

【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・レポート部部長 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】** グローバル・インデックス・バランス・ファンド

**【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】

グローバル・インデックス・バランス・ファンド

ただし、愛称として“投資生活”という名称を用いることがあります。

（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、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。

ただし、「分配金再投資コース」（ ）を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、後記「第二部 ファンド情報 第2 管理及び運営 3 資産管理等の概要（４）計算期間」に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（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。

なお、「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。

(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、後記「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針 (4) 分配方針 収益分配金の支払い」に規定する収益分配金の再投資をする場合を除き、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の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の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ることができます。

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
	海外	債券
追加型	内外	不動産投信
		その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

(用語の定義について)

当ファンドが該当する商品分類に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

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

< 投資対象地域 >

- ・グローバル(日本を含む)
...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、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド(以下これらを「マザーファンド」又は「親投資信託」という場合があります。)の各受益証券への投資を通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

当ファンドが主要投資対象とする各マザーファンドは、それぞれが定めている以下のベンチマーク(運用成果を判断するうえで基準になる市場全体の動きを示す指数です。)と連動する投資成果を目標とする運用を行います。

日本株式マザーファンド:「TOPIX」(東証株価指数、配当込み)

外国株式マザーファンド:「MSCIコクサイ指数(円ベース)」

外国債券マザーファンド:「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)」

「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。

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。

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。

（２）【ファンドの沿革】

- 平成20年3月3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22年9月11日 ファンドの名称を「ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド」から、「グローバル・インデックス・バランス・ファンド」に変更
- 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（グローバル・インデックス・バランス・ファンド）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、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド）に投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



ファンドの関係法人

委託会社 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

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

受託会社 三井住友信託銀行株式会社

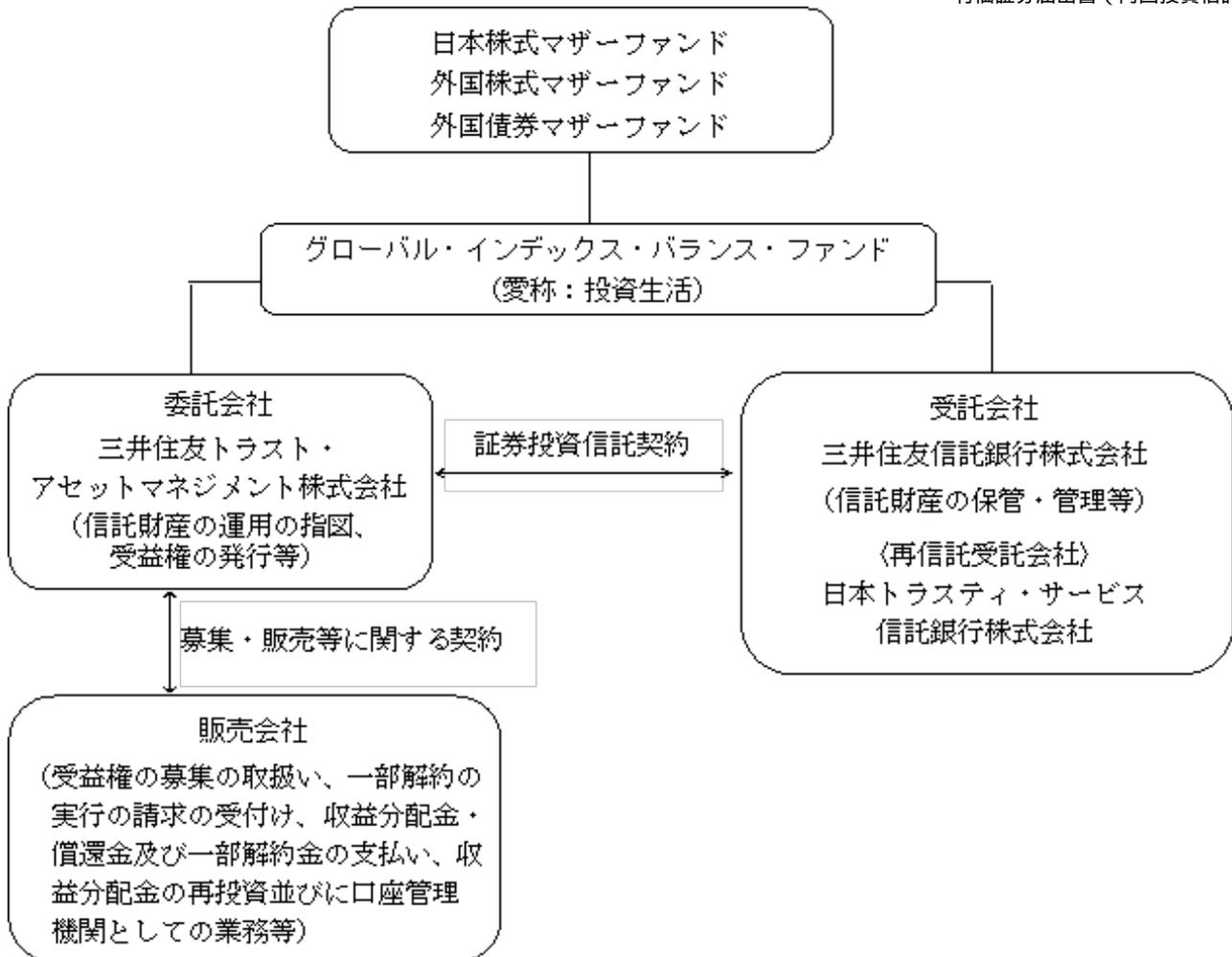
（再信託受託会社 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

販売会社

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

ファンドの関係法人



委託会社と関係法人との契約の概要

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

委託会社の概況

A．資本金の額：3億円（平成24年4月1日現在（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、外国株式マザーファンド及び外国債券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を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

従って当ファンドでは、基本的に各マザーファンドを通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資することになります。このほか、国内外の株式や外国の公社債等に直接投資することもあります。

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、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- B．各資産への配分は、3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、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。
- E．運用の効率化を図るため、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．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- G．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。
- H．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。
- I．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。
- J．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）J．、K．及びL．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」、「外国株式マザーファンド」及び「外国債券マザーファンド」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ません。）
17. 預託証券（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券
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せん。）
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. の証券又は証券並びに上記12. 及び17. の証券又は証券のうち上記1. の証券又は証券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. の証券又は証券のうち上記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

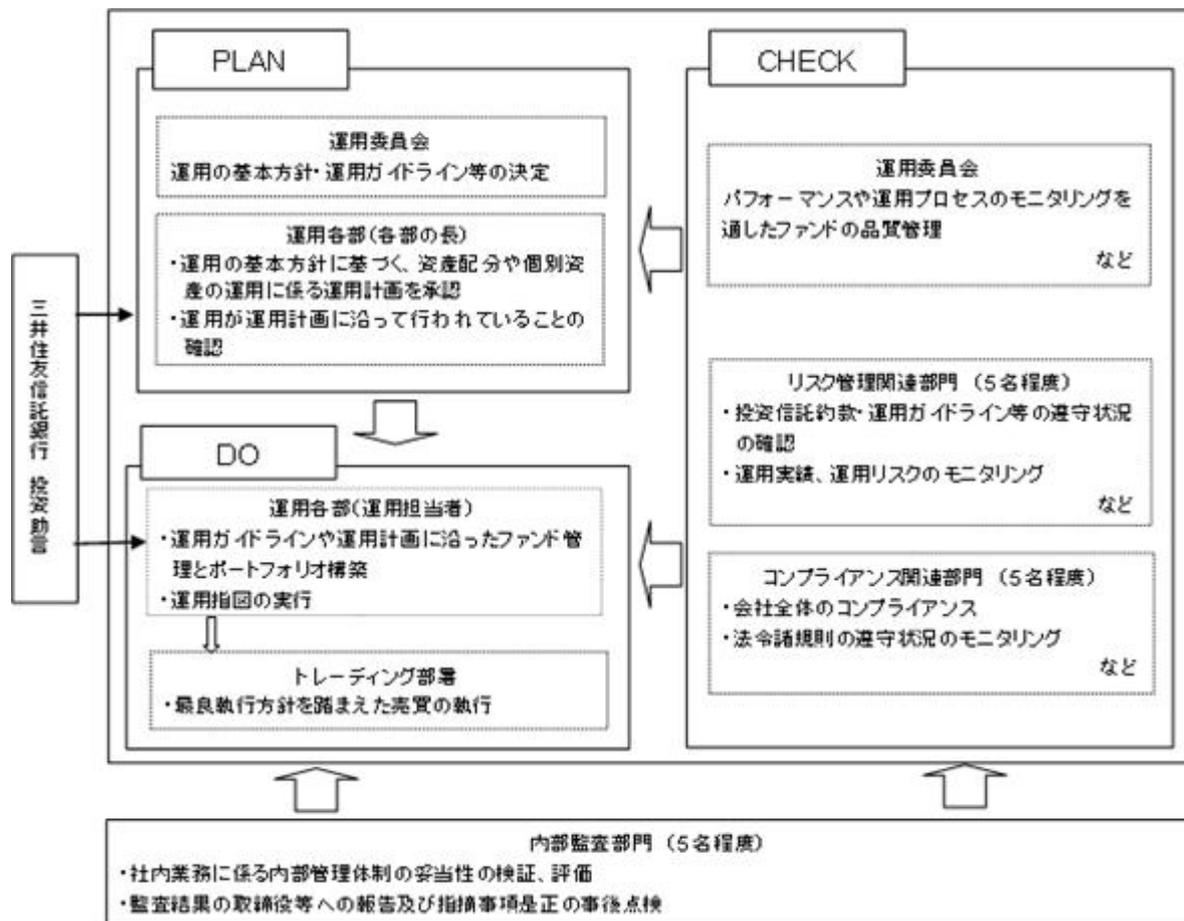
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

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。

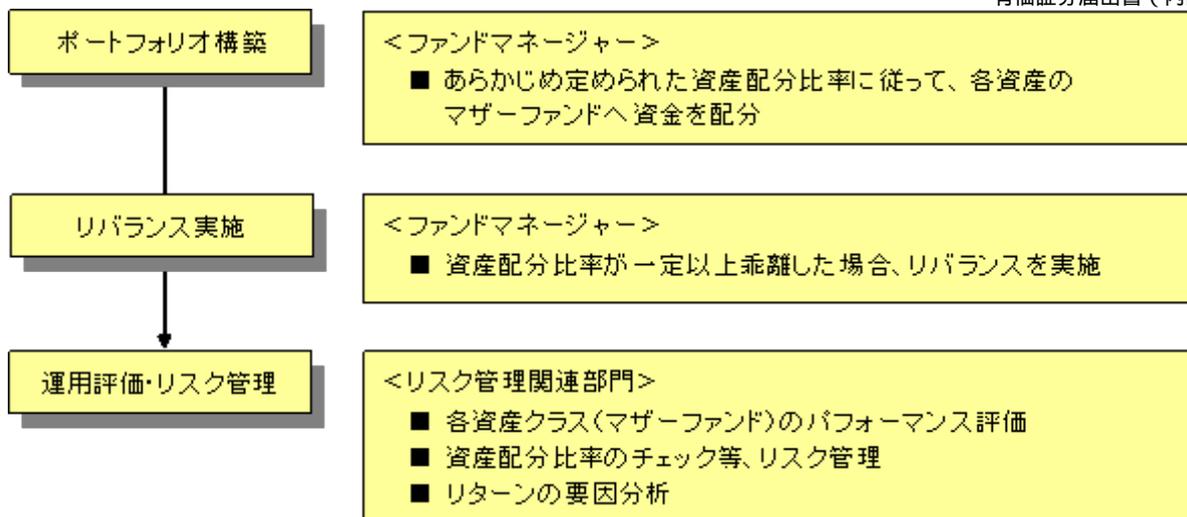
（3）【運用体制】

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 >

- ・ファンドマネージャーは、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

年1回の毎決算時（決算日は6月10日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

- A. 分配対象額は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）及び売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額。）等の全額とします。なお、前期から繰り越された分配準備積立金及び収益調整金は、全額分配に使用することがあります。
- B. 分配金額については、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- C. 収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

分配収益の計算

- A. 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。
- イ. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）とみなし配当等収益との合計額は、諸経費（後記「4 手数料等及び税金（4）その他の手数料等」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あてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
- ロ. 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- ハ. 上記イ. 及びロ. においてみなし配当等収益とは、マザーファンドの配当等収益にマザーファンドの受益権総口数に占める信託財産に属するマザーファンドの受益権口数の割合を乗じて得た額をい

います。

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

ホ．「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額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、上記二．に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

B．毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

A．支払時期と場所

イ．収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として計算期間終了日から起算して5営業日までの日）から、毎計算期間終了日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者として）に対する支払いを開始します。

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

ハ．上記イ．に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

B．時効

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（5）【投資制限】

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、信託財産の純資産総額の75%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割合

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

E．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資

産総額の5%以下とします。

G．投資信託証券への投資割合

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

H．投資する株式等の範囲

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

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

I．信用取引の指図範囲

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

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

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

J．先物取引等の運用指図

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

K．スワップ取引の運用指図

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

ロ．スワップ取引の指図に当たっては、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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

L．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図に当たっては、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るときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- M．有価証券の貸付の指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の a．及び b．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
- a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ． a．及び b．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- N．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記 O．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- O．公社債の借入れの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、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。
- P．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- Q．外国為替予約取引の指図
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- ロ．上記イ．の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨

建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。))を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

R. 一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

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

S. 再投資の指図

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

T. 資金の借入れ

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

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

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

二. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

U. 受託会社による資金の立替え

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

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

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

V. 利害関係人等との取引等

イ. 受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社(第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託会社が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。)及び受託会社の利害関係人(金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下イ. 及び下記ロ. において同じ。)、信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記(2)に掲げる資産への投資等並びに上記I. からO. まで及びQ. からT. までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

ロ. 受託会社は、受託会社がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託会社又は受託会社の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託会社の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

八．委託会社は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託会社、その取締役、執行役及び委託会社の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託会社が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記I．からO．まで及びQ．からT．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託会社は、委託会社の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。

二．上記イ．から八．までの場合、委託会社及び受託会社は、受益者に対して信託法第31条第3項及び同法第32条第3項の通知は行いません。

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、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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。

「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

M S C I 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、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限り、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。

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
の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むこと
があります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

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。

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。

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。

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。

(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率が小さかつ

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】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はありませんが、下記 の信託財産留保額が控除されます。

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

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

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

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

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。

(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以下の率を乗じて得た額とします。その配分は以下のとおりです。

		ファンドの純資産総額	
		100億円以下の部分	100億円超の部分
総額		0.63%（税抜 0.6%）	0.525%（税抜 0.5%）
（配分）	委託会社	0.315%（税抜 0.3%）	0.2625%（税抜 0.25%）
	販売会社	0.2625%（税抜 0.25%）	0.21%（税抜 0.2%）
	受託会社	0.0525%（税抜 0.05%）	0.0525%（税抜 0.05%）

なお、マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

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

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

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、原則として、確定申告により、配当控除の適用が可能です。

	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、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。

	税 率（所得税のみ）
平成24年12月31日まで	7%
平成25年1月1日から平成25年12月31日まで	7.147%
平成26年1月1日から平成49年12月31日まで	15.315%
平成50年1月1日以降	15%

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

上記は、平成24年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」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	636,055,654	33.12
	中央三井外国株式マザーファンド	日本	654,210,248	34.06
	中央三井外国債券マザーファンド	日本	632,106,193	32.91
	親投資信託受益証券合計			1,922,372,095
その他の資産(負債控除後)			1,688,847	0.09
合計(純資産総額)			1,920,683,248	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

（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	929,226,668	0.7215	670,437,041	0.6845	636,055,654	33.12
	中央三井外国株式 マザーファンド	717,965,593	0.9718	697,718,964	0.9112	654,210,248	34.06
	中央三井外国債券 マザーファンド	431,177,485	1.5142	652,931,761	1.4660	632,106,193	32.91

（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。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）	1万口当たりの 基準価額（円）
第1期計算期間（平成20年6月10日現在）	522,933,234	10,627
第2期計算期間（平成21年6月10日現在）	1,311,145,790	7,776
第3期計算期間（平成22年6月10日現在）	1,596,924,893	7,467
第4期計算期間（平成23年6月10日現在）	1,894,852,177	7,723
平成23年1月末日	1,867,104,490	7,864
平成23年2月末日	1,903,428,781	8,058
平成23年3月末日	1,898,537,513	8,007
平成23年4月末日	1,930,712,288	8,066
平成23年5月末日	1,904,712,067	7,876
平成23年6月末日	1,920,702,202	7,842
平成23年7月末日	1,888,199,899	7,623
平成23年8月末日	1,824,383,857	7,217
平成23年9月末日	1,791,402,586	6,989
平成23年10月末日	1,909,076,143	7,366
平成23年11月末日	1,817,679,326	6,972
平成23年12月末日	1,855,351,097	7,068
平成24年1月末日	1,920,683,248	7,232

（注）決算日における基準価額は、分配付、分配落とも同一です。

【分配の推移】

	1万口当たりの収益分配金
第1期計算期間	0円

第2期計算期間	0円
第3期計算期間	0円
第4期計算期間	0円

【収益率の推移】

	収益率
第1期計算期間	6.3%
第2期計算期間	26.8%
第3期計算期間	4.0%
第4期計算期間	3.4%
第5期中間計算期間（自平成23年6月11日至平成23年12月10日）	8.3%

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

（4）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1期計算期間	510,143,440	18,045,396	492,098,044
第2期計算期間	1,395,056,723	201,040,178	1,686,114,589
第3期計算期間	816,801,713	364,200,118	2,138,716,184
第4期計算期間	586,983,066	272,034,617	2,453,664,633
第5期中間計算期間 （自平成23年6月11日 至平成23年12月10日）	244,861,140	103,307,305	2,595,218,468

（注1）設定及び解約の実績は、全て本邦内における実績です。

（注2）第1期計算期間の設定口数には、当初募集期間中の募集に係る設定口数を含みます。

（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〉

2011年6月	0円
2010年6月	0円
2009年6月	0円
2008年6月	0円
-	-
設定来累計	0円

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

〈主な資産の状況〉

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	33.12%
中央三井外国株式マザーファンド	34.06%
中央三井外国債券マザーファンド	32.91%

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

組入上位銘柄

(中央三井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%

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%

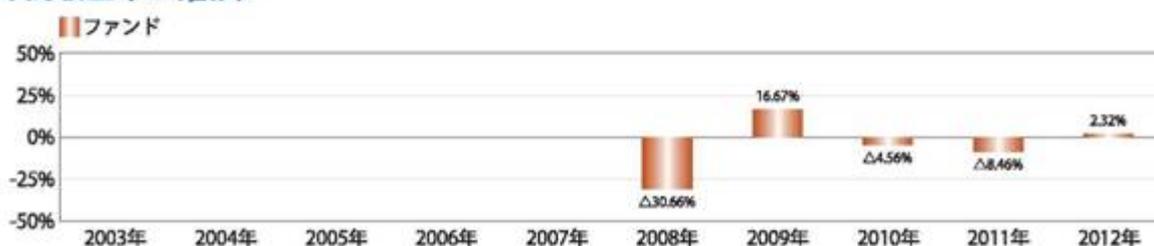
組入上位銘柄

(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%

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

〈年間収益率の推移〉



・年間収益率は「期間中の基準価額増減＋分配金（税引前）」/前年末の基準価額で算出しています。
 ・2008年はファンドの設定日から年末までの分配金（税引前）を含む基準価額の騰落率を表示しています。
 ・2012年（直近年）は年初から基準日までの分配金（税引前）を含む基準価額の騰落率を表示しています。
 ・ファンドにはベンチマークはありません。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

（1）申込みの受付

申込期間中において、毎営業日お申込みいただけます。

（注）お申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

ただし、分配金再投資に関する契約（下記（4））をご参照ください。）に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、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（「分配金再投資コース」（ ）を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。）。

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

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とします。

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

（4）その他

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

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

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

を過ぎての受付けは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

- (2) 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- (3) 委託会社は、一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。
なお、一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。
- (4) 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。
解約価額は委託会社の営業日において日々算出され、日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。
なお、受益者の手取額は、当該解約価額から税額を差引いた金額となります。
- 販売会社の詳細につきましては、以下の照会先にお問い合わせください。
（照会先）
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
・お問い合わせ窓口
電 話：0120-668001（フリーダイヤル）
受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで
・ホームページ アドレス：<http://www.smtam.jp/>
- (5) 委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、上記（1）による一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。
- (6) 上記（5）により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして上記（4）の規定に準じて計算された価額とします。
- (7) 一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。
- (8) 解約に係る手数料については、徴収しません。
- (9) 当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、上記（4）に記載の照会先までお問い合わせください。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額

信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及び社団法人投資信託協会規則に従って時価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、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド）

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す。）

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

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20年3月3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、毎年6月11日から翌年6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20年3月3日から平成20年6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。

□ . 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。

八 . 所定の手続き

- a . 委託会社は、上記イ . 及びロ . の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b . 委託会社は、上記イ . 及びロ . の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c . 上記b . の書面決議において、受益者（委託会社及び当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下c . において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d . 上記b . の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e . 上記b . からd . までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b . からd . までの手続きを行うことが困難な場合には適用しません。

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 . に該当する場合には、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。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、下記 の規定に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

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

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。

信託約款の変更等

- A．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更すること又は当ファンドと他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更又は併合しようとする旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は に定める以外の方法によって変更することができないものとし、
- B．委託会社は、上記A．の事項（上記A．の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款の変更等の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- C．上記B．の書面決議において、受益者（委託会社及び当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下C．において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- D．上記B．の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- E．書面決議の効力は、当ファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。
- F．上記B．からE．までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- G．上記A．からF．までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

反対者の買取請求権

信託契約の解約又は重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約又は重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容及び買取請求の手続きに関する事項は、上記 A．八．b．又は B．に規定する書面に付記します。

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第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下、下記八．及び ににおいて同じ。）を含みます。）を委託先として選定します。

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

ロ．受託会社は、上記イ．に定める委託先の選定に当たっては、当該委託先が上記イ．1．から4．までに掲げる基準に適合していることを確認するものとし、

八．上記イ．及びロ．にかかわらず、受託会社は、次の1．から4．までに掲げる業務を、受託会社及び委託会社が適当と認める者（受託会社の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとし、

1. 信託財産の保存に係る業務
2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用又は改良を目的とする業務
3. 委託会社の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
4. 受託会社が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

B. 混蔵寄託

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

C. 信託財産の登記等及び記載等の留保等

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

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

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

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

運用報告書

委託会社は、毎決算時及び償還時に運用報告書を作成し、販売会社を通じて知っ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何らかの意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

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

信託事務処理の再委託

A. 受託会社は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託会社の利害関係人を含みます。）と信託契約を締結し、これを再委託することができます。

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次のとおりです。

(1) 収益分配金に対する請求権

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、毎計算期間終了日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録

されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間終了日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし）に対する支払いを開始します。

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

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

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。

（7）他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

当ファンドの受益者は、委託会社又は受託会社に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名又は名称及び住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（平成21年6月11日から平成22年6月10日まで）及び第4期計算期間（平成22年6月11日から平成23年6月10日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。
- (3) 当ファンドは、ファンドの名称を平成22年9月11日をもって「ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド」から「グローバル・インデックス・バランス・ファンド」に変更いたしました。

1【財務諸表】

【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 (平成22年6月10日現在)	第4期 (平成23年6月10日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,602,007,879	1,900,820,430
未収入金	2,371,408	428,005
流動資産合計	1,604,379,287	1,901,248,435
資産合計	1,604,379,287	1,901,248,435
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,371,408	428,005
未払受託者報酬	420,092	493,254
未払委託者報酬	4,620,944	5,425,734
その他未払費用	41,950	49,265
流動負債合計	7,454,394	6,396,258
負債合計	7,454,394	6,396,258
純資産の部		
元本等		
元本	2,138,716,184	2,453,664,633
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	541,791,291	558,812,456
純資産合計	1,596,924,893	1,894,852,177
負債純資産合計	1,604,379,287	1,901,248,435

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 3 期	第 4 期
	自 平成21年 6 月11日 至 平成22年 6 月10日	自 平成22年 6 月11日 至 平成23年 6 月10日
営業収益		
受取利息	27	4
有価証券売買等損益	57,328,069	68,500,977
営業収益合計	57,328,042	68,500,981
営業費用		
受託者報酬	794,372	937,435
委託者報酬	8,737,936	10,311,748
その他費用	79,309	93,619
営業費用合計	9,611,617	11,342,802
営業利益又は営業損失（ ）	66,939,659	57,158,179
経常利益又は経常損失（ ）	66,939,659	57,158,179
当期純利益又は当期純損失（ ）	66,939,659	57,158,179
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	7,896,380	8,313,546
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	374,968,799	541,791,291
剰余金増加額又は欠損金減少額	80,817,134	68,514,677
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	80,817,134	68,514,677
剰余金減少額又は欠損金増加額	172,803,587	134,380,475
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	172,803,587	134,380,475
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	541,791,291	558,812,456

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第 3 期 自 平成21年 6 月11日 至 平成22年 6 月10日	第 4 期 自 平成22年 6 月11日 至 平成23年 6 月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額 で評価しております。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

	第 3 期 (平成22年 6 月10日現在)	第 4 期 (平成23年 6 月10日現在)
1. 当該計算期間の末日における受益権総数	2,138,716,184 口	2,453,664,633 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 541,791,291 円	元本の欠損 558,812,456 円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7467 円 (7,467 円)	0.7723 円 (7,723 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 3 期 自 平成21年 6 月11日 至 平成22年 6 月10日	第 4 期 自 平成22年 6 月11日 至 平成23年 6 月10日
費用控除後の配当等収益額	A	30,333,864 円 (39,945,454 円)	38,319,940 円 (47,218,364 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	88,544,029 円	118,523,092 円
分配準備積立金額	D	31,453,613 円	55,168,165 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	150,331,506 円	212,011,197 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,138,716,184 口	2,453,664,633 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	702.90 円	864.05 円
10,000口当たり分配金額	H	円	円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	円	円

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

	第 3 期 自 平成21年 6 月11日 至 平成22年 6 月10日	第 4 期 自 平成22年 6 月11日 至 平成23年 6 月10日

2. 欠損金減少額・増加額	「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ欠損金増加額と減少額との純額を表示しております。	同左
---------------	--	----

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	第 3 期 自 平成21年 6 月11日 至 平成22年 6 月10日	第 4 期 自 平成22年 6 月11日 至 平成23年 6 月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは価格変動リスク等に晒されております。	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	<p>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。</p> <p>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。</p>	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

	第 3 期 (平成22年 6 月10日現在)	第 4 期 (平成23年 6 月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び 差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭 債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	(1) 親投資信託受益証券 同左 (2) コール・ローン等の金銭 債権及び金銭債務 同左
3. 金融商品の時価等に関する 事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
4. 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額	金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第 3 期 自 平成21年 6 月11日 至 平成22年 6 月10日	第 4 期 自 平成22年 6 月11日 至 平成23年 6 月10日
該当事項はありません。	同左

(重要な後発事象に関する注記)

第 3 期 自 平成21年 6 月11日 至 平成22年 6 月10日	第 4 期 自 平成22年 6 月11日 至 平成23年 6 月10日
該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

1. 本書における開示対象ファンドの当該計算期間における元本額の変動

	第 3 期 自 平成21年 6 月11日 至 平成22年 6 月10日	第 4 期 自 平成22年 6 月11日 至 平成23年 6 月10日
期首元本額	1,686,114,589 円	2,138,716,184 円
期中追加設定元本額	816,801,713 円	586,983,066 円
期中一部解約元本額	364,200,118 円	272,034,617 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 3 期 (平成22年 6 月10日現在)	第 4 期 (平成23年 6 月10日現在)
	最終の計算期間(自 平成21年 6 月11日 至 平成22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22年 6 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)
親投資信託受益証券	59,737,250	67,809,865
合計	59,737,250	67,809,865

3. デリバティブ取引関係

第 3 期 自 平成21年 6 月11日 至 平成22年 6 月10日
当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

第 4 期 (平成23年 6 月10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。

(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	862,319,753	631,304,291	
	中央三井外国株式マザーファンド	629,648,260	628,892,682	
	中央三井外国債券マザーファンド	420,522,159	640,623,457	
合計		1,912,490,172	1,900,820,430	

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 >

「グローバル・インデックス・バランス・ファンド」は、「中央三井日本株式マザーファンド」、「中央三井外国株式マザーファンド」及び「中央三井外国債券マザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、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6月10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6月10日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,805,921,450
株式	229,788,908,785
派生商品評価勘定	115,067,325
未収配当金	2,196,994,462
未収利息	15,481
流動資産合計	239,906,907,503
資産合計	239,906,907,503
負債の部	
流動負債	
前受金	84,846,000
未払解約金	120,439,971
流動負債合計	205,285,971
負債合計	205,285,971
純資産の部	
元本等	
元本	327,432,073,619
剰余金	
欠損金	87,730,452,087
純資産合計	239,701,621,532
負債・純資産合計	239,906,907,503

(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6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<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6月10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 2,440,000,000 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	327,432,073,619 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>87,730,452,087 円</p>
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	<p>0.7321 円</p> <p>(7,321 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6月10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、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6月10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6月10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 6 月10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 6 月10日現在	
計算期間の期首元本額	331,189,663,848 円
計算期間中の追加設定元本額	47,842,722,872 円
計算期間中の一部解約元本額	51,600,313,101 円
計算日の元本額	327,432,073,619 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	2,488,524,817 円
中央三井D C 日本株式インデックスファンド	326,186,104 円
中央三井D C 日本株式インデックスファンドL	42,745,814,906 円
中央三井D C 日本株式インデックスファンドA	1,542,677,919 円
中央三井D C バランスファンド3 0	346,451,400 円
中央三井D C バランスファンド5 0	811,167,109 円
中央三井D C バランスファンド7 0	473,633,477 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	319,565,612 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	207,699,535 円
新生・4分散ファンド	249,179,347 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	862,319,753 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	123,688,945 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	259,075,262 円
日本債券・株式バランスファンド(資産配分調整型)	65,191,598 円
C M A M 日本株式インデックスe	437,409,978 円
中央三井インデックスコレクション(国内株式)	16,610,406 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式3 0)	2,697,974 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式5 0)	6,164,447 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式7 0)	5,494,553 円
中央三井日本株式インデックスファンドV A (適格機関投資家専用)	34,194,794,245 円
中央三井バランスV A 3 0 (適格機関投資家専用)	6,883,190,378 円
中央三井バランスV A 5 0 (適格機関投資家専用)	52,799,066,222 円
中央三井V A バランスファンド(株2 5 / 1 0 0) (適格機関投資家専用)	40,778,166,763 円
中央三井V A バランスファンド(株5 0 / 1 0 0) (適格機関投資家専用)	6,510,576,384 円
中央三井V A バランス株式3 0 (適格機関投資家専用)	1,000,736,786 円
中央三井V A バランスファンド(株6 0 / 1 0 0) (適格機関投資家専用)	8,333,570,406 円
中央三井バランスV A 2 5 (適格機関投資家専用)	6,643,428,727 円
中央三井バランスV A 3 7 . 5 (適格機関投資家専用)	2,741,441,353 円
中央三井バランスV A 5 0 L (適格機関投資家専用)	41,550,322,285 円
中央三井バランスV A 7 5 (適格機関投資家専用)	2,865,274,320 円
中央三井V A バランスファンド(株4 0 / 1 0 0) (適格機関投資家専用)	20,512,541,459 円
中央三井V A ポートフォリオ4 0 (適格機関投資家専用)	8,067,516,825 円
中央三井V A ポートフォリオ2 0 (適格機関投資家専用)	268,779,497 円
中央三井バランスV A 4 0 (適格機関投資家専用)	3,606,192,853 円

中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	2,821,968,580 円
CMAM・バランスファンドVA(適格機関投資家専用)	7,987,338,035 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)	443,323,343 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)	1,220,489,646 円
CMAM・VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	348,875,548 円
中央三井バランスVA20(適格機関投資家専用)	1,827,317,564 円
中央三井VAファンド25(適格機関投資家専用)	3,612,338,891 円
CMAM・バランスファンドVA2(適格機関投資家専用)	3,197,734,096 円
中央三井バランスVA20L(適格機関投資家専用)	131,453,082 円
中央三井バランスVA25L(適格機関投資家専用)	1,976,291,539 円
CMAM・バランスファンドVA3(適格機関投資家専用)	14,537,760,725 円
中央三井世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	593,598,091 円
中央三井国内バランスVA30(適格機関投資家専用)	225,776,743 円
中央三井国内バランスVA25(適格機関投資家専用)	81,347,519 円
CMAM・VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	357,138,773 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)	19,223,371 円
中央三井世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	4,946,428 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成23年6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	27,372,730,735
合計	27,372,730,735

(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6月10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6月10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	9,756,417,675		9,871,485,000	115,067,325
	合計	9,756,417,675		9,871,485,000	115,067,325

(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6月10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6月10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	93,000	175	16,275,000	
日本水産	269,400	253	68,158,200	
マルハニチロホールディングス	462,000	120	55,440,000	
サカタのタネ	34,600	1,116	38,613,600	
ホクト	23,800	1,793	42,673,400	
住石ホールディングス	69,100	100	6,910,000	
日鉄鉱業	60,000	331	19,860,000	
三井松島産業	138,000	172	23,736,000	
国際石油開発帝石	2,369	588,000	1,392,972,000	
日本海洋掘削	6,000	2,662	15,972,000	
関東天然瓦斯開発	25,000	453	11,325,000	
石油資源開発	37,000	3,900	144,300,000	
ショーボンドホールディングス	22,200	1,893	42,024,600	
ミライト・ホールディングス	66,200	600	39,720,000	
ダイセキ環境ソリューション	20	188,500	3,770,000	
東急建設	110,680	206	22,800,080	
コムシスホールディングス	113,500	762	86,487,000	
ミサワホーム	40,600	492	19,975,200	
高松コンストラクショングループ	23,200	1,014	23,524,800	
東建コーポレーション	8,950	3,185	28,505,750	
ヤマウラ	13,000	195	2,535,000	
大成建設	1,108,000	185	204,980,000	
大林組	701,000	357	250,257,000	
清水建設	664,000	344	228,416,000	
松井建設	45,000	300	13,500,000	
鹿島建設	1,028,000	232	238,496,000	
太平工業	54,000	326	17,604,000	
前田建設工業	170,000	257	43,690,000	
奥村組	242,000	282	68,244,000	
大和小田急建設	40,500	198	8,019,000	
東鉄工業	35,000	706	24,710,000	
戸田建設	272,000	286	77,792,000	
青木あすなろ建設	31,000	398	12,338,000	

北野建設	82,000	182	14,924,000	
三井ホーム	41,000	399	16,359,000	
矢作建設工業	30,600	379	11,597,400	
ピーエス三菱	22,900	299	6,847,100	
大東建託	91,400	7,000	639,800,000	
新日本建設	31,000	249	7,719,000	
N I P P O	59,000	569	33,571,000	
前田道路	71,000	714	50,694,000	
日本道路	83,000	223	18,509,000	
五洋建設	307,500	180	55,350,000	
大林道路	43,000	172	7,396,000	
住友林業	160,900	708	113,917,200	
日本基礎技術	40,000	311	12,440,000	
巴コーポレーション	41,200	315	12,978,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
パナホーム	78,000	514	40,092,000	
大和ハウス工業	583,000	1,006	586,498,000	
ライト工業	59,100	252	14,893,200	
積水ハウス	702,000	773	542,646,000	
北陸電気工事	25,000	211	5,275,000	
ユアテック	44,000	360	15,840,000	
西部電気工業	29,000	323	9,367,000	
四電工	29,000	328	9,512,000	
中電工	36,900	885	32,656,500	
関電工	114,000	340	38,760,000	
きんでん	155,000	657	101,835,000	
東京エネシス	27,000	373	10,071,000	
トーエネック	40,000	401	16,040,000	
住友電設	25,000	400	10,000,000	
日本電設工業	46,000	788	36,248,000	
協和エクシオ	88,000	747	65,736,000	
新日本空調	24,100	380	9,158,000	
日本電話施設	47,000	239	11,233,000	
九電工	49,000	476	23,324,000	
三機工業	60,000	411	24,660,000	
日揮	235,000	2,225	522,875,000	

中外炉工業	75,000	267	20,025,000	
ヤマト	33,000	312	10,296,000	
太平電業	30,000	591	17,730,000	
高砂熱学工業	71,400	601	42,911,400	
三晃金属工業	38,000	374	14,212,000	
NECネットエスアイ	22,400	975	21,840,000	
朝日工業社	35,000	349	12,215,000	
大気社	37,800	1,569	59,308,200	
ダイダン	38,000	493	18,734,000	
日比谷総合設備	35,000	761	26,635,000	
東芝プラントシステム	38,000	853	32,414,000	
東洋エンジニアリング	137,000	319	43,703,000	
千代田化工建設	152,000	970	147,440,000	
新興プランテック	45,000	808	36,360,000	
日本製粉	136,000	364	49,504,000	
日清製粉グループ本社	212,000	990	209,880,000	
日東富士製粉	19,000	288	5,472,000	
昭和産業	89,000	220	19,580,000	
鳥越製粉	20,400	684	13,953,600	
協同飼料	82,000	91	7,462,000	
中部飼料	20,800	535	11,128,000	
日本配合飼料	73,000	100	7,300,000	
東洋精糖	36,000	93	3,348,000	
日本甜菜製糖	130,000	169	21,970,000	
三井製糖	92,000	320	29,440,000	
森永製菓	229,000	178	40,762,000	
中村屋	55,000	368	20,240,000	
江崎グリコ	84,000	863	72,492,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
名糖産業	10,400	992	10,316,800	
不二家	135,000	127	17,145,000	
山崎製パン	171,000	1,026	175,446,000	
第一屋製パン	33,000	89	2,937,000	
モロゾフ	36,000	258	9,288,000	
カルビー	14,000	2,459	34,426,000	
森永乳業	197,000	353	69,541,000	

ヤクルト本社	125,400	2,211	277,259,400
明治ホールディングス	69,200	3,290	227,668,000
雪印メグミルク	45,800	1,487	68,104,600
プリマハム	132,000	96	12,672,000
日本ハム	163,000	1,092	177,996,000
伊藤ハム	129,000	333	42,957,000
丸大食品	103,000	246	25,338,000
米久	20,500	576	11,808,000
S Foods	15,000	677	10,155,000
サッポロホールディングス	332,000	315	104,580,000
アサヒビール	438,700	1,597	700,603,900
キリンホールディングス	939,000	1,102	1,034,778,000
宝ホールディングス	197,000	390	76,830,000
オエノンホールディングス	64,000	181	11,584,000
養命酒製造	18,000	730	13,140,000
三国コカ・コーラボトリング	27,900	701	19,557,900
コカ・コーラウエスト	72,000	1,476	106,272,000
コカ・コーラ セントラル ジャパン	26,400	1,053	27,799,200
ダイドードリンコ	9,700	2,949	28,605,300
伊藤園	70,900	1,418	100,536,200
キーコーヒー	20,500	1,431	29,335,500
ユニカフェ	5,700	372	2,120,400
ジャパンフーズ	3,100	774	2,399,400
日清オイリオグループ	101,000	380	38,380,000
不二製油	56,700	1,193	67,643,100
J - オイルミルズ	87,000	236	20,532,000
キッコーマン	191,000	816	155,856,000
味の素	635,000	953	605,155,000
キューピー	120,900	982	118,723,800
ハウス食品	83,000	1,344	111,552,000
カゴメ	83,900	1,427	119,725,300
焼津水産化学工業	11,100	721	8,003,100
アリアケジャパン	19,200	1,558	29,913,600
ニチレイ	262,000	350	91,700,000
東洋水産	101,000	1,954	197,354,000
日清食品ホールディングス	83,700	2,967	248,337,900
永谷園	21,000	828	17,388,000
フジッコ	25,000	962	24,050,000
ロック・フィールド	11,400	1,212	13,816,800

日本たばこ産業	4,859	314,000	1,525,726,000	
わらべや日洋	13,100	913	11,960,300	
なとり	10,900	789	8,600,100	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ミヨシ油脂	74,000	108	7,992,000	
片倉工業	25,300	830	20,999,000	
ゲンゼ	150,000	264	39,600,000	
川島織物セルコン	82,000	66	5,412,000	
東洋紡績	923,000	112	103,376,000	
ユニチカ	496,000	54	26,784,000	
富士紡ホールディングス	99,000	186	18,414,000	
日清紡ホールディングス	139,000	738	102,582,000	
倉敷紡績	209,000	157	32,813,000	
シキボウ	135,000	87	11,745,000	
日本毛織	75,000	614	46,050,000	
トーア紡コーポレーション	85,000	60	5,100,000	
ダイドーリミテッド	27,100	809	21,923,900	
帝国繊維	24,000	487	11,688,000	
帝人	829,000	360	298,440,000	
東レ	1,691,000	605	1,023,055,000	
サカイオーベックス	63,000	121	7,623,000	
住江織物	61,000	143	8,723,000	
日本フェルト	12,200	384	4,684,800	
イチカワ	14,000	151	2,114,000	
日本バイリーン	24,000	352	8,448,000	
日東製網	29,000	99	2,871,000	
芦森工業	52,000	114	5,928,000	
アツギ	191,000	99	18,909,000	
ダイニック	45,000	132	5,940,000	
セーレン	54,700	486	26,584,200	
東海染工	33,000	88	2,904,000	
小松精練	37,000	339	12,543,000	
ワコールホールディングス	130,000	970	126,100,000	
ホギメディカル	11,600	3,515	40,774,000	
レナウン	43,000	136	5,848,000	
クラウディア	3,000	1,143	3,429,000	

T S Iホールディングス	97,490	513	50,012,370	
三陽商会	107,000	230	24,610,000	
オンワードホールディングス	146,000	622	90,812,000	
ルック	38,000	118	4,484,000	
ゴールドウイン	52,000	255	13,260,000	
デサント	55,000	361	19,855,000	
ヤマトインターナショナル	13,600	347	4,719,200	
特種東海製紙	138,000	152	20,976,000	
王子製紙	965,000	345	332,925,000	
三菱製紙	311,000	76	23,636,000	
北越紀州製紙	135,500	471	63,820,500	
中越パルプ工業	83,000	129	10,707,000	
巴川製紙所	38,000	180	6,840,000	
大王製紙	92,000	558	51,336,000	
日本製紙グループ本社	105,500	1,543	162,786,500	
レンゴー	176,000	510	89,760,000	
トーモク	69,000	202	13,938,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ザ・バック	15,500	1,296	20,088,000	
クラレ	322,500	1,191	384,097,500	
旭化成	1,272,000	529	672,888,000	
共和レザー	13,200	255	3,366,000	
コープケミカル	39,000	101	3,939,000	
昭和電工	1,455,000	166	241,530,000	
住友化学	1,502,000	394	591,788,000	
日本化成	45,000	165	7,425,000	
住友精化	47,000	434	20,398,000	
日産化学工業	155,100	853	132,300,300	
ラサ工業	88,000	135	11,880,000	
クレハ	143,000	361	51,623,000	
テイカ	39,000	284	11,076,000	
片倉チッカリン	18,000	215	3,870,000	
日本曹達	132,000	307	40,524,000	
東ソー	545,000	312	170,040,000	
トクヤマ	340,000	382	129,880,000	
セントラル硝子	209,000	382	79,838,000	

東亜合成	222,000	397	88,134,000	
ダイソー	90,000	276	24,840,000	
関東電化工業	50,000	490	24,500,000	
電気化学工業	459,000	392	179,928,000	
信越化学工業	364,000	4,120	1,499,680,000	
日本カーバイド工業	56,000	186	10,416,000	
堺化学工業	70,000	359	25,130,000	
エア・ウォーター	178,000	949	168,922,000	
大陽日酸	287,000	637	182,819,000	
日本化学工業	85,000	170	14,450,000	
日本パーカライジング	52,000	1,158	60,216,000	
高压ガス工業	34,000	412	14,008,000	
チタン工業	27,000	416	11,232,000	
四国化成工業	33,000	434	14,322,000	
戸田工業	32,000	719	23,008,000	
ステラ ケミファ	9,800	2,839	27,822,200	
保土谷化学工業	51,000	380	19,380,000	
日本触媒	179,000	1,002	179,358,000	
大日精化工業	80,000	363	29,040,000	
カネカ	272,000	531	144,432,000	
三菱瓦斯化学	345,000	590	203,550,000	
三井化学	993,000	266	264,138,000	
J S R	182,400	1,549	282,537,600	
東京応化工業	39,300	1,741	68,421,300	
三菱ケミカルホールディングス	1,268,500	555	704,017,500	
日本合成化学工業	52,000	552	28,704,000	
ダイセル化学工業	284,000	500	142,000,000	
住友ベークライト	204,000	528	107,712,000	
積水化学工業	454,000	650	295,100,000	
日本ゼオン	204,000	685	139,740,000	
アイカ工業	64,100	1,089	69,804,900	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
宇部興産	915,000	246	225,090,000	
積水樹脂	34,000	785	26,690,000	
タキロン	52,000	299	15,548,000	
旭有機材工業	78,000	212	16,536,000	

日立化成工業	94,500	1,634	154,413,000
ニチバン	21,000	269	5,649,000
リケンテクノス	41,000	277	11,357,000
大倉工業	52,000	261	13,572,000
積水化成成品工業	50,000	300	15,000,000
群栄化学工業	62,000	213	13,206,000
タイガースポリマー	11,300	360	4,068,000
日本カーリット	19,100	448	8,556,800
日本化薬	154,000	787	121,198,000
日本精化	19,500	502	9,789,000
A D E K A	87,300	759	66,260,700
日油	186,000	337	62,682,000
ハリマ化成	19,800	718	14,216,400
花王	594,900	2,061	1,226,088,900
第一工業製薬	42,000	237	9,954,000
三洋化成工業	62,000	617	38,254,000
大日本塗料	132,000	93	12,276,000
日本ペイント	189,000	612	115,668,000
関西ペイント	247,000	685	169,195,000
中国塗料	59,000	630	37,170,000
日本特殊塗料	17,300	310	5,363,000
藤倉化成	29,000	405	11,745,000
太陽ホールディングス	16,300	2,267	36,952,100
D I C	834,000	189	157,626,000
サカタインクス	47,000	352	16,544,000
東洋インキS Cホールディングス	198,000	367	72,666,000
富士フイルムホールディングス	466,800	2,372	1,107,249,600
資生堂	362,800	1,412	512,273,600
ライオン	252,000	442	111,384,000
高砂香料工業	74,000	383	28,342,000
マンダム	21,900	2,133	46,712,700
ミルボン	11,600	2,367	27,457,200
ファンケル	42,200	1,062	44,816,400
コーセー	39,300	2,003	78,717,900
ドクターシーラボ	145	366,500	53,142,500
ポーラ・オルビスホールディングス	26,000	1,991	51,766,000
エステー	10,400	842	8,756,800
コニシ	17,800	1,058	18,832,400
長谷川香料	28,200	1,229	34,657,800

小林製薬	30,300	3,885	117,715,500	
荒川化学工業	17,900	675	12,082,500	
メック	16,200	378	6,123,600	
日本高純度化学	64	205,000	13,120,000	
荏原ユーザライト	3,300	2,944	9,715,200	
アース製薬	15,700	2,738	42,986,600	

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	43,000	262	11,266,000	
北興化学工業	24,000	238	5,712,000	
大成ラミック	6,400	2,185	13,984,000	
クミアイ化学工業	48,000	221	10,608,000	
日本農薬	52,000	348	18,096,000	
アキレス	182,000	106	19,292,000	
有沢製作所	34,000	465	15,810,000	
日東電工	180,100	4,185	753,718,500	
レック	5,700	1,223	6,971,100	
アロン化成	17,000	493	8,381,000	
きもと	19,700	778	15,326,600	
藤森工業	15,700	1,082	16,987,400	
前澤化成工業	22,900	738	16,900,200	
J S P	14,700	1,344	19,756,800	
エフピコ	10,800	4,915	53,082,000	
天馬	19,600	799	15,660,400	
信越ポリマー	42,800	405	17,334,000	
東リ	89,000	163	14,507,000	
ニフコ	41,800	2,044	85,439,200	
日本バルカー工業	92,000	224	20,608,000	
ユニ・チャーム	120,700	3,345	403,741,500	
協和発酵キリン	261,000	788	205,668,000	
武田薬品工業	818,600	3,665	3,000,169,000	代用有価証券で 200,000株 担保差入
アステラス製薬	485,100	3,170	1,537,767,000	
大日本住友製薬	154,700	758	117,262,600	
塩野義製薬	318,500	1,352	430,612,000	
田辺三菱製薬	181,900	1,380	251,022,000	
わかもと製薬	23,000	239	5,497,000	

あすか製薬	26,000	577	15,002,000	
日本新薬	50,000	996	49,800,000	
中外製薬	217,600	1,316	286,361,600	
科研製薬	92,000	1,168	107,456,000	
エーザイ	269,000	3,085	829,865,000	
ロート製薬	99,000	871	86,229,000	
小野薬品工業	109,600	4,295	470,732,000	
久光製薬	61,700	3,505	216,258,500	
有機合成薬品工業	19,000	193	3,667,000	
持田製薬	85,000	852	72,420,000	
大正製薬	175,000	1,808	316,400,000	
参天製薬	67,700	3,265	221,040,500	
扶桑薬品工業	73,000	210	15,330,000	
日本ケミファ	33,000	302	9,966,000	
ツムラ	59,600	2,559	152,516,400	
日医工	33,500	1,936	64,856,000	
キッセイ薬品工業	44,200	1,560	68,952,000	
生化学工業	41,800	880	36,784,000	
栄研化学	16,900	1,065	17,998,500	
日水製薬	8,800	659	5,799,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
鳥居薬品	14,900	1,546	23,035,400	
東和薬品	11,100	4,700	52,170,000	
沢井製薬	14,300	8,420	120,406,000	
ゼリア新薬工業	31,000	991	30,721,000	
第一三共	735,000	1,576	1,158,360,000	
キョーリン製薬ホールディングス	58,000	1,571	91,118,000	
大幸薬品	10,800	878	9,482,400	
ダイト	6,100	1,421	8,668,100	
大塚ホールディングス	506,000	2,103	1,064,118,000	
昭和シェル石油	195,300	762	148,818,600	
コスモ石油	604,000	229	138,316,000	
ニチレキ	34,000	361	12,274,000	
東燃ゼネラル石油	330,000	1,006	331,980,000	
ユシロ化学工業	11,300	1,180	13,334,000	
ビービー・カストロール	10,500	332	3,486,000	

AOCホールディングス	56,800	508	28,854,400	
MORESCO	4,500	835	3,757,500	
出光興産	25,900	9,030	233,877,000	
JXホールディングス	2,425,300	530	1,285,409,000	
横浜ゴム	244,000	439	107,116,000	
東洋ゴム工業	182,000	196	35,672,000	
ブリヂストン	684,900	1,848	1,265,695,200	
住友ゴム工業	153,400	980	150,332,000	
藤倉ゴム工業	14,300	293	4,189,900	
オカモト	80,000	295	23,600,000	
フコク	9,300	712	6,621,600	
ニッタ	19,800	1,507	29,838,600	
東海ゴム工業	33,900	963	32,645,700	
三ツ星ベルト	53,000	374	19,822,000	
バンドー化学	78,000	298	23,244,000	
日東紡績	178,000	175	31,150,000	
旭硝子	1,076,000	913	982,388,000	
日本板硝子	937,000	249	233,313,000	
石塚硝子	30,000	135	4,050,000	
日本山村硝子	95,000	195	18,525,000	
日本電気硝子	451,000	1,085	489,335,000	
オハラ	8,600	771	6,630,600	
住友大阪セメント	417,000	209	87,153,000	
太平洋セメント	924,000	150	138,600,000	
デイ・シイ	23,700	210	4,977,000	
日本ヒューム	26,000	298	7,748,000	
日本コンクリート工業	46,000	196	9,016,000	
東海カーボン	204,000	436	88,944,000	
日本カーボン	109,000	220	23,980,000	
東洋炭素	12,100	4,430	53,603,000	
ノリタケカンパニーリミテド	114,000	303	34,542,000	
TOTO	313,000	589	184,357,000	
日本碍子	262,000	1,376	360,512,000	
日本特殊陶業	193,000	1,065	205,545,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
MARUWA	5,000	3,615	18,075,000	

品川リフラクトリーズ	56,000	223	12,488,000	
黒崎播磨	48,000	320	15,360,000	
東京窯業	28,000	164	4,592,000	
ニッカトー	8,400	408	3,427,200	
フジミインコーポレーテッド	20,200	983	19,856,600	
ニチアス	118,000	442	52,156,000	
ニチハ	30,400	657	19,972,800	
新日本製鐵	5,733,000	234	1,341,522,000	
住友金属工業	4,048,000	163	659,824,000	
神戸製鋼所	3,027,000	166	502,482,000	
日新製鋼	838,000	146	122,348,000	
中山製鋼所	111,000	103	11,433,000	
合同製鐵	122,000	192	23,424,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	517,500	1,948	1,008,090,000	
東京製鐵	120,600	800	96,480,000	
共英製鋼	23,300	1,204	28,053,200	
大和工業	49,900	2,430	121,257,000	
東京鐵鋼	46,000	208	9,568,000	
大阪製鐵	13,700	1,521	20,837,700	
淀川製鋼所	167,000	321	53,607,000	
東洋鋼鈑	52,000	336	17,472,000	
住友鋼管	14,800	515	7,622,000	
丸一鋼管	73,100	2,020	147,662,000	
モリ工業	36,000	304	10,944,000	
大同特殊鋼	366,000	497	181,902,000	
日本高周波鋼業	86,000	106	9,116,000	
日本金属工業	168,000	86	14,448,000	
日本冶金工業	112,500	211	23,737,500	
山陽特殊製鋼	108,000	497	53,676,000	
愛知製鋼	116,000	535	62,060,000	
日立金属	142,000	1,098	155,916,000	
日本金属	56,000	167	9,352,000	
大平洋金属	152,000	575	87,400,000	
日本電工	86,000	503	43,258,000	
栗本鐵工所	113,000	163	18,419,000	
日本鑄鉄管	23,000	182	4,186,000	
三菱製鋼	132,000	257	33,924,000	
日亜鋼業	30,000	189	5,670,000	
日本精線	17,000	404	6,868,000	

シンニッタン	21,200	316	6,699,200	
新家工業	94,000	120	11,280,000	
日本軽金属	494,000	151	74,594,000	
大紀アルミニウム工業所	34,000	203	6,902,000	
三井金属鉱業	631,000	250	157,750,000	
東邦亜鉛	123,000	374	46,002,000	
三菱マテリアル	1,363,000	238	324,394,000	
住友金属鉱山	603,000	1,239	747,117,000	
DOWAホールディングス	261,000	475	123,975,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
古河機械金属	367,000	78	28,626,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,800	6,100	145,180,000	
東邦チタニウム	35,400	2,473	87,544,200	
住友軽金属工業	364,000	77	28,028,000	
古河スカイ	88,000	262	23,056,000	
古河電気工業	687,000	315	216,405,000	
住友電気工業	771,600	1,131	872,679,600	
フジクラ	327,000	349	114,123,000	
昭和電線ホールディングス	292,000	96	28,032,000	
タツタ電線	49,000	448	21,952,000	
日立電線	186,000	200	37,200,000	
沖電線	23,000	168	3,864,000	
カナレ電気	2,400	1,289	3,093,600	
平河ヒューテック	4,200	630	2,646,000	
リョービ	123,000	318	39,114,000	
アサヒホールディングス	30,500	1,625	49,562,500	
稲葉製作所	11,100	867	9,623,700	
トーカロ	11,300	1,690	19,097,000	
アルファC o	6,800	980	6,664,000	
SUMCO	133,600	1,352	180,627,200	
川田テクノロジーズ	6,900	1,250	8,625,000	
東洋製罐	154,400	1,203	185,743,200	
ホッカンホールディングス	53,000	227	12,031,000	
コロナ	10,700	852	9,116,400	
横河ブリッジホールディングス	44,000	482	21,208,000	
駒井ハルテック	53,000	192	10,176,000	

高田機工	34,000	179	6,086,000	
三和ホールディングス	241,000	266	64,106,000	
文化シャッター	84,000	211	17,724,000	
東洋シャッター	22,900	308	7,053,200	
住生活グループ	263,700	1,931	509,204,700	
日本ファイルコン	16,300	358	5,835,400	
ノーリツ	43,900	1,506	66,113,400	
長府製作所	21,000	1,923	40,383,000	
リンナイ	35,100	5,790	203,229,000	
ダイニチ工業	12,100	656	7,937,600	
日東精工	32,000	208	6,656,000	
三洋工業	73,000	144	10,512,000	
岡部	60,000	420	25,200,000	
中国工業	90,000	95	8,550,000	
東プレ	42,300	714	30,202,200	
高周波熱錬	29,300	620	18,166,000	
東京製綱	158,000	330	52,140,000	
パイオラックス	9,400	1,754	16,487,600	
日本発條	158,000	775	122,450,000	
中央発條	29,000	275	7,975,000	
三益半導体工業	18,400	883	16,247,200	
アタカ大機	16,000	268	4,288,000	
日本製鋼所	337,000	560	188,720,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日立ツール	13,200	861	11,365,200	
三浦工業	35,400	2,252	79,720,800	
タクマ	80,000	436	34,880,000	
ツガミ	63,000	442	27,846,000	
オークマ	143,000	678	96,954,000	
東芝機械	131,000	387	50,697,000	
アマダ	308,000	587	180,796,000	
アイダエンジニアリング	58,100	346	20,102,600	
牧野フライス製作所	102,000	701	71,502,000	
オーエスジー	96,200	1,002	96,392,400	
ダイジェット工業	30,000	137	4,110,000	
旭ダイヤモンド工業	46,000	1,772	81,512,000	

森精機製作所	115,100	1,002	115,330,200	
ディスコ	22,000	5,100	112,200,000	
日東工器	13,000	1,862	24,206,000	
豊和工業	121,000	77	9,317,000	
大阪機工	80,000	103	8,240,000	
東洋機械金属	19,700	210	4,137,000	
津田駒工業	56,000	186	10,416,000	
島精機製作所	28,700	2,205	63,283,500	
日阪製作所	28,000	881	24,668,000	
やまびこ	8,600	845	7,267,000	
ベガサスミシン製造	23,800	226	5,378,800	
ナプテスコ	82,400	1,818	149,803,200	
三井海洋開発	18,000	1,306	23,508,000	
レオン自動機	23,000	169	3,887,000	
S M C	65,200	13,320	868,464,000	
新川	15,600	640	9,984,000	
ホソカワミクロン	35,000	391	13,685,000	
ユニオンツール	13,800	1,684	23,239,200	
オイレス工業	22,100	1,477	32,641,700	
サトー	20,800	1,008	20,966,400	
日本エアーテック	7,900	371	2,930,900	
日精樹脂工業	19,700	241	4,747,700	
ワイエイシー	9,400	1,023	9,616,200	
小松製作所	1,035,400	2,276	2,356,570,400	
住友重機械工業	557,000	551	306,907,000	
日立建機	97,600	1,663	162,308,800	
日工	30,000	279	8,370,000	
巴工業	8,300	1,681	13,952,300	
井関農機	223,000	172	38,356,000	
T O W A	21,100	477	10,064,700	
丸山製作所	49,000	166	8,134,000	
北川鉄工所	100,000	136	13,600,000	
クボタ	916,000	685	627,460,000	
荏原実業	5,200	1,260	6,552,000	
三菱化工機	67,000	187	12,529,000	
月島機械	35,000	673	23,555,000	
帝国電機製作所	7,700	1,699	13,082,300	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
東京機械製作所	72,000	66	4,752,000	
新東工業	44,700	802	35,849,400	
澁谷工業	13,000	801	10,413,000	
アイチ コーポレーション	36,000	390	14,040,000	
小森コーポレーション	58,300	715	41,684,500	
鶴見製作所	17,000	579	9,843,000	
住友精密工業	39,000	761	29,679,000	
酒井重工業	41,000	146	5,986,000	
荏原製作所	383,000	455	174,265,000	
石井鐵工所	32,000	180	5,760,000	
西島製作所	25,600	1,091	27,929,600	
ダイキン工業	227,900	2,826	644,045,400	
オルガノ	38,000	617	23,446,000	
トーヨーカネツ	117,000	192	22,464,000	
栗田工業	120,500	2,331	280,885,500	
椿本チエイン	112,000	435	48,720,000	
大同工業	46,000	154	7,084,000	
日本コンベヤ	67,000	79	5,293,000	
木村化工機	20,000	320	6,400,000	
アネスト岩田	39,000	396	15,444,000	
ダイフク	88,500	452	40,002,000	
加藤製作所	49,000	217	10,633,000	
油研工業	42,000	217	9,114,000	
タダノ	92,000	431	39,652,000	
フジテック	61,000	418	25,498,000	
シーケーディ	58,800	716	42,100,800	
キトー	69	70,100	4,836,900	
平和	45,300	1,238	56,081,400	
理想科学工業	16,300	1,163	18,956,900	
SANKYO	63,200	4,205	265,756,000	
日本金銭機械	19,200	613	11,769,600	
マースエンジニアリング	10,300	1,238	12,751,400	
福島工業	6,400	878	5,619,200	
オーイズミ	7,300	208	1,518,400	
ダイコク電機	8,600	777	6,682,200	
アマノ	58,000	743	43,094,000	
サンデン	119,000	369	43,911,000	

マックス	37,000	1,008	37,296,000
グローリー	57,800	1,718	99,300,400
大和冷機工業	30,000	395	11,850,000
セガサミーホールディングス	207,000	1,592	329,544,000
日本ピストンリング	82,000	165	13,530,000
リケン	83,000	343	28,469,000
帝国ピストンリング	25,600	925	23,680,000
ホシザキ電機	42,000	1,721	72,282,000
大豊工業	14,900	695	10,355,500
日本精工	464,000	766	355,424,000
NTN	483,000	433	209,139,000
ジェイテクト	221,700	1,129	250,299,300

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
不二越	210,000	449	94,290,000	
日本トムソン	72,000	656	47,232,000	
THK	138,800	1,994	276,767,200	
ユーション精機	10,800	1,592	17,193,600	
前澤給装工業	13,500	1,122	15,147,000	
イーグル工業	26,000	960	24,960,000	
前澤工業	15,300	254	3,886,200	
日本ピラー工業	23,000	609	14,007,000	
キッツ	86,300	429	37,022,700	
日立工機	56,600	707	40,016,200	
マキタ	136,100	3,440	468,184,000	
日立造船	877,000	116	101,732,000	
三菱重工業	3,497,000	394	1,377,818,000	
IHI	1,426,000	192	273,792,000	
イビデン	127,100	2,506	318,512,600	
コニカミノルタホールディングス	551,000	652	359,252,000	
ブラザー工業	269,700	1,093	294,782,100	
ミネベア	310,000	389	120,590,000	
日立製作所	4,686,000	464	2,174,304,000	
東芝	4,118,000	410	1,688,380,000	
三菱電機	2,087,000	889	1,855,343,000	
富士電機	629,000	243	152,847,000	
東洋電機製造	36,000	359	12,924,000	

安川電機	229,000	865	198,085,000	
シンフォニアテクノロジー	125,000	245	30,625,000	
明電舎	206,000	335	69,010,000	
オリジン電気	28,000	348	9,744,000	
デンヨー	19,700	957	18,852,900	
東芝テック	131,000	350	45,850,000	
芝浦メカトロニクス	37,000	320	11,840,000	
マブチモーター	28,400	3,965	112,606,000	
日本電産	103,400	7,270	751,718,000	
高岳製作所	83,000	224	18,592,000	
ダイヘン	114,000	305	34,770,000	
JVC・ケンウッド・ホールディングス	99,300	391	38,826,300	
第一精工	5,700	3,190	18,183,000	
日新電機	35,000	743	26,005,000	
大崎電気工業	30,000	755	22,650,000	
オムロン	232,400	2,044	475,025,600	
日東工業	31,400	842	26,438,800	
I D E C	25,000	922	23,050,000	
エルピーダメモリ	185,400	1,000	185,400,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	402,000	512	205,824,000	
サクサホールディングス	64,000	126	8,064,000	
メルコホールディングス	12,200	2,004	24,448,800	
テクノメディカ	16	296,000	4,736,000	
日本電気	2,700,000	162	437,400,000	
富士通	2,012,000	443	891,316,000	
沖電気工業	781,000	67	52,327,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
岩崎通信機	91,000	79	7,189,000	
電気興業	68,000	327	22,236,000	
サンケン電気	122,000	465	56,730,000	
ナカヨ通信機	29,000	174	5,046,000	
アイホン	13,500	1,264	17,064,000	
ルネサスエレクトロニクス	54,100	722	39,060,200	
セイコーエプソン	142,400	1,300	185,120,000	
ワコム	425	93,700	39,822,500	
アルバック	38,700	2,134	82,585,800	

アクセル	9,600	1,512	14,515,200
ナナオ	17,700	1,540	27,258,000
日本信号	48,600	590	28,674,000
京三製作所	45,000	441	19,845,000
能美防災	28,000	440	12,320,000
ホーチキ	19,000	352	6,688,000
マスプロ電工	16,600	595	9,877,000
日本無線	70,000	223	15,610,000
パナソニック	2,429,800	924	2,245,135,200
シャープ	936,000	723	676,728,000
アンリツ	91,000	674	61,334,000
富士通ゼネラル	50,000	523	26,150,000
日立国際電気	50,000	642	32,100,000
ソニー	1,171,700	2,024	2,371,520,800
T D K	117,500	4,330	508,775,000
帝国通信工業	49,000	141	6,909,000
ミツミ電機	73,700	793	58,444,100
タムラ製作所	63,000	269	16,947,000
アルプス電気	164,700	808	133,077,600
パイオニア	295,800	335	99,093,000
日本電波工業	16,100	1,115	17,951,500
日本トリム	2,700	1,867	5,040,900
ローランド ディー . ジー .	10,400	1,117	11,616,800
フォスター電機	19,800	1,573	31,145,400
クラリオン	111,000	142	15,762,000
S M K	61,000	312	19,032,000
ヨコオ	17,800	452	8,045,600
東光	88,000	199	17,512,000
ティアック	115,000	35	4,025,000
ホシデン	51,800	705	36,519,000
ヒロセ電機	33,700	7,930	267,241,000
日本航空電子工業	48,000	542	26,016,000
T O A	25,000	465	11,625,000
アルパイン	40,800	1,091	44,512,800
スミダコーポレーション	12,900	723	9,326,700
アイコム	12,200	1,993	24,314,600
船井電機	18,800	2,316	43,540,800
横河電機	209,100	658	137,587,800
新電元工業	74,000	349	25,826,000

山武	58,400	1,738	101,499,200	
----	--------	-------	-------------	--

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日本光電工業	38,500	1,902	73,227,000	
チノー	40,000	217	8,680,000	
共和電業	22,000	273	6,006,000	
日本電子材料	8,900	450	4,005,000	
堀場製作所	35,800	2,459	88,032,200	
アドバンテスト	142,200	1,448	205,905,600	
小野測器	23,000	217	4,991,000	
エスベック	21,600	543	11,728,800	
パナソニック電工SUNX	18,300	449	8,216,700	
キーエンス	46,600	21,750	1,013,550,000	
日置電機	10,000	1,649	16,490,000	
シスメックス	73,400	2,896	212,566,400	
メガチップス	18,700	1,337	25,001,900	
OBARA	15,500	1,028	15,934,000	
日本電産コパル電子	21,500	517	11,115,500	
ミヤチテクノス	11,000	620	6,820,000	
東京電波	6,100	610	3,721,000	
澤藤電機	13,000	251	3,263,000	
コーセル	30,300	1,291	39,117,300	
日立メディコ	15,000	939	14,085,000	
新日本無線	15,000	200	3,000,000	
オブテックス	14,300	1,040	14,872,000	
千代田インテグレ	10,100	994	10,039,400	
東光電気	13,000	332	4,316,000	
スタンレー電気	141,000	1,323	186,543,000	
岩崎電気	76,000	271	20,596,000	
ウシオ電機	126,700	1,577	199,805,900	
岡谷電機産業	11,100	401	4,451,100	
ヘリオス テクノ ホールディング	20,100	201	4,040,100	
日本セラミック	13,600	1,667	22,671,200	
新神戸電機	17,000	1,207	20,519,000	
日本デジタル研究所	17,700	923	16,337,100	
古河電池	15,000	567	8,505,000	
双信電機	10,100	379	3,827,900	

山一電機	21,100	264	5,570,400	
図研	14,700	577	8,481,900	
日本電子	77,000	249	19,173,000	
カシオ計算機	198,900	546	108,599,400	
ファナック	217,300	12,070	2,622,811,000	
日本シイエムケイ	40,900	273	11,165,700	
エンプラス	10,700	1,000	10,700,000	
ローム	104,600	4,480	468,608,000	
浜松ホトニクス	81,400	3,375	274,725,000	
三井ハイテック	24,800	357	8,853,600	
新光電気工業	52,500	757	39,742,500	
京セラ	173,500	8,280	1,436,580,000	
太陽誘電	94,000	1,058	99,452,000	
村田製作所	218,900	5,110	1,118,579,000	
ユーシン	25,200	602	15,170,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
双葉電子工業	35,700	1,412	50,408,400	
北陸電気工業	84,000	154	12,936,000	
ニチコン	65,700	1,318	86,592,600	
日本ケミコン	129,000	502	64,758,000	
K O A	26,200	849	22,243,800	
市光工業	51,000	156	7,956,000	
小糸製作所	104,000	1,227	127,608,000	
ミツバ	39,000	611	23,829,000	
スター精密	39,700	879	34,896,300	
大日本スクリーン製造	230,000	689	158,470,000	
キヤノン電子	19,100	2,077	39,670,700	
キヤノン	1,296,200	3,765	4,880,193,000	
リコー	627,000	865	542,355,000	
日本電産サンキョー	50,000	530	26,500,000	
M U T O Hホールディングス	25,000	170	4,250,000	
東京エレクトロン	163,800	4,390	719,082,000	
トヨタ紡織	73,000	1,226	89,498,000	
鬼怒川ゴム工業	53,000	468	24,804,000	
ユニプレス	30,200	1,845	55,719,000	
豊田自動織機	190,000	2,430	461,700,000	

モリタホールディングス	36,000	472	16,992,000	
三櫻工業	24,300	615	14,944,500	
デンソー	458,200	2,846	1,304,037,200	
東海理化電機製作所	48,800	1,482	72,321,600	
三井造船	808,000	169	136,552,000	
佐世保重工業	136,000	136	18,496,000	
川崎重工業	1,624,000	293	475,832,000	
日本車輛製造	76,000	320	24,320,000	
日本輸送機	24,000	194	4,656,000	
近畿車輛	31,000	297	9,207,000	
日産自動車	2,636,100	793	2,090,427,300	
いすゞ自動車	1,209,000	353	426,777,000	
トヨタ自動車	2,680,800	3,300	8,846,640,000	代用有価証券で 500,000株 担保差入
日野自動車	261,000	447	116,667,000	
三菱自動車工業	4,306,000	94	404,764,000	
エフテック	7,400	1,167	8,635,800	
武蔵精密工業	20,300	1,937	39,321,100	
トヨタ車体	38,000	1,247	47,386,000	
日産車体	82,000	593	48,626,000	
関東自動車工業	32,000	606	19,392,000	
新明和工業	93,000	295	27,435,000	
極東開発工業	38,800	418	16,218,400	
日信工業	42,500	1,325	56,312,500	
トピー工業	172,000	208	35,776,000	
ティラド	75,000	346	25,950,000	
曙ブレーキ工業	97,300	398	38,725,400	
タチエス	27,300	1,345	36,718,500	
NOK	101,000	1,350	136,350,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
フタバ産業	59,300	489	28,997,700	
カヤバ工業	130,000	540	70,200,000	
シロキ工業	47,000	255	11,985,000	
大同メタル工業	32,000	799	25,568,000	
プレス工業	96,000	349	33,504,000	
カルソニックカンセイ	107,000	427	45,689,000	

太平洋工業	43,000	362	15,566,000
ケーヒン	43,100	1,622	69,908,200
河西工業	26,000	419	10,894,000
アイシン精機	171,800	2,924	502,343,200
富士機工	25,000	274	6,850,000
マツダ	1,615,000	194	313,310,000
ダイハツ工業	221,000	1,278	282,438,000
愛知機械工業	48,000	266	12,768,000
今仙電機製作所	14,300	1,014	14,500,200
本田技研工業	1,760,500	2,985	5,255,092,500
スズキ	436,200	1,731	755,062,200
富士重工業	659,000	571	376,289,000
ヤマハ発動機	317,300	1,415	448,979,500
ショーワ	44,600	556	24,797,600
T B K	21,000	387	8,127,000
エクセディ	25,300	2,717	68,740,100
豊田合成	59,000	1,695	100,005,000
愛三工業	25,400	757	19,227,800
ヨロズ	12,600	1,629	20,525,400
エフ・シー・シー	30,800	1,875	57,750,000
シマノ	85,100	4,110	349,761,000
タカタ	32,400	2,268	73,483,200
テイ・エス テック	39,800	1,352	53,809,600
日本電産トーソク	12,700	888	11,277,600
テルモ	164,000	4,385	719,140,000
クリエートメディック	6,300	794	5,002,200
日機装	73,000	697	50,881,000
島津製作所	249,000	721	179,529,000
J M S	31,000	262	8,122,000
クボテック	45	36,250	1,631,250
モリテックス	4,500	422	1,899,000
長野計器	13,700	645	8,836,500
バイ・テクノロジー	30	679,000	20,370,000
東京計器	72,000	111	7,992,000
愛知時計電機	45,000	260	11,700,000
東京精密	40,100	1,623	65,082,300
ニコン	363,600	1,925	699,930,000
トプコン	48,000	455	21,840,000
オリンパス	246,100	2,614	643,305,400

理研計器	16,900	663	11,204,700	
タムロン	20,400	1,915	39,066,000	
H O Y A	479,200	1,721	824,703,200	
ノーリツ鋼機	18,900	439	8,297,100	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
エー・アンド・デイ	20,300	355	7,206,500	
日本電産コパル	16,300	931	15,175,300	
シチズンホールディングス	227,000	428	97,156,000	
リズム時計工業	108,000	112	12,096,000	
大研医器	3,100	884	2,740,400	
セイコーホールディングス	111,000	241	26,751,000	
ニプロ	41,400	1,469	60,816,600	
S R I スポーツ	138	86,800	11,978,400	
バンダイナムコホールディングス	233,200	956	222,939,200	
共立印刷	25,900	146	3,781,400	
フランスベッドホールディングス	145,000	100	14,500,000	
パイロットコーポレーション	197	151,000	29,747,000	
トッパン・フォームズ	45,100	617	27,826,700	
フジシールインターナショナル	21,400	1,563	33,448,200	
タカラトミー	63,300	699	44,246,700	
廣済堂	17,100	225	3,847,500	
タカノ	9,300	469	4,361,700	
プロネクサス	23,500	373	8,765,500	
ウッドワン	51,000	288	14,688,000	
大建工業	106,000	252	26,712,000	
凸版印刷	589,000	596	351,044,000	
大日本印刷	635,000	882	560,070,000	
図書印刷	36,000	129	4,644,000	
共同印刷	66,000	184	12,144,000	
日本写真印刷	37,900	1,450	54,955,000	
光村印刷	21,000	235	4,935,000	
宝印刷	12,100	576	6,969,600	
アシックス	194,000	1,145	222,130,000	
ツツミ	9,400	1,914	17,991,600	
ローランド	20,500	803	16,461,500	
小松ウオール工業	8,500	728	6,188,000	

ヤマハ	166,100	893	148,327,300
河合楽器製作所	81,000	144	11,664,000
クリナップ	32,400	457	14,806,800
ビジョン	14,500	2,720	39,440,000
パラマウントベッド	16,700	2,169	36,222,300
キングジム	17,500	646	11,305,000
リンテック	44,600	2,386	106,415,600
イトーキ	46,900	170	7,973,000
任天堂	119,300	16,310	1,945,783,000
三菱鉛筆	17,700	1,452	25,700,400
タカラスタナード	106,000	566	59,996,000
コクヨ	108,400	580	62,872,000
ナカバヤシ	47,000	154	7,238,000
グロープライド	99,000	84	8,316,000
岡村製作所	81,000	463	37,503,000
美津濃	105,000	356	37,380,000
ユニハアー	24,100	893	21,521,300

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
東京電力	1,536,000	190	291,840,000	代用有価証券で 300,000株 担保差入
中部電力	638,500	1,149	733,636,500	
関西電力	851,500	1,180	1,004,770,000	
中国電力	288,500	1,050	302,925,000	
北陸電力	204,400	1,235	252,434,000	
東北電力	521,300	804	419,125,200	
四国電力	206,900	1,538	318,212,200	
九州電力	460,800	1,096	505,036,800	
北海道電力	195,300	1,086	212,095,800	
沖縄電力	12,500	3,230	40,375,000	
電源開発	129,500	1,870	242,165,000	
東京瓦斯	2,609,000	361	941,849,000	
大阪瓦斯	2,025,000	296	599,400,000	
東邦瓦斯	537,000	406	218,022,000	
北海道瓦斯	41,000	262	10,742,000	
西部瓦斯	235,000	179	42,065,000	
静岡瓦斯	54,500	430	23,435,000	

東武鉄道	1,087,000	320	347,840,000	
相鉄ホールディングス	375,000	216	81,000,000	
東京急行電鉄	1,146,000	320	366,720,000	
京浜急行電鉄	536,000	534	286,224,000	
小田急電鉄	669,000	614	410,766,000	
京王電鉄	541,000	422	228,302,000	
京成電鉄	335,000	442	148,070,000	
富士急行	57,000	412	23,484,000	
新京成電鉄	27,000	345	9,315,000	
東日本旅客鉄道	362,800	4,575	1,659,810,000	
西日本旅客鉄道	1,944	306,000	594,864,000	
東海旅客鉄道	1,811	610,000	1,104,710,000	
西日本鉄道	270,000	344	92,880,000	
ハマキョウレックス	6,000	2,453	14,718,000	
サカイ引越センター	3,800	1,634	6,209,200	
近畿日本鉄道	1,885,000	245	461,825,000	
阪急阪神ホールディングス	1,400,000	305	427,000,000	
南海電気鉄道	435,000	303	131,805,000	
京阪電気鉄道	467,000	342	159,714,000	
名糖運輸	7,800	558	4,352,400	
名古屋鉄道	728,000	201	146,328,000	
日本通運	826,000	316	261,016,000	
ヤマトホールディングス	424,600	1,234	523,956,400	
山九	254,000	359	91,186,000	
丸運	11,300	191	2,158,300	
丸全昭和運輸	70,000	246	17,220,000	
センコー	84,000	259	21,756,000	
トナミホールディングス	43,000	143	6,149,000	
日本梱包運輸倉庫	63,000	782	49,266,000	
日本石油輸送	24,000	203	4,872,000	
福山通運	145,000	419	60,755,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
セイノーホールディングス	161,000	559	89,999,000	
神奈川中央交通	24,000	401	9,624,000	
日立物流	36,200	1,319	47,747,800	
日本郵船	1,763,000	293	516,559,000	

商船三井	1,016,000	413	419,608,000
川崎汽船	645,000	265	170,925,000
N S ユナイテッド海運	75,000	147	11,025,000
乾汽船	24,800	373	9,250,400
明治海運	18,700	256	4,787,200
飯野海運	100,800	351	35,380,800
共栄タンカー	17,000	146	2,482,000
第一中央汽船	137,000	140	19,180,000
全日本空輸	2,781,000	245	681,345,000
パスコ	25,000	285	7,125,000
国際航業ホールディングス	15,000	314	4,710,000
日新	79,000	193	15,247,000
三菱倉庫	148,000	853	126,244,000
三井倉庫	97,000	294	28,518,000
住友倉庫	152,000	361	54,872,000
澁澤倉庫	54,000	260	14,040,000
東陽倉庫	33,000	169	5,577,000
日本トランスシティ	44,000	246	10,824,000
ケイヒン	38,000	85	3,230,000
安田倉庫	17,700	452	8,000,400
東洋埠頭	60,000	130	7,800,000
宇徳	15,100	191	2,884,100
上組	231,000	721	166,551,000
サンリツ	5,400	574	3,099,600
キムラユニティー	4,700	661	3,106,700
キューソー流通システム	6,600	845	5,577,000
郵船ロジスティクス	16,400	1,328	21,779,200
近鉄エクスプレス	18,700	2,512	46,974,400
東海運	11,200	183	2,049,600
バンテック	24	121,100	2,906,400
システナ	206	71,000	14,626,000
新日鉄ソリューションズ	17,200	1,424	24,492,800
コア	7,800	612	4,773,600
デジタルハーツ	15	129,000	1,935,000
ITホールディングス	68,400	679	46,443,600
グリー	89,100	1,899	169,200,900
コーエーテクモホールディングス	40,700	622	25,315,400
三菱総合研究所	8,000	1,415	11,320,000
ドワンゴ	103	171,000	17,613,000

ベリサーブ	13	124,800	1,622,400	
マクロミル	25,200	776	19,555,200	
ティーガイア	167	147,800	24,682,600	
GMOペイメントゲートウェイ	45	265,100	11,929,500	
ザッパラス	114	98,600	11,240,400	
インターネットイニシアティブ	121	308,000	37,268,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ソネットエンタテインメント	116	335,000	38,860,000	
SRAホールディングス	11,000	748	8,228,000	
JBI Sホールディングス	21,600	267	5,767,200	
朝日ネット	17,000	310	5,270,000	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	4,200	2,246	9,433,200	
フェイス	706	12,270	8,662,620	
野村総合研究所	116,600	1,665	194,139,000	
サイバネットシステム	172	20,690	3,558,680	
インテージ	6,200	1,676	10,391,200	
シンプレクス・ホールディングス	350	31,350	10,972,500	
クレスコ	6,200	545	3,379,000	
フジ・メディア・ホールディングス	2,145	106,100	227,584,500	
オービック	7,100	14,400	102,240,000	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	4,600	687	3,160,200	
ヤフー	15,078	27,100	408,613,800	
トレンドマイクロ	90,900	2,541	230,976,900	
日本オラクル	32,900	3,440	113,176,000	
アルファシステムズ	5,700	1,169	6,663,300	
フューチャーアーキテクト	250	34,300	8,575,000	
シーエーシー	12,700	655	8,318,500	
ソフトバンク・テクノロジー	5,000	585	2,925,000	
トーセ	5,000	503	2,515,000	
オービックビジネスコンサルタント	5,250	4,825	25,331,250	
日立ビジネスソリューション	6,600	652	4,303,200	
伊藤忠テクノソリューションズ	29,300	2,668	78,172,400	
アイティフォー	23,300	267	6,221,100	
東計電算	3,700	1,030	3,811,000	

エックスネット	19	121,800	2,314,200	
大塚商会	16,400	4,795	78,638,000	
サイボウズ	279	16,040	4,475,160	
アグレックス	4,900	753	3,689,700	
電通国際情報サービス	12,800	486	6,220,800	
ウェザーニューズ	6,300	2,040	12,852,000	
C I J	20,800	277	5,761,600	
WOWOW	64	139,700	8,940,800	
ネットワンシステムズ	512	149,300	76,441,600	
アルゴグラフィックス	9,000	982	8,838,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	39,400	1,030	40,582,000	
日本ユニシス	57,000	433	24,681,000	
兼松エレクトロニクス	14,900	829	12,352,100	
東京放送ホールディングス	111,000	939	104,229,000	
日本テレビ放送網	18,080	10,830	195,806,400	
テレビ朝日	522	112,400	58,672,800	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,566	30,450	47,684,700	
テレビ東京ホールディングス	9,400	960	9,024,000	
アイ・ティー・シーネットワーク	17,400	468	8,143,200	
イー・アクセス	1,122	36,450	40,896,900	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
NECモバイルング	7,600	2,659	20,208,400	
日本電信電話	773,400	3,895	3,012,393,000	
KDDI	3,196	590,000	1,885,640,000	
光通信	26,500	1,848	48,972,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	16,969	147,300	2,499,533,700	
GMOインターネット	58,600	340	19,924,000	
学研ホールディングス	62,000	131	8,122,000	
ゼンリン	29,800	755	22,499,000	
昭文社	12,500	561	7,012,500	
角川グループホールディングス	19,500	2,556	49,842,000	
インプレスホールディングス	17,700	108	1,911,600	
アイネット	10,100	449	4,534,900	
松竹	126,000	630	79,380,000	
東宝	134,700	1,274	171,607,800	
東映	88,000	340	29,920,000	

葵プロモーション	10,000	416	4,160,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,454	243,300	353,758,200	
D T S	19,700	761	14,991,700	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	67,300	1,268	85,336,400	
シーイーシー	13,600	375	5,100,000	
カブコン	43,900	1,758	77,176,200	
ジャステック	12,100	467	5,650,700	
住商情報システム	21,200	1,256	26,627,200	
C S K	87,600	289	25,316,400	
日本システムウエア	8,000	298	2,384,000	
アイネス	28,200	523	14,748,600	
T K C	17,400	1,728	30,067,200	
富士ソフト	27,900	1,108	30,913,200	
N S D	39,900	703	28,049,700	
コナミ	94,900	1,832	173,856,800	
福井コンピュータ	4,100	428	1,754,800	
J B C Cホールディングス	17,200	513	8,823,600	
ソフトバンク	911,800	3,050	2,780,990,000	
ハウスイ	18,000	85	1,530,000	
インターニックス	8,300	328	2,722,400	
高千穂交易	8,500	819	6,961,500	
伊藤忠食品	5,100	2,690	13,719,000	
エレマテック	16,400	1,016	16,662,400	
J A L U X	10,000	701	7,010,000	
トーマンデバイス	2,600	1,900	4,940,000	
東京エレクトロン デバイス	41	146,800	6,018,800	
双日	1,378,500	142	195,747,000	
アルフレッサ ホールディングス	53,900	2,987	160,999,300	
横浜冷凍	47,800	522	24,951,600	
神栄	27,000	133	3,591,000	
山下医科器械	1,700	1,020	1,734,000	
ラサ商事	17,800	329	5,856,200	
アルコニックス	5,700	2,140	12,198,000	
あい ホールディングス	36,900	338	12,472,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ダイワボウホールディングス	200,000	155	31,000,000	

バイタルケーエスケー・ホールディングス	38,700	618	23,916,600
UKCホールディングス	12,200	787	9,601,400
TOKAIホールディングス	100,600	400	40,240,000
日本コークス工業	179,500	129	23,155,500
ミタチ産業	4,800	400	1,920,000
JFE商事ホールディングス	147,000	352	51,744,000
シップヘルスケアホールディングス	26,700	1,481	39,542,700
ソフトクリエイト	1,800	1,121	2,017,800
協栄産業	23,000	147	3,381,000
小野建	17,900	677	12,118,300
佐鳥電機	15,100	489	7,383,900
エコトレーディング	5,100	717	3,656,700
伯東	12,500	753	9,412,500
コンドーテック	13,600	979	13,314,400
中山福	12,800	599	7,667,200
ナガイレーベン	13,700	2,143	29,359,100
菱食	20,000	1,769	35,380,000
松田産業	17,300	1,163	20,119,900
メディパルホールディングス	190,100	703	133,640,300
アドヴァン	21,300	665	14,164,500
SPK	4,600	1,231	5,662,600
アズワン	13,500	1,675	22,612,500
スズデン	7,800	451	3,517,800
尾家産業	6,700	751	5,031,700
シモジマ	14,100	992	13,987,200
ドウシシャ	11,400	1,890	21,546,000
高速	12,200	551	6,722,200
黒田電気	27,500	861	23,677,500
丸文	16,400	376	6,166,400
ハピネット	5,500	934	5,137,000
トーマンエレクトロニクス	8,400	979	8,223,600
エクセル	10,000	812	8,120,000
マルカキカイ	7,600	590	4,484,000
ガリバーインターナショナル	5,590	2,914	16,289,260
日本エム・ディ・エム	17,200	192	3,302,400
進和	12,800	890	11,392,000
エスケイジャパン	7,300	238	1,737,400
ダイトエレクトロン	8,700	704	6,124,800
シークス	13,100	1,231	16,126,100

田中商事	21,600	507	10,951,200	
オーハシテクニカ	11,700	543	6,353,100	
マクニカ	9,400	1,765	16,591,000	
白銅	6,700	779	5,219,300	
伊藤忠商事	1,437,600	811	1,165,893,600	
丸紅	1,802,000	535	964,070,000	
高島	36,000	246	8,856,000	
F & A アクアホールディングス	16,500	749	12,358,500	
長瀬産業	116,600	946	110,303,600	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
蝶理	141,000	97	13,677,000	
豊田通商	229,400	1,322	303,266,800	
三共生興	35,700	250	8,925,000	
ツカモトコーポレーション	39,000	83	3,237,000	
三井物産	1,777,700	1,312	2,332,342,400	
日本紙パルプ商事	117,000	278	32,526,000	
日立ハイテクノロジーズ	62,500	1,722	107,625,000	
カメイ	26,000	308	8,008,000	
東都水産	35,000	117	4,095,000	
スターゼン	69,000	226	15,594,000	
山善	85,700	525	44,992,500	
椿本興業	22,000	193	4,246,000	
住友商事	1,134,400	1,047	1,187,716,800	
内田洋行	47,000	227	10,669,000	
三菱商事	1,649,500	1,977	3,261,061,500	
第一実業	54,000	332	17,928,000	
キヤノンマーケティングジャパン	68,500	874	59,869,000	
西華産業	77,000	202	15,554,000	
佐藤商事	18,400	434	7,985,600	
菱洋エレクトロ	25,100	797	20,004,700	
東京産業	20,500	238	4,879,000	
神鋼商事	67,000	180	12,060,000	
阪和興業	200,000	319	63,800,000	
カナデン	26,000	484	12,584,000	
菱電商事	38,000	481	18,278,000	
フルサト工業	13,000	507	6,591,000	

岩谷産業	239,000	275	65,725,000	
すてきナイスグループ	94,000	149	14,006,000	
昭光通商	99,000	104	10,296,000	
ニチモウ	47,000	132	6,204,000	
極東貿易	44,000	155	6,820,000	
イワキ	31,000	199	6,169,000	
三愛石油	51,000	440	22,440,000	
稲畑産業	61,000	465	28,365,000	
G S I クレオス	56,000	113	6,328,000	
明和産業	27,800	232	6,449,600	
東邦ホールディングス	62,800	748	46,974,400	
サンゲツ	36,500	1,898	69,277,000	
ミツウロコ	34,100	482	16,436,200	
シナネン	46,000	328	15,088,000	
伊藤忠エネクス	46,600	421	19,618,600	
サンリオ	57,700	3,390	195,603,000	
サンワテクノス	10,000	848	8,480,000	
リョーサン	33,500	1,685	56,447,500	
新光商事	19,300	591	11,406,300	
トーホー	43,000	301	12,943,000	
三信電気	25,500	624	15,912,000	
東陽テクニカ	29,800	845	25,181,000	
モスフードサービス	27,100	1,505	40,785,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
加賀電子	20,500	871	17,855,500	
ソーダニッカ	23,000	332	7,636,000	
立花エレテック	13,200	735	9,702,000	
P a l t a c	16,900	1,290	21,801,000	
ヤマタネ	104,000	116	12,064,000	
丸紅建材リース	21,000	158	3,318,000	
日鐵商事	46,000	203	9,338,000	
トラスコ中山	27,800	1,442	40,087,600	
オートボックスセブン	26,700	3,200	85,440,000	
加藤産業	29,800	1,416	42,196,800	
イノテック	12,400	550	6,820,000	
イエローハット	19,700	789	15,543,300	

富士エレクトロニクス	11,600	1,188	13,780,800	
J Kホールディングス	33,100	363	12,015,300	
日伝	8,600	2,407	20,700,200	
北沢産業	56,500	159	8,983,500	
杉本商事	11,800	715	8,437,000	
因幡電機産業	24,300	2,038	49,523,400	
住金物産	112,000	176	19,712,000	
ミスミグループ本社	69,900	1,946	136,025,400	
江守商事	5,000	833	4,165,000	
アルテック	10,800	285	3,078,000	
タキヒヨー	32,000	404	12,928,000	
スズケン	85,200	1,793	152,763,600	
ジェコス	30,700	327	10,038,900	
ローソン	71,500	4,025	287,787,500	
サンエー	7,000	3,115	21,805,000	
キリン堂	9,200	439	4,038,800	
ダイユーエイト	3,300	525	1,732,500	
カワチ薬品	14,400	1,504	21,657,600	
エービーシー・マート	24,500	3,335	81,707,500	
ハードオフコーポレーション	10,400	391	4,066,400	
アスクル	16,300	1,227	20,000,100	
ゲオ	343	99,900	34,265,700	
ポイント	17,440	3,305	57,639,200	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	15,000	100	1,500,000	
くらコーポレーション	10,900	1,148	12,513,200	
キャンドウ	88	71,700	6,309,600	
パル	6,050	2,445	14,792,250	
エディオン	75,600	785	59,346,000	
サーラコーポレーション	19,500	351	6,844,500	
バルス	98	67,600	6,624,800	
あみやき亭	36	213,000	7,668,000	
ひらまつ	46	110,200	5,069,200	
ハニーズ	18,290	823	15,052,670	
アルベン	13,300	1,297	17,250,100	
ビックカメラ	787	40,900	32,188,300	
D C Mホールディングス	97,300	486	47,287,800	
Monotaro	4,100	1,361	5,580,100	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ユニバース	3,700	1,215	4,495,500	
J・フロントリテイリング	486,000	305	148,230,000	
ドトール・日レスホールディングス	36,300	978	35,501,400	
マツモトキヨシホールディングス	38,300	1,812	69,399,600	
ココカラファイン	19,900	1,947	38,745,300	
三越伊勢丹ホールディングス	409,100	707	289,233,700	
クリエイトSDホールディングス	8,700	1,742	15,155,400	
丸善CHIホールディングス	12,500	212	2,650,000	
ブックオフコーポレーション	12,900	709	9,146,100	
あさひ	8,600	1,479	12,719,400	
サークルKサンクス	44,800	1,219	54,611,200	
日本調剤	2,770	2,793	7,736,610	
コスモス薬品	10,400	3,280	34,112,000	
セブン&アイ・ホールディングス	861,500	2,192	1,888,408,000	
ツルハホールディングス	18,500	3,695	68,357,500	
サンマルクホールディングス	6,700	2,956	19,805,200	
フェリシモ	6,100	995	6,069,500	
トリドール	78	100,200	7,815,600	
クスリのアオキ	3,200	1,101	3,523,200	
メディカルシステムネットワーク	4,400	684	3,009,600	
総合メディカル	4,500	2,689	12,100,500	
はるやま商事	10,100	398	4,019,800	
カップ・クリエイト	15,250	1,593	24,293,250	
ライトオン	15,800	423	6,683,400	
ジーンズメイト	7,300	235	1,715,500	
良品計画	23,700	3,760	89,112,000	
三城ホールディングス	25,700	751	19,300,700	
コナカ	24,700	370	9,139,000	
ハウスオブローゼ	2,200	1,197	2,633,400	
G-7ホールディングス	5,600	376	2,105,600	
イオン北海道	15,500	327	5,068,500	
コジマ	25,600	439	11,238,400	
コーナン商事	20,200	1,334	26,946,800	
エコス	7,300	456	3,328,800	
ワタミ	24,400	1,621	39,552,400	
マルシェ	5,700	666	3,796,200	
ドン・キホーテ	40,000	2,556	102,240,000	

メガネトップ	21,800	1,015	22,127,000	
西松屋チェーン	45,400	633	28,738,200	
ゼンショー	78,700	1,001	78,778,700	
幸楽苑	12,800	1,096	14,028,800	
ハークスレイ	6,100	532	3,245,200	
サイゼリヤ	30,600	1,413	43,237,800	
ポプラ	6,200	406	2,517,200	
ユナイテッドアローズ	19,600	1,585	31,066,000	
ハイデイ日高	9,200	1,197	11,012,400	
京都きもの友禅	13,400	911	12,207,400	
コロワイド	68,500	450	30,825,000	
杏番屋	8,400	2,531	21,260,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
トップカルチャー	7,900	340	2,686,000	
スギホールディングス	32,900	2,038	67,050,200	
スクロール	29,500	245	7,227,500	
ファミリーマート	69,600	2,821	196,341,600	
木曽路	23,600	1,602	37,807,200	
千趣会	37,400	484	18,101,600	
タカキュー	17,000	144	2,448,000	
ケーヨー	39,000	413	16,107,000	
上新電機	45,000	845	38,025,000	
日本瓦斯	19,700	1,035	20,389,500	
マルエツ	42,000	275	11,550,000	
ロイヤルホールディングス	31,900	856	27,306,400	
東天紅	16,000	126	2,016,000	
いなげや	23,000	854	19,642,000	
島忠	46,700	1,979	92,419,300	
チヨダ	27,100	1,203	32,601,300	
鈴丹	6,300	151	951,300	
ライフコーポレーション	13,100	1,329	17,409,900	
カスミ	42,500	439	18,657,500	
リンガーハット	15,900	1,090	17,331,000	
さが美	18,000	96	1,728,000	
M r M a x	21,200	255	5,406,000	
テンアライド	14,600	235	3,431,000	

AOKIホールディングス	19,500	1,155	22,522,500
オークワ	29,000	822	23,838,000
コメリ	28,300	2,168	61,354,400
青山商事	52,400	1,370	71,788,000
しまむら	21,500	7,510	161,465,000
CFSコーポレーション	20,500	360	7,380,000
高島屋	279,000	487	135,873,000
松屋	38,300	399	15,281,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	121,000	609	73,689,000
丸栄	35,000	82	2,870,000
ニッセンホールディングス	41,400	468	19,375,200
パルコ	53,700	615	33,025,500
丸井グループ	268,400	551	147,888,400
原信ナルスホールディングス	12,400	1,168	14,483,200
ダイエー	95,850	278	26,646,300
イズミヤ	72,000	312	22,464,000
イオン	726,100	896	650,585,600
ユニー	167,300	696	116,440,800
イズミ	56,700	1,156	65,545,200
東武ストア	28,000	235	6,580,000
平和堂	41,900	955	40,014,500
フジ	23,400	1,715	40,131,000
ヤオコー	9,100	2,385	21,703,500
ゼビオ	25,000	1,687	42,175,000
ケーズホールディングス	47,400	3,360	159,264,000
Olympic	13,900	531	7,380,900

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日産東京販売ホールディングス	32,000	105	3,360,000	
アインファーマシーズ	11,500	3,220	37,030,000	
元気寿司	6,600	914	6,032,400	
ヤマダ電機	93,930	6,830	641,541,900	
アークランドサカモト	12,200	1,099	13,407,800	
ニトリホールディングス	40,800	7,110	290,088,000	
グルメ杵屋	15,000	456	6,840,000	
愛眼	16,800	406	6,820,800	
吉野家ホールディングス	560	97,800	54,768,000	

松屋フーズ	10,000	1,504	15,040,000
サガミチェーン	25,000	475	11,875,000
プレナス	26,000	1,264	32,864,000
ミニストップ	15,300	1,376	21,052,800
アークス	26,500	1,216	32,224,000
パロー	41,100	1,075	44,182,500
ベルク	10,300	927	9,548,100
大庄	9,800	921	9,025,800
ファーストリテイリング	48,100	12,060	580,086,000
サンドラッグ	39,200	2,414	94,628,800
ヤマザワ	5,500	1,119	6,154,500
やまや	3,500	833	2,915,500
ベルーナ	26,000	527	13,702,000
新生銀行	1,426,000	79	112,654,000
あおぞら銀行	748,000	175	130,900,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	15,586,600	364	5,673,522,400
りそなホールディングス	1,271,000	349	443,579,000
三井住友トラスト・ホールディングス	3,931,000	254	998,474,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,570,100	2,287	3,590,818,700
第四銀行	268,000	218	58,424,000
北越銀行	230,000	158	36,340,000
西日本シティ銀行	723,000	223	161,229,000
札幌北洋ホールディングス	310,500	310	96,255,000
千葉銀行	812,000	472	383,264,000
横浜銀行	1,411,000	379	534,769,000
常陽銀行	793,000	314	249,002,000
群馬銀行	470,000	397	186,590,000
武蔵野銀行	33,200	2,519	83,630,800
千葉興業銀行	39,400	424	16,705,600
筑波銀行	90,900	227	20,634,300
東京都民銀行	38,900	961	37,382,900
七十七銀行	348,000	311	108,228,000
青森銀行	164,000	242	39,688,000
秋田銀行	141,000	231	32,571,000
山形銀行	125,000	350	43,750,000
岩手銀行	13,900	2,931	40,740,900
東邦銀行	174,000	166	28,884,000
東北銀行	111,000	121	13,431,000
みちのく銀行	103,000	138	14,214,000

ふくおかフィナンシャルグループ	836,000	311	259,996,000	
-----------------	---------	-----	-------------	--

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
静岡銀行	621,000	711	441,531,000	
十六銀行	258,000	222	57,276,000	
スルガ銀行	217,000	648	140,616,000	
八十二銀行	380,000	419	159,220,000	
山梨中央銀行	126,000	313	39,438,000	
大垣共立銀行	275,000	231	63,525,000	
福井銀行	177,000	221	39,117,000	
北國銀行	230,000	279	64,170,000	
清水銀行	7,000	2,750	19,250,000	
滋賀銀行	193,000	427	82,411,000	
南都銀行	192,000	350	67,200,000	
百五銀行	186,000	302	56,172,000	
京都銀行	369,000	692	255,348,000	
三重銀行	92,000	184	16,928,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,443,000	143	206,349,000	
広島銀行	608,000	330	200,640,000	
山陰合同銀行	122,000	508	61,976,000	
中国銀行	169,000	928	156,832,000	
鳥取銀行	65,000	144	9,360,000	
伊予銀行	220,000	681	149,820,000	
百十四銀行	241,000	270	65,070,000	
四国銀行	149,000	224	33,376,000	
阿波銀行	170,000	471	80,070,000	
鹿児島銀行	133,000	496	65,968,000	
大分銀行	133,000	217	28,861,000	
宮崎銀行	137,000	170	23,290,000	
肥後銀行	162,000	428	69,336,000	
佐賀銀行	125,000	172	21,500,000	
十八銀行	132,000	200	26,400,000	
沖縄銀行	15,600	3,340	52,104,000	
琉球銀行	43,300	986	42,693,800	
みずほ信託銀行	1,954,000	65	127,010,000	
八千代銀行	10,800	2,032	21,945,600	
みずほフィナンシャルグループ	25,403,400	121	3,073,811,400	

紀陽ホールディングス	816,000	106	86,496,000	
山口フィナンシャルグループ	206,000	694	142,964,000	
長野銀行	72,000	162	11,664,000	
名古屋銀行	186,000	218	40,548,000	
愛知銀行	6,900	3,965	27,358,500	
第三銀行	125,000	177	22,125,000	
中京銀行	85,000	165	14,025,000	
東日本銀行	108,000	152	16,416,000	
大光銀行	78,000	227	17,706,000	
愛媛銀行	130,000	225	29,250,000	
トマト銀行	79,000	141	11,139,000	
みなと銀行	213,000	138	29,394,000	
京葉銀行	170,000	381	64,770,000	
関西アーバン銀行	287,000	142	40,754,000	
栃木銀行	104,000	276	28,704,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
北日本銀行	6,400	1,639	10,489,600	
東和銀行	221,000	89	19,669,000	
福島銀行	253,000	38	9,614,000	
大東銀行	131,000	44	5,764,000	
トモニホールディングス	158,500	265	42,002,500	
フィデアホールディングス	118,500	168	19,908,000	
池田泉州ホールディングス	772,500	109	84,202,500	
SBIホールディングス	25,744	7,200	185,356,800	
ジャフコ	29,100	1,847	53,747,700	
大和証券グループ本社	2,040,000	329	671,160,000	
野村ホールディングス	4,337,400	393	1,704,598,200	
みずほ証券	527,000	177	93,279,000	
みずほインベスターズ証券	480,000	68	32,640,000	
岡三証券グループ	176,000	275	48,400,000	
丸三証券	65,000	290	18,850,000	
東洋証券	78,000	110	8,580,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	237,000	204	48,348,000	
光世証券	50,000	67	3,350,000	
水戸証券	56,000	99	5,544,000	
いちよし証券	46,200	460	21,252,000	

松井証券	122,300	356	43,538,800	
だいこう証券ビジネス	11,900	266	3,165,400	
マネックスグループ	1,222	14,830	18,122,260	
カブドットコム証券	84,300	222	18,714,600	
極東証券	27,800	558	15,512,400	
岩井コスモホールディングス	19,600	329	6,448,400	
N K S Jホールディングス	1,722,000	510	878,220,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	615,500	1,848	1,137,444,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	197,300	1,382	272,668,600	
第一生命保険	11,015	113,300	1,247,999,500	
東京海上ホールディングス	781,900	2,189	1,711,579,100	
T & Dホールディングス	375,300	1,861	698,433,300	
クレディセゾン	156,200	1,215	189,783,000	
芙蓉総合リース	20,400	2,583	52,693,200	
興銀リース	29,600	1,894	56,062,400	
東京センチュリーリース	49,800	1,303	64,889,400	
日本証券金融	88,800	457	40,581,600	
大阪証券金融	36,000	146	5,256,000	
ポケットカード	27,100	233	6,314,300	
リコーリース	15,200	1,646	25,019,200	
イオンクレジットサービス	91,500	1,034	94,611,000	
アコム	42,980	1,237	53,166,260	
プロミス	107,700	581	62,573,700	
ジャックス	146,000	203	29,638,000	
オリエントコーポレーション	303,500	86	26,101,000	
日立キャピタル	50,300	1,038	52,211,400	
オリックス	107,150	7,510	804,696,500	
三菱UFJリース	52,240	2,966	154,943,840	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
アサックス	43	129,000	5,547,000	
NECキャピタルソリューション	7,100	1,000	7,100,000	
日本駐車場開発	2,457	4,230	10,393,110	
昭栄	38,500	747	28,759,500	
東京建物不動産販売	8,500	231	1,963,500	
野村不動産ホールディングス	94,800	1,236	117,172,800	

常和ホールディングス	4,200	1,228	5,157,600
ヒューリック	59,500	702	41,769,000
パーク24	96,500	784	75,656,000
三井不動産	971,000	1,320	1,281,720,000
三菱地所	1,441,000	1,379	1,987,139,000
平和不動産	190,500	166	31,623,000
東京建物	456,000	274	124,944,000
ダイビル	61,800	579	35,782,200
サンケイビル	41,600	409	17,014,400
東急不動産	444,000	342	151,848,000
京阪神不動産	26,400	357	9,424,800
住友不動産	494,000	1,638	809,172,000
東宝不動産	23,300	414	9,646,200
大京	352,000	128	45,056,000
テーオーシー	82,300	355	29,216,500
東京楽天地	37,000	269	9,953,000
フジ住宅	23,700	363	8,603,100
空港施設	23,800	302	7,187,600
明和地所	13,600	454	6,174,400
住友不動産販売	7,650	3,400	26,010,000
ゴールドクレスト	19,110	1,628	31,111,080
東栄住宅	16,600	899	14,923,400
日本エスリード	10,100	724	7,312,400
東急リバブル	22,900	689	15,778,100
飯田産業	24,400	682	16,640,800
日神不動産	14,000	483	6,762,000
アーネストワン	39,400	758	29,865,200
タカラレーベン	21,000	516	10,836,000
サンヨーハウジング名古屋	97	77,200	7,488,400
イオンモール	99,300	1,857	184,400,100
フージャースコーポレーション	343	30,800	10,564,400
タクトホーム	120	68,700	8,244,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,646	65,600	107,977,600
日本空港ビルデング	76,100	829	63,086,900
日本工営	74,000	249	18,426,000
ネクスト	75	53,200	3,990,000
日本M&Aセンター	48	381,000	18,288,000
ノバレーゼ	45	54,900	2,470,500
アコーディア・ゴルフ	624	50,600	31,574,400

パソナグループ	219	71,200	15,592,800	
リンクアンドモチベーション	49	47,400	2,322,600	
テンプホールディングス	30,000	724	21,720,000	
学情	7,900	257	2,030,300	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
スタジオアリス	9,500	969	9,205,500	
シミック	7,300	1,312	9,577,600	
NECフィールディング	17,800	941	16,749,800	
総合警備保障	79,600	857	68,217,200	
カクコム	150	556,000	83,400,000	
ルネサンス	11,400	299	3,408,600	
新日本科学	14,100	266	3,750,600	
エムスリー	85	611,000	51,935,000	
ベストプライダル	39	60,800	2,371,200	
ディー・エヌ・エー	85,000	3,150	267,750,000	
博報堂DYホールディングス	30,210	4,095	123,709,950	
ぐるなび	15,700	779	12,230,300	
一休	157	37,550	5,895,350	
ジャパンベストレスキューシステム	35	85,900	3,006,500	
ジェイコムホールディングス	4,000	944	3,776,000	
PGMホールディングス	471	41,800	19,687,800	
イーピーエス	118	170,300	20,095,400	
アミューズ	6,600	883	5,827,800	
ドリームインキュベータ	94	69,300	6,514,200	
TAC	13,700	215	2,945,500	
ケネディクス	2,508	13,270	33,281,160	
電通	198,300	2,121	420,594,300	
テイクアンドグヴ・ニーズ	1,185	5,320	6,304,200	
イオンファンタジー	7,600	920	6,992,000	
みらかホールディングス	53,000	3,220	170,660,000	
アルプス技研	9,900	601	5,949,900	
サニックス	33,800	273	9,227,400	
ダイオーズ	4,400	479	2,107,600	
日本空調サービス	5,700	690	3,933,000	
オリエンタルランド	58,900	6,680	393,452,000	
ダスキン	61,100	1,552	94,827,200	

明光ネットワークジャパン	20,500	745	15,272,500	
ファルコSDホールディングス	11,700	760	8,892,000	
秀英予備校	5,100	295	1,504,500	
田谷	4,100	638	2,615,800	
ラウンドワン	56,700	541	30,674,700	
リゾートトラスト	34,300	923	31,658,900	
ビー・エム・エル	12,900	2,054	26,496,600	
ワタベウェディング	7,100	657	4,664,700	
もしもしホットライン	13,650	1,389	18,959,850	
東急コミュニティー	5,800	2,412	13,989,600	
リソー教育	2,339	3,975	9,297,525	
ウェアハウス	6,800	253	1,720,400	
ユー・エス・エス	28,410	5,730	162,789,300	
東京個別指導学院	18,200	155	2,821,000	
テー・オー・ダブリュー	7,000	460	3,220,000	
セントラルスポーツ	7,300	889	6,489,700	
リゾートソリューション	22,000	130	2,860,000	
エイチ・アイ・エス	22,500	2,043	45,967,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
共立メンテナンス	10,200	1,123	11,454,600	
イチネンホールディングス	23,500	382	8,977,000	
建設技術研究所	13,200	524	6,916,800	
燦ホールディングス	4,700	1,217	5,719,900	
スバル興業	29,000	240	6,960,000	
東京テアトル	90,000	102	9,180,000	
ホリプロ	8,100	699	5,661,900	
よみうりランド	51,000	267	13,617,000	
東京都競馬	154,000	101	15,554,000	
カナモト	28,000	526	14,728,000	
東京ドーム	164,000	158	25,912,000	
トランス・コスモス	28,600	832	23,795,200	
乃村工藝社	44,000	237	10,428,000	
藤田観光	57,000	298	16,986,000	
日本管財	8,200	1,314	10,774,800	
トーカイ	10,000	1,480	14,800,000	
白洋舎	25,000	197	4,925,000	

セコム	226,700	3,820	865,994,000	
セントラル警備保障	9,900	776	7,682,400	
丹青社	42,000	227	9,534,000	
メイテック	32,000	1,685	53,920,000	
アサツー ディ・ケイ	35,200	2,020	71,104,000	
応用地質	21,100	727	15,339,700	
船井総合研究所	22,700	522	11,849,400	
進学会	13,400	295	3,953,000	
ベネッセホールディングス	68,900	3,405	234,604,500	
イオンディライト	24,700	1,474	36,407,800	
ナック	5,400	1,410	7,614,000	
ニチイ学館	38,700	723	27,980,100	
ダイセキ	32,300	1,622	52,390,600	
合計	312,331,485		229,788,908,785	

（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△](#)

「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6月10日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,984,197,620
コール・ローン	1,964,642,010
株式	255,129,861,077
投資信託受益証券	67,447,315
投資証券	4,188,869,371
派生商品評価勘定	14,084,142
未収入金	11,879,075
未収配当金	688,807,435
未収利息	3,896
差入委託証拠金	1,499,806,102
流動資産合計	268,549,598,043
資産合計	268,549,598,043
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	308,990,417
未払解約金	150,100,034
流動負債合計	459,090,451
負債合計	459,090,451
純資産の部	
元本等	
元本	268,408,266,709
剰余金	
欠損金	317,759,117
純資産合計	268,090,507,592
負債・純資産合計	268,549,598,043

(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6月10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 6 月10日現在
<p>1 . 計算日における受益権総数</p>	<p>268,408,266,709 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 317,759,117 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>0.9988 円 (9,988 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6月10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6月10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 6 月10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 6 月10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 6 月10日現在

計算期間の期首元本額	311,028,634,110 円
計算期間中の追加設定元本額	24,927,487,114 円
計算期間中の一部解約元本額	67,547,854,515 円
計算日の元本額	268,408,266,709 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	4,588,933,720 円
中央三井DC外国株式インデックスファンド	3,408,901,464 円
中央三井DC外国株式インデックスファンドL	16,779,992,730 円
中央三井DCバランスファンド30	123,653,453 円
中央三井DCバランスファンド50	385,918,410 円
中央三井DCバランスファンド70	253,408,718 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	264,648,704 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	162,989,220 円
新生・4分散ファンド	185,763,012 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	629,648,260 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	90,420,664 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	190,822,822 円
CMAA外国株式インデックスe	1,984,861,588 円
中央三井インデックスコレクション(外国株式)	12,431,118 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式30)	961,083 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式50)	2,929,173 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式70)	2,935,827 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)	22,309,839,068 円

中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)	5,498,858,879 円
中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)	40,941,595,420 円
中央三井VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	29,304,494,718 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)	4,678,924,326 円
中央三井VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	387,088,717 円
為替ヘッジ付外国株式ファンド(適格機関投資家専用)	2,641,354,196 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)	29,944,735,455 円
中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)	3,463,350,604 円
中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	1,860,760,710 円
中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)	31,850,184,515 円
中央三井バランスVA75(適格機関投資家専用)	2,345,545,349 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)	44,224,082,308 円
中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	5,797,491,624 円
中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	193,141,411 円
中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)	2,802,617,407 円
中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	2,128,886,927 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)	955,785,602 円
CMAM・VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	2,256,513,095 円
中央三井バランスVA20(適格機関投資家専用)	1,495,927,042 円
中央三井VAファンド25(適格機関投資家専用)	2,595,978,397 円
中央三井バランスVA20L(適格機関投資家専用)	107,212,100 円
中央三井バランスVA25L(適格機関投資家専用)	721,501,080 円
CMAM・VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	770,152,471 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)	63,025,322 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成23年6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	7,786,313,930
投資信託受益証券	829,941
投資証券	141,957,122
合計	7,645,186,749

(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6月10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6月10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	8,882,037,659		8,597,036,869	285,000,790
	合計	8,882,037,659		8,597,036,869	285,000,790

(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 6月10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	1,219,170,564		1,207,118,910	12,051,654
	ユーロ	341,924,929		346,310,160	4,385,231
	英ポンド	238,544,562		236,305,500	2,239,062
	計	1,799,640,055		1,789,734,570	9,905,485
	合計	1,799,640,055		1,789,734,570	9,905,485

（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 6月10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6月10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	17,100	46.91	802,161.00	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	70,100	74.67	5,234,367.00	
	APACHE CORP	54,012	120.29	6,497,103.48	
	ARCH COAL INC	23,000	26.54	610,420.00	
	BAKER HUGHES INC	61,559	74.70	4,598,457.30	
	CABOT OIL & GAS CORP	15,000	59.33	889,950.00	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	34,300	46.01	1,578,143.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	92,400	29.75	2,748,900.00	
	CHEVRON CORP	284,342	101.23	28,783,940.66	
	CIMAREX ENERGY CO	12,000	87.64	1,051,680.00	
	CONCHO RESOURCES INC	13,900	89.62	1,245,718.00	
	CONOCOPHILLIPS	192,500	72.51	13,958,175.00	
	CONSOL ENERGY INC	32,000	49.95	1,598,400.00	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,400	61.67	394,688.00	
	DENBURY RESOURCES INC	56,600	20.46	1,158,036.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	58,000	81.42	4,722,360.00	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	9,900	69.18	684,882.00	
	EL PASO CORP	99,500	20.09	1,998,955.00	
	EOG RESOURCES INC	35,900	110.78	3,977,002.00	
	EQT CORP	20,100	53.16	1,068,516.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	702,802	81.18	57,053,466.36	
	FMC TECHNOLOGIES INC	33,900	42.31	1,434,309.00	
	HALLIBURTON CO	129,500	48.98	6,342,910.00	
	HELMERICH & PAYNE	15,000	62.58	938,700.00	
	HESS CORP	42,900	75.11	3,222,219.00	
	KINDER MORGAN INC	15,600	29.69	463,164.00	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	11,920	64.48	768,601.60	
	MARATHON OIL CORP	100,300	51.15	5,130,345.00	
	MURPHY OIL CORP	25,900	65.91	1,707,069.00	
	NABORS INDUSTRIES INC	41,100	26.90	1,105,590.00	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	59,721	73.00	4,359,633.00		
NEWFIELD EXPLORATION CO	19,300	68.43	1,320,699.00		
NOBLE CORP	35,700	39.60	1,413,720.00		

NOBLE ENERGY INC	24,800	88.68	2,199,264.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	115,180	103.96	11,974,112.80	
PEABODY ENERGY CORP	38,100	56.30	2,145,030.00	
PETROHAWK ENERGY CORP	42,800	25.61	1,096,108.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,900	88.39	1,317,011.00	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION CO	20,200	37.15	750,430.00	
QEP RESOURCES INC	24,900	39.96	995,004.00	
RANGE RESOURCES CORP	23,100	54.04	1,248,324.00	
ROWAN COMPANIES INC	17,900	37.62	673,398.00	
SCHLUMBERGER LIMITED	192,834	85.84	16,552,870.56	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	49,000	43.16	2,114,840.00	
SPECTRA ENERGY CORP	91,578	27.16	2,487,258.48	
SUNOCO INC	17,100	41.06	702,126.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	ULTRA PETROLEUM CORP	21,600	46.97	1,014,552.00	
	VALERO ENERGY CORP	80,064	25.40	2,033,625.60	
	WEATHERFORD INTL LTD	104,748	18.57	1,945,170.36	
	WHITING PETROLEUM CORP	16,700	60.15	1,004,505.00	
	WILLIAMS COS INC	82,620	29.91	2,471,164.20	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	30,300	92.65	2,807,295.00	
	AIRGAS INC	11,300	67.01	757,213.00	
	ALCOA INC	150,600	15.50	2,334,300.00	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	14,300	61.81	883,883.00	
	BALL CORP	24,200	38.66	935,572.00	
	CELANESE CORP-SERIES A	22,400	47.47	1,063,328.00	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,100	154.86	1,564,086.00	
	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	19,200	85.19	1,635,648.00	
	CROWN HOLDINGS INC	22,900	38.93	891,497.00	
	DOW CHEMICAL COMPANY	165,502	35.17	5,820,705.34	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	130,646	50.46	6,592,397.16	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	10,400	101.14	1,051,856.00	
	ECOLAB INC	32,800	54.39	1,783,992.00	
	FMC CORP	10,100	79.58	803,758.00	
	FREEMONT-MCMORAN COPPER-B	133,076	49.85	6,633,838.60	
	INTERNATIONAL PAPER CO	58,800	29.23	1,718,724.00	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,536	62.00	715,232.00		

LUBRIZOL CORP	9,300	134.28	1,248,804.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	40,000	40.00	1,600,000.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,600	80.65	532,290.00	
MEADWESTVACO CORP	24,200	32.71	791,582.00	
MONSANTO CO	75,800	69.51	5,268,858.00	
MOSAIC CO/THE	38,000	68.84	2,615,920.00	
NEWMONT MINING CORP HOLDING CO	69,750	52.92	3,691,170.00	
NUCOR CORP	44,700	39.67	1,773,249.00	
OWENS-ILLINOIS INC	23,200	30.28	702,496.00	
PPG INDUSTRIES INC.	23,100	85.26	1,969,506.00	
PRAXAIR INC	43,314	101.65	4,402,868.10	
ROCK-TENN COMPANY-CL A	9,700	69.78	676,866.00	
SEALED AIR CORP	23,000	23.93	550,390.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO	13,200	82.27	1,085,964.00	
SIGMA-ALDRICH	17,500	68.51	1,198,925.00	
UNITED STATES STEEL CORP	20,700	42.72	884,304.00	
VULCAN MATERIALS COMPANY	18,500	37.43	692,455.00	
WALTER ENERGY INC	8,800	118.53	1,043,064.00	
3M COMPANY	95,938	91.96	8,822,458.48	
AGCO CORP	13,200	48.24	636,768.00	
AMETEK INC	22,700	42.06	954,762.00	
BOEING COMPANY	99,095	74.18	7,350,867.10	
BUCYRUS INTERNATIONAL INC	11,100	91.76	1,018,536.00	
CATERPILLAR INC	90,500	99.26	8,983,030.00	
COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	23,000	61.09	1,405,070.00	
CUMMINS INC	26,600	96.58	2,569,028.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	DANAHER CORP	79,404	52.34	4,156,005.36	
	DEERE & CO	59,926	82.00	4,913,932.00	
	DOVER CORP	26,400	62.30	1,644,720.00	
	EATON CORP	45,200	46.81	2,115,812.00	
	EMERSON ELECTRIC CO	106,900	51.69	5,525,661.00	
	FASTENAL CO	39,700	31.34	1,244,198.00	
	FLOWSERVE CORP	7,900	110.54	873,266.00	
	FLUOR CORP	25,300	62.89	1,591,117.00	
	FOSTER WHEELER AG	17,800	32.33	575,474.00	

GENERAL DYNAMICS CORPORATION	45,400	70.49	3,200,246.00
GENERAL ELECTRIC	1,505,145	18.58	27,965,594.10
GOODRICH CORP	17,800	87.05	1,549,490.00
GRAINGER (W.W.) INC	8,300	143.42	1,190,386.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	105,600	56.46	5,962,176.00
ILLINOIS TOOL WORKS	63,576	55.34	3,518,295.84
INGERSOLL-RAND PLC	46,668	44.93	2,096,793.24
ITT CORPORATION	25,100	55.78	1,400,078.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17,900	42.19	755,201.00
JOY GLOBAL INC	14,600	90.28	1,318,088.00
KBR INC	21,700	36.36	789,012.00
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	16,300	80.13	1,306,119.00
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	42,200	77.89	3,286,958.00
MASCO CORP	50,900	12.23	622,507.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	39,200	63.65	2,495,080.00
PACCAR INC	46,375	46.94	2,176,842.50
PALL CORP	16,600	53.32	885,112.00
PARKER HANNIFIN CORP	22,850	87.80	2,006,230.00
PENTAIR INC	14,200	37.82	537,044.00
PRECISION CASTPARTS CORP	20,200	151.14	3,053,028.00
QUANTA SERVICES INC	30,400	18.98	576,992.00
RAYTHEON COMPANY	51,500	48.61	2,503,415.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	20,100	79.66	1,601,166.00
ROCKWELL COLLONS	22,200	59.68	1,324,896.00
ROPER INDUSTRIES INC	13,400	79.46	1,064,764.00
SPX CORP	7,300	76.11	555,603.00
TEXTRON INC	38,900	21.42	833,238.00
TYCO INTERNATIONAL LTD	67,232	46.82	3,147,802.24
UNITED TECHNOLOGIES CORP	124,000	84.09	10,427,160.00
URS CORP	11,900	42.56	506,464.00
AVERY DENNISON CORP	14,000	36.98	517,720.00
CINTAS CORP	18,800	31.45	591,260.00
DUN & BRADSTREET CORP	7,100	76.26	541,446.00
EQUIFAX INC	17,800	35.57	633,146.00
IHS INC-CLASS A	6,000	85.09	510,540.00
IRON MOUNTAIN INC	25,900	32.43	839,937.00
MANPOWERGROUP	11,800	55.42	653,956.00
NIELSEN HOLDINGS NV	12,700	31.49	399,923.00
PITNEY BOWES INC	29,306	22.84	669,349.04

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	REPUBLIC SERVICES INC	43,570	30.19	1,315,378.30	
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	19,800	26.18	518,364.00	
	RR DONNELLEY & SONS CO	29,700	19.83	588,951.00	
	STERICYCLE INC	11,700	86.08	1,007,136.00	
	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	17,200	33.89	582,908.00	
	WASTE MANAGEMENT INC	63,900	36.91	2,358,549.00	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	23,500	76.42	1,795,870.00	
	CSX CORP	52,900	75.25	3,980,725.00	
	DELTA AIR LINES INC	28,400	9.18	260,712.00	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	30,000	48.15	1,444,500.00	
	FEDEX CORP	42,295	86.21	3,646,251.95	
	HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	38,200	14.58	556,956.00	
	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	13,800	43.17	595,746.00	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	50,500	71.44	3,607,720.00	
	SOUTHWEST AIRLINES	28,300	11.05	312,715.00	
	UNION PACIFIC CORPORATION	69,760	101.29	7,065,990.40	
	UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	11,400	21.91	249,774.00	
	UNITED PARCEL SERVICE -CL B	104,120	69.29	7,214,474.80	
	AUTOLIV INC	12,600	72.68	915,768.00	
	BORGWARNER INC	16,400	69.32	1,136,848.00	
	FORD MOTOR CO	499,770	13.80	6,896,826.00	
	GENERAL MOTORS CO	110,600	29.45	3,257,170.00	
	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	33,200	16.06	533,192.00	
	HARLEY-DAVIDSON INC	33,900	36.37	1,232,943.00	
	JOHNSON CONTROLS INC	96,042	36.57	3,512,255.94	
	TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	14,700	53.23	782,481.00	
	COACH INC	41,900	59.99	2,513,581.00	
	DR HORTON INC	41,300	10.87	448,931.00	
	FORTUNE BRANDS INC	19,600	64.02	1,254,792.00	
	GARMIN LTD	16,400	33.71	552,844.00	
	HASBRO INC	17,700	43.32	766,764.00	
	LEGGETT & PLATT INC	21,100	23.99	506,189.00	
	LULULEMON ATHLETICA INC	7,000	86.14	602,980.00	
	MATTEL INC	51,600	25.52	1,316,832.00	
MOHAWK INDUSTRIES INC	8,400	60.99	512,316.00		

NEWELL RUBBERMAID INC	41,000	14.76	605,160.00
NIKE INC. CLASS B	52,100	80.67	4,202,907.00
POLO RALPH LAUREN CORP	9,300	121.83	1,133,019.00
PULTE GROUP INC	50,800	7.04	357,632.00
STANLEY BLACK AND DECKER INC	22,337	68.86	1,538,125.82
TOLL BROTHERS INC	20,800	20.14	418,912.00
VF CORP	12,500	93.20	1,165,000.00
WHIRLPOOL CORP	10,800	74.56	805,248.00
APOLLO GROUP INC-CL A	18,800	44.48	836,224.00
CARNIVAL CORP	64,300	35.98	2,313,514.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,400	277.87	1,222,628.00
DARDEN RESTAURANTS INC	19,600	47.58	932,568.00
DEVRY INC	9,400	58.36	548,584.00

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	H&R BLOCK INC	43,600	15.77	687,572.00	
	INTL GAME TECHNOLOGY	42,200	16.01	675,622.00	
	LAS VEGAS SANDS CORP	51,500	39.64	2,041,460.00	
	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	41,174	34.60	1,424,620.40	
	MC DONALD'S CORPORATION	147,956	81.26	12,022,904.56	
	MGM RESORTS INTERNATIONAL	47,700	13.04	622,008.00	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,800	34.20	677,160.00	
	STARBUCKS CORP	105,700	35.53	3,755,521.00	
	STARWOOD HOTELS & RESORTS	27,420	56.43	1,547,310.60	
	WYNN RESORTS LTD	11,400	135.18	1,541,052.00	
	YUM BRANDS INC	66,200	53.70	3,554,940.00	
	CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	30,200	35.42	1,069,684.00	
	CBS CORP-CL B	89,170	26.71	2,381,730.70	
	COMCAST CORP-CL A	293,623	24.27	7,126,230.21	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	98,550	22.94	2,260,737.00	
	DIRECTV-CLASS A	112,169	47.78	5,359,434.82	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	19,384	40.96	793,968.64	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	19,884	36.73	730,339.32	
	DISH NETWORK CORP-A	29,500	28.94	853,730.00	
	INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES	69,060	11.90	821,814.00	
	LIBERTY GLOBAL INC-A	16,853	42.99	724,510.47	
	LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	15,500	40.72	631,160.00	

MCGRAW-HILL INC	43,400	41.38	1,795,892.00	
NEWS CORP INC CLASS A	258,005	16.80	4,334,484.00	
NEWS CORP INC CLASS B	63,165	17.42	1,100,334.30	
OMNICOM GROUP	40,300	46.34	1,867,502.00	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	13,000	46.45	603,850.00	
SIRIUS XM RADIO INC	529,700	2.08	1,104,424.50	
THE WALT DISNEY CO.	255,658	39.37	10,065,255.46	
TIME WARNER CABLE	48,741	75.61	3,685,307.01	
TIME WARNER INC	154,962	35.22	5,457,761.64	
VIACOM INC-CLASS B	78,570	48.95	3,846,001.50	
VIRGIN MEDIA INC	44,050	32.03	1,410,921.50	
WASHINGTON POST -CL B	800	424.72	339,776.00	
ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	12,500	66.64	833,000.00	
ADVANCE AUTO PARTS	11,950	58.16	695,012.00	
AMAZON.COM INC	51,100	189.60	9,688,560.00	
AUTOZONE INC	3,800	291.94	1,109,372.00	
BED BATH & BEYOND INC	36,700	53.47	1,962,349.00	
BEST BUY CO INC	48,650	28.97	1,409,390.50	
CARMAX INC	31,800	27.09	861,462.00	
DOLLAR GENERAL CORP	14,500	32.70	474,150.00	
DOLLAR TREE INC	18,050	62.40	1,126,320.00	
EXPEDIA INC	28,950	27.32	790,914.00	
FAMILY DOLLAR STORES	17,900	52.57	941,003.00	
GAMESTOP CORP-CLASS A	20,700	26.50	548,550.00	
GAP INC/THE	62,300	17.81	1,109,563.00	
GENUINE PARTS CO	22,700	50.77	1,152,479.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	HOME DEPOT INC	232,304	34.33	7,974,996.32	
	J.C. PENNEY CO INC (HLDG CO)	25,200	30.72	774,144.00	
	KOHL'S CORP	39,420	50.69	1,998,199.80	
	LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	81,747	17.20	1,406,048.40	
	LIMITED BRANDS	39,730	36.32	1,442,993.60	
	LOWE'S COS INC	191,996	22.77	4,371,748.92	
	MACY'S INC	60,852	28.13	1,711,766.76	
	NETFLIX INC	7,100	262.57	1,864,247.00	
	NORDSTROM INC	25,200	42.64	1,074,528.00	

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	19,800	59.80	1,184,040.00
PETSMART INC	16,700	43.88	732,796.00
PRICELINE.COM INC	7,000	503.17	3,522,190.00
ROSS STORES INC	17,400	77.68	1,351,632.00
SEARS HOLDING CORP	6,385	67.45	430,668.25
STAPLES INC	102,250	15.18	1,552,155.00
TARGET CORP	95,020	47.16	4,481,143.20
TIFFANY & CO	17,100	72.65	1,242,315.00
TJX COMPANIES INC	56,000	50.43	2,824,080.00
URBAN OUTFITTERS INC	19,000	29.19	554,610.00
COSTCO WHOLESALE CORP	61,900	79.03	4,891,957.00
CVS CAREMARK CORP	193,883	37.75	7,319,083.25
KROGER CO	85,600	23.80	2,037,280.00
SAFEWAY INC	53,600	22.41	1,201,176.00
SYSCO CORP	82,690	30.89	2,554,294.10
WAL-MART STORES	277,626	53.62	14,886,306.12
WALGREEN CO	130,806	43.60	5,703,141.60
WHOLE FOODS MARKET INC	20,800	55.14	1,146,912.00
ALTRIA GROUP INC	296,475	27.46	8,141,203.50
ARCHER DANIELS MIDLAND COMPANY	90,310	30.09	2,717,427.90
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,680	71.75	838,040.00
BUNGE LIMITED	20,500	68.89	1,412,245.00
CAMPBELL SOUP	29,000	34.04	987,160.00
COCA-COLA CO/THE	292,734	65.89	19,288,243.26
COCA-COLA ENTERPRISES	48,700	28.13	1,369,931.00
CONAGRA FOODS INC	62,150	24.55	1,525,782.50
CONSTELLATION BRANDS INC-A	27,600	21.27	587,052.00
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	32,686	39.91	1,304,498.26
GENERAL MILLS INC	90,480	38.06	3,443,668.80
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	18,100	76.16	1,378,496.00
HANSEN NATURAL CORPORATION	10,700	73.12	782,384.00
HEINZ (H.J.) CO	45,400	53.56	2,431,624.00
HERSHEY CO/THE	23,600	54.50	1,286,200.00
HORMEL FOODS CORP	20,700	28.81	596,367.00
JM SMUCKER CO/THE	17,200	78.13	1,343,836.00
KELLOGG CO	36,500	55.79	2,036,335.00
KRAFT FOODS INC-A	235,518	34.22	8,059,425.96
LORILLARD INC	21,187	101.66	2,153,870.42
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	17,100	48.92	836,532.00

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	MEAD JOHNSON NUTRITION CO	28,900	64.99	1,878,211.00	
	MOLSON COORS BREWING CO -B	23,000	44.74	1,029,020.00	
	PEPSICO INC	224,821	69.51	15,627,307.71	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	254,775	68.12	17,355,273.00	
	RALCORP HOLDINGS INC	7,900	86.70	684,930.00	
	REYNOLDS AMERICAN INC	49,500	38.12	1,886,940.00	
	SARA LEE CORP	85,800	18.88	1,619,904.00	
	TYSON FOODS INC-CL A	43,600	17.47	761,692.00	
	AVON PRODUCTS, INC	60,640	27.67	1,677,908.80	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	20,200	40.35	815,070.00	
	CLOROX COMPANY	19,700	67.10	1,321,870.00	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	70,000	85.10	5,957,000.00	
	ENERGIZER HOLDINGS INC	9,700	71.06	689,282.00	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	17,200	96.79	1,664,788.00	
	KIMBERLY-CLARK CORP	57,647	65.43	3,771,843.21	
	PROCTER & GAMBLE CO	396,915	65.01	25,803,444.15	
	AETNA INC	54,500	43.92	2,393,640.00	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	39,100	41.54	1,624,214.00	
	BARD (C.R.) INC	12,100	110.49	1,336,929.00	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	82,410	58.90	4,853,949.00	
	BECKMAN COULTER INC	10,200	83.28	849,456.00	
	BECTON DICKINSON & CO	31,400	86.30	2,709,820.00	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	214,786	6.88	1,477,727.68	
	CARDINAL HEALTH INC	49,354	44.44	2,193,291.76	
	CAREFUSION CORP	31,577	28.11	887,629.47	
	CERNER CORP	10,000	117.43	1,174,300.00	
	CIGNA CORP	38,300	50.40	1,930,320.00	
	COVENTRY HEALTH CARE INC	21,350	34.55	737,642.50	
	COVIDIEN PLC	70,032	54.92	3,846,157.44	
	DAVITA INC	14,000	84.02	1,176,280.00	
	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	20,100	37.38	751,338.00	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	16,200	86.46	1,400,652.00	
	EXPRESS SCRIPTS INC	70,700	57.17	4,041,919.00	
	HCA HOLDINGS INC	22,700	35.24	799,948.00	
HENRY SCHEIN INC	13,100	69.71	913,201.00		

HOLOGIC INC	37,444	20.14	754,122.16
HUMANA INC	23,800	79.99	1,903,762.00
INTUITIVE SURGICAL INC	5,600	341.98	1,915,088.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	14,400	96.36	1,387,584.00
MCKESSON CORP	35,800	84.93	3,040,494.00
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	57,410	57.44	3,297,630.40
MEDTRONIC, INCORPORATED	152,645	38.87	5,933,311.15
OMNICARE INC	16,700	30.88	515,696.00
PATTERSON COS INC	13,400	32.53	435,902.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	24,300	58.60	1,423,980.00
ST JUDE MEDICAL INC	48,500	49.54	2,402,690.00
STRYKER CORP	42,100	58.98	2,483,058.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	155,468	50.60	7,866,680.80

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	17,100	66.43	1,135,953.00	
	WELLPOINT INC	53,298	77.75	4,143,919.50	
	ZIMMER HOLDINGS INC	27,900	64.05	1,786,995.00	
	ABBOTT LABORATORIES	219,353	51.53	11,303,260.09	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	49,000	48.71	2,386,790.00	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	25,600	47.03	1,203,968.00	
	ALLERGAN INC	43,500	80.16	3,486,960.00	
	AMGEN INC	132,162	58.88	7,781,698.56	
	BIOGEN IDEC INC	32,457	93.72	3,041,870.04	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	241,875	27.86	6,738,637.50	
	CELGENE CORP	66,500	59.58	3,962,070.00	
	CEPHALON INC	10,700	79.78	853,646.00	
	COVANCE INC	9,400	56.44	530,536.00	
	ELI LILLY & CO	147,633	37.72	5,568,716.76	
	FOREST LABORATORIES INC	41,100	37.86	1,556,046.00	
	GILEAD SCIENCES INC	112,800	41.16	4,642,848.00	
	HOSPIRA INC	24,015	54.69	1,313,380.35	
	HUMAN GENOME SCIENCES INC	27,200	25.37	690,064.00	
	ILLUMINA INC	18,000	73.69	1,326,420.00	
	JOHNSON & JOHNSON	387,970	66.78	25,908,636.60	
LIFE TECHNOLOGIES CORP	26,400	51.00	1,346,400.00		
MERCK & CO. INC.	437,019	36.00	15,732,684.00		

MYLAN INC	61,500	22.54	1,386,210.00	
PERRIGO CO	11,800	84.69	999,342.00	
PFIZER	1,133,172	20.73	23,490,655.56	
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVEL	16,300	26.88	438,144.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	56,200	63.53	3,570,386.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28,800	48.09	1,384,992.00	
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	19,800	22.46	444,708.00	
WATERS CORPORATION	13,200	94.19	1,243,308.00	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	17,900	64.14	1,148,106.00	
BB&T CORPORATION	98,000	25.86	2,534,280.00	
CIT GROUP INC	27,400	42.92	1,176,008.00	
COMERICA INC	25,000	33.99	849,750.00	
FIFTH THIRD BANCORP	129,643	12.32	1,597,201.76	
HUDSON CITY BANCORP INC	67,000	8.34	558,780.00	
KEYCORP	134,740	8.13	1,095,436.20	
M & T BANK CORP	15,900	85.43	1,358,337.00	
MARSHALL & ILSLEY CORP	72,099	7.71	555,883.29	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	61,700	15.49	955,733.00	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN	52,200	12.69	662,418.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	74,288	59.14	4,393,392.32	
REGIONS FINANCIAL CORP	180,537	6.12	1,104,886.44	
SUNTRUST BANKS INC	75,908	25.53	1,937,931.24	
US BANCORP	272,357	24.41	6,648,234.37	
WELLS FARGO & COMPANY	709,320	26.22	18,598,370.40	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	153,101	48.33	7,399,371.33	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	35,080	57.29	2,009,733.20	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	BANK OF AMERICA CORP	1,434,500	10.65	15,277,425.00	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	175,292	26.56	4,655,755.52	
	BLACKROCK INC	13,100	192.32	2,519,392.00	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	64,584	50.15	3,238,887.60	
	CITIGROUP INC	411,776	37.77	15,552,779.52	
	CME GROUP INC	9,100	266.25	2,422,875.00	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	76,957	22.82	1,756,158.74	
	EATON VANCE CORP	17,400	29.76	517,824.00	
	FRANKLIN RESOURCES INC	22,200	123.47	2,741,034.00	

GOLDMAN SACHS GROUP INC	70,100	133.53	9,360,453.00
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	10,400	116.71	1,213,784.00
INVESCO LTD	65,311	23.17	1,513,255.87
JEFFERIES GROUP INC (NEW)	19,600	21.44	420,224.00
JPMORGAN CHASE & CO	564,587	40.98	23,136,775.26
LEGG MASON INC	22,000	31.72	697,840.00
LEUCADIA NATIONAL CORP	29,400	33.56	986,664.00
MOODY'S CORP	29,300	41.75	1,223,275.00
MORGAN STANLEY	197,114	22.51	4,437,036.14
NASDAQ OMX GROUP	18,500	24.15	446,775.00
NORTHERN TRUST CORP	30,800	47.35	1,458,380.00
NYSE GROUP INC	36,900	34.70	1,280,430.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	145,000	16.26	2,357,700.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	21,100	21.70	457,870.00
SLM CORP	74,700	15.91	1,188,477.00
STATE STREET CORP	70,973	43.38	3,078,808.74
T ROWE PRICE GROUP INC	36,678	58.13	2,132,092.14
TD AMERITRADE HOLDING CORP	32,600	18.92	616,792.00
ACE LTD	48,000	66.83	3,207,840.00
AFLAC INC	66,610	45.14	3,006,775.40
ALLSTATE CORP	75,060	30.20	2,266,812.00
AMERICAN INT'L GROUP	66,513	28.10	1,869,015.30
AON CORP	42,500	50.80	2,159,000.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	19,200	33.15	636,480.00
ASSURANT INC	15,700	35.03	549,971.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	16,800	31.73	533,064.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	127,400	75.01	9,556,274.00
CHUBB CORP	41,918	64.44	2,701,195.92
CINCINNATI FINANCIAL CORP	21,871	29.42	643,444.82
EVEREST RE GROUP LTD	8,000	84.13	673,040.00
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC CL-A	31,065	15.33	476,226.45
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	69,200	10.47	724,524.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GR	59,700	24.65	1,471,605.00
LINCOLN NATIONAL CORP	45,607	26.72	1,218,619.04
LOEWS CORP	47,090	41.17	1,938,695.30
MARSH & MCLENNAN COS	76,839	29.94	2,300,559.66
METLIFE INC	149,140	41.66	6,213,172.40
OLD REPUBLIC INTL CORP	35,350	11.90	420,665.00
PARTNERRE LTD	9,100	70.88	645,008.00

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	45,300	28.79	1,304,187.00	
	PROGRESSIVE CORP	89,100	20.38	1,815,858.00	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	68,486	60.13	4,118,063.18	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	7,900	71.60	565,640.00	
	TORCHMARK CORP	11,600	63.53	736,948.00	
	TRAVELERS COS INC/THE	61,113	61.08	3,732,782.04	
	UNUM GROUP	45,600	25.13	1,145,928.00	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	24,200	41.82	1,012,044.00	
	WR BERKLEY CORP	18,850	32.35	609,797.50	
	XL GROUP PLC	46,500	21.23	987,195.00	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	114,000	18.42	2,099,880.00	
	CB RICHARD ELLIS GROUP INC-A	41,100	25.19	1,035,309.00	
	RAYONIER INC	11,400	63.78	727,092.00	
	WEYERHAEUSER CO	75,712	21.04	1,592,980.48	
	ACCENTURE PLC-CL A	90,800	56.35	5,116,580.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	78,000	11.33	883,740.00	
	ADOBE SYSTEMS INC	71,900	32.20	2,315,180.00	
	AKAMAI TECHNOLOGIES	26,300	30.04	790,052.00	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	7,500	88.19	661,425.00	
	AUTODESK INC	32,100	38.08	1,222,368.00	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	70,400	52.72	3,711,488.00	
	BMC SOFTWARE INC	25,100	52.56	1,319,256.00	
	CA INC	58,900	21.98	1,294,622.00	
	CITRIX SYSTEMS INC	26,600	81.46	2,166,836.00	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	42,900	73.59	3,157,011.00	
	COMPUTER SCIENCES CORP	22,300	38.38	855,874.00	
	EBAY INC	165,772	30.66	5,082,569.52	
	ELECTRONIC ARTS INC	46,910	23.10	1,083,621.00	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION	36,223	31.80	1,151,891.40	
	FISERV INC	21,400	63.42	1,357,188.00	
	GOOGLE INC-CLASS A	35,600	516.73	18,395,588.00	
	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE	172,878	164.84	28,497,209.52	
	INTUIT INC	42,100	50.80	2,138,680.00	
	MASTERCARD INC-CLASS A	15,800	271.70	4,292,860.00	
MICROSOFT CORP	1,071,891	23.94	25,661,070.54		

NUANCE COMMUNICATIONS INC	34,700	20.49	711,003.00	
ORACLE CORP	572,876	31.62	18,114,339.12	
PAYCHEX INC	46,000	30.23	1,390,580.00	
RED HAT INC	27,000	42.49	1,147,230.00	
SAIC INC	42,800	16.55	708,340.00	
SALESFORCE.COM INC	17,700	141.82	2,510,214.00	
SYMANTEC CORP	109,700	18.85	2,067,845.00	
SYNOPSYS INC	21,800	25.76	561,568.00	
TERADATA CORP	24,100	53.45	1,288,145.00	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	23,775	17.68	420,342.00	
VERISIGN INC	24,800	34.02	843,696.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	70,200	76.43	5,365,386.00	
VMWARE INC-CLASS A	11,700	94.60	1,106,820.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	WESTERN UNION CO	92,748	20.00	1,854,960.00	
	YAHOO! INC	175,000	15.22	2,663,500.00	
	AMPHENOL CORP-CL A	25,100	51.37	1,289,387.00	
	APPLE INC	130,600	331.49	43,292,594.00	
	ARROW ELECTRONICS INC	16,700	39.79	664,493.00	
	AVNET INC	21,500	31.77	683,055.00	
	CISCO SYSTEMS INC	783,013	15.30	11,980,098.90	
	CORNING INC	220,800	18.71	4,131,168.00	
	DELL INC	247,258	15.67	3,874,532.86	
	DOLBY LABORATORIES INC-CL A	7,600	44.30	336,680.00	
	EMC CORP/MASS	293,200	26.91	7,890,012.00	
	F5 NETWORKS INC	11,700	108.93	1,274,481.00	
	FLEXTRONICS INTL LTD	110,200	6.95	765,890.00	
	FLIR SYSTEMS INC	22,800	33.66	767,448.00	
	HARRIS CORP	18,500	46.05	851,925.00	
	HEWLETT-PACKARD CO	308,300	35.46	10,932,318.00	
	JUNIPER NETWORKS INC	75,800	31.90	2,418,020.00	
	MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS I	39,862	23.36	931,176.32	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	42,971	45.56	1,957,758.76	
	NETAPP INC	51,260	50.19	2,572,739.40	
	QUALCOMM INC	232,938	55.87	13,014,246.06	
	SANDISK CORP	33,200	42.53	1,411,996.00	

SEAGATE TECHNOLOGY	66,800	15.38	1,027,384.00	
TE CONNECTIVITY LTD	62,732	35.51	2,227,613.32	
WESTERN DIGITAL CORP	32,500	33.69	1,094,925.00	
XEROX CORP	196,012	9.56	1,873,874.72	
AMERICAN TOWER CORP-CL A	56,400	49.85	2,811,540.00	
AT&T INC	837,852	30.33	25,412,051.16	
CENTURYLINK INC	84,667	40.89	3,462,033.63	
CROWN CASTLE INTL CORP	41,100	40.51	1,664,961.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	142,885	8.02	1,145,937.70	
METROPCS COMMUNICATIONS INC	35,700	16.60	592,620.00	
NII HOLDINGS INC	24,000	40.96	983,040.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	16,100	37.15	598,115.00	
SPRINT NEXTEL CORP	423,838	5.41	2,292,963.58	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	396,948	35.67	14,159,135.16	
WINDSTREAM CORP	71,500	13.02	930,930.00	
AES CORP	96,300	12.44	1,197,972.00	
ALLIANT ENERGY CORP	15,700	39.89	626,273.00	
AMEREN CORPORATION	33,900	28.51	966,489.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY	67,900	37.46	2,543,534.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	24,800	28.53	707,544.00	
CALPINE CORP	44,100	15.58	687,078.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	56,800	18.82	1,068,976.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	41,100	52.31	2,149,941.00	
CONSTELLATION ENERGY GROUP	27,300	36.69	1,001,637.00	
DOMINION RESOURCES INC	82,100	47.98	3,939,158.00	
DTE ENERGY COMPANY	23,900	49.57	1,184,723.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	DUKE ENERGY CORP	187,156	18.41	3,445,541.96	
	EDISON INTERNATIONAL	43,800	39.04	1,709,952.00	
	ENERGEN CORP	10,200	59.17	603,534.00	
	ENTERGY CORP	25,600	67.88	1,737,728.00	
	EXELON CORP	93,500	41.63	3,892,405.00	
	FIRSTENERGY CORP	59,075	43.75	2,584,531.25	
	INTEGRYS ENERGY GROUP INC	11,400	50.27	573,078.00	
	MDU RESOURCES GROUP INC	25,800	22.36	576,888.00	
	NEXTERA ENERGY INC	56,694	55.63	3,153,887.22	

NISOURCE INC	40,000	19.59	783,600.00	
NORTHEAST UTILITIES	25,000	34.08	852,000.00	
NRG ENERGY INC	35,600	24.10	857,960.00	
NSTAR	14,700	44.58	655,326.00	
ONEOK INC	14,300	69.53	994,279.00	
P G & E CORP	56,200	41.96	2,358,152.00	
PEPCO HOLDINGS INC	32,300	19.13	617,899.00	
PINNACLE WEST CAPITAL	15,400	43.35	667,590.00	
PPL CORPORATION	79,800	27.12	2,164,176.00	
PROGRESS ENERGY INC	41,400	46.91	1,942,074.00	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	71,500	32.04	2,290,860.00	
SCANA CORP	17,100	39.22	670,662.00	
SEMPRA ENERGY	32,300	53.06	1,713,838.00	
SOUTHERN COMPANY	117,432	39.53	4,642,086.96	
WISCONSIN ENERGY CORP	33,600	30.86	1,036,896.00	
XCEL ENERGY INC	68,400	24.17	1,653,228.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	83,292	7.64	636,350.88	
ALTERA CORPORATION	45,300	44.08	1,996,824.00	
ANALOG DEVICES	42,200	38.42	1,621,324.00	
APPLIED MATERIALS INC	188,800	12.78	2,412,864.00	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	26,000	34.22	889,720.00	
BROADCOM CORP-CL A	68,735	33.92	2,331,491.20	
CREE INC	15,500	38.44	595,820.00	
FIRST SOLAR INC	7,900	114.12	901,548.00	
INTEL CORP	777,865	21.75	16,922,453.07	
KLA-TENCOR CORPORATION	24,061	40.87	983,373.07	
LAM RESEARCH CORP	17,700	45.08	797,916.00	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	32,425	32.11	1,041,166.75	
LSI CORP	88,700	7.02	622,674.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	79,500	14.82	1,178,190.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	42,600	25.23	1,074,798.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,400	36.96	975,744.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	126,700	8.49	1,075,683.00	
NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	34,500	24.58	848,010.00	
NVIDIA CORP	81,100	17.37	1,408,707.00	
TEXAS INSTRUMENTS INCORPORATED	165,927	32.91	5,460,657.57	
XILINX INC	37,300	33.81	1,261,113.00	
米ドル 小計	43,333,304		1,711,884,345.12 (137,532,788,286)	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	40,900	25.47	1,041,723.00	
	ATHABASCA OIL SANDS CORP	42,600	16.80	715,680.00	
	BAYTEX ENERGY CORP	16,000	50.95	815,200.00	
	BONAVISTA ENERGY CORP	19,200	29.21	560,832.00	
	CAMECO CORP	55,600	25.89	1,439,484.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	154,940	40.45	6,267,323.00	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	68,500	29.19	1,999,515.00	
	CENOVUS ENERGY INC	106,240	34.59	3,674,841.60	
	ENBRIDGE INC	102,640	30.42	3,122,308.80	
	ENCANA CORP	103,940	32.11	3,337,513.40	
	ENERPLUS CORP	25,200	30.57	770,364.00	
	HUSKY ENERGY INC	37,900	28.77	1,090,383.00	
	IMPERIAL OIL LTD	42,000	45.50	1,911,000.00	
	MEG ENERGY CORP	17,500	51.42	899,850.00	
	NEXEN INC	74,200	21.01	1,558,942.00	
	NIKO RESOURCES LTD	6,700	72.70	487,090.00	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	35,900	26.63	956,017.00	
	PENGROWTH ENERGY CORP	47,500	12.41	589,475.00	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	64,478	23.41	1,509,429.98	
	PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	10,800	15.33	165,564.00	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	26,300	14.84	390,292.00	
	SUNCOR ENERGY INC	222,032	38.80	8,614,841.60	
	TALISMAN ENERGY INC	145,400	19.76	2,873,104.00	
	TOURMALINE OIL CORP	15,700	30.09	472,413.00	
	TRANSCANADA CORP	99,050	42.02	4,162,081.00	
	VERMILION ENERGY INC	12,400	49.30	611,320.00	
	AGNICO-EAGLE MINES	23,800	61.18	1,456,084.00	
	AGRIUM INC	22,300	82.49	1,839,527.00	
	BARRICK GOLD CORP	141,500	43.25	6,119,875.00	
	CENTERRA GOLD INC	23,800	15.35	365,330.00	
	ELDORADO GOLD CORPORATION	77,400	14.09	1,090,566.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	12,300	122.33	1,504,659.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	17,900	37.51	671,429.00	
GOLDCORP INC	113,140	46.42	5,251,958.80		
IAMGOLD CORP	52,800	20.43	1,078,704.00		

INMET MINING CORPORATION	7,500	66.99	502,425.00
IVANHOE MINES LTD	37,100	22.05	818,055.00
KINROSS GOLD CORP	159,820	15.25	2,437,255.00
OSISKO MINING CORP	48,500	14.12	684,820.00
PAN AMERICAN SILVER CORP	15,000	29.52	442,800.00
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	121,100	53.98	6,536,978.00
SILVER WHEATON CORP	50,000	32.33	1,616,500.00
SINO-FOREST CORPORATION	34,700	5.15	178,705.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	82,045	47.50	3,897,137.50
YAMANA GOLD INC	106,600	11.60	1,236,560.00
BOMBARDIER INC CL B	202,940	7.06	1,432,756.40
CAE INC	36,900	12.28	453,132.00
FINNING INTERNATIONAL INC	24,200	28.60	692,120.00

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
カナダドル	SNC-LAVALIN GROUP INC	21,800	54.15	1,180,470.00	
	RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	14,000	25.35	354,900.00	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	65,400	74.30	4,859,220.00	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	23,910	59.36	1,419,297.60	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	30,800	44.91	1,383,228.00	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	16,600	33.48	555,768.00	
	TIM HORTONS INC	24,903	43.62	1,086,268.86	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	52,540	20.69	1,087,052.60	
	THOMSON REUTERS CORP	52,953	36.55	1,935,432.15	
	YELLOW MEDIA INC	73,000	3.65	266,450.00	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	11,100	61.70	684,870.00	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	18,000	26.59	478,620.00	
	EMPIRE CO LTD 'A'	4,200	57.00	239,400.00	
	LOBLAW COMPANIES LTD	16,100	40.13	646,093.00	
	METRO INC -A	14,800	48.00	710,400.00	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	31,300	39.25	1,228,525.00	
	WESTON (GEORGE) LTD	7,500	70.58	529,350.00	
	SAPUTO INC	20,800	46.09	958,672.00	
	VITERRA INC	52,500	11.08	581,700.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	41,000	52.48	2,151,680.00	
BANK OF MONTREAL	80,500	60.23	4,848,515.00		
BANK OF NOVA SCOTIA	152,700	58.24	8,893,248.00		

CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	56,000	77.14	4,319,840.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	23,000	77.62	1,785,260.00	
ROYAL BANK OF CANADA	202,100	54.86	11,087,206.00	
TORONTO-DOMINION BANK	125,150	79.78	9,984,467.00	
CI FINANCIAL CORP	22,800	22.88	521,664.00	
IGM FINANCIAL INC	16,700	49.09	819,803.00	
ONEX CORPORATION	13,600	35.30	480,080.00	
TMX GROUP INC	10,700	44.30	474,010.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,900	381.55	1,106,495.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	40,900	25.69	1,050,721.00	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	12,100	40.66	491,986.00	
INTACT FINANCIAL CORP	16,300	53.86	877,918.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	252,000	16.08	4,052,160.00	
POWER CO OF CANADA	49,200	26.55	1,306,260.00	
POWER FINANCIAL CORP	35,700	29.97	1,069,929.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	80,800	28.62	2,312,496.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT-CL A	78,925	31.08	2,452,989.00	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	35,525	18.16	645,134.00	
CGI GROUP INC	34,300	22.21	761,803.00	
OPEN TEXT CORP	8,200	60.25	494,050.00	
RESEARCH IN MOTION	66,400	36.65	2,433,560.00	
BCE INC	35,892	38.38	1,377,534.96	
BELL ALIANT INC	10,700	29.05	310,835.00	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	60,900	37.10	2,259,390.00	
TELUS CORP	7,300	51.79	378,067.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	22,200	49.75	1,104,450.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
カナダドル	CANADIAN UTILITIES LTD A	12,200	56.87	693,814.00	
	FORTIS INC	24,600	32.16	791,136.00	
	TRANSALTA CORP	31,200	20.91	652,392.00	
カナダドル 小計		5,219,663		182,518,574.25 (15,065,083,118)	
ユーロ	CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	20,672	25.51	527,342.72	
	ENI SPA	340,614	16.26	5,538,383.64	
	FUGRO NV-CVA	9,806	52.63	516,089.78	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	32,682	14.62	477,810.84	

NESTE OIL OYJ	18,111	11.07	200,488.77
OMV AG	21,557	28.54	615,236.78
REPSOL YPF SA	112,473	22.44	2,523,894.12
SAIPEM	37,401	36.22	1,354,664.22
SBM OFFSHORE NV	23,679	17.93	424,682.86
TECHNIP S.A.	13,902	73.37	1,019,989.74
TENARIS SA	66,707	16.18	1,079,319.26
TOTAL SA	299,718	38.66	11,587,097.88
ACERINOX SA	14,331	12.39	177,561.09
AIR LIQUIDE	40,275	94.00	3,785,850.00
AKZO NOBEL	32,726	48.47	1,586,392.85
ARCELORMITTAL	121,275	22.53	2,732,932.12
ARKEMA	7,844	73.74	578,416.56
BASF SE	130,178	64.00	8,331,392.00
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	28,479	5.43	154,783.36
CRH PLC	100,170	14.54	1,456,471.80
ERAMET	762	227.50	173,355.00
HEIDELBERGCEMENT AG	19,866	46.45	922,775.70
IMERYS SA	5,421	49.02	265,737.42
K+S AG	24,415	54.49	1,330,373.35
KONINKLIJKE DSM NV	22,162	45.61	1,010,919.63
LAFARGE SA	28,326	45.58	1,291,099.08
LANXESS	11,754	57.04	670,448.16
LINDE AG	23,885	115.05	2,747,969.25
OUTOKUMPU OYJ	18,406	9.42	173,476.55
RAUTARUUKKI OYJ	12,773	15.80	201,813.40
SALZGITTER AG	6,046	50.55	305,625.30
SOLVAY SA	8,521	106.80	910,042.80
STORA ENSO OYJ-R SHS	82,183	7.33	602,401.39
THYSSENKRUPP AG	47,241	34.41	1,625,799.01
UMICORE	16,104	36.58	589,084.32
UPM-KYMMENE OYJ	73,453	12.49	917,427.97
VOESTALPINE AG	15,791	35.33	557,974.98
WACKER CHEMIE AG	2,211	149.90	331,428.90
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,003	32.08	641,696.24
ALSTOM	29,093	42.20	1,227,870.06
BEKAERT NV	5,492	67.92	373,016.64
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	10,410	31.98	332,963.85
BOUYGUES	33,705	31.18	1,050,921.90

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	BRENNTAG AG	4,744	82.01	389,055.44	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	56,237	43.88	2,467,679.56	
	EIFFAGE	5,821	45.17	262,934.57	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	57,659	21.57	1,243,992.92	
	FERROVIAL SA	51,982	8.52	443,302.49	
	FIAT INDUSTRIAL	108,006	8.99	970,973.94	
	FINMECCANICA SPA	57,170	8.16	466,793.05	
	FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	7,217	20.08	144,917.36	
	GEA GROUP AG	24,749	23.80	589,026.20	
	HOCHTIEF AG	6,087	58.95	358,828.65	
	KONE OYJ-B	22,376	42.86	959,035.36	
	LEGRAND SA	27,973	28.48	796,671.04	
	MAN SE	14,936	95.18	1,421,608.48	
	METSO OYJ	18,053	38.95	703,164.35	
	PHILIPS ELECTRONICS NV	139,297	18.02	2,510,131.94	
	PRYSMIAN SPA	28,913	14.99	433,405.87	
	SAFRAN S.A.	23,565	27.88	656,992.20	
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	34,691	114.10	3,958,243.10	
	SIEMENS AG-REG	116,615	91.18	10,632,955.70	
	THALES SA	14,108	29.03	409,555.24	
	VALLOUREC	15,881	83.47	1,325,587.07	
	VINCI S.A.	62,995	42.60	2,683,587.00	
	WARTSILA OYJ	23,762	23.86	566,961.32	
	WENDEL	4,653	82.23	382,616.19	
	ZARDOYA OTIS SA	19,745	11.60	229,042.00	
	BIC	3,933	64.09	252,065.97	
	BUREAU VERITAS SA	7,731	55.41	428,374.71	
	EDENRED	22,338	20.03	447,541.83	
	RANDSTAD HOLDING NV	16,871	32.65	550,922.50	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	52,373	15.59	816,756.93	
	ADP	4,909	65.01	319,134.09	
	AIR FRANCE - KLM	20,501	10.71	219,565.71	
	ATLANTIA SPA	45,290	15.17	687,049.30	
DEUTSCHE POST AG-REG	119,553	12.62	1,509,356.62		
FRAPORT AG	5,191	54.20	281,352.20		

GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	74,510	7.78	579,687.80
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	135,081	2.52	341,349.68
LUFTHANSA (REGD)	32,345	14.08	455,417.60
POSTNL	54,083	6.60	356,947.80
TNT EXPRESS NV - W/I	54,083	8.47	458,083.01
VOPAK (KON)	10,104	33.90	342,525.60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	46,772	62.93	2,943,361.96
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	7,501	41.50	311,291.50
CONTINENTAL AG	11,339	70.12	795,090.68
DAIMLER AG	128,381	47.43	6,089,110.83
FIAT SPA	109,875	7.27	798,791.25
MICHELIN CLASS B (BROWN BDS)	24,939	65.19	1,625,773.41
NOKIAN RENKAAT OYJ	15,537	33.27	516,915.99

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	PEUGEOT SA	21,491	28.41	610,559.31	
	PIRELLI & CO SPA	34,184	6.79	232,109.36	
	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PFD	21,631	47.70	1,031,798.70	
	RENAULT SA	27,154	37.20	1,010,264.57	
	VOLKSWAGEN AG	4,168	118.30	493,074.40	
	VOLKSWAGEN AG (PREF)	20,498	127.50	2,613,495.00	
	ADIDAS-SALOMON AG	29,555	49.75	1,470,361.25	
	CHRISTIAN DIOR	7,727	103.90	802,835.30	
	LUXOTTICA GROUP SPA	16,717	21.35	356,907.95	
	LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	34,770	116.90	4,064,613.00	
	ACCOR SA	21,100	29.58	624,243.50	
	AUTOGRILL SPA	16,968	8.63	146,518.68	
	OPAP SA	31,544	11.50	362,756.00	
	SODEXO	13,319	53.47	712,166.93	
	TUI AG	20,994	7.43	156,132.37	
	AXEL SPRINGER AG	6,399	34.13	218,429.86	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	14,235	30.84	439,078.57	
	JC DECAUX SA	10,079	21.89	220,679.70	
	KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	10,205	42.00	428,610.00	
	LAGARDERE S.C.A.	16,672	27.30	455,145.60	
	M6-METROPOLE TELEVISION	9,975	15.81	157,704.75	
MEDIASET ESPANA COMUNICACION	23,643	6.09	144,009.51		

MEDIASET SPA	101,851	3.52	358,719.22	
PROSIEBEN SAT1 MEDIA AG-PFD	11,005	19.30	212,396.50	
PUBLICIS GROUPE	17,598	37.60	661,684.80	
REED ELSEVIER NV	98,823	9.13	902,253.99	
SANOMAWSOY OYJ	11,628	12.70	147,675.60	
SES	43,068	19.11	823,029.48	
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	17,287	12.38	214,013.06	
VIVENDI SA	174,670	18.84	3,290,782.80	
WOLTERS KLUWER	42,920	15.26	654,959.20	
INDITEX	30,819	60.83	1,874,719.77	
PPR	10,729	116.00	1,244,564.00	
CARREFOUR SA	81,842	29.58	2,420,886.36	
CASINO GUICHARD PERRACHON	7,799	70.69	551,311.31	
COLRUYT SA	10,653	38.78	413,176.60	
DELHAIZE GROUP	14,573	54.44	793,354.12	
JERONIMO MARTINS	31,652	13.09	414,324.68	
KESKO OYJ-B SHS	9,615	33.26	319,794.90	
KONINKLIJKE AHOLD NV	168,370	9.40	1,583,014.74	
METRO AG	18,631	44.90	836,625.05	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	113,753	40.42	4,597,896.26	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	25,861	17.88	462,394.68	
DANONE	82,375	50.28	4,141,815.00	
HEINEKEN HOLDING NV	16,276	35.04	570,311.04	
HEINEKEN NV	36,616	40.68	1,489,721.96	
KERRY GROUP PLC-A	19,836	29.30	581,194.80	
PARMALAT SPA	172,173	2.58	445,239.37	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	PERNOD-RICARD	27,995	68.13	1,907,299.35	
	SUEDZUCKER AG	9,525	22.35	212,883.75	
	UNILEVER NV-CVA	230,116	22.32	5,136,189.12	
	BEIERSDORF AG	14,240	45.82	652,548.00	
	HENKEL AG & CO KGAA	18,668	40.11	748,773.48	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	25,168	48.72	1,226,184.96	
	L'OREAL	33,859	85.41	2,891,897.19	
	CELESIO AG	12,054	16.00	192,924.27	
	ESSILOR INTERNATIONAL	28,565	55.72	1,591,641.80	

FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	27,844	50.78	1,413,918.32
FRESENIUS SE & CO KGAA	16,117	72.79	1,173,156.43
BAYER AG	117,205	56.02	6,565,824.10
ELAN CORP PLC	73,241	7.17	525,723.89
GRIFOLS SA	19,903	13.51	268,889.53
MERCK KGAA	9,129	76.61	699,372.69
ORION OYJ	13,356	17.89	238,938.84
QIAGEN N.V.	33,460	13.27	444,014.20
SANOFI	157,939	52.54	8,298,115.06
UCB SA	14,247	33.00	470,151.00
ALPHA BANK A.E.	72,940	3.27	238,513.80
ANGLO IRISH BANK CORP PLC	126,938	0.01	1,269.38
BANCA CARIGE SPA	91,616	1.60	147,410.14
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	353,719	0.76	270,948.75
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	602,679	7.75	4,670,762.25
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REG	474,822	0.44	212,245.43
BANCO DE SABADELL SA	152,194	2.85	433,905.09
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	75,447	2.59	195,634.07
BANCO POPOLARE SPA	249,940	1.58	397,154.66
BANCO POPULAR ESPANOL	136,446	3.88	529,410.48
BANCO SANTANDER SA	1,196,261	7.87	9,415,770.33
BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD	120,501	2.08	250,642.08
BANKINTER SA	30,197	4.49	135,644.92
BNP PARIBAS	135,911	52.35	7,114,940.85
COMMERZBANK AG	507,179	3.11	1,577,326.69
CREDIT AGRICOLE SA	135,707	10.19	1,383,532.86
DEXIA	88,725	2.33	206,817.97
EFG EUROBANK ERGASIAS	49,038	3.09	151,527.42
ERSTE GROUP BANK AG	27,174	33.96	922,964.91
INTESA SANPAOLO	1,428,072	1.78	2,541,968.16
INTESA SANPAOLO-RNC	134,006	1.52	204,359.15
KBC GROUP	23,146	27.07	626,677.95
NATIONAL BANK OF GREECE	137,398	4.90	673,250.20
NATIXIS	125,377	3.51	440,574.77
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	7,024	34.99	245,804.88
SOCIETE GENERALE	89,626	39.84	3,570,699.84
UBI BANCA SCPA-RTS	85,774	0.20	17,583.67
UNICREDIT SPA	1,905,826	1.49	2,853,021.52
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	85,774	4.33	372,087.61

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	CRITERIA CAIXACORP SA	120,818	4.93	596,236.83	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	131,740	39.74	5,236,006.30	
	DEUTSCHE BOERSE AG	27,547	52.91	1,457,511.77	
	EURAZEO	4,301	52.54	225,974.54	
	EURAZEO - RTS	4,097	1.09	4,465.73	
	EXOR SPA	9,213	22.62	208,398.06	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,595	61.31	710,889.45	
	ING GROEP NV-CVA	541,124	8.12	4,393,926.88	
	MEDIOBANCA SPA	73,228	7.15	523,580.20	
	POHJOLA BANK PLC	19,515	9.01	175,927.72	
	AEGON NV	242,787	4.53	1,100,310.68	
	AGEAS	321,054	1.90	610,002.60	
	ALLIANZ SE-REG	64,332	93.43	6,010,538.76	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	164,947	14.59	2,406,576.73	
	AXA	246,626	14.92	3,679,659.92	
	CNP ASSURANCES	21,876	14.17	310,092.30	
	DELTA LLOYD NV	14,248	15.71	223,836.08	
	HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	8,666	36.00	311,976.00	
	MAPFRE SA	108,218	2.59	280,717.49	
	MAPFRE SA-RTS	108,218	0.01	1,082.18	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	26,624	103.65	2,759,577.60	
	SAMPO OYJ-A SHS	59,340	22.78	1,351,765.20	
	SCOR SE	23,868	19.10	455,878.80	
	VIENNA INSURANCE GROUP AG	5,519	38.38	211,819.22	
	IMMOFINANZ AG	142,559	2.98	426,108.85	
	AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	34,890	14.07	491,076.75	
	ATOS ORIGIN	6,936	37.88	262,735.68	
	CAP GEMINI SA	21,267	37.40	795,385.80	
	DASSAULT SYSTEMS SA	8,365	58.12	486,173.80	
	INDRA SISTEMAS SA	12,973	13.75	178,443.61	
	SAP AG	130,411	42.22	5,505,952.42	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,952	13.82	234,276.64	
	ALCATEL-LUCENT	327,499	3.69	1,210,108.80	
NEOPOST SA	4,494	59.31	266,539.14		
NOKIA OYJ	529,024	4.30	2,279,035.39		

BELGACOM SA	21,488	23.99	515,604.56
DEUTSCHE TELEKOM AG (REGD)	400,461	10.14	4,062,676.84
ELISA CORPORATION-A SHS	19,120	14.93	285,461.60
FRANCE TELECOM SA	261,916	15.27	4,000,766.90
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	34,621	6.08	210,495.68
ILIAD SA	2,708	88.20	238,845.60
KONINKLIJKE KPN NV	222,152	10.03	2,229,295.32
MOBISTAR SA	4,253	52.46	223,112.38
PORTUGAL TELECOM SGPS SA (REGD	95,299	7.26	692,442.53
TELECOM ITALIA SPA	1,325,833	0.95	1,265,507.59
TELECOM ITALIA-RNC	865,998	0.84	733,067.30
TELEFONICA S.A.	582,180	16.43	9,568,128.30
TELEKOM AUSTRIA AG	46,935	8.69	407,959.02

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	A2A SPA	157,578	1.17	184,523.83	
	ACCIONA S.A.	3,744	73.00	273,312.00	
	E.ON AG	254,401	19.50	4,962,091.50	
	EDP RENOVAVEIS SA	31,340	4.60	144,383.38	
	ELECTRICITE DE FRANCE	34,066	27.33	931,023.78	
	ENAGAS	25,294	16.10	407,233.40	
	ENEL GREEN POWER SPA	248,032	1.91	474,733.24	
	ENEL SPA	929,842	4.61	4,286,571.62	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	269,607	2.57	695,316.45	
	FORTUM OYJ	62,747	23.14	1,451,965.58	
	GAS NATURAL SDG SA	45,574	13.31	606,817.81	
	GDF SUEZ	174,787	24.69	4,315,491.03	
	IBERDROLA RENOVABLES	124,421	3.05	380,479.41	
	IBERDROLA SA	534,599	6.10	3,262,123.09	
	PUBLIC POWER CORP	17,603	9.57	168,460.71	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,287	41.77	638,537.99	
	RWE AG	59,151	39.02	2,308,072.02	
	RWE AG-NON VTG PFD	5,510	36.59	201,610.90	
	SNAM RETE GAS	227,746	4.09	932,847.61	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	38,047	14.28	543,501.39	
	TERNA SPA	184,046	3.35	616,922.19	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,182	20.20	993,722.31		

	VERBUND AG	9,620	31.70	304,954.00	
	ASML HOLDING NV	60,925	26.22	1,597,758.12	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	153,517	7.64	1,173,637.46	
	STMICROELECTRONICS NV	91,578	7.25	663,940.50	
	ユーロ 小計	26,542,716		342,610,781.57 (40,013,513,179)	
英ポンド	AMEC PLC	46,772	11.14	521,040.08	
	BG GROUP PLC	480,180	13.70	6,580,866.90	
	BP PLC	2,664,396	4.50	11,991,114.19	
	CAIRN ENERGY PLC	197,693	4.24	838,416.01	
	ESSAR ENERGY PLC	46,829	4.26	199,491.54	
	PETROFAC LTD	36,628	15.44	565,536.32	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	505,128	21.47	10,845,098.16	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	382,083	21.64	8,270,186.53	
	TULLOW OIL PLC	125,447	13.23	1,659,663.81	
	ANGLO AMERICAN PLC	187,127	29.88	5,592,290.39	
	ANTOFAGASTA PLC	56,670	12.56	711,775.20	
	BHP BILLITON PLC	309,284	23.24	7,189,306.58	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES	37,931	8.02	304,206.62	
	FRESNILLO PLC	25,329	14.17	358,911.93	
	GLENORE INTERNATIONAL-W/I	117,741	5.15	606,366.15	
	JOHNSON MATTHEY PLC	30,326	19.84	601,667.84	
	KAZAKHMYS PLC	30,244	12.43	375,932.92	
	LONMIN PLC	23,258	15.44	359,103.52	
RANDGOLD RESOURCES LTD	13,079	48.43	633,415.97		
REXAM PLC	126,011	3.92	494,215.14		

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
英ポンド	RIO TINTO PLC	204,820	41.99	8,601,415.90	
	VEDANTA RESOURCES PLC	16,847	20.44	344,352.68	
	XSTRATA PLC	293,161	13.65	4,001,647.65	
	BAE SYSTEMS PLC	481,524	3.19	1,537,506.13	
	BALFOUR BEATTY PLC	98,617	3.12	307,980.89	
	BUNZL PLC	47,308	7.79	368,765.86	
	COBHAM PLC	165,915	2.15	357,878.65	
	INVENSYS PLC	114,322	3.02	346,281.33	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	264,412	6.10	1,612,913.20	

SMITHS GROUP PLC	56,233	11.61	652,865.13
WEIR GROUP PLC/THE	29,772	20.50	610,326.00
WOLSELEY PLC	40,193	19.71	792,204.03
AGGREKO PLC	38,908	19.34	752,480.72
BABCOCK INTL GROUP PLC	51,514	6.88	354,416.32
CAPITA GROUP PLC	88,052	7.35	647,182.20
EXPERIAN PLC	142,615	8.02	1,144,485.37
G4S PLC	199,266	2.83	564,719.84
INTERTEK GROUP PLC	22,929	19.89	456,057.81
SERCO GROUP PLC	70,876	5.81	412,143.94
BURBERRY GROUP PLC	62,598	13.08	818,781.84
CARNIVAL PLC	25,746	23.13	595,504.98
COMPASS GROUP PLC	266,762	5.98	1,596,570.57
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	40,823	12.06	492,325.38
TUI TRABEL PLC	84,827	2.18	185,092.51
WHITBREAD PLC	24,956	15.45	385,570.20
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	160,948	8.35	1,344,720.54
ITV PLC	530,952	0.66	355,206.88
PEARSON PLC	114,784	11.61	1,332,642.24
REED ELSEVIER PLC	171,587	5.48	940,296.76
WPP PLC	178,213	7.34	1,308,974.48
HOME RETAIL PLC	117,835	1.74	205,622.07
KINGFISHER PLC	333,661	2.74	914,231.14
MARKS & SPENCER GROUP PLC	227,567	3.67	836,991.42
NEXT PLC	25,897	22.54	583,718.38
MORRISON <WM.>#194 SUPERMARKETS	320,190	2.97	951,604.68
SAINSBURY (J) PLC	174,293	3.27	570,983.86
TESCO PLC	1,140,446	4.09	4,671,266.81
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	50,326	10.46	526,409.96
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	283,007	27.30	7,726,091.10
DIAGEO PLC	354,897	12.89	4,574,622.33
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	143,859	21.10	3,035,424.90
SABMILLER PLC	134,392	22.42	3,013,740.60
UNILEVER PLC	181,306	19.64	3,560,849.84
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	87,117	34.86	3,036,898.62
SMITH & NEPHEW PLC	127,749	6.60	843,782.14
ASTRAZENECA PLC	197,176	31.74	6,259,352.12
GLAXOSMITHKLINE PLC	735,144	12.95	9,520,114.80
SHIRE PLC	79,419	18.70	1,485,135.30

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
英ポンド	BARCLAYS PLC	1,640,448	2.59	4,264,344.57	
	HSBC HLDGS PLC	2,509,624	6.21	15,602,332.40	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,769,800	0.47	2,758,829.87	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,456,734	0.41	1,008,734.98	
	STANDARD CHARTERED PLC	332,812	15.66	5,213,499.98	
	3I GROUP PLC	137,106	2.72	373,613.85	
	ICAP PLC	79,245	4.69	372,372.25	
	INVESTEC PLC	71,201	5.02	357,785.02	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	21,429	9.45	202,504.05	
	MAN GROUP PLC	266,352	2.42	645,903.60	
	SCHRODERS PLC	16,241	15.44	250,761.04	
	ADMIRAL GROUP PLC	28,455	17.48	497,393.40	
	AVIVA PLC	398,350	4.31	1,718,481.90	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	828,726	1.16	961,322.16	
	OLD MUTUAL PLC	770,683	1.28	991,869.02	
	PRUDENTIAL PLC	359,598	7.20	2,590,903.59	
	RESOLUTION LTD	205,194	3.16	648,618.23	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	492,973	1.37	675,373.01	
	STANDARD LIFE PLC	322,499	2.06	664,347.94	
	AUTONOMY CORP PLC	32,682	17.98	587,622.36	
	SAGE GROUP PLC	186,134	2.89	539,602.46	
	BT GROUP PLC	1,096,144	1.97	2,159,403.68	
	INMARSAT PLC	65,283	5.98	390,392.34	
	VODAFONE GROUP PLC	7,338,700	1.61	11,844,661.80	
	CENTRICA PLC	728,041	3.27	2,380,694.07	
	INTERNATIONAL POWER PLC	219,539	3.19	700,768.48	
NATIONAL GRID PLC	497,208	6.00	2,985,734.04		
SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	131,603	14.10	1,855,602.30		
SEVERN TRENT PLC	33,495	14.67	491,371.65		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	96,285	6.06	583,968.52		
ARM HOLDINGS PLC	190,643	5.66	1,079,992.59		
	英ポンド 小計	41,569,144		209,635,561.05 (27,571,268,989)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	45,066	54.50	2,456,097.00	
	GIVAUDAN-REG	1,195	907.50	1,084,462.50	

HOLCIM LTD-REG	34,654	64.45	2,233,450.30	
SIKA AG-BR	294	2,100.00	617,400.00	
SYNGENTA AG	13,364	285.90	3,820,767.60	
ABB LTD	310,694	21.83	6,782,450.02	
GEBERIT AG-REG	5,595	198.40	1,110,048.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,042	102.70	312,413.40	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,867	103.00	707,301.00	
SULZER AG-REG	3,399	146.10	496,593.90	
ADECCO SA-REG	18,777	54.65	1,026,163.05	
SGS SA	774	1,635.00	1,265,490.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	7,761	128.80	999,616.80	
CIE FINANC RICHEMONT-BR A	73,740	53.25	3,926,655.00	
THE SWATCH GROUP AG-B	4,357	403.50	1,758,049.50	

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	THE SWATCH GROUP AG-REG	6,240	72.35	451,464.00	
	ARYZTA AG	11,936	45.85	547,265.60	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	129	2,665.00	343,785.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	16	30,965.00	495,440.00	
	NESTLE SA-REGISTERD	491,103	53.15	26,102,124.45	
	SONOVA HOLDING AG	6,964	87.55	609,698.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,124	221.80	249,303.20	
	SYNTHESES INC	9,254	147.90	1,368,666.60	
	ACTELION LTD-REG	15,591	44.31	690,837.21	
	LONZA GROUP AG-REG	6,845	69.65	476,754.25	
	NOVARTIS AG-REG SHS	330,772	52.20	17,266,298.40	
	ROCHE HLDGS AG GENUSSCHINE	99,576	142.60	14,199,537.60	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	159,125	34.53	5,494,586.25	
	GAM HOLDING LTD	30,432	14.50	441,264.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	29,695	34.78	1,032,792.10	
	PARGESA HOLDING SA-BR	3,818	77.70	296,658.60	
	UBS AG REG	515,803	15.43	7,958,840.29	
	BALOISE HOLDING AG-REG	7,186	87.75	630,571.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	4,380	136.80	599,184.00	
	SWISS RE LTD	49,749	49.50	2,462,575.50	
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	20,574	219.60	4,518,050.40		
SWISSCOM AG (REG)	3,293	387.10	1,274,720.30		

スイスフラン 小計		2,333,184		116,107,375.52 (11,091,737,583)
スウェーデン クローナ	BOLIDEN AB	38,637	114.20	4,412,345.40
	HOLMEN AB-B SHARES	7,461	208.10	1,552,634.10
	SSAB AB-A SHARES	25,509	96.15	2,452,690.35
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	82,408	94.35	7,775,194.80
	ALFA LAVAL AB	48,521	132.20	6,414,476.20
	ASSA ABLOY AB B	44,847	168.40	7,552,234.80
	ATLAS COPCO AB-A SHS	94,861	158.30	15,016,496.30
	ATLAS COPCO AB-B SHS	55,124	141.70	7,811,070.80
	HEXAGON AB-B SHS	36,460	157.20	5,731,512.00
	SANDVIK AB	142,442	112.20	15,981,992.40
	SCANIA AB-B SHS	45,987	143.70	6,608,331.90
	SKANSKA AB-B SHS	57,393	110.50	6,341,926.50
	SKF AB-B SHS	55,081	178.00	9,804,418.00
	VOLVO AB-B SHS	194,700	107.40	20,910,780.00
	SECURITAS AB-B SHS	44,999	64.70	2,911,435.30
	ELECTROLUX AB-SER B	33,887	155.90	5,282,983.30
	HUSQVARNA AB-B SHS	62,678	45.99	2,882,561.22
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	7,294	422.20	3,079,526.80
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	144,438	223.50	32,281,893.00
	SWEDISH MATCH AB	31,104	212.70	6,615,820.80
GETINGE AB-B SHS	28,763	169.00	4,860,947.00	
NORDEA BANK AB	371,190	68.90	25,574,991.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK-A	199,253	52.55	10,470,745.15	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	69,131	197.30	13,639,546.30	

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	SWEDBANK AB - A SHARES	114,729	105.90	12,149,801.10	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,631	104.30	1,734,613.30	
	INVESTOR AB-B SHS	64,343	142.60	9,175,311.80	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	30,664	143.60	4,403,350.40	
	RATOS AB-B SHS	29,254	120.90	3,536,808.60	
	ERICSSON(L.M.)TEL CLASS B	425,427	89.80	38,203,344.60	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	10,930	677.00	7,399,610.00	
	TELE2 AB -B SHS	44,785	120.30	5,387,635.50	
TELIASONERA AB	306,857	46.32	14,213,616.24		

スウェーデンクローナ 小計		2,965,788		322,170,644.96 (4,159,223,026)
ノルウェー クローネ	AKER SOLUTIONS ASA	23,626	109.50	2,587,047.00
	SEADRILL LTD	43,982	186.80	8,215,837.60
	STATOIL ASA	157,654	135.40	21,346,351.60
	SUBSEA 7 SA	40,442	135.50	5,479,891.00
	NORSK HYDRO ASA	131,960	40.65	5,364,174.00
	YARA INTERNATIONAL ASA	26,773	335.10	8,971,632.30
	ORKLA ASA	110,899	50.00	5,544,950.00
	DNB NOR ASA	138,054	79.20	10,933,876.80
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	28,346	68.50	1,941,701.00
	TELENOR ASA	105,740	87.40	9,241,676.00
	RENEWABLE ENERGY CORP AS	71,650	11.14	798,181.00
ノルウェークローネ 小計		879,126		80,425,318.30 (1,195,120,229)
デンマーク クローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	6,515	868.00	5,655,020.00
	VESTAS WIND SYSTEM AS	28,776	144.30	4,152,376.80
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	78	44,200.00	3,447,600.00
	A P MOLLER MAERSK A/S	187	45,960.00	8,594,520.00
	DSV A/S	29,546	125.50	3,708,023.00
	PANDORA A/S	8,416	167.30	1,407,996.80
	CARLSBERG AS-B	15,112	583.50	8,817,852.00
	COLOPLAST-B	3,273	765.50	2,505,481.50
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,438	478.50	1,645,083.00
	NOVO NORDISK AS-B	59,138	637.00	37,670,906.00
	DANSKE BANK AS	92,440	101.50	9,382,660.00
	TRYG A/S	3,675	306.00	1,124,550.00
	TDC A/S	52,618	47.15	2,480,938.70
デンマーククローネ 小計		303,212		90,593,007.80 (1,418,686,502)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	19,071	12.67	241,629.57
	ORIGIN ENERGY LIMITED	149,952	15.65	2,346,748.80
	PALADIN ENERGY LTD	100,516	2.71	272,398.36
	SANTOS	124,091	14.00	1,737,274.00
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	88,164	43.71	3,853,648.44
	WORLEYPARSONS LTD	27,115	28.97	785,521.55
	ALUMINA LTD	344,710	2.18	751,467.80
	AMCOR LTD	175,997	7.05	1,240,778.85
	BHP BILLITON LTD	455,169	42.95	19,549,508.55

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
オーストラリア ドル	BLUESCOPE STEEL LIMITED	264,739	1.30	344,160.70	
	BORAL LIMITED	104,098	4.43	461,154.14	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	178,898	6.35	1,136,002.30	
	ILUKA RESOURCES LIMITED	59,344	17.18	1,019,529.92	
	INCITEC PIVOT LTD	234,061	3.67	859,003.87	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	61,559	5.65	347,808.35	
	LYNAS CORP LTD	239,573	2.10	503,103.30	
	MACARTHUR COAL LTD	23,345	10.96	255,861.20	
	NEWCREST MINING LIMITED	108,096	37.40	4,042,790.40	
	ONESTEEL LIMITED	191,804	1.83	351,960.34	
	ORICA LIMITED	51,152	25.65	1,312,048.80	
	OZ MINERALS LTD	45,969	13.38	615,065.22	
	RIO TINTO LTD	61,557	79.79	4,911,633.03	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	23,138	16.30	377,149.40	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	21,419	21.72	465,220.68	
	BRAMBLES LTD	202,637	7.15	1,448,854.55	
	ASCIANO LTD	413,350	1.52	628,292.00	
	MAP GROUP	61,192	3.13	191,530.96	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	159,503	1.90	303,055.70	
	QR NATIONAL LTD	241,277	3.24	781,737.48	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	96,464	5.10	491,966.40	
	TRANSURBAN GROUP	186,412	5.46	1,017,809.52	
	CROWN LTD	66,589	8.48	564,674.72	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	97,005	4.21	408,391.05	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	97,005	3.26	316,236.30	
	TATTS GROUP LTD	186,948	2.23	416,894.04	
	FAIRFAX MEDIA LTD	304,194	0.99	302,673.03	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	76,332	2.48	189,303.36	
	METCASH LTD	110,471	4.04	446,302.84	
	WESFARMERS LTD	141,995	31.49	4,471,422.55	
	WESFARMERS LTD-PPP	21,459	31.91	684,756.69	
	WOOLWORTHS LIMITED	171,278	26.78	4,586,824.84	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	80,096	11.61	929,914.56	
FOSTER'S GROUP LTD	272,757	4.44	1,211,041.08		
COCHLEAR LIMITED	8,144	74.40	605,913.60		

RAMSAY HEALTH CARE LTD	18,877	18.00	339,786.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	52,128	11.96	623,450.88	
CSL LIMITED	77,410	32.72	2,532,855.20	
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	367,952	21.50	7,910,968.00	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	52,365	8.60	450,339.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	219,537	49.60	10,889,035.20	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	307,499	24.28	7,466,075.72	
WESTPAC BANKING CORPORATION	426,430	21.79	9,291,909.70	
ASX LTD	24,741	30.99	766,723.59	
MACQUARIE GROUP LTD	48,861	31.38	1,533,258.18	
AMP LIMITED	397,880	4.88	1,941,654.40	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	298,773	3.58	1,069,607.34	
QBE INSURANCE GROUP LTD	148,555	17.25	2,562,573.75	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
オーストラリア ドル	SUNCORP GROUP LTD	181,013	8.09	1,464,395.17	
	LEND LEASE GROUP	75,898	8.82	669,420.36	
	COMPUTERSHARE LTD	62,796	9.15	574,583.40	
	TELSTRA CORPORATION LTD	615,211	3.02	1,857,937.22	
	AGL ENERGY LTD	66,286	14.16	938,609.76	
	SP AUSNET	194,121	0.92	178,591.32	
オーストラリアドル 小計		9,784,978		120,840,837.03 (10,329,474,749)	
ニュージーラン ドル	FLETCHER BUILDING LTD	96,176	8.57	824,228.32	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	130,329	2.28	297,150.12	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	87,272	3.51	306,324.72	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	276,577	2.32	643,041.52	
	CONTACT ENERGY LIMITED	44,339	5.86	259,826.54	
ニュージーランドドル 小計		634,693		2,330,571.22 (154,703,317)	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA LTD	302,000	86.85	26,228,700.00	
	NWS HOLDINGS LTD	188,500	10.56	1,990,560.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	170,000	18.20	3,094,000.00	
	MTR CORPORATION	207,500	27.55	5,716,625.00	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	31,500	56.20	1,770,300.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	105,000	25.50	2,677,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	175,000	16.86	2,950,500.00	

SANDS CHINA LTD	341,200	19.30	6,585,160.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	202,000	19.54	3,947,080.00	
SJM HOLDINGS LTD	230,000	18.50	4,255,000.00	
WYNN MACAU LTD	224,000	23.40	5,241,600.00	
ESPRIT HOLDINGS LTD	173,578	27.80	4,825,468.40	
LI & FUNG LTD	796,400	16.60	13,220,240.00	
LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	89,500	22.60	2,022,700.00	
BANK OF EAST ASIA LIMITED	216,420	32.40	7,012,008.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	523,000	22.95	12,002,850.00	
HANG SENG BANK LTD	108,100	122.20	13,209,820.00	
WING HANG BANK LIMITED	27,000	80.70	2,178,900.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	144,700	169.40	24,512,180.00	
AIA GROUP LTD	1,106,000	27.95	30,912,700.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	197,000	116.90	23,029,300.00	
HANG LUNG GROUP LTD	124,000	49.25	6,107,000.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	347,000	30.85	10,704,950.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	154,585	50.25	7,767,896.25	
HOPEWELL HOLDINGS	82,000	24.10	1,976,200.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	90,000	38.75	3,487,500.00	
KERRY PROPERTIES LTD	106,000	39.50	4,187,000.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	360,000	12.62	4,543,200.00	
SINO LAND CO	376,000	13.16	4,948,160.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	200,000	116.40	23,280,000.00	
SWIRE PACIFIC CL A	103,000	115.00	11,845,000.00	
WHARF HOLDINGS LTD	215,000	54.45	11,706,750.00	
WHEELOCK & CO LTD	132,000	31.45	4,151,400.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
香港ドル	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	309,000	3.69	1,140,210.00	
	PCCW LTD	622,000	3.12	1,940,640.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	65,000	39.85	2,590,250.00	
	CLP HOLDINGS LTD	272,000	64.95	17,666,400.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	669,973	17.50	11,724,527.50	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	196,000	55.95	10,966,200.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	27,900	102.50	2,859,750.00	
香港ドル 小計		10,009,856		340,976,225.15 (3,518,874,643)	

シンガポール ドル	COSCO CORP SINGAPORE LTD	143,000	1.85	264,550.00	
	FRASER & NEAVE LTD	139,500	5.72	797,940.00	
	KEPPEL CORP LTD	200,500	11.08	2,221,540.00	
	NOBLE GROUP LTD	537,145	2.01	1,079,661.45	
	SEBACORP INDUSTRIES LIMITED	139,000	4.98	692,220.00	
	SEBACORP MARINE LTD	120,400	5.21	627,284.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	240,000	2.94	705,600.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	272,000	1.53	416,160.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	266,000	1.41	375,060.00	
	NEPTUNE ORIENT LINES LTD	140,000	1.68	235,200.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	76,600	14.22	1,089,252.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	860,400	1.97	1,694,988.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	216,250	3.81	823,912.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	16,000	39.56	632,960.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	178,800	2.74	489,912.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	983,720	0.68	668,929.60	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	276,000	5.33	1,471,080.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	245,000	14.66	3,591,700.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	354,000	9.32	3,299,280.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	175,000	19.14	3,349,500.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	122,000	7.49	913,780.00	
	CAPITALAND LIMITED	362,000	3.00	1,086,000.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	196,000	1.58	309,680.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	71,000	10.82	768,220.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	261,000	2.06	537,660.00		
KEPPEL LAND LTD	105,000	3.92	411,600.00		
UOL GROUP LTD	67,400	4.97	334,978.00		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,125,880	3.11	3,501,486.80		
STARHUB LTD	87,000	2.78	241,860.00		
シンガポールドル 小計		7,976,595		32,631,994.35 (2,133,479,790)	
イスラエル シェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	63,732	54.80	3,492,513.60	
	ISRAEL CORP LTD	327	3,590.00	1,173,930.00	
	MAKHTESHIM-AGAN INDUSTRIES	33,000	17.65	582,450.00	
	DELEK GROUP LTD	633	779.50	493,423.50	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,688	166.80	615,158.40	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	133,181	167.00	22,241,227.00	
	BANK HAPOLIM BM	150,307	16.69	2,508,623.83	
	BANK LEUMI LE- ISRAEL	166,527	15.70	2,614,473.90	

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	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	112,026	6.50	728,169.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	19,485	35.70	695,614.50	
	NICE SYSTEMS LTD	9,047	113.00	1,022,311.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	250,636	8.93	2,239,432.66	
	CELLCOM ISRAEL LTD	7,107	101.30	719,939.10	
	PARTNER COMMUNICATIONS CO	12,263	55.75	683,662.25	
イスラエルシェケル 小計		961,959		39,810,928.74 (945,907,666)	
合計		152,514,218		255,129,861,077 (255,129,861,077)	

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	251,000	502,000.00	
		CAPITAMALL TRUST	271,600	529,620.00	
	シンガポールドル 小計		522,600	1,031,620.00 (67,447,315)	
投資信託受益証券 合計			522,600	67,447,315 (67,447,315)	
投資証券	米ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,129	1,608,669.27	
		BOSTON PROPERTIES INC	20,200	2,083,832.00	
		DUKE REALTY CORP	36,300	501,666.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	41,700	2,524,518.00	
		FED REALTY INVS TRUST	8,900	742,972.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	61,197	977,316.09	
		HCP INC	56,700	2,042,334.00	
		HEALTH CARE REIT INC	24,300	1,242,459.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	96,481	1,578,429.16	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	751,000	645,860.00	
		KIMCO REALTY CORP	58,400	1,031,928.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	16,500	546,315.00	
		MACERICH CO	18,700	954,635.00	
		PLUM CREEK TIMBER CO	23,300	919,418.00	
		PROLOGIS INC	58,440	1,909,234.80	

	PUBLIC STORAGE INC	20,500	2,357,295.00	
	REGENCY CENTERS CORP	11,800	505,158.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	41,465	4,710,009.35	
	VENTAS INC	23,100	1,220,835.00	
	VORNADO REALTY TRUST	23,249	2,177,501.34	
	米ドル 小計	1,404,361	30,280,385.01 (2,432,726,131)	
カナダドル	CRESCENT POINT ENERGY CORP	34,400	1,557,976.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	18,400	459,264.00	
	カナダドル 小計	52,800	2,017,240.00 (166,502,989)	
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	0.00	
	CORIO NV	8,356	388,470.44	
	FONCIERE DES REGIONS	3,781	274,009.07	

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	ユーロ	GECINA SA	3,106	310,600.00	
		ICADE	3,344	291,764.00	
		KLEPIERRE	14,784	429,031.68	
		UNIBAIL	12,957	1,984,364.55	
		ユーロ 小計	1,651,912	3,678,239.74 (429,581,619)	
	英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	124,984	736,780.68	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	79,141	306,196.52	
		HAMMERSON PLC	101,570	489,262.69	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	110,206	934,546.88	
		SEGRO PLC	106,565	347,401.90	
		英ポンド 小計	522,466	2,814,188.67 (370,122,093)	
	オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	282,061	526,043.76	
		DEXUS PROPERTY GROUP	683,575	625,471.12	
		GOODMAN GROUP	899,810	665,859.40	
		GPT GROUP	249,012	774,427.32	
		MIRVAC GROUP	490,879	633,233.91	
		STOCKLAND	342,460	1,188,336.20	
WESTFIELD GROUP		309,703	2,697,513.13		
WESTFIELD RETAIL TRUST		414,847	1,082,750.67		

オーストラリアドル 小計		3,672,347	8,193,635.51 (700,391,963)	
香港ドル	LINK REIT	319,000	8,676,800.00	
香港ドル 小計		319,000	8,676,800.00 (89,544,576)	
投資証券 合計		7,622,886	4,188,869,371 (4,188,869,371)	
合計			4,256,316,686 (4,256,316,686)	

(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	592	98.3%		1.7%	54.0%
カナダドル	101	98.9%		1.1%	5.9%
ユーロ	268	98.9%		1.1%	15.6%
英ポンド	104	98.7%		1.3%	10.8%
スイスフラン	37	100.0%			4.3%
スウェーデンクローナ	33	100.0%			1.6%
ノルウェークローネ	11	100.0%			0.5%
デンマーククローネ	13	100.0%			0.5%
オーストラリアドル	71	93.7%		6.3%	4.3%
ニュージーランドドル	5	100.0%			0.1%
香港ドル	41	97.5%		2.5%	1.4%
シンガポールドル	31	96.9%	3.1%		0.8%
イスラエルシェケル	14	100.0%			0.4%
合計	1,321	98.4%	0.0%	1.6%	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。

[次へ](#)

「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6月10日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	530,224,334
コール・ローン	5,791,938,616
国債証券	413,130,754,152
派生商品評価勘定	70,574,870
未収利息	4,946,685,289
前払費用	261,209,654
差入委託証拠金	258,677,730
流動資産合計	424,990,064,645
資産合計	424,990,064,645
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	56,223,562
未払解約金	290,740,895
流動負債合計	346,964,457
負債合計	346,964,457
純資産の部	
元本等	
元本	278,752,660,011
剰余金	
剰余金	145,890,440,177
純資産合計	424,643,100,188
負債・純資産合計	424,990,064,645

(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6月10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 6月10日現在	
1. 計算日における受益権総数	278,752,660,011 口
2. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5234 円 (15,234 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 6月10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6月10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6月10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6月10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6月10日現在

計算期間の期首元本額	287,334,220,980 円
計算期間中の追加設定元本額	28,199,425,217 円
計算期間中の一部解約元本額	36,780,986,186 円
計算日の元本額	278,752,660,011 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	7,264,628,013 円
中央三井D C 外国債券インデックスファンド	1,833,887,169 円
中央三井D C 外国債券インデックスファンドL	8,254,658,432 円
物価連動債組入世界債券ファンド	130,351,103 円
中央三井D C バランスファンド3 0	83,299,039 円
中央三井D C バランスファンド5 0	130,021,250 円
中央三井D C バランスファンド7 0	28,936,011 円
ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)	166,243,011 円
ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)	104,199,031 円
新生・4分散ファンド	123,953,805 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	420,522,159 円
4資産インデックスバランスオープン(分配型)	60,579,408 円
4資産インデックスバランスオープン(成長型)	127,638,256 円
C M A M 外国債券インデックスe	362,212,277 円
中央三井インデックスコレクション(外国債券)	6,132,087 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式3 0)	648,546 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式5 0)	987,831 円
中央三井インデックスコレクション(バランス株式7 0)	330,205 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)	563,883,712 円
中央三井外国債券インデックスファンドV A(適格機関投資家専用)	19,359,811,158 円
中央三井バランスV A 3 0(適格機関投資家専用)	8,315,026,938 円
中央三井バランスV A 5 0(適格機関投資家専用)	27,149,691,544 円
中央三井V A バランスファンド(株2 5 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	94,933,509,954 円
中央三井V A バランスファンド(株5 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	5,052,332,734 円
中央三井V A バランス株式3 0(適格機関投資家専用)	116,501,059 円
中央三井V A バランスファンド(株6 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	10,104,646,418 円
中央三井バランスV A 2 5(適格機関投資家専用)	7,782,285,173 円
中央三井バランスV A 3 7. 5(適格機関投資家専用)	2,257,422,502 円
中央三井バランスV A 5 0 L(適格機関投資家専用)	21,210,340,005 円
中央三井バランスV A 7 5(適格機関投資家専用)	822,938,002 円
中央三井V A バランスファンド(株4 0 / 1 0 0)(適格機関投資家専用)	34,820,285,732 円
中央三井V A ポートフォリオ4 0(適格機関投資家専用)	5,869,204,931 円

中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	521,460,915 円
中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)	2,765,294,919 円
中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)	2,821,275,310 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)	430,037,915 円
CMAM・VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	169,201,211 円
中央三井バランスVA20(適格機関投資家専用)	3,875,264,532 円
中央三井VAファンド25(適格機関投資家専用)	7,007,721,317 円
中央三井バランスVA20L(適格機関投資家専用)	49,678,719 円
中央三井バランスVA25L(適格機関投資家専用)	1,035,916,704 円
中央三井世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	307,436,291 円
CMAM・VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	2,250,676,109 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)	59,752,448 円
中央三井世界バランスVA20(適格機関投資家専用)	1,836,126 円

2. 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成23年6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	5,181,420,229
合計	5,181,420,229

(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6月10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6月10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	3,949,784,390		3,970,153,848	20,369,458
	合計	3,949,784,390		3,970,153,848	20,369,458

(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6月10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	3,010,254,490		2,980,243,000	30,011,490
	カナダドル	328,553,800		321,828,000	6,725,800
	ユーロ	3,606,927,500		3,642,912,000	35,984,500
	英ポンド	624,832,650		618,050,000	6,782,650
	計	7,570,568,440		7,563,033,000	7,535,440
	売 建				
	米ドル	867,529,640		859,531,000	7,998,640
	カナダドル	82,968,800		82,520,000	448,800
	ユーロ	1,042,468,850		1,050,840,000	8,371,150
英ポンド	159,241,000		157,800,000	1,441,000	
計	2,152,208,290		2,150,691,000	1,517,290	
合計	9,722,776,730		9,713,724,000	6,018,150	

(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6月10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6月10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 0.750% 2012/05/31	9,000,000	9,045,703.17	
		US TREASURY N/B 4.750% 2012/05/31	8,120,000	8,476,518.75	
		US TREASURY N/B 1.875% 2012/06/15	30,000,000	30,494,531.40	
		US TREASURY N/B 0.625% 2012/06/30	16,050,000	16,110,187.50	
		US TREASURY N/B 1.500% 2012/07/15	13,000,000	13,173,671.94	
		US TREASURY N/B 0.625% 2012/07/31	5,000,000	5,019,921.90	
		US TREASURY N/B 4.625% 2012/07/31	2,910,000	3,053,908.60	
		US TREASURY N/B 1.750% 2012/08/15	40,000,000	40,684,375.20	
		US TREASURY N/B 4.375% 2012/08/15	7,100,000	7,442,796.87	
		US TREASURY N/B 0.375% 2012/08/31	5,000,000	5,004,687.50	
		US TREASURY N/B 4.125% 2012/08/31	7,200,000	7,536,937.53	
		US TREASURY N/B 1.375% 2012/09/15	12,700,000	12,872,640.62	
		US TREASURY N/B 0.375% 2012/09/30	18,600,000	18,620,343.75	
		US TREASURY N/B 4.250% 2012/09/30	9,140,000	9,609,139.10	
		US TREASURY N/B 1.375% 2012/10/15	2,000,000	2,028,906.26	
		US TREASURY N/B 0.375% 2012/10/31	10,000,000	10,008,593.80	
		US TREASURY N/B 3.875% 2012/10/31	18,200,000	19,107,156.25	
		US TREASURY N/B 1.375% 2012/11/15	4,000,000	4,060,312.52	
		US TREASURY N/B 4.000% 2012/11/15	17,000,000	17,897,812.50	
		US TREASURY N/B 0.500% 2012/11/30	15,000,000	15,038,671.95	
		US TREASURY N/B 1.125% 2012/12/15	9,000,000	9,107,578.17	
		US TREASURY N/B 0.625% 2012/12/31	1,120,000	1,124,900.00	
		US TREASURY N/B 0.625% 2013/01/31	6,570,000	6,598,743.75	
		US TREASURY N/B 2.875% 2013/01/31	17,740,000	18,481,476.65	
		US TREASURY N/B 1.375% 2013/02/15	1,000,000	1,016,875.00	
		US TREASURY N/B 3.875% 2013/02/15	9,650,000	10,221,460.93	
		US TREASURY N/B 0.625% 2013/02/28	27,450,000	27,570,093.75	
		US TREASURY N/B 2.750% 2013/02/28	15,630,000	16,269,853.12	
		US TREASURY N/B 1.375% 2013/03/15	9,880,000	10,052,128.17	
		US TREASURY N/B 0.750% 2013/03/31	8,200,000	8,252,531.25	
		US TREASURY N/B 1.750% 2013/04/15	24,000,000	24,596,250.00	
		US TREASURY N/B 0.625% 2013/04/30	13,700,000	13,755,656.25	
		US TREASURY N/B 3.125% 2013/04/30	12,700,000	13,354,843.75	
		US TREASURY N/B 1.375% 2013/05/15	10,000,000	10,184,375.00	
		US TREASURY N/B 3.625% 2013/05/15	10,000,000	10,617,187.50	
		US TREASURY N/B 1.125% 2013/06/15	11,410,000	11,565,996.15	
		US TREASURY N/B 1.000% 2013/07/15	17,030,000	17,221,587.50	
		US TREASURY N/B 3.375% 2013/07/31	17,810,000	18,917,559.37	
		US TREASURY N/B 0.750% 2013/08/15	15,000,000	15,089,062.50	
		US TREASURY N/B 4.250% 2013/08/15	6,930,000	7,494,145.31	
US TREASURY N/B 3.125% 2013/08/31	3,210,000	3,396,581.25			
US TREASURY N/B 0.750% 2013/09/15	15,000,000	15,087,890.70			
US TREASURY N/B 0.500% 2013/10/15	13,700,000	13,688,226.63			
US TREASURY N/B 2.750% 2013/10/31	21,600,000	22,732,312.60			
US TREASURY N/B 0.500% 2013/11/15	15,000,000	14,982,421.95			

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 4.250% 2013/11/15	11,250,000	12,253,710.93	
		US TREASURY N/B 2.000% 2013/11/30	6,500,000	6,729,531.25	

US TREASURY N/B	1.500%	2013/12/31	40,120,000	41,032,103.32	
US TREASURY N/B	1.750%	2014/01/31	18,900,000	19,468,476.65	
US TREASURY N/B	4.000%	2014/02/15	4,000,000	4,358,750.00	
US TREASURY N/B	1.875%	2014/02/28	2,000,000	2,066,406.26	
US TREASURY N/B	1.250%	2014/03/15	15,100,000	15,347,734.37	
US TREASURY N/B	1.750%	2014/03/31	13,000,000	13,395,078.19	
US TREASURY N/B	1.250%	2014/04/15	5,110,000	5,192,638.30	
US TREASURY N/B	1.875%	2014/04/30	6,880,000	7,116,500.00	
US TREASURY N/B	4.750%	2014/05/15	9,300,000	10,395,656.25	
US TREASURY N/B	2.250%	2014/05/31	5,000,000	5,226,953.15	
US TREASURY N/B	2.625%	2014/06/30	13,000,000	13,744,453.19	
US TREASURY N/B	2.625%	2014/07/31	32,650,000	34,527,375.00	
US TREASURY N/B	4.250%	2014/08/15	12,550,000	13,912,851.56	
US TREASURY N/B	2.375%	2014/08/31	26,000,000	27,285,781.38	
US TREASURY N/B	2.375%	2014/09/30	12,150,000	12,743,261.77	
US TREASURY N/B	2.375%	2014/10/31	15,950,000	16,730,054.68	
US TREASURY N/B	4.250%	2014/11/15	9,230,000	10,268,375.00	
US TREASURY N/B	2.125%	2014/11/30	11,400,000	11,860,453.18	
US TREASURY N/B	2.625%	2014/12/31	3,480,000	3,680,371.89	
US TREASURY N/B	2.250%	2015/01/31	20,900,000	21,824,171.87	
US TREASURY N/B	11.250%	2015/02/15	2,550,000	3,497,484.37	
US TREASURY N/B	4.000%	2015/02/15	10,020,000	11,111,240.62	
US TREASURY N/B	2.375%	2015/02/28	5,500,000	5,767,265.62	
US TREASURY N/B	2.500%	2015/03/31	12,820,000	13,504,067.25	
US TREASURY N/B	2.500%	2015/04/30	8,930,000	9,403,010.93	
US TREASURY N/B	4.125%	2015/05/15	7,040,000	7,850,700.00	
US TREASURY N/B	2.125%	2015/05/31	6,950,000	7,212,796.87	
US TREASURY N/B	1.875%	2015/06/30	17,900,000	18,385,257.90	
US TREASURY N/B	1.750%	2015/07/31	2,000,000	2,042,031.26	
US TREASURY N/B	4.250%	2015/08/15	500,000	561,796.87	
US TREASURY N/B	1.250%	2015/08/31	9,690,000	9,683,943.75	
US TREASURY N/B	1.250%	2015/09/30	21,980,000	21,930,201.67	
US TREASURY N/B	1.250%	2015/10/31	10,000,000	9,958,593.80	
US TREASURY N/B	4.500%	2015/11/15	12,160,000	13,824,400.00	
US TREASURY N/B	1.375%	2015/11/30	25,000,000	24,994,140.75	
US TREASURY N/B	2.125%	2015/12/31	11,000,000	11,350,625.00	
US TREASURY N/B	4.500%	2016/02/15	7,700,000	8,770,781.25	
US TREASURY N/B	2.625%	2016/02/29	27,900,000	29,373,468.75	
US TREASURY N/B	2.250%	2016/03/31	4,150,000	4,292,980.48	
US TREASURY N/B	2.375%	2016/03/31	7,900,000	8,219,703.12	
US TREASURY N/B	5.125%	2016/05/15	22,000,000	25,767,500.00	
US TREASURY N/B	7.250%	2016/05/15	1,670,000	2,125,596.87	
US TREASURY N/B	3.250%	2016/07/31	3,560,000	3,844,800.00	
US TREASURY N/B	4.875%	2016/08/15	3,750,000	4,358,789.06	
US TREASURY N/B	3.000%	2016/08/31	1,030,000	1,098,881.25	
US TREASURY N/B	3.000%	2016/09/30	4,000,000	4,265,000.00	
US TREASURY N/B	3.125%	2016/10/31	5,400,000	5,791,500.00	
US TREASURY N/B	4.625%	2016/11/15	7,450,000	8,576,812.50	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B 7.500% 2016/11/15	8,250,000	10,735,312.50	
		US TREASURY N/B 2.750% 2016/11/30	15,500,000	16,294,375.00	
		US TREASURY N/B 3.250% 2016/12/31	9,800,000	10,553,375.00	
		US TREASURY N/B 3.125% 2017/01/31	5,000,000	5,352,343.75	
		US TREASURY N/B 4.625% 2017/02/15	23,500,000	27,058,046.87	
		US TREASURY N/B 3.000% 2017/02/28	31,550,000	33,497,226.56	

US TREASURY N/B	3.250%	2017/03/31	15,300,000	16,459,453.12	
US TREASURY N/B	3.125%	2017/04/30	4,900,000	5,231,515.62	
US TREASURY N/B	4.500%	2017/05/15	15,530,000	17,789,129.68	
US TREASURY N/B	8.750%	2017/05/15	5,200,000	7,212,562.50	
US TREASURY N/B	2.750%	2017/05/31	9,900,000	10,347,046.87	
US TREASURY N/B	2.500%	2017/06/30	11,900,000	12,251,421.87	
US TREASURY N/B	2.375%	2017/07/31	10,000,000	10,207,812.50	
US TREASURY N/B	1.875%	2017/08/31	2,000,000	1,980,312.50	
US TREASURY N/B	1.875%	2017/09/30	8,210,000	8,115,071.87	
US TREASURY N/B	1.875%	2017/10/31	4,900,000	4,837,218.75	
US TREASURY N/B	4.250%	2017/11/15	4,350,000	4,927,054.68	
US TREASURY N/B	2.250%	2017/11/30	2,000,000	2,014,375.00	
US TREASURY N/B	2.750%	2017/12/31	11,000,000	11,415,937.50	
US TREASURY N/B	2.625%	2018/01/31	30,250,000	31,114,960.93	
US TREASURY N/B	3.500%	2018/02/15	4,000,000	4,335,000.00	
US TREASURY N/B	2.625%	2018/04/30	5,600,000	5,730,375.00	
US TREASURY N/B	3.875%	2018/05/15	2,040,000	2,255,475.00	
US TREASURY N/B	3.750%	2018/11/15	8,040,000	8,797,518.75	
US TREASURY N/B	2.750%	2019/02/15	2,000,000	2,042,812.50	
US TREASURY N/B	3.125%	2019/05/15	46,920,000	49,024,068.75	
US TREASURY N/B	3.625%	2019/08/15	18,400,000	19,820,250.00	
US TREASURY N/B	8.125%	2019/08/15	9,600,000	13,605,000.00	
US TREASURY N/B	3.375%	2019/11/15	25,070,000	26,441,015.62	
US TREASURY N/B	3.625%	2020/02/15	27,430,000	29,388,673.43	
US TREASURY N/B	3.500%	2020/05/15	26,650,000	28,161,554.68	
US TREASURY N/B	2.625%	2020/08/15	11,000,000	10,780,000.00	
US TREASURY N/B	8.750%	2020/08/15	6,800,000	10,107,562.50	
US TREASURY N/B	2.625%	2020/11/15	15,000,000	14,622,656.25	
US TREASURY N/B	3.625%	2021/02/15	31,230,000	32,986,687.50	
US TREASURY N/B	8.125%	2021/08/15	1,750,000	2,544,609.37	
US TREASURY N/B	8.000%	2021/11/15	6,100,000	8,826,890.62	
US TREASURY N/B	7.250%	2022/08/15	100,000	138,625.00	
US TREASURY N/B	7.125%	2023/02/15	2,850,000	3,924,984.37	
US TREASURY N/B	6.250%	2023/08/15	10,080,000	13,018,950.00	
US TREASURY N/B	7.500%	2024/11/15	4,690,000	6,727,951.56	
US TREASURY N/B	7.625%	2025/02/15	1,200,000	1,741,312.50	
US TREASURY N/B	6.875%	2025/08/15	6,340,000	8,686,790.62	
US TREASURY N/B	6.000%	2026/02/15	1,940,000	2,462,284.37	
US TREASURY N/B	6.750%	2026/08/15	1,000,000	1,361,406.25	
US TREASURY N/B	6.500%	2026/11/15	5,150,000	6,864,789.06	
US TREASURY N/B	6.625%	2027/02/15	2,500,000	3,375,390.62	
US TREASURY N/B	6.375%	2027/08/15	1,640,000	2,168,643.75	
US TREASURY N/B	6.125%	2027/11/15	6,700,000	8,660,796.87	
US TREASURY N/B	5.500%	2028/08/15	3,750,000	4,551,562.50	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B 5.250% 2028/11/15	4,350,000	5,136,398.43	
		US TREASURY N/B 5.250% 2029/02/15	2,000,000	2,360,937.50	
		US TREASURY N/B 6.125% 2029/08/15	2,200,000	2,858,968.75	
		US TREASURY N/B 6.250% 2030/05/15	3,520,000	4,648,050.00	
		US TREASURY N/B 5.375% 2031/02/15	7,480,000	8,974,831.24	
		US TREASURY N/B 4.500% 2036/02/15	10,720,000	11,363,200.00	
		US TREASURY N/B 5.000% 2037/05/15	7,230,000	8,242,200.00	
		US TREASURY N/B 4.375% 2038/02/15	3,200,000	3,307,000.00	
		US TREASURY N/B 4.500% 2038/05/15	9,500,000	10,018,046.87	
		US TREASURY N/B 3.500% 2039/02/15	17,420,000	15,375,871.87	

		US TREASURY N/B	4.250%	2039/05/15	8,710,000	8,773,964.06	
		US TREASURY N/B	4.500%	2039/08/15	19,450,000	20,416,421.87	
		US TREASURY N/B	4.375%	2039/11/15	14,800,000	15,204,687.50	
		US TREASURY N/B	4.625%	2040/02/15	14,900,000	15,954,640.62	
		US TREASURY N/B	4.375%	2040/05/15	11,800,000	12,115,281.25	
		US TREASURY N/B	3.875%	2040/08/15	28,910,000	27,193,468.75	
		US TREASURY N/B	4.250%	2040/11/15	14,820,000	14,880,206.25	
		US TREASURY N/B	4.750%	2041/02/15	7,900,000	8,625,812.50	
		US TREASURY N/B	4.375%	2041/05/15	6,350,000	6,514,703.12	
		米ドル 小計			1,838,240,000	1,945,903,493.58 (156,333,886,674)	
カナダドル	国債証券	CANADA-GOV'T	1.500%	2012/06/01	1,940,000	1,944,791.80	
		CANADA-GOV'T	3.750%	2012/06/01	1,090,000	1,116,192.70	
		CANADA-GOV'T	5.250%	2012/06/01	8,030,000	8,338,432.30	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2012/09/01	6,320,000	6,373,720.00	
		CANADA-GOV'T	1.500%	2012/12/01	6,300,000	6,312,852.00	
		CANADA-GOV'T	1.750%	2013/03/01	6,900,000	6,934,500.00	
		CANADA-GOV'T	3.500%	2013/06/01	2,590,000	2,688,575.40	
		CANADA-GOV'T	5.250%	2013/06/01	5,760,000	6,173,798.40	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2013/08/01	440,000	443,876.40	
		CANADA-GOV'T	2.500%	2013/09/01	3,810,000	3,883,456.80	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2014/03/01	3,380,000	3,401,970.00	
		CANADA-GOV'T	3.000%	2014/06/01	8,100,000	8,377,506.00	
		CANADA-GOV'T	5.000%	2014/06/01	3,090,000	3,374,094.60	
		CANADA-GOV'T	2.250%	2014/08/01	3,200,000	3,237,152.00	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2014/12/01	8,010,000	8,026,340.40	
		CANADA-GOV'T	2.500%	2015/06/01	1,900,000	1,932,300.00	
		CANADA-GOV'T	4.500%	2015/06/01	4,490,000	4,908,378.20	
		CANADA-GOV'T	3.000%	2015/12/01	2,210,000	2,287,637.30	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2016/06/01	1,200,000	1,185,360.00	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2016/06/01	5,570,000	6,026,461.50	
		CANADA-GOV'T	2.750%	2016/09/01	3,840,000	3,920,064.00	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2017/06/01	4,950,000	5,369,859.00	
		CANADA-GOV'T	4.250%	2018/06/01	1,800,000	1,981,872.00	
		CANADA-GOV'T	3.750%	2019/06/01	9,650,000	10,286,900.00	
CANADA-GOV'T	3.500%	2020/06/01	3,730,000	3,891,285.20			
CANADA-GOV'T	3.250%	2021/06/01	3,560,000	3,621,232.00			
CANADA-GOV'T	8.000%	2023/06/01	2,200,000	3,261,368.00			
CANADA-GOV'T	9.000%	2025/06/01	600,000	987,246.00			
CANADA-GOV'T	8.000%	2027/06/01	2,690,000	4,235,835.40			

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
カナダドル	国債証券	CANADA-GOV'T	5.750%	2029/06/01	5,160,000	6,747,422.40
		CANADA-GOV'T	5.750%	2033/06/01	5,660,000	7,579,589.00
		CANADA-GOV'T	5.000%	2037/06/01	5,910,000	7,343,175.00
		CANADA-GOV'T	4.000%	2041/06/01	6,180,000	6,714,570.00
		カナダドル 小計			140,260,000	152,907,813.80 (12,621,010,951)
メキシコ ペソ	国債証券	MEXICAN BONOS	7.500%	2012/06/21	42,230,000	43,395,970.30
		MEXICAN BONOS	9.000%	2012/12/20	41,510,000	43,903,466.60
		MEXICAN BONOS	9.000%	2013/06/20	45,110,000	48,301,081.40
		MEXICAN BONOS	8.000%	2013/12/19	34,010,000	36,004,686.50
		MEXICAN BONOS	7.000%	2014/06/19	16,970,000	17,602,302.20
		MEXICAN BONOS	9.500%	2014/12/18	43,720,000	48,732,935.20
		MEXICAN BONOS	6.000%	2015/06/18	21,210,000	21,163,550.10
		MEXICAN BONOS	8.000%	2015/12/17	17,840,000	19,126,264.00

		MEXICAN BONOS	7.250%	2016/12/15	25,890,000	27,063,075.90	
		MEXICAN BONOS	7.750%	2017/12/14	22,600,000	24,140,868.00	
		MEXICAN BONOS	8.500%	2018/12/13	16,620,000	18,500,553.00	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2020/06/11	33,670,000	36,267,303.80	
		MEXICAN BONOS	6.500%	2021/06/10	16,730,000	16,157,499.40	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2023/12/07	10,140,000	10,895,937.00	
		MEXICAN BONOS	10.000%	2024/12/05	33,460,000	41,692,498.40	
		MEXICAN BONOS	7.500%	2027/06/03	37,480,000	37,451,515.20	
		MEXICAN BONOS	8.500%	2029/05/31	34,840,000	37,769,347.20	
		MEXICAN BONOS	10.000%	2036/11/20	26,350,000	32,351,739.50	
		MEXICAN BONOS	8.500%	2038/11/18	26,370,000	27,953,782.20	
		メキシコペソ 小計			546,750,000	588,474,375.90 (4,007,510,499)	
ユーロ	国債証券 (ベルギー)	BELGIAN 0262	8.000%	2012/12/24	3,120,000	3,391,440.00	
		BELGIAN 0282	8.000%	2015/03/28	2,160,000	2,530,440.00	
		BELGIAN 0291	5.500%	2028/03/28	6,120,000	6,798,708.00	
		BELGIAN 0298	5.000%	2012/09/28	5,510,000	5,721,584.00	
		BELGIAN 0300	5.500%	2017/09/28	2,550,000	2,796,585.00	
		BELGIAN 0301	4.250%	2013/09/28	4,410,000	4,572,729.00	
		BELGIAN 0303	4.250%	2014/09/28	3,400,000	3,538,380.00	
		BELGIAN 0304	5.000%	2035/03/28	5,680,000	5,994,104.00	
		BELGIAN 0306	3.750%	2015/09/28	7,630,000	7,780,311.00	
		BELGIAN 0307	3.250%	2016/09/28	5,820,000	5,743,176.00	
		BELGIAN 0308	4.000%	2022/03/28	5,340,000	5,250,822.00	
		BELGIAN 0309	4.000%	2017/03/28	5,640,000	5,732,496.00	
		BELGIAN 0310	4.000%	2013/03/28	5,770,000	5,941,946.00	
		BELGIAN 0312	4.000%	2018/03/28	4,620,000	4,675,440.00	
		BELGIAN 0314	4.000%	2014/03/28	5,220,000	5,392,260.00	
		BELGIAN 0315	4.000%	2019/03/28	3,360,000	3,376,464.00	
		BELGIAN 0316	3.500%	2015/03/28	4,330,000	4,386,290.00	
		BELGIAN 0318	3.750%	2020/09/28	7,610,000	7,414,423.00	
		BELGIAN 0319	2.750%	2016/03/28	2,600,000	2,527,200.00	
		BELGIAN 0320	4.250%	2041/03/28	2,300,000	2,145,900.00	
		BELGIAN 0321	4.250%	2021/09/28	3,120,000	3,139,032.00	
		BELGIAN 0323	3.500%	2017/06/28	270,000	266,274.00	

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 2.500% 2012/07/01	6,260,000	6,276,589.00	
		BTPS 4.250% 2012/10/15	9,900,000	10,133,640.00	
		BTPS 2.000% 2012/12/15	7,550,000	7,497,225.50	
		BTPS 4.750% 2013/02/01	10,080,000	10,416,672.00	
		BTPS 4.250% 2013/04/15	4,760,000	4,874,240.00	
		BTPS 2.000% 2013/06/01	8,420,000	8,271,471.20	
		BTPS 4.250% 2013/08/01	10,360,000	10,611,748.00	
		BTPS 2.250% 2013/11/01	1,040,000	1,017,536.00	
		BTPS 3.750% 2013/12/15	8,210,000	8,306,057.00	
		BTPS 3.000% 2014/04/01	240,000	237,360.00	
		BTPS 3.500% 2014/06/01	12,020,000	12,044,040.00	
		BTPS 4.250% 2014/08/01	4,170,000	4,265,910.00	
		BTPS 4.250% 2015/02/01	14,730,000	15,049,641.00	
		BTPS 3.000% 2015/04/15	14,500,000	14,152,000.00	
		BTPS 3.000% 2015/06/15	1,880,000	1,826,796.00	
		BTPS 3.750% 2015/08/01	15,140,000	15,161,196.00	
		BTPS 3.000% 2015/11/01	4,200,000	4,055,940.00	
		BTPS 3.750% 2016/08/01	8,430,000	8,386,164.00	
		BTPS 4.000% 2017/02/01	11,380,000	11,387,966.00	

	BTPS	5.250%	2017/08/01	13,570,000	14,386,914.00	
	BTPS	4.500%	2018/02/01	7,060,000	7,158,840.00	
	BTPS	4.500%	2018/08/01	6,760,000	6,822,192.00	
	BTPS	4.250%	2019/02/01	1,820,000	1,806,168.00	
	BTPS	4.500%	2019/03/01	11,620,000	11,678,100.00	
	BTPS	4.250%	2019/09/01	17,810,000	17,592,718.00	
	BTPS	4.500%	2020/02/01	15,820,000	15,851,640.00	
	BTPS	4.250%	2020/03/01	6,310,000	6,191,372.00	
	BTPS	4.000%	2020/09/01	3,250,000	3,116,425.00	
	BTPS	3.750%	2021/03/01	8,240,000	7,672,264.00	
	BTPS	3.750%	2021/08/01	14,100,000	13,191,960.00	
	BTPS	4.750%	2021/09/01	1,200,000	1,200,120.00	
	BTPS	4.750%	2023/08/01	3,830,000	3,805,105.00	
	BTPS	9.000%	2023/11/01	7,420,000	10,174,304.00	
	BTPS	5.000%	2025/03/01	9,370,000	9,390,614.00	
	BTPS	4.500%	2026/03/01	4,740,000	4,455,600.00	
	BTPS	7.250%	2026/11/01	4,000,000	4,883,600.00	
	BTPS	6.500%	2027/11/01	9,740,000	11,078,276.00	
	BTPS	5.250%	2029/11/01	10,800,000	10,804,320.00	
	BTPS	6.000%	2031/05/01	12,330,000	13,230,090.00	
	BTPS	5.750%	2033/02/01	6,980,000	7,279,442.00	
	BTPS	5.000%	2034/08/01	8,250,000	7,840,800.00	
	BTPS	4.000%	2037/02/01	9,360,000	7,609,680.00	
	BTPS	5.000%	2039/08/01	9,810,000	9,170,388.00	
	BTPS	5.000%	2040/09/01	6,140,000	5,715,112.00	
国債証券 (ドイツ)	BUNDESUBL - 151	4.250%	2012/10/12	6,530,000	6,762,337.40	
	BUNDESUBL - 152	3.500%	2013/04/12	8,050,000	8,331,911.00	
	BUNDESUBL - 153	4.000%	2013/10/11	10,750,000	11,310,075.00	
	BUNDESUBL - 154	2.250%	2014/04/11	9,740,000	9,853,958.00	
	BUNDESUBL - 155	2.500%	2014/10/10	4,000,000	4,070,200.00	
	BUNDESUBL - 156	2.500%	2015/02/27	11,270,000	11,441,304.00	

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)	BUNDESUBL - 157	2.250%	2015/04/10	10,150,000	10,203,287.50	
		BUNDESUBL - 158	1.750%	2015/10/09	7,930,000	7,788,053.00	
		BUNDESUBL - 159	2.000%	2016/02/26	1,280,000	1,264,704.00	
		BUNDESSCHATZANW	0.500%	2012/06/15	8,230,000	8,152,391.10	
		BUNDESSCHATZANW	0.750%	2012/09/14	2,020,000	2,000,729.20	
		BUNDESSCHATZANW	1.000%	2012/12/14	7,290,000	7,230,586.50	
		BUNDESSCHATZANW	1.500%	2013/03/15	1,040,000	1,038,866.40	
		BUNDESSCHATZANW	1.750%	2013/06/14	1,100,000	1,101,870.00	
		DEUTSCHLAND REP	5.000%	2012/07/04	9,700,000	10,056,184.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.500%	2013/01/04	8,460,000	8,845,353.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.750%	2013/07/04	10,450,000	10,888,900.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.250%	2014/01/04	13,440,000	14,263,872.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.250%	2014/07/04	7,250,000	7,750,250.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.750%	2015/01/04	13,360,000	14,150,244.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.250%	2015/07/04	7,850,000	8,189,120.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.500%	2016/01/04	11,440,000	12,061,764.00	
		DEUTSCHLAND REP	6.000%	2016/06/20	1,050,000	1,229,025.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.000%	2016/07/04	7,300,000	7,870,130.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.750%	2017/01/04	9,250,000	9,873,450.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.250%	2017/07/04	9,010,000	9,871,356.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.000%	2018/01/04	8,070,000	8,732,547.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.250%	2018/07/04	8,170,000	8,979,647.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.750%	2019/01/04	8,730,000	9,298,323.00	

	DEUTSCHLAND REP	3.500%	2019/07/04	12,390,000	12,963,657.00	
	DEUTSCHLAND REP	3.250%	2020/01/04	12,020,000	12,332,520.00	
	DEUTSCHLAND REP	3.000%	2020/07/04	6,720,000	6,753,600.00	
	DEUTSCHLAND REP	2.250%	2020/09/04	9,450,000	8,902,845.00	
	DEUTSCHLAND REP	2.500%	2021/01/04	1,800,000	1,723,320.00	
	DEUTSCHLAND REP	3.250%	2021/07/04	2,030,000	2,062,683.00	
	DEUTSCHLAND REP	6.250%	2024/01/04	4,480,000	5,833,408.00	
	DEUTSCHLAND REP	6.500%	2027/07/04	5,360,000	7,292,816.00	
	DEUTSCHLAND REP	5.625%	2028/01/04	2,870,000	3,593,240.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.750%	2028/07/04	7,940,000	9,097,652.00	
	DEUTSCHLAND REP	6.250%	2030/01/04	2,860,000	3,878,446.00	
	DEUTSCHLAND REP	5.500%	2031/01/04	6,530,000	8,195,803.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.750%	2034/07/04	7,940,000	9,254,070.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.000%	2037/01/04	8,200,000	8,660,020.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.250%	2039/07/04	5,820,000	6,459,618.00	
	DEUTSCHLAND REP	4.750%	2040/07/04	7,040,000	8,459,264.00	
	DEUTSCHLAND REP	3.250%	2042/07/04	2,680,000	2,511,964.00	
国債証券 (フィンランド)	FINNISH GOV'T	4.250%	2012/09/15	2,290,000	2,366,257.00	
	FINNISH GOV'T	5.375%	2013/07/04	2,610,000	2,800,269.00	
	FINNISH GOV'T	3.125%	2014/09/15	2,530,000	2,615,261.00	
	FINNISH GOV'T	4.250%	2015/07/04	2,180,000	2,343,282.00	
	FINNISH GOV'T	1.750%	2016/04/15	2,380,000	2,303,364.00	
	FINNISH GOV'T	3.875%	2017/09/15	2,470,000	2,623,634.00	
	FINNISH GOV'T	4.375%	2019/07/04	2,030,000	2,212,903.00	
	FINNISH GOV'T	3.375%	2020/04/15	2,680,000	2,712,696.00	
	FINNISH GOV'T	3.500%	2021/04/15	1,660,000	1,685,564.00	
	FINNISH GOV'T	4.000%	2025/07/04	2,380,000	2,480,674.00	

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)	BTAN-2YR ISSUE	0.750% 2012/09/20	2,810,000	2,782,743.00	
		BTAN-5YR ISSUE	4.500% 2012/07/12	9,120,000	9,416,400.00	
		BTAN-5YR ISSUE	3.750% 2013/01/12	15,150,000	15,652,980.00	
		BTAN-5YR ISSUE	4.500% 2013/07/12	8,680,000	9,158,268.00	
		BTAN-5YR ISSUE	2.500% 2014/01/12	5,990,000	6,067,870.00	
		BTAN-5YR ISSUE	3.000% 2014/07/12	8,180,000	8,387,772.00	
		BTAN-5YR ISSUE	2.500% 2015/01/15	8,600,000	8,661,060.00	
		BTAN-5YR ISSUE	2.000% 2015/07/12	9,390,000	9,223,797.00	
		BTAN-5YR ISSUE	2.250% 2016/02/25	4,660,000	4,581,246.00	
		FRANCE O.A.T.	4.750% 2012/10/25	7,750,000	8,078,600.00	
		FRANCE O.A.T.	8.500% 2012/12/26	2,180,000	2,408,682.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000% 2013/04/25	5,720,000	5,956,236.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000% 2013/10/25	10,700,000	11,218,950.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000% 2014/04/25	13,560,000	14,286,816.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000% 2014/10/25	3,170,000	3,351,958.00	
		FRANCE O.A.T.	3.500% 2015/04/25	15,920,000	16,572,720.00	
		FRANCE O.A.T.	3.000% 2015/10/25	13,300,000	13,575,310.00	
		FRANCE O.A.T.	3.250% 2016/04/25	9,300,000	9,561,330.00	
		FRANCE O.A.T.	5.000% 2016/10/25	10,860,000	12,093,696.00	
		FRANCE O.A.T.	3.750% 2017/04/25	10,340,000	10,846,660.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250% 2017/10/25	8,260,000	8,891,890.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000% 2018/04/25	8,670,000	9,197,136.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250% 2018/10/25	3,470,000	3,732,332.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250% 2019/04/25	11,300,000	12,149,760.00	
		FRANCE O.A.T.	3.750% 2019/10/25	16,990,000	17,654,309.00	
		FRANCE O.A.T.	8.500% 2019/10/25	4,010,000	5,576,707.00	
		FRANCE O.A.T.	3.500% 2020/04/25	7,940,000	8,069,422.00	

		FRANCE O.A.T.	2.500%	2020/10/25	14,190,000	13,202,376.00	
		FRANCE O.A.T.	3.750%	2021/04/25	10,360,000	10,675,980.00	
		FRANCE O.A.T.	8.500%	2023/04/25	5,390,000	7,975,583.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250%	2023/10/25	12,900,000	13,679,160.00	
		FRANCE O.A.T.	6.000%	2025/10/25	5,240,000	6,562,052.00	
		FRANCE O.A.T.	3.500%	2026/04/25	6,080,000	5,865,984.00	
		FRANCE O.A.T.	5.500%	2029/04/25	9,060,000	10,918,206.00	
		FRANCE O.A.T.	5.750%	2032/10/25	9,180,000	11,521,818.00	
		FRANCE O.A.T.	4.750%	2035/04/25	7,330,000	8,178,081.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2038/10/25	10,190,000	10,194,076.00	
		FRANCE O.A.T.	4.500%	2041/04/25	5,190,000	5,625,441.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2055/04/25	6,860,000	6,803,062.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2060/04/25	2,530,000	2,512,037.00	
	国債証券 (アイルランド)	IRISH GOVT	5.000%	2013/04/18	2,340,000	2,101,811.40	
		IRISH GOVT	4.000%	2014/01/15	4,720,000	3,808,143.20	
		IRISH GOVT	4.600%	2016/04/18	3,970,000	2,962,612.50	
		IRISH GOVT	4.500%	2018/10/18	3,550,000	2,406,190.00	
		IRISH GOVT	4.400%	2019/06/18	3,540,000	2,355,551.40	
		IRISH GOVT	5.900%	2019/10/18	3,440,000	2,392,348.00	
		IRISH GOVT	4.500%	2020/04/18	4,160,000	2,709,033.60	
		IRISH GOVT	5.000%	2020/10/18	2,600,000	1,705,886.00	
		IRISH GOVT	5.400%	2025/03/13	3,380,000	2,191,085.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考			
ユーロ	国債証券 (オランダ)	NETHERLANDS GOVT	5.000%	2012/07/15	6,690,000	6,938,199.00		
		NETHERLANDS GOVT	1.750%	2013/01/15	6,310,000	6,323,882.00		
		NETHERLANDS GOVT	4.250%	2013/07/15	5,640,000	5,935,536.00		
		NETHERLANDS GOVT	1.000%	2014/01/15	2,440,000	2,385,344.00		
		NETHERLANDS GOVT	3.750%	2014/07/15	6,540,000	6,871,578.00		
		NETHERLANDS GOVT	2.750%	2015/01/15	5,460,000	5,562,648.00		
		NETHERLANDS GOVT	3.250%	2015/07/15	4,890,000	5,070,441.00		
		NETHERLANDS GOVT	4.000%	2016/07/15	5,350,000	5,716,475.00		
		NETHERLANDS GOVT	4.500%	2017/07/15	6,180,000	6,767,718.00		
		NETHERLANDS GOVT	4.000%	2018/07/15	3,450,000	3,678,045.00		
		NETHERLANDS GOVT	4.000%	2019/07/15	8,850,000	9,417,285.00		
		NETHERLANDS GOVT	3.500%	2020/07/15	4,450,000	4,557,245.00		
		NETHERLANDS GOVT	3.250%	2021/07/15	2,890,000	2,881,330.00		
		NETHERLANDS GOVT	3.750%	2023/01/15	4,420,000	4,564,092.00		
		NETHERLANDS GOVT	7.500%	2023/01/15	1,660,000	2,306,736.00		
		NETHERLANDS GOVT	5.500%	2028/01/15	4,590,000	5,654,421.00		
		NETHERLANDS GOVT	4.000%	2037/01/15	4,870,000	5,098,403.00		
		NETHERLANDS GOVT	3.750%	2042/01/15	4,200,000	4,249,980.00		
			国債証券 (ポルトガル)	PORTUGUESE OT'S	5.000%	2012/06/15	3,650,000	3,524,440.00
		PORTUGUESE OT'S		5.450%	2013/09/23	4,360,000	3,859,908.00	
		PORTUGUESE OT'S		4.375%	2014/06/16	2,800,000	2,287,908.00	
		PORTUGUESE OT'S		3.600%	2014/10/15	2,520,000	2,007,961.20	
		PORTUGUESE OT'S		3.350%	2015/10/15	4,040,000	3,059,532.40	
		PORTUGUESE OT'S		6.400%	2016/02/15	1,340,000	1,092,984.40	
		PORTUGUESE OT'S		4.200%	2016/10/15	2,660,000	1,967,628.60	
		PORTUGUESE OT'S		4.350%	2017/10/16	2,290,000	1,603,595.40	
		PORTUGUESE OT'S		4.450%	2018/06/15	2,740,000	1,864,186.40	
		PORTUGUESE OT'S		4.750%	2019/06/14	3,470,000	2,334,997.70	
		PORTUGUESE OT'S		4.800%	2020/06/15	3,030,000	2,000,133.30	
		PORTUGUESE OT'S		3.850%	2021/04/15	2,970,000	1,819,897.20	
		PORTUGUESE OT'S		4.950%	2023/10/25	2,820,000	1,776,346.20	
		PORTUGUESE OT'S	4.100%	2037/04/15	2,790,000	1,620,599.40		

国債証券 (オーストリア)	REP OF AUSTRIA	5.000%	2012/07/15	3,830,000	3,972,859.00	
	REP OF AUSTRIA	3.800%	2013/10/20	5,090,000	5,313,451.00	
	REP OF AUSTRIA	4.300%	2014/07/15	4,540,000	4,822,842.00	
	REP OF AUSTRIA	3.400%	2014/10/20	3,820,000	3,955,228.00	
	REP OF AUSTRIA	3.500%	2015/07/15	4,890,000	5,080,221.00	
	REP OF AUSTRIA	4.000%	2016/09/15	4,360,000	4,625,088.00	
	REP OF AUSTRIA	3.200%	2017/02/20	2,550,000	2,592,840.00	
	REP OF AUSTRIA	4.300%	2017/09/15	2,600,000	2,791,100.00	
	REP OF AUSTRIA	4.650%	2018/01/15	4,580,000	5,022,886.00	
	REP OF AUSTRIA	4.350%	2019/03/15	5,310,000	5,723,649.00	
	REP OF AUSTRIA	3.900%	2020/07/15	4,560,000	4,756,992.00	
	REP OF AUSTRIA	3.500%	2021/09/15	5,490,000	5,521,293.00	
	REP OF AUSTRIA	3.650%	2022/04/20	1,920,000	1,945,728.00	
	REP OF AUSTRIA	4.850%	2026/03/15	3,200,000	3,577,280.00	
	REP OF AUSTRIA	6.250%	2027/07/15	2,810,000	3,635,578.00	
REP OF AUSTRIA	4.150%	2037/03/15	3,980,000	4,062,386.00		
国債証券 (スペイン)	SPANISH GOV'T	5.000%	2012/07/30	7,070,000	7,239,680.00	
	SPANISH GOV'T	3.900%	2012/10/31	9,790,000	9,887,900.00	

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	6.150% 2013/01/31	6,550,000	6,841,475.00	
		SPANISH GOV'T	2.300% 2013/04/30	6,610,000	6,483,088.00	
		SPANISH GOV'T	4.200% 2013/07/30	2,210,000	2,237,625.00	
		SPANISH GOV'T	2.500% 2013/10/31	3,990,000	3,877,083.00	
		SPANISH GOV'T	4.250% 2014/01/31	4,840,000	4,883,076.00	
		SPANISH GOV'T	3.400% 2014/04/30	670,000	658,141.00	
		SPANISH GOV'T	4.750% 2014/07/30	4,860,000	4,957,686.00	
		SPANISH GOV'T	3.300% 2014/10/31	8,840,000	8,618,116.00	
		SPANISH GOV'T	4.400% 2015/01/31	6,070,000	6,110,669.00	
		SPANISH GOV'T	3.000% 2015/04/30	4,240,000	4,048,352.00	
		SPANISH GOV'T	3.150% 2016/01/31	6,420,000	6,062,406.00	
		SPANISH GOV'T	3.250% 2016/04/30	4,310,000	4,049,719.10	
		SPANISH GOV'T	3.800% 2017/01/31	3,620,000	3,445,878.00	
		SPANISH GOV'T	5.500% 2017/07/30	7,840,000	8,094,800.00	
		SPANISH GOV'T	4.100% 2018/07/30	5,580,000	5,273,658.00	
		SPANISH GOV'T	4.600% 2019/07/30	5,950,000	5,736,990.00	
		SPANISH GOV'T	4.300% 2019/10/31	5,850,000	5,513,625.00	
		SPANISH GOV'T	4.000% 2020/04/30	8,910,000	8,160,669.00	
		SPANISH GOV'T	4.850% 2020/10/31	3,370,000	3,249,691.00	
		SPANISH GOV'T	5.500% 2021/04/30	5,140,000	5,162,359.00	
		SPANISH GOV'T	4.800% 2024/01/31	5,930,000	5,519,644.00	
		SPANISH GOV'T	4.650% 2025/07/30	5,590,000	5,029,323.00	
		SPANISH GOV'T	5.900% 2026/07/30	1,750,000	1,753,500.00	
		SPANISH GOV'T	6.000% 2029/01/31	7,160,000	7,218,712.00	
	SPANISH GOV'T	5.750% 2032/07/30	5,680,000	5,572,080.00		
SPANISH GOV'T	4.200% 2037/01/31	7,160,000	5,549,000.00			
SPANISH GOV'T	4.900% 2040/07/30	4,980,000	4,251,924.00			
SPANISH GOV'T	4.700% 2041/07/30	4,420,000	3,640,312.00			
	ユーロ 小計		1,543,940,000	1,574,750,753.20 (183,915,140,466)		
英ポンド	国債証券	TREASURY	5.250% 2012/06/07	5,450,000	5,692,743.00	
		TREASURY	4.500% 2013/03/07	16,520,000	17,555,804.00	
		TREASURY	8.000% 2013/09/27	4,120,000	4,771,742.80	
		TREASURY	2.250% 2014/03/07	7,940,000	8,162,796.40	
		TREASURY	5.000% 2014/09/07	7,730,000	8,594,987.00	
		TREASURY	2.750% 2015/01/22	14,500,000	15,064,050.00	

TREASURY	4.750%	2015/09/07	10,010,000	11,197,686.50	
TREASURY	8.000%	2015/12/07	1,730,000	2,187,066.00	
TREASURY	2.000%	2016/01/22	5,900,000	5,894,159.00	
TREASURY	4.000%	2016/09/07	6,700,000	7,305,680.00	
TREASURY	8.750%	2017/08/25	1,920,000	2,620,992.00	
TREASURY	5.000%	2018/03/07	8,620,000	9,877,571.80	
TREASURY	4.500%	2019/03/07	5,210,000	5,766,428.00	
TREASURY	3.750%	2019/09/07	14,590,000	15,304,910.00	
TREASURY	4.750%	2020/03/07	6,070,000	6,799,614.00	
TREASURY	3.750%	2020/09/07	9,230,000	9,578,894.00	
TREASURY	8.000%	2021/06/07	5,970,000	8,385,462.00	
TREASURY	3.750%	2021/09/07	2,490,000	2,558,101.50	
TREASURY	4.000%	2022/03/07	3,390,000	3,536,448.00	
TREASURY	5.000%	2025/03/07	7,340,000	8,302,274.00	

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
英ポンド	国債証券	TREASURY 4.250% 2027/12/07	6,190,000	6,396,746.00	
		TREASURY 6.000% 2028/12/07	4,330,000	5,442,810.00	
		TREASURY 4.750% 2030/12/07	6,850,000	7,458,965.00	
		TREASURY 4.250% 2032/06/07	7,630,000	7,776,953.80	
		TREASURY 4.500% 2034/09/07	3,830,000	4,019,010.50	
		TREASURY 4.250% 2036/03/07	9,210,000	9,318,678.00	
		TREASURY 4.750% 2038/12/07	6,770,000	7,440,433.10	
		TREASURY 4.250% 2039/09/07	5,940,000	6,024,348.00	
		TREASURY 4.250% 2040/12/07	6,950,000	7,032,357.50	
		TREASURY 4.500% 2042/12/07	5,980,000	6,349,564.00	
		TREASURY 4.250% 2046/12/07	8,010,000	8,175,807.00	
		TREASURY 4.250% 2049/12/07	7,220,000	7,377,396.00	
		TREASURY 4.250% 2055/12/07	8,020,000	8,238,705.40	
		TREASURY 4.000% 2060/01/22	2,640,000	2,572,970.40	
	英ポンド 小計			235,000,000	252,782,154.70 (33,245,908,986)
スイスフラン	国債証券	SWISS (GOVT) 2.750% 2012/06/10	3,270,000	3,348,480.00	
		SWISS (GOVT) 4.000% 2013/02/11	2,870,000	3,043,635.00	
		SWISS (GOVT) 4.250% 2014/01/06	1,910,000	2,087,630.00	
		SWISS (GOVT) 2.500% 2016/03/12	2,650,000	2,834,175.00	
		SWISS (GOVT) 4.250% 2017/06/05	2,450,000	2,875,320.00	
		SWISS (GOVT) 3.000% 2018/01/08	2,460,000	2,722,974.00	
		SWISS (GOVT) 3.000% 2019/05/12	2,250,000	2,505,375.00	
		SWISS (GOVT) 4.000% 2023/02/11	1,810,000	2,217,250.00	
	SWISS (GOVT) 4.000% 2028/04/08	2,250,000	2,872,350.00		
スイスフラン 小計			21,920,000	24,507,189.00 (2,341,171,765)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDEN GOVT 5.500% 2012/10/08	25,810,000	26,899,182.00	
		SWEDEN GOVT 6.750% 2014/05/05	32,230,000	36,000,910.00	
		SWEDEN GOVT 4.500% 2015/08/12	24,350,000	26,156,770.00	
		SWEDEN GOVT 3.000% 2016/07/12	18,050,000	18,290,065.00	
		SWEDEN GOVT 3.750% 2017/08/12	20,450,000	21,546,120.00	
		SWEDEN GOVT 4.250% 2019/03/12	27,120,000	29,707,248.00	
		SWEDEN GOVT 5.000% 2020/12/01	33,150,000	38,798,760.00	
		SWEDEN GOVT 3.500% 2022/06/01	11,690,000	12,326,052.90	
	SWEDEN GOVT 3.500% 2039/03/30	16,470,000	17,281,971.00		
スウェーデンクローナ 小計			209,320,000	227,007,078.90 (2,930,661,388)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOV'T 6.500% 2013/05/15	24,300,000	26,141,940.00	
		NORWEGIAN GOV'T 5.000% 2015/05/15	21,100,000	23,047,530.00	

		NORWEGIAN GOV'T	4.250%	2017/05/19	15,240,000	16,334,232.00	
		NORWEGIAN GOV'T	4.500%	2019/05/22	10,250,000	11,210,425.00	
		NORWEGIAN GOV'T	3.750%	2021/05/25	8,710,000	9,016,592.00	
		ノルウェークローネ 小計			79,600,000	85,750,719.00 (1,274,255,684)	
デンマーク クローネ	国債証券	DENMARK - BULLET	4.000%	2012/11/15	32,020,000	33,137,498.00	
		DENMARK - BULLET	5.000%	2013/11/15	31,650,000	33,995,265.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2015/11/15	34,760,000	37,158,440.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2017/11/15	20,930,000	22,562,540.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2019/11/15	35,940,000	38,563,620.00	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
デンマーク クローネ	国債証券	DENMARK - BULLET	3.000%	2021/11/15	9,300,000	9,140,505.00	
		DENMARK - BULLET	7.000%	2024/11/10	9,850,000	13,593,000.00	
		DENMARK - BULLET	4.500%	2039/11/15	39,950,000	46,493,810.00	
			デンマーククローネ 小計			214,400,000	234,644,678.00 (3,674,535,657)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVT BOND	0.000%	2012/07/25	10,310,000	9,793,572.10	
		POLAND GOVT BOND	0.000%	2012/10/25	9,420,000	8,838,880.20	
		POLAND GOVT BOND	0.000%	2013/01/25	9,330,000	8,651,242.50	
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2013/04/25	8,480,000	8,547,924.80	
		POLAND GOVT BOND	0.000%	2013/07/25	2,330,000	2,107,974.30	
		POLAND GOVT BOND	5.000%	2013/10/24	11,430,000	11,446,687.80	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2014/04/25	12,190,000	12,421,731.90	
		POLAND GOVT BOND	5.500%	2015/04/25	10,150,000	10,247,034.00	
		POLAND GOVT BOND	6.250%	2015/10/24	13,470,000	13,958,287.50	
		POLAND GOVT BOND	5.000%	2016/04/25	5,220,000	5,136,271.20	
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2017/10/25	10,570,000	10,413,035.50	
		POLAND GOVT BOND	5.500%	2019/10/25	10,190,000	9,990,785.50	
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2020/10/25	8,080,000	7,725,368.80	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2022/09/23	10,200,000	10,025,682.00	
	POLAND GOVT BOND	5.750%	2029/04/25	2,600,000	2,486,250.00		
		ポーランドズロチ 小計			133,970,000	131,790,728.10 (3,907,595,088)	
オーストラリ アドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVT.	4.750%	2012/11/15	3,540,000	3,537,946.80	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.500%	2013/05/15	6,680,000	6,885,610.40	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2013/12/15	3,620,000	3,678,788.80	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.250%	2014/06/15	4,700,000	4,884,193.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.500%	2014/10/21	3,150,000	3,115,192.50	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.250%	2015/04/15	5,710,000	5,979,397.80	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.750%	2016/06/15	3,390,000	3,356,744.10	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.000%	2017/02/15	5,850,000	6,118,749.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2018/01/21	1,110,000	1,133,465.40	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.250%	2019/03/15	5,180,000	5,209,008.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.500%	2020/04/15	4,840,000	4,609,228.80	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.750%	2021/05/15	4,750,000	4,947,932.50	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.750%	2022/07/15	2,960,000	3,085,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2023/04/21	470,000	478,093.40		
		オーストラリアドル 小計			55,950,000	57,020,150.50 (4,874,082,464)	
シンガポール ドル	国債証券	SPR GOV'T	3.500%	2012/07/01	2,540,000	2,622,677.00	
		SPR GOV'T	2.500%	2012/10/01	1,130,000	1,160,803.80	
		SPR GOV'T	1.625%	2013/04/01	2,140,000	2,186,245.40	
		SPR GOV'T	2.250%	2013/07/01	700,000	725,872.00	
		SPR GOV'T	3.625%	2014/07/01	2,110,000	2,303,845.70	
		SPR GOV'T	1.375%	2014/10/01	700,000	718,550.00	

	SPR GOV'T	2.875%	2015/07/01	1,720,000	1,857,582.80	
	SPR GOV'T	1.125%	2016/04/01	780,000	782,901.60	
	SPR GOV'T	3.750%	2016/09/01	2,010,000	2,271,742.20	
	SPR GOV'T	2.375%	2017/04/01	710,000	749,894.90	
	SPR GOV'T	4.000%	2018/09/01	1,560,000	1,791,067.20	
	SPR GOV'T	2.500%	2019/06/01	1,250,000	1,296,337.50	

通貨	種類	銘柄		券面総額	評価額	備考
シンガポールドル	国債証券	SPR GOV'T	3.250% 2020/09/01	1,920,000	2,086,425.60	
		SPR GOV'T	3.125% 2022/09/01	1,270,000	1,353,210.40	
		SPR GOV'T	3.000% 2024/09/01	710,000	737,029.70	
		SPR GOV'T	3.500% 2027/03/01	1,650,000	1,793,599.50	
		SPR GOV'T	2.875% 2030/09/01	1,170,000	1,167,671.70	
	シンガポールドル 小計			24,070,000	25,605,457.00 (1,674,084,778)	
マレーシアリングット	国債証券	MALAYSIAN GOV'T	3.718% 2012/06/15	5,960,000	6,011,792.40	
		MALAYSIAN GOV'T	2.509% 2012/08/27	5,330,000	5,307,933.80	
		MALAYSIAN GOV'T	3.702% 2013/02/25	5,470,000	5,515,127.50	
		MALAYSIAN GOV'T	3.210% 2013/05/31	2,290,000	2,290,137.40	
		MALAYSIAN GOV'T	3.461% 2013/07/31	4,820,000	4,841,063.40	
		MALAYSIAN GOV'T	5.094% 2014/04/30	9,680,000	10,144,640.00	
		MALAYSIAN GOV'T	3.434% 2014/08/15	2,280,000	2,292,494.40	
		MALAYSIAN GOV'T	3.741% 2015/02/27	6,510,000	6,561,819.60	
		MALAYSIAN GOV'T	3.835% 2015/08/12	5,200,000	5,281,380.00	
		MALAYSIAN GOV'T	4.262% 2016/09/15	9,560,000	9,897,946.00	
		MALAYSIAN GOV'T	3.814% 2017/02/15	3,010,000	3,023,003.20	
		MALAYSIAN GOV'T	4.240% 2018/02/07	6,350,000	6,515,544.50	
		MALAYSIAN GOV'T	4.378% 2019/11/29	10,140,000	10,474,721.40	
		MALAYSIAN GOV'T	4.160% 2021/07/15	2,830,000	2,873,016.00	
		MALAYSIAN GOV'T	4.392% 2026/04/15	1,900,000	1,941,762.00	
MALAYSIAN GOV'T	3.502% 2027/05/31	2,670,000	2,421,358.92			
MALAYSIAN GOV'T	5.248% 2028/09/15	1,910,000	2,102,871.80			
	マレーシアリングット 小計			85,910,000	87,496,612.32 (2,330,909,752)	
国債証券 合計					413,130,754,152 (413,130,754,152)	
合計					413,130,754,152 (413,130,754,152)	

(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	164	100.0%	37.8%
カナダドル	33	100.0%	3.1%
メキシコペソ	19	100.0%	1.0%
ユーロ	249	100.0%	44.5%
英ポンド	34	100.0%	8.0%
スイスフラン	9	100.0%	0.6%
スウェーデンクローナ	9	100.0%	0.7%

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	15	100.0%	0.9%
オーストラリアドル	14	100.0%	1.2%
シンガポールドル	17	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	17	100.0%	0.6%
合計	593	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](#)

（１）当ファンドの中間財務諸表は、「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）」並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期中間計算期間（平成23年6月11日から平成23年12月10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中間監査を受けております。

【グローバル・インデックス・バランス・ファンド 中間財務諸表】
（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

		第5期中間計算期間 （平成23年12月10日現在）
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券		1,843,107,169
未収入金		622,720
流動資産合計		1,843,729,889
資産合計		1,843,729,889
負債の部		
流動負債		
未払解約金		628,189
未払受託者報酬		484,063
未払委託者報酬		5,324,596
その他未払費用		48,340
流動負債合計		6,485,188
負債合計		6,485,188
純資産の部		
元本等		
元本		2,595,218,468
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		757,973,767
純資産合計		1,837,244,701
負債純資産合計		1,843,729,889

（ 2 ）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 5 期中間計算期間 自 平成23年 6 月11日 至 平成23年12月10日
営業収益	
受取利息	2
有価証券売買等損益	154,635,988
営業収益合計	154,635,986
営業費用	
受託者報酬	484,063
委託者報酬	5,324,596
その他費用	48,340
営業費用合計	5,856,999
営業利益又は営業損失（ ）	160,492,985
経常利益又は経常損失（ ）	160,492,985
中間純利益又は中間純損失（ ）	160,492,985
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	4,803,262
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	558,812,456
剰余金増加額又は欠損金減少額	23,888,858
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	23,888,858
剰余金減少額又は欠損金増加額	67,360,446
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	67,360,446
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	757,973,767

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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。
-----------------	---------------------------------------

(追加情報)

<p>当該中間計算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。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

	第 5 期中間計算期間 (平成23年12月10日現在)
1. 当該中間計算期間の末日における受益権総数	2,595,218,468 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 757,973,767 円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7079 円 (7,079 円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

	第 5 期中間計算期間 自 平成23年 6 月11日 至 平成23年12月10日
剰余金増加額・減少額又は欠損金減少額・増加額	「中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「中間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)

金融商品の時価等に関する事項

	第 5 期中間計算期間 (平成23年12月10日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	中間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、中間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>
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>

(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中間計算期間における元本額の変動

	第5期中間計算期間 自 平成23年6月11日 至 平成23年12月10日
期首元本額	2,453,664,633 円
期中追加設定元本額	244,861,140 円
期中一部解約元本額	103,307,305 円

2. 有価証券関係

該当事項はありません。

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。

[次へ](#)

<参考>

「グローバル・インデックス・バランス・ファンド」は、「中央三井日本株式マザーファンド」、「中央三井外国株式マザーファンド」及び「中央三井外国債券マザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、中間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10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10日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,284,418,512
株式	225,133,684,570
未収配当金	235,542,420
未収利息	16,584
前払金	1,009,000
流動資産合計	233,654,671,086
資産合計	233,654,671,086
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	90,289,000
未払金	423,150
未払解約金	162,281,014
流動負債合計	252,993,164
負債合計	252,993,164
純資産の部	
元本等	
元本	349,357,609,373
剰余金	

欠損金	115,955,931,451
純資産合計	233,401,677,922
負債・純資産合計	233,654,671,086

(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10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. 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に知りうる直近の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10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: center;">株式 2,034,100,000 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	349,357,609,373 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 style="text-align: center;">元本の欠損</p> <p style="text-align: right;">115,955,931,451 円</p>
4. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	<p style="text-align: right;">0.6681 円</p> <p style="text-align: right;">(6,681 円)</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

平成23年12月10日現在

<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p> <p>(1) 株式</p> <p>「(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) デリバティブ取引</p> <p>「(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。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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

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。

（関連当事者との取引に関する注記）

平成23年12月10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10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10日現在

中間計算期間の期首元本額	327,432,073,619 円
中間計算期間中の追加設定元本額	41,508,430,026 円
中間計算期間中の一部解約元本額	19,582,894,272 円
計算日の元本額	349,357,609,373 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	2,507,983,621 円
中央三井D C 日本株式インデックスファンド	357,150,708 円
中央三井D C 日本株式インデックスファンドL	45,405,300,131 円
中央三井D C 日本株式インデックスファンドA	1,616,229,373 円
中央三井D C バランスファンド30	459,979,362 円
中央三井D C バランスファンド50	1,030,381,754 円

中央三井DCバランスファンド70	540,292,002 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)	186,742,911 円
新生・4分散ファンド	232,285,131 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	911,014,932 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)	220,458,812 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
CMAAM日本株式インデックスe	822,772,096 円
中央三井インデックスコレクション(国内株式)	2,986,930,623 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)	798,652,489 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)	33,412,867,817 円
中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)	6,980,867,288 円
中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)	53,257,070,840 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)	42,260,052,295 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)	6,555,341,281 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)	8,348,903,934 円
中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)	6,919,314,071 円
中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,783,724,974 円
中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)	40,921,589,714 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)	21,281,922,922 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)	3,666,523,122 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
CMAAM・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
CMAAM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）	2,224,896,824 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）	667,216,975 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

平成23年12月10日現在

該当事項はありません。

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10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	8,298,469,000		8,208,180,000	90,289,000
	合計	8,298,469,000		8,208,180,000	90,289,000

(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に知りうる直近の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10日現在

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10日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	4,065,931,652
コール・ローン	1,929,234,221
株式	241,148,522,974
投資信託受益証券	66,282,094
投資証券	4,225,315,673
派生商品評価勘定	183,686,156
未収入金	10,252,619
未収配当金	688,043,030
未収利息	3,862
差入委託証拠金	2,871,658,995
流動資産合計	255,188,931,276
資産合計	255,188,931,276
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	40,778,700
未払解約金	196,371,257
流動負債合計	237,149,957
負債合計	237,149,957
純資産の部	
元本等	
元本	291,630,210,739
剰余金	
欠損金	36,678,429,420
純資産合計	254,951,781,319
負債・純資産合計	255,188,931,276

(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10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(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> <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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<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。</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に知りうる直近の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	<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に知りうる直近の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>

4．収益及び費用の計上基準	<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。</p> <p>(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>
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10日現在
1．計算日における受益権総数	291,630,210,739 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> 36,678,429,420 円
3．1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8742 円 (8,742 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

平成23年12月10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。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成23年12月10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10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10日現在

中間計算期間の期首元本額	268,408,266,709 円
中間計算期間中の追加設定元本額	45,572,311,310 円
中間計算期間中の一部解約元本額	22,350,367,280 円
計算日の元本額	291,630,210,739 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	4,640,928,220 円
中央三井D C 外国株式インデックスファンド	3,699,447,329 円
中央三井D C 外国株式インデックスファンドL	17,855,912,750 円
中央三井D C バランスファンド3 0	181,327,451 円
中央三井D C バランスファンド5 0	541,471,408 円
中央三井D C バランスファンド7 0	319,179,706 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）	146,438,395 円
新生・4分散ファンド	182,783,476 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	727,968,352 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）	178,010,166 円
C M A M 外国株式インデックスe	3,607,238,662 円
中央三井インデックスコレクション（外国株式）	2,067,447,011 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式3 0）	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5 0）	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7 0）	459,122,163 円
中央三井外国株式インデックスファンドV A（適格機関投資家専用）	21,391,891,077 円
中央三井バランスV A 3 0（適格機関投資家専用）	5,775,737,829 円
中央三井バランスV A 5 0（適格機関投資家専用）	41,948,086,507 円
中央三井V A バランスファンド（株2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	33,267,215,872 円
中央三井V A バランスファンド（株5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	5,161,023,291 円
中央三井V A バランス株式3 0（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V A バランスファンド（株6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	32,864,017,078 円
中央三井バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	3,586,032,463 円

中央三井バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	1,897,561,008 円
中央三井バランスVA50L（適格機関投資家専用）	32,408,573,811 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）	50,259,386,372 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）	2,916,336,785 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）	737,143,202 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

平成23年12月10日現在

該当事項はありません。

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10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	9,280,896,052		9,427,108,817	146,212,765
	合計	9,280,896,052		9,427,108,817	146,212,765

(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. 計算日に知りうる直近の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10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		1,272,120,960	8,216,736
	ユーロ	292,778,148		285,962,560	6,815,588
	英ポンド	240,179,247		235,544,520	4,634,727
	計	1,796,861,619		1,793,628,040	3,233,579
	売建				
米ドル	93,670,650		93,742,380	71,730	
計	93,670,650		93,742,380	71,730	
合計		1,890,532,269		1,887,370,420	3,305,309

（注）時価の算定方法

わが国における計算日に知りうる直近の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。

計算日に知りうる直近の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。

計算日に知りうる直近の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10日現在
該当事項はありません。

[次へ](#)

「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10日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	468,369,067
コール・ローン	7,443,289,591
国債証券	381,195,517,114
派生商品評価勘定	55,496,182
未収利息	4,051,617,511
前払費用	185,992,412
差入委託証拠金	247,812,408
流動資産合計	393,648,094,285
資産合計	393,648,094,285
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	87,853,373
未払解約金	305,229,932
流動負債合計	393,083,305
負債合計	393,083,305
純資産の部	
元本等	
元本	268,198,417,930
剰余金	
剰余金	125,056,593,050
純資産合計	393,255,010,980
負債・純資産合計	393,648,094,285

(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10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に知りうる直近の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に知りうる直近の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 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10日現在	
1．計算日における受益権総数	268,198,417,930 口
2．1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4663 円 (14,663 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

平成23年12月10日現在	
<p>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ぬ。</p>	

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。

(関連当事者との取引に関する注記)

平成23年12月10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10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10日現在

中間計算期間の期首元本額	278,752,660,011 円
中間計算期間中の追加設定元本額	12,863,983,301 円
中間計算期間中の一部解約元本額	23,418,225,382 円
計算日の元本額	268,198,417,930 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	5,910,341,276 円
中央三井DC外国債券インデックスファンド	1,860,969,470 円
中央三井DC外国債券インデックスファンドL	8,570,349,343 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	102,422,877 円
中央三井DCバランスファンド50	152,846,494 円
中央三井DCバランスファンド70	29,770,592 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）	90,779,255 円
新生・4分散ファンド	110,792,642 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	407,875,715 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）	105,864,058 円

C M A M外国債券インデックス e	551,208,254 円
中央三井インデックスコレクション(外国債券)	1,026,234,142 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)	45,330,950 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)	18,233,595,074 円
中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)	8,092,770,771 円
中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)	26,022,578,752 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)	90,262,107,923 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)	4,665,705,575 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)	9,285,549,924 円
中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)	7,570,863,756 円
中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	2,159,865,526 円
中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)	20,437,308,921 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)	33,143,814,632 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)	2,701,097,407 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
C M A M・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)	975,533,703 円
中央三井世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	309,683,427 円
C M A M・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

平成23年12月10日現在

該当事項はありません。

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10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	4,807,258,357		4,835,714,876	28,456,519
	合計	4,807,258,357		4,835,714,876	28,456,519

(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. 計算日に知りうる直近の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10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		4,818,640,000	13,612,050
	カナダドル	518,524,450		516,528,000	1,996,450
	ユーロ	5,045,347,300		4,980,480,000	64,867,300
	英ポンド	1,005,507,000		996,628,000	8,879,000
	計	11,374,406,700		11,312,276,000	62,130,700
	売建				
	米ドル	1,837,619,840		1,834,192,000	3,427,840
	カナダドル	196,110,050		197,496,000	1,385,950
	ユーロ	1,920,439,750		1,919,560,000	879,750
英ポンド	369,092,350		370,697,000	1,604,650	
計	4,323,261,990		4,321,945,000	1,316,990	
合計	15,697,668,690		15,634,221,000	60,813,710	

(注) 時価の算定方法

わが国における計算日に知りうる直近の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。

計算日に知りうる直近の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。

計算日に知りうる直近の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10日現在
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	1,923,742,818 円
負債総額	3,059,570 円
純資産総額（ - ）	1,920,683,248 円
発行済口数	2,655,715,973 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7232 円
1万口当たり純資産額	7,232 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

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り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

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

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、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 其他有価証券	46,016	46,016	-
(4)未払金	(520,453)	(520,453)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券取引に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	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 border="0"> <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 border="0"> <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 border="0"> <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 border="0"> <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 border="0"> <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 border="0"> <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での報告体制を敷いております。

2．金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び(4) 未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	65,000

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

（追加情報）

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

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

1．金融商品の状況に関する事項

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

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

投資有価証券については、定期的な時価の把握及び社内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)支払代行手数料	3,100,880	未払手数料	243,621
同一の親会社を持つ会社	中央三井アセット信託銀行株式会社 (注)親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	11,000	信託業務	該当なし	投資信託委託投資顧問	支払投資顧問料 (注1)調査費(支払投資顧問料) 建物の賃借 (注2)	2,425,966 -	未払費用 前払費用 長期差入保証金	201,863 11,088 72,681

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

13. 1株当たり情報

項目	第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)	第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)
1. 1株当たり純資産額	487,545円94銭	542,702円95銭
2. 1株当たり当期純利益	62,395円92銭 (注) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため、記載していません。	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	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 なお、耐用年数は、建物については主として15年～18年、器具備品については主として5年～20年であります。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間(5年)を耐用年数としております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間負担分を計上しております。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間負担分を計上しております。</p> <p>(4) 退職給付引当金 従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による中間期末退職給付債務相当額を計上しております。</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 その他有価証券	48,718	48,718	-
(4) 未払金	(391,659)	(391,659)	-

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法

（1）現金・預金

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

（2）未収委託者報酬及び（4）未払金

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

（3）投資有価証券

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

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

内 容	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

有価証券関係

第26期中間会計期間末 (平成23年9月30日)			
1. その他有価証券			
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
区分	中間貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
投資信託受益証券	200	200	0
計	200	200	0
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
区分	中間貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
投資信託受益証券	48,518	50,000	1,482
計	48,518	50,000	1,482
非上場株式（中間貸借対照表計上額 10,000千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。			

デリバティブ関係

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

資産除去債務関係

第26期中間会計期間末 (平成23年9月30日)	
資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの	
当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減	
	千円
期首残高	16,345
時の経過による調整額	40
中間期末残高	16,385

セグメント情報等

第26期中間会計期間
(平成23年4月1日から
平成23年9月30日まで)

(セグメント情報)

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連情報)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

1 株当たり情報

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

(注) 1株当たり中間純利益算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

重要な後発事象

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

4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

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

(2) 運用財産相互間の取引

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

(3) 通常の見取条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の見取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：野村證券株式会社

資本金の額：10,000百万円（平成23年9月末日現在）

事業の内容：「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、収益分配金の再投資並びに口座管理機関としての業務等を行います。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成23年9月末日現在）

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

第3【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23年8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」に掲げられているグローバル・インデックス・バランス・ファンドの平成22年6月11日から平成23年6月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、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、グローバル・インデックス・バランス・ファンドの平成23年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

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」に掲げられているグローバル・インデックス・バランス・ファンドの平成23年6月11日から平成23年12月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル・インデックス・バランス・ファンドの平成23年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成23年6月1日から平成23年12月10日まで）の損益の状況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

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、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。
 2. 中間財務諸表の範囲にはXBR 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8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、「ファンドの経理状況」に掲げられているジョインベスト・グローバル・バランス・ファンドの平成21年6月11日から平成22年6月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、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、ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンドの平成22年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

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。