,479.00	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	76,800	52.48	4,030,464.00	
	BMC SOFTWARE INC	27,800	34.70	964,660.00	
	CA INC	62,300	21.41	1,333,843.00	
	CITRIX SYSTEMS INC	29,300	71.26	2,087,918.00	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	47,300	69.38	3,281,674.00	
	COMPUTER SCIENCES CORP	23,800	25.95	617,610.00	
	EBAY INC	180,772	31.64	5,719,626.08	
	ELECTRONIC ARTS INC	52,310	21.99	1,150,296.90	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION	37,523	25.72	965,091.56	
	FISERV INC	22,100	58.65	1,296,165.00	
	GOOGLE INC-CLASS A	39,600	627.42	24,845,832.00	
	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE	186,178	194.56	36,222,791.68	
	INTUIT INC	45,000	53.27	2,397,150.00	
	MASTERCARD INC-CLASS A	16,900	377.42	6,378,398.00	
	MICROSOFT CORP	1,175,191	25.70	30,202,408.70	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	37,200	24.74	920,328.00	
	ORACLE CORP	630,776	31.69	19,989,291.44	
PAYCHEX INC	50,100	30.06	1,506,006.00		
RED HAT INC	29,700	49.70	1,476,090.00		

SAIC INC	42,600	12.46	530,796.00	
SALESFORCE.COM INC	19,600	123.88	2,428,048.00	
SYMANTEC CORP	116,100	16.19	1,879,659.00	
SYNOPSYS INC	23,100	28.02	647,262.00	
TERADATA CORP	26,500	52.77	1,398,405.00	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	25,775	20.20	520,655.00	
VERISIGN INC	24,800	33.94	841,712.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	81,200	97.19	7,891,828.00	
VMWARE INC-CLASS A	13,200	96.43	1,272,876.00	
WESTERN UNION CO	97,148	18.18	1,766,150.64	
YAHOO! INC	187,000	15.94	2,980,780.00	
AMPHENOL CORP-CL A	26,500	44.97	1,191,705.00	
APPLE INC	144,500	393.62	56,878,090.00	
ARROW ELECTRONICS INC	18,200	36.10	657,020.00	
AVNET INC	23,400	30.70	718,380.00	
CISCO SYSTEMS INC	857,213	18.88	16,184,181.44	
CORNING INC	244,900	13.79	3,377,171.00	
DELL INC	255,958	15.79	4,041,576.82	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	7,600	32.89	249,964.00	
EMC CORP/MASS	321,800	23.55	7,578,390.00	
F5 NETWORKS INC	12,800	114.74	1,468,672.00	
FLEXTRONICS INTL LTD	114,100	5.90	673,190.00	
FLIR SYSTEMS INC	24,500	25.67	628,915.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	HARRIS CORP	19,500	35.51	692,445.00	
	HEWLETT-PACKARD CO	323,300	27.90	9,020,070.00	
	JUNIPER NETWORKS INC	82,000	19.90	1,631,800.00	
	MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS I	44,162	38.87	1,716,576.94	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	48,171	47.02	2,265,000.42	
	NETAPP INC	57,460	38.01	2,184,054.60	
	QUALCOMM INC	261,338	55.18	14,420,630.84	
	SANDISK CORP	37,300	50.39	1,879,547.00	
	SEAGATE TECHNOLOGY	66,800	16.16	1,079,488.00	
	TE CONNECTIVITY LTD	67,632	33.02	2,233,208.64	
	WESTERN DIGITAL CORP	36,500	32.38	1,181,870.00	
	XEROX CORP	215,312	8.16	1,756,945.92	

AMERICAN TOWER CORP-CL A	61,700	58.59	3,615,003.00
AT&T INC	923,552	29.03	26,810,714.56
CENTURYLINK INC	96,067	35.72	3,431,513.24
CROWN CASTLE INTL CORP	44,700	43.24	1,932,828.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	156,485	5.16	807,462.60
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	23,920	18.39	439,888.80
METROPCS COMMUNICATIONS INC	39,500	8.47	334,565.00
NII HOLDINGS INC	26,100	20.23	528,003.00
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	17,400	40.59	706,266.00
SPRINT NEXTEL CORP	459,738	2.47	1,135,552.86
VERIZON COMMUNICATIONS INC	441,248	38.43	16,957,160.64
WINDSTREAM CORP	80,200	11.72	939,944.00
AES CORP	104,500	11.86	1,239,370.00
ALLIANT ENERGY CORP	17,000	42.06	715,020.00
AMEREN CORPORATION	37,900	32.33	1,225,307.00
AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY	75,200	39.73	2,987,696.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	26,900	31.08	836,052.00
CALPINE CORP	50,100	15.17	760,017.00
CENTERPOINT ENERGY INC	62,100	19.83	1,231,443.00
CONSOLIDATED EDISON INC	45,600	59.24	2,701,344.00
CONSTELLATION ENERGY GROUP	30,000	39.36	1,180,800.00
DOMINION RESOURCES INC	88,500	50.77	4,493,145.00
DTE ENERGY COMPANY	26,600	52.18	1,387,988.00
DUKE ENERGY CORP	207,456	20.86	4,327,532.16
EDISON INTERNATIONAL	47,600	39.05	1,858,780.00
ENTERGY CORP	27,400	71.27	1,952,798.00
EXELON CORP	103,300	43.58	4,501,814.00
FIRSTENERGY CORP	65,175	44.77	2,917,884.75
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	12,300	51.24	630,252.00
MDU RESOURCES GROUP INC	29,700	20.87	619,839.00
NEXTERA ENERGY INC	62,494	57.48	3,592,155.12
NISOURCE INC	44,000	22.25	979,000.00
NORTHEAST UTILITIES	27,800	34.30	953,540.00
NRG ENERGY INC	37,900	18.93	717,447.00
NSTAR	15,900	44.92	714,228.00
ONEOK INC	15,400	83.51	1,286,054.00
P G & E CORP	62,700	38.24	2,397,648.00

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	PEPCO HOLDINGS INC	34,700	19.50	676,650.00	
	PINNACLE WEST CAPITAL	16,700	46.26	772,542.00	
	PPL CORPORATION	90,000	29.07	2,616,300.00	
	PROGRESS ENERGY INC	45,900	54.37	2,495,583.00	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	78,800	31.71	2,498,748.00	
	SCANA CORP	18,700	42.98	803,726.00	
	SEMPRA ENERGY	35,000	52.53	1,838,550.00	
	SOUTHERN COMPANY	133,632	44.56	5,954,641.92	
	WISCONSIN ENERGY CORP	36,800	33.07	1,216,976.00	
	XCEL ENERGY INC	75,500	25.98	1,961,490.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES	89,692	5.54	496,893.68	
	ALTERA CORPORATION	50,500	35.89	1,812,445.00	
	ANALOG DEVICES	46,100	35.20	1,622,720.00	
	APPLIED MATERIALS INC	205,300	11.20	2,299,360.00	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	34,500	30.61	1,056,045.00	
	BROADCOM CORP-CL A	74,235	30.29	2,248,578.15	
	CREE INC	16,800	23.79	399,672.00	
	FIRST SOLAR INC	8,600	45.67	392,762.00	
	INTEL CORP	818,365	25.01	20,467,308.65	
	KLA-TENCOR CORPORATION	26,361	49.00	1,291,689.00	
	LAM RESEARCH CORP	19,100	42.63	814,233.00	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	35,825	30.23	1,082,989.75	
	LSI CORP	89,300	5.73	511,689.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	81,700	14.29	1,167,493.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	46,400	25.61	1,188,304.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	30,000	34.81	1,044,300.00	
	MICRON TECHNOLOGY INC	141,700	5.89	834,613.00	
	NVIDIA CORP	94,100	14.90	1,402,090.00	
TEXAS INSTRUMENTS INCORPORATED	180,027	29.94	5,390,008.38		
XILINX INC	41,800	32.64	1,364,352.00		
米ドル 小計		47,235,118		1,810,612,393.54 (140,648,370,730)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	43,900	26.37	1,157,643.00	
	ATHABASCA OIL SANDS CORP	46,100	12.83	591,463.00	
	BAYTEX ENERGY CORP	17,700	54.49	964,473.00	
	BONAVISTA ENERGY CORP	21,900	26.44	579,036.00	
	CAMECO CORP	62,100	18.79	1,166,859.00	

CANADIAN NATURAL RESOURCES	171,040	37.66	6,441,366.40	
CANADIAN OIL SANDS LTD	74,500	20.92	1,558,540.00	
CENOVUS ENERGY INC	117,540	34.41	4,044,551.40	
ENBRIDGE INC	114,640	36.68	4,204,995.20	
ENCANA CORP	114,740	19.55	2,243,167.00	
ENERPLUS CORP	27,500	26.15	719,125.00	
HUSKY ENERGY INC	51,800	25.00	1,295,000.00	
IMPERIAL OIL LTD	45,600	44.19	2,015,064.00	
MEG ENERGY CORP	19,100	43.37	828,367.00	
NEXEN INC	81,000	15.00	1,215,000.00	
NIKO RESOURCES LTD	7,300	47.01	343,173.00	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	39,100	20.56	803,896.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
カナダドル	PEMBINA PIPELINE CORP	26,100	30.60	798,660.00	
	PENGROWTH ENERGY CORP	56,000	11.03	617,680.00	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	73,278	19.40	1,421,593.20	
	PRECISION DRILLING CORP	36,000	11.15	401,400.00	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	29,000	14.10	408,900.00	
	SUNCOR ENERGY INC	245,332	29.85	7,323,160.20	
	TALISMAN ENERGY INC	160,700	12.65	2,032,855.00	
	TOURMALINE OIL CORP	18,600	29.66	551,676.00	
	TRANSCANADA CORP	109,550	42.36	4,640,538.00	
	VERMILION ENERGY INC	14,200	47.49	674,358.00	
	AGNICO-EAGLE MINES	26,600	43.98	1,169,868.00	
	AGRIUM INC	24,300	70.04	1,701,972.00	
	BARRICK GOLD CORP	155,800	50.70	7,899,060.00	
	CENTERRA GOLD INC	26,000	22.05	573,300.00	
	ELDORADO GOLD CORPORATION	84,400	16.74	1,412,856.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	74,900	20.55	1,539,195.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	19,400	41.35	802,190.00	
	GOLDCORP INC	125,940	51.20	6,448,128.00	
	IAMGOLD CORP	58,900	19.56	1,152,084.00	
	INMET MINING CORPORATION	8,200	65.33	535,706.00	
IVANHOE MINES LTD	44,300	22.22	984,346.00		
KINROSS GOLD CORP	177,120	13.61	2,410,603.20		
NEW GOLD INC	65,600	11.06	725,536.00		

OSISKO MINING CORP	52,800	10.82	571,296.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	16,100	24.98	402,178.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	133,400	41.57	5,545,438.00	
SILVER WHEATON CORP	54,300	33.93	1,842,399.00	
SINO-FOREST CORPORATION	34,700	0.01	347.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	90,645	37.92	3,437,258.40	
YAMANA GOLD INC	114,500	16.38	1,875,510.00	
BOMBARDIER INC CL B	220,540	3.67	809,381.80	
CAE INC	40,400	10.07	406,828.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	26,300	24.03	631,989.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	23,700	49.22	1,166,514.00	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	14,000	20.28	283,920.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	70,100	78.97	5,535,797.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	26,610	64.75	1,722,997.50	
MAGNA INTERNATIONAL INC	34,200	36.67	1,254,114.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	18,200	19.43	353,626.00	
TIM HORTONS INC	25,003	50.88	1,272,152.64	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	58,340	20.34	1,186,635.60	
THOMSON REUTERS CORP	57,853	27.32	1,580,543.96	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	12,000	65.10	781,200.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	19,400	29.95	581,030.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	4,200	62.55	262,710.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	17,300	38.16	660,168.00	
METRO INC -A	15,700	52.85	829,745.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	33,500	42.99	1,440,165.00	
WESTON (GEORGE) LTD	8,100	68.43	554,283.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
カナダドル	SAPUTO INC	21,900	38.41	841,179.00	
	VITERRA INC	57,000	10.22	582,540.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	44,500	47.92	2,132,440.00	
	BANK OF MONTREAL	99,162	56.66	5,618,518.92	
	BANK OF NOVA SCOTIA	169,200	48.98	8,287,416.00	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	62,200	71.92	4,473,424.00	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,000	68.10	1,702,500.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	223,900	49.47	11,076,333.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	138,550	73.27	10,151,558.50	

	CI FINANCIAL CORP	24,900	21.08	524,892.00
	IGM FINANCIAL INC	17,800	45.00	801,000.00
	ONEX CORPORATION	14,900	33.99	506,451.00
	TMX GROUP INC	11,600	43.00	498,800.00
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,100	402.01	1,246,231.00
	GREAT-WEST LIFECO INC	43,700	20.09	877,933.00
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	13,200	27.04	356,928.00
	INTACT FINANCIAL CORP	20,200	58.06	1,172,812.00
	MANULIFE FINANCIAL CORP	278,600	11.32	3,153,752.00
	POWER CO OF CANADA	53,700	22.65	1,216,305.00
	POWER FINANCIAL CORP	39,000	25.30	986,700.00
	SUN LIFE FINANCIAL INC	90,500	18.32	1,657,960.00
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT-CL A	86,325	28.22	2,436,091.50
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	38,625	15.67	605,253.75
	CGI GROUP INC	36,400	18.72	681,408.00
	OPEN TEXT CORP	8,800	55.68	489,984.00
	RESEARCH IN MOTION	72,500	16.76	1,215,100.00
	BCE INC	39,392	40.74	1,604,830.08
	BELL ALIANT INC	11,800	28.03	330,754.00
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	64,300	36.76	2,363,668.00
	TELUS CORP	7,300	55.35	404,055.00
	TELUS CORPORATION -NON VOTE	25,400	52.70	1,338,580.00
	CANADIAN UTILITIES LTD A	13,400	60.47	810,298.00
	FORTIS INC	29,000	32.58	944,820.00
	TRANSALTA CORP	33,200	20.89	693,548.00
	カナダドル 小計	5,856,725		183,169,674.25 (13,950,202,390)
ユーロ	CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	22,679	17.51	397,109.29
	ENI SPA	374,552	16.10	6,030,287.20
	FUGRO NV-CVA	10,472	42.85	448,777.56
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	35,508	11.76	417,574.08
	NESTE OIL OYJ	18,111	8.32	150,683.52
	OMV AG	25,115	24.57	617,201.12
	REPSOL YPF SA	123,680	23.12	2,859,481.60
	SAIPEM	40,681	32.71	1,330,675.51
	SBM OFFSHORE NV	26,520	15.94	422,728.80
	TECHNIP S.A.	15,246	68.71	1,047,552.66
	TENARIS SA	74,249	13.82	1,026,121.18
	TOTAL SA	330,831	38.85	12,854,438.50

ACERINOX SA	14,331	10.08	144,456.48	
-------------	--------	-------	------------	--

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	AIR LIQUIDE	44,217	92.25	4,079,018.25	
	AKZO NOBEL	35,596	35.62	1,267,929.52	
	ARCELORMITTAL	133,802	14.14	1,891,960.28	
	ARKEMA	8,494	52.33	444,491.02	
	BASF SE	143,149	53.90	7,715,731.10	
	CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	28,479	5.15	146,809.24	
	CRH PLC	111,663	13.50	1,507,450.50	
	HEIDELBERGCEMENT AG	21,583	31.75	685,368.16	
	IMERYS SA	5,421	34.38	186,401.08	
	K+S AG	26,468	35.07	928,365.10	
	KONINKLIJKE DSM NV	24,247	35.64	864,163.08	
	LAFARGE SA	31,528	27.54	868,438.76	
	LANXESS	12,770	38.13	486,920.10	
	LINDE AG	26,613	110.60	2,943,397.80	
	SALZGITTER AG	6,046	38.90	235,219.63	
	SOLVAY SA	9,100	64.33	585,403.00	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	91,475	4.40	403,221.80	
	THYSSENKRUPP AG	59,289	18.01	1,068,091.33	
	UMICORE	17,497	32.08	561,391.24	
	UPM-KYMMENE OYJ	79,805	8.21	655,199.05	
	VOESTALPINE AG	16,865	20.28	342,106.52	
	WACKER CHEMIE AG	2,460	67.01	164,844.60	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,733	23.43	509,312.85	
	ALSTOM	32,405	24.55	795,704.77	
	BEKAERT NV	6,120	28.04	171,635.40	
	BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	10,410	26.18	272,533.80	
	BOUYGUES SA	29,255	23.74	694,513.70	
	BRENNTAG AG	5,138	69.90	359,146.20	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	62,602	30.77	1,926,576.55	
	EIFFAGE	5,821	17.62	102,566.02	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	63,901	22.40	1,431,701.90	
	FERROVIAL SA	56,290	9.29	523,384.42	
	FIAT INDUSTRIAL	120,227	6.56	789,290.25	
	FINMECCANICA SPA	63,634	3.07	195,865.45	

FOMENTO DE CONSTRUCC Y CONTRA	7,217	20.10	145,061.70	
GEA GROUP AG	26,800	21.29	570,572.00	
HOCHTIEF AG	6,659	43.77	291,464.43	
KONE OYJ-B	24,482	40.01	979,524.82	
LEGRAND SA	34,879	24.63	859,069.77	
MAN SE	9,737	62.86	612,067.82	
METSO OYJ	19,614	28.52	559,391.28	
PHILIPS ELECTRONICS NV	157,253	15.70	2,468,872.10	
PRYSMIAN SPA	32,021	10.17	325,653.57	
SAFRAN S.A.	25,602	22.83	584,493.66	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	76,295	41.79	3,188,368.05	
SIEMENS AG-REG	128,234	74.75	9,585,491.50	
THALES SA	15,278	22.35	341,463.30	
VALLOUREC	17,618	48.82	860,198.85	
VINCI S.A.	70,344	33.07	2,326,276.08	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	WARTSILA OYJ	25,732	23.63	608,047.16	
	WENDEL	5,161	51.50	265,791.50	
	ZARDOYA OTIS SA	22,525	10.10	227,502.50	
	BIC	4,472	65.15	291,350.80	
	BUREAU VERITAS SA	8,385	54.03	453,041.55	
	EDENRED	24,270	18.64	452,514.15	
	RANDSTAD HOLDING NV	18,359	21.95	402,980.05	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	59,549	12.01	715,481.23	
	ADP	5,446	52.85	287,821.10	
	ATLANTIA SPA	48,370	11.79	570,282.30	
	DEUTSCHE POST AG-REG	130,036	10.84	1,409,590.24	
	FRAPORT AG	5,777	39.26	226,833.90	
	GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	81,054	5.37	435,746.30	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	145,865	1.79	261,098.35	
	LUFTHANSA (REGD)	35,142	9.11	320,143.62	
	TNT EXPRESS NV - W/I	54,083	5.52	298,970.82	
	VOPAK (KON)	11,055	40.47	447,451.12	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	51,603	53.80	2,776,241.40	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	8,207	37.64	308,911.48	
	CONTINENTAL AG	12,279	50.84	624,264.36	

DAIMLER AG	141,173	34.16	4,822,469.68	
FIAT SPA	117,392	3.94	462,759.26	
MICHELIN CLASS B (BROWN BDS)	28,053	47.16	1,323,119.74	
NOKIAN RENKAAT OYJ	16,891	23.78	401,667.98	
PEUGEOT SA	23,920	12.86	307,730.80	
PIRELLI & CO SPA	37,402	6.82	255,268.65	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PFD	24,077	43.98	1,059,026.84	
RENAULT SA	30,224	28.47	860,628.40	
VOLKSWAGEN AG	4,528	110.50	500,344.00	
VOLKSWAGEN AG (PREF)	22,540	124.65	2,809,611.00	
ADIDAS-SALOMON AG	32,607	50.12	1,634,262.84	
CHRISTIAN DIOR	8,572	94.80	812,625.60	
LUXOTTICA GROUP SPA	18,349	21.42	393,035.58	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	39,605	114.45	4,532,792.25	
ACCOR SA	22,636	19.62	444,118.32	
AUTOGRILL SPA	16,968	7.54	127,938.72	
OPAP SA	35,111	6.62	232,434.82	
SODEXO	14,824	52.51	778,408.24	
AXEL SPRINGER AG	6,399	32.74	209,503.26	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	15,202	28.73	436,829.47	
JC DECAUX SA	10,079	18.90	190,493.10	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	13,813	39.49	545,475.37	
LAGARDERE S.C.A.	18,114	18.60	336,920.40	
MEDIASET SPA	111,438	2.18	242,934.84	
PROSIEBEN SAT1 MEDIA AG-PFD	11,005	13.94	153,409.70	
PUBLICIS GROUPE	22,419	35.64	799,125.25	
REED ELSEVIER NV	105,686	8.76	925,915.04	
SANOMAWSOY OYJ	11,628	8.56	99,593.82	
SES	47,121	18.16	855,717.36	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	17,287	7.80	134,838.60	
	WOLTERS KLUWER	45,838	13.20	605,290.79	
	INDITEX	34,002	63.40	2,155,726.80	
	PPR	11,693	112.60	1,316,631.80	
	CARREFOUR SA	89,996	18.52	1,666,725.92	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	8,494	64.19	545,229.86	

COLRUYT SA	11,623	28.25	328,349.75
DELHAIZE GROUP	15,587	43.41	676,631.67
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	90,793	3.27	297,347.07
JERONIMO MARTINS	33,804	13.10	443,001.42
KESKO OYJ-B SHS	10,520	24.73	260,159.60
KONINKLIJKE AHOLD NV	181,085	9.79	1,773,003.23
METRO AG	19,898	30.15	599,924.70
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	125,122	44.20	5,531,018.01
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	28,125	11.97	336,656.25
DANONE	91,015	47.86	4,355,977.90
HEINEKEN HOLDING NV	17,683	29.93	529,252.19
HEINEKEN NV	39,827	35.03	1,395,338.94
KERRY GROUP PLC-A	21,551	28.10	605,583.10
PERNOD-RICARD	30,944	69.30	2,144,419.20
SUEDZUCKER AG	10,421	23.28	242,652.98
UNILEVER NV-CVA	253,886	25.50	6,475,362.43
BEIERSDORF AG	15,471	42.64	659,760.79
HENKEL AG & CO KGAA	19,937	36.38	725,308.06
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	27,375	44.11	1,207,511.25
L'OREAL	37,467	80.40	3,012,346.80
CELESIO AG	12,054	12.74	153,567.96
ESSILOR INTERNATIONAL	31,338	52.88	1,657,153.44
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	32,551	50.32	1,637,966.32
FRESENIUS SE & CO KGAA	17,473	70.12	1,225,206.76
BAYER AG	128,883	47.37	6,105,832.12
ELAN CORP PLC	78,412	8.57	671,990.84
GRIFOLS SA	21,776	12.45	271,220.08
GRIFOLS SA-RTS	21,776	0.79	17,203.04
MERCK KGAA	9,918	73.42	728,179.56
ORION OYJ	14,834	14.69	217,911.46
QIAGEN N.V.	35,866	10.76	385,918.16
SANOFI	178,626	53.34	9,527,910.84
UCB SA	15,479	31.50	487,588.50
BANCA CARIGE SPA	91,616	1.42	130,736.03
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	760,546	0.28	216,147.17
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	714,367	6.52	4,657,672.84
BANCO DE SABADELL SA	174,845	2.90	508,624.10
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	75,447	1.17	88,499.33
BANCO POPOLARE SPA	270,667	0.98	265,253.66

BANCO POPULAR ESPANOL	149,046	3.42	509,737.32	
BANCO SANTANDER SA	1,315,454	5.97	7,854,575.83	
BANKIA SAU	132,958	3.53	470,538.36	
BANKINTER SA	30,197	4.33	130,753.01	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	BNP PARIBAS	150,585	32.50	4,894,765.42	
	CAIXABANK	120,818	3.97	479,889.09	
	COMMERZBANK AG	562,655	1.32	746,643.18	
	CREDIT AGRICOLE SA	151,050	4.79	724,284.75	
	ERSTE GROUP BANK AG	29,021	12.79	371,323.69	
	INTESA SANPAOLO	1,570,363	1.27	2,005,353.55	
	INTESA SANPAOLO-RNC	134,006	0.99	133,804.99	
	IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	126,938	0.01	1,269.38	
	KBC GROUP	24,721	11.14	275,391.94	
	NATIONAL BANK OF GREECE	146,741	1.82	267,068.62	
	NATIXIS	137,179	2.17	298,089.96	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	7,024	19.99	140,444.88	
	SOCIETE GENERALE	102,812	19.55	2,010,488.66	
	UNICREDIT SPA	2,102,784	0.80	1,682,227.20	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	124,903	3.31	413,428.93	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	144,867	29.58	4,285,890.19	
	DEUTSCHE BOERSE AG-NEW	29,962	41.80	1,252,411.60	
	EURAZEO	4,301	29.00	124,729.00	
	EXOR SPA	9,213	15.36	141,511.68	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,383	52.18	646,144.94	
	ING GROEP NV-CVA	596,958	5.83	3,482,652.97	
	MEDIOBANCA SPA	79,300	4.62	366,683.20	
	POHJOLA BANK PLC	21,721	7.45	161,821.45	
	AEGON NV	270,238	3.35	907,459.20	
	AGEAS	347,890	1.33	462,693.70	
	ALLIANZ SE-REG	70,836	79.39	5,623,670.04	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	181,984	12.44	2,263,880.96	
	AXA	271,239	11.17	3,029,739.63	
	CNP ASSURANCES	21,876	10.12	221,385.12	
	DELTA LLOYD NV	15,951	13.49	215,178.99	
	HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	9,481	37.39	354,541.99	

MAPFRE SA	118,404	2.51	297,667.65	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	27,952	95.00	2,655,440.00	
SAMPO OYJ-A SHS	64,543	19.23	1,241,161.89	
SCOR SE	25,931	17.81	461,960.76	
VIENNA INSURANCE GROUP AG	5,519	28.87	159,333.53	
IMMOFINANZ AG	142,559	2.28	325,034.52	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	48,830	12.40	605,492.00	
ATOS	7,779	35.09	272,965.11	
CAP GEMINI SA	22,712	27.00	613,224.00	
DASSAULT SYSTEMS SA	9,275	61.04	566,146.00	
INDRA SISTEMAS SA	14,343	10.40	149,238.91	
SAP AG	143,405	43.80	6,281,856.02	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,952	14.04	238,006.08	
ALCATEL-LUCENT	364,829	1.26	460,414.19	
NEOPOST SA	5,071	50.54	256,288.34	
NOKIA OYJ	583,668	3.85	2,248,289.13	
BELGACOM SA	23,346	23.68	552,950.01	
DEUTSCHE TELEKOM AG (REGD)	437,773	9.28	4,066,035.62	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	ELISA CORPORATION-A SHS	22,229	15.78	350,773.62	
	FRANCE TELECOM SA	288,986	12.53	3,622,439.51	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	34,621	3.00	103,863.00	
	ILIAD SA	3,010	90.53	272,495.30	
	KONINKLIJKE KPN NV	230,280	9.04	2,081,731.20	
	MOBISTAR SA	4,718	38.74	182,798.91	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA (REGD)	103,197	4.79	495,139.20	
	TELECOM ITALIA SPA	1,442,087	0.84	1,222,168.73	
	TELECOM ITALIA-RNC	924,889	0.70	656,208.74	
	TELEFONICA S.A.	640,187	13.90	8,898,599.30	
	TELEKOM AUSTRIA AG	50,994	8.67	442,117.98	
	VIVENDI SA	194,353	16.91	3,286,509.23	
	A2A SPA	157,578	0.76	120,310.80	
	ACCIONA S.A.	3,744	68.66	257,063.04	
	E.ON AG	280,678	17.81	4,998,875.18	
	EDP RENOVAVEIS SA	31,340	4.35	136,485.70	
ELECTRICITE DE FRANCE	37,792	19.70	744,502.40		

ENAGAS	27,481	14.48	398,062.28		
ENEL GREEN POWER SPA	268,590	1.63	439,413.24		
ENEL SPA	1,025,889	3.15	3,237,705.68		
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	292,923	2.44	717,368.42		
FORTUM OYJ	68,249	16.48	1,124,743.52		
GAS NATURAL SDG SA	54,095	13.16	712,160.67		
GDF SUEZ	192,979	21.34	4,118,171.86		
IBERDROLA SA	595,928	5.04	3,005,264.90		
RED ELECTRICA CORPORACION SA	16,609	33.00	548,097.00		
RWE AG	65,260	27.94	1,823,364.40		
RWE AG-NON VTG PFD	5,510	26.03	143,425.30		
SNAM RETE GAS	246,917	3.36	830,134.95		
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	43,606	9.09	396,465.75		
TERNA SPA	184,046	2.65	489,194.26		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	56,686	8.79	498,269.94		
VERBUND AG	10,707	19.40	207,769.33		
ASML HOLDING NV	67,217	30.99	2,083,054.83		
INFINEON TECHNOLOGIES AG	166,978	5.87	981,329.70		
STMICROELECTRONICS NV	97,805	4.44	434,254.20		
ユーロ 小計	28,127,679		310,628,373.73 (32,233,906,341)		
英ポンド	AMEC PLC	50,945	9.11	464,108.95	
	BG GROUP PLC	528,326	13.48	7,124,476.11	
	BP PLC	2,952,366	4.52	13,346,170.50	
	CAIRN ENERGY PLC	220,257	2.77	610,111.89	
	ESSAR ENERGY PLC	46,829	2.22	104,381.84	
	PETROFAC LTD	39,795	14.14	562,701.30	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	564,038	22.93	12,936,211.53	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	418,368	23.56	9,856,750.08	
	TULLOW OIL PLC	140,881	13.70	1,930,069.70	
	ANGLO AMERICAN PLC	206,222	24.49	5,050,376.78	
	ANTOFAGASTA PLC	60,524	12.28	743,234.72	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
英ポンド	BHP BILLITON PLC	328,552	19.61	6,442,904.72	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES	37,931	6.85	259,827.35	
	FRESNILLO PLC	27,519	17.69	486,811.11	

GLENCORE INTERNATIONAL-W/I	127,500	4.04	515,992.50
JOHNSON MATTHEY PLC	32,948	18.76	618,104.48
KAZAKHMYS PLC	32,859	9.43	309,860.37
LONMIN PLC	25,471	10.22	260,313.62
RANDGOLD RESOURCES LTD	14,259	68.70	979,593.30
REXAM PLC	134,595	3.47	467,448.43
RIO TINTO PLC	218,026	32.45	7,076,033.83
VEDANTA RESOURCES PLC	18,803	11.12	209,089.36
XSTRATA PLC	323,442	10.11	3,271,615.83
BAE SYSTEMS PLC	525,114	2.79	1,469,794.08
BALFOUR BEATTY PLC	107,944	2.51	271,910.93
BUNZL PLC	50,702	8.43	427,417.86
COBHAM PLC	178,974	1.75	314,457.31
INVENSYS PLC	124,280	2.02	251,791.28
MEGGITT PLC	121,137	3.58	434,155.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	291,795	7.25	2,116,972.72
SMITHS GROUP PLC	60,193	9.23	555,882.35
WEIR GROUP PLC/THE	32,433	19.65	637,308.45
WOLSELEY PLC	44,787	19.66	880,512.42
AGGREKO PLC	41,824	18.53	774,998.72
BABCOCK INTL GROUP PLC	55,104	7.11	392,064.96
CAPITA GROUP PLC	96,419	6.26	603,582.94
EXPERIAN PLC	154,132	8.16	1,257,717.12
G4S PLC	216,502	2.51	543,853.02
INTERTEK GROUP PLC	24,577	19.43	477,531.11
SERCO GROUP PLC	75,727	4.71	356,825.62
GKN PLC	238,368	1.86	444,079.58
BURBERRY GROUP PLC	66,970	12.63	845,831.10
CARNIVAL PLC	28,116	21.90	615,740.40
COMPASS GROUP PLC	295,676	5.87	1,737,096.50
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	44,550	11.17	497,623.50
TUI TRABEL PLC	84,827	1.56	132,669.42
WHITBREAD PLC	27,191	15.99	434,784.09
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	177,572	7.33	1,302,490.62
ITV PLC	580,933	0.64	375,282.71
PEARSON PLC	126,957	11.44	1,452,388.08
REED ELSEVIER PLC	186,841	5.21	974,375.81
WPP PLC	194,455	6.65	1,294,098.02
KINGFISHER PLC	363,225	2.55	927,313.42

MARKS & SPENCER GROUP PLC	243,548	3.15	767,906.84	
NEXT PLC	27,298	25.95	708,383.10	
MORRISON <WM.>#8194 SUPERMARKETS	342,531	3.16	1,084,453.14	
SAINSBURY (J) PLC	187,029	2.97	555,850.18	
TESCO PLC	1,249,315	3.99	4,984,766.85	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	56,016	10.85	607,773.60	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	308,112	29.98	9,238,738.32	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
英ポンド	DIAGEO PLC	390,263	13.60	5,307,576.80	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	157,927	23.51	3,712,863.77	
	SABMILLER PLC	148,557	21.84	3,244,484.88	
	TATE & LYLE PLC	72,844	6.85	499,345.62	
	UNILEVER PLC	200,033	21.32	4,264,703.56	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	96,504	32.42	3,128,659.68	
	SMITH & NEPHEW PLC	137,117	5.89	807,619.13	
	ASTRAZENECA PLC	209,454	29.54	6,188,318.43	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	790,856	14.24	11,261,789.44	
	SHIRE PLC	87,663	21.31	1,868,098.53	
	BARCLAYS PLC	1,805,115	1.90	3,433,328.73	
	HSBC HLDGS PLC	2,781,461	5.04	14,043,596.58	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,426,810	0.26	1,716,922.29	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,763,346	0.21	607,659.78	
	STANDARD CHARTERED PLC	370,802	14.58	5,408,147.17	
	3I GROUP PLC	148,984	1.83	273,534.62	
	ICAP PLC	86,118	3.41	294,265.20	
	INVESTEC PLC	76,017	3.54	269,632.29	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	23,445	8.20	192,249.00	
	MAN GROUP PLC	296,448	1.34	399,611.90	
	SCHRODERS PLC	17,769	13.64	242,369.16	
	ADMIRAL GROUP PLC	31,120	8.54	265,920.40	
	AVIVA PLC	446,215	3.21	1,433,688.79	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	901,975	1.06	960,603.37	
	OLD MUTUAL PLC	849,363	1.17	996,302.79	
	PRUDENTIAL PLC	397,087	6.54	2,598,934.41	
RESOLUTION LTD	225,033	2.53	569,558.52		
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	554,126	1.06	587,373.56		

	STANDARD LIFE PLC	366,048	2.03	746,005.82	
	SAGE GROUP PLC	202,986	2.86	581,757.87	
	BT GROUP PLC	1,211,540	1.93	2,343,118.36	
	INMARSAT PLC	70,871	4.23	300,067.81	
	VODAFONE GROUP PLC	7,922,215	1.74	13,796,537.42	
	CENTRICA PLC	806,013	2.86	2,311,645.28	
	INTERNATIONAL POWER PLC	234,788	3.25	763,765.36	
	NATIONAL GRID PLC	554,716	6.05	3,358,805.38	
	SEVERN TRENT PLC	36,449	14.78	538,716.22	
	SSE PLC	146,029	12.55	1,832,663.95	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	107,186	6.01	644,187.86	
	ARM HOLDINGS PLC	210,205	5.70	1,198,168.50	
	英bond 小計	45,943,128		217,367,207.70 (26,403,594,719)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	49,844	39.14	1,950,894.16	
	GIVAUDAN-REG	1,307	852.00	1,113,564.00	
	HOLCIM LTD-REG	38,233	52.50	2,007,232.50	
	SIKA AG-BR	314	1,695.00	532,230.00	
	SYNGENTA AG	14,744	263.50	3,885,044.00	
	ABB LTD	341,651	17.39	5,941,310.89	
	GEBERIT AG-REG	6,102	179.10	1,092,868.20	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
スイスフラン	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,386	108.50	367,381.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,461	107.60	802,803.60	
	SULZER AG-REG	3,771	98.95	373,140.45	
	ADECCO SA-REG	20,334	38.22	777,165.48	
	SGS SA	842	1,537.00	1,294,154.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	8,491	109.80	932,311.80	
	CIE FINANC RICHEMONT-BR A	81,356	49.01	3,987,257.56	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,739	351.10	1,663,862.90	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	6,826	62.60	427,307.60	
	ARYZTA AG	12,968	43.40	562,811.20	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	282	850.50	239,841.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	141	2,853.00	402,273.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	18	31,985.00	575,730.00	
	NESTLE SA-REGISTERD	514,320	51.60	26,538,912.00	

	SONOVA HOLDING AG	7,541	96.75	729,591.75	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,124	164.90	185,347.60	
	SYNTHESE INC	10,033	154.20	1,547,088.60	
	ACTELION LTD-REG	16,984	32.98	560,132.32	
	LONZA GROUP AG-REG	7,905	54.90	433,984.50	
	NOVARTIS AG-REG SHS	363,730	50.90	18,513,857.00	
	ROCHE HLDGS AG GENUSSCHINE	109,498	154.50	16,917,441.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	177,827	22.98	4,086,464.46	
	GAM HOLDING LTD	32,490	10.80	350,892.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	32,490	34.80	1,130,652.00	
	PARGESA HOLDING SA-BR	4,249	65.00	276,185.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,081	167.50	348,567.50	
	UBS AG REG	567,215	11.42	6,477,595.30	
	BALOISE HOLDING AG-REG	7,186	62.90	451,999.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	4,678	93.70	438,328.60	
	SWISS RE LTD	54,111	49.46	2,676,330.06	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	22,698	209.50	4,755,231.00	
	SWISSCOM AG (REG)	3,582	344.70	1,234,715.40	
	スイスフラン 小計	2,542,552		116,582,498.83 (9,778,940,001)	
スウェーデン クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	34,683	168.00	5,826,744.00	
	BOLIDEN AB	41,978	101.70	4,269,162.60	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,461	190.70	1,422,812.70	
	SSAB AB-A SHARES	25,509	60.50	1,543,294.50	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	90,768	97.55	8,854,418.40	
	ALFA LAVAL AB	51,820	130.70	6,772,874.00	
	ASSA ABLOY AB B	49,398	165.40	8,170,429.20	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	104,659	145.20	15,196,486.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	61,356	127.70	7,835,161.20	
	SANDVIK AB	154,932	83.15	12,882,595.80	
	SCANIA AB-B SHS	49,114	101.00	4,960,514.00	
	SKANSKA AB-B SHS	61,378	104.60	6,420,138.80	
	SKF AB-B SHS	61,373	140.80	8,641,318.40	
	VOLVO AB-B SHS	216,448	73.60	15,930,572.80	
SECURITAS AB-B SHS	49,234	60.25	2,966,348.50		

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

スウェーデン クローナ	ELECTROLUX AB-SER B	36,879	111.80	4,123,072.20	
	HUSQVARNA AB-B SHS	69,587	32.09	2,233,046.83	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	7,294	312.00	2,275,728.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	159,357	209.90	33,449,034.30	
	SWEDISH MATCH AB	33,491	222.00	7,435,002.00	
	GETINGE AB-B SHS	30,718	167.50	5,145,265.00	
	NORDEA BANK AB	410,011	52.80	21,648,580.80	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK-A	216,725	40.51	8,779,529.75	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	76,345	182.70	13,948,231.50	
	SWEDBANK AB - A SHARES	124,376	89.05	11,075,682.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,631	79.15	1,316,343.65	
	INVESTOR AB-B SHS	69,985	125.40	8,776,119.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	32,334	132.60	4,287,488.40	
	RATOS AB-B SHS	29,254	76.30	2,232,080.20	
	ERICSSON(L.M.)TEL CLASS B	469,371	67.55	31,706,011.05	
	HEXAGON AB-B SHS	38,895	97.20	3,780,594.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	11,730	695.00	8,152,350.00	
TELE2 AB -B SHS	48,657	131.70	6,408,126.90		
TELIASONERA AB	337,431	45.30	15,285,624.30		
スウェーデンクローナ 小計		3,279,182		303,750,782.38 (3,502,246,520)	
ノルウェー クローネ	AKER SOLUTIONS ASA	23,626	65.70	1,552,228.20	
	SEADRILL LTD	50,471	196.70	9,927,645.70	
	STATOIL ASA	173,938	153.40	26,682,089.20	
	SUBSEA 7 SA	43,195	108.50	4,686,657.50	
	NORSK HYDRO ASA	142,897	26.84	3,835,355.48	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,121	231.10	6,729,863.10	
	ORKLA ASA	121,338	42.60	5,168,998.80	
	DNB ASA	150,159	56.00	8,408,904.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	31,447	67.20	2,113,238.40	
TELENOR ASA	112,790	95.00	10,715,050.00		
ノルウェークローネ 小計		878,982		79,820,030.38 (1,077,570,410)	
デンマーク クローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	36,255	169.70	6,152,473.50	
	VESTAS WIND SYSTEM AS	31,264	67.35	2,105,630.40	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	84	34,840.00	2,926,560.00	
	A P MOLLER MAERSK A/S	207	36,660.00	7,588,620.00	
	DSV A/S	31,310	101.90	3,190,489.00	
	CARLSBERG AS-B	16,820	395.60	6,653,992.00	

	COLOPLAST-B	3,580	831.00	2,974,980.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,438	456.70	1,570,134.60	
	NOVO NORDISK AS-B	66,279	634.50	42,054,025.50	
	DANSKE BANK AS	100,213	75.10	7,525,996.30	
	TRYG A/S	3,675	319.70	1,174,897.50	
	TDC A/S	56,979	46.41	2,644,395.39	
	デンマーククローネ 小計	350,104		86,562,194.19 (1,208,408,230)	
オーストラリア アドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	19,071	12.77	243,536.67	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	165,982	14.29	2,371,882.78	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
オーストラリア アドル	SANTOS	146,943	12.81	1,882,339.83	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	98,903	31.89	3,154,016.67	
	WORLEYPARSONS LTD	29,673	26.82	795,829.86	
	ALUMINA LTD	374,521	1.34	501,858.14	
	AMCOR LTD	188,592	7.34	1,384,265.28	
	BHP BILLITON LTD	500,526	35.86	17,948,862.36	
	BLUESCOPE STEEL LTD-RIGHTS	211,791	0.00	1,270.74	
	BORAL LIMITED	114,770	3.69	423,501.30	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	191,144	4.72	902,199.68	
	ILUKA RESOURCES LIMITED	64,262	16.85	1,082,814.70	
	INCITEC PIVOT LTD	249,977	3.13	782,428.01	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	68,761	6.78	466,199.58	
	LYNAS CORP LTD	261,311	1.30	339,704.30	
	NEWCREST MINING LIMITED	119,229	33.05	3,940,518.45	
	ONESTEEL LIMITED	191,804	0.81	155,361.24	
	ORICA LIMITED	55,810	25.54	1,425,387.40	
	OZ MINERALS LTD	49,705	10.88	540,790.40	
	RIO TINTO LTD	67,915	63.74	4,328,902.10	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	25,836	13.25	342,327.00	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	23,242	21.02	488,546.84	
	BRAMBLES LTD	227,303	7.05	1,602,486.15	
CAMPBELL BROTHERS LTD	10,521	50.76	534,045.96		
ASCIANO LTD	149,699	4.81	720,052.19		
MAP GROUP	61,192	2.78	170,113.76		
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	159,503	1.59	253,609.77	

QR NATIONAL LTD	262,144	3.39	888,668.16	
TOLL HOLDINGS LIMITED	106,074	4.67	495,365.58	
TRANSURBAN GROUP	204,278	5.57	1,137,828.46	
CROWN LTD	71,548	8.16	583,831.68	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	107,693	3.73	401,694.89	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	107,693	2.72	292,924.96	
TATTS GROUP LTD	202,391	2.36	477,642.76	
FAIRFAX MEDIA LTD	351,320	0.79	277,542.80	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	76,332	2.09	159,533.88	
METCASH LTD	120,891	4.06	490,817.46	
WESFARMERS LTD	156,757	31.48	4,934,710.36	
WOOLWORTHS LIMITED	189,610	25.61	4,855,912.10	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	89,386	11.55	1,032,408.30	
FOSTER'S GROUP LTD	297,371	5.38	1,599,855.98	
COCHLEAR LIMITED	8,709	54.81	477,340.29	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20,653	18.66	385,384.98	
SONIC HEALTHCARE LTD	56,635	11.54	653,567.90	
CSL LIMITED	81,801	32.09	2,624,994.09	
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	409,726	20.85	8,542,787.10	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	56,379	9.22	519,814.38	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	242,932	48.84	11,864,798.88	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	343,059	24.02	8,240,277.18	
WESTPAC BANKING CORPORATION	472,270	21.07	9,950,728.90	
ASX LTD	26,880	30.81	828,172.80	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
オーストラリア アドル	MACQUARIE GROUP LTD	53,293	24.38	1,299,283.34	
	AMP LIMITED	432,015	4.30	1,857,664.50	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	326,897	3.09	1,010,111.73	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	170,295	13.86	2,360,288.70	
	SUNCORP GROUP LTD	197,686	8.34	1,648,701.24	
	LEND LEASE GROUP	83,243	7.37	613,500.91	
	COMPUTERSHARE LTD	68,227	7.97	543,769.19	
	TELSTRA CORPORATION LTD	678,758	3.23	2,192,388.34	
	AGL ENERGY LTD	72,534	14.42	1,045,940.28	
	SP AUSNET	219,745	0.93	205,461.57	

オーストラリアドル 小計		10,193,211		121,276,564.83 (9,590,550,746)	
ニュージーラ ンドドル	FLETCHER BUILDING LTD	104,147	6.08	633,213.76	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	145,568	2.37	345,724.00	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	87,272	3.45	301,088.40	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	295,397	2.11	624,764.65	
	CONTACT ENERGY LIMITED	56,144	5.40	303,177.60	
ニュージーランドドル 小計		688,528		2,207,968.41 (132,698,901)	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA LTD	332,000	66.05	21,928,600.00	
	NWS HOLDINGS LTD	213,500	10.88	2,322,880.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	186,000	13.10	2,436,600.00	
	MTR CORPORATION	222,000	24.90	5,527,800.00	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	31,500	37.45	1,179,675.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	116,500	22.90	2,667,850.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	190,000	14.80	2,812,000.00	
	SANDS CHINA LTD	379,600	23.15	8,787,740.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	222,000	13.68	3,036,960.00	
	SJM HOLDINGS LTD	254,000	12.56	3,190,240.00	
	WYNN MACAU LTD	238,800	19.42	4,637,496.00	
	LI & FUNG LTD	872,400	15.68	13,679,232.00	
	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	89,500	17.86	1,598,470.00	
	BANK OF EAST ASIA LIMITED	237,020	28.10	6,660,262.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	569,000	17.88	10,173,720.00	
	HANG SENG BANK LTD	117,600	92.80	10,913,280.00	
	WING HANG BANK LIMITED	27,000	61.95	1,672,650.00	
	FIRST PACIFIC CO	332,000	8.63	2,865,160.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	159,800	127.30	20,342,540.00	
	AIA GROUP LTD	1,314,000	23.50	30,879,000.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	217,000	88.85	19,280,450.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	135,000	43.50	5,872,500.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	378,000	23.05	8,712,900.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	144,585	36.70	5,306,269.50	
	HOPEWELL HOLDINGS	82,000	20.10	1,648,200.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	99,000	24.35	2,410,650.00	
KERRY PROPERTIES LTD	106,000	25.95	2,750,700.00		
NEW WORLD DEVELOPMENT	560,000	6.56	3,673,600.00		
SINO LAND CO	446,600	10.14	4,528,524.00		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	218,000	98.45	21,462,100.00		

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
香港ドル	SWIRE PACIFIC CL A	114,000	90.95	10,368,300.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	238,000	35.90	8,544,200.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	144,000	19.62	2,825,280.00	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	309,000	4.86	1,501,740.00	
	PCCW LTD	622,000	2.79	1,735,380.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	71,000	43.30	3,074,300.00	
	CLP HOLDINGS LTD	300,000	66.60	19,980,000.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	728,973	17.60	12,829,924.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	213,500	56.70	12,105,450.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	31,100	86.20	2,680,820.00		
香港ドル 小計		11,261,978		308,603,443.30 (3,079,862,364)	
シンガポール ドル	COSCO CORP SINGAPORE LTD	143,000	0.88	126,555.00	
	FRASER & NEAVE LTD	139,500	5.93	827,235.00	
	KEPPEL CORP LTD	219,500	9.20	2,019,400.00	
	NOBLE GROUP LTD	590,145	1.18	696,371.10	
	SEBACORP INDUSTRIES LIMITED	151,000	4.19	632,690.00	
	SEBACORP MARINE LTD	131,400	3.86	507,204.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	240,000	2.73	655,200.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	272,000	0.92	251,600.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	296,000	1.42	420,320.00	
	NEPTUNE ORIENT LINES LTD	140,000	1.12	157,500.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	82,600	10.16	839,216.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	958,400	1.52	1,456,768.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	235,250	3.64	856,310.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	17,000	49.00	833,000.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	228,800	2.26	517,088.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,049,720	0.71	745,301.20	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	302,000	5.04	1,522,080.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	274,000	12.08	3,309,920.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	396,000	7.96	3,152,160.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	194,000	15.36	2,979,840.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	132,000	6.09	803,880.00	
CAPITALAND LIMITED	393,000	2.35	923,550.00		
CAPITAMALLS ASIA LTD	196,000	1.22	239,120.00		

	CITY DEVELOPMENTS LTD	77,000	9.00	693,000.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	289,000	1.72	497,080.00	
	KEPPEL LAND LTD	105,000	2.35	246,750.00	
	UOL GROUP LTD	67,400	3.87	260,838.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,241,880	3.13	3,887,084.40	
	STARHUB LTD	87,000	2.86	248,820.00	
	シンガポールドル 小計	8,648,595		30,305,880.70 (1,815,928,371)	
イスラエル シェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	68,212	36.08	2,461,088.96	
	ISRAEL CORP LTD	327	2,253.00	736,731.00	
	DELEK GROUP LTD	633	705.80	446,771.40	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,688	159.00	586,392.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	146,570	151.70	22,234,669.00	
	BANK HAPOLIM BM	162,589	13.12	2,133,167.68	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
イスラエル シェケル	BANK LEUMI LE-ISRAEL	180,928	11.19	2,024,584.32	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	112,026	5.68	636,979.83	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	19,485	31.16	607,152.60	
	NICE SYSTEMS LTD	9,047	129.00	1,167,063.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	269,518	7.09	1,910,882.62	
	CELLCOM ISRAEL LTD	7,107	62.32	442,908.24	
	PARTNER COMMUNICATIONS CO	12,263	34.00	416,942.00	
	イスラエルシェケル 小計	992,393		35,805,332.65 (737,589,852)	
	合計	165,998,175		244,159,869,575 (244,159,869,575)	

B. 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託 受益証券	シンガポール ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	271,000	516,255.00	
		CAPITAMALL TRUST	337,600	570,544.00	
		シンガポールドル 小計	608,600	1,086,799.00 (65,120,996)	
	投資信託受益証券 合計	608,600	65,120,996 (65,120,996)		
投資証券	米ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,529	1,825,423.56	

	BOSTON PROPERTIES INC	22,900	2,186,721.00	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	15,500	1,005,485.00	
	DUKE REALTY CORP	39,700	466,872.00	
	EQUITY RESIDENTIAL	46,200	2,513,280.00	
	FED REALTY INVS TRUST	9,600	864,000.00	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	66,797	943,173.64	
	HCP INC	63,500	2,464,435.00	
	HEALTH CARE REIT INC	29,600	1,501,904.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	110,081	1,575,259.11	
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	822,000	509,640.00	
	KIMCO REALTY CORP	64,000	1,026,560.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	17,700	531,000.00	
	MACERICH CO	20,600	1,029,176.00	
	PLUM CREEK TIMBER CO	24,900	896,151.00	
	PROLOGIS INC	71,540	2,053,198.00	
	PUBLIC STORAGE INC	22,600	2,941,842.00	
	REGENCY CENTERS CORP	13,800	505,494.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	45,765	5,688,589.50	
	VENTAS INC	42,100	2,248,140.00	
	VORNADO REALTY TRUST	25,549	1,901,612.07	
	米ドル 小計	1,588,961	34,677,955.88 (2,693,783,612)	
カナダドル	CRESCENT POINT ENERGY CORP	38,500	1,704,010.00	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	12,000	279,960.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	20,000	513,000.00	
	カナダドル 小計	70,500	2,496,970.00 (190,169,235)	

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	0.00	
		CORIO NV	9,207	302,219.77	
		FONCIERE DES REGIONS	4,215	201,582.37	
		GECINA SA	3,446	209,930.32	
		ICADE	3,666	206,322.48	
		KLEPIERRE	16,009	349,396.42	
		UNIBAIL	14,327	1,964,231.70	
	ユーロ 小計	1,656,454	3,233,683.06 (335,559,291)		

英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	132,527	620,888.99	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	85,721	271,049.80	
	HAMMERSON PLC	101,570	376,824.70	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	118,733	772,951.83	
	SEGRO PLC	106,565	229,327.88	
英ポンド 小計		545,116	2,271,043.20 (275,863,617)	
オーストラリア ドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	282,061	521,812.85	
	DEXUS PROPERTY GROUP	742,693	642,429.44	
	GOODMAN GROUP	1,078,178	625,343.24	
	GPT GROUP	270,547	854,928.52	
	MIRVAC GROUP	524,429	671,269.12	
	STOCKLAND	374,697	1,258,981.92	
	WESTFIELD GROUP	341,873	2,717,890.35	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	456,211	1,181,586.49	
オーストラリアドル 小計		4,070,689	8,474,241.93 (670,143,051)	
香港ドル	LINK REIT	351,000	9,828,000.00	
香港ドル 小計		351,000	9,828,000.00 (98,083,440)	
投資証券 合計		8,282,720	4,263,602,246 (4,263,602,246)	
合計			4,328,723,242 (4,328,723,242)	

(注) 有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (注1)	組入投資信託 受益証券 時価比率 (注2)	組入投資証券 時価比率 (注3)	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	588	98.1%		1.9%	57.7%
カナダドル	103	98.7%		1.3%	5.7%

ユーロ	252	99.0%		1.0%	13.1%
英ポンド	105	99.0%		1.0%	10.7%
スイスフラン	39	100.0%			3.9%
スウェーデンクローナ	34	100.0%			1.4%
ノルウェークローネ	10	100.0%			0.4%
デンマーククローネ	12	100.0%			0.5%
オーストラリアドル	69	93.5%		6.5%	4.1%
ニュージーランドドル	5	100.0%			0.1%
香港ドル	41	96.9%		3.1%	1.3%
シンガポールドル	31	96.5%	3.5%		0.8%
イスラエルシェケル	13	100.0%			0.3%
合計	1,302	98.3%	0.0%	1.7%	100.0%

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

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

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

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次△](#)

「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23年12月12日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	468,586,079
コール・ローン	7,257,160,167
国債証券	380,940,980,013
派生商品評価勘定	30,528,945
未収利息	4,155,456,088
前払費用	185,998,152
差入委託証拠金	247,711,227
流動資産合計	393,286,420,671
資産合計	393,286,420,671
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	92,668,507
未払解約金	188,370,393
流動負債合計	281,038,900
負債合計	281,038,900
純資産の部	
元本等	
元本	268,151,095,146
剰余金	
剰余金	124,854,286,625
純資産合計	393,005,381,771
負債・純資産合計	393,286,420,671

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成23年12月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

平成23年12月12日現在	
1. 計算日における受益権総数	268,151,095,146 口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4656 円 (14,656 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23年12月12日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>

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23年12月12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23年12月12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23年12月12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23年12月12日現在	
特定期間の期首元本額	278,752,660,011 円
特定期間中の追加設定元本額	12,870,087,678 円
特定期間中の一部解約元本額	23,471,652,543 円
計算日の元本額	268,151,095,146 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	5,913,685,932 円
中央三井DC外国債券インデックスファンド	1,860,170,804 円
中央三井DC外国債券インデックスファンドL	8,569,043,099 円
物価連動債組入世界債券ファンド	111,439,979 円
中央三井DCバランスファンド30	102,422,825 円
中央三井DCバランスファンド50	152,750,219 円
中央三井DCバランスファンド70	29,770,540 円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	144,250,151 円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	90,304,877 円
新生・4分散ファンド	110,219,994 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	406,591,717 円
4資産インデックスバランスオープン（分配型）	54,559,411 円
4資産インデックスバランスオープン（成長型）	105,328,549 円
CMAM外国債券インデックスe	551,458,121 円
中央三井インデックスコレクション（外国債券）	1,026,726,012 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式30）	108,652,828 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式50）	150,929,566 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式70）	45,426,187 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VA（適格機関投資家専用）	18,224,288,808 円
中央三井バランスVA30（適格機関投資家専用）	8,091,186,300 円
中央三井バランスVA50（適格機関投資家専用）	26,020,034,080 円
中央三井VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	90,248,575,301 円
中央三井VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	4,663,507,674 円
中央三井VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	116,501,059 円
中央三井VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	9,281,929,323 円
中央三井バランスVA25（適格機関投資家専用）	7,568,871,943 円
中央三井バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	2,159,665,243 円
中央三井バランスVA50L（適格機関投資家専用）	20,432,206,580 円
中央三井バランスVA75（適格機関投資家専用）	729,574,740 円
中央三井VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	33,139,269,418 円
中央三井VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	5,634,875,608 円
中央三井VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	526,715,740 円

中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)	2,699,439,216 円
中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	2,745,535,072 円
中央三井VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	411,233,306 円
CMAM・VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	159,256,812 円
中央三井バランスVA20(適格機関投資家専用)	3,786,618,609 円
中央三井VAファンド25(適格機関投資家専用)	6,836,871,733 円
中央三井バランスVA20L(適格機関投資家専用)	48,838,174 円
中央三井バランスVA25L(適格機関投資家専用)	975,440,895 円
中央三井世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	309,624,018 円
CMAM・VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	3,313,536,745 円
私募外国債券インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	42,834,908 円
中央三井世界バランスVA20(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23年12月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	14,787,099,462
合計	14,787,099,462

(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23年12月12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23年12月12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	4,805,307,609		4,805,623,737	316,128
	合計	4,805,307,609		4,805,623,737	316,128

(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

区分	種類	平成23年12月12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	4,805,027,950		4,815,540,000	10,512,050
	カナダドル	518,524,450		517,752,000	772,450
	ユーロ	5,045,347,300		4,980,480,000	64,867,300
	英ポンド	1,005,507,000		995,890,000	9,617,000
	計	11,374,406,700		11,309,662,000	64,744,700
	売 建				
	米ドル	1,853,151,660		1,848,546,000	4,605,660
	カナダドル	196,110,050		197,964,000	1,853,950
	ユーロ	1,972,307,450		1,971,440,000	867,450
英ポンド	369,092,350		370,422,500	1,330,150	
計	4,390,661,510		4,388,372,500	2,289,010	
合計	15,765,068,210		15,698,034,500	62,455,690	

(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23年12月12日現在

該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表（平成23年12月12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 0.500% 2012/11/30	15,000,000	15,051,562.50	
		US TREASURY N/B 1.125% 2012/12/15	9,000,000	9,084,375.00	
		US TREASURY N/B 0.625% 2012/12/31	1,120,000	1,125,162.50	
		US TREASURY N/B 0.625% 2013/01/31	6,570,000	6,602,850.00	
		US TREASURY N/B 2.875% 2013/01/31	17,740,000	18,287,445.40	
		US TREASURY N/B 1.375% 2013/02/15	1,000,000	1,013,750.00	
		US TREASURY N/B 3.875% 2013/02/15	9,650,000	10,072,187.50	
		US TREASURY N/B 0.625% 2013/02/28	27,450,000	27,591,539.06	
		US TREASURY N/B 2.750% 2013/02/28	15,630,000	16,123,321.87	
		US TREASURY N/B 1.375% 2013/03/15	9,880,000	10,026,656.25	
		US TREASURY N/B 0.750% 2013/03/31	8,200,000	8,260,859.41	
		US TREASURY N/B 1.750% 2013/04/15	24,000,000	24,502,500.00	
		US TREASURY N/B 0.625% 2013/04/30	13,700,000	13,781,343.75	
		US TREASURY N/B 3.125% 2013/04/30	12,700,000	13,214,945.37	
		US TREASURY N/B 1.375% 2013/05/15	10,000,000	10,167,187.50	
		US TREASURY N/B 3.625% 2013/05/15	10,000,000	10,487,500.00	
		US TREASURY N/B 0.500% 2013/05/31	14,970,000	15,034,324.29	
		US TREASURY N/B 1.125% 2013/06/15	11,410,000	11,565,996.15	
		US TREASURY N/B 0.375% 2013/06/30	1,000,000	1,002,421.88	
		US TREASURY N/B 1.000% 2013/07/15	17,030,000	17,240,214.06	
		US TREASURY N/B 3.375% 2013/07/31	17,810,000	18,736,676.56	
		US TREASURY N/B 0.750% 2013/08/15	15,000,000	15,133,593.75	
		US TREASURY N/B 4.250% 2013/08/15	6,930,000	7,397,775.00	
		US TREASURY N/B 0.125% 2013/08/31	9,600,000	9,583,500.00	
		US TREASURY N/B 3.125% 2013/08/31	3,210,000	3,369,998.43	
		US TREASURY N/B 0.750% 2013/09/15	15,000,000	15,137,109.45	
		US TREASURY N/B 0.125% 2013/09/30	21,000,000	20,960,625.00	
		US TREASURY N/B 0.500% 2013/10/15	13,700,000	13,762,078.12	
		US TREASURY N/B 0.250% 2013/10/31	10,000,000	10,003,906.30	
		US TREASURY N/B 2.750% 2013/10/31	21,600,000	22,615,875.00	
		US TREASURY N/B 0.500% 2013/11/15	15,000,000	15,069,140.70	
		US TREASURY N/B 4.250% 2013/11/15	2,140,000	2,304,512.50	

US TREASURY N/B	0.250%	2013/11/30	12,400,000	12,403,875.00	
US TREASURY N/B	2.000%	2013/11/30	6,500,000	6,723,437.50	
US TREASURY N/B	0.750%	2013/12/15	2,000,000	2,020,000.00	
US TREASURY N/B	1.500%	2013/12/31	40,120,000	41,148,075.00	
US TREASURY N/B	1.750%	2014/01/31	18,900,000	19,489,148.53	
US TREASURY N/B	4.000%	2014/02/15	4,000,000	4,322,500.00	
US TREASURY N/B	1.875%	2014/02/28	2,000,000	2,070,156.26	
US TREASURY N/B	1.250%	2014/03/15	15,100,000	15,431,492.26	
US TREASURY N/B	1.750%	2014/03/31	13,000,000	13,439,765.69	
US TREASURY N/B	1.250%	2014/04/15	5,110,000	5,225,374.24	
US TREASURY N/B	1.875%	2014/04/30	6,880,000	7,139,075.00	
US TREASURY N/B	1.000%	2014/05/15	4,900,000	4,983,453.12	
US TREASURY N/B	4.750%	2014/05/15	9,300,000	10,298,296.87	
US TREASURY N/B	2.250%	2014/05/31	5,000,000	5,238,671.90	

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 0.750% 2014/06/15	10,000,000	10,111,718.80	
		US TREASURY N/B 2.625% 2014/06/30	13,000,000	13,766,796.94	
		US TREASURY N/B 0.625% 2014/07/15	2,000,000	2,015,937.50	
		US TREASURY N/B 2.625% 2014/07/31	32,650,000	34,611,550.94	
		US TREASURY N/B 0.500% 2014/08/15	13,000,000	13,058,906.25	
		US TREASURY N/B 4.250% 2014/08/15	12,550,000	13,857,945.31	
		US TREASURY N/B 2.375% 2014/08/31	26,000,000	27,427,968.88	
		US TREASURY N/B 0.250% 2014/09/15	9,000,000	8,976,796.92	
		US TREASURY N/B 2.375% 2014/09/30	12,150,000	12,836,285.21	
		US TREASURY N/B 0.500% 2014/10/15	5,100,000	5,120,718.75	
		US TREASURY N/B 2.375% 2014/10/31	15,950,000	16,873,355.54	
		US TREASURY N/B 0.375% 2014/11/15	14,000,000	14,005,468.82	
		US TREASURY N/B 4.250% 2014/11/15	9,230,000	10,271,259.37	
		US TREASURY N/B 2.125% 2014/11/30	11,400,000	11,986,921.93	
		US TREASURY N/B 2.625% 2014/12/31	3,480,000	3,715,171.89	
		US TREASURY N/B 2.250% 2015/01/31	14,900,000	15,754,421.87	
		US TREASURY N/B 11.250% 2015/02/15	2,550,000	3,422,578.12	
		US TREASURY N/B 4.000% 2015/02/15	10,020,000	11,148,815.62	
		US TREASURY N/B 2.375% 2015/02/28	5,500,000	5,842,890.62	
		US TREASURY N/B 2.500% 2015/03/31	12,820,000	13,698,370.37	
US TREASURY N/B 2.500% 2015/04/30	8,930,000	9,549,518.75			
US TREASURY N/B 4.125% 2015/05/15	7,040,000	7,917,800.00			

US TREASURY N/B	2.125%	2015/05/31	6,950,000	7,347,453.12	
US TREASURY N/B	1.875%	2015/06/30	23,900,000	25,074,461.05	
US TREASURY N/B	1.750%	2015/07/31	8,000,000	8,361,875.04	
US TREASURY N/B	4.250%	2015/08/15	500,000	568,203.12	
US TREASURY N/B	1.250%	2015/08/31	11,990,000	12,321,598.43	
US TREASURY N/B	1.250%	2015/09/30	21,980,000	22,568,995.42	
US TREASURY N/B	1.250%	2015/10/31	10,000,000	10,260,937.50	
US TREASURY N/B	4.500%	2015/11/15	12,160,000	14,010,600.00	
US TREASURY N/B	1.375%	2015/11/30	25,000,000	25,769,531.25	
US TREASURY N/B	2.125%	2015/12/31	11,000,000	11,675,468.75	
US TREASURY N/B	2.000%	2016/01/31	3,000,000	3,166,875.00	
US TREASURY N/B	4.500%	2016/02/15	7,700,000	8,916,359.37	
US TREASURY N/B	2.625%	2016/02/29	22,900,000	24,767,781.25	
US TREASURY N/B	2.250%	2016/03/31	9,150,000	9,763,335.93	
US TREASURY N/B	2.375%	2016/03/31	7,900,000	8,464,109.37	
US TREASURY N/B	2.000%	2016/04/30	6,090,000	6,432,086.74	
US TREASURY N/B	2.625%	2016/04/30	13,580,000	14,700,350.00	
US TREASURY N/B	5.125%	2016/05/15	22,000,000	26,221,250.00	
US TREASURY N/B	7.250%	2016/05/15	1,670,000	2,148,298.43	
US TREASURY N/B	1.750%	2016/05/31	10,960,000	11,450,631.30	
US TREASURY N/B	1.500%	2016/06/30	21,960,000	22,678,846.98	
US TREASURY N/B	3.250%	2016/06/30	9,000,000	10,005,468.75	
US TREASURY N/B	1.500%	2016/07/31	9,950,000	10,270,265.62	
US TREASURY N/B	3.250%	2016/07/31	3,560,000	3,961,056.25	
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	11,092,812.50	
US TREASURY N/B	3.000%	2016/08/31	1,030,000	1,134,609.37	
US TREASURY N/B	1.000%	2016/09/30	10,000,000	10,075,781.30	
US TREASURY N/B	3.000%	2016/09/30	4,000,000	4,404,375.00	

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	5,983,875.00	
		US TREASURY N/B 4.625% 2016/11/15	2,450,000	2,893,296.87	
		US TREASURY N/B 7.500% 2016/11/15	8,250,000	10,895,156.25	
		US TREASURY N/B 2.750% 2016/11/30	15,500,000	16,897,421.87	
		US TREASURY N/B 3.250% 2016/12/31	9,800,000	10,925,468.75	
		US TREASURY N/B 3.125% 2017/01/31	5,000,000	5,546,093.75	
		US TREASURY N/B 4.625% 2017/02/15	18,500,000	21,942,734.37	

US TREASURY N/B	3.000%	2017/02/28	31,550,000	34,808,523.43	
US TREASURY N/B	3.250%	2017/03/31	15,300,000	17,088,187.50	
US TREASURY N/B	3.125%	2017/04/30	4,900,000	5,442,828.12	
US TREASURY N/B	4.500%	2017/05/15	15,530,000	18,378,784.37	
US TREASURY N/B	8.750%	2017/05/15	2,700,000	3,809,953.12	
US TREASURY N/B	2.750%	2017/05/31	9,900,000	10,798,734.37	
US TREASURY N/B	2.500%	2017/06/30	2,200,000	2,371,187.50	
US TREASURY N/B	2.375%	2017/07/31	2,000,000	2,140,625.00	
US TREASURY N/B	1.875%	2017/08/31	2,000,000	2,085,312.50	
US TREASURY N/B	1.875%	2017/09/30	1,210,000	1,259,723.43	
US TREASURY N/B	1.875%	2017/10/31	4,900,000	5,099,062.50	
US TREASURY N/B	4.250%	2017/11/15	4,350,000	5,127,562.50	
US TREASURY N/B	2.250%	2017/11/30	2,000,000	2,123,125.00	
US TREASURY N/B	2.750%	2017/12/31	11,000,000	12,002,031.25	
US TREASURY N/B	2.625%	2018/01/31	25,250,000	27,356,796.87	
US TREASURY N/B	3.500%	2018/02/15	4,000,000	4,540,000.00	
US TREASURY N/B	2.875%	2018/03/31	4,800,000	5,270,250.00	
US TREASURY N/B	2.625%	2018/04/30	5,600,000	6,062,000.00	
US TREASURY N/B	3.875%	2018/05/15	2,040,000	2,366,718.75	
US TREASURY N/B	2.375%	2018/05/31	1,100,000	1,172,187.50	
US TREASURY N/B	2.375%	2018/06/30	4,960,000	5,281,625.00	
US TREASURY N/B	2.250%	2018/07/31	15,000,000	15,839,062.50	
US TREASURY N/B	1.500%	2018/08/31	6,500,000	6,538,593.75	
US TREASURY N/B	1.375%	2018/09/30	10,520,000	10,482,193.75	
US TREASURY N/B	1.750%	2018/10/31	16,630,000	16,962,600.00	
US TREASURY N/B	3.750%	2018/11/15	5,040,000	5,819,625.00	
US TREASURY N/B	2.750%	2019/02/15	2,000,000	2,172,187.50	
US TREASURY N/B	3.125%	2019/05/15	15,520,000	17,253,875.00	
US TREASURY N/B	3.625%	2019/08/15	18,400,000	21,108,250.00	
US TREASURY N/B	8.125%	2019/08/15	3,600,000	5,325,187.50	
US TREASURY N/B	3.375%	2019/11/15	25,070,000	28,293,845.31	
US TREASURY N/B	3.625%	2020/02/15	25,030,000	28,721,925.00	
US TREASURY N/B	3.500%	2020/05/15	26,650,000	30,322,703.12	
US TREASURY N/B	2.625%	2020/08/15	15,000,000	15,965,625.00	
US TREASURY N/B	8.750%	2020/08/15	1,800,000	2,815,312.50	
US TREASURY N/B	2.625%	2020/11/15	15,000,000	15,923,437.50	
US TREASURY N/B	3.625%	2021/02/15	31,230,000	35,748,590.62	
US TREASURY N/B	3.125%	2021/05/15	9,190,000	10,109,000.00	
US TREASURY N/B	2.125%	2021/08/15	25,400,000	25,626,218.74	

US TREASURY N/B	2.000%	2021/11/15	17,000,000	16,915,000.00	
US TREASURY N/B	8.000%	2021/11/15	6,100,000	9,427,359.37	
US TREASURY N/B	7.250%	2022/08/15	100,000	149,421.87	
US TREASURY N/B	7.125%	2023/02/15	1,450,000	2,161,179.68	
US TREASURY N/B	6.250%	2023/08/15	10,080,000	14,195,475.00	

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 7.500% 2024/11/15	4,690,000	7,355,239.06	
		US TREASURY N/B 7.625% 2025/02/15	800,000	1,270,375.00	
		US TREASURY N/B 6.875% 2025/08/15	6,340,000	9,576,371.87	
		US TREASURY N/B 6.000% 2026/02/15	1,040,000	1,467,862.50	
		US TREASURY N/B 6.500% 2026/11/15	2,150,000	3,188,718.75	
		US TREASURY N/B 6.625% 2027/02/15	2,500,000	3,759,765.62	
		US TREASURY N/B 6.375% 2027/08/15	2,640,000	3,909,262.50	
		US TREASURY N/B 6.125% 2027/11/15	2,700,000	3,917,531.25	
		US TREASURY N/B 5.500% 2028/08/15	5,250,000	7,227,773.43	
		US TREASURY N/B 5.250% 2028/11/15	3,350,000	4,499,468.75	
		US TREASURY N/B 5.250% 2029/02/15	1,600,000	2,152,750.00	
		US TREASURY N/B 6.125% 2029/08/15	2,200,000	3,248,437.50	
		US TREASURY N/B 6.250% 2030/05/15	3,520,000	5,302,000.00	
		US TREASURY N/B 5.375% 2031/02/15	7,480,000	10,356,293.75	
		US TREASURY N/B 4.500% 2036/02/15	8,320,000	10,527,400.00	
		US TREASURY N/B 5.000% 2037/05/15	7,230,000	9,842,967.18	
		US TREASURY N/B 4.375% 2038/02/15	3,200,000	3,994,500.00	
		US TREASURY N/B 4.500% 2038/05/15	9,500,000	12,088,750.00	
		US TREASURY N/B 3.500% 2039/02/15	4,770,000	5,165,760.93	
		US TREASURY N/B 4.250% 2039/05/15	15,510,000	19,036,101.56	
		US TREASURY N/B 4.500% 2039/08/15	19,450,000	24,786,593.75	
		US TREASURY N/B 4.375% 2039/11/15	14,800,000	18,509,250.00	
		US TREASURY N/B 4.625% 2040/02/15	14,700,000	19,100,812.50	
		US TREASURY N/B 4.375% 2040/05/15	11,800,000	14,757,375.00	
		US TREASURY N/B 3.875% 2040/08/15	26,910,000	31,047,412.50	
		US TREASURY N/B 4.250% 2040/11/15	14,820,000	18,179,971.87	
		US TREASURY N/B 4.750% 2041/02/15	7,900,000	10,482,312.50	
		US TREASURY N/B 4.375% 2041/05/15	9,650,000	12,092,656.25	
US TREASURY N/B 3.750% 2041/08/15	12,440,000	14,049,425.00			
US TREASURY N/B 3.125% 2041/11/15	1,000,000	1,004,531.25			

		米ドル 小計			1,846,960,000	2,021,726,185.39 (157,047,690,081)
カナダドル	国債証券	CANADA-GOV'T	1.500%	2012/12/01	6,300,000	6,336,855.00
		CANADA-GOV'T	1.750%	2013/03/01	6,900,000	6,972,036.00
		CANADA-GOV'T	3.500%	2013/06/01	2,590,000	2,688,679.00
		CANADA-GOV'T	5.250%	2013/06/01	5,760,000	6,126,048.00
		CANADA-GOV'T	2.000%	2013/08/01	4,120,000	4,194,736.80
		CANADA-GOV'T	2.500%	2013/09/01	3,810,000	3,914,889.30
		CANADA-GOV'T	1.500%	2013/11/01	2,150,000	2,174,424.00
		CANADA-GOV'T	1.000%	2014/02/01	280,000	280,546.00
		CANADA-GOV'T	2.000%	2014/03/01	3,380,000	3,460,004.60
		CANADA-GOV'T	3.000%	2014/06/01	8,100,000	8,504,676.00
		CANADA-GOV'T	5.000%	2014/06/01	2,790,000	3,065,121.90
		CANADA-GOV'T	2.250%	2014/08/01	3,800,000	3,925,780.00
		CANADA-GOV'T	2.000%	2014/12/01	8,010,000	8,236,522.80
		CANADA-GOV'T	1.000%	2015/02/01	150,000	149,643.00
		CANADA-GOV'T	2.500%	2015/06/01	4,530,000	4,740,916.80
		CANADA-GOV'T	4.500%	2015/06/01	3,100,000	3,454,981.00
		CANADA-GOV'T	3.000%	2015/12/01	2,210,000	2,362,512.10
CANADA-GOV'T	2.000%	2016/06/01	1,200,000	1,236,276.00		
CANADA-GOV'T	4.000%	2016/06/01	6,470,000	7,227,442.90		

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	2.750% 2016/09/01	3,840,000	4,086,912.00
		CANADA-GOV'T	1.500% 2017/03/01	960,000	963,177.60
		CANADA-GOV'T	4.000% 2017/06/01	4,950,000	5,609,736.00
		CANADA-GOV'T	4.250% 2018/06/01	3,150,000	3,658,851.00
		CANADA-GOV'T	3.750% 2019/06/01	8,670,000	9,872,529.00
		CANADA-GOV'T	3.500% 2020/06/01	3,730,000	4,174,802.50
		CANADA-GOV'T	3.250% 2021/06/01	3,560,000	3,917,780.00
		CANADA-GOV'T	2.750% 2022/06/01	960,000	1,013,856.00
		CANADA-GOV'T	8.000% 2023/06/01	2,000,000	3,168,440.00
		CANADA-GOV'T	9.000% 2025/06/01	860,000	1,521,090.60
		CANADA-GOV'T	8.000% 2027/06/01	2,050,000	3,510,871.00
		CANADA-GOV'T	5.750% 2029/06/01	4,760,000	6,883,245.60
		CANADA-GOV'T	5.750% 2033/06/01	4,870,000	7,310,503.10
		CANADA-GOV'T	5.000% 2037/06/01	5,420,000	7,703,391.80
CANADA-GOV'T	4.000% 2041/06/01	6,180,000	7,860,960.00		

		CANADA-GOV'T	3.500%	2045/12/01	1,000,000	1,183,060.00	
		カナダドル 小計			132,610,000	151,491,297.40 (11,537,577,209)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEXICAN BONOS	9.000%	2012/12/20	38,510,000	40,184,799.90	
		MEXICAN BONOS	9.000%	2013/06/20	44,110,000	46,895,546.50	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2013/12/19	35,830,000	38,078,690.80	
		MEXICAN BONOS	7.000%	2014/06/19	16,970,000	17,856,682.50	
		MEXICAN BONOS	9.500%	2014/12/18	38,070,000	42,938,010.90	
		MEXICAN BONOS	6.000%	2015/06/18	26,600,000	27,407,044.00	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2015/12/17	22,840,000	25,144,556.00	
		MEXICAN BONOS	6.250%	2016/06/16	7,500,000	7,771,500.00	
		MEXICAN BONOS	7.250%	2016/12/15	21,990,000	23,721,052.80	
		MEXICAN BONOS	7.750%	2017/12/14	22,600,000	25,030,856.00	
		MEXICAN BONOS	8.500%	2018/12/13	12,160,000	14,030,208.00	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2020/06/11	38,260,000	42,758,228.20	
		MEXICAN BONOS	6.500%	2021/06/10	30,530,000	30,750,426.60	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2023/12/07	10,140,000	11,418,654.00	
		MEXICAN BONOS	10.000%	2024/12/05	32,410,000	42,055,540.10	
		MEXICAN BONOS	7.500%	2027/06/03	36,430,000	38,045,670.50	
		MEXICAN BONOS	8.500%	2029/05/31	37,340,000	41,955,970.80	
		MEXICAN BONOS	7.750%	2031/05/29	8,000,000	8,287,280.00	
		MEXICAN BONOS	10.000%	2036/11/20	28,160,000	35,433,446.40	
		MEXICAN BONOS	8.500%	2038/11/18	27,520,000	30,071,654.40	
		メキシコペソ 小計			535,970,000	589,835,818.40 (3,379,759,239)	
ユーロ	国債証券 (ベルギー)	BELGIAN 0262	8.000%	2012/12/24	3,120,000	3,298,776.00	
		BELGIAN 0282	8.000%	2015/03/28	2,160,000	2,429,784.00	
		BELGIAN 0291	5.500%	2028/03/28	5,780,000	6,351,064.00	
		BELGIAN 0300	5.500%	2017/09/28	3,070,000	3,262,796.00	
		BELGIAN 0301	4.250%	2013/09/28	4,610,000	4,690,675.00	
		BELGIAN 0303	4.250%	2014/09/28	4,250,000	4,319,700.00	
		BELGIAN 0304	5.000%	2035/03/28	5,680,000	5,985,584.00	
		BELGIAN 0306	3.750%	2015/09/28	6,920,000	6,934,532.00	
		BELGIAN 0307	3.250%	2016/09/28	5,400,000	5,252,040.00	
		BELGIAN 0308	4.000%	2022/03/28	5,340,000	5,141,886.00	
		BELGIAN 0309	4.000%	2017/03/28	5,110,000	5,070,142.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

ユーロ	国債証券 (ベルギー)	BELGIAN 0310	4.000%	2013/03/28	5,770,000	5,861,166.00
		BELGIAN 0312	4.000%	2018/03/28	3,960,000	3,912,084.00
		BELGIAN 0314	4.000%	2014/03/28	5,640,000	5,700,912.00
		BELGIAN 0315	4.000%	2019/03/28	4,200,000	4,123,560.00
		BELGIAN 0316	3.500%	2015/03/28	1,930,000	1,914,560.00
		BELGIAN 0318	3.750%	2020/09/28	7,610,000	7,266,028.00
		BELGIAN 0319	2.750%	2016/03/28	2,600,000	2,492,360.00
		BELGIAN 0320	4.250%	2041/03/28	3,330,000	3,125,871.00
		BELGIAN 0321	4.250%	2021/09/28	3,270,000	3,210,486.00
		BELGIAN 0323	3.500%	2017/06/28	1,750,000	1,688,750.00
		BELGIAN 0324	4.500%	2026/03/28	1,790,000	1,781,587.00
	国債証券 (イタリア)	BTPS	2.000%	2012/12/15	7,550,000	7,290,280.00
		BTPS	4.750%	2013/02/01	10,080,000	9,998,352.00
		BTPS	4.250%	2013/04/15	4,760,000	4,669,560.00
		BTPS	2.000%	2013/06/01	10,320,000	9,760,656.00
		BTPS	4.250%	2013/08/01	10,360,000	10,113,432.00
		BTPS	2.250%	2013/11/01	9,430,000	8,840,625.00
		BTPS	3.750%	2013/12/15	8,210,000	7,895,557.00
		BTPS	3.000%	2014/04/01	240,000	225,288.00
		BTPS	3.500%	2014/06/01	12,020,000	11,315,628.00
		BTPS	4.250%	2014/07/01	2,410,000	2,304,924.00
		BTPS	4.250%	2014/08/01	4,170,000	3,988,188.00
		BTPS	4.250%	2015/02/01	12,230,000	11,575,695.00
		BTPS	3.000%	2015/04/15	15,970,000	14,406,537.00
		BTPS	3.000%	2015/06/15	1,880,000	1,692,940.00
		BTPS	3.750%	2015/08/01	12,040,000	11,067,168.00
		BTPS	3.000%	2015/11/01	4,200,000	3,742,620.00
		BTPS	3.750%	2016/04/15	1,330,000	1,200,192.00
		BTPS	3.750%	2016/08/01	8,430,000	7,565,925.00
		BTPS	4.750%	2016/09/15	2,960,000	2,753,688.00
		BTPS	4.000%	2017/02/01	9,060,000	8,162,154.00
		BTPS	5.250%	2017/08/01	13,570,000	12,803,295.00
		BTPS	4.500%	2018/02/01	6,360,000	5,731,632.00
BTPS	4.500%	2018/08/01	5,900,000	5,310,000.00		
BTPS	4.250%	2019/02/01	1,820,000	1,601,600.00		
BTPS	4.500%	2019/03/01	11,620,000	10,372,012.00		
BTPS	4.250%	2019/09/01	15,790,000	13,765,722.00		
BTPS	4.500%	2020/02/01	13,620,000	12,045,528.00		
BTPS	4.250%	2020/03/01	6,310,000	5,496,010.00		

	BTPS	4.000%	2020/09/01	4,250,000	3,603,150.00	
	BTPS	3.750%	2021/03/01	5,240,000	4,357,060.00	
	BTPS	3.750%	2021/08/01	14,100,000	11,624,040.00	
	BTPS	4.750%	2021/09/01	8,230,000	7,369,965.00	
	BTPS	5.000%	2022/03/01	4,300,000	3,793,890.00	
	BTPS	4.750%	2023/08/01	6,830,000	5,765,886.00	
	BTPS	9.000%	2023/11/01	3,920,000	4,351,200.00	
	BTPS	5.000%	2025/03/01	8,470,000	7,100,401.00	
	BTPS	4.500%	2026/03/01	7,000,000	5,569,200.00	
	BTPS	7.250%	2026/11/01	4,000,000	4,074,000.00	
	BTPS	6.500%	2027/11/01	9,810,000	9,047,272.50	
	BTPS	5.250%	2029/11/01	9,480,000	7,750,848.00	

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	11,193,637.50	
		BTPS	5.750% 2033/02/01	6,580,000	5,553,520.00	
		BTPS	5.000% 2034/08/01	8,250,000	6,499,350.00	
		BTPS	4.000% 2037/02/01	9,000,000	6,274,800.00	
		BTPS	5.000% 2039/08/01	10,110,000	7,946,460.00	
		BTPS	5.000% 2040/09/01	6,140,000	4,832,180.00	
	国債証券 (ドイツ)	BUNDESUBL-152	3.500% 2013/04/12	8,050,000	8,404,602.50	
		BUNDESUBL-153	4.000% 2013/10/11	10,750,000	11,476,915.00	
		BUNDESUBL-154	2.250% 2014/04/11	10,940,000	11,449,804.00	
		BUNDESUBL-155	2.500% 2014/10/10	4,000,000	4,224,800.00	
		BUNDESUBL-156	2.500% 2015/02/27	6,970,000	7,385,412.00	
		BUNDESUBL-157	2.250% 2015/04/10	10,150,000	10,685,920.00	
		BUNDESUBL-158	1.750% 2015/10/09	7,930,000	8,230,943.50	
		BUNDESUBL-159	2.000% 2016/02/26	6,180,000	6,478,803.00	
		BUNDESUBL-160	2.750% 2016/04/08	540,000	582,876.00	
		BUNDESUBL-161	1.250% 2016/10/14	620,000	627,099.00	
		BUNDESSCHATZANW	1.000% 2012/12/14	7,290,000	7,358,161.50	
		BUNDESSCHATZANW	1.500% 2013/03/15	5,640,000	5,735,485.20	
		BUNDESSCHATZANW	1.750% 2013/06/14	4,320,000	4,419,360.00	
		BUNDESSCHATZANW	0.750% 2013/09/13	1,370,000	1,381,645.00	
		BUNDESSCHATZANW	0.250% 2013/12/13	710,000	709,219.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.500% 2013/01/04	8,460,000	8,858,043.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.750% 2013/07/04	10,450,000	11,022,137.50	
		DEUTSCHLAND REP	4.250% 2014/01/04	13,440,000	14,531,328.00	

DEUTSCHLAND REP	4.250%	2014/07/04	4,610,000	5,058,322.50	
DEUTSCHLAND REP	3.750%	2015/01/04	11,840,000	12,976,640.00	
DEUTSCHLAND REP	3.250%	2015/07/04	7,850,000	8,558,855.00	
DEUTSCHLAND REP	3.500%	2016/01/04	11,440,000	12,673,804.00	
DEUTSCHLAND REP	6.000%	2016/06/20	1,050,000	1,279,005.00	
DEUTSCHLAND REP	4.000%	2016/07/04	7,600,000	8,641,960.00	
DEUTSCHLAND REP	3.750%	2017/01/04	7,400,000	8,373,100.00	
DEUTSCHLAND REP	4.250%	2017/07/04	7,010,000	8,151,228.00	
DEUTSCHLAND REP	4.000%	2018/01/04	6,320,000	7,296,756.00	
DEUTSCHLAND REP	4.250%	2018/07/04	9,340,000	10,961,424.00	
DEUTSCHLAND REP	3.750%	2019/01/04	5,930,000	6,776,211.00	
DEUTSCHLAND REP	3.500%	2019/07/04	12,390,000	13,958,574.00	
DEUTSCHLAND REP	3.250%	2020/01/04	12,020,000	13,368,644.00	
DEUTSCHLAND REP	3.000%	2020/07/04	6,720,000	7,341,600.00	
DEUTSCHLAND REP	2.250%	2020/09/04	13,530,000	13,941,312.00	
DEUTSCHLAND REP	2.500%	2021/01/04	5,000,000	5,248,500.00	
DEUTSCHLAND REP	3.250%	2021/07/04	4,250,000	4,721,750.00	
DEUTSCHLAND REP	2.250%	2021/09/04	1,620,000	1,654,506.00	
DEUTSCHLAND REP	6.250%	2024/01/04	3,930,000	5,526,366.00	
DEUTSCHLAND REP	6.500%	2027/07/04	5,360,000	7,986,400.00	
DEUTSCHLAND REP	5.625%	2028/01/04	2,870,000	3,967,775.00	
DEUTSCHLAND REP	4.750%	2028/07/04	7,140,000	9,060,660.00	
DEUTSCHLAND REP	6.250%	2030/01/04	3,920,000	5,862,360.00	
DEUTSCHLAND REP	5.500%	2031/01/04	5,330,000	7,464,665.00	
DEUTSCHLAND REP	4.750%	2034/07/04	8,040,000	10,733,400.00	
DEUTSCHLAND REP	4.000%	2037/01/04	8,200,000	10,111,420.00	
DEUTSCHLAND REP	4.250%	2039/07/04	6,520,000	8,505,992.00	

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	8,193,400.00	
		DEUTSCHLAND REP 3.250% 2042/07/04	4,850,000	5,497,475.00	
	国債証券 (フィンランド)	FINNISH GOV'T 5.375% 2013/07/04	2,270,000	2,441,385.00	
		FINNISH GOV'T 3.125% 2014/09/15	2,530,000	2,688,125.00	
		FINNISH GOV'T 4.250% 2015/07/04	2,280,000	2,520,996.00	
		FINNISH GOV'T 1.750% 2016/04/15	2,010,000	2,039,346.00	
		FINNISH GOV'T 1.875% 2017/04/15	1,250,000	1,251,375.00	
		FINNISH GOV'T 3.875% 2017/09/15	2,450,000	2,698,920.00	
		FINNISH GOV'T 4.375% 2019/07/04	2,030,000	2,293,697.00	

	FINNISH GOV'T	3.375%	2020/04/15	2,680,000	2,837,048.00	
	FINNISH GOV'T	3.500%	2021/04/15	1,920,000	2,051,136.00	
	FINNISH GOV'T	4.000%	2025/07/04	2,410,000	2,670,762.00	
国債証券 (フランス)	BTAN-2YR ISSUE	2.000%	2013/09/25	4,190,000	4,259,554.00	
	BTAN-5YR ISSUE	3.750%	2013/01/12	15,150,000	15,646,920.00	
	BTAN-5YR ISSUE	4.500%	2013/07/12	6,390,000	6,754,230.00	
	BTAN-5YR ISSUE	2.500%	2014/01/12	5,990,000	6,152,928.00	
	BTAN-5YR ISSUE	3.000%	2014/07/12	14,930,000	15,530,186.00	
	BTAN-5YR ISSUE	2.500%	2015/01/15	5,600,000	5,740,560.00	
	BTAN-5YR ISSUE	2.000%	2015/07/12	9,390,000	9,447,279.00	
	BTAN-5YR ISSUE	2.250%	2016/02/25	7,740,000	7,788,762.00	
	BTAN-5YR ISSUE	2.500%	2016/07/25	4,670,000	4,727,441.00	
	FRANCE O.A.T.	8.500%	2012/12/26	2,180,000	2,354,400.00	
	FRANCE O.A.T.	4.000%	2013/04/25	5,720,000	5,975,112.00	
	FRANCE O.A.T.	4.000%	2013/10/25	8,800,000	9,268,160.00	
	FRANCE O.A.T.	4.000%	2014/04/25	12,760,000	13,556,224.00	
	FRANCE O.A.T.	4.000%	2014/10/25	3,170,000	3,389,364.00	
	FRANCE O.A.T.	3.500%	2015/04/25	11,320,000	11,972,032.00	
	FRANCE O.A.T.	3.000%	2015/10/25	14,790,000	15,374,205.00	
	FRANCE O.A.T.	3.250%	2016/04/25	9,300,000	9,727,800.00	
	FRANCE O.A.T.	5.000%	2016/10/25	10,860,000	12,203,382.00	
	FRANCE O.A.T.	3.750%	2017/04/25	10,340,000	11,002,794.00	
	FRANCE O.A.T.	4.250%	2017/10/25	9,550,000	10,372,255.00	
	FRANCE O.A.T.	4.000%	2018/04/25	8,780,000	9,436,744.00	
	FRANCE O.A.T.	4.250%	2018/10/25	8,470,000	9,216,207.00	
	FRANCE O.A.T.	4.250%	2019/04/25	11,300,000	12,262,760.00	
	FRANCE O.A.T.	3.750%	2019/10/25	16,450,000	17,331,720.00	
	FRANCE O.A.T.	8.500%	2019/10/25	4,010,000	5,541,419.00	
	FRANCE O.A.T.	3.500%	2020/04/25	9,960,000	10,253,820.00	
	FRANCE O.A.T.	2.500%	2020/10/25	11,690,000	11,114,852.00	
	FRANCE O.A.T.	3.750%	2021/04/25	10,720,000	11,176,672.00	
	FRANCE O.A.T.	3.250%	2021/10/25	1,320,000	1,318,944.00	
	FRANCE O.A.T.	8.500%	2023/04/25	4,090,000	6,031,114.00	
	FRANCE O.A.T.	4.250%	2023/10/25	13,500,000	14,574,600.00	
	FRANCE O.A.T.	6.000%	2025/10/25	5,040,000	6,375,096.00	
	FRANCE O.A.T.	3.500%	2026/04/25	8,550,000	8,467,920.00	
FRANCE O.A.T.	5.500%	2029/04/25	9,210,000	11,243,568.00		
FRANCE O.A.T.	5.750%	2032/10/25	8,580,000	10,982,400.00		
FRANCE O.A.T.	4.750%	2035/04/25	7,330,000	8,431,699.00		

	FRANCE O.A.T.	4.000%	2038/10/25	9,190,000	9,522,678.00	
	FRANCE O.A.T.	4.500%	2041/04/25	6,640,000	7,461,368.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
ユーロ	国債証券 (フランス)	FRANCE O.A.T.	4.000%	2055/04/25	5,880,000	6,050,520.00
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2060/04/25	3,230,000	3,349,510.00
	国債証券 (アイルランド)	IRISH GOVT	5.000%	2013/04/18	2,160,000	2,054,484.00
		IRISH GOVT	4.000%	2014/01/15	4,550,000	4,109,560.00
		IRISH GOVT	4.600%	2016/04/18	3,730,000	3,171,992.00
		IRISH GOVT	4.500%	2018/10/18	3,550,000	2,783,022.50
		IRISH GOVT	4.400%	2019/06/18	3,540,000	2,713,941.00
		IRISH GOVT	5.900%	2019/10/18	2,570,000	2,154,688.00
		IRISH GOVT	4.500%	2020/04/18	4,160,000	3,149,744.00
		IRISH GOVT	5.000%	2020/10/18	2,600,000	2,020,070.00
		IRISH GOVT	5.400%	2025/03/13	3,050,000	2,307,782.50
	国債証券 (オランダ)	NETHERLANDS GOVT	1.750%	2013/01/15	5,810,000	5,904,703.00
		NETHERLANDS GOVT	4.250%	2013/07/15	5,640,000	5,982,912.00
		NETHERLANDS GOVT	1.000%	2014/01/15	4,680,000	4,713,228.00
		NETHERLANDS GOVT	3.750%	2014/07/15	6,000,000	6,447,000.00
		NETHERLANDS GOVT	2.750%	2015/01/15	5,740,000	6,036,184.00
		NETHERLANDS GOVT	3.250%	2015/07/15	5,040,000	5,398,848.00
		NETHERLANDS GOVT	4.000%	2016/07/15	6,170,000	6,852,402.00
		NETHERLANDS GOVT	2.500%	2017/01/15	2,810,000	2,919,309.00
		NETHERLANDS GOVT	4.500%	2017/07/15	6,180,000	7,028,514.00
		NETHERLANDS GOVT	4.000%	2018/07/15	5,600,000	6,252,960.00
		NETHERLANDS GOVT	4.000%	2019/07/15	8,030,000	9,000,024.00
		NETHERLANDS GOVT	3.500%	2020/07/15	4,450,000	4,830,475.00
		NETHERLANDS GOVT	3.250%	2021/07/15	3,730,000	3,950,070.00
		NETHERLANDS GOVT	3.750%	2023/01/15	4,120,000	4,538,180.00
		NETHERLANDS GOVT	7.500%	2023/01/15	1,120,000	1,635,312.00
		NETHERLANDS GOVT	5.500%	2028/01/15	4,790,000	6,404,230.00
	NETHERLANDS GOVT	4.000%	2037/01/15	4,770,000	5,781,717.00	
	NETHERLANDS GOVT	3.750%	2042/01/15	4,130,000	4,959,304.00	
	国債証券 (オーストリア)	REP OF AUSTRIA	3.800%	2013/10/20	4,570,000	4,793,016.00
		REP OF AUSTRIA	4.300%	2014/07/15	4,030,000	4,309,279.00
		REP OF AUSTRIA	3.400%	2014/10/20	4,310,000	4,519,466.00
		REP OF AUSTRIA	3.500%	2015/07/15	4,930,000	5,184,388.00
		REP OF AUSTRIA	4.000%	2016/09/15	4,360,000	4,693,104.00

	REP OF AUSTRIA	3.200%	2017/02/20	2,720,000	2,799,968.00	
	REP OF AUSTRIA	4.300%	2017/09/15	2,530,000	2,744,291.00	
	REP OF AUSTRIA	4.650%	2018/01/15	4,580,000	5,033,420.00	
	REP OF AUSTRIA	4.350%	2019/03/15	4,670,000	5,040,331.00	
	REP OF AUSTRIA	3.900%	2020/07/15	4,410,000	4,623,885.00	
	REP OF AUSTRIA	3.500%	2021/09/15	5,490,000	5,623,956.00	
	REP OF AUSTRIA	3.650%	2022/04/20	2,400,000	2,461,440.00	
	REP OF AUSTRIA	4.850%	2026/03/15	3,350,000	3,820,005.00	
	REP OF AUSTRIA	6.250%	2027/07/15	2,730,000	3,570,840.00	
	REP OF AUSTRIA	4.150%	2037/03/15	4,480,000	4,782,400.00	
国債証券 (スペイン)	SPANISH GOV'T	6.150%	2013/01/31	6,550,000	6,660,695.00	
	SPANISH GOV'T	2.300%	2013/04/30	9,610,000	9,336,115.00	
	SPANISH GOV'T	4.200%	2013/07/30	2,210,000	2,194,088.00	
	SPANISH GOV'T	2.500%	2013/10/31	3,990,000	3,842,370.00	
	SPANISH GOV'T	4.250%	2014/01/31	4,840,000	4,799,344.00	
	SPANISH GOV'T	3.400%	2014/04/30	2,610,000	2,541,357.00	
	SPANISH GOV'T	4.750%	2014/07/30	4,860,000	4,846,878.00	
	SPANISH GOV'T	3.300%	2014/10/31	11,170,000	10,756,710.00	

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	4.400%	2015/01/31	7,070,000	6,985,867.00	
		SPANISH GOV'T	3.000%	2015/04/30	5,360,000	5,049,120.00	
		SPANISH GOV'T	3.150%	2016/01/31	7,220,000	6,778,858.00	
		SPANISH GOV'T	3.250%	2016/04/30	4,310,000	4,003,559.00	
		SPANISH GOV'T	4.250%	2016/10/31	3,380,000	3,233,308.00	
		SPANISH GOV'T	3.800%	2017/01/31	3,620,000	3,392,302.00	
		SPANISH GOV'T	5.500%	2017/07/30	7,140,000	7,168,560.00	
		SPANISH GOV'T	4.100%	2018/07/30	6,420,000	5,973,810.00	
		SPANISH GOV'T	4.600%	2019/07/30	5,950,000	5,628,700.00	
		SPANISH GOV'T	4.300%	2019/10/31	4,550,000	4,209,660.00	
		SPANISH GOV'T	4.000%	2020/04/30	8,910,000	8,076,915.00	
		SPANISH GOV'T	4.850%	2020/10/31	6,810,000	6,440,217.00	
		SPANISH GOV'T	5.500%	2021/04/30	5,640,000	5,539,890.00	
		SPANISH GOV'T	5.850%	2022/01/31	560,000	545,384.00	
		SPANISH GOV'T	4.800%	2024/01/31	5,930,000	5,271,770.00	
		SPANISH GOV'T	4.650%	2025/07/30	5,950,000	5,114,620.00	
		SPANISH GOV'T	5.900%	2026/07/30	2,350,000	2,253,650.00	
SPANISH GOV'T	6.000%	2029/01/31	7,160,000	6,842,812.00			

		SPANISH GOV'T	5.750%	2032/07/30	4,450,000	4,116,695.00	
		SPANISH GOV'T	4.200%	2037/01/31	5,890,000	4,290,865.00	
		SPANISH GOV'T	4.900%	2040/07/30	4,980,000	3,952,128.00	
		SPANISH GOV'T	4.700%	2041/07/30	4,520,000	3,476,558.00	
		ユーロ 小計			1,471,250,000	1,498,974,308.70 (155,548,564,013)	
英ポンド	国債証券	TREASURY	4.500%	2013/03/07	15,330,000	16,104,931.50	
		TREASURY	2.250%	2014/03/07	7,740,000	8,059,816.80	
		TREASURY	5.000%	2014/09/07	9,490,000	10,657,061.22	
		TREASURY	2.750%	2015/01/22	14,500,000	15,482,041.50	
		TREASURY	4.750%	2015/09/07	9,990,000	11,517,471.00	
		TREASURY	8.000%	2015/12/07	2,280,000	2,934,360.00	
		TREASURY	2.000%	2016/01/22	5,900,000	6,184,952.30	
		TREASURY	4.000%	2016/09/07	6,700,000	7,655,748.30	
		TREASURY	1.750%	2017/01/22	3,710,000	3,834,874.89	
		TREASURY	8.750%	2017/08/25	1,920,000	2,721,024.00	
		TREASURY	5.000%	2018/03/07	8,620,000	10,509,926.38	
		TREASURY	4.500%	2019/03/07	5,210,000	6,262,420.00	
		TREASURY	3.750%	2019/09/07	12,760,000	14,654,222.00	
		TREASURY	4.750%	2020/03/07	4,620,000	5,646,009.60	
		TREASURY	3.750%	2020/09/07	8,920,000	10,207,896.36	
		TREASURY	8.000%	2021/06/07	5,970,000	9,050,042.40	
		TREASURY	3.750%	2021/09/07	6,490,000	7,391,091.07	
		TREASURY	4.000%	2022/03/07	4,030,000	4,690,597.60	
		TREASURY	5.000%	2025/03/07	6,780,000	8,693,316.00	
		TREASURY	4.250%	2027/12/07	7,290,000	8,693,325.00	
		TREASURY	6.000%	2028/12/07	3,600,000	5,181,660.00	
		TREASURY	4.750%	2030/12/07	6,430,000	8,103,593.97	
		TREASURY	4.250%	2032/06/07	7,630,000	9,037,078.82	
TREASURY	4.500%	2034/09/07	3,960,000	4,841,496.00			
TREASURY	4.250%	2036/03/07	9,210,000	10,965,794.40			
TREASURY	4.750%	2038/12/07	6,060,000	7,784,615.40			
TREASURY	4.250%	2039/09/07	6,610,000	7,862,000.10			

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
英ポンド	国債証券	TREASURY	4.250% 2040/12/07	7,450,000	8,871,117.30	
		TREASURY	4.500% 2042/12/07	5,070,000	6,324,459.96	
		TREASURY	4.250% 2046/12/07	8,010,000	9,688,415.40	

		TREASURY	4.250%	2049/12/07	7,220,000	8,796,270.40	
		TREASURY	3.750%	2052/07/22	1,110,000	1,227,604.50	
		TREASURY	4.250%	2055/12/07	6,220,000	7,673,738.40	
		TREASURY	4.000%	2060/01/22	4,540,000	5,392,325.98	
		英債券 小計			231,370,000	272,701,298.55 (33,125,026,734)	
スイス フラン	国債証券	SWISS (GOVT)	4.000%	2013/02/11	2,420,000	2,535,434.00	
		SWISS (GOVT)	4.250%	2014/01/06	1,910,000	2,080,754.00	
		SWISS (GOVT)	2.500%	2016/03/12	2,490,000	2,745,474.00	
		SWISS (GOVT)	4.250%	2017/06/05	2,350,000	2,856,425.00	
		SWISS (GOVT)	3.000%	2018/01/08	2,260,000	2,612,108.00	
		SWISS (GOVT)	3.000%	2019/05/12	2,160,000	2,541,240.00	
		SWISS (GOVT)	4.000%	2023/02/11	1,710,000	2,281,482.00	
		SWISS (GOVT)	4.000%	2028/04/08	2,100,000	3,016,440.00	
		スイスフラン 小計			17,400,000	20,669,357.00 (1,733,745,665)	
スウェーデ ンクローナ	国債証券	SWEDEN GOVT	6.750%	2014/05/05	31,250,000	35,590,625.00	
		SWEDEN GOVT	4.500%	2015/08/12	22,990,000	25,932,720.00	
		SWEDEN GOVT	3.000%	2016/07/12	18,050,000	19,611,325.00	
		SWEDEN GOVT	3.750%	2017/08/12	19,050,000	21,625,560.00	
		SWEDEN GOVT	4.250%	2019/03/12	20,850,000	24,819,840.00	
		SWEDEN GOVT	5.000%	2020/12/01	29,200,000	37,524,920.00	
		SWEDEN GOVT	3.500%	2022/06/01	19,230,000	22,672,554.60	
		SWEDEN GOVT	3.500%	2039/03/30	15,440,000	19,985,536.00	
		スウェーデンクローナ 小計			176,060,000	207,763,080.60 (2,395,508,319)	
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOV'T	6.500%	2013/05/15	22,510,000	24,225,262.00	
		NORWEGIAN GOV'T	5.000%	2015/05/15	20,540,000	23,035,610.00	
		NORWEGIAN GOV'T	4.250%	2017/05/19	13,770,000	15,505,708.50	
		NORWEGIAN GOV'T	4.500%	2019/05/22	10,890,000	12,632,400.00	
		NORWEGIAN GOV'T	3.750%	2021/05/25	11,170,000	12,443,380.00	
		ノルウェークローネ 小計			78,880,000	87,842,360.50 (1,185,871,866)	
デンマーク クローネ	国債証券	DENMARK - BULLET	5.000%	2013/11/15	32,050,000	34,921,680.00	
		DENMARK - BULLET	2.000%	2014/11/15	11,300,000	11,781,380.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2015/11/15	36,170,000	40,691,250.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2017/11/15	20,930,000	24,216,010.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2019/11/15	34,580,000	40,493,180.00	
		DENMARK - BULLET	3.000%	2021/11/15	11,850,000	12,912,471.00	

		DENMARK - BULLET	7.000%	2024/11/10	9,980,000	15,330,278.00	
		DENMARK - BULLET	4.500%	2039/11/15	39,060,000	55,914,390.00	
		デンマーククローネ 小計			195,920,000	236,260,639.00 (3,298,198,520)	
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVT BOND	0.000%	2013/01/25	9,330,000	8,861,167.50	
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2013/04/25	8,480,000	8,534,272.00	
		POLAND GOVT BOND	0.000%	2013/07/25	4,560,000	4,232,592.00	
		POLAND GOVT BOND	5.000%	2013/10/24	9,650,000	9,683,292.50	
		POLAND GOVT BOND	0.000%	2014/01/25	350,000	316,435.00	

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	5.750%	2014/04/25	12,190,000	12,412,467.50	
		POLAND GOVT BOND	5.500%	2015/04/25	10,150,000	10,280,935.00	
		POLAND GOVT BOND	6.250%	2015/10/24	12,440,000	12,921,428.00	
		POLAND GOVT BOND	5.000%	2016/04/25	7,370,000	7,302,933.00	
		POLAND GOVT BOND	4.750%	2016/10/25	1,500,000	1,465,875.00	
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2017/10/25	10,570,000	10,476,984.00	
		POLAND GOVT BOND	5.500%	2019/10/25	9,740,000	9,623,607.00	
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2020/10/25	9,060,000	8,686,728.00	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2021/10/25	2,050,000	2,026,630.00	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2022/09/23	9,800,000	9,684,360.00	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2029/04/25	2,600,000	2,540,980.00	
		ポーランドズロチ 小計			119,840,000	119,050,686.50 (2,740,546,803)	
オーストラ リアドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVT.	6.500%	2013/05/15	6,680,000	6,987,213.20	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2013/12/15	3,360,000	3,517,684.80	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.250%	2014/06/15	4,700,000	5,059,362.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.500%	2014/10/21	3,850,000	3,999,033.50	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.250%	2015/04/15	5,710,000	6,277,288.50	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.750%	2015/10/21	1,970,000	2,080,201.80	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.750%	2016/06/15	3,890,000	4,135,108.90	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.000%	2017/02/15	5,920,000	6,666,689.60	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.250%	2017/07/21	1,480,000	1,542,115.60	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2018/01/21	2,860,000	3,180,577.40	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.250%	2019/03/15	5,180,000	5,733,586.60	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.500%	2020/04/15	6,760,000	7,150,795.60	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.750%	2021/05/15	5,040,000	5,811,976.80	
AUSTRALIAN GOVT.	5.750%	2022/07/15	3,180,000	3,681,072.60			

		AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2023/04/21	1,560,000	1,772,752.80	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.750%	2027/04/21	1,350,000	1,435,522.50	
		オーストラリアドル 小計			63,490,000	69,030,982.20 (5,458,970,072)	
シンガポールドル	国債証券	SPR GOV'T	1.625%	2013/04/01	2,200,000	2,237,026.00	
		SPR GOV'T	2.250%	2013/07/01	2,360,000	2,430,705.60	
		SPR GOV'T	3.625%	2014/07/01	2,110,000	2,279,433.00	
		SPR GOV'T	1.375%	2014/10/01	700,000	716,604.00	
		SPR GOV'T	2.875%	2015/07/01	1,720,000	1,856,206.80	
		SPR GOV'T	1.125%	2016/04/01	780,000	795,405.00	
		SPR GOV'T	3.750%	2016/09/01	1,660,000	1,881,560.20	
		SPR GOV'T	2.375%	2017/04/01	710,000	760,530.70	
		SPR GOV'T	4.000%	2018/09/01	1,390,000	1,627,120.10	
		SPR GOV'T	2.500%	2019/06/01	620,000	662,011.20	
		SPR GOV'T	3.250%	2020/09/01	1,920,000	2,148,364.80	
		SPR GOV'T	2.250%	2021/06/01	1,270,000	1,319,872.90	
		SPR GOV'T	3.125%	2022/09/01	1,390,000	1,538,132.30	
		SPR GOV'T	3.000%	2024/09/01	1,150,000	1,248,371.00	
		SPR GOV'T	3.500%	2027/03/01	1,490,000	1,680,496.50	
		SPR GOV'T	2.875%	2030/09/01	1,060,000	1,118,437.80	
		シンガポールドル 小計			22,530,000	24,300,277.90 (1,456,072,651)	

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	3.702%	2013/02/25	3,420,000	3,451,823.10
		MALAYSIAN GOV'T	3.210%	2013/05/31	3,300,000	3,319,437.00
		MALAYSIAN GOV'T	3.461%	2013/07/31	5,530,000	5,588,341.50
		MALAYSIAN GOV'T	5.094%	2014/04/30	9,680,000	10,149,964.00
		MALAYSIAN GOV'T	3.434%	2014/08/15	2,280,000	2,302,868.40
		MALAYSIAN GOV'T	3.741%	2015/02/27	5,790,000	5,888,545.80
		MALAYSIAN GOV'T	3.835%	2015/08/12	5,630,000	5,751,945.80
		MALAYSIAN GOV'T	4.262%	2016/09/15	7,570,000	7,905,880.90
		MALAYSIAN GOV'T	3.814%	2017/02/15	3,010,000	3,065,775.30
		MALAYSIAN GOV'T	4.240%	2018/02/07	9,470,000	9,850,694.00
		MALAYSIAN GOV'T	3.580%	2018/09/28	2,800,000	2,804,508.00
		MALAYSIAN GOV'T	4.378%	2019/11/29	9,560,000	10,033,124.40
		MALAYSIAN GOV'T	4.160%	2021/07/15	4,610,000	4,774,623.10
		MALAYSIAN GOV'T	4.392%	2026/04/15	3,680,000	3,852,518.40

	MALYSIAN GOV'T	3.502%	2027/05/31	1,680,000	1,575,537.60	
	MALYSIAN GOV'T	5.248%	2028/09/15	1,910,000	2,177,266.30	
	マレーシアリングット 小計			79,920,000	82,492,853.60 (2,033,448,841)	
	国債証券 合計				380,940,980,013 (380,940,980,013)	
	合計				380,940,980,013 (380,940,980,013)	

(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	178	100.0%	41.2%
カナダドル	35	100.0%	3.0%
メキシコペソ	20	100.0%	0.9%
ユーロ	237	100.0%	40.8%
英ポンド	34	100.0%	8.7%
スイスフラン	8	100.0%	0.5%
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%	1.4%
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%	0.5%
合計	597	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」リートマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成23年12月12日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	375,711,536
投資証券	15,130,465,800
未収入金	101,653,363
未収配当金	209,453,287
未収利息	752
流動資産合計	15,817,284,738
資産合計	15,817,284,738
負債の部	
流動負債	
未払解約金	78,932,955
流動負債合計	78,932,955
負債合計	78,932,955
純資産の部	
元本等	
元本	16,550,749,788
剰余金	
欠損金	812,398,005
純資産合計	15,738,351,783
負債・純資産合計	15,817,284,738

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成23年12月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	平成23年12月12日現在

1. 計算日における受益権総数	16,550,749,788 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 812,398,005 円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9509 円 (9,509 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23年12月12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、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、リートの価格変動リスク、信用リスク及び流動性リスク等に晒されております。
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23年12月12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) 投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

4. 金銭債権の計算日後の償還予定額

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23年12月12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23年12月12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23年12月12日現在

特定期間の期首元本額	23,722,660,812 円
特定期間中の追加設定元本額	1,899,989,795 円
特定期間中の一部解約元本額	9,071,900,819 円
計算日の元本額	16,550,749,788 円

計算日の元本額の内訳

中央三井Jリートファンド	10,729,095,684 円
3資産バランスオープン	3,441,615,966 円
3資産バランスオープンアルファ	466,141,525 円
C M A M / Jリートファンド(ラップ向け)	3,118,340 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	204,269,677 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	129,212,665 円
中央三井Jリートアクティブファンド(1年決算型)	1,577,295,931 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成23年12月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	2,125,341,491
合計	2,125,341,491

(注) 当期間の損益に含まれた評価差額は、「中央三井Jリートマザーファンド」の期首から計算日までの期間(平成23年8月16日から平成23年12月12日まで)に対応するものです。

3. デリバティブ取引関係

平成23年12月12日現在

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表（平成23年12月12日現在）

有価証券明細表

A．株式

該当事項はありません。

B．株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額 (口)	評価額(円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	1,061	532,622,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,248	316,992,000	
	野村不動産レジデンシャル投資法人	798	267,330,000	
	産業ファンド投資法人	648	250,776,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	5,934	847,375,200	
	日本ビルファンド投資法人	3,271	2,283,158,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,816	1,729,024,000	
	日本リテールファンド投資法人	9,678	1,112,002,200	
	オリックス不動産投資法人	1,344	432,096,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	3,781	709,693,700	
	プレミアム投資法人	1,021	250,655,500	
	東急リアル・エステート投資法人	907	340,578,500	
	グローバル・ワン不動産投資法人	470	236,410,000	
	野村不動産オフィスファンド投資法人	1,573	622,908,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	11,310	908,193,000	
	森トラスト総合リート投資法人	1,322	795,844,000	
	フロンティア不動産投資法人	1,163	769,906,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	826	536,074,000	
	福岡リート投資法人	597	299,097,000	
	ケネディクス不動産投資法人	1,279	276,264,000	
	積水ハウス・S I 投資法人	743	212,349,400	
	大和証券オフィス投資法人	1,386	215,384,400	
	阪急リート投資法人	320	106,240,000	
ジャパン・ホテル・アンド・リゾート投資法人	441	73,602,900		
トップリート投資法人	761	265,208,500		
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	908	428,122,000		
ジャパンエクセレント投資法人	997	312,559,500		
	合計	56,603	15,130,465,800	

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](#)

「海外リートマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	平成23年12月12日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,878,551
コール・ローン	9,829,052
投資信託受益証券	14,861,957
投資証券	1,033,042,582
未収入金	1,168
未収配当金	1,345,645
未収利息	19
流動資産合計	1,060,958,974
資産合計	1,060,958,974
負債の部	
流動負債	
未払解約金	237,089
流動負債合計	237,089
負債合計	237,089
純資産の部	
元本等	
元本	2,169,566,255
剰余金	
欠損金	1,108,844,370
純資産合計	1,060,721,885
負債・純資産合計	1,060,958,974

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	平成23年12月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券及び投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>

3．外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4．収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
5．その他	<p>外貨建資産等の会計処理 外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成23年12月12日現在	
1．計算日における受益権総数	2,169,566,255 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	<p style="text-align: center;">元本の欠損</p> <p>1,108,844,370 円</p>
3．1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	<p>0.4889 円</p> <p>(4,889 円)</p>

(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23年12月12日現在	
<p>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。</p>	

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、リートの価格変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、カントリーリスク及び流動性リスク等に晒されております。

また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として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23年12月12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) 投資信託受益証券及び投資証券

「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3．金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

4．金銭債権の計算日後の償還予定額

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23年12月12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23年12月12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23年12月12日現在	
特定期間の期首元本額	2,642,673,765 円
特定期間中の追加設定元本額	440,275 円
特定期間中の一部解約元本額	473,547,785 円
計算日の元本額	2,169,566,255 円
計算日の元本額の内訳	
グローバル3資産バランスオープン	1,487,646,170 円
ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）	419,928,427 円
ベスタ・世界6資産ファンド（1年決算型）	261,991,658 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成23年12月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	1,820,432
投資証券	9,851,586
合計	8,031,154

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「海外リートマザーファンド」の期首から計算日まで
の期間（平成23年9月13日から平成23年12月12日まで）に対応するものです。

3. デリバティブ取引関係

平成23年12月12日現在
計算日においてデリバティブ取引の残高がないため、該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表（平成23年12月12日現在）

有価証券明細表

A．株式

該当事項はありません。

B．株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託 受益証券	シンガポール ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	42,000	80,010.00	
		CAPITACOMMERCIAL TRUST	49,000	51,450.00	
		CAPITAMALL TRUST	65,000	109,850.00	
		K-REIT ASIA	8,000	6,720.00	
		シンガポールドル 小計	164,000	248,030.00 (14,861,957)	
投資信託受益証券 合計			164,000	14,861,957 (14,861,957)	
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	1,000	19,350.00	
		AGREE REALTY CORP	200	4,900.00	
		ALEXANDER'S INC	100	38,008.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,500	101,640.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	800	16,352.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	1,700	67,643.00	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	3,100	67,921.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,600	13,872.00	
		ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	1,000	15,650.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,300	288,972.00	
		BIOMED REALTY TRUST INC	3,200	58,048.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	3,600	343,764.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	3,500	30,590.00	
		BRE PROPERTIES INC	1,800	86,796.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,800	104,130.00	
		CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	800	8,064.00	
		CAPLEASE INC	1,800	7,542.00	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,800	58,102.00	
		CEDAR REALTY TRUST INC	1,900	7,068.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	300	3,171.00	
		CHESAPEAK LODGING TRUST	600	9,408.00	
		COGDELL SPENCER INC	1,900	7,220.00	
		COLONIAL PROPERTIES TRUST	2,100	40,908.00	
		COMMONWEALTH REIT	2,000	33,420.00	
		CORESITE REALTY CORP	500	8,785.00	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	1,800	39,096.00	
		COUSINS PROPERTIES INC	2,700	16,335.00	
		CUBESMART	2,500	25,450.00	
		DCT INDUSTRIAL TRUST UNIT	6,100	29,646.00	
		DDR CORP	5,500	64,295.00	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	4,300	40,205.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	2,500	162,175.00	
DOUGLAS EMMETT INC	3,200	58,400.00			
DUKE REALTY CORP	6,200	72,912.00			
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	1,600	38,192.00			
EASTGROUP PROPERTIES INC	700	29,120.00			
EDUCATION REALTY TRUST INC	1,800	16,848.00			

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	米ドル	ENTERTAINMENT PROPERTIES TR	1,200	52,080.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	900	57,528.00	

EQUITY ONE INC	1,500	24,660.00	
EQUITY RESIDENTIAL	7,300	397,120.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	800	107,776.00	
EXCEL TRUST INC	600	7,014.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	2,400	57,264.00	
FED REALTY INVS TRUST	1,600	144,000.00	
FELCOR LODGING TRUST INC	2,600	7,176.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST	2,100	20,769.00	
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	1,300	16,367.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1,800	19,206.00	
GENERAL GROWTH PROPERTIES	15,100	213,212.00	
GETTY REALTY CORP	700	9,163.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	200	3,484.00	
GLIMCHER REALTY TRUST	2,700	23,787.00	
HCP INC	10,100	391,981.00	
HEALTH CARE REIT INC	4,700	238,478.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	1,900	33,649.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	3,900	18,174.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	1,800	51,768.00	
HOME PROPERTIES INC	1,000	55,160.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	3,200	71,104.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	17,600	251,856.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	400	5,340.00	
INLAND REAL ESTATE CORP	1,900	14,155.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,400	17,472.00	
KILROY REALTY CORP	1,400	51,086.00	
KIMCO REALTY CORP	10,100	162,004.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	1,600	6,848.00	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	2,200	52,558.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	3,800	28,006.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	2,900	87,000.00	
LTC PROPERTIES INC	800	23,616.00	
MACERICH CO	3,300	164,868.00	
MACK-CALI REALTY CORP	2,200	57,398.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	2,900	27,318.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	900	51,534.00	
MISSION WEST PROPERTIES	500	3,840.00	
MONMOUTH REIT -CL A	900	7,866.00	
MPG OFFICE TRUST INC	1,400	2,912.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	2,200	56,386.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	700	30,597.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,600	48,906.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	300	4,977.00	
PARKWAY PROPERTIES INC	700	6,986.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1,200	22,680.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	1,700	17,170.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	4,400	72,028.00	
POST PROPERTIES INC	1,200	48,924.00	

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	米ドル	PROLOGIS INC	11,300	324,310.00	
		PS BUSINESS PARKS INC/CA	500	27,245.00	
		PUBLIC STORAGE INC	3,500	455,595.00	
		RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	1,200	11,160.00	
		REALTY INCOME CORP	3,100	105,090.00	
		REGENCY CENTERS CORP	2,200	80,586.00	

	SAUL CENTERS INC	300	10,503.00	
	SENIOR HOUSING PROP TRUST	3,800	81,966.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	7,300	907,390.00	
	SL GRENN REALTY CORP	2,100	142,380.00	
	SOVRAN SELF STORAGE INC	700	28,273.00	
	STAG INDUSTRIAL INC	300	3,306.00	
	STRATEGIC HOTELS & RESORTS I	4,000	20,560.00	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	700	6,475.00	
	SUN COMMUNITIES INC	500	17,120.00	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	3,000	22,440.00	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	2,100	59,241.00	
	TAUBMAN CENTERS INC	1,400	86,884.00	
	TERRENO REALTY CORP	300	3,963.00	
	UDR INC	5,400	129,168.00	
	UMH PROPERTIES INC	400	3,712.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	300	11,352.00	
	URSTADT BIDDLE - CL A	600	10,338.00	
	VENTAS INC	7,100	379,140.00	
	VORNADO REALTY TRUST	4,600	342,378.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	1,700	46,342.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	3,100	64,325.00	
	WINTHROP REALTY TRUST	900	8,766.00	
	米ドル 小計	295,800	8,769,257.00 (681,195,883)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	600	14,640.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	1,000	13,940.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	600	30,990.00	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTI-U	300	7,170.00	
	CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	1,300	34,346.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	900	19,089.00	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	800	28,216.00	
	CANMARC REAL ESTATE INVESTME	600	9,660.00	
	CHARTWELL SENIORS HOUSING RE	2,100	16,716.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	900	19,674.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	400	5,440.00	
	DUNDEE REAL ESTATE INVESTMEN	700	22,946.00	
	EXTENDICARE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,200	8,892.00	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,000	46,660.00	
	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	1,300	5,382.00	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	800	12,808.00	
	NORTHERN PROPERTY REAL ESTAT	400	12,304.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	400	4,460.00	
	PRIMARIS RETAIL REAL ESTATE	1,000	20,600.00	

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	カナダドル	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3,300	84,645.00	
		TRANSGLOBE APARTMENT REAL ES	700	8,057.00	
		WHITEROCK REAL ESTATE INVEST	450	5,791.50	
		カナダドル 小計	21,750	432,426.50 (32,933,602)	
	ユーロ	AEDIFICA	174	7,617.72	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,418	12,479.81	
		ALTAREA	36	4,392.00	
		ANF IMMOBILIER	287	8,007.30	
		BEFIMMO S.C.A.	349	17,038.18	

	BENI STABILI SPA	21,067	7,369.23	
	BGP HOLDINGS PLC	900,544	0.00	
	COFINIMMO	359	31,250.95	
	CORIO NV	2,282	74,906.65	
	EUROBANK PROPERTIES REAL EST	461	1,608.89	
	EUROCOMMERCIAL-CVA	928	23,311.36	
	FONCIERE DES REGIONS	965	46,151.12	
	GECINA SA	669	40,755.48	
	HAMBORNER REIT AG	843	5,417.11	
	ICADE	583	32,811.24	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,517	3,803.31	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	192	3,686.40	
	KLEPIERRE	2,405	52,489.12	
	MERCIALYS	1,153	28,179.32	
	NIEUWE STEEN INVESTMENTS NV	1,365	12,148.50	
	SILIC	216	16,545.60	
	STE DE LA TOUR EIFFEL	170	6,415.80	
	UNIBAIL	2,257	309,434.70	
	VASTNED RETAIL NV	474	14,201.04	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	264	9,445.92	
	WERELDHAVE NV	555	28,710.15	
	ユーロ 小計	944,533	798,176.90 (82,826,816)	
英債券	BIG YELLOW GROUP PLC	3,524	9,162.40	
	BRITISH LAND CO PLC	21,935	102,765.47	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	15,303	48,388.08	
	DERWENT LONDON PLC	2,087	32,891.12	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	8,011	26,828.83	
	HAMMERSON PLC	17,617	65,359.07	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	19,173	124,816.23	
	LONDON & STAMFORD PROPERTY P	13,984	14,767.10	
	METRIC PROPERTY INVESTMENT P	4,868	4,332.52	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	1,914	5,990.82	
	SEGRO PLC	19,003	40,894.45	
	SHAFTESBURY PLC	6,417	31,629.39	
	WORKSPACE GROUP PLC	2,776	6,593.00	
	英債券 小計	136,612	514,418.48 (62,486,412)	

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	7,459	14,358.57	
		ALE PROPERTY GROUP	3,746	7,492.00	
		ASPEN GROUP	14,652	6,373.62	
		ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	1,493	3,224.88	
		AUSTRALAND PROPERTY GROUP	6,019	15,950.35	
		BWP TRUST	10,141	17,645.34	
		CENTRO RETAIL AUSTRALIA	7,016	12,734.04	
		CFS RETAIL PROPERTY TRUST	58,050	107,392.50	
		CHALLENGER DIVERSIFIED PROPERTY GROUP	14,887	7,443.50	
		CHARTER HALL GROUP	7,345	14,910.35	
		CHARTER HALL OFFICE REIT	10,532	37,493.92	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	6,775	21,951.00	
		COMMONWEALTH PROPERTY OFFICE	62,763	59,624.85	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	21,834	14,410.44	
		DEXUS PROPERTY GROUP	119,631	103,480.81	
		GOODMAN GROUP	162,720	94,377.60	

	GPT GROUP	42,304	133,680.64	
	INVESTA OFFICE FUND	72,558	43,897.59	
	MIRVAC GROUP	84,434	108,075.52	
	STOCKLAND	58,914	197,951.04	
	TISHMAN SPEYER OFFICE FUND	6,301	3,087.49	
	WESTFIELD GROUP	52,347	416,158.65	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	69,458	179,896.22	
	オーストラリアドル 小計	901,379	1,621,610.92 (128,236,991)	
ニュージーランド ドル	ARGOSY PROPERTY TRUST	13,879	11,033.80	
	DNZ PROPERTY FUND LTD	6,096	7,498.08	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	22,328	21,658.16	
	KIWI INCOME PROP	24,044	24,524.88	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	7,085	7,864.35	
	ニュージーランドドル 小計	73,432	72,579.27 (4,362,014)	
香港ドル	CHAMPION REIT	60,000	177,000.00	
	FORTUNE REIT	28,000	101,080.00	
	LINK REIT	55,500	1,554,000.00	
	PROSPERITY REIT	33,000	49,500.00	
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	20,000	35,600.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	33,000	73,590.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,000	58,480.00	
	香港ドル 小計	246,500	2,049,250.00 (20,451,515)	
シンガポール ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	10,600	10,017.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	17,000	17,170.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	14,000	13,300.00	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	32,000	15,360.00	
	CAPITARETAIL CHINA TRUST	11,000	12,540.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	18,000	27,990.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	12,000	9,120.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	11,000	16,555.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	12,000	8,940.00	

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	シンガポール ドル	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	44,000	15,620.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	27,000	23,490.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	25,920	27,864.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	36,000	30,240.00	
		PARKWAY LIFE REAL ESTATE	11,000	19,360.00	
		SAIZEN REIT	50,000	6,900.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	34,000	19,210.00	
		SUNTEC REIT	57,000	62,985.00	
		シンガポールドル 小計	422,520	336,661.00 (20,172,727)	
		イスラエル シェケル	REIT 1 LTD	2,669	18,282.65
		イスラエルシェケル 小計	2,669	18,282.65 (376,622)	
		投資証券 合計	3,045,195	1,033,042,582 (1,033,042,582)	
		合計		1,047,904,539 (1,047,904,539)	

(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	組入投資信託 受益証券時価比率 (注1)	組入投資証券 時価比率 (注2)	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	115		100.0%	65.0%
カナダドル	22		100.0%	3.1%
ユーロ	26		100.0%	7.9%
英ポンド	13		100.0%	6.0%
オーストラリアドル	23		100.0%	12.2%
ニュージーランドドル	5		100.0%	0.4%
香港ドル	7		100.0%	2.0%
シンガポールドル	21	42.4%	57.6%	3.3%
イスラエルシェケル	1		100.0%	0.0%
合計	233	1.4%	98.6%	100.0%

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

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

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】平成24年1月31日

資産総額	1,198,095,434 円
負債総額	3,678,806 円
純資産総額（ - ）	1,194,416,628 円
発行済口数	2,036,722,917 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.5864 円
1万口当たり純資産額	5,864 円

<参考>

マザーファンドの現況（平成24年1月31日）

純資産額計算書

（中央三井日本株式マザーファンド）

資産総額	238,984,074,701 円
負債総額	615,906,870 円
純資産総額（ - ）	238,368,167,831 円
発行済口数	348,238,170,334 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6845 円
1万口当たり純資産額	6,845 円

（中央三井日本債券マザーファンド）

資産総額	368,096,179,451 円
負債総額	4,832,221,080 円
純資産総額（ - ）	363,263,958,371 円
発行済口数	302,549,639,659 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2007 円
1万口当たり純資産額	12,007 円

（中央三井外国株式マザーファンド）

資産総額	255,553,348,615 円
負債総額	188,028,202 円
純資産総額（ - ）	255,365,320,413 円
発行済口数	280,238,871,908 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9112 円
1万口当たり純資産額	9,112 円

（中央三井外国債券マザーファンド）

資産総額	396,824,105,354 円
負債総額	295,415,294 円
純資産総額（ - ）	396,528,690,060 円
発行済口数	270,484,513,850 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4660 円
1万口当たり純資産額	14,660 円

（中央三井Jリートマザーファンド）

資産総額	14,982,070,796 円
負債総額	156,400,903 円
純資産総額(-)	14,825,669,893 円
発行済口数	15,262,404,072 口
1口当たり純資産額(/)	0.9714 円
1万口当たり純資産額	9,714 円

(海外リートマザーファンド)

資産総額	1,062,479,744 円
負債総額	543,354 円
純資産総額(-)	1,061,936,390 円
発行済口数	2,037,816,746 口
1口当たり純資産額(/)	0.5211 円
1万口当たり純資産額	5,211 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。

第三部【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：24,000株

発行済株式総数：6,000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。

委託会社の機構は平成24年4月1日現在（予定）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1月31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	165	1,266,156
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	165	1,266,156

（ご参考）平成24年1月31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	138	2,407,981
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	639
単位型公社債投資信託	0	0
合計	143	2,408,580

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

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

(単位：千円)

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

特別損失

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

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

重要な会計方針

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	<p>その他有価証券 時価のあるもの</p> <p>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。)</p> <p>時価のないもの</p> <p>移動平均法による原価法によっております。</p>	<p>その他有価証券 時価のあるもの</p> <p>同 左</p> <p>時価のないもの</p> <p>同 左</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。</p> <p>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。</p>	<p>有形固定資産 同 左</p> <p>無形固定資産 同 左</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金</p> <p>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。</p> <p>(2) 退職給付引当金</p> <p>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。</p>	<p>(1) 賞与引当金 同 左</p> <p>(2) 退職給付引当金 同 左</p>
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理</p> <p>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。</p>	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

-	<p>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。</p> <p>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。</p>
---	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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)												
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">建 物</td> <td style="text-align: right;">38,352千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">96,447千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 40px;">計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">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	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">建 物</td> <td style="text-align: right;">49,316千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">113,320千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 40px;">計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">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												
<p>2 関係会社に対するものは次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">預金</td> <td style="text-align: right;">3,498,856千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未払手数料</td> <td style="text-align: right;">353,462千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未払費用</td> <td style="text-align: right;">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	<p>2 関係会社に対するものは次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">預金</td> <td style="text-align: right;">3,477,508千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未払手数料</td> <td style="text-align: right;">333,570千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未払費用</td> <td style="text-align: right;">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)								
<p>1 関係会社に対するものは次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">支払手数料</td> <td style="text-align: right;">4,065,257千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">受取利息</td> <td style="text-align: right;">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	<p>1 関係会社に対するものは次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">支払手数料</td> <td style="text-align: right;">3,761,890千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">受取利息</td> <td style="text-align: right;">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								
<p>2 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">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 その他有価証券	46,016	46,016	-
(4)未払金	(520,453)	(520,453)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券取引に関する事項

（1）現金及び預金、及び（2）未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

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

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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 その他有価証券	39,590	39,590	-
(4)未払金	(495,343)	(495,343)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券取引に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

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

(有価証券関係)

前事業年度(平成22年3月31日現在)

1. その他有価証券

(単位:千円)

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

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

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

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

（単位:千円）

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

当事業年度（平成23年3月31日現在）

1．その他有価証券

（単位:千円）

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

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

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

（単位:千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
7,639	756	480

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度 （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)												
<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>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。</p> <p>2. 退職給付債務及びその他に関する事項</p> <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> <p>(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。</p> <p>(2) 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <table> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>52,327千円</td> </tr> </table> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>4. 退職給付債務等の計算基礎</p> <p>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。</p>	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	<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>同左</p> <p>2. 退職給付債務及びその他に関する事項</p> <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> <p>(1) 同左</p> <p>(2) 同左</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <table> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>63,772千円</td> </tr> </table> <p>(1) 同左</p> <p>(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。</p> <p>4. 退職給付債務等の計算基礎</p> <p>同左</p>	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)																								
<p>1. 繰延税金資産の発生の主な原因別の内訳</p> <p>(繰延税金資産)</p> <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> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <p>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。</p>	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	<p>1. 繰延税金資産の発生の主な原因別の内訳</p> <p>(繰延税金資産)</p> <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> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <p>同左</p>	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（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 その他有価証券	31,282	31,282	-
(4)未払金	(489,894)	(489,894)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

(有価証券関係)

第26期中間会計期間末(平成23年9月30日)

その他有価証券

（単位：千円）

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

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

（デリバティブ取引関係）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

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

（関連情報）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1)売上高

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

(2)有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第26期中間会計期間(自平成23年4月1日至平成23年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

第26期中間会計期間(自平成23年4月1日至平成23年9月30日)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

第26期中間会計期間(自平成23年4月1日至平成23年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

[次へ](#)

<参考> 中央三井アセットマネジメント株式会社の経理状況

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

ただし、第24期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）は、改正前の財務諸表等規則及び業府令に基づいて作成しており、第25期事業年度（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）は、改正後の財務諸表等規則及び業府令に基づいて作成しております。

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

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

(2) 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第24期事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）、第25期事業年度（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）の財務諸表及び第26期中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査及び中間監査を受けております。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月10日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 松崎雅則

印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 平木達也

印

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

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

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

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年6月10日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松崎雅則 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 平木達也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている中央三井アセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、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	<p>その他有価証券</p> <p>(1) 時価のないもの 移動平均法に基づく原価法を採用しております。</p> <p>(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。</p>	<p>その他有価証券</p> <p>(1) 時価のないもの 同左</p> <p>(2) 時価のあるもの 同左</p>
2. 固定資産の減価償却の方法		
(1) 有形固定資産	<p>定率法を採用しております。</p> <p>なお、耐用年数は、建物については主として15年～18年、器具備品については主として5年～20年であります。</p>	同左
(2) 無形固定資産	<p>定額法を採用しております。</p> <p>なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（5年）を耐用年数としております。</p>	同左
3. 引当金の計上基準		
(1) 貸倒引当金	<p>一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p>	同左
(2) 賞与引当金	<p>従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当期負担分を計上しております。</p>	同左
(3) 退職給付引当金	<p>従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による期末退職給付債務相当額を計上しております。</p>	同左
(4) 役員退職慰労引当金	<p>役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づき期末要支給額を計上しております。</p>	-
4. その他財務諸表作成の基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理は税抜方式を採用しております。</p>	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)
-	<p>資産除去債務に関する会計基準の適用</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

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)
-	<p>当社は、役員への退職慰労金の支払に備えるため、役員に対する退職慰労金の支給見積額のうち、当事業年度末までに発生していると認められる額を「役員退職慰労引当金」として計上しておりましたが、役員に対する退職慰労金制度を廃止し、退職慰労金を打切り支給することとしました。</p> <p>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。</p>

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	28,053千円	建物	33,765千円
		器具備品	177,074千円	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)								
<p>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。</p> <p>雑損失（臨時経営指導料） 4,490千円 統合関連費用 9,577千円</p>	<p>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。</p> <p>統合関連費用 51,394千円</p> <p>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。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>用途</th> <th>場所</th> <th>種類</th> <th>金額</th> </tr> </thead> <tbody> <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> </tbody> </table> <p>(経緯)</p> <p>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。</p> <p>(減損損失の金額)</p> <p>建物 15,615千円 器具備品 2,007千円 合計 17,622千円</p> <p>(グルーピングの方法)</p> <p>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。</p>	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	第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)				
項目	株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末
1. 発行済株式に関する事項	普通株式(株)	5,050	-	-	5,050
2. 自己株式に関する事項	該当事項はありません。				
3. 新株予約権等に関する事項	該当事項はありません。				
4. 配当に関する事項	(1) 配当金支払額 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	第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)				
項目	株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末
1. 発行済株式に関する事項	普通株式(株)	5,050	-	-	5,050
2. 自己株式に関する事項	該当事項はありません。				
3. 新株予約権等に関する事項	該当事項はありません。				
4. 配当に関する事項	(1) 配当金支払額 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23年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、次のとおりであります。

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

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び(4) 未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

6．有価証券関係

第24期 (平成22年3月31日)				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ないもの				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	区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円		千円	千円	千円
その他	9,897	10,000	103	その他	58,149	56,200	1,949
計	9,897	10,000	103	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				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	区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
	千円	千円	千円		千円	千円	千円
その他	986	1,000	13	その他	986	1,000	13
計	986	1,000	13	計	986	1,000	13
2．当事業年度中に売却したその他有価証券				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	区分	売却額	売却益の 合計額	売却損の 合計額
	千円	千円	千円		千円	千円	千円
その他	64,901	2,918	17	その他	128,650	67,194	344
計	64,901	2,918	17	計	128,650	67,194	344
3．時価評価されていない有価証券				3．時価評価されていない有価証券			
内容	貸借対照表計上額（千円）			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			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。				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)																
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成22年3月31日現在）</p> <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> <p>（注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 （平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）</p> <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> <p>（注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	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	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 同左</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項（平成23年3月31日現在）</p> <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> <p>（注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 （平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）</p> <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> <p>（注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。</p>	退職給付債務	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)																																																																				
<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <table border="0"> <tr> <td colspan="2">繰延税金資産</td> </tr> <tr> <td>貸倒引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">16,271千円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">18,883千円</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">9,168千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">25,501千円</td> </tr> <tr> <td><hr/></td> <td></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right;">69,823千円</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td style="text-align: right;">39,576千円</td> </tr> <tr> <td><hr/></td> <td></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right;">30,247千円</td> </tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、記載を省略しております。</p>	繰延税金資産		貸倒引当金繰入超過額	16,271千円	賞与引当金繰入超過額	18,883千円	未払事業税	9,168千円	その他	25,501千円	<hr/>		繰延税金資産小計	69,823千円	評価性引当額	39,576千円	<hr/>		繰延税金資産合計	30,247千円	<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <table border="0"> <tr> <td colspan="2">繰延税金資産</td> </tr> <tr> <td>貸倒引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">15,294千円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">20,418千円</td> </tr> <tr> <td>資産除去債務</td> <td style="text-align: right;">6,650千円</td> </tr> <tr> <td>移転による除却予定資産減損</td> <td style="text-align: right;">7,170千円</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">6,824千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">19,740千円</td> </tr> <tr> <td><hr/></td> <td></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td> <td style="text-align: right;">76,099千円</td> </tr> <tr> <td>評価性引当額</td> <td style="text-align: right;">32,440千円</td> </tr> <tr> <td><hr/></td> <td></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td> <td style="text-align: right;">43,658千円</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table border="0"> <tr> <td> 其他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">793千円</td> </tr> <tr> <td> その他</td> <td style="text-align: right;">806千円</td> </tr> <tr> <td><hr/></td> <td></td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td> <td style="text-align: right;">1,600千円</td> </tr> </table> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <table border="0"> <tr> <td>法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">40.7%</td> </tr> <tr> <td colspan="2">(調整)</td> </tr> <tr> <td> 受取配当金等永久に益金に 算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">2.9%</td> </tr> <tr> <td> 評価性引当額の減少</td> <td style="text-align: right;">1.6%</td> </tr> <tr> <td> 住民税均等割</td> <td style="text-align: right;">0.1%</td> </tr> <tr> <td> その他</td> <td style="text-align: right;">0.4%</td> </tr> <tr> <td><hr/></td> <td></td> </tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right;">36.7%</td> </tr> </table>	繰延税金資産		貸倒引当金繰入超過額	15,294千円	賞与引当金繰入超過額	20,418千円	資産除去債務	6,650千円	移転による除却予定資産減損	7,170千円	未払事業税	6,824千円	その他	19,740千円	<hr/>		繰延税金資産小計	76,099千円	評価性引当額	32,440千円	<hr/>		繰延税金資産合計	43,658千円	其他有価証券評価差額金	793千円	その他	806千円	<hr/>		繰延税金負債合計	1,600千円	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%	<hr/>		税効果会計適用後の法人税等の負担率	36.7%
繰延税金資産																																																																					
貸倒引当金繰入超過額	16,271千円																																																																				
賞与引当金繰入超過額	18,883千円																																																																				
未払事業税	9,168千円																																																																				
その他	25,501千円																																																																				
<hr/>																																																																					
繰延税金資産小計	69,823千円																																																																				
評価性引当額	39,576千円																																																																				
<hr/>																																																																					
繰延税金資産合計	30,247千円																																																																				
繰延税金資産																																																																					
貸倒引当金繰入超過額	15,294千円																																																																				
賞与引当金繰入超過額	20,418千円																																																																				
資産除去債務	6,650千円																																																																				
移転による除却予定資産減損	7,170千円																																																																				
未払事業税	6,824千円																																																																				
その他	19,740千円																																																																				
<hr/>																																																																					
繰延税金資産小計	76,099千円																																																																				
評価性引当額	32,440千円																																																																				
<hr/>																																																																					
繰延税金資産合計	43,658千円																																																																				
其他有価証券評価差額金	793千円																																																																				
その他	806千円																																																																				
<hr/>																																																																					
繰延税金負債合計	1,600千円																																																																				
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%																																																																				
<hr/>																																																																					
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VAバランスファンド(株25/100)	1,150,446千円

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

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

(追加情報)

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

12. 関連当事者との取引関係

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	<p>その他有価証券</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
2. 固定資産の減価償却の方法 (1) 有形固定資産 (2) 無形固定資産	<p>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。</p> <p>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。</p>
3. 引当金の計上基準 (1) 貸倒引当金 (2) 賞与引当金 (3) 役員賞与引当金 (4) 退職給付引当金	<p>一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による中間期末退職給付債務相当額を計上しております。</p>
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ち、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 其他有価証券	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	<u>16,385</u>

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) 通常の実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

通常の実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

当会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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する予定です。

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（予定））

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
株式会社愛知銀行	18,000	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社青森銀行	19,562	
株式会社秋田銀行	14,100	
株式会社岩手銀行	12,089	
株式会社京都銀行	42,103	
株式会社四国銀行	25,000	
株式会社荘内銀行	7,000	
株式会社千葉興業銀行	57,941	
株式会社福井銀行	17,965	
株式会社北越銀行	24,538	
株式会社横浜銀行	215,628	
浜銀TT証券株式会社	3,307	「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。

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【その他】

- (1) 金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2) 目論見書の表紙等に委託会社又は受託会社のロゴ・マーク、ファンドの図案及びキャッチコピーを記載することがあります。
- (3) 目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。
ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5) 目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6) 交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載し、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9) 目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10) 有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成24年2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 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」に掲げられているベスト・世界6資産ファンド（毎月決算型）の平成23年6月11日から平成23年12月12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、ベスタ・世界6資産ファンド（毎月決算型）の平成23年12月12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であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、住信アセットマネジメント株式会社の平成23年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成23年12月14日

住信アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている住信アセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第26期事業年度の中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成22年6月29日

住信アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員 公認会計士 壁谷 惠嗣 印

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

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

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

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

以上

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