【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成24年5月25日
【計算期間】	４資産インデックスバランスオープン（分配型）第8特定期間 ４資産インデックスバランスオープン（成長型）第8期 （自 平成23年8月27日 至 平成24年2月27日）
【ファンド名】	４資産インデックスバランスオープン（分配型） ４資産インデックスバランスオープン（成長型） （上記ファンドを総称して「当ファンド」又は「ベーシック４」といいます。また、愛称として、４資産インデックスバランスオープン（分配型）を「ベーシック４（分配型）」、４資産インデックスバランスオープン（成長型）を「ベーシック４（成長型）」という名称を用いることがあります。）
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都港区芝3丁目33番1号
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポーティング部長 橋詰 廣志
【連絡場所】	東京都港区芝3丁目33番1号
【電話番号】	03-6737-0521
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① ファンドの目的

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

② 信託金限度額

各ファンドについて、１兆円を上限とします。

③ 基本的性格

当ファンドは、委託会社である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が投資家のために、利殖の目的をもって設定する証券投資信託で、三井住友信託銀行株式会社がその受託会社となることを引受けたものです。

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

商品分類表

○ベーシック４（分配型）

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 追 加 型	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 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。

○ベーシック４（成長型）

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 追 加 型	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 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
○ベーシック４（分配型）

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 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券 （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	年１回 年２回 年４回 年６回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリー ファンド ファンド ・オブ・ ファンズ	あり （　） なし

（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。

○ベーシック４（成長型）

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 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　）	年１回 年２回 年４回 年６回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリー ファンド ファンド ・オブ・ ファンズ	あり （　）
不動産投信				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				

（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２回…目論見書又は投資信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいいます。

・年４回…目論見書又は投資信託約款において、年４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。

④ ファンドの特色

Ａ．国内外の株式・公社債へ分散投資します。

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行い、日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド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、国内外の株式及び公社債へ分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。

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）
日本債券マザーファンド：「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」
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

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に関するすべての権利及びＴＯＰＩＸの商標に関するすべ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。

※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合について

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

※ＭＳＣＩコクサイ指数について

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

B．収益分配方針の異なる２つのファンドがあります。

収益分配方針につきましては、後記「２ 投資方針 （４）分配方針 ① 分配方針」をご参照ください。

販売会社によっては、お取り扱いが異なる場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

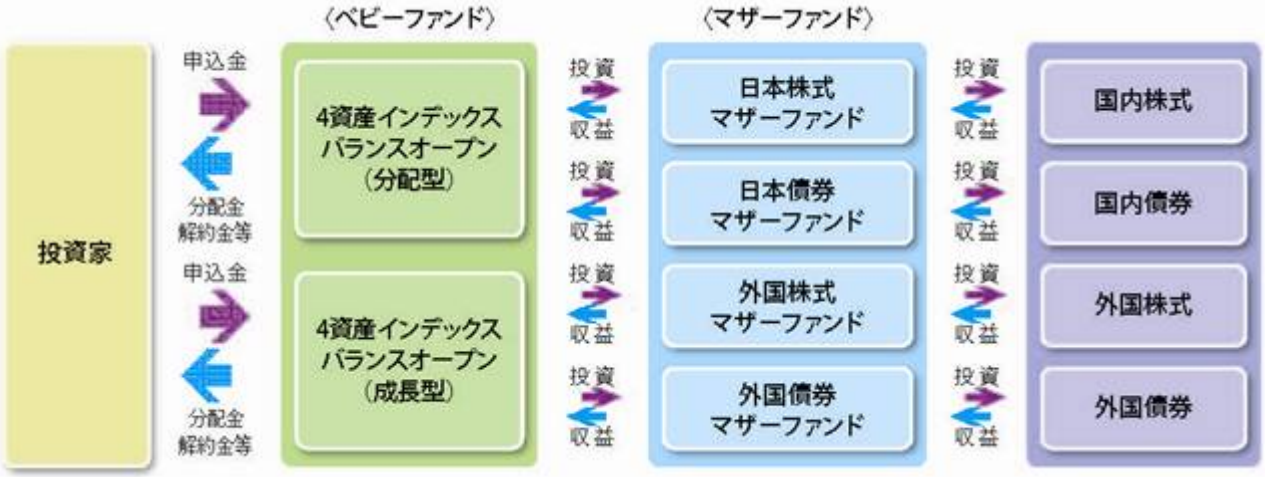
平成20年３月31日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

平成24年４月１日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継
当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンドの名称を日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マザーファンド、中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンドに変更

（３）【ファンドの仕組み】

① ファミリーファンド方式での運用

ファミリーファンド方式とは、投資家から投資された資金をまとめてベビーファンド（４資産インデックスバランスオープン（分配型）、４資産インデックスバランスオープン（成長型））とし、その資金をマザーファンド（日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド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。



② ファンドの関係法人

委託会社 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

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

受託会社 三井住友信託銀行株式会社

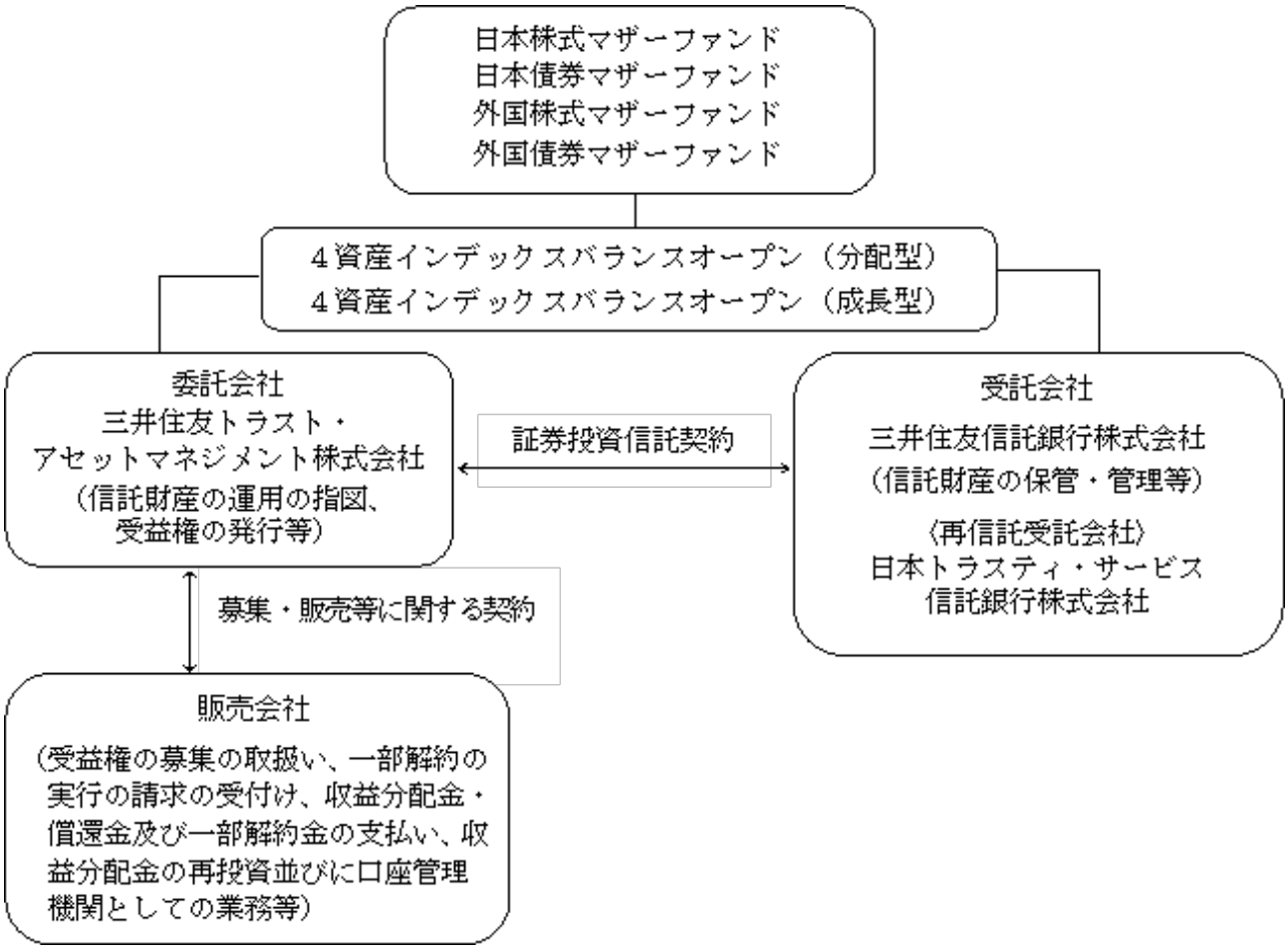
（再信託受託会社 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

販売会社

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

ファンドの関係法人



委託会社と関係法人との契約の概要

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

③ 委託会社の概況

A．資本金の額：３億円（平成24年４月１日現在）

B．委託会社の沿革

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

平成11年３月25日：証券投資信託委託業の認可

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

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

Ｃ．大株主の状況（平成24年４月１日現在）

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

２【投資方針】

（１）【投資方針】

① 運用方針

日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド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と安定的な収益の確保を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

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・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・公社債等に直接投資することもあります。

② 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・公社債への分散投資をすることにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。

Ｂ．各資産への配分は、４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75%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】

① 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

１．有価証券

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

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

４．約束手形（上記１．に掲げるものに該当するものを除きます。）

B．次に掲げる特定資産以外の資産

1．為替手形

② 運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」、「日本債券マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」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書
2．国債証券
3．地方債証券
4．特別の法律により法人の発行する債券
5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6．資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
8．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証書
9．資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
10．コマーシャル・ペーパー
11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
12．外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記１．から11．までの証券又は証書の性質を有するもの
13．投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）
14．投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）
15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
16．オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
17．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
18．外国法人が発行する譲渡性預金証書
19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます。）
21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22．外国の者に対する権利で上記21．の有価証券の性質を有するもの

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

③ 運用指図できる金融商品

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

ることを指図することができます。

１．預金

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

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

５．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

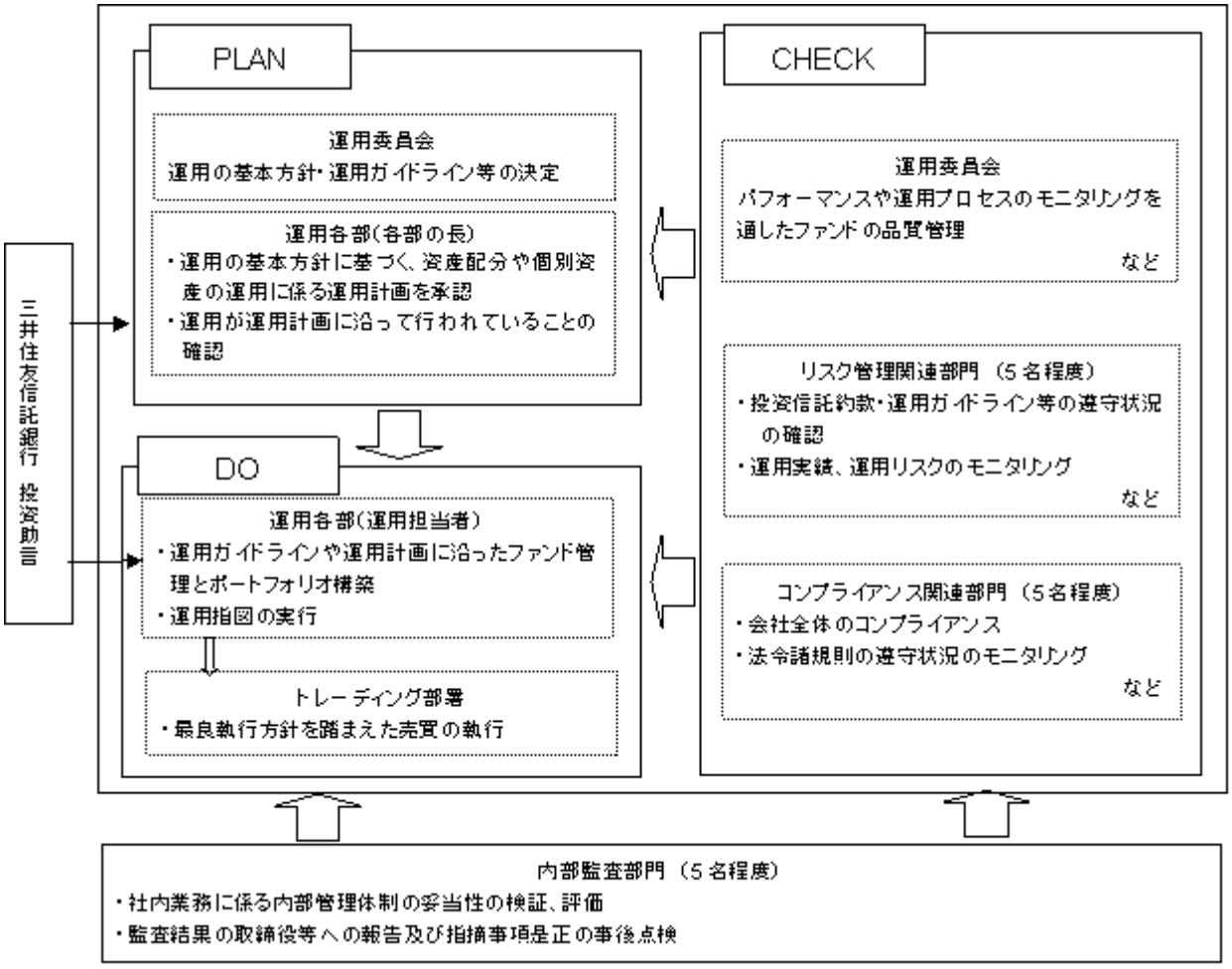
６．外国の者に対する権利で上記５．の権利の性質を有するもの

B．金融商品による運用の特例

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

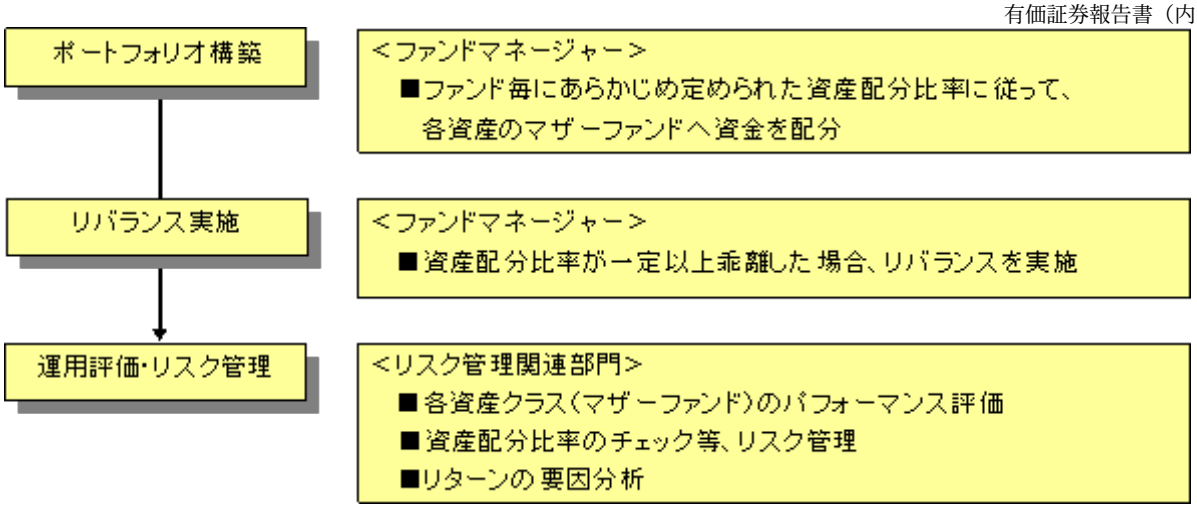
（３）【運用体制】

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



＜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】

① 分配方針

毎決算時（ベーシック４（分配型）は、原則として、２月、５月、８月及び11月の各26日。ベーシック４（成長型）は、原則として２月及び８月の各26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、その他の調整金は、全額分配に使用することがあります。

B．分配金額については、委託会社が各ファンド毎に基準価額水準、市況動向等を勘案し次の範囲内で決定します。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。

○ベーシック４（分配型）

原則として、経費控除後の配当等収益に、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案し売買益等（上記A．の範囲内）を加えた額

○ベーシック４（成長型）

原則として、経費控除後の配当等収益

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。

② 分配収益の計算

A．信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

イ．配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額（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 ①」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。

ニ．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（ただし、後記「４　手数料等及び税金　（１）申込手数料」に規定する申込手数料及び当該手数料に係る消費税等に相当する金額を除きます。以下本項において同じ。）と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、上記ニ．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。

③ 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ます。）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、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】

① 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70％未満とします。

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

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

I．信用取引の指図範囲

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

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

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

J．先物取引等の運用指図

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（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あたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

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

L．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図

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

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

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

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

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

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

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

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

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

N．公社債の空売りの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産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あたり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

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

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

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

P．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

Q．外国為替予約取引の指図

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

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

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

R．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

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

S．再投資の指図

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

T．資金の借入れ

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

U．受託会社による資金の立替え

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

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

ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそ

のつど別にこれを定めます。

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。

ハ．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。

ニ．上記イ．からハ．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。

② 関連法令に基づく投資制限

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

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

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

Ｂ．同一の法人の発行する株式への投資制限

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

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

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

ロ．当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数

（参考）マザーファンドの概要

「日本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
① 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。
② 運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。
③ 株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。
④ 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。
⑤ 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。
⑥ 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。
⑦ 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。
⑧ 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

３．投資制限
① 株式への投資割合には制限を設けません。
② 外貨建資産への投資は、行いません。
③ 新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
④ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
⑤ 同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５%以下とします。
⑥ 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。
⑦ 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

「日本債券マザーファンド」の概要

１．基本方針
この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法
（１）投資対象
わが国の公社債を主要投資対象とします。
（２）投資態度
① わが国の公社債に投資を行い、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合と連動する投資成果を目標として運用を行

います。

② 運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

③ 運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④ ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

⑤ 国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

⑥ 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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。

⑦ 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

３．投資制限

① 株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において信託財産の純資産総額の10％以下とします。

② 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。

③ 外貨建資産への投資は、行いません。

④ 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

「外国株式マザーファンド」の概要

１．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

２．運用方法

（１）投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

（２）投資態度

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

② 運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

③ 株式の組入比率は、原則として高位（90％以上）とします。

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

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

⑥ ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等並びに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

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

貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

⑧ 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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。

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

３．投資制限

① 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

② 株式への投資割合には制限を設けません。

③ 新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10％以下とします。

④ 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10％以下とします。

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

⑥ 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑦ 同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。

「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

① 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。

② 運用に際しては、三井住友信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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。

⑦ 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。

⑧ 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

３．投資制限

① 株式への投資は転換社債を転換したもの及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において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。

② 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の５％以下とします。

③ 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

④ 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。

●投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 株価変動リスク

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

② 為替変動リスク

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

③ 金利変動リスク

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

④ 信用リスク

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

⑤ カントリーリスク

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

⑥ 流動性リスク

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

＜その他の留意点＞

① 同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

② 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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

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

③ ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

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

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

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

① お申込受付日の翌営業日の基準価額に、3.15%（税抜※ 3.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

※「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。

なお、マザーファンドにおいては、申込手数料はかかりません。

② 「分配金再投資コース」（※）において収益分配金を再投資する場合については無手数料とします。

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

③ 償還乗換えにより当ファンドの受益権をお求めいただく場合には、当該償還金額の範囲内（単位型証券投資信託にあっては、当該償還金額とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数について申込手数料を優遇することがあります。（「償還乗換優遇制度」（※））

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

④ 申込手数料及び申込手数料に対する消費税等相当額はお申込金額（※）の中から差引きます。

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

⑤ 上記①から③までの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、以下の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

・お問い合わせ窓口

電　話：０１２０－６６８００１（フリーダイヤル）

受付時間：営業日の午前９時から午後５時まで

・ホームページ アドレス：http://www.smtam.jp/

（２）【換金（解約）手数料】

① 解約手数料はありませんが、下記②の信託財産留保額が控除されます。

② 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.15%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」「④ 個人の受益者に対する課税」もしくは「⑤ 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%
日本債券マザーファンド		0.1%
外国株式マザーファンド		0.2%
外国債券マザーファンド		0.1%

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

① 信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率 0.6825%（税抜 0.65%）を乗じて得た額とします。その配分は以下のとおりです。

委託会社	年率 0.294%	（税抜 0.28%）
販売会社	年率 0.3255%	（税抜 0.31%）
受託会社	年率 0.063%	（税抜 0.06%）

なお、マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

② 上記①の信託報酬は、毎計算期末又は信託終了のときに信託財産中から支弁します。

③ 信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

（４）【その他の手数料等】

① 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど信託財産中から支弁します。

② 信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、受益者の負担とし、毎計算期末又は信託終了のときに信託財産中から支弁します。

なお、マザーファンドにおいては、監査報酬はかかりません。

③ 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。

④ 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。

① 個別元本について

A．追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。

B．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

C．ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については各販売会社毎に、個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」の両コースで取得する場合はコース別に、個別元本の算出が行われる場合があります。

D．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「③ 収益分配金の課税について」をご参照ください。）

② 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④又は⑤をご参照ください。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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３月30日現在のものですので、税法が改正された場合などは、
上記の内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

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

以下の記載事項は、平成24年３月30日現在の状況について記載してあります。

（１）【投資状況】

（４資産インデックスバランスオープン（分配型））

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	53,247,679	25.68
	中央三井日本債券マザーファンド	日本	47,521,470	22.92
	中央三井外国株式マザーファンド	日本	55,989,822	27.01
	中央三井外国債券マザーファンド	日本	50,685,760	24.45
	親投資信託受益証券合計		207,444,731	100.06
その他の資産（負債控除後）			△126,461	△0.06
合計（純資産総額）			207,318,270	100.00

（４資産インデックスバランスオープン（成長型））

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	159,697,803	25.39
	中央三井日本債券マザーファンド	日本	147,983,312	23.53
	中央三井外国株式マザーファンド	日本	168,745,346	26.83
	中央三井外国債券マザーファンド	日本	152,999,342	24.32
	親投資信託受益証券合計		629,425,803	100.06
その他の資産（負債控除後）			△382,598	△0.06
合計（純資産総額）			629,043,205	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	256,522,332,610	96.97
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,014,481,401	3.03
合計（純資産総額）		264,536,814,011	100.00

（中央三井日本債券マザーファンド）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
公社債	日本	365,396,102,088	99.50
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,828,262,751	0.50
合計（純資産総額）		367,224,364,839	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	147,165,876,819	52.59
	イギリス	26,367,626,883	9.42
	カナダ	14,624,812,376	5.23
	スイス	11,447,917,174	4.09
	ドイツ	10,500,186,772	3.75
	その他	51,178,637,592	18.29
	小計	261,285,057,616	93.37
投資信託受益証券	オーストラリア	99,954,128	0.04
	シンガポール	49,608,651	0.02
	香港	858,313	0.00
	小計	150,421,092	0.05
投資証券	アメリカ	3,480,581,395	1.24
	オーストラリア	694,239,161	0.25
	その他	919,132,241	0.33
	小計	5,093,952,797	1.82
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		13,298,203,070	4.75
合計（純資産総額）		279,827,634,575	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	171,105,320,613	40.47
	フランス	40,160,944,171	9.50
	ドイツ	38,892,715,752	9.20
	イタリア	38,253,115,693	9.05
	イギリス	34,827,934,181	8.24
	その他	91,433,079,647	21.63
	小計	414,673,110,057	98.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,131,462,664	1.92
合計（純資産総額）		422,804,572,721	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

（４資産インデックスバランスオープン（分配型））

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	68,030,765	0.7570	51,499,290	0.7827	53,247,679	25.68
	中央三井日本債券マザーファンド	39,515,608	1.2007	47,446,410	1.2026	47,521,470	22.92
	中央三井外国株式マザーファンド	53,914,129	1.0186	54,916,932	1.0385	55,989,822	27.01
	中央三井外国債券マザーファンド	31,891,877	1.5799	50,385,977	1.5893	50,685,760	24.45

（４資産インデックスバランスオープン（成長型））

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	204,034,501	0.7570	154,454,118	0.7827	159,697,803	25.39
	中央三井日本債券マザーファンド	123,052,813	1.2005	147,724,937	1.2026	147,983,312	23.53
	中央三井外国株式マザーファンド	162,489,501	1.0186	165,511,806	1.0385	168,745,346	26.83
	中央三井外国債券マザーファンド	96,268,384	1.5799	152,094,420	1.5893	152,999,342	24.32

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

②【投資不動産物件】
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】
該当事項はありません。

＜参考＞
当ファンドが主要投資対象としている親投資信託の状況
（中央三井日本株式マザーファンド）
① 投資有価証券の主要銘柄
A．主要銘柄の明細

順位	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	2,852,400	2,720.00	7,758,528,000	3,570.00	10,183,068,000	3.85
2	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	16,435,100	355.00	5,834,460,500	412.00	6,771,261,200	2.56
3	本田技研工業	輸送用機器	1,855,800	2,673.00	4,960,553,400	3,145.00	5,836,491,000	2.21
4	キヤノン	電気機器	1,366,500	3,390.00	4,632,435,000	3,910.00	5,343,015,000	2.02
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,648,500	2,397.00	3,951,454,500	2,723.00	4,488,865,500	1.70
6	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	27,896,500	117.00	3,263,890,500	135.00	3,766,027,500	1.42
7	日本電信電話	情報・通信業	999,800	3,835.00	3,834,233,000	3,755.00	3,754,249,000	1.42
8	ファナック	電気機器	229,000	12,950.00	2,965,550,000	14,680.00	3,361,720,000	1.27
9	武田薬品工業	医薬品	863,000	3,245.00	2,800,435,000	3,645.00	3,145,635,000	1.19
10	三菱商事	卸売業	1,581,100	1,698.00	2,684,707,800	1,920.00	3,035,712,000	1.15
11	日立製作所	電気機器	4,940,000	430.00	2,124,200,000	531.00	2,623,140,000	0.99
12	日本たばこ産業	食料品	5,464	380,000.00	2,076,320,000	466,000.00	2,546,224,000	0.96
13	三井物産	卸売業	1,874,000	1,267.00	2,374,358,000	1,357.00	2,543,018,000	0.96
14	小松製作所	機械	1,074,400	2,093.00	2,248,719,200	2,359.00	2,534,509,600	0.96
15	日産自動車	輸送用機器	2,798,700	716.98	2,006,611,926	881.00	2,465,654,700	0.93
16	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	17,888	138,000.00	2,468,544,000	137,400.00	2,457,811,200	0.93
17	ソフトバンク	情報・通信業	983,600	2,239.00	2,202,280,400	2,447.00	2,406,869,200	0.91
18	ソニー	電気機器	1,372,400	1,422.00	1,951,552,800	1,704.00	2,338,569,600	0.88

19	三菱地所	不動産業	1,519,000	1,276.00	1,938,244,000	1,476.00	2,242,044,000	0.85
20	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	908,200	2,114.00	1,919,934,800	2,458.00	2,232,355,600	0.84
21	東日本旅客鉄道	陸運業	382,500	4,670.00	1,786,275,000	5,210.00	1,992,825,000	0.75
22	信越化学工業	化学	413,200	3,970.00	1,640,404,000	4,780.00	1,975,096,000	0.75
23	パナソニック	電気機器	2,513,200	644.00	1,618,500,800	761.00	1,912,545,200	0.72
24	東京海上ホールディングス	保険業	824,200	1,860.00	1,533,012,000	2,271.00	1,871,758,200	0.71
25	ＫＤＤＩ	情報・通信業	3,369	482,500.00	1,625,542,500	536,000.00	1,805,784,000	0.68
26	アステラス製薬	医薬品	511,400	3,015.00	1,541,871,000	3,400.00	1,738,760,000	0.66
27	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	4,699,500	286.00	1,344,057,000	366.00	1,720,017,000	0.65
28	東芝	電気機器	4,631,000	341.00	1,579,171,000	364.00	1,685,684,000	0.64
29	国際石油開発帝石	鉱業	2,996	506,000.00	1,515,976,000	559,000.00	1,674,764,000	0.63
30	三菱電機	電気機器	2,200,000	771.00	1,696,200,000	732.00	1,610,400,000	0.61
合計			87,402,717		79,878,022,126		92,063,873,500	34.80

（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	0.10
	鉱業	0.72
	建設業	2.29
	食料品	3.51
	繊維製品	0.89
	パルプ・紙	0.36
	化学	5.66
	医薬品	4.60
	石油・石炭製品	0.81
	ゴム製品	0.77
	ガラス・土石製品	1.09
	鉄鋼	1.85
	非鉄金属	1.17
	金属製品	0.67
	機械	4.95
	電気機器	13.38
	輸送用機器	10.46
	精密機器	1.39
	その他製品	1.57
	電気・ガス業	2.90
	陸運業	3.71
	海運業	0.41
	空運業	0.28
	倉庫・運輸関連業	0.23
	情報・通信業	5.87
	卸売業	5.40
	小売業	4.13
	銀行業	9.30
	証券、商品先物取引業	1.16
	保険業	2.35
	その他金融業	0.79
	不動産業	2.42
	サービス業	1.82
合計		96.97

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

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

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	930	7,925,997,575	7,970,100,000	3.01

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

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

（中央三井日本債券マザーファンド）

① 投資有価証券の主要銘柄

A．主要銘柄の明細

順位	銘柄名	利率（%）	償還日	額面金額（円）	簿価（円）		評価額（円）		投資比率（%）
					単価	金額	単価	金額	
1	利付国庫債券（５年）第８７回	0.5	2014/12/20	5,200,000,000	100.91	5,247,466,000	100.94	5,249,140,000	1.43
2	利付国庫債券（１０年）第２８９回	1.5	2017/12/20	3,600,000,000	106.11	3,820,279,000	106.17	3,822,192,000	1.04
3	利付国庫債券（１０年）第２８５回	1.7	2017/3/20	3,400,000,000	106.76	3,630,146,000	106.78	3,630,792,000	0.99
4	利付国庫債券（５年）第８８回	0.5	2015/3/20	3,500,000,000	100.91	3,531,927,000	101.00	3,535,035,000	0.96
5	利付国庫債券（２年）第３１３回	0.1	2014/2/15	3,500,000,000	99.98	3,499,580,000	99.98	3,499,335,000	0.95
6	利付国庫債券（１０年）第３１２回	1.2	2020/12/20	3,200,000,000	102.85	3,291,200,000	103.04	3,297,536,000	0.90
7	利付国庫債券（１０年）第２８８回	1.7	2017/9/20	3,000,000,000	107.09	3,212,790,000	107.15	3,214,500,000	0.88
8	利付国庫債券（１０年）第２８４回	1.7	2016/12/20	2,950,000,000	106.55	3,143,284,000	106.53	3,142,635,000	0.86
9	利付国庫債券（１０年）第３０５回	1.3	2019/12/20	2,900,000,000	104.49	3,030,312,000	104.54	3,031,747,000	0.83
10	利付国庫債券（１０年）第３１３回	1.3	2021/3/20	2,800,000,000	103.46	2,897,076,000	103.70	2,903,684,000	0.79
11	利付国庫債券（２年）第３０９回	0.1	2013/10/15	2,900,000,000	99.96	2,898,985,000	99.99	2,899,768,000	0.79
12	利付国庫債券（５年）第１００回	0.3	2016/9/20	2,800,000,000	99.92	2,797,760,000	100.08	2,802,464,000	0.76
13	利付国庫債券（１０年）第３１８回	1.0	2021/9/20	2,700,000,000	100.26	2,707,128,000	100.60	2,716,416,000	0.74
14	利付国庫債券（１０年）第３１５回	1.2	2021/6/20	2,600,000,000	102.33	2,660,658,000	102.63	2,668,614,000	0.73
15	利付国庫債券（１０年）第３１７回	1.1	2021/9/20	2,500,000,000	101.28	2,532,022,000	101.52	2,538,050,000	0.69
16	利付国庫債券（５年）第９６回	0.5	2016/3/20	2,400,000,000	100.81	2,419,632,000	101.03	2,424,936,000	0.66
17	利付国庫債券（５年）第８９回	0.4	2015/6/20	2,400,000,000	100.53	2,412,936,000	100.71	2,417,232,000	0.66
18	利付国庫債券（５年）第９９回	0.4	2016/9/20	2,400,000,000	100.29	2,407,128,000	100.52	2,412,672,000	0.66
19	利付国庫債券（５年）第９２回	0.3	2015/9/20	2,400,000,000	100.18	2,404,392,000	100.37	2,409,072,000	0.66
20	利付国庫債券（２年）第３０７回	0.2	2013/8/15	2,400,000,000	100.12	2,402,952,000	100.12	2,403,096,000	0.65
21	利付国庫債券（１０年）第３０７回	1.3	2020/3/20	2,200,000,000	104.34	2,295,524,000	104.40	2,296,910,000	0.63
22	利付国庫債券（５年）第１０２回	0.3	2016/12/20	2,200,000,000	99.92	2,198,442,000	100.00	2,200,000,000	0.60
23	利付国庫債券（２年）第３１４回	0.1	2014/3/15	2,200,000,000	99.97	2,199,470,000	99.98	2,199,560,000	0.60
24	利付国庫債券（５年）第８２回	0.9	2014/3/20	2,100,000,000	101.63	2,134,356,000	101.54	2,132,424,000	0.58
25	利付国庫債券（５年）第８５回	0.7	2014/9/20	2,100,000,000	101.39	2,129,337,000	101.37	2,128,854,000	0.58
26	利付国庫債券（５年）第８６回	0.6	2014/9/20	2,100,000,000	101.13	2,123,734,000	101.12	2,123,709,000	0.58
27	利付国庫債券（１０年）第３１１回	0.8	2020/9/20	2,100,000,000	99.76	2,095,159,000	100.00	2,100,000,000	0.57
28	利付国庫債券（５年）第８３回	0.9	2014/6/20	2,000,000,000	101.79	2,035,820,000	101.69	2,033,940,000	0.55
29	利付国庫債券（５年）第９４回	0.6	2015/12/20	2,000,000,000	101.23	2,024,680,000	101.43	2,028,720,000	0.55
30	利付国庫債券（５年）第９３回	0.5	2015/12/20	2,000,000,000	100.84	2,016,800,000	101.06	2,021,360,000	0.55
合計				80,550,000,000		82,200,975,000		82,284,393,000	22.41

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

（注２）国／地域は全て日本、種類は全て国債証券です。

B．種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	76.34
地方債証券	6.56
特殊債券	9.68
社債券	6.91
合計	99.50

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

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

銘柄名	国／地域	数量（枚）	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
債券先物取引 買建 長期国債先物	日本	5	709,997,350	710,050,000	0.19

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

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

（中央三井外国株式マザーファンド）

① 投資有価証券の主要銘柄

A．主要銘柄の明細

順位	国／地域	銘柄名	業種	株数	簿価（円）		評価額（円）		投資比率（%）
					単価	金額	単価	金額	
1	アメリカ	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	133,500	38,133.69	5,090,848,189	50,124.39	6,691,606,518	2.39
2	アメリカ	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	688,402	7,047.79	4,851,714,452	7,074.91	4,870,385,773	1.74
3	アメリカ	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE	ソフトウェア・サービス	169,278	15,847.87	2,682,696,719	17,117.71	2,897,651,933	1.04
4	アメリカ	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	1,087,391	2,482.13	2,699,054,521	2,639.94	2,870,650,041	1.03
5	アメリカ	CHEVRON CORP	エネルギー	286,042	8,767.20	2,507,789,510	8,782.00	2,512,021,273	0.90
6	アメリカ	GENERAL ELECTRIC	資本財	1,516,245	1,565.71	2,374,014,363	1,639.69	2,486,172,522	0.89
7	スイス	NESTLE SA-REGISTERD	食品・飲料・タバコ	473,928	4,835.28	2,291,577,423	5,108.46	2,421,045,074	0.87
8	アメリカ	AT&T INC	電気通信サービス	851,152	2,463.23	2,096,586,800	2,565.14	2,183,332,467	0.78
9	アメリカ	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	395,215	5,219.88	2,062,977,601	5,507.55	2,176,667,124	0.78
10	アメリカ	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	392,270	5,357.96	2,101,769,362	5,386.73	2,113,053,597	0.76
11	アメリカ	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	545,787	3,134.72	1,710,893,026	3,753.61	2,048,675,525	0.73
12	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	1,103,972	1,721.88	1,900,907,859	1,842.69	2,034,288,983	0.73
13	アメリカ	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	719,520	2,482.13	1,785,947,933	2,789.52	2,007,121,618	0.72
14	アメリカ	GOOGLE INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	36,800	50,061.10	1,842,248,741	53,292.81	1,961,175,698	0.70
15	イギリス	HSBC HLDGS PLC	銀行	2,566,080	731.56	1,877,251,235	718.56	1,843,885,370	0.66
16	アメリカ	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	293,634	5,591.38	1,641,820,948	6,066.44	1,781,314,188	0.64
17	アメリカ	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	249,475	6,316.30	1,575,759,316	7,121.76	1,776,701,949	0.63
18	アメリカ	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	731,365	2,196.11	1,606,162,963	2,314.47	1,692,722,644	0.60

19	イギリス	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	7,220,275	232.47	1,678,510,325	229.12	1,654,328,396	0.59
20	イギリス	BP PLC	エネルギー	2,723,407	642.25	1,749,115,226	602.71	1,641,449,851	0.59
21	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	335,165	4,707.80	1,577,890,457	4,532.96	1,519,291,817	0.54
22	イギリス	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	522,940	2,964.34	1,550,173,946	2,861.24	1,496,257,839	0.53
23	スイス	ROCHE HLDGS AG GENUSSCHINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	100,899	14,387.47	1,451,682,344	14,296.41	1,442,494,481	0.52
24	アメリカ	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	579,676	2,383.50	1,381,663,542	2,408.98	1,396,433,049	0.50
25	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	437,819	3,156.09	1,381,798,794	3,124.04	1,367,764,900	0.49
26	アメリカ	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	272,326	5,085.91	1,385,027,487	4,998.79	1,361,302,065	0.49
27	オーストラリア	BHP BILLITON LTD	素材	461,218	3,265.04	1,505,897,294	2,926.66	1,349,829,424	0.48
28	アメリカ	QUALCOMM INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	241,438	5,017.69	1,211,463,331	5,583.16	1,347,988,601	0.48
29	アメリカ	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	772,113	1,659.41	1,281,256,743	1,728.45	1,334,563,115	0.48
30	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	724,970	1,863.71	1,351,137,173	1,838.75	1,333,045,837	0.48
合計						60,205,637,623		63,613,221,672	22.73

（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	11.29
	素材	6.77
	資本財	7.13
	商業・専門サービス	0.79
	運輸	1.68
	自動車・自動車部品	1.29
	耐久消費財・アパレル	1.24
	消費者サービス	1.67
	メディア	2.45
	小売	2.75
	食品・生活必需品小売り	2.14
	食品・飲料・タバコ	6.59
	家庭用品・パーソナル用品	1.70
	ヘルスケア機器・サービス	2.62
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.31
	銀行	7.08
	各種金融	4.66
	保険	3.88
	不動産	0.67
	ソフトウェア・サービス	5.82
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.99
	電気通信サービス	3.74
	公益事業	3.46
	半導体・半導体製造装置	1.64
	小計	93.37
投資信託受益証券	―	0.05
投資証券	―	1.82
合計		95.25

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

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

取引名	国／地域	資産名	種類	数量（枚）	簿価（円）	時価（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	アメリカ	S&P 500 FUTU	買建	256	7,379,092,335	7,354,755,712	2.63
	カナダ	S&P/TSX60 IX	買建	53	621,303,188	616,846,902	0.22
	ドイツ	SWISS MKT IX	買建	168	943,792,826	928,899,417	0.33
	ドイツ	DJ EURO STOX	買建	581	1,575,036,476	1,521,482,130	0.54
	オーストラリア	ASX SPI 200	買建	95	875,207,953	880,775,875	0.31
	イギリス	FTSE 100 IDX	買建	251	1,925,686,886	1,876,773,736	0.67

（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）

① 投資有価証券の主要銘柄

A．主要銘柄の明細

順位	国／地域	銘柄名	利率（%）	償還日	額面金額	簿価（円）		評価額（円）		投資比率（%）
						単価	金額	単価	金額	
1	アメリカ	US TREASURY N/B	1.500	2013/12/31	40,120,000	8,415.48	3,376,292,770	8,387.87	3,365,215,371	0.80
2	アメリカ	US TREASURY N/B	3.625	2021/2/15	31,230,000	9,528.90	2,975,876,445	9,345.25	2,918,524,648	0.69
3	アメリカ	US TREASURY N/B	3.000	2017/2/28	31,550,000	9,120.52	2,877,524,552	9,004.29	2,840,856,588	0.67
4	アメリカ	US TREASURY N/B	2.625	2014/7/31	32,650,000	8,695.44	2,839,062,842	8,639.58	2,820,823,418	0.67
5	アメリカ	US TREASURY N/B	0.500	2013/11/15	32,000,000	8,256.88	2,642,203,038	8,242.75	2,637,682,588	0.62
6	アメリカ	US TREASURY N/B	3.875	2040/8/15	26,910,000	9,519.91	2,561,808,747	9,211.70	2,478,868,763	0.59
7	アメリカ	US TREASURY N/B	3.500	2020/5/15	26,650,000	9,450.56	2,518,575,780	9,277.19	2,472,372,800	0.58
8	アメリカ	US TREASURY N/B	1.250	2019/1/31	30,050,000	8,173.73	2,456,206,252	8,074.52	2,426,394,891	0.57
9	アメリカ	US TREASURY N/B	3.625	2020/2/15	25,030,000	9,527.61	2,384,763,012	9,352.96	2,341,047,178	0.55
10	アメリカ	US TREASURY N/B	3.375	2019/11/15	25,070,000	9,373.51	2,349,939,622	9,209.13	2,308,729,556	0.55
11	アメリカ	US TREASURY N/B	0.625	2013/2/28	27,450,000	8,255.60	2,266,162,274	8,249.82	2,264,575,933	0.54
12	アメリカ	US TREASURY N/B	2.375	2014/8/31	26,000,000	8,655.63	2,250,464,937	8,603.62	2,236,942,124	0.53
13	アメリカ	US TREASURY N/B	2.625	2018/1/31	25,250,000	8,976.68	2,266,613,987	8,853.40	2,235,484,525	0.53
14	アメリカ	US TREASURY N/B	5.125	2016/5/15	22,000,000	9,793.45	2,154,559,481	9,666.95	2,126,730,469	0.50
15	アメリカ	US TREASURY N/B	1.375	2015/11/30	25,000,000	8,499.60	2,124,900,459	8,422.54	2,105,637,178	0.50
16	アメリカ	US TREASURY N/B	2.125	2021/8/15	25,400,000	8,414.20	2,137,207,117	8,253.67	2,096,433,172	0.50
17	イギリス	TREASURY	4.500	2013/3/7	15,330,000	13,713.20	2,102,235,001	13,623.89	2,088,543,594	0.49
18	アメリカ	US TREASURY N/B	1.875	2015/6/30	23,900,000	8,637.01	2,064,246,165	8,559.96	2,045,830,468	0.48
19	アメリカ	US TREASURY N/B	2.625	2016/2/29	22,900,000	8,916.33	2,041,839,748	8,812.30	2,018,018,775	0.48
20	アメリカ	US TREASURY N/B	1.750	2013/4/15	24,000,000	8,369.25	2,008,620,862	8,348.70	2,003,689,462	0.47
21	アメリカ	US TREASURY N/B	4.500	2039/8/15	19,450,000	10,540.86	2,050,198,728	10,192.84	1,982,508,200	0.47
22	アメリカ	US TREASURY N/B	2.000	2021/11/15	24,320,000	8,288.34	2,015,726,188	8,132.95	1,977,935,226	0.47
23	フランス	FRANCE O.A.T.	3.750	2019/10/25	16,450,000	11,906.71	1,958,654,124	11,907.81	1,958,834,745	0.46
24	アメリカ	US TREASURY N/B	4.750	2017/8/15	19,000,000	9,885.27	1,878,202,027	9,774.83	1,857,217,900	0.44
25	アメリカ	US TREASURY N/B	1.500	2016/6/30	21,960,000	8,534.27	1,874,126,953	8,446.30	1,854,808,955	0.44
26	アメリカ	US TREASURY N/B	1.250	2015/9/30	21,980,000	8,463.00	1,860,167,743	8,394.29	1,845,066,238	0.44
27	アメリカ	US TREASURY N/B	2.750	2013/10/31	21,600,000	8,574.08	1,852,002,688	8,534.91	1,843,542,247	0.44
28	フランス	BTAN-5YR ISSUE	3.000	2014/7/12	15,830,000	11,560.84	1,830,081,288	11,533.39	1,825,735,953	0.43
29	アメリカ	US TREASURY N/B	4.625	2017/2/15	18,500,000	9,780.61	1,809,412,850	9,638.70	1,783,160,215	0.42
30	イタリア	BTPS	3.000	2015/4/15	15,970,000	10,813.10	1,726,852,708	10,833.96	1,730,184,370	0.41
合計							67,254,528,388		66,491,395,550	15.73

（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	98.08
合計	98.08

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

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

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	28	283,624,429	282,289,254	0.07
	アメリカ	US 10YR NOTE	買建	18	193,822,783	192,185,904	0.05
	アメリカ	US LONG BOND	買建	14	163,154,321	159,797,907	0.04
	ドイツ	EURO-SCHATZ	買建	16	193,817,203	193,862,880	0.05
	ドイツ	EURO-BOBL FU	買建	17	231,363,752	231,607,728	0.05
	ドイツ	EURO-BUND FU	買建	27	409,485,704	410,033,826	0.10

（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】

①【純資産の推移】

（４資産インデックスバランスオープン（分配型））

平成24年３月30日及び同日前１年以内における各月末並びに下記特定期間末の純資産の推移は次のとおりです。

	純資産総額（円）		１万口当たりの基準価額（円）	
	（分配落）	（分配付）※	（分配落）	（分配付）※
第１特定期間（平成20年８月26日現在）	435,609,876	436,872,171	10,161	10,190
第２特定期間（平成21年２月26日現在）	365,005,012	366,489,759	7,350	7,380
第３特定期間（平成21年８月26日現在）	486,627,229	488,273,025	8,714	8,743
第４特定期間（平成22年２月26日現在）	413,485,635	415,472,248	8,325	8,365
第５特定期間（平成22年８月26日現在）	329,498,369	331,167,420	7,897	7,937
第６特定期間（平成23年２月28日現在）	394,035,328	395,893,919	8,480	8,520
第７特定期間（平成23年８月26日現在）	328,014,776	329,720,221	7,693	7,733
第８特定期間（平成24年２月27日現在）	218,609,705	219,665,163	8,285	8,325
平成23年３月末日	386,413,749	—	8,452	—
平成23年４月末日	384,875,252	—	8,504	—
平成23年５月末日	374,977,117	—	8,319	—
平成23年６月末日	364,932,868	—	8,295	—
平成23年７月末日	351,956,480	—	8,127	—
平成23年８月末日	331,198,050	—	7,767	—
平成23年９月末日	322,140,284	—	7,591	—
平成23年10月末日	330,745,521	—	7,881	—
平成23年11月末日	313,922,940	—	7,526	—
平成23年12月末日	317,105,362	—	7,612	—
平成24年１月末日	203,777,717	—	7,743	—
平成24年２月末日	218,345,339	—	8,273	—
平成24年３月末日	207,318,270	—	8,409	—

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

（４資産インデックスバランスオープン（成長型））

	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８月26日現在）	836,204,658	10,187
第２期計算期間（平成21年２月26日現在）	740,083,144	7,421
第３期計算期間（平成21年８月26日現在）	1,040,341,028	8,839
第４期計算期間（平成22年２月26日現在）	1,028,095,855	8,523
第５期計算期間（平成22年８月26日現在）	912,973,219	8,166
第６期計算期間（平成23年２月28日現在）	840,656,299	8,849
第７期計算期間（平成23年８月26日現在）	703,717,239	8,092
第８期計算期間（平成24年２月27日現在）	638,106,215	8,806
平成23年３月末日	817,488,849	8,802
平成23年４月末日	813,472,866	8,857
平成23年５月末日	781,454,382	8,706
平成23年６月末日	771,433,996	8,681
平成23年７月末日	744,964,859	8,505
平成23年８月末日	710,014,629	8,170
平成23年９月末日	688,599,568	7,985
平成23年10月末日	706,383,558	8,293
平成23年11月末日	609,887,641	7,962
平成23年12月末日	611,284,531	8,053
平成24年１月末日	603,526,989	8,193
平成24年２月末日	637,085,045	8,794
平成24年３月末日	629,043,205	8,937

（注）決算日における基準価額は、分配付、分配落とも同一です。

②【分配の推移】

（４資産インデックスバランスオープン（分配型））

特定期間	１万口当たりの収益分配金
第１特定期間（自　平成20年３月31日　至　平成20年８月26日）	30　円
第２特定期間（自　平成20年８月27日　至　平成21年２月26日）	60　円
第３特定期間（自　平成21年２月27日　至　平成21年８月26日）	60　円
第４特定期間（自　平成21年８月27日　至　平成22年２月26日）	80　円
第５特定期間（自　平成22年２月27日　至　平成22年８月26日）	80　円
第６特定期間（自　平成22年８月27日　至　平成23年２月28日）	80　円
第７特定期間（自　平成23年３月１日　至　平成23年８月26日）	80　円
第８特定期間（自　平成23年８月27日　至　平成24年２月27日）	80　円

（注）収益分配金は、各特定期間中の分配金の累計金額を表示しております。

（４資産インデックスバランスオープン（成長型））

	１万口当たりの収益分配金
第１期計算期間	0　円
第２期計算期間	0　円
第３期計算期間	0　円

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

③【収益率の推移】

（４資産インデックスバランスオープン（分配型））

特定期間	収益率
第１特定期間（自 平成20年３月31日 至 平成20年８月26日）	1.9 %
第２特定期間（自 平成20年８月27日 至 平成21年２月26日）	△27.1 %
第３特定期間（自 平成21年２月27日 至 平成21年８月26日）	19.4 %
第４特定期間（自 平成21年８月27日 至 平成22年２月26日）	△3.6 %
第５特定期間（自 平成22年２月27日 至 平成22年８月26日）	△4.2 %
第６特定期間（自 平成22年８月27日 至 平成23年２月28日）	8.4 %
第７特定期間（自 平成23年３月１日 至 平成23年８月26日）	△8.3 %
第８特定期間（自 平成23年８月27日 至 平成24年２月27日）	8.7 %

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

（４資産インデックスバランスオープン（成長型））

	収益率
第１期計算期間	1.9 %
第２期計算期間	△27.2 %
第３期計算期間	19.1 %
第４期計算期間	△3.6 %
第５期計算期間	△4.2 %
第６期計算期間	8.4 %
第７期計算期間	△8.6 %
第８期計算期間	8.8 %

（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】

（４資産インデックスバランスオープン（分配型））

特定期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第１特定期間（自 平成20年３月31日 至 平成20年８月26日）	430,927,305	2,198,864	428,728,441
第２特定期間（自 平成20年８月27日 至 平成21年２月26日）	103,108,359	35,207,969	496,628,831
第３特定期間（自 平成21年２月27日 至 平成21年８月26日）	108,522,777	46,685,607	558,466,001
第４特定期間（自 平成21年８月27日 至 平成22年２月26日）	63,711,059	125,523,738	496,653,322
第５特定期間（自 平成22年２月27日 至 平成22年８月26日）	83,913,110	163,303,670	417,262,762

第６特定期間（自 平成22年８月27日 至 平成23年２月28日）	156,032,898	108,647,747	464,647,913
第７特定期間（自 平成23年３月１日 至 平成23年８月26日）	1,055,305	39,341,842	426,361,376
第８特定期間（自 平成23年８月27日 至 平成24年２月27日）	11,041,040	173,537,857	263,864,559

（４資産インデックスバランスオープン（成長型））

	設定口数	解約口数	発行済み口数
第１期計算期間	837,044,474	16,224,753	820,819,721
第２期計算期間	218,854,764	42,352,506	997,321,979
第３期計算期間	216,371,899	36,712,472	1,176,981,406
第４期計算期間	206,792,044	177,569,508	1,206,203,942
第５期計算期間	68,182,569	156,302,282	1,118,084,229
第６期計算期間	31,744,867	199,831,374	949,997,722
第７期計算期間	18,008,066	98,408,749	869,597,039
第８期計算期間	13,395,503	158,384,002	724,608,540

（注１）設定及び解約の実績は、全て本邦内における実績です。
（注２）第１特定期間及び第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3月30日 現在（基準日）

〈基準価額・純資産の推移〉

4資産インデックスバランスオープン（分配型）

4資産インデックスバランスオープン（成長型）

・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〉

4資産インデックスバランスオープン（分配型）

2012年2月	40円
2011年11月	40円
2011年8月	40円
2011年5月	40円
2011年2月	40円
直近1年間累計	160円
設定来累計	550円

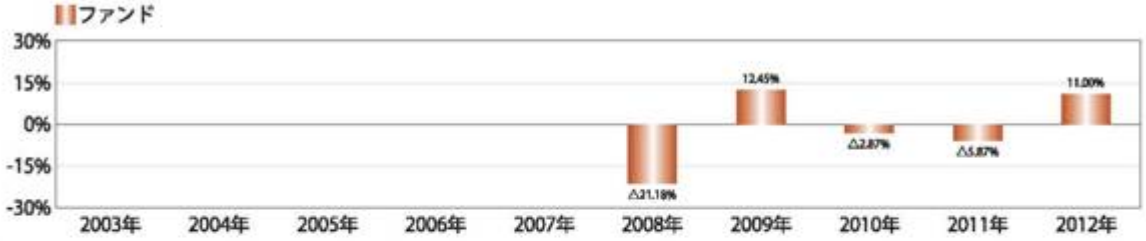
4資産インデックスバランスオープン（成長型）

2012年2月	0円
2011年8月	0円
2011年2月	0円
2010年8月	0円
2010年2月	0円
設定来累計	0円

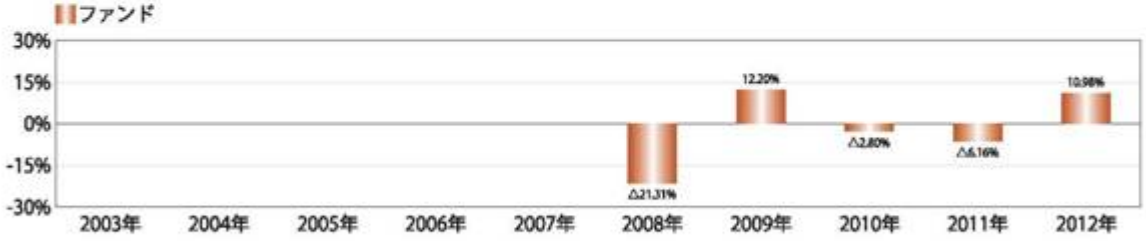
・分配金は1万口当たり、税引前の値です。
・運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

〈年間収益率の推移〉

4資産インデックスバランスオープン（分配型）



4資産インデックスバランスオープン（成長型）



・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。

運用実績

〈主な資産の状況〉

組入ファンド

4資産インデックスバランスオープン（分配型）

ファンド名	比率
中央三井日本株式マザーファンド	25.68%
中央三井日本債券マザーファンド	22.92%
中央三井外国株式マザーファンド	27.01%
中央三井外国債券マザーファンド	24.45%

4資産インデックスバランスオープン（成長型）

ファンド名	比率
中央三井日本株式マザーファンド	25.39%
中央三井日本債券マザーファンド	23.53%
中央三井外国株式マザーファンド	26.83%
中央三井外国債券マザーファンド	24.32%

・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	3.85%
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	2.56%
本田技研工業	輸送用機器	2.21%
キヤノン	電気機器	2.02%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.70%

組入上位銘柄（中央三井日本債券マザーファンド）

銘柄名	種類	償還日	利率	比率
利付国庫債券（５年）第８７回	国債証券	2014/12/20	0.500%	1.43%
利付国庫債券（１０年）第２８９回	国債証券	2017/12/20	1.500%	1.04%
利付国庫債券（１０年）第２８５回	国債証券	2017/03/20	1.700%	0.99%
利付国庫債券（５年）第８８回	国債証券	2015/03/20	0.500%	0.96%
利付国庫債券（２年）第３１３回	国債証券	2014/02/15	0.100%	0.95%

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	2.39%
EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	エネルギー	1.74%
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	1.03%
CHEVRON CORP	アメリカ	エネルギー	0.90%

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	0.80%
US TREASURY N/B	国債証券	2021/02/15	3.625%	米ドル	0.69%
US TREASURY N/B	国債証券	2017/02/28	3.000%	米ドル	0.67%

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

（１）申込みの受付け

申込期間中において、毎営業日お申込みいただけます。

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

ただし、分配金再投資に関する契約（下記（４）②をご参照ください。）に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、ニューヨーク証券取引所又はロンドン証券取引所が休業日の場合は、受益権の取得申込みを受付けないものとし、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付けを中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取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。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

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

（３）販売価額

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

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

（４）その他

① 受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。このため販売会社は総合約款を取得申込者に交付し、取得申込者は総合約款に基づく取引口座の設定を申込む旨の申込書を提出していただきます。

② 「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。

③ 受益権取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

２【換金（解約）手続等】

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

（注）一部解約の実行の請求の受付けは、営業日の午後３時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎての受付けは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

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

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

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

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

（４）一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.15%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】

① 基準価額

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

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

② 当ファンドの主たる投資対象としている資産及び基準価額に与える影響が大きいと想定される資産の評価方法

Ａ．親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド、日本債券マザーファンド、外国株式マザーファンド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

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31日）から無期限とします。ただし、委託会社は、下記（５）①の事項に該当することとなった場合は、この信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

① 当ファンドの計算期間は、以下のとおりとします。

○ ４資産インデックスバランスオープン（分配型）

毎年２月27日から５月26日まで、５月27日から８月26日まで、８月27日から11月26日まで及び11月27日から翌年２月26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31日から平成20年８月26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。

○ ４資産インデックスバランスオープン（成長型）

毎年２月27日から８月26日まで、及び８月27日から翌年２月26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31日から平成20年８月26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。

② 上記①の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

（５）【その他】

① 信託の終了

この信託契約を解約し信託を終了させる場合は下記のとおりです。

Ａ．委託会社の所定の手続きを経て信託を終了させる場合

イ．受益権の口数が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。

ロ．受益者に有利な場合又はやむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

ハ．所定の手続き

ａ．委託会社は、上記イ．及びロ．の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を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③の規定に従います。

Ｃ．委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

ロ．上記イ．の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、下記③Ｄ．に該当する場合には、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。受託会社が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③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。

② 委託会社の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い

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

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

③ 信託約款の変更等

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③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ます。

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発します。

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．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にあっても、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。

④ 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る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①A．ハ．b．又は③B．に規定する書面に付記します。

⑤ 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥ 信託財産の管理

A．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、下記ハ．及び⑨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ます。

ハ．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ます。

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．委託会社のみの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。

⑦ 運用報告書

委託会社は、毎年２月及び８月の決算時並びに償還時に運用報告書を作成し、販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

⑧ 関係法人との契約の更改等に関する手続き、変更した場合の開示方法

A．委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約の有効期間は、有効期間満了日の３ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示がないときは、自動的に１年間延長され、その後も同様とします。

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

⑨ 信託事務処理の再委託

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

① 受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

② 収益分配金は、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ます。）に対する支払いを開始します。

③ 上記②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。

④ 上記②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。

⑤ 受益者が、収益分配金については上記②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

① 受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

② 償還金は、信託終了日（償還日）後１ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日）から起算して５営業日までの日）から、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対する支払いを開始します。

③ 償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

（３）一部解約請求権

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

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

③ 一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

（４）投資信託約款等重要事項変更時の反対者の買取請求権

前記「３ 資産管理等の概要 （５）その他 ④ 反対者の買取請求権」をご参照ください。

（５）受益権均等分割

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

（６）帳簿閲覧権

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

（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）各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）「４資産インデックスバランスオープン（分配型）」の計算期間は６ヶ月未満であるため、財務諸表は６ヶ月毎に作成しております。

（３）各ファンドは、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、「４資産インデックスバランスオープン（分配型）」の第８特定期間（平成23年８月27日から平成24年２月27日まで）並びに「４資産インデックスバランスオープン（成長型）」の第８期計算期間（平成23年８月27日から平成24年２月27日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（４）各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」、「中央三井日本債券マザーファンド」、「中央三井外国株式マザーファンド」、「中央三井外国債券マザーファンド」については、平成24年４月１日付にてそれぞれ「日本株式マザーファンド」、「日本債券マザーファンド」、「外国株式マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」に名称を変更しました。以下では、変更前の名称で表示しています。

１【財務諸表】

【４資産インデックスバランスオープン（分配型）】

（１）【貸借対照表】

(単位：円)

	第７特定期間 (平成23年８月26日現在)	第８特定期間 (平成24年２月27日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	330,333,834	220,121,629
流動資産合計	330,333,834	220,121,629
資産合計	330,333,834	220,121,629
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,705,445	1,055,458
未払受託者報酬	56,211	41,823
未払委託者報酬	552,746	411,187
その他未払費用	4,656	3,456
流動負債合計	2,319,058	1,511,924
負債合計	2,319,058	1,511,924
純資産の部		
元本等		
元本	426,361,376	263,864,559
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△98,346,600	△45,254,854
純資産合計	328,014,776	218,609,705
負債純資産合計	330,333,834	220,121,629

（２）【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第７特定期間 (自 平成23年３月１日 至 平成23年８月26日)	第８特定期間 (自 平成23年８月27日 至 平成24年２月27日)
営業収益		
有価証券売買等損益	△29,683,966	18,188,876
営業収益合計	△29,683,966	18,188,876
営業費用		
受託者報酬	113,759	94,120
委託者報酬	1,118,572	925,430
その他費用	9,420	7,782
営業費用合計	1,241,751	1,027,332
営業利益又は営業損失（△）	△30,925,717	17,161,544
経常利益又は経常損失（△）	△30,925,717	17,161,544
当期純利益又は当期純損失（△）	△30,925,717	17,161,544
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△394,283	3,669,028
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△70,612,585	△98,346,600
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,482,174	44,854,458
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,482,174	44,854,458
剰余金減少額又は欠損金増加額	176,373	2,531,436
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	176,373	2,531,436
分配金	3,508,382	2,723,792
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△98,346,600	△45,254,854

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２．その他	ファンドの計算期間 第８特定期間（自 平成23年８月27日 至 平成24年２月27日） 第８特定期間は当特定期間末日が休業日のため、平成23年８月27日から平成24年２月27日までとなっております。

（追加情報）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第７特定期間 （平成23年８月26日現在）	第８特定期間 （平成24年２月27日現在）
１．当該特定期間の末日における受益権総数	426,361,376 口	263,864,559 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 98,346,600 円	元本の欠損 45,254,854 円
３．１口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	0.7693 円 (7,693 円)	0.8285 円 (8,285 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７特定期間 自 平成23年３月１日 至 平成23年８月26日	第８特定期間 自 平成23年８月27日 至 平成24年２月27日
		第 12 期 自 平成23年３月１日 至 平成23年５月26日	第 14 期 自 平成23年８月27日 至 平成23年11月28日
費用控除後の配当等収益額	A	2,075,262 円 (2,703,400 円)	1,615,169 円 (2,186,035 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	3,295,358 円	3,063,742 円

分配準備積立金額	D	575,298 円	352,227 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,945,918 円	5,031,138 円
当ファンドの期末残存口数	F	450,734,301 口	417,083,729 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	131.91 円	120.62 円
10,000口当たり分配金額	H	40 円	40 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,802,937 円	1,668,334 円
		第 13 期 自 平成23年５月27日 至 平成23年８月26日	第 15 期 自 平成23年11月29日 至 平成24年２月27日
費用控除後の配当等収益額	A	1,241,107 円 （1,854,720 円）	917,124 円 （934,241 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	3,119,781 円	1,945,509 円
分配準備積立金額	D	820,891 円	189,941 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,181,779 円	3,052,574 円
当ファンドの期末残存口数	F	426,361,376 口	263,864,559 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	121.53 円	115.68 円
10,000口当たり分配金額	H	40 円	40 円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	1,705,445 円	1,055,458 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７特定期間 自 平成23年３月１日 至 平成23年８月26日	第８特定期間 自 平成23年８月27日 至 平成24年２月27日
２．剰余金増加額・減少額又は欠損金減少額・増加額	「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ欠損金増加額と減少額との純額を表示しております。	「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ欠損金増加額と減少額との純額を表示しております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第７特定期間 自 平成23年３月１日 至 平成23年８月26日	第８特定期間 自 平成23年８月27日 至 平成24年２月27日
１．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

２．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク等に晒されております。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク等に晒されております。
３．金融商品に係るリスク管理体制	委託会社においては、運用セクションから組織的に独立した業務管理室が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。 また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。	委託会社においては、運用セクションから組織的に独立した業務管理室が、法令や約款等に定められた運用制限の遵守状況のチェックや、市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のモニタリングを日次で実施しており、問題が生じた場合は、運用セクションに速やかに連絡され是正を行うとともに、定例的に開催される運用リスク管理委員会に報告する体制となっております。 また、パフォーマンス評価を月次で実施し、その分析及び評価結果は、定例的に開催される運用委員会に報告する体制となっております。

２．金融商品の時価等に関する事項

	第７特定期間 （平成23年８月26日現在）	第８特定期間 （平成24年２月27日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．時価の算定方法	（１）親投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 （２）コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	（１）親投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 （２）コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

１．本書における開示対象ファンドの当該特定期間における元本額の変動

	第７特定期間 自 平成23年３月１日 至 平成23年８月26日	第８特定期間 自 平成23年８月27日 至 平成24年２月27日
期首元本額	464,647,913 円	426,361,376 円
期中追加設定元本額	1,055,305 円	11,041,040 円
期中一部解約元本額	39,341,842 円	173,537,857 円

２．有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第７特定期間 （平成23年８月26日現在）	第８特定期間 （平成24年２月27日現在）
	最終の計算期間（自 平成23年５月27日 至 平成23年８月26日）の損益に含まれた評価差額（円）	最終の計算期間（自 平成23年11月29日 至 平成24年２月27日）の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△23,201,797	24,850,287
合計	△23,201,797	24,850,287

３．デリバティブ取引関係

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

① 有価証券明細表

Ａ．株式

該当事項はありません。

Ｂ．株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考

親投資信託受益証券	中央三井日本株式マザーファンド	73,296,711	55,485,610	
	中央三井日本債券マザーファンド	42,742,867	51,325,634	
	中央三井外国株式マザーファンド	57,869,733	58,946,110	
	中央三井外国債券マザーファンド	34,409,947	54,364,275	
合計		208,319,258	220,121,629	

② 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

④ 不動産等明細表
該当事項はありません。

⑤ 商品明細表
該当事項はありません。

⑥ 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

⑦ その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表
該当事項はありません。

【４資産インデックスバランスオープン（成長型）】
（１）【貸借対照表】

(単位：円)

	第７期 (平成23年８月26日現在)	第８期 (平成24年２月27日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	706,350,593	640,359,654
未収入金	139,892	1,589,096
流動資産合計	706,490,485	641,948,750
資産合計	706,490,485	641,948,750
負債の部		
流動負債		
未払解約金	139,892	1,589,096
未払受託者報酬	241,234	206,436
未払委託者報酬	2,372,078	2,029,862
その他未払費用	20,042	17,141
流動負債合計	2,773,246	3,842,535
負債合計	2,773,246	3,842,535
純資産の部		
元本等		
元本	869,597,039	724,608,540
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△165,879,800	△86,502,325
純資産合計	703,717,239	638,106,215
負債純資産合計	706,490,485	641,948,750

（２）【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第７期 (自 平成23年３月１日 至 平成23年８月26日)	第８期 (自 平成23年８月27日 至 平成24年２月27日)
営業収益		
有価証券売買等損益	△64,919,392	53,455,410
営業収益合計	△64,919,392	53,455,410
営業費用		
受託者報酬	241,234	206,436
委託者報酬	2,372,078	2,029,862
その他費用	20,042	17,141
営業費用合計	2,633,354	2,253,439
営業利益又は営業損失（△）	△67,552,746	51,201,971
経常利益又は経常損失（△）	△67,552,746	51,201,971
当期純利益又は当期純損失（△）	△67,552,746	51,201,971
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△1,995,010	△385,477
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△109,341,423	△165,879,800
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,447,118	30,386,233
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,447,118	30,386,233
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,427,759	2,596,206
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,427,759	2,596,206
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△165,879,800	△86,502,325

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２．その他	ファンドの計算期間 第８期（自 平成23年８月27日 至 平成24年２月27日） 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年２月27日から８月26日まで、及び８月27日から翌年２月26日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第８期計算期間は平成23年８月27日から平成24年２月27日までとなっております。

（追加情報）

当該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。

（貸借対照表に関する注記）

	第 7 期 （平成23年８月26日現在）	第 8 期 （平成24年２月27日現在）
１．当該計算期間の末日における受益権総数	869,597,039 口	724,608,540 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 165,879,800 円	元本の欠損 86,502,325 円
３．１口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	0.8092 円 (8,092 円)	0.8806 円 (8,806 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 7 期 自 平成23年３月１日 至 平成23年８月26日	第 8 期 自 平成23年８月27日 至 平成24年２月27日
費用控除後の配当等収益額	A	6,778,720 円 (9,412,074 円)	6,467,140 円 (6,749,721 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	9,947,889 円	8,831,651 円
分配準備積立金額	D	31,112,123 円	31,219,226 円

当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	47,838,732 円	46,518,017 円
当ファンドの期末残存口数	F	869,597,039 口	724,608,540 口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	550.12 円	641.97 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 7 期 自 平成23年３月１日 至 平成23年８月26日	第 8 期 自 平成23年８月27日 至 平成24年２月27日
２．剰余金増加額・減少額又は欠損金減少額・増加額	「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ欠損金増加額と減少額との純額を表示しております。	「当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額」及び「当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額」は、それぞれ欠損金増加額と減少額との純額を表示しております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

	第 7 期 自 平成23年３月１日 至 平成23年８月26日	第 8 期 自 平成23年８月27日 至 平成24年２月27日
１．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク等に晒されております。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク等に晒されております。

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

２．金融商品の時価等に関する事項

	第 7 期 （平成23年８月26日現在）	第 8 期 （平成24年２月27日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．時価の算定方法	（１）親投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 （２）コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	（１）親投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 （２）コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
３．金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

４．金銭債権の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。	金銭債権は全て１年以内に償還予定であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

１．本書における開示対象ファンドの当該計算期間における元本額の変動

	第 7 期 自 平成23年３月１日 至 平成23年８月26日	第 8 期 自 平成23年８月27日 至 平成24年２月27日
期首元本額	949,997,722 円	869,597,039 円
期中追加設定元本額	18,008,066 円	13,395,503 円
期中一部解約元本額	98,408,749 円	158,384,002 円

２．有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 7 期 （平成23年８月26日現在） 最終の計算期間（自 平成23年３月１日 至 平成23年８月26日）の損益に含まれた評価差額（円）	第 8 期 （平成24年２月27日現在） 最終の計算期間（自 平成23年８月27日 至 平成24年２月27日）の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△61,819,994	54,493,070
合計	△61,819,994	54,493,070

３．デリバティブ取引関係

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

① 有価証券明細表

Ａ．株式

該当事項はありません。

Ｂ．株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	中央三井日本株式マザーファンド	211,258,028	159,922,327	
	中央三井日本債券マザーファンド	126,441,456	151,830,900	
	中央三井外国株式マザーファンド	167,877,402	170,999,921	
	中央三井外国債券マザーファンド	99,757,267	157,606,506	
合計		605,334,153	640,359,654	

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表

該当事項はありません。

⑥ 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

⑦ その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表

該当事項はありません。

次へ

＜参考＞

「４資産インデックスバランスオープン（分配型）」「４資産インデックスバランスオープン（成長型）」は、「中央三井日本株式マザーファンド」、「中央三井日本債券マザーファンド」、「中央三井外国株式マザーファンド」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24年２月27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24年２月27日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,778,960,784
株式	253,618,909,875
派生商品評価勘定	479,586,750
未収入金	5,006,266,542
未収配当金	334,672,832
未収利息	7,540
流動資産合計	263,218,404,323
資産合計	263,218,404,323
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	102,625
前受金	485,316,000
未払解約金	260,031,040
流動負債合計	745,449,665
負債合計	745,449,665
純資産の部	
元本等	
元本	346,714,313,028
剰余金	
欠損金	84,241,358,370
純資産合計	262,472,954,658
負債・純資産合計	263,218,404,323

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成24年２月27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	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、金融商品取引所等の発表する計算日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
３．収益及び費用の計上基準	（１）受取配当金 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。 （２）派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

	平成24年２月27日現在
１．担保に供している資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。 株式　2,490,400,000 円 なお、上記の金額には、約定未受渡株式を含んでおります。
２．計算日における受益権総数	346,714,313,028 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	元本の欠損 84,241,358,370 円
４．１口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	0.7570 円 （ 7,570 円）

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

平成24年２月27日現在

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

２．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク
当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、株価変動リスク、信用リスク及び流動性リスク等に晒されております。
また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。

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

２．金融商品の時価等に関する事項

平成24年２月27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24年２月27日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

平成24年２月27日現在
該当事項はありません。

（その他の注記）

１．元本の変動

平成24年２月27日現在	
特定期間／計算期間の期首元本額	332,600,637,652 円
特定期間／計算期間中の追加設定元本額	32,121,726,911 円
特定期間／計算期間中の一部解約元本額	18,008,051,535 円
計算日の元本額	346,714,313,028 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	2,462,891,928 円
中央三井ＤＣ日本株式インデックスファンド	350,523,522 円
中央三井ＤＣ日本株式インデックスファンドＬ	46,403,770,914 円
中央三井ＤＣ日本株式インデックスファンドＡ	1,627,668,811 円
中央三井ＤＣバランスファンド３０	465,586,851 円
中央三井ＤＣバランスファンド５０	1,035,993,507 円
中央三井ＤＣバランスファンド７０	551,534,841 円
ベスタ・世界６資産ファンド（毎月決算型）	271,945,195 円
ベスタ・世界６資産ファンド（１年決算型）	177,120,750 円
新生・４分散ファンド	225,838,863 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	928,130,170 円
４資産インデックスバランスオープン（分配型）	73,296,711 円
４資産インデックスバランスオープン（成長型）	211,258,028 円
日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）	94,218,359 円
ＣＭＡＭ日本株式インデックスｅ	939,919,337 円
中央三井インデックスコレクション（国内株式）	3,006,019,992 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式３０）	479,802,696 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式５０）	1,012,928,761 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式７０）	794,036,134 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）	32,614,593,275 円
中央三井バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	6,903,524,200 円
中央三井バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	52,648,347,355 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）	40,152,011,301 円
中央三井ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	6,373,995,748 円
中央三井ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	1,029,540,102 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）	8,298,109,415 円
中央三井バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	6,855,445,918 円
中央三井バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	2,743,514,910 円
中央三井バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	40,207,014,572 円
中央三井バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	2,683,959,473 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）	20,682,386,160 円
中央三井ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	8,150,282,671 円
中央三井ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	281,709,875 円
中央三井バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	3,629,979,800 円
中央三井ＶＡバランス株式４０（適格機関投資家専用）	2,782,111,052 円
ＣＭＡＭ・バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	8,606,646,219 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）	439,543,517 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）	1,217,621,395 円
ＣＭＡＭ・ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	353,126,595 円
中央三井バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	1,828,256,455 円
中央三井ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	3,692,403,173 円
ＣＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	3,381,245,757 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）	2,200,629,281 円
ＣＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	26,044,353,609 円
中央三井世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	685,553,314 円
中央三井国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	256,063,850 円
中央三井国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	81,694,351 円
ＣＭＡＭ・ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	613,797,429 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）	15,100,915 円
中央三井世界バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	5,280,300 円

２．有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成24年２月27日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	23,816,465,116
合計	23,816,465,116

（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24年１月24日から平成24年２月27日まで）に対応するものです。

３．デリバティブ取引関係

Ⅰ．ヘッジ会計が適用されていないもの

株式関連

区分	種類	平成24年２月27日現在			
		契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引 買 建	8,279,665,875	―	8,759,150,000	479,484,125
合計		8,279,665,875	―	8,759,150,000	479,484,125

（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。

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年２月27日現在
該当事項はありません。

次へ

（３）附属明細表（平成24年２月27日現在）

① 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	99,000	200	19,800,000	
日本水産	287,400	281	80,759,400	
マルハニチロホールディングス	494,000	144	71,136,000	
サカタのタネ	37,000	1,132	41,884,000	
ホクト	25,500	1,719	43,834,500	
住石ホールディングス	73,200	106	7,759,200	
日鉄鉱業	64,000	409	26,176,000	
三井松島産業	163,000	184	29,992,000	
国際石油開発帝石	3,032	588,000	1,782,816,000	
日本海洋掘削	6,200	2,829	17,539,800	
関東天然瓦斯開発	25,000	439	10,975,000	
石油資源開発	35,600	3,985	141,866,000	
ショーボンドホールディングス	23,400	1,894	44,319,600	
ミライト・ホールディングス	74,800	601	44,954,800	
ダイセキ環境ソリューション	22	170,000	3,740,000	
間組	110,000	267	29,370,000	
東急建設	112,910	221	24,953,110	
コムシスホールディングス	121,100	878	106,325,800	
ミサワホーム	31,600	724	22,878,400	
高松コンストラクショングループ	23,200	1,254	29,092,800	
東建コーポレーション	9,730	2,940	28,606,200	
ヤマウラ	15,500	237	3,673,500	
大成建設	1,261,000	210	264,810,000	
大林組	748,000	363	271,524,000	
清水建設	763,000	329	251,027,000	
長谷工コーポレーション	1,559,000	62	96,658,000	
松井建設	44,000	330	14,520,000	
鹿島建設	1,169,000	250	292,250,000	
鉄建建設	161,000	116	18,676,000	
安藤建設	123,000	133	16,359,000	
太平工業	49,000	419	20,531,000	
前田建設工業	170,000	325	55,250,000	
ナカノフドー建設	48,000	184	8,832,000	

奥村組	237,000	328	77,736,000	
大和小田急建設	36,500	224	8,176,000	
東鉄工業	36,000	752	27,072,000	
イチケン	63,000	163	10,269,000	
戸田建設	268,000	290	77,720,000	
青木あすなろ建設	22,000	441	9,702,000	
北野建設	82,000	189	15,498,000	
植木組	43,000	204	8,772,000	
三井ホーム	45,000	441	19,845,000	
矢作建設工業	33,800	406	13,722,800	
ピーエス三菱	21,300	425	9,052,500	
大東建託	94,700	7,110	673,317,000	
新日本建設	34,800	236	8,212,800	
ＮＩＰＰＯ	59,000	869	51,271,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
東亜道路工業	57,000	238	13,566,000	
前田道路	74,000	947	70,078,000	
日本道路	81,000	338	27,378,000	
東亜建設工業	232,000	172	39,904,000	
五洋建設	316,500	273	86,404,500	
大林道路	38,000	258	9,804,000	
住友林業	171,700	725	124,482,500	
日本基礎技術	35,100	331	11,618,100	
日成ビルド工業	102,000	194	19,788,000	
巴コーポレーション	38,400	326	12,518,400	
パナホーム	95,000	538	51,110,000	
大和ハウス工業	622,000	1,039	646,258,000	
ライト工業	56,700	500	28,350,000	
積水ハウス	702,000	755	530,010,000	
日特建設	81,000	118	9,558,000	
北陸電気工事	23,000	245	5,635,000	
ユアテック	39,000	485	18,915,000	
西部電気工業	27,000	359	9,693,000	
四電工	27,000	343	9,261,000	
中電工	38,700	866	33,514,200	
関電工	119,000	426	50,694,000	

きんでん	166,000	631	104,746,000	
東京エネシス	26,000	484	12,584,000	
トーエネック	40,000	460	18,400,000	
住友電設	21,400	564	12,069,600	
日本電設工業	48,000	747	35,856,000	
協和エクシオ	84,800	733	62,158,400	
新日本空調	24,400	470	11,468,000	
日本電話施設	50,000	259	12,950,000	
九電工	51,000	514	26,214,000	
三機工業	62,000	443	27,466,000	
日揮	233,000	2,310	538,230,000	
中外炉工業	80,000	294	23,520,000	
ヤマト	29,000	314	9,106,000	
太平電業	32,000	642	20,544,000	
高砂熱学工業	74,900	657	49,209,300	
三晃金属工業	37,000	254	9,398,000	
朝日工業社	32,000	342	10,944,000	
大氣社	39,600	1,616	63,993,600	
ダイダン	38,000	539	20,482,000	
日比谷総合設備	33,300	880	29,304,000	
東芝プラントシステム	40,000	908	36,320,000	
東洋エンジニアリング	133,000	357	47,481,000	
千代田化工建設	198,000	966	191,268,000	
新興プランテック	51,200	706	36,147,200	
日本製粉	157,000	377	59,189,000	
日清製粉グループ本社	226,000	959	216,734,000	
日東富士製粉	20,000	309	6,180,000	
昭和産業	103,000	259	26,677,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
鳥越製粉	21,900	683	14,957,700	
協同飼料	88,000	101	8,888,000	
中部飼料	22,400	541	12,118,400	
日本配合飼料	78,000	119	9,282,000	
東洋精糖	40,000	106	4,240,000	
日本甜菜製糖	139,000	194	26,966,000	
三井製糖	89,000	281	25,009,000	

森永製菓	244,000	192	46,848,000	
中村屋	58,000	418	24,244,000	
江崎グリコ	90,000	898	80,820,000	
名糖産業	11,200	1,009	11,300,800	
不二家	144,000	170	24,480,000	
山崎製パン	183,000	1,090	199,470,000	
モロゾフ	39,000	274	10,686,000	
カルビー	13,400	3,695	49,513,000	
森永乳業	211,000	307	64,777,000	
ヤクルト本社	133,700	2,491	333,046,700	
明治ホールディングス	73,900	3,405	251,629,500	
雪印メグミルク	53,800	1,512	81,345,600	
プリマハム	141,000	136	19,176,000	
日本ハム	189,000	1,021	192,969,000	
伊藤ハム	137,000	323	44,251,000	
丸大食品	120,000	319	38,280,000	
米久	22,200	729	16,183,800	
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	16,000	675	10,800,000	
サッポロホールディングス	408,000	300	122,400,000	
アサヒグループホールディングス	467,900	1,782	833,797,800	
キリンホールディングス	1,000,000	964	964,000,000	
宝ホールディングス	211,000	508	107,188,000	
オエノンホールディングス	64,000	192	12,288,000	
養命酒製造	19,000	796	15,124,000	
三国コカ・コーラボトリング	26,200	694	18,182,800	
コカ・コーラウエスト	84,500	1,383	116,863,500	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	28,200	1,022	28,820,400	
ダイドードリンコ	11,500	3,180	36,570,000	
伊藤園	69,300	1,351	93,624,300	
キーコーヒー	21,900	1,500	32,850,000	
ユニカフェ	6,300	383	2,412,900	
ジャパンフーズ	3,400	850	2,890,000	
日清オイリオグループ	96,000	343	32,928,000	
不二製油	60,500	1,098	66,429,000	
Ｊ－オイルミルズ	93,000	233	21,669,000	
キッコーマン	204,000	886	180,744,000	
味の素	657,000	941	618,237,000	
キユーピー	126,900	1,138	144,412,200	
ハウス食品	88,500	1,412	124,962,000	

カゴメ	96,400	1,590	153,276,000	
焼津水産化学工業	11,900	780	9,282,000	
アリアケジャパン	22,800	1,620	36,936,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ニチレイ	279,000	383	106,857,000	
東洋水産	107,000	2,006	214,642,000	
日清食品ホールディングス	97,400	3,010	293,174,000	
永谷園	24,000	895	21,480,000	
フジッコ	27,000	1,025	27,675,000	
ロック・フィールド	12,400	1,394	17,285,600	
日本たばこ産業	5,529	436,500	2,413,408,500	
わらべや日洋	14,000	1,103	15,442,000	
なとり	11,600	900	10,440,000	
ミヨシ油脂	80,000	114	9,120,000	
片倉工業	29,700	749	22,245,300	
グンゼ	175,000	255	44,625,000	
東洋紡績	985,000	118	116,230,000	
ユニチカ	521,000	51	26,571,000	
富士紡ホールディングス	99,000	176	17,424,000	
日清紡ホールディングス	148,000	774	114,552,000	
倉敷紡績	241,000	165	39,765,000	
シキボウ	154,000	115	17,710,000	
日本毛織	80,000	586	46,880,000	
トーア紡コーポレーション	103,000	64	6,592,000	
ダイドーリミテッド	29,100	698	20,311,800	
帝国繊維	25,000	595	14,875,000	
帝人	953,000	275	262,075,000	
東レ	1,691,000	578	977,398,000	
サカイオーベックス	68,000	145	9,860,000	
住江織物	59,000	168	9,912,000	
日本フエルト	13,000	423	5,499,000	
イチカワ	15,000	175	2,625,000	
日本バイリーン	30,000	360	10,800,000	
芦森工業	55,000	122	6,710,000	
アツギ	185,000	102	18,870,000	
ダイニック	48,000	169	8,112,000	

セーレン	58,300	491	28,625,300	
東海染工	34,000	122	4,148,000	
小松精練	37,000	396	14,652,000	
ワコールホールディングス	139,000	1,009	140,251,000	
ホギメディカル	14,700	3,405	50,053,500	
レナウン	52,100	160	8,336,000	
クラウディア	3,200	1,097	3,510,400	
ＴＳＩホールディングス	104,800	449	47,055,200	
三陽商会	115,000	218	25,070,000	
オンワードホールディングス	143,000	648	92,664,000	
ルック	40,000	236	9,440,000	
ゴールドウイン	54,000	454	24,516,000	
デサント	59,000	416	24,544,000	
ヤマトインターナショナル	14,600	387	5,650,200	
特種東海製紙	147,000	183	26,901,000	
王子製紙	1,030,000	405	417,150,000	
三菱製紙	331,000	82	27,142,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
北越紀州製紙	144,500	518	74,851,000	
中越パルプ工業	89,000	178	15,842,000	
巴川製紙所	41,000	194	7,954,000	
大王製紙	98,000	545	53,410,000	
日本製紙グループ本社	112,500	1,755	197,437,500	
レンゴー	187,000	567	106,029,000	
トーモク	74,000	228	16,872,000	
ザ・パック	13,800	1,269	17,512,200	
クラレ	370,500	1,170	433,485,000	
旭化成	1,357,000	512	694,784,000	
共和レザー	13,900	306	4,253,400	
コープケミカル	35,000	125	4,375,000	
昭和電工	1,449,000	184	266,616,000	
住友化学	1,602,000	346	554,292,000	
日本化成	44,000	148	6,512,000	
住友精化	44,000	378	16,632,000	
日産化学工業	177,300	824	146,095,200	
ラサ工業	94,000	131	12,314,000	

クレハ	151,000	411	62,061,000	
テイカ	39,000	305	11,895,000	
石原産業	391,000	89	34,799,000	
片倉チッカリン	17,000	235	3,995,000	
日本曹達	139,000	374	51,986,000	
東ソー	623,000	246	153,258,000	
トクヤマ	363,000	298	108,174,000	
セントラル硝子	223,000	371	82,733,000	
東亜合成	292,000	371	108,332,000	
ダイソー	93,000	264	24,552,000	
関東電化工業	52,000	322	16,744,000	
電気化学工業	489,000	331	161,859,000	
信越化学工業	418,100	4,395	1,837,549,500	
日本カーバイド工業	74,000	137	10,138,000	
堺化学工業	73,000	317	23,141,000	
エア・ウォーター	190,000	1,061	201,590,000	
大陽日酸	306,000	540	165,240,000	
日本化学工業	93,000	154	14,322,000	
日本パーカライジング	55,000	1,224	67,320,000	
高圧ガス工業	35,000	494	17,290,000	
チタン工業	25,000	379	9,475,000	
四国化成工業	34,000	479	16,286,000	
戸田工業	30,000	636	19,080,000	
ステラ ケミファ	11,100	2,224	24,686,400	
保土谷化学工業	47,000	293	13,771,000	
日本触媒	169,000	980	165,620,000	
大日精化工業	84,000	382	32,088,000	
カネカ	290,000	475	137,750,000	
三菱瓦斯化学	401,000	527	211,327,000	
三井化学	989,000	279	275,931,000	
ＪＳＲ	212,200	1,681	356,708,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
東京応化工業	41,900	1,902	79,693,800	
大阪有機化学工業	14,400	446	6,422,400	
三菱ケミカルホールディングス	1,457,500	480	699,600,000	
日本合成化学工業	48,000	498	23,904,000	

ダイセル	303,000	525	159,075,000	
住友ベークライト	200,000	490	98,000,000	
積水化学工業	485,000	685	332,225,000	
日本ゼオン	218,000	768	167,424,000	
アイカ工業	60,700	1,151	69,865,700	
宇部興産	976,000	241	235,216,000	
積水樹脂	36,000	822	29,592,000	
タキロン	55,000	287	15,785,000	
旭有機材工業	83,000	230	19,090,000	
日立化成工業	100,800	1,529	154,123,200	
ニチバン	23,000	275	6,325,000	
リケンテクノス	38,000	255	9,690,000	
大倉工業	56,000	261	14,616,000	
積水化成品工業	60,000	295	17,700,000	
群栄化学工業	62,000	221	13,702,000	
タイガースポリマー	12,100	325	3,932,500	
日本カーリット	18,600	419	7,793,400	
日本化薬	164,000	767	125,788,000	
日本精化	19,400	570	11,058,000	
ＡＤＥＫＡ	100,300	788	79,036,400	
日油	185,000	402	74,370,000	
ハリマ化成	19,900	568	11,303,200	
花王	618,300	2,050	1,267,515,000	
第一工業製薬	42,000	246	10,332,000	
三洋化成工業	73,000	568	41,464,000	
大日本塗料	134,000	101	13,534,000	
日本ペイント	220,000	649	142,780,000	
関西ペイント	264,000	783	206,712,000	
中国塗料	72,000	557	40,104,000	
日本特殊塗料	18,300	358	6,551,400	
藤倉化成	29,500	443	13,068,500	
太陽ホールディングス	19,000	2,277	43,263,000	
ＤＩＣ	890,000	169	150,410,000	
サカタインクス	43,000	391	16,813,000	
東洋インキＳＣホールディングス	210,000	336	70,560,000	
富士フイルムホールディングス	498,000	2,052	1,021,896,000	
資生堂	387,000	1,389	537,543,000	
ライオン	269,000	465	125,085,000	
高砂香料工業	77,000	388	29,876,000	

マンダム	23,400	1,991	46,589,400	
ミルボン	12,400	2,347	29,102,800	
ファンケル	58,600	1,059	62,057,400	
コーセー	37,700	1,829	68,953,300	
ドクターシーラボ	141	380,000	53,580,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	23,800	2,070	49,266,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
エステー	14,300	1,020	14,586,000	
コニシ	16,900	1,092	18,454,800	
長谷川香料	29,600	1,222	36,171,200	
小林製薬	32,300	3,925	126,777,500	
荒川化学工業	18,200	746	13,577,200	
メック	16,800	330	5,544,000	
日本高純度化学	66	209,500	13,827,000	
荏原ユージライト	3,200	2,282	7,302,400	
アース製薬	16,800	2,865	48,132,000	
イハラケミカル工業	40,000	354	14,160,000	
北興化学工業	23,000	243	5,589,000	
大成ラミック	6,800	2,587	17,591,600	
クミアイ化学工業	54,000	352	19,008,000	
日本農薬	53,000	349	18,497,000	
アキレス	195,000	120	23,400,000	
有沢製作所	38,700	345	13,351,500	
日東電工	192,100	3,395	652,179,500	
レック	7,000	1,280	8,960,000	
きもと	19,300	548	10,576,400	
藤森工業	16,800	1,287	21,621,600	
前澤化成工業	22,800	862	19,653,600	
ＪＳＰ	15,700	1,283	20,143,100	
エフピコ	10,300	5,130	52,839,000	
天馬	18,800	837	15,735,600	
信越ポリマー	45,700	387	17,685,900	
東リ	93,000	175	16,275,000	
ニフコ	52,000	2,221	115,492,000	
日本バルカー工業	91,000	242	22,022,000	
ユニ・チャーム	128,700	4,120	530,244,000	

協和発酵キリン	319,000	865	275,935,000	
武田薬品工業	873,200	3,645	3,182,814,000	代用有価証券で 200,000株 担保差入
アステラス製薬	517,500	3,285	1,699,987,500	
大日本住友製薬	165,000	841	138,765,000	
塩野義製薬	364,000	1,123	408,772,000	
田辺三菱製薬	232,800	1,113	259,106,400	
わかもと製薬	26,000	250	6,500,000	
あすか製薬	27,000	534	14,418,000	
日本新薬	49,000	975	47,775,000	
中外製薬	270,800	1,308	354,206,400	
科研製薬	92,000	1,032	94,944,000	
エーザイ	287,000	3,275	939,925,000	
ロート製薬	98,000	954	93,492,000	
小野薬品工業	114,000	4,370	498,180,000	
久光製薬	72,400	3,570	258,468,000	
有機合成薬品工業	17,000	223	3,791,000	
持田製薬	82,000	936	76,752,000	
参天製薬	78,300	3,180	248,994,000	
扶桑薬品工業	78,000	229	17,862,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日本ケミファ	35,000	385	13,475,000	
ツムラ	63,600	2,333	148,378,800	
日医工	39,400	1,788	70,447,200	
キッセイ薬品工業	43,300	1,592	68,933,600	
生化学工業	44,500	919	40,895,500	
栄研化学	18,100	1,077	19,493,700	
日水製薬	9,400	732	6,880,800	
鳥居薬品	15,900	1,508	23,977,200	
東和薬品	11,900	3,500	41,650,000	
沢井製薬	15,300	7,870	120,411,000	
ゼリア新薬工業	33,000	1,358	44,814,000	
第一三共	784,100	1,489	1,167,524,900	
キョーリン製薬ホールディングス	57,000	1,452	82,764,000	
大幸薬品	10,800	851	9,190,800	
ダイト	6,500	1,130	7,345,000	

大塚ホールディングス	462,700	2,242	1,037,373,400	
大正製薬ホールディングス	56,100	7,070	396,627,000	
日本コークス工業	188,000	134	25,192,000	
昭和シェル石油	208,400	558	116,287,200	
コスモ石油	644,000	243	156,492,000	
ニチレキ	36,000	472	16,992,000	
東燃ゼネラル石油	352,000	764	268,928,000	
ユシロ化学工業	12,600	903	11,377,800	
ビーピー・カストロール	9,500	342	3,249,000	
ＡＯＣホールディングス	54,000	573	30,942,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	4,900	896	4,390,400	
出光興産	27,600	8,420	232,392,000	
ＪＸホールディングス	2,587,100	512	1,324,595,200	
横浜ゴム	284,000	547	155,348,000	
東洋ゴム工業	176,000	222	39,072,000	
ブリヂストン	730,600	1,929	1,409,327,400	
住友ゴム工業	181,800	1,020	185,436,000	
藤倉ゴム工業	15,300	319	4,880,700	
オカモト	86,000	309	26,574,000	
フコク	9,900	767	7,593,300	
ニッタ	23,200	1,418	32,897,600	
東海ゴム工業	43,400	1,006	43,660,400	
三ツ星ベルト	62,000	443	27,466,000	
バンドー化学	84,000	309	25,956,000	
日東紡績	172,000	282	48,504,000	
旭硝子	1,148,000	745	855,260,000	
日本板硝子	999,000	146	145,854,000	
石塚硝子	32,000	158	5,056,000	
日本山村硝子	94,000	209	19,646,000	
日本電気硝子	447,000	762	340,614,000	
オハラ	9,200	905	8,326,000	
住友大阪セメント	473,000	248	117,304,000	
太平洋セメント	1,369,000	179	245,051,000	
デイ・シイ	22,700	291	6,605,700	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日本ヒューム	28,000	391	10,948,000	

日本コンクリート工業	44,000	273	12,012,000	
東海カーボン	202,000	443	89,486,000	
日本カーボン	108,000	228	24,624,000	
東洋炭素	11,500	3,360	38,640,000	
ノリタケカンパニーリミテド	122,000	262	31,964,000	
ＴＯＴＯ	360,000	612	220,320,000	
日本碍子	303,000	1,111	336,633,000	
日本特殊陶業	201,000	1,091	219,291,000	
ＭＡＲＵＷＡ	6,800	3,450	23,460,000	
品川リフラクトリーズ	60,000	242	14,520,000	
黒崎播磨	52,000	283	14,716,000	
東京窯業	30,000	206	6,180,000	
ニッカトー	8,800	527	4,637,600	
フジミインコーポレーテッド	21,500	1,048	22,532,000	
ニチアス	116,000	457	53,012,000	
ニチハ	31,500	947	29,830,500	
新日本製鐵	6,116,000	235	1,437,260,000	
住友金属工業	4,318,000	170	734,060,000	
神戸製鋼所	3,229,000	145	468,205,000	
日新製鋼	825,000	145	119,625,000	
中山製鋼所	118,000	94	11,092,000	
合同製鐵	130,000	220	28,600,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	552,100	1,796	991,571,600	
東京製鐵	117,900	687	80,997,300	
共英製鋼	24,800	1,488	36,902,400	
大和工業	53,200	2,624	139,596,800	
東京鐵鋼	45,000	305	13,725,000	
大阪製鐵	14,600	1,545	22,557,000	
淀川製鋼所	165,000	367	60,555,000	
東洋鋼鈑	56,000	325	18,200,000	
住友鋼管	13,600	674	9,166,400	
丸一鋼管	71,500	1,815	129,772,500	
モリ工業	35,000	301	10,535,000	
大同特殊鋼	390,000	540	210,600,000	
日本高周波鋼業	91,000	109	9,919,000	
日本金属工業	180,000	78	14,040,000	
日本冶金工業	171,500	152	26,068,000	
山陽特殊製鋼	116,000	437	50,692,000	
愛知製鋼	124,000	455	56,420,000	

日立金属	152,000	1,011	153,672,000	
日本金属	56,000	157	8,792,000	
大平洋金属	162,000	461	74,682,000	
日本電工	84,000	361	30,324,000	
栗本鐵工所	111,000	209	23,199,000	
日本鋳鉄管	25,000	188	4,700,000	
三菱製鋼	141,000	267	37,647,000	
日亜鋼業	36,000	215	7,740,000	
日本精線	16,000	401	6,416,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
シンニッタン	20,600	459	9,455,400	
新家工業	89,000	142	12,638,000	
日本軽金属	527,000	125	65,875,000	
大紀アルミニウム工業所	36,000	303	10,908,000	
三井金属鉱業	634,000	254	161,036,000	
東邦亜鉛	131,000	357	46,767,000	
三菱マテリアル	1,454,000	266	386,764,000	
住友金属鉱山	603,000	1,223	737,469,000	
ＤＯＷＡホールディングス	278,000	543	150,954,000	
古河機械金属	391,000	84	32,844,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	22,900	3,500	80,150,000	
東邦チタニウム	37,800	1,425	53,865,000	
住友軽金属工業	563,000	85	47,855,000	
古河スカイ	94,000	263	24,722,000	
古河電気工業	733,000	236	172,988,000	
住友電気工業	823,100	1,062	874,132,200	
フジクラ	349,000	285	99,465,000	
昭和電線ホールディングス	328,000	84	27,552,000	
タツタ電線	50,000	428	21,400,000	
日立電線	194,000	193	37,442,000	
沖電線	25,000	169	4,225,000	
カナレ電気	2,900	1,265	3,668,500	
平河ヒューテック	4,500	796	3,582,000	
リョービ	131,000	326	42,706,000	
アサヒホールディングス	32,600	1,664	54,246,400	
稲葉製作所	11,800	948	11,186,400	

トーカロ	13,100	1,674	21,929,400	
アルファＣｏ	7,900	1,049	8,287,100	
ＳＵＭＣＯ	142,500	854	121,695,000	
川田テクノロジーズ	7,100	1,258	8,931,800	
東洋製罐	164,700	1,171	192,863,700	
ホッカンホールディングス	57,000	245	13,965,000	
コロナ	11,200	1,253	14,033,600	
横河ブリッジホールディングス	51,000	570	29,070,000	
駒井ハルテック	54,000	263	14,202,000	
高田機工	30,000	229	6,870,000	
三和ホールディングス	251,000	287	72,037,000	
文化シヤッター	79,000	295	23,305,000	
東洋シヤッター	20,500	399	8,179,500	
住生活グループ	302,900	1,677	507,963,300	
日本フイルコン	17,400	413	7,186,200	
ノーリツ	45,600	1,519	69,266,400	
長府製作所	25,200	1,966	49,543,200	
リンナイ	37,500	5,800	217,500,000	
ダイニチ工業	12,700	773	9,817,100	
日東精工	31,000	243	7,533,000	
三洋工業	61,000	178	10,858,000	
岡部	58,800	427	25,107,600	
東プレ	45,000	799	35,955,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
高周波熱錬	31,200	761	23,743,200	
東京製綱	159,000	187	29,733,000	
パイオラックス	10,000	1,962	19,620,000	
日本発條	168,700	841	141,876,700	
中央発條	31,000	317	9,827,000	
三益半導体工業	19,600	796	15,601,600	
アタカ大機	15,000	293	4,395,000	
日本製鋼所	359,000	611	219,349,000	
日立ツール	14,200	863	12,254,600	
三浦工業	34,600	2,253	77,953,800	
タクマ	79,000	402	31,758,000	
ツガミ	59,000	612	36,108,000	

オークマ	141,000	675	95,175,000	
東芝機械	129,000	434	55,986,000	
アマダ	329,000	580	190,820,000	
アイダエンジニアリング	62,000	468	29,016,000	
牧野フライス製作所	117,000	584	68,328,000	
オーエスジー	102,600	1,221	125,274,600	
ダイジェット工業	31,000	180	5,580,000	
旭ダイヤモンド工業	58,000	1,122	65,076,000	
森精機製作所	122,800	837	102,783,600	
ディスコ	23,500	4,520	106,220,000	
日東工器	14,000	1,867	26,138,000	
豊和工業	131,000	79	10,349,000	
大阪機工	97,000	120	11,640,000	
東洋機械金属	20,500	239	4,899,500	
津田駒工業	60,000	204	12,240,000	
島精機製作所	30,900	1,575	48,667,500	
日阪製作所	30,000	898	26,940,000	
やまびこ	9,100	1,160	10,556,000	
ペガサスミシン製造	24,800	228	5,654,400	
ナブテスコ	96,700	1,871	180,925,700	
三井海洋開発	19,200	1,654	31,756,800	
レオン自動機	25,000	210	5,250,000	
ＳＭＣ	69,500	13,840	961,880,000	
新川	18,000	495	8,910,000	
ホソカワミクロン	38,000	440	16,720,000	
ユニオンツール	13,300	1,510	20,083,000	
オイレス工業	25,900	1,534	39,730,600	
サトーホールディングス	24,500	1,116	27,342,000	
日本エアーテック	8,900	393	3,497,700	
日精樹脂工業	20,500	395	8,097,500	
ワイエイシイ	9,400	694	6,523,600	
小松製作所	1,104,400	2,425	2,678,170,000	
住友重機械工業	595,000	451	268,345,000	
日立建機	118,900	1,703	202,486,700	
日工	32,000	328	10,496,000	
巴工業	8,900	1,642	14,613,800	
井関農機	238,000	206	49,028,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ＴＯＷＡ	20,800	510	10,608,000	
丸山製作所	52,000	186	9,672,000	
北川鉄工所	107,000	165	17,655,000	
クボタ	1,067,000	804	857,868,000	
荏原実業	5,500	1,214	6,677,000	
三菱化工機	71,000	177	12,567,000	
月島機械	35,000	692	24,220,000	
帝国電機製作所	8,400	1,550	13,020,000	
新東工業	51,800	852	44,133,600	
澁谷工業	14,300	902	12,898,600	
アイチ コーポレーション	38,400	370	14,208,000	
小森コーポレーション	67,400	609	41,046,600	
鶴見製作所	19,000	648	12,312,000	
住友精密工業	35,000	513	17,955,000	
酒井重工業	44,000	192	8,448,000	
荏原製作所	380,000	306	116,280,000	
石井鐵工所	34,000	177	6,018,000	
西島製作所	27,600	1,082	29,863,200	
ダイキン工業	283,600	2,409	683,192,400	
オルガノ	44,000	602	26,488,000	
トーヨーカネツ	125,000	188	23,500,000	
栗田工業	128,500	2,082	267,537,000	
椿本チエイン	120,000	482	57,840,000	
大同工業	51,000	153	7,803,000	
日本コンベヤ	72,000	88	6,336,000	
木村化工機	21,400	404	8,645,600	
アネスト岩田	38,000	356	13,528,000	
ダイフク	102,000	471	48,042,000	
加藤製作所	53,000	322	17,066,000	
油研工業	45,000	181	8,145,000	
タダノ	107,000	588	62,916,000	
フジテック	65,000	509	33,085,000	
シーケーディ	62,700	616	38,623,200	
キトー	105	66,200	6,951,000	
平和	48,300	1,570	75,831,000	
理想科学工業	16,100	1,249	20,108,900	
ＳＡＮＫＹＯ	67,500	3,885	262,237,500	

日本金銭機械	20,500	618	12,669,000	
マースエンジニアリング	12,600	1,458	18,370,800	
福島工業	6,100	1,161	7,082,100	
オーイズミ	7,800	256	1,996,800	
ダイコク電機	10,200	958	9,771,600	
アマノ	67,700	750	50,775,000	
サンデン	117,000	306	35,802,000	
マックス	36,000	1,030	37,080,000	
グローリー	66,400	1,755	116,532,000	
大和冷機工業	32,000	429	13,728,000	
セガサミーホールディングス	239,200	1,568	375,065,600	
日本ピストンリング	82,000	205	16,810,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
リケン	81,000	359	29,079,000	
ＴＰＲ	24,700	1,170	28,899,000	
ホシザキ電機	44,900	1,797	80,685,300	
大豊工業	15,700	914	14,349,800	
日本精工	495,000	647	320,265,000	
ＮＴＮ	515,000	362	186,430,000	
ジェイテクト	212,900	923	196,506,700	
不二越	224,000	455	101,920,000	
日本トムソン	72,000	541	38,952,000	
ＴＨＫ	148,000	1,774	262,552,000	
ユーシン精機	11,600	1,618	18,768,800	
前澤給装工業	13,200	1,113	14,691,600	
イーグル工業	28,000	764	21,392,000	
前澤工業	16,300	227	3,700,100	
日本ピラー工業	23,000	636	14,628,000	
キッツ	92,100	361	33,248,100	
日立工機	60,700	718	43,582,600	
マキタ	145,200	3,365	488,598,000	
日立造船	880,500	110	96,855,000	
三菱重工業	3,731,000	387	1,443,897,000	
ＩＨＩ	1,521,000	207	314,847,000	
イビデン	146,000	1,929	281,634,000	
コニカミノルタホールディングス	588,000	692	406,896,000	

ブラザー工業	287,700	1,059	304,674,300	
ミネベア	331,000	388	128,428,000	
日立製作所	4,999,000	474	2,369,526,000	
東芝	4,686,000	350	1,640,100,000	
三菱電機	2,226,000	738	1,642,788,000	
富士電機	671,000	223	149,633,000	
東洋電機製造	39,000	329	12,831,000	
安川電機	262,000	786	205,932,000	
シンフォニアテクノロジー	134,000	190	25,460,000	
明電舎	220,000	301	66,220,000	
オリジン電気	32,000	318	10,176,000	
デンヨー	21,000	1,028	21,588,000	
東芝テック	140,000	310	43,400,000	
芝浦メカトロニクス	39,000	248	9,672,000	
マブチモーター	30,300	3,765	114,079,500	
日本電産	120,300	7,560	909,468,000	
高岳製作所	88,000	253	22,264,000	
ダイヘン	131,000	300	39,300,000	
ＪＶＣケンウッド	135,000	382	51,570,000	
第一精工	5,200	2,652	13,790,400	
日新電機	45,000	554	24,930,000	
大崎電気工業	32,000	851	27,232,000	
オムロン	247,900	1,789	443,493,100	
日東工業	33,500	922	30,887,000	
ＩＤＥＣ	29,300	828	24,260,400	
エルピーダメモリ	300,600	334	100,400,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	429,000	443	190,047,000	
サクサホールディングス	58,000	208	12,064,000	
メルコホールディングス	12,500	2,055	25,687,500	
テクノメディカ	17	317,500	5,397,500	
日本電気	3,060,000	162	495,720,000	
富士通	2,146,000	445	954,970,000	
沖電気工業	864,000	93	80,352,000	
岩崎通信機	102,000	85	8,670,000	
電気興業	69,000	402	27,738,000	

サンケン電気	113,000	373	42,149,000	
ナカヨ通信機	23,000	349	8,027,000	
アイホン	13,000	1,554	20,202,000	
ルネサスエレクトロニクス	57,700	606	34,966,200	
セイコーエプソン	151,900	1,102	167,393,800	
ワコム	441	149,800	66,061,800	
アルバック	42,500	1,040	44,200,000	
アクセル	10,300	1,781	18,344,300	
ナナオ	18,900	1,833	34,643,700	
日本信号	51,800	523	27,091,400	
京三製作所	48,000	363	17,424,000	
能美防災	29,000	542	15,718,000	
ホーチキ	20,000	449	8,980,000	
日本無線	50,000	216	10,800,000	
パナソニック	2,543,100	751	1,909,868,100	
シャープ	1,075,000	584	627,800,000	
アンリツ	106,000	974	103,244,000	
富士通ゼネラル	53,000	520	27,560,000	
日立国際電気	51,000	710	36,210,000	
ソニー	1,388,700	1,760	2,444,112,000	
ＴＤＫ	116,400	4,180	486,552,000	
帝国通信工業	53,000	153	8,109,000	
ミツミ電機	78,900	780	61,542,000	
タムラ製作所	74,000	237	17,538,000	
アルプス電気	175,700	727	127,733,900	
パイオニア	315,500	417	131,563,500	
日本電波工業	17,300	1,177	20,362,100	
日本トリム	2,850	2,040	5,814,000	
ローランド ディー．ジー．	10,300	1,003	10,330,900	
フォスター電機	21,100	1,331	28,084,100	
クラリオン	138,000	174	24,012,000	
ＳＭＫ	71,000	292	20,732,000	
ヨコオ	17,500	480	8,400,000	
東光	101,000	189	19,089,000	
ティアック	125,000	36	4,500,000	
ホシデン	60,300	632	38,109,600	
ヒロセ電機	38,700	8,120	314,244,000	
日本航空電子工業	51,000	663	33,813,000	
ＴＯＡ	25,000	599	14,975,000	

ユニデン	67,000	323	21,641,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
アルパイン	43,600	1,115	48,614,000	
スミダコーポレーション	13,800	577	7,962,600	
アイコム	12,500	2,005	25,062,500	
リオン	4,900	753	3,689,700	
船井電機	20,100	1,942	39,034,200	
横河電機	241,400	785	189,499,000	
新電元工業	79,000	398	31,442,000	
山武	57,100	1,790	102,209,000	
日本光電工業	44,300	2,068	91,612,400	
チノー	40,000	238	9,520,000	
共和電業	23,000	250	5,750,000	
日本電子材料	8,800	415	3,652,000	
堀場製作所	41,200	2,564	105,636,800	
アドバンテスト	165,500	1,137	188,173,500	
小野測器	24,000	298	7,152,000	
エスペック	23,000	603	13,869,000	
パナソニック電工ＳＵＮＸ	19,500	416	8,112,000	
キーエンス	49,700	20,850	1,036,245,000	
日置電機	10,700	1,362	14,573,400	
シスメックス	78,300	2,873	224,955,900	
メガチップス	18,300	1,473	26,955,900	
ＯＢＡＲＡ ＧＲＯＵＰ	16,600	1,057	17,546,200	
日本電産コパル電子	23,000	481	11,063,000	
ミヤチテクノス	11,100	711	7,892,100	
東京電波	6,500	428	2,782,000	
澤藤電機	12,000	237	2,844,000	
コーセル	32,400	1,174	38,037,600	
日立メディコ	16,000	970	15,520,000	
新日本無線	14,000	197	2,758,000	
オプテックス	15,300	1,004	15,361,200	
千代田インテグレ	10,700	994	10,635,800	
東光電気	14,000	364	5,096,000	
スタンレー電気	149,300	1,382	206,332,600	
岩崎電気	81,000	185	14,985,000	

ウシオ電機	135,100	1,222	165,092,200	
岡谷電機産業	11,900	374	4,450,600	
ヘリオス テクノ ホールディング	24,000	157	3,768,000	
日本セラミック	14,500	1,456	21,112,000	
日本デジタル研究所	18,800	920	17,296,000	
古河電池	16,000	401	6,416,000	
双信電機	10,800	375	4,050,000	
山一電機	22,500	197	4,432,500	
図研	15,100	671	10,132,100	
日本電子	82,000	231	18,942,000	
カシオ計算機	212,100	571	121,109,100	
ファナック	231,700	14,320	3,317,944,000	
日本シイエムケイ	47,900	451	21,602,900	
エンプラス	11,300	1,687	19,063,100	
ローム	109,700	4,035	442,639,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
浜松ホトニクス	86,800	2,867	248,855,600	
三井ハイテック	29,400	422	12,406,800	
新光電気工業	74,700	701	52,364,700	
京セラ	185,100	6,900	1,277,190,000	
太陽誘電	99,900	842	84,115,800	
村田製作所	233,500	4,810	1,123,135,000	
ユーシン	31,100	667	20,743,700	
双葉電子工業	38,600	1,380	53,268,000	
北陸電気工業	90,000	127	11,430,000	
ニチコン	70,100	1,012	70,941,200	
日本ケミコン	128,000	338	43,264,000	
ＫＯＡ	28,000	822	23,016,000	
市光工業	54,000	174	9,396,000	
小糸製作所	111,000	1,395	154,845,000	
ミツバ	41,000	800	32,800,000	
スター精密	36,700	785	28,809,500	
大日本スクリーン製造	211,000	680	143,480,000	
キヤノン電子	20,400	2,026	41,330,400	
キヤノン	1,382,700	3,680	5,088,336,000	
リコー	669,000	749	501,081,000	

日本電産サンキョー	53,000	538	28,514,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	23,000	404	9,292,000	
東京エレクトロン	187,200	4,465	835,848,000	
トヨタ紡織	77,800	1,046	81,378,800	
鬼怒川ゴム工業	51,000	623	31,773,000	
ユニプレス	35,500	2,285	81,117,500	
豊田自動織機	202,700	2,543	515,466,100	
モリタホールディングス	36,000	528	19,008,000	
三櫻工業	28,400	653	18,545,200	
デンソー	549,900	2,704	1,486,929,600	
東海理化電機製作所	52,100	1,493	77,785,300	
三井造船	862,000	157	135,334,000	
佐世保重工業	146,000	151	22,046,000	
川崎重工業	1,618,000	257	415,826,000	
日本車輌製造	81,000	368	29,808,000	
日本輸送機	29,000	260	7,540,000	
近畿車輛	33,000	316	10,428,000	
日産自動車	2,812,000	837	2,353,644,000	
いすゞ自動車	1,407,000	439	617,673,000	
トヨタ自動車	2,886,400	3,380	9,756,032,000	代用有価証券で 500,000株 担保差入
日野自動車	318,000	575	182,850,000	
三菱自動車工業	4,976,000	99	492,624,000	
エフテック	7,800	1,346	10,498,800	
武蔵精密工業	21,600	1,941	41,925,600	
日産車体	65,000	844	54,860,000	
新明和工業	99,000	387	38,313,000	
極東開発工業	38,400	748	28,723,200	
日信工業	40,800	1,430	58,344,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
トピー工業	167,000	242	40,414,000	
ティラド	81,000	340	27,540,000	
曙ブレーキ工業	113,100	437	49,424,700	
タチエス	29,100	1,626	47,316,600	
ＮＯＫ	107,700	1,608	173,181,600	
フタバ産業	63,200	498	31,473,600	

カヤバ工業	154,000	460	70,840,000	
シロキ工業	50,000	269	13,450,000	
大同メタル工業	34,000	985	33,490,000	
プレス工業	103,000	471	48,513,000	
カルソニックカンセイ	132,000	471	62,172,000	
太平洋工業	46,000	444	20,424,000	
ケーヒン	46,100	1,660	76,526,000	
河西工業	28,000	453	12,684,000	
アイシン精機	183,300	2,899	531,386,700	
富士機工	26,000	314	8,164,000	
マツダ	1,846,000	140	258,440,000	
ダイハツ工業	207,000	1,522	315,054,000	
愛知機械工業	50,000	335	16,750,000	
今仙電機製作所	16,400	1,098	18,007,200	
本田技研工業	1,877,900	3,140	5,896,606,000	
スズキ	465,300	1,955	909,661,500	
富士重工業	703,000	632	444,296,000	
ヤマハ発動機	362,600	1,195	433,307,000	
ショーワ	47,500	662	31,445,000	
ＴＢＫ	23,000	535	12,305,000	
エクセディ	30,200	2,393	72,268,600	
豊田合成	62,900	1,545	97,180,500	
愛三工業	23,200	761	17,655,200	
ヨロズ	13,400	1,766	23,664,400	
エフ・シー・シー	36,400	1,905	69,342,000	
シマノ	84,300	4,655	392,416,500	
タカタ	40,200	2,088	83,937,600	
テイ・エス テック	47,100	1,563	73,617,300	
日本電産トーソク	10,800	1,031	11,134,800	
テルモ	157,500	3,900	614,250,000	
クリエートメディック	6,700	805	5,393,500	
日機装	72,000	730	52,560,000	
島津製作所	266,000	694	184,604,000	
ＪＭＳ	33,000	258	8,514,000	
クボテック	48	23,650	1,135,200	
モリテックス	4,800	341	1,636,800	
長野計器	15,600	800	12,480,000	
ブイ・テクノロジー	30	329,000	9,870,000	
東京計器	77,000	173	13,321,000	

愛知時計電機	44,000	286	12,584,000	
東京精密	39,900	1,762	70,303,800	
ニコン	387,900	2,141	830,493,900	
トプコン	51,200	505	25,856,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
オリンパス	262,500	1,373	360,412,500	
理研計器	18,000	613	11,034,000	
タムロン	19,300	2,324	44,853,200	
ＨＯＹＡ	541,200	1,877	1,015,832,400	
ノーリツ鋼機	20,400	427	8,710,800	
エー・アンド・デイ	21,700	263	5,707,100	
日本電産コパル	17,400	964	16,773,600	
シチズンホールディングス	266,400	499	132,933,600	
リズム時計工業	105,000	150	15,750,000	
大研医器	2,800	811	2,270,800	
セイコーホールディングス	132,000	188	24,816,000	
ニプロ	88,300	630	55,629,000	
パラマウントベッドホールディングス	19,100	2,116	40,415,600	
ＳＨＯ－ＢＩ	4,000	498	1,992,000	
永大産業	42,000	406	17,052,000	
ＳＲＩスポーツ	14,700	930	13,671,000	
バンダイナムコホールディングス	238,400	1,136	270,822,400	
共立印刷	26,900	271	7,289,900	
フランスベッドホールディングス	153,000	164	25,092,000	
パイロットコーポレーション	194	153,700	29,817,800	
トッパン・フォームズ	48,100	706	33,958,600	
フジシールインターナショナル	24,900	1,515	37,723,500	
タカラトミー	74,300	580	43,094,000	
廣済堂	20,300	277	5,623,100	
タカノ	10,000	474	4,740,000	
プロネクサス	25,200	415	10,458,000	
ウッドワン	54,000	336	18,144,000	
大建工業	109,000	283	30,847,000	
凸版印刷	677,000	638	431,926,000	
大日本印刷	678,000	826	560,028,000	
図書印刷	38,000	169	6,422,000	

共同印刷	76,000	231	17,556,000	
日本写真印刷	37,600	1,162	43,691,200	
光村印刷	22,000	287	6,314,000	
宝印刷	13,000	603	7,839,000	
アシックス	207,300	979	202,946,700	
ツツミ	11,400	2,150	24,510,000	
ローランド	23,800	783	18,635,400	
小松ウオール工業	9,100	847	7,707,700	
ヤマハ	163,600	786	128,589,600	
河合楽器製作所	87,000	174	15,138,000	
クリナップ	36,700	521	19,120,700	
ピジョン	19,600	2,844	55,742,400	
キングジム	18,800	634	11,919,200	
リンテック	42,500	1,744	74,120,000	
イトーキ	48,600	339	16,475,400	
任天堂	127,300	12,660	1,611,618,000	
三菱鉛筆	18,300	1,400	25,620,000	
タカラスタンダード	111,000	611	67,821,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
コクヨ	115,700	594	68,725,800	
ナカバヤシ	47,000	206	9,682,000	
グローブライド	114,000	110	12,540,000	
岡村製作所	79,000	584	46,136,000	
美津濃	112,000	436	48,832,000	
アデランス	28,400	950	26,980,000	
東京電力	1,777,100	238	422,949,800	代用有価証券で 300,000株 担保差入
中部電力	733,400	1,486	1,089,832,400	
関西電力	908,300	1,325	1,203,497,500	
中国電力	307,700	1,504	462,780,800	
北陸電力	218,100	1,537	335,219,700	
東北電力	556,100	920	511,612,000	
四国電力	204,900	2,240	458,976,000	
九州電力	491,600	1,184	582,054,400	
北海道電力	208,300	1,189	247,668,700	
沖縄電力	13,300	3,380	44,954,000	

電源開発	138,100	2,090	288,629,000	
東京瓦斯	2,686,000	361	969,646,000	
大阪瓦斯	2,160,000	307	663,120,000	
東邦瓦斯	566,000	473	267,718,000	
北海道瓦斯	40,000	277	11,080,000	
西部瓦斯	251,000	223	55,973,000	
静岡瓦斯	58,000	521	30,218,000	
東武鉄道	1,264,000	409	516,976,000	
相鉄ホールディングス	356,000	256	91,136,000	
東京急行電鉄	1,310,000	388	508,280,000	
京浜急行電鉄	572,000	709	405,548,000	
小田急電鉄	713,000	765	545,445,000	
京王電鉄	622,000	572	355,784,000	
京成電鉄	357,000	586	209,202,000	
富士急行	61,000	491	29,951,000	
新京成電鉄	29,000	353	10,237,000	
東日本旅客鉄道	387,000	5,180	2,004,660,000	
西日本旅客鉄道	193,500	3,275	633,712,500	
東海旅客鉄道	1,932	664,000	1,282,848,000	
西日本鉄道	288,000	383	110,304,000	
ハマキョウレックス	6,400	2,400	15,360,000	
サカイ引越センター	4,100	1,735	7,113,500	
近畿日本鉄道	2,010,000	305	613,050,000	
阪急阪神ホールディングス	1,494,000	343	512,442,000	
南海電気鉄道	464,000	359	166,576,000	
京阪電気鉄道	499,000	403	201,097,000	
名糖運輸	9,100	642	5,842,200	
名古屋鉄道	777,000	224	174,048,000	
日本通運	881,000	314	276,634,000	
ヤマトホールディングス	452,900	1,272	576,088,800	
山九	270,000	325	87,750,000	
丸運	12,000	214	2,568,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
丸全昭和運輸	75,000	268	20,100,000	
センコー	89,000	319	28,391,000	
トナミホールディングス	46,000	199	9,154,000	

日本梱包運輸倉庫	66,700	915	61,030,500	
日本石油輸送	25,000	208	5,200,000	
福山通運	135,000	447	60,345,000	
セイノーホールディングス	172,000	591	101,652,000	
神奈川中央交通	26,000	435	11,310,000	
日立物流	46,400	1,329	61,665,600	
日本郵船	1,763,000	248	437,224,000	
商船三井	1,167,000	378	441,126,000	
川崎汽船	688,000	181	124,528,000	
ＮＳユナイテッド海運	96,000	144	13,824,000	
乾汽船	24,400	340	8,296,000	
明治海運	19,900	412	8,198,800	
飯野海運	107,500	397	42,677,500	
共栄タンカー	19,000	228	4,332,000	
第一中央汽船	146,000	134	19,564,000	
全日本空輸	2,967,000	249	738,783,000	
パスコ	21,000	300	6,300,000	
国際航業ホールディングス	19,000	200	3,800,000	
日新	84,000	217	18,228,000	
三菱倉庫	158,000	939	148,362,000	
三井倉庫	103,000	316	32,548,000	
住友倉庫	163,000	398	64,874,000	
澁澤倉庫	53,000	248	13,144,000	
東陽倉庫	35,000	190	6,650,000	
日本トランスシティ	46,000	291	13,386,000	
ケイヒン	41,000	123	5,043,000	
安田倉庫	17,300	529	9,151,700	
東洋埠頭	64,000	158	10,112,000	
宇徳	15,000	297	4,455,000	
上組	246,000	690	169,740,000	
サンリツ	5,800	554	3,213,200	
キムラユニティー	5,000	730	3,650,000	
キユーソー流通システム	7,000	867	6,069,000	
郵船ロジスティクス	17,500	1,203	21,052,500	
近鉄エクスプレス	19,900	2,602	51,779,800	
東海運	14,000	261	3,654,000	
エーアイテイー	1,800	1,203	2,165,400	
バンテック	26	232,000	6,032,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	22,800	1,142	26,037,600	

システナ	263	60,500	15,911,500	
新日鉄ソリューションズ	14,700	1,567	23,034,900	
コア	8,200	730	5,986,000	
ソフトクリエイト	2,400	1,150	2,760,000	
デジタルハーツ	18	143,000	2,574,000	
ＩＴホールディングス	66,800	937	62,591,600	
グリー	112,300	2,449	275,022,700	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
コーエーテクモホールディングス	43,400	645	27,993,000	
三菱総合研究所	8,500	1,624	13,804,000	
ボルテージ	2,200	1,184	2,604,800	
ネクソン	110,400	1,236	136,454,400	
ドワンゴ	110	129,700	14,267,000	
ベリサーブ	13	140,000	1,820,000	
マクロミル	21,400	793	16,970,200	
ティーガイア	143	144,000	20,592,000	
GMOペイメントゲートウェイ	48	330,500	15,864,000	
ザッパラス	122	94,200	11,492,400	
インターネットイニシアティブ	129	247,100	31,875,900	
ソネットエンタテインメント	124	312,500	38,750,000	
ＳＲＡホールディングス	11,600	886	10,277,600	
ＪＢＩＳホールディングス	23,500	309	7,261,500	
朝日ネット	18,000	365	6,570,000	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	5,200	2,153	11,195,600	
フェイス	753	9,610	7,236,330	
野村総合研究所	124,400	1,893	235,489,200	
サイバネットシステム	180	22,130	3,983,400	
インテージ	6,700	1,539	10,311,300	
シンプレクス・ホールディングス	378	26,040	9,843,120	
クレスコ	5,500	640	3,520,000	
フジ・メディア・ホールディングス	2,288	123,600	282,796,800	
オービック	6,880	15,440	106,227,200	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	4,400	779	3,427,600	
ヤフー	16,085	25,320	407,272,200	

トレンドマイクロ	97,000	2,339	226,883,000	
日本オラクル	43,900	2,815	123,578,500	
アルファシステムズ	6,000	1,338	8,028,000	
フューチャーアーキテクト	264	35,200	9,292,800	
シーエーシー	14,900	686	10,221,400	
ソフトバンク・テクノロジー	5,300	736	3,900,800	
トーセ	5,400	524	2,829,600	
オービックビジネスコンサルタント	5,600	3,565	19,964,000	
日立ビジネスソリューション	7,000	1,008	7,056,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	25,900	3,435	88,966,500	
アイティフォー	24,500	305	7,472,500	
東計電算	3,900	1,042	4,063,800	
エックスネット	20	123,000	2,460,000	
大塚商会	17,500	5,810	101,675,000	
サイボウズ	402	33,200	13,346,400	
ソフトブレーン	323	8,550	2,761,650	
アグレックス	5,800	786	4,558,800	
電通国際情報サービス	13,500	640	8,640,000	
ウェザーニューズ	5,900	2,118	12,496,200	
ＣＩＪ	21,900	337	7,380,300	
WOWOW	68	200,200	13,613,600	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ネットワンシステムズ	496	197,300	97,860,800	
アルゴグラフィックス	8,300	1,133	9,403,900	
エイベックス・グループ・ホールディングス	42,100	997	41,973,700	
日本ユニシス	53,100	551	29,258,100	
兼松エレクトロニクス	14,400	855	12,312,000	
東京放送ホールディングス	131,600	1,149	151,208,400	
日本テレビ放送網	19,280	12,130	233,866,400	
テレビ朝日	556	135,100	75,115,600	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	1,667	38,600	64,346,200	
テレビ東京ホールディングス	14,000	1,104	15,456,000	
アイ・ティー・シーネットワーク	18,600	538	10,006,800	
イー・アクセス	1,681	21,320	35,838,920	
ＮＥＣモバイリング	8,100	2,813	22,785,300	
日本電信電話	1,011,600	3,750	3,793,500,000	

ＫＤＤＩ	3,410	507,000	1,728,870,000	
光通信	20,300	2,292	46,527,600	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	18,101	137,800	2,494,317,800	
ＧＭＯインターネット	65,400	393	25,702,200	
学研ホールディングス	66,000	173	11,418,000	
ゼンリン	31,800	816	25,948,800	
昭文社	12,100	639	7,731,900	
角川グループホールディングス	20,800	2,572	53,497,600	
インプレスホールディングス	18,800	154	2,895,200	
アイネット	9,500	485	4,607,500	
松竹	144,000	769	110,736,000	
東宝	156,700	1,411	221,103,700	
東映	93,000	396	36,828,000	
葵プロモーション	10,500	497	5,218,500	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,357	266,700	361,911,900	
ＤＴＳ	22,700	1,059	24,039,300	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	71,800	1,589	114,090,200	
シーイーシー	13,000	392	5,096,000	
カプコン	42,100	1,787	75,232,700	
ジャステック	13,900	495	6,880,500	
ＳＣＳＫ	44,800	1,240	55,552,000	
日本システムウエア	7,300	332	2,423,600	
アイネス	26,600	628	16,704,800	
ＴＫＣ	18,500	1,624	30,044,000	
富士ソフト	28,800	1,578	45,446,400	
ＮＳＤ	42,500	696	29,580,000	
コナミ	99,200	2,190	217,248,000	
福井コンピュータ	3,000	434	1,302,000	
ＪＢＣＣホールディングス	17,200	574	9,872,800	
ソフトバンク	995,300	2,359	2,347,912,700	
ホウスイ	19,000	126	2,394,000	
インターニックス	8,900	401	3,568,900	
高千穂交易	9,100	923	8,399,300	
伊藤忠食品	5,500	2,916	16,038,000	
エレマテック	17,900	1,415	25,328,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	

ＪＡＬＵＸ	8,700	821	7,142,700	
トーメンデバイス	3,300	2,020	6,666,000	
東京エレクトロン デバイス	44	150,900	6,639,600	
双日	1,470,500	152	223,516,000	
アルフレッサ ホールディングス	57,500	3,530	202,975,000	
横浜冷凍	51,100	628	32,090,800	
神栄	29,000	158	4,582,000	
山下医科器械	1,800	987	1,776,600	
ラサ商事	14,500	404	5,858,000	
アルコニックス	6,800	1,867	12,695,600	
あい ホールディングス	35,700	365	13,030,500	
ダイワボウホールディングス	215,000	187	40,205,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	41,300	700	28,910,000	
八洲電機	14,400	373	5,371,200	
ＵＫＣホールディングス	13,000	1,058	13,754,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	107,300	388	41,632,400	
ミタチ産業	5,100	418	2,131,800	
ＪＦＥ商事ホールディングス	153,000	414	63,342,000	
シップヘルスケアホールディングス	28,500	1,556	44,346,000	
富士興産	79,000	87	6,873,000	
協栄産業	26,000	160	4,160,000	
小野建	19,100	736	14,057,600	
佐鳥電機	16,100	504	8,114,400	
エコートレーディング	5,400	743	4,012,200	
伯東	13,300	824	10,959,200	
コンドーテック	25,800	531	13,699,800	
中山福	13,600	635	8,636,000	
ナガイレーベン	29,300	1,206	35,335,800	
三菱食品	20,200	2,115	42,723,000	
松田産業	17,500	1,343	23,502,500	
メディパルホールディングス	236,600	972	229,975,200	
アドヴァン	20,500	762	15,621,000	
ＳＰＫ	5,200	1,424	7,404,800	
アズワン	14,500	1,779	25,795,500	
スズデン	8,600	536	4,609,600	
尾家産業	7,300	858	6,263,400	
シモジマ	13,400	1,100	14,740,000	
ドウシシャ	11,200	2,231	24,987,200	
高速	13,000	673	8,749,000	

黒田電気	27,100	868	23,522,800	
丸文	17,400	393	6,838,200	
ハピネット	12,500	727	9,087,500	
トーメンエレクトロニクス	10,100	1,155	11,665,500	
エクセル	10,000	816	8,160,000	
マルカキカイ	8,100	766	6,204,600	
ガリバーインターナショナル	6,680	3,220	21,509,600	
日本エム・ディ・エム	18,300	274	5,014,200	
進和	13,800	954	13,165,200	
エスケイジャパン	7,300	263	1,919,900	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ダイトエレクトロン	10,000	432	4,320,000	
シークス	13,900	1,178	16,374,200	
田中商事	18,800	464	8,723,200	
オーハシテクニカ	12,400	591	7,328,400	
マクニカ	11,300	1,942	21,944,600	
白銅	7,100	806	5,722,600	
伊藤忠商事	1,752,600	924	1,619,402,400	
丸紅	1,922,000	579	1,112,838,000	
高島	39,000	217	8,463,000	
Ｆ＆Ａアクアホールディングス	17,100	780	13,338,000	
長瀬産業	124,400	971	120,792,400	
蝶理	135,000	105	14,175,000	
豊田通商	244,700	1,592	389,562,400	
三共生興	38,400	300	11,520,000	
ツカモトコーポレーション	41,000	191	7,831,000	
三井物産	1,896,300	1,397	2,649,131,100	
日本紙パルプ商事	114,000	290	33,060,000	
日立ハイテクノロジーズ	66,600	1,871	124,608,600	
カメイ	29,000	1,003	29,087,000	
東都水産	37,000	164	6,068,000	
スターゼン	74,000	263	19,462,000	
山善	87,500	648	56,700,000	
椿本興業	23,000	261	6,003,000	
住友商事	1,296,500	1,199	1,554,503,500	
内田洋行	50,000	291	14,550,000	

三菱商事	1,599,900	2,008	3,212,599,200	
第一実業	51,000	389	19,839,000	
キヤノンマーケティングジャパン	73,100	1,032	75,439,200	
西華産業	82,000	243	19,926,000	
佐藤商事	19,600	547	10,721,200	
菱洋エレクトロ	24,700	908	22,427,600	
東京産業	22,000	292	6,424,000	
ユアサ商事	239,000	141	33,699,000	
神鋼商事	66,000	205	13,530,000	
阪和興業	219,000	383	83,877,000	
カナデン	25,000	550	13,750,000	
菱電商事	36,000	506	18,216,000	
フルサト工業	14,000	760	10,640,000	
岩谷産業	251,000	276	69,276,000	
すてきナイスグループ	101,000	246	24,846,000	
昭光通商	93,000	140	13,020,000	
ニチモウ	41,000	222	9,102,000	
極東貿易	34,000	194	6,596,000	
イワキ	33,000	203	6,699,000	
三愛石油	53,000	390	20,670,000	
稲畑産業	62,400	531	33,134,400	
ＧＳＩクレオス	56,000	128	7,168,000	
明和産業	24,200	297	7,187,400	
東邦ホールディングス	70,300	1,279	89,913,700	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
サンゲツ	38,900	2,132	82,934,800	
ミツウロコグループホールディングス	35,300	533	18,814,900	
シナネン	47,000	384	18,048,000	
伊藤忠エネクス	48,500	478	23,183,000	
サンリオ	55,400	3,405	188,637,000	
サンワテクノス	10,700	811	8,677,700	
リョーサン	35,800	1,689	60,466,200	
新光商事	24,100	732	17,641,200	
トーホー	46,000	313	14,398,000	
三信電気	31,400	808	25,371,200	
東陽テクニカ	31,800	891	28,333,800	

モスフードサービス	28,900	1,573	45,459,700	
加賀電子	23,800	856	20,372,800	
ソーダニッカ	23,000	370	8,510,000	
立花エレテック	14,400	729	10,497,600	
Ｐａｌｔａｃ	23,200	1,096	25,427,200	
ヤマタネ	111,000	129	14,319,000	
丸紅建材リース	23,000	188	4,324,000	
日鐵商事	49,000	228	11,172,000	
トラスコ中山	28,600	1,665	47,619,000	
オートバックスセブン	26,000	3,920	101,920,000	
加藤産業	31,800	1,563	49,703,400	
イノテック	13,200	571	7,537,200	
イエローハット	20,900	1,197	25,017,300	
富士エレクトロニクス	11,300	1,211	13,684,300	
ＪＫホールディングス	32,200	404	13,008,800	
日伝	9,200	2,277	20,948,400	
北沢産業	48,500	185	8,972,500	
杉本商事	12,900	764	9,855,600	
因幡電機産業	25,900	2,419	62,652,100	
住金物産	112,000	225	25,200,000	
ミスミグループ本社	81,200	1,988	161,425,600	
江守商事	4,400	959	4,219,600	
アルテック	13,900	242	3,363,800	
タキヒヨー	34,000	456	15,504,000	
スズケン	84,400	2,400	202,560,000	
ジェコス	29,500	392	11,564,000	
ローソン	69,300	4,760	329,868,000	
サンエー	7,600	3,080	23,408,000	
キリン堂	9,900	508	5,029,200	
ダイユーエイト	3,600	831	2,991,600	
カワチ薬品	15,500	1,720	26,660,000	
エービーシー・マート	31,200	2,792	87,110,400	
ハードオフコーポレーション	11,000	649	7,139,000	
アスクル	15,300	1,251	19,140,300	
ゲオホールディングス	367	93,000	34,131,000	
ポイント	18,550	3,030	56,206,500	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	16,000	151	2,416,000	
くらコーポレーション	11,600	1,198	13,896,800	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
キャンドゥ	119	86,600	10,305,400	
パル	6,450	3,235	20,865,750	
エディオン	88,000	585	51,480,000	
サーラコーポレーション	19,000	505	9,595,000	
あみやき亭	34	203,000	6,902,000	
ひらまつ	96	70,800	6,796,800	
ゲンキー	1,700	1,876	3,189,200	
ハニーズ	19,480	1,183	23,044,840	
アルペン	14,400	1,477	21,268,800	
ビックカメラ	839	44,350	37,209,650	
ＤＣＭホールディングス	113,700	588	66,855,600	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	12,800	999	12,787,200	
Ｊ．フロント リテイリング	519,000	392	203,448,000	
ドトール・日レスホールディングス	35,200	1,058	37,241,600	
マツモトキヨシホールディングス	40,900	1,684	68,875,600	
物語コーポレーション	2,500	1,293	3,232,500	
ココカラファイン	23,000	2,232	51,336,000	
三越伊勢丹ホールディングス	436,500	881	384,556,500	
クリエイトＳＤホールディングス	9,400	1,833	17,230,200	
丸善ＣＨＩホールディングス	7,500	216	1,620,000	
ブックオフコーポレーション	12,400	725	8,990,000	
あさひ	12,800	1,517	19,417,600	
サークルKサンクス	48,700	1,773	86,345,100	
日本調剤	3,020	2,540	7,670,800	
コスモス薬品	9,800	3,560	34,888,000	
セブン＆アイ・ホールディングス	919,000	2,216	2,036,504,000	
ツルハホールディングス	18,000	4,030	72,540,000	
サンマルクホールディングス	6,400	3,115	19,936,000	
フェリシモ	6,500	1,086	7,059,000	
トリドール	19,300	821	15,845,300	
クスリのアオキ	3,400	1,801	6,123,400	
メディカルシステムネットワーク	4,300	1,049	4,510,700	
総合メディカル	5,400	2,610	14,094,000	
はるやま商事	9,700	434	4,209,800	
カッパ・クリエイト	16,250	1,800	29,250,000	
ライトオン	16,800	600	10,080,000	

ジーンズメイト	8,000	215	1,720,000	
良品計画	23,300	3,815	88,889,500	
三城ホールディングス	27,500	602	16,555,000	
コナカ	26,200	653	17,108,600	
ハウス オブ ローゼ	2,600	1,305	3,393,000	
Ｇ－７ホールディングス	7,000	419	2,933,000	
イオン北海道	14,400	352	5,068,800	
コジマ	30,100	502	15,110,200	
コーナン商事	24,200	1,212	29,330,400	
エコス	7,900	485	3,831,500	
ワタミ	26,300	1,732	45,551,600	
マルシェ	5,600	727	4,071,200	
ドン・キホーテ	58,600	2,807	164,490,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
メガネトップ	31,700	823	26,089,100	
西松屋チェーン	48,500	641	31,088,500	
ゼンショーホールディングス	83,700	997	83,448,900	
幸楽苑	13,700	1,260	17,262,000	
ハークスレイ	5,800	514	2,981,200	
サイゼリヤ	32,700	1,275	41,692,500	
ポプラ	6,000	490	2,940,000	
ユナイテッドアローズ	23,800	1,623	38,627,400	
ハイデイ日高	11,760	1,271	14,946,960	
京都きもの友禅	14,800	963	14,252,400	
コロワイド	73,000	607	44,311,000	
壱番屋	8,900	2,317	20,621,300	
トップカルチャー	8,500	393	3,340,500	
スギホールディングス	39,400	2,173	85,616,200	
スクロール	29,200	335	9,782,000	
ファミリーマート	67,500	3,140	211,950,000	
木曽路	25,200	1,556	39,211,200	
千趣会	39,900	541	21,585,900	
タカキュー	18,000	175	3,150,000	
ケーヨー	41,500	526	21,829,000	
上新電機	48,000	856	41,088,000	
日本瓦斯	21,000	1,267	26,607,000	

マルエツ	45,000	312	14,040,000	
ロイヤルホールディングス	36,900	930	34,317,000	
東天紅	17,000	173	2,941,000	
いなげや	24,700	943	23,292,100	
島忠	49,700	1,803	89,609,100	
チヨダ	28,900	1,437	41,529,300	
ライフコーポレーション	14,100	1,405	19,810,500	
カスミ	45,500	525	23,887,500	
リンガーハット	20,000	1,073	21,460,000	
ＭｒＭａｘ	22,600	352	7,955,200	
テンアライド	17,400	274	4,767,600	
ＡＯＫＩホールディングス	19,800	1,310	25,938,000	
オークワ	32,000	1,123	35,936,000	
コメリ	30,100	2,357	70,945,700	
青山商事	60,600	1,467	88,900,200	
しまむら	25,500	8,670	221,085,000	
ＣＦＳコーポレーション	15,000	388	5,820,000	
高島屋	297,000	597	177,309,000	
松屋	44,800	511	22,892,800	
エイチ・ツー・オー リテイリング	114,000	566	64,524,000	
ニッセンホールディングス	44,400	405	17,982,000	
パルコ	40,300	855	34,456,500	
丸井グループ	286,300	636	182,086,800	
原信ナルスホールディングス	12,400	1,378	17,087,200	
ダイエー	136,600	290	39,614,000	
イズミヤ	77,000	429	33,033,000	
イオン	774,500	1,032	799,284,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ユニー	164,700	804	132,418,800	
イズミ	65,800	1,368	90,014,400	
東武ストア	30,000	281	8,430,000	
平和堂	40,700	1,017	41,391,900	
フジ	25,100	1,863	46,761,300	
ヤオコー	9,800	2,600	25,480,000	
ゼビオ	26,600	1,913	50,885,800	
ケーズホールディングス	54,800	2,762	151,357,600	

Ｏｌｙｍｐｉｃ	14,900	859	12,799,100	
日産東京販売ホールディングス	33,000	206	6,798,000	
アインファーマシーズ	12,300	3,765	46,309,500	
元気寿司	7,000	1,036	7,252,000	
ヤマダ電機	106,880	5,200	555,776,000	
アークランドサカモト	14,500	1,369	19,850,500	
ニトリホールディングス	43,500	6,850	297,975,000	
グルメ杵屋	16,000	470	7,520,000	
愛眼	18,100	368	6,660,800	
吉野家ホールディングス	597	107,200	63,998,400	
松屋フーズ	10,700	1,657	17,729,900	
サガミチェーン	26,000	569	14,794,000	
プレナス	24,700	1,300	32,110,000	
ミニストップ	16,400	1,451	23,796,400	
アークス	30,400	1,470	44,688,000	
バロー	43,900	1,202	52,767,800	
ベルク	11,100	1,210	13,431,000	
大庄	10,500	1,023	10,741,500	
ファーストリテイリング	51,300	16,380	840,294,000	
サンドラッグ	41,800	2,306	96,390,800	
ヤマザワ	5,900	1,433	8,454,700	
やまや	4,000	1,101	4,404,000	
ベルーナ	27,750	622	17,260,500	
新生銀行	1,711,000	105	179,655,000	
あおぞら銀行	684,000	237	162,108,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	16,630,900	420	6,984,978,000	
りそなホールディングス	1,912,000	391	747,592,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	4,391,000	286	1,255,826,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,661,400	2,756	4,578,818,400	
第四銀行	286,000	278	79,508,000	
北越銀行	225,000	176	39,600,000	
西日本シティ銀行	771,000	236	181,956,000	
札幌北洋ホールディングス	331,300	298	98,727,400	
千葉銀行	867,000	507	439,569,000	
横浜銀行	1,411,000	389	548,879,000	
常陽銀行	846,000	366	309,636,000	
群馬銀行	502,000	437	219,374,000	
武蔵野銀行	35,400	2,775	98,235,000	
千葉興業銀行	42,100	462	19,450,200	

筑波銀行	91,300	293	26,750,900	
東京都民銀行	41,500	997	41,375,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
七十七銀行	344,000	366	125,904,000	
青森銀行	164,000	257	42,148,000	
秋田銀行	151,000	261	39,411,000	
山形銀行	134,000	391	52,394,000	
岩手銀行	14,800	3,705	54,834,000	
東邦銀行	185,000	285	52,725,000	
東北銀行	118,000	157	18,526,000	
みちのく銀行	110,000	170	18,700,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	891,000	346	308,286,000	
静岡銀行	663,000	813	539,019,000	
十六銀行	275,000	282	77,550,000	
スルガ銀行	214,000	749	160,286,000	
八十二銀行	405,000	477	193,185,000	
山梨中央銀行	134,000	386	51,724,000	
大垣共立銀行	293,000	288	84,384,000	
福井銀行	189,000	255	48,195,000	
北國銀行	262,000	311	81,482,000	
清水銀行	7,500	3,375	25,312,500	
滋賀銀行	206,000	504	103,824,000	
南都銀行	204,000	399	81,396,000	
百五銀行	198,000	360	71,280,000	
京都銀行	393,000	696	273,528,000	
三重銀行	91,000	198	18,018,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,539,000	161	247,779,000	
広島銀行	648,000	371	240,408,000	
山陰合同銀行	131,000	631	82,661,000	
中国銀行	180,000	1,070	192,600,000	
鳥取銀行	70,000	165	11,550,000	
伊予銀行	235,000	739	173,665,000	
百十四銀行	241,000	390	93,990,000	
四国銀行	159,000	313	49,767,000	
阿波銀行	194,000	524	101,656,000	
鹿児島銀行	142,000	528	74,976,000	

大分銀行	142,000	245	34,790,000	
宮崎銀行	146,000	220	32,120,000	
肥後銀行	170,000	471	80,070,000	
佐賀銀行	133,000	210	27,930,000	
十八銀行	141,000	257	36,237,000	
沖縄銀行	16,600	3,395	56,357,000	
琉球銀行	46,200	996	46,015,200	
八千代銀行	11,500	2,098	24,127,000	
セブン銀行	617,300	174	107,410,200	
みずほフィナンシャルグループ	28,226,400	136	3,838,790,400	
紀陽ホールディングス	875,000	129	112,875,000	
山口フィナンシャルグループ	219,000	747	163,593,000	
長野銀行	72,000	170	12,240,000	
名古屋銀行	198,000	288	57,024,000	
愛知銀行	7,900	4,910	38,789,000	
第三銀行	124,000	176	21,824,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
中京銀行	90,000	227	20,430,000	
東日本銀行	105,000	187	19,635,000	
大光銀行	78,000	269	20,982,000	
愛媛銀行	138,000	247	34,086,000	
トマト銀行	85,000	159	13,515,000	
みなと銀行	199,000	167	33,233,000	
京葉銀行	181,000	391	70,771,000	
関西アーバン銀行	306,000	131	40,086,000	
栃木銀行	110,000	303	33,330,000	
北日本銀行	6,800	2,084	14,171,200	
東和銀行	220,000	95	20,900,000	
福島銀行	254,000	76	19,304,000	
大東銀行	140,000	76	10,640,000	
トモニホールディングス	169,000	386	65,234,000	
フィデアホールディングス	126,400	213	26,923,200	
池田泉州ホールディングス	906,500	122	110,593,000	
ＳＢＩホールディングス	23,275	7,940	184,803,500	
ジャフコ	28,400	1,837	52,170,800	
大和証券グループ本社	2,176,000	339	737,664,000	

野村ホールディングス	4,755,500	378	1,797,579,000	
岡三証券グループ	187,000	338	63,206,000	
丸三証券	74,300	375	27,862,500	
東洋証券	83,000	166	13,778,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	252,000	312	78,624,000	
光世証券	53,000	91	4,823,000	
水戸証券	65,000	158	10,270,000	
いちよし証券	49,300	553	27,262,900	
松井証券	130,400	508	66,243,200	
だいこう証券ビジネス	12,600	347	4,372,200	
マネックスグループ	1,773	17,690	31,364,370	
カブドットコム証券	89,800	310	27,838,000	
極東証券	29,600	695	20,572,000	
岩井コスモホールディングス	21,000	380	7,980,000	
ＮＫＳＪホールディングス	459,300	1,858	853,379,400	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	656,500	1,701	1,116,706,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	210,500	1,453	305,856,500	
第一生命保険	11,750	106,100	1,246,675,000	
東京海上ホールディングス	834,100	2,221	1,852,536,100	
Ｔ＆Ｄホールディングス	800,700	930	744,651,000	
クレディセゾン	179,400	1,526	273,764,400	
芙蓉総合リース	22,000	2,922	64,284,000	
興銀リース	32,200	1,956	62,983,200	
東京センチュリーリース	59,000	1,602	94,518,000	
日本証券金融	97,700	495	48,361,500	
大阪証券金融	42,800	192	8,217,600	
ポケットカード	31,700	285	9,034,500	
リコーリース	16,700	1,994	33,299,800	
イオンクレジットサービス	97,600	1,159	113,118,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
アコム	46,130	1,561	72,008,930	
ジャックス	145,000	279	40,455,000	
オリエントコーポレーション	355,000	90	31,950,000	
日立キャピタル	45,700	1,236	56,485,200	
オリックス	114,300	7,740	884,682,000	

三菱ＵＦＪリース	55,720	3,535	196,970,200	
アサックス	60	91,900	5,514,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	9,800	1,307	12,808,600	
日本駐車場開発	2,709	3,845	10,416,105	
昭栄	43,200	356	15,379,200	
東京建物不動産販売	13,200	256	3,379,200	
野村不動産ホールディングス	105,300	1,427	150,263,100	
常和ホールディングス	4,700	1,489	6,998,300	
ヒューリック	72,300	1,050	75,915,000	
パーク２４	113,600	991	112,577,600	
三井不動産	975,000	1,548	1,509,300,000	
三菱地所	1,538,000	1,459	2,243,942,000	
平和不動産	213,500	214	45,689,000	
東京建物	419,000	323	135,337,000	
ダイビル	66,700	587	39,152,900	
サンケイビル	41,800	739	30,890,200	
東急不動産	442,000	397	175,474,000	
京阪神ビルディング	29,200	400	11,680,000	
住友不動産	526,000	1,884	990,984,000	
東宝不動産	25,300	539	13,636,700	
大京	344,000	207	71,208,000	
テーオーシー	88,000	425	37,400,000	
東京楽天地	40,000	296	11,840,000	
フジ住宅	30,900	426	13,163,400	
空港施設	25,900	397	10,282,300	
明和地所	13,700	430	5,891,000	
住友不動産販売	8,250	3,690	30,442,500	
ゴールドクレスト	20,570	1,594	32,788,580	
東栄住宅	16,300	849	13,838,700	
リロ・ホールディング	7,600	2,244	17,054,400	
日本エスリード	10,100	809	8,170,900	
東急リバブル	21,500	762	16,383,000	
飯田産業	22,500	704	15,840,000	
日神不動産	15,300	539	8,246,700	
アーネストワン	37,600	947	35,607,200	
タカラレーベン	27,600	569	15,704,400	
サンヨーハウジング名古屋	108	77,200	8,337,600	
イオンモール	100,200	1,839	184,267,800	
フージャースコーポレーション	362	55,700	20,163,400	

タクトホーム	133	73,900	9,828,700	
トーセイ	258	28,080	7,244,640	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,365	64,800	88,452,000	
ランドビジネス	223	16,500	3,679,500	
グランディハウス	68	66,900	4,549,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日本空港ビルデング	70,100	1,134	79,493,400	
日本工営	79,000	289	22,831,000	
ネクスト	9,300	375	3,487,500	
日本M＆Aセンター	47	399,500	18,776,500	
ノバレーゼ	55	52,000	2,860,000	
アコーディア・ゴルフ	956	62,400	59,654,400	
パソナグループ	235	73,100	17,178,500	
リンクアンドモチベーション	52	49,600	2,579,200	
エス・エム・エス	36	74,300	2,674,800	
テンプホールディングス	32,100	751	24,107,100	
クックパッド	3,400	1,669	5,674,600	
学情	8,500	265	2,252,500	
スタジオアリス	11,200	1,205	13,496,000	
シミックホールディングス	7,800	1,201	9,367,800	
ＮＥＣフィールディング	18,900	1,043	19,712,700	
綜合警備保障	84,600	957	80,962,200	
カカクコム	36,100	2,356	85,051,600	
ルネサンス	11,700	457	5,346,900	
エムスリー	183	309,500	56,638,500	
ベストブライダル	59	81,000	4,779,000	
ディー・エヌ・エー	104,200	2,600	270,920,000	
博報堂ＤＹホールディングス	29,540	4,935	145,779,900	
ぐるなび	16,800	938	15,758,400	
一休	167	37,150	6,204,050	
ジャパンベストレスキューシステム	37	74,500	2,756,500	
ジェイコムホールディングス	4,400	703	3,093,200	
ＰＧＭホールディングス	339	53,100	18,000,900	
イーピーエス	127	174,300	22,136,100	
アミューズ	7,000	1,103	7,721,000	
ドリームインキュベータ	77	72,700	5,597,900	

ＴＡＣ	15,800	210	3,318,000	
ケネディクス	2,623	15,120	39,659,760	
電通	211,500	2,462	520,713,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,080	7,060	7,624,800	
イオンファンタジー	8,000	1,307	10,456,000	
みらかホールディングス	60,700	3,080	186,956,000	
アルプス技研	10,600	628	6,656,800	
サニックス	36,500	235	8,577,500	
ダイオーズ	4,700	499	2,345,300	
日本空調サービス	6,100	740	4,514,000	
オリエンタルランド	62,800	8,280	519,984,000	
ダスキン	69,900	1,660	116,034,000	
明光ネットワークジャパン	21,900	779	17,060,100	
ファルコＳＤホールディングス	13,200	935	12,342,000	
秀英予備校	6,000	312	1,872,000	
田谷	4,400	708	3,115,200	
ラウンドワン	73,700	548	40,387,600	
リゾートトラスト	36,700	1,261	46,278,700	
ビー・エム・エル	15,400	2,011	30,969,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ワタベウェディング	7,700	725	5,582,500	
もしもしホットライン	38,800	810	31,428,000	
東急コミュニティー	6,200	2,536	15,723,200	
リソー教育	2,471	5,310	13,121,010	
ウェアハウス	6,200	246	1,525,200	
ユー・エス・エス	30,310	7,910	239,752,100	
東京個別指導学院	14,800	175	2,590,000	
テー・オー・ダブリュー	7,500	484	3,630,000	
セントラルスポーツ	7,700	1,078	8,300,600	
リゾートソリューション	23,000	174	4,002,000	
エイチ・アイ・エス	24,000	2,124	50,976,000	
共立メンテナンス	11,900	1,624	19,325,600	
イチネンホールディングス	25,000	444	11,100,000	
建設技術研究所	13,300	527	7,009,100	
燦ホールディングス	5,400	1,613	8,710,200	
スバル興業	25,000	273	6,825,000	

東京テアトル	94,000	124	11,656,000	
よみうりランド	49,000	261	12,789,000	
東京都競馬	184,000	125	23,000,000	
カナモト	30,000	920	27,600,000	
東京ドーム	188,000	226	42,488,000	
トランス・コスモス	30,400	1,042	31,676,800	
乃村工藝社	47,000	284	13,348,000	
藤田観光	61,000	285	17,385,000	
日本管財	8,700	1,504	13,084,800	
トーカイ	9,700	1,633	15,840,100	
白洋舎	27,000	217	5,859,000	
セコム	225,700	3,775	852,017,500	
セントラル警備保障	10,600	790	8,374,000	
丹青社	46,000	232	10,672,000	
メイテック	36,600	1,674	61,268,400	
アサツー ディ・ケイ	40,600	2,255	91,553,000	
応用地質	24,700	1,012	24,996,400	
船井総合研究所	24,300	540	13,122,000	
進学会	13,000	323	4,199,000	
ベネッセホールディングス	72,000	3,685	265,320,000	
イオンディライト	26,400	1,512	39,916,800	
ナック	6,600	1,503	9,919,800	
ニチイ学館	46,100	950	43,795,000	
ダイセキ	37,600	1,449	54,482,400	
合計	337,140,796	―	253,618,909,875	

（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。

② 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表

該当事項はありません。

⑤ 商品明細表
該当事項はありません。

⑥ 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

⑦ その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表
該当事項はありません。

次へ

「中央三井日本債券マザーファンド」の状況

（１）貸借対照表

項目	平成24年２月27日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,421,173,966
国債証券	273,913,382,400
地方債証券	22,899,247,557
特殊債券	34,318,260,060
社債券	24,453,976,000
派生商品評価勘定	739,710
未収入金	2,118,340,000
未収利息	1,433,385,900
前払金	2,050,000
前払費用	50,748,537
流動資産合計	365,611,304,130
資産合計	365,611,304,130
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,099,400
未払金	2,099,748,000
未払解約金	941,288,462
流動負債合計	3,044,135,862
負債合計	3,044,135,862
純資産の部	
元本等	
元本	301,931,445,641
剰余金	
剰余金	60,635,722,627
純資産合計	362,567,168,268
負債・純資産合計	365,611,304,130

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成24年２月27日現在
１．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。

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

（貸借対照表に関する注記）

	平成24年２月27日現在
１．担保に供している資産	先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。 国債証券　51,758,000 円 なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおります。
２．計算日における受益権総数	301,931,445,641 口
３．１口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	1.2008 円 （ 12,008 円）

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

平成24年２月27日現在
１．金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスク、信用リスク及び流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。

３．金融商品に係るリスク管理体制

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

平成24年２月27日現在
１．貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２．時価の算定方法 （１）国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 （２）デリバティブ取引 「（その他の注記）」の「３．デリバティブ取引関係」に記載しております。 （３）コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 ３．金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 ４．金銭債権の計算日後の償還予定額 金銭債権は全て１年以内に償還予定であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

平成24年２月27日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

平成24年２月27日現在
該当事項はありません。

（その他の注記）

１．元本の変動

平成24年２月27日現在	
特定期間／計算期間の期首元本額	298,210,760,566 円

特定期間／計算期間中の追加設定元本額	40,355,592,898 円
特定期間／計算期間中の一部解約元本額	36,634,907,823 円
計算日の元本額	301,931,445,641 円
計算日の元本額の内訳	
中央三井日本債券インデックスファンド	10,550,038,765 円
中央三井ＤＣ日本債券インデックスファンド	2,019,976,798 円
中央三井ＤＣ日本債券インデックスファンドＬ	21,647,693,233 円
中央三井ＤＣバランスファンド３０	809,578,685 円
中央三井ＤＣバランスファンド５０	802,976,834 円
中央三井ＤＣバランスファンド７０	200,669,897 円
ベスタ・世界６資産ファンド（毎月決算型）	163,370,048 円
ベスタ・世界６資産ファンド（１年決算型）	102,454,284 円
中央三井日本債券インデックスファンド（ＳＭＡ専用）	4,883,211,192 円
新生・４分散ファンド	129,880,177 円
４資産インデックスバランスオープン（分配型）	42,742,867 円
４資産インデックスバランスオープン（成長型）	126,441,456 円
日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）	232,885,213 円
ＣＭＡＭ日本債券インデックスｅ	388,062,321 円
中央三井インデックスコレクション（国内債券）	1,764,698,377 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式３０）	805,328,020 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式５０）	762,946,410 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式７０）	296,981,894 円
中央三井バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	9,838,554,447 円
中央三井バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	31,054,075,371 円
中央三井ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	27,841,077,206 円
中央三井ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	1,472,969,191 円
中央三井ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	7,190,944,181 円
中央三井バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	10,660,748,187 円
中央三井バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	2,356,277,917 円
中央三井バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	24,144,887,716 円
中央三井バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	243,480,998 円
中央三井ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	29,874,037,167 円
中央三井ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	7,061,252,638 円
中央三井ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	650,978,839 円
中央三井バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	3,216,180,478 円
中央三井ＶＡバランス株式４０（適格機関投資家専用）	1,675,769,851 円
ＣＭＡＭ・バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	4,900,034,121 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）	1,015,900,635 円
ＣＭＡＭ・ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	1,836,009,485 円
中央三井バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	4,694,915,228 円
中央三井ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	4,266,184,097 円
ＣＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	6,490,394,099 円
中央三井バランスＶＡ２０Ｌ（適格機関投資家専用）	624,023,625 円
中央三井バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	3,922,098,290 円
ＣＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	47,604,323,199 円
中央三井世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	1,236,740,498 円
中央三井国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	330,201,129 円

中央三井国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	137,958,454 円
ＣＭＡＭ・ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	1,065,916,921 円
私募日本債券インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	9,053,924 円
ＣＭＡＭ私募日本債券インデックスファンド（適格機関投資家専用）	20,764,417,199 円
中央三井世界バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	22,104,079 円

２．有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成24年２月27日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	200,489,500
地方債証券	20,473,855
特殊債券	26,935,876
社債券	77,671,000
合計	325,570,231

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「中央三井日本債券マザーファンド」の期首から計算日までの期間（平成24年１月24日から平成24年２月27日まで）に対応するものです。

３．デリバティブ取引関係

Ⅰ．ヘッジ会計が適用されていないもの

債券関連

区分	種類	平成24年２月27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	3,850,669,690	―	3,848,310,000	△2,359,690
合計		3,850,669,690	―	3,848,310,000	△2,359,690

（注）１．時価の算定方法

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

２．債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年２月27日現在
該当事項はありません。

次へ

（３）附属明細表（平成24年２月27日現在）

① 有価証券明細表

Ａ．株式

該当事項はありません。

Ｂ．株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	利付国庫債券（２年）第３０２回	1,500,000,000	1,501,470,000	
	利付国庫債券（２年）第３０３回	2,300,000,000	2,302,438,000	
	利付国庫債券（２年）第３０４回	500,000,000	500,570,000	
	利付国庫債券（２年）第３０５回	1,800,000,000	1,802,196,000	
	利付国庫債券（２年）第３０６回	600,000,000	600,822,000	
	利付国庫債券（２年）第３０７回	2,400,000,000	2,403,312,000	
	利付国庫債券（２年）第３０８回	600,000,000	599,952,000	
	利付国庫債券（２年）第３０９回	2,900,000,000	2,899,739,000	
	利付国庫債券（２年）第３１０回	1,200,000,000	1,201,944,000	
	利付国庫債券（２年）第３１１回	1,300,000,000	1,302,197,000	
	利付国庫債券（２年）第３１２回	400,000,000	399,960,000	
	利付国庫債券（２年）第３１３回	2,100,000,000	2,099,790,000	
	利付国庫債券（５年）第７０回	1,700,000,000	1,712,410,000	
	利付国庫債券（５年）第７１回	2,100,000,000	2,126,355,000	
	利付国庫債券（５年）第７２回	1,200,000,000	1,221,792,000	
	利付国庫債券（５年）第７３回	1,200,000,000	1,218,672,000	
	利付国庫債券（５年）第７４回	1,300,000,000	1,315,145,000	
	利付国庫債券（５年）第７５回	600,000,000	609,270,000	
	利付国庫債券（５年）第７６回	1,800,000,000	1,830,618,000	
	利付国庫債券（５年）第７７回	1,100,000,000	1,115,290,000	
	利付国庫債券（５年）第７８回	700,000,000	710,024,000	
	利付国庫債券（５年）第７９回	1,700,000,000	1,718,224,000	
	利付国庫債券（５年）第８０回	1,300,000,000	1,316,276,000	
	利付国庫債券（５年）第８１回	1,700,000,000	1,724,191,000	
	利付国庫債券（５年）第８２回	2,100,000,000	2,134,167,000	
	利付国庫債券（５年）第８３回	2,000,000,000	2,036,300,000	
	利付国庫債券（５年）第８４回	1,800,000,000	1,824,390,000	
	利付国庫債券（５年）第８５回	2,100,000,000	2,131,038,000	
	利付国庫債券（５年）第８６回	2,100,000,000	2,125,683,000	
	利付国庫債券（５年）第８７回	4,100,000,000	4,142,394,000	
	利付国庫債券（５年）第８８回	2,800,000,000	2,829,764,000	
	利付国庫債券（５年）第８９回	2,400,000,000	2,417,736,000	
	利付国庫債券（５年）第９０回	1,900,000,000	1,907,790,000	
	利付国庫債券（５年）第９１回	1,000,000,000	1,007,230,000	
	利付国庫債券（５年）第９２回	2,000,000,000	2,007,400,000	
	利付国庫債券（５年）第９３回	2,300,000,000	2,324,288,000	
	利付国庫債券（５年）第９４回	2,000,000,000	2,028,680,000	
	利付国庫債券（５年）第９５回	1,900,000,000	1,927,056,000	
	利付国庫債券（５年）第９６回	2,400,000,000	2,424,552,000	
	利付国庫債券（５年）第９７回	1,600,000,000	1,609,184,000	
	利付国庫債券（５年）第９８回	2,000,000,000	2,002,960,000	
	利付国庫債券（５年）第９９回	2,400,000,000	2,412,408,000	
	利付国庫債券（５年）第１００回	2,000,000,000	2,001,340,000	
	利付国庫債券（５年）第１０１回	1,800,000,000	1,808,514,000	
	利付国庫債券（５年）第１０２回	1,200,000,000	1,200,000,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	利付国庫債券（４０年）第１回	400,000,000	433,060,000	
	利付国庫債券（４０年）第２回	600,000,000	616,350,000	

	利付国庫債券（４０年）第３回	600,000,000	612,690,000	
	利付国庫債券（４０年）第４回	600,000,000	609,600,000	
	利付国庫債券（１０年）第２４７回	910,000,000	916,643,000	
	利付国庫債券（１０年）第２４８回	170,000,000	171,062,500	
	利付国庫債券（１０年）第２４９回	760,000,000	763,952,000	
	利付国庫債券（１０年）第２５０回	600,000,000	603,120,000	
	利付国庫債券（１０年）第２５１回	770,000,000	778,015,700	
	利付国庫債券（１０年）第２５２回	730,000,000	738,555,600	
	利付国庫債券（１０年）第２５３回	1,350,000,000	1,381,347,000	
	利付国庫債券（１０年）第２５４回	520,000,000	530,457,200	
	利付国庫債券（１０年）第２５５回	710,000,000	725,385,700	
	利付国庫債券（１０年）第２５６回	1,040,000,000	1,064,356,800	
	利付国庫債券（１０年）第２５７回	400,000,000	408,648,000	
	利付国庫債券（１０年）第２５８回	480,000,000	491,793,600	
	利付国庫債券（１０年）第２５９回	1,180,000,000	1,213,818,800	
	利付国庫債券（１０年）第２６０回	860,000,000	889,549,600	
	利付国庫債券（１０年）第２６１回	790,000,000	820,778,400	
	利付国庫債券（１０年）第２６２回	730,000,000	760,112,500	
	利付国庫債券（１０年）第２６３回	750,000,000	778,282,500	
	利付国庫債券（１０年）第２６４回	1,330,000,000	1,376,762,800	（注）
	利付国庫債券（１０年）第２６５回	730,000,000	757,951,700	
	利付国庫債券（１０年）第２６６回	560,000,000	579,880,000	
	利付国庫債券（１０年）第２６７回	410,000,000	423,407,000	
	利付国庫債券（１０年）第２６８回	1,200,000,000	1,249,212,000	
	利付国庫債券（１０年）第２６９回	1,740,000,000	1,800,778,200	
	利付国庫債券（１０年）第２７０回	1,600,000,000	1,659,392,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７１回	1,400,000,000	1,447,376,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７２回	1,500,000,000	1,563,825,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７３回	1,000,000,000	1,046,080,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７４回	900,000,000	943,650,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７５回	1,200,000,000	1,253,664,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７６回	800,000,000	841,816,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７７回	1,600,000,000	1,687,312,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７８回	700,000,000	743,820,000	
	利付国庫債券（１０年）第２７９回	700,000,000	749,434,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８０回	1,500,000,000	1,605,045,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８１回	1,000,000,000	1,074,060,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８２回	1,800,000,000	1,915,416,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８３回	1,400,000,000	1,496,068,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８４回	2,950,000,000	3,146,381,500	
	利付国庫債券（１０年）第２８５回	3,400,000,000	3,634,158,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８６回	1,700,000,000	1,829,302,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８７回	1,700,000,000	1,838,159,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８８回	3,000,000,000	3,217,200,000	
	利付国庫債券（１０年）第２８９回	2,900,000,000	3,080,989,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９０回	600,000,000	634,140,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９１回	1,300,000,000	1,366,300,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９２回	800,000,000	859,928,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	利付国庫債券（１０年）第２９３回	1,700,000,000	1,839,553,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９４回	1,200,000,000	1,291,152,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９５回	700,000,000	744,366,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９６回	1,800,000,000	1,914,264,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９７回	1,200,000,000	1,268,568,000	
	利付国庫債券（１０年）第２９８回	1,300,000,000	1,365,741,000	

	利付国庫債券（１０年）第２９９回	1,100,000,000	1,154,824,000	
	利付国庫債券（１０年）第３００回	1,400,000,000	1,489,278,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０１回	900,000,000	957,681,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０２回	1,800,000,000	1,902,744,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０３回	1,200,000,000	1,267,560,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０４回	1,400,000,000	1,468,180,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０５回	3,300,000,000	3,455,463,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０６回	1,900,000,000	2,000,605,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０７回	2,200,000,000	2,299,726,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０８回	1,400,000,000	1,460,186,000	
	利付国庫債券（１０年）第３０９回	1,900,000,000	1,951,205,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１０回	1,300,000,000	1,321,346,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１１回	2,000,000,000	2,000,000,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１２回	3,700,000,000	3,813,886,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１３回	2,800,000,000	2,903,460,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１４回	1,900,000,000	1,937,468,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１５回	2,600,000,000	2,666,950,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１６回	1,400,000,000	1,423,422,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１７回	1,800,000,000	1,825,236,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１８回	2,700,000,000	2,713,014,000	
	利付国庫債券（１０年）第３１９回	800,000,000	809,672,000	
	利付国庫債券（１０年）第３２０回	1,300,000,000	1,303,484,000	
	利付国庫債券（３０年）第１回	50,000,000	58,504,000	
	利付国庫債券（３０年）第２回	100,000,000	110,781,000	
	利付国庫債券（３０年）第３回	330,000,000	360,046,500	
	利付国庫債券（３０年）第４回	190,000,000	225,421,700	
	利付国庫債券（３０年）第５回	180,000,000	193,176,000	
	利付国庫債券（３０年）第６回	270,000,000	298,576,800	
	利付国庫債券（３０年）第７回	190,000,000	206,997,400	
	利付国庫債券（３０年）第８回	370,000,000	371,117,400	
	利付国庫債券（３０年）第９回	180,000,000	167,956,200	
	利付国庫債券（３０年）第１０回	170,000,000	149,549,000	
	利付国庫債券（３０年）第１１回	310,000,000	304,990,400	
	利付国庫債券（３０年）第１２回	370,000,000	389,658,100	
	利付国庫債券（３０年）第１３回	250,000,000	258,637,500	
	利付国庫債券（３０年）第１４回	350,000,000	387,121,000	
	利付国庫債券（３０年）第１５回	440,000,000	494,920,800	
	利付国庫債券（３０年）第１６回	250,000,000	281,232,500	
	利付国庫債券（３０年）第１７回	430,000,000	475,558,500	
	利付国庫債券（３０年）第１８回	660,000,000	717,855,600	
	利付国庫債券（３０年）第１９回	270,000,000	293,608,800	
	利付国庫債券（３０年）第２０回	140,000,000	157,382,400	
	利付国庫債券（３０年）第２１回	420,000,000	456,132,600	
	利付国庫債券（３０年）第２２回	300,000,000	337,512,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	利付国庫債券（３０年）第２３回	400,000,000	450,000,000	
	利付国庫債券（３０年）第２４回	200,000,000	224,990,000	
	利付国庫債券（３０年）第２５回	700,000,000	758,716,000	
	利付国庫債券（３０年）第２６回	700,000,000	772,513,000	
	利付国庫債券（３０年）第２７回	900,000,000	1,012,041,000	
	利付国庫債券（３０年）第２８回	900,000,000	1,012,626,000	
	利付国庫債券（３０年）第２９回	900,000,000	994,338,000	
	利付国庫債券（３０年）第３０回	900,000,000	975,654,000	
	利付国庫債券（３０年）第３１回	1,400,000,000	1,486,716,000	
	利付国庫債券（３０年）第３２回	1,200,000,000	1,298,520,000	

	利付国庫債券（３０年）第３３回	1,500,000,000	1,523,535,000	
	利付国庫債券（３０年）第３４回	1,400,000,000	1,481,382,000	
	利付国庫債券（３０年）第３５回	1,500,000,000	1,518,330,000	
	利付国庫債券（２０年）第２１回	40,000,000	42,351,600	
	利付国庫債券（２０年）第２２回	170,000,000	179,280,300	
	利付国庫債券（２０年）第２３回	130,000,000	140,895,300	
	利付国庫債券（２０年）第２４回	160,000,000	175,072,000	
	利付国庫債券（２０年）第２５回	80,000,000	86,552,800	
	利付国庫債券（２０年）第２６回	50,000,000	55,585,500	
	利付国庫債券（２０年）第２７回	410,000,000	461,036,800	
	利付国庫債券（２０年）第２８回	110,000,000	126,245,900	
	利付国庫債券（２０年）第２９回	100,000,000	114,195,000	
	利付国庫債券（２０年）第３０回	200,000,000	224,854,000	
	利付国庫債券（２０年）第３１回	280,000,000	316,780,800	
	利付国庫債券（２０年）第３２回	80,000,000	91,152,000	
	利付国庫債券（２０年）第３３回	430,000,000	498,537,700	
	利付国庫債券（２０年）第３４回	70,000,000	81,207,700	
	利付国庫債券（２０年）第３５回	270,000,000	310,540,500	
	利付国庫債券（２０年）第３７回	410,000,000	471,319,600	
	利付国庫債券（２０年）第３９回	640,000,000	722,553,600	
	利付国庫債券（２０年）第４０回	450,000,000	501,417,000	
	利付国庫債券（２０年）第４１回	620,000,000	659,314,200	
	利付国庫債券（２０年）第４２回	380,000,000	433,469,800	
	利付国庫債券（２０年）第４３回	340,000,000	396,667,800	
	利付国庫債券（２０年）第４４回	370,000,000	421,245,000	
	利付国庫債券（２０年）第４５回	470,000,000	531,913,100	
	利付国庫債券（２０年）第４６回	290,000,000	323,268,800	
	利付国庫債券（２０年）第４７回	470,000,000	524,176,900	
	利付国庫債券（２０年）第４８回	230,000,000	262,280,500	
	利付国庫債券（２０年）第４９回	280,000,000	309,954,400	
	利付国庫債券（２０年）第５０回	590,000,000	642,639,800	
	利付国庫債券（２０年）第５１回	240,000,000	263,234,400	
	利付国庫債券（２０年）第５２回	430,000,000	475,416,600	
	利付国庫債券（２０年）第５３回	350,000,000	386,970,500	
	利付国庫債券（２０年）第５４回	280,000,000	312,233,600	
	利付国庫債券（２０年）第５５回	490,000,000	536,971,400	
	利付国庫債券（２０年）第５６回	410,000,000	449,347,700	
	利付国庫債券（２０年）第５７回	360,000,000	390,628,800	
	利付国庫債券（２０年）第５８回	350,000,000	379,711,500	
	利付国庫債券（２０年）第５９回	440,000,000	467,979,600	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	利付国庫債券（２０年）第６０回	570,000,000	588,787,200	
	利付国庫債券（２０年）第６１回	390,000,000	385,963,500	
	利付国庫債券（２０年）第６２回	250,000,000	241,367,500	
	利付国庫債券（２０年）第６３回	770,000,000	825,016,500	
	利付国庫債券（２０年）第６４回	410,000,000	443,173,100	
	利付国庫債券（２０年）第６５回	370,000,000	399,255,900	
	利付国庫債券（２０年）第６６回	540,000,000	576,779,400	
	利付国庫債券（２０年）第６７回	560,000,000	603,176,000	
	利付国庫債券（２０年）第６８回	230,000,000	255,426,500	
	利付国庫債券（２０年）第６９回	260,000,000	285,841,400	
	利付国庫債券（２０年）第７０回	400,000,000	452,916,000	
	利付国庫債券（２０年）第７１回	700,000,000	776,713,000	
	利付国庫債券（２０年）第７２回	1,120,000,000	1,227,979,200	
	利付国庫債券（２０年）第７３回	440,000,000	476,423,200	

	利付国庫債券（２０年）第７４回	310,000,000	339,273,300	
	利付国庫債券（２０年）第７５回	360,000,000	393,451,200	
	利付国庫債券（２０年）第７６回	630,000,000	674,055,900	
	利付国庫債券（２０年）第７７回	310,000,000	335,147,200	
	利付国庫債券（２０年）第７８回	200,000,000	213,488,000	
	利付国庫債券（２０年）第７９回	300,000,000	323,817,000	
	利付国庫債券（２０年）第８０回	350,000,000	381,972,500	
	利付国庫債券（２０年）第８１回	920,000,000	991,934,800	
	利付国庫債券（２０年）第８２回	510,000,000	556,058,100	
	利付国庫債券（２０年）第８３回	530,000,000	576,926,200	
	利付国庫債券（２０年）第８４回	600,000,000	645,756,000	
	利付国庫債券（２０年）第８５回	750,000,000	815,475,000	
	利付国庫債券（２０年）第８６回	270,000,000	300,294,000	
	利付国庫債券（２０年）第８７回	500,000,000	549,545,000	
	利付国庫債券（２０年）第８８回	400,000,000	444,224,000	
	利付国庫債券（２０年）第８９回	1,000,000,000	1,097,950,000	
	利付国庫債券（２０年）第９０回	900,000,000	985,869,000	
	利付国庫債券（２０年）第９１回	600,000,000	665,292,000	
	利付国庫債券（２０年）第９２回	1,100,000,000	1,188,594,000	
	利付国庫債券（２０年）第９３回	700,000,000	745,724,000	
	利付国庫債券（２０年）第９４回	800,000,000	863,176,000	
	利付国庫債券（２０年）第９５回	500,000,000	552,190,000	
	利付国庫債券（２０年）第９６回	400,000,000	430,944,000	
	利付国庫債券（２０年）第９７回	700,000,000	762,762,000	
	利付国庫債券（２０年）第９８回	600,000,000	645,402,000	
	利付国庫債券（２０年）第９９回	1,400,000,000	1,503,474,000	
	利付国庫債券（２０年）第１００回	900,000,000	977,706,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０１回	500,000,000	557,495,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０２回	400,000,000	445,408,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０３回	400,000,000	439,900,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０４回	700,000,000	750,106,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０５回	1,100,000,000	1,176,604,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０６回	300,000,000	325,263,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０７回	500,000,000	534,170,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０８回	1,200,000,000	1,246,848,000	
	利付国庫債券（２０年）第１０９回	700,000,000	726,187,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	利付国庫債券（２０年）第１１０回	700,000,000	746,886,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１１回	600,000,000	648,342,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１２回	1,100,000,000	1,172,149,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１３回	1,100,000,000	1,170,565,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１４回	1,500,000,000	1,593,990,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１５回	900,000,000	970,119,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１６回	600,000,000	645,900,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１７回	1,400,000,000	1,485,554,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１８回	800,000,000	835,832,000	
	利付国庫債券（２０年）第１１９回	400,000,000	405,300,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２０回	600,000,000	589,152,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２１回	600,000,000	616,488,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２２回	1,400,000,000	1,415,750,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２３回	1,100,000,000	1,164,350,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２４回	600,000,000	625,200,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２５回	900,000,000	966,141,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２６回	700,000,000	728,644,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２７回	800,000,000	820,072,000	

	利付国庫債券（２０年）第１２８回	900,000,000	920,808,000	
	利付国庫債券（２０年）第１２９回	700,000,000	705,047,000	
	利付国庫債券（２０年）第１３０回	1,100,000,000	1,107,205,000	
	利付国庫債券（２０年）第１３１回	500,000,000	494,915,000	
	利付国庫債券（２０年）第１３２回	600,000,000	593,400,000	
	利付国庫債券（２０年）第１３３回	600,000,000	603,522,000	
国債証券 小計		262,810,000,000	273,913,382,400	
地方債証券	東京都公募公債第５９８回	103,000,000	103,461,440	
	東京都公募公債第６０２回	200,000,000	204,082,000	
	東京都公募公債第６０５回	100,000,000	102,347,000	
	東京都公募公債第６０８回	100,000,000	102,912,000	
	東京都公募公債第６０９回	200,000,000	205,578,000	
	東京都公募公債第６１３回	100,000,000	103,529,000	
	東京都公募公債第６１６回	100,000,000	103,408,000	
	東京都公募公債第６１７回	100,000,000	103,380,000	
	東京都公募公債第６１９回	100,000,000	104,026,000	
	東京都公募公債第６２４回	100,000,000	104,167,000	
	東京都公募公債第６２５回	100,000,000	104,088,000	
	東京都公募公債第６２６回	100,000,000	104,758,000	
	東京都公募公債第６２７回	100,000,000	104,476,000	
	東京都公募公債第６２８回	100,000,000	104,972,000	
	東京都公募公債第６３７回	180,000,000	191,970,000	
	東京都公募公債第６４２回	100,000,000	107,074,000	
	東京都公募公債第６４６回	100,000,000	108,294,000	
	東京都公募公債第６４７回	100,000,000	108,190,000	
	東京都公募公債第６５６回	100,000,000	106,002,000	
	東京都公募公債第６５７回	100,000,000	107,799,000	
	東京都公募公債第６５９回	100,000,000	106,720,000	
	東京都公募公債第６６８回	100,000,000	106,256,000	
	東京都公募公債第６８１回	100,000,000	104,817,000	
	東京都公募公債第６８２回	100,000,000	104,171,000	
	東京都公募公債第６９２回	100,000,000	103,840,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
地方債証券	東京都公募公債（２０年）第３回	100,000,000	110,755,000	
	東京都公募公債（２０年）第１１回	200,000,000	216,614,000	
	東京都公募公債（２０年）第１８回	200,000,000	214,320,000	
	東京都公募公債（２０年）第２０回	100,000,000	104,928,000	
	東京都公募公債（２０年）第２１回	100,000,000	106,264,000	
	北海道平成１７年度第１回公募公債	100,000,000	103,448,000	
	北海道平成１９年度第１４回公募公債（１０年）	100,000,000	106,481,000	
	北海道平成２０年度第１４回公募公債	100,000,000	107,011,000	
	北海道平成２０年度第１５回公募公債（５年）	100,000,000	101,940,000	
	北海道平成２１年度第６回公募公債	100,000,000	105,959,000	
	北海道平成２２年度第１回公募公債	100,000,000	104,616,000	
	神奈川県第１２６回公募公債	100,000,000	102,863,000	
	神奈川県第１２７回公募公債	100,000,000	103,902,000	
	神奈川県第１３０回公募公債	100,000,000	103,466,000	
	神奈川県第１３４回公募公債	100,000,000	103,964,000	
	神奈川県第１３５回公募公債	100,000,000	104,827,000	
	神奈川県第１４３回公募公債	150,000,000	160,038,000	
	神奈川県第１４４回公募公債	100,000,000	106,976,000	
	神奈川県第１６２回公募公債	100,000,000	106,731,000	
	神奈川県第１６８回公募公債	100,000,000	104,578,000	
	神奈川県第１７３回公募公債	100,000,000	103,732,000	
	神奈川県第１７４回公募公債	100,000,000	102,721,000	

	神奈川県第１７５回公募公債	100,000,000	102,060,000	
	神奈川県第１６回２０年公募公債	100,000,000	104,097,000	
	第２５４回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	100,454,000	
	第２６７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,148,000	
	第２７５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,044,000	
	第２８５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	104,359,000	
	第２８６回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	104,407,000	
	第２９３回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	107,520,000	
	第２９８回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	107,086,000	
	第３０５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	107,717,000	
	第３０９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	106,331,000	
	第３２４回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	106,414,000	
	第３３１回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	104,558,000	
	第３３４回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	104,832,000	
	第３３５回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	104,873,000	
	第３３９回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,764,000	
	第５０回大阪府公募公債（５年）	100,000,000	101,562,000	
	京都府平成１７年度第３回公募公債	100,000,000	104,606,000	
	京都府平成２０年度第６回公募公債	100,000,000	105,754,000	
	京都府平成２１年度第４回公募公債	100,000,000	101,093,000	
	京都府平成２１年度第５回公募公債	100,000,000	104,471,000	
	京都府平成２２年度第４回公募公債	100,000,000	100,773,000	
	兵庫県平成１６年度第１０回公募公債	100,000,000	103,405,000	
	兵庫県平成１７年度第３回公募公債	100,000,000	103,243,000	
	兵庫県平成１８年度第３回公募公債	110,000,000	117,474,500	
	兵庫県平成１８年度第８回公募公債	100,000,000	107,541,000	
	兵庫県平成１８年度第１０回公募公債	100,000,000	107,454,000	
	兵庫県平成２１年度第１回公募公債	100,000,000	106,337,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
地方債証券	兵庫県平成２１年度第３５回公募公債	100,000,000	104,865,000	
	静岡県平成１５年度第３回公募公債	100,000,000	102,043,000	
	静岡県平成１７年度第７回公募公債	100,000,000	105,601,000	
	静岡県平成１９年度第４回公募公債	100,000,000	108,139,000	
	静岡県平成１９年度第７回公募公債	100,000,000	107,592,000	
	静岡県平成２１年度第５回公募公債	100,000,000	104,637,000	
	静岡県平成２２年度第３回公募公債	100,000,000	104,434,000	
	静岡県平成２３年度１回公募公債	100,000,000	103,791,000	
	愛知県平成１７年度第１回公募公債（１０年）	100,000,000	103,688,000	
	愛知県平成１８年度第４回公募公債（１０年）	129,000,000	137,563,020	
	愛知県平成２０年度第６回公募公債（１０年）	100,000,000	107,271,000	
	愛知県平成２０年度第１０回公募公債（１０年）	100,000,000	105,758,000	
	愛知県平成２１年度第１回公募公債（１０年）	100,000,000	106,649,000	
	愛知県平成２２年度第１回公募公債（１０年）	100,000,000	104,771,000	
	愛知県平成２２年度第５回公募公債（１０年）	100,000,000	103,377,000	
	愛知県平成２２年度第１４回公募公債（２０年）	100,000,000	104,095,000	
	愛知県平成２３年度第４回公募公債（１０年）	100,000,000	101,814,000	
	広島県平成１６年度第１回公募公債	100,000,000	103,213,000	
	広島県平成２０年度第６回公募公債	100,000,000	105,682,000	
	埼玉県平成１５年度第５回公募公債	100,000,000	102,354,000	
	埼玉県平成１９年度第２回公募公債	100,000,000	107,929,000	
	埼玉県平成１９年度第５回公募公債	100,000,000	107,596,000	
	埼玉県平成１９年度第７回公募公債	100,000,000	106,769,000	
	埼玉県平成２０年度第５回公募公債	100,000,000	107,398,000	
	埼玉県平成２１年度第１回公募公債	200,000,000	212,170,000	
	埼玉県平成２１年度第２回公募公債	100,000,000	106,401,000	

	埼玉県平成２２年度第４回公募公債	100,000,000	102,633,000	
	福岡県平成２０年度第５回公募公債	100,000,000	107,000,000	
	福岡県平成２１年度第５回公募公債	100,000,000	104,760,000	
	福岡県平成２２年度第２回１５年公募公債	100,000,000	103,526,000	
	福岡県平成１９年度第１回３０年公募公債	100,000,000	110,954,000	
	福岡県平成２０年度第１回３０年公募公債	200,000,000	208,266,000	
	千葉県平成１５年度第１回公募公債	100,000,000	100,428,000	
	千葉県平成１７年度第７回公募公債	100,000,000	104,616,000	
	千葉県平成１８年度第６回公募公債	175,000,000	186,144,000	
	千葉県平成１８年度第７回公募公債	100,000,000	106,982,000	
	千葉県平成２１年度第１回公募公債	100,000,000	106,090,000	
	千葉県平成２１年度第３回公募公債	100,000,000	106,883,000	
	千葉県平成２２年度第４回公募公債	100,000,000	102,630,000	
	千葉県第８回２０年公募公債	100,000,000	105,849,000	
	新潟県平成１７年度第１回公募公債	100,000,000	103,504,000	
	新潟県平成２０年度第２回公募公債	100,000,000	105,931,000	
	岐阜県平成１８年度第１回公募公債	100,000,000	106,618,000	
	第１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,611,000	
	第５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,081,000	
	第６回共同発行市場公募地方債	155,700,000	159,184,566	
	第９回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,818,000	
	第１１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,246,000	
	第１５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,296,000	
	第１６回共同発行市場公募地方債	127,000,000	131,927,600	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
地方債証券	第１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,004,000	
	第１８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,628,000	
	第１９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,725,000	
	第２０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,560,000	
	第２２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,450,000	
	第２３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,243,000	
	第２４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,920,000	
	第２６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,422,000	
	第２７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,494,000	
	第２９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,961,000	
	第３０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,665,000	
	第３１回共同発行市場公募地方債	150,000,000	156,672,000	
	第３４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,291,000	
	第３５回共同発行市場公募地方債	160,000,000	168,209,600	
	第３８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,018,000	
	第４１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,365,000	
	第４３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,669,000	
	第４８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,563,000	
	第５３回共同発行市場公募地方債	200,000,000	214,752,000	
	第５４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,856,000	
	第５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,075,000	
	第５７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,718,000	
	第６３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,292,000	
	第６５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,669,000	
	第６７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,897,000	
	第７４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,394,000	
	第７５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,883,000	
	第７７回共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,250,000	
	第７８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,963,000	
	第７９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,537,000	

	第８０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,974,000	
	第８２回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,961,000	
	第８３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,085,000	
	第８４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,555,000	
	第８５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,979,000	
	第８７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,661,000	
	第８８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,630,000	
	第９３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,903,000	
	第９４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,719,000	
	第９５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,990,000	
	第９６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,011,000	
	第９７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,751,000	
	第９８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,910,000	
	第９９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,709,000	
	静岡市平成１８年度第１回公募公債	100,000,000	107,214,000	
	大阪市平成１６年度第５回公募公債	100,000,000	103,535,000	
	大阪市平成１７年度第１回公募公債	100,000,000	103,234,000	
	大阪市平成１８年度第３回公募公債	200,000,000	214,688,000	
	大阪市平成２１年度第７回公募公債	100,000,000	104,753,000	
	名古屋市第１２回し号公募公債	100,000,000	103,913,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
地方債証券	名古屋市第１２回せ号公募公債	100,000,000	104,029,000	
	名古屋市第１２回ゆ号公募公債	100,000,000	102,535,000	
	名古屋市第１２回す号公募公債	100,000,000	105,576,000	
	名古屋市第４５５回１０年公募公債	186,700,000	199,195,831	
	名古屋市第４６３回１０年公募公債	100,000,000	108,886,000	
	名古屋市第４６４回１０年公募公債	100,000,000	106,611,000	
	名古屋市第１回２０年公募公債	100,000,000	107,837,000	
	京都市平成１９年度第２回公募公債	100,000,000	107,082,000	
	京都市平成２１年度第５回公募公債	100,000,000	104,962,000	
	京都市平成２２年度第３回公募公債	100,000,000	100,301,000	
	京都市第２回２０年公募公債	100,000,000	107,836,000	
	横浜市平成２０年度第１回公募公債	100,000,000	108,130,000	
	横浜市平成２０年度第６回公募公債	100,000,000	105,979,000	
	横浜市平成２１年度第６回公募公債	100,000,000	104,578,000	
	横浜市平成２２年度第１回公募公債	100,000,000	104,287,000	
	横浜市平成２２年度第３回公募公債	100,000,000	102,495,000	
	横浜市平成２３年度第１回公募公債	100,000,000	101,985,000	
	横浜市平成１５年度第２回公募公債	100,000,000	100,536,000	
	横浜市平成１７年度第３回公募公債	100,000,000	104,736,000	
	横浜市第５回２０年公募公債	100,000,000	108,883,000	
	横浜市第２４回５年公募公債	100,000,000	101,306,000	
	札幌市平成１８年度第４回公募公債	100,000,000	106,509,000	
	札幌市平成２３年度第４回公募公債（１０年）	100,000,000	100,298,000	
	第７９回川崎市公募公債	100,000,000	107,679,000	
	福岡市平成１９年度第３回公募公債	100,000,000	107,770,000	
	福岡市平成１９年度第５回公募公債	100,000,000	105,749,000	
	福岡市平成２０年度第５回公募公債	100,000,000	106,241,000	
	広島市平成１７年度第１回公募公債	100,000,000	104,508,000	
地方債証券 小計		21,826,400,000	22,899,247,557	
特殊債券	政府保証第７回日本政策投資銀行債券	102,000,000	104,338,860	
	政府保証第８回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,064,000	
	政府保証第１０回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,036,000	
	政府保証第１５回日本政策投資銀行債券	210,000,000	228,975,600	
	政府保証第１６回日本政策投資銀行債券	200,000,000	214,204,000	

	政府保証第２１回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,581,000	
	第１３回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,753,000	
	第１６回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,191,000	
	第１９回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,364,000	
	第２４回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,621,000	
	第２９回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,739,000	
	第４１回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,597,000	
	第４７回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,712,000	
	政府保証第３１９回道路債券	100,000,000	101,116,000	
	政府保証第３２３回道路債券	100,000,000	102,438,000	
	政府保証第３２５回道路債券	101,000,000	103,305,830	
	政府保証第３２７回道路債券	100,000,000	102,912,000	
	政府保証第３２８回道路債券	100,000,000	103,022,000	
	政府保証第３２９回道路債券	150,000,000	155,028,000	
	政府保証第３３０回道路債券	100,000,000	103,960,000	
	政府保証第３３３回道路債券	100,000,000	103,795,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊債券	政府保証第３３４回道路債券	100,000,000	103,642,000	
	政府保証第３３５回道路債券	100,000,000	103,440,000	
	政府保証第３３６回道路債券	131,000,000	135,638,710	
	政府保証第３３８回道路債券	100,000,000	104,007,000	
	政府保証第３４３回道路債券	100,000,000	103,577,000	
	政府保証第３４６回道路債券	115,000,000	119,662,100	
	第１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,546,000	
	第３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,824,000	
	第６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,862,000	
	第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	165,198,000	
	第２２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,458,000	
	第２５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,084,000	
	第２７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,638,000	
	第３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,746,000	
	第３２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,091,000	
	第３５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,325,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,294,000	
	第３８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,720,000	
	第３９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,479,000	
	第４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,153,000	
	第４５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,523,000	
	第４８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,792,000	
	第４９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,399,000	
	第５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,358,000	
	第５６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,516,000	
	第５９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,730,000	
	第６１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,667,000	
	政府保証第１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,695,000	
	政府保証第１４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	157,000,000	167,699,550	
	政府保証第１６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	108,454,810	
	政府保証第２１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,883,000	
	政府保証第２５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	125,000,000	133,808,750	
	政府保証第３３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,755,000	
	政府保証第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,810,000	
	政府保証第４０回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	216,104,000	
	政府保証第４３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,382,000	
	政府保証第４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	214,206,000	
	政府保証第４９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,016,000	

	政府保証第５４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,455,000	
	政府保証第５６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,459,000	
	政府保証第５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	214,616,000	
	政府保証第６２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,332,000	
	政府保証第６６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,069,000	
	政府保証第６７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,450,000	
	政府保証第６９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,730,000	
	政府保証第７１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,766,000	
	政府保証第７５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,702,000	
	政府保証第７７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,702,000	
	政府保証第７８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,780,000	
	政府保証第８０回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,072,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊債券	政府保証第８６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,962,000	
	政府保証第８９回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,474,000	
	政府保証第９１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,679,000	
	政府保証第９３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,109,000	
	政府保証第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,519,000	
	政府保証第９８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,231,000	
	政府保証第１００回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,946,000	
	政府保証第１０３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,138,000	
	政府保証第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,842,000	
	政府保証第１０７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,978,000	
	政府保証第１１０回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,948,000	
	政府保証第１１１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,472,000	
	政府保証第１３３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,300,000	
	第２１回道路債券	100,000,000	110,545,000	
	第２６回道路債券	100,000,000	102,587,000	
	第２７回道路債券	100,000,000	111,095,000	
	第３０回道路債券	100,000,000	103,101,000	
	第３３回道路債券	100,000,000	112,733,000	
	第３７回道路債券	100,000,000	103,634,000	
	第３８回道路債券	100,000,000	109,012,000	
	第４１回道路債券	100,000,000	103,727,000	
	第４２回道路債券	100,000,000	108,276,000	
	政府保証第８２６回公営企業債券	200,000,000	201,262,000	
	政府保証第８２９回公営企業債券	100,000,000	101,329,000	
	政府保証第８３０回公営企業債券	100,000,000	101,109,000	
	政府保証第８３２回公営企業債券	100,000,000	102,071,000	
	政府保証第８３３回公営企業債券	100,000,000	102,340,000	
	政府保証第８３８回公営企業債券	100,000,000	102,901,000	
	政府保証第８３９回公営企業債券	100,000,000	103,014,000	
	政府保証第８４１回公営企業債券	100,000,000	103,942,000	
	政府保証第８４３回公営企業債券	100,000,000	103,439,000	
	政府保証第８４７回公営企業債券	100,000,000	103,538,000	
	政府保証第８４８回公営企業債券	100,000,000	103,317,000	
	政府保証第８５０回公営企業債券	100,000,000	103,750,000	
	政府保証第８５１回公営企業債券	100,000,000	103,505,000	
	政府保証第８５２回公営企業債券	100,000,000	103,574,000	
	政府保証第８５５回公営企業債券	100,000,000	103,737,000	
	政府保証第８５７回公営企業債券	100,000,000	105,012,000	
	政府保証第８５９回公営企業債券	100,000,000	104,778,000	
	政府保証第８６０回公営企業債券	100,000,000	105,213,000	
	政府保証第８６２回公営企業債券	100,000,000	106,188,000	
	政府保証第８６４回公営企業債券	100,000,000	106,792,000	

	政府保証第８７１回公営企業債券	100,000,000	107,049,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊債券	政府保証第８７４回公営企業債券	100,000,000	106,734,000	
	政府保証第８７６回公営企業債券	200,000,000	215,820,000	
	政府保証第８７７回公営企業債券	200,000,000	215,930,000	
	政府保証第８７９回公営企業債券	200,000,000	214,020,000	
	政府保証第８８４回公営企業債券	100,000,000	105,452,000	
	政府保証第８８５回公営企業債券	100,000,000	107,283,000	
	政府保証第８８６回公営企業債券	100,000,000	107,948,000	
	政府保証１５年第２回公営企業債券	100,000,000	110,218,000	
	政府保証第２回地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	213,466,000	
	第１回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,401,000	
	政府保証第３回地方公営企業等金融機構債券	200,000,000	210,788,000	
	政府保証第４回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,708,000	
	第２回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,234,000	
	第３回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,694,000	
	２０年第２回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	107,338,000	
	政府保証第８回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,057,000	
	第４回地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,305,000	
	第１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,685,000	
	政府保証第３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,014,000	
	政府保証第５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,700,000	
	政府保証第６回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,128,000	
	２０年第４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,390,000	
	政府保証第８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,255,000	
	政府保証第１０回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,169,000	
	政府保証第１１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,862,000	
	２０年第７回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,575,000	
	第１２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,164,000	
	政府保証第１３回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,966,000	
	政府保証第１４回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,276,000	
	２０年第１２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,518,000	
	２０年第５回公営企業債券	100,000,000	108,852,000	
	２０年第９回公営企業債券	100,000,000	110,652,000	
	２０年第１１回公営企業債券	100,000,000	107,843,000	
	２０年第１５回公営企業債券	100,000,000	107,938,000	
	２０年第１７回公営企業債券	200,000,000	221,192,000	
	２０年第２４回公営企業債券	100,000,000	107,890,000	
	第１２回公営企業債券	200,000,000	206,704,000	
	第１３回公営企業債券	100,000,000	103,989,000	
	第１７回公営企業債券	200,000,000	209,014,000	
	第１９回公営企業債券	200,000,000	213,484,000	
	第２３回公営企業債券	100,000,000	107,177,000	
	第２４回公営企業債券	100,000,000	107,319,000	
	政府保証第１８７回首都高速道路債券	200,000,000	204,850,000	
	政府保証第１８９回首都高速道路債券	100,000,000	102,254,000	
	政府保証第１９０回首都高速道路債券	100,000,000	102,543,000	
	政府保証第１９７回首都高速道路債券	100,000,000	103,977,000	
	首都高速道路株式会社第５回社債	100,000,000	101,045,000	
	第９回首都高速道路債券	100,000,000	103,265,000	
	政府保証第１４４回阪神高速道路債券	100,000,000	103,955,000	
	政府保証第１４８回阪神高速道路債券	100,000,000	103,753,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考

特殊債券	第６回阪神高速道路債券	100,000,000	103,606,000	
	政府保証第１７６回中小企業債券	100,000,000	102,239,000	
	政府保証第１７８回中小企業債券	100,000,000	102,417,000	
	政府保証第１８４回中小企業債券	100,000,000	103,440,000	
	政府保証第１８７回中小企業債券	100,000,000	104,662,000	
	政府保証第１９１回中小企業債券	200,000,000	213,936,000	
	株式会社日本政策金融公庫第７回社債（一般担保付）	100,000,000	100,984,000	
	政府保証第１回日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,571,000	
	政府保証第４回日本政策金融公庫債券	100,000,000	101,981,000	
	第１２回国際協力銀行債券	100,000,000	102,795,000	
	第１５回国際協力銀行債券	100,000,000	103,444,000	
	第１６回国際協力銀行債券	100,000,000	109,484,000	
	第１９回国際協力銀行債券	100,000,000	106,301,000	
	第２１回国際協力銀行債券	100,000,000	104,412,000	
	第２５回国際協力銀行債券	100,000,000	106,688,000	
	第２７回国際協力銀行債券	100,000,000	106,569,000	
	第２９回国際協力銀行債券	100,000,000	106,925,000	
	第１６回都市再生債券	100,000,000	106,472,000	
	第２４回都市再生債券	100,000,000	107,746,000	
	第３４回都市再生債券	100,000,000	104,058,000	
	第３５回都市再生債券	100,000,000	100,983,000	
	第４３回都市再生債券	100,000,000	102,447,000	
	政府保証第２７回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,033,000	
	第２回本州四国連絡橋債券	100,000,000	102,875,000	
	第３２２回東京交通債券	100,000,000	110,985,000	
	第３２３回東京交通債券	100,000,000	114,151,000	
	第３２４回東京交通債券	100,000,000	114,324,000	
	第３４４回東京交通債券	100,000,000	104,304,000	
	政府保証第１７４回預金保険機構債券	100,000,000	100,484,000	
	政府保証第１７７回預金保険機構債券	100,000,000	100,330,000	
	貸付債権担保第１８回住宅金融公庫債券	44,420,000	46,166,150	
	貸付債権担保Ｓ種第１回住宅金融支援機構債券	94,760,000	99,768,066	
	貸付債権担保第１回住宅金融支援機構債券	319,540,000	336,488,401	
	貸付債権担保Ｓ種第２回住宅金融支援機構債券	49,093,000	51,953,649	
	貸付債権担保第８回住宅金融支援機構債券	133,042,000	139,060,820	
	貸付債権担保Ｓ種第１２回住宅金融支援機構債券	68,152,000	71,663,872	
	貸付債権担保第２４回住宅金融支援機構債券	76,963,000	82,181,861	
	貸付債権担保第２５回住宅金融支援機構債券	75,763,000	80,673,200	
	貸付債権担保第２６回住宅金融支援機構債券	152,140,000	160,530,521	
	貸付債権担保Ｓ種第１７回住宅金融支援機構債券	214,218,000	223,482,928	
	貸付債権担保Ｓ種第１８回住宅金融支援機構債券	71,648,000	74,290,378	
	貸付債権担保第３４回住宅金融支援機構債券	86,833,000	90,192,568	
	貸付債権担保第３５回住宅金融支援機構債券	89,734,000	93,170,812	
	貸付債権担保第３６回住宅金融支援機構債券	90,450,000	93,594,042	
	貸付債権担保第３９回住宅金融支援機構債券	185,186,000	187,591,566	
	貸付債権担保第４２回住宅金融支援機構債券	94,357,000	94,877,850	
	貸付債権担保第４３回住宅金融支援機構債券	94,832,000	96,650,877	
	貸付債権担保第４５回住宅金融支援機構債券	95,371,000	98,620,289	
	貸付債権担保第４９回住宅金融支援機構債券	97,136,000	100,169,557	
	貸付債権担保第５０回住宅金融支援機構債券	97,675,000	100,007,479	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊債券	貸付債権担保第５１回住宅金融支援機構債券	97,956,000	100,145,316	
	貸付債権担保第５３回住宅金融支援機構債券	98,794,000	99,609,050	
	貸付債権担保Ｓ種第１回住宅金融公庫債券	35,065,000	35,990,716	
	貸付債権担保Ｓ種第３回住宅金融公庫債券	108,741,000	113,267,887	

	貸付債権担保Ｓ種第５回住宅金融公庫債券	38,220,000	39,730,072	
	貸付債権担保Ｓ種第６回住宅金融公庫債券	40,623,000	43,147,719	
	貸付債権担保Ｓ種第７回住宅金融公庫債券	165,824,000	175,785,047	
	貸付債権担保Ｓ種第８回住宅金融公庫債券	42,137,000	44,474,339	
	貸付債権担保Ｓ種第９回住宅金融公庫債券	42,185,000	44,698,804	
	貸付債権担保Ｓ種第１０回住宅金融公庫債券	43,519,000	46,047,453	
	貸付債権担保第７回住宅金融公庫債券	31,073,000	32,265,271	
	貸付債権担保第１０回住宅金融公庫債券	70,740,000	72,149,140	
	貸付債権担保第１１回住宅金融公庫債券	38,411,000	38,062,228	
	貸付債権担保第１２回住宅金融公庫債券	41,143,000	42,383,050	
	貸付債権担保第２０回住宅金融公庫債券	92,912,000	97,694,180	
	貸付債権担保第２５回住宅金融公庫債券	50,197,000	51,770,675	
	貸付債権担保第２８回住宅金融公庫債券	53,827,000	55,583,375	
	貸付債権担保第２９回住宅金融公庫債券	174,192,000	180,147,624	
	貸付債権担保第３１回住宅金融公庫債券	61,463,000	63,112,666	
	貸付債権担保第３２回住宅金融公庫債券	188,760,000	193,894,272	
	貸付債権担保第３４回住宅金融公庫債券	64,697,000	66,981,451	
	貸付債権担保第３６回住宅金融公庫債券	61,480,000	63,846,980	
	貸付債権担保第３７回住宅金融公庫債券	62,019,000	64,442,702	
	貸付債権担保第３９回住宅金融公庫債券	185,172,000	191,558,582	
	貸付債権担保第４０回住宅金融公庫債券	123,374,000	128,294,155	
	貸付債権担保第４１回住宅金融公庫債券	63,328,000	66,474,135	
	貸付債権担保第４２回住宅金融公庫債券	60,982,000	64,991,566	
	貸付債権担保第４７回住宅金融公庫債券	59,025,000	62,325,087	
	貸付債権担保第５１回住宅金融公庫債券	186,405,000	196,813,855	
	貸付債権担保第５３回住宅金融公庫債券	63,588,000	66,621,147	
	政府保証第９回国民生活債券	200,000,000	202,626,000	
	政府保証第１２回国民生活債券	100,000,000	102,560,000	
	政府保証第１５回国民生活債券	100,000,000	103,959,000	
	政府保証第１９回国民生活債券	125,000,000	133,072,500	
	政府保証第２０回国民生活債券	100,000,000	103,144,000	
	第１１回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	106,618,000	
	い第７０４号商工債	200,000,000	204,290,000	
	い第７０５号商工債	100,000,000	102,339,000	
	い第７０７号商工債	200,000,000	204,804,000	
	い第７１０号商工債	200,000,000	203,420,000	
	い第７１３号商工債	100,000,000	101,469,000	
	い第７１４号商工債	100,000,000	101,775,000	
	い第７１５号商工債	100,000,000	101,249,000	
	い第７１６号商工債	100,000,000	101,273,000	
	い第７１７号商工債	100,000,000	101,279,000	
	い第７２６号商工債	100,000,000	100,425,000	
	い第６９５号農林債	100,000,000	101,034,000	
	い第６９７号農林債	100,000,000	101,648,000	
	い第７０１号農林債	100,000,000	101,963,000	
	い第７０４号農林債	100,000,000	101,991,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
特殊債券	い第７０８号農林債	100,000,000	101,984,000	
	い第７１５号農林債	200,000,000	202,328,000	
	い第７１７号農林債	100,000,000	101,338,000	
	い第７１８号農林債	100,000,000	101,203,000	
	い第７２０号農林債	100,000,000	101,059,000	
	い第７２１号農林債	100,000,000	100,888,000	
	い第７２４号農林債	100,000,000	100,529,000	
	い第７２５号農林債	100,000,000	100,144,000	

	い第７２８号農林債	100,000,000	100,655,000	
	い第７２９号農林債	100,000,000	101,416,000	
	い第７３０号農林債	100,000,000	101,202,000	
	第２２２回信金中金債（５年）	100,000,000	101,444,000	
	第２２３回信金中金債（５年）	100,000,000	101,675,000	
	第２２４回信金中金債（５年）	100,000,000	101,705,000	
	第２２５回信金中金債（５年）	100,000,000	101,587,000	
	第２２８回信金中金債（５年）	100,000,000	102,115,000	
	第２３０回信金中金債（５年）	200,000,000	203,870,000	
	第２３１回信金中金債（５年）	100,000,000	102,219,000	
	第２３４回信金中金債（５年）	100,000,000	102,030,000	
	第２３７回信金中金債（５年）	100,000,000	101,860,000	
	第２３８回信金中金債（５年）	100,000,000	101,525,000	
	第２４３回信金中金債（５年）	100,000,000	101,249,000	
	第２４６回信金中金債（５年）	100,000,000	101,124,000	
	第２４８回信金中金債（５年）	100,000,000	100,793,000	
	第２５１回信金中金債（５年）	100,000,000	100,036,000	
	第１２４号商工債（３年）	100,000,000	100,148,000	
	政府保証第５回東日本高速道路債券	100,000,000	107,460,000	
	政府保証第８回中日本高速道路債券	100,000,000	107,401,000	
	政府保証第１０回中日本高速道路債券	172,000,000	183,757,920	
	政府保証第２０回中日本高速道路債券	100,000,000	105,409,000	
	中日本高速道路株式会社第２回社債	100,000,000	103,650,000	
	中日本高速道路株式会社第５回社債	100,000,000	107,580,000	
	中日本高速道路株式会社第６回社債	100,000,000	106,765,000	
	中日本高速道路株式会社第１４回社債	100,000,000	100,932,000	
	政府保証第３回西日本高速道路債券	100,000,000	106,850,000	
	政府保証第２０回西日本高速道路債券	100,000,000	105,269,000	
特殊債券 小計		32,816,165,000	34,318,260,060	
社債券	フランス電力第１回円貨社債（２００９）	100,000,000	99,618,000	
	ジーディーエフ・スエズ第１回円貨社債（２００９）	100,000,000	98,865,000	
	第１回スウェーデン輸出信用銀行円貨債券（２００９）	100,000,000	100,563,000	
	一般担保第２回住宅金融支援機構債券	200,000,000	213,328,000	
	一般担保第６回住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,028,000	
	一般担保第１１回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,309,000	
	一般担保第１４回住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,555,000	
	一般担保第１７回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,639,000	
	一般担保第２１回住宅金融支援機構債券	200,000,000	216,188,000	
	一般担保第２３回住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,346,000	
	一般担保第２５回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,513,000	
	一般担保第２９回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,321,000	
	一般担保第３０回住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,422,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	一般担保第４１回住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,030,000	
	一般担保第４３回住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,151,000	
	第９回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	200,000,000	202,964,000	
	第１４回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	100,000,000	102,547,000	
	第１１回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	99,380,000	
	第１７回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	94,325,000	
	第２２回シティグループ・インク円貨社債	100,000,000	100,951,000	
	第３回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債	100,000,000	95,559,000	

	ナショナル・オーストラリア銀行第４回円貨社債（２０１０）	100,000,000	100,204,000	
	ナショナル・オーストラリア銀行第６回円貨社債（２０１１）	100,000,000	99,459,000	
	ウエストパック・バンキング・コーポ・第２回円貨社債２００９	100,000,000	102,512,000	
	ウエストパック・バンキング・コーポ・第５回円貨社債２０１０	200,000,000	201,262,000	
	ウエストパック・バンキング・コーポ・第７回円貨社債２０１０	100,000,000	100,020,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行第１回円貨社債２００９	100,000,000	102,341,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行第５回円貨社債２０１０	100,000,000	100,428,000	
	オーストラリア・ニュージーランド銀行第６回円貨社債２０１１	100,000,000	99,421,000	
	ウォルマート・ストアーズ・インク第３回円貨社債（２００９）	100,000,000	102,147,000	
	ウォルマート・ストアーズ・インク第４回円貨社債（２０１０）	100,000,000	100,867,000	
	エイチエスビーシー・バンク・ピーエルシー第１回円貨社債（２００９）	100,000,000	99,654,000	
	キリンホールディングス株式会社第３回無担保社債	100,000,000	106,301,000	
	味の素株式会社第１７回無担保社債	100,000,000	100,478,000	
	日本たばこ産業株式会社第５回社債	100,000,000	101,952,000	
	株式会社セブン＆アイ・ホールディングス第５回無担保社債	100,000,000	101,268,000	
	住友化学株式会社第２３回無担保社債	100,000,000	101,309,000	
	住友化学株式会社第４３回無担保社債	100,000,000	104,311,000	
	三菱化学株式会社第３７回無担保社債	100,000,000	107,967,000	
	三井化学株式会社第３１回無担保社債	100,000,000	100,646,000	
	花王株式会社第２回無担保社債	100,000,000	102,145,000	
	エーザイ株式会社第６回無担保社債	100,000,000	101,741,000	
	エーザイ株式会社第７回無担保社債	100,000,000	104,814,000	
	第一三共株式会社第２回無担保社債	100,000,000	107,071,000	
	新日本石油株式会社第２６回無担保社債	100,000,000	107,386,000	
	株式会社ブリヂストン第４回無担保社債	100,000,000	100,767,000	
	新日本製鐵株式会社第５２回無担保社債	100,000,000	102,894,000	
	新日本製鐵株式会社第５６回無担保社債	100,000,000	102,648,000	
	新日本製鐵株式会社第６２回無担保社債	100,000,000	102,071,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	ジェイエフイーホールディングス株式会社第１３回無担保社債	100,000,000	101,554,000	
	株式会社豊田自動織機第１５回無担保社債	100,000,000	104,619,000	
	株式会社東芝第５０回無担保社債	100,000,000	100,905,000	
	三菱電機株式会社第４２回無担保社債	100,000,000	102,098,000	
	パナソニック株式会社第７回無担保社債	100,000,000	102,266,000	
	シャープ株式会社第２２回無担保社債	100,000,000	102,281,000	
	シャープ株式会社第２４回無担保社債	100,000,000	101,123,000	
	ソニー株式会社第１７回無担保社債	100,000,000	103,716,000	
	ソニー株式会社第２５回無担保社債	100,000,000	102,171,000	
	ソニー株式会社第２６回無担保社債	100,000,000	107,678,000	
	松下電工株式会社第３回無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	104,042,000	
	三菱重工業株式会社第１７回無担保社債	100,000,000	100,585,000	
	三菱重工業株式会社第２２回無担保社債	100,000,000	107,897,000	

	トヨタ自動車株式会社第７回無担保社債	200,000,000	203,948,000	
	トヨタ自動車株式会社第９回無担保社債	100,000,000	101,889,000	
	トヨタ自動車株式会社第１０回無担保社債	100,000,000	107,045,000	
	アイシン精機株式会社第５回無担保社債	100,000,000	103,058,000	
	大日本印刷株式会社第１回無担保社債	200,000,000	204,430,000	
	伊藤忠商事株式会社第６２回無担保社債	100,000,000	100,657,000	
	三井物産株式会社第５８回無担保社債	100,000,000	106,839,000	
	三菱商事株式会社第４６回無担保社債	100,000,000	102,662,000	
	三菱商事株式会社第５３回無担保社債	100,000,000	101,813,000	
	三菱商事株式会社第７０回無担保社債	100,000,000	107,548,000	
	三菱商事株式会社第７６回無担保社債	100,000,000	101,708,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第１２回無担保社債	100,000,000	101,177,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第１３回無担保社債	100,000,000	101,506,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第１５回無担保社債	100,000,000	102,025,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第１６回無担保社債	300,000,000	306,228,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第１７回無担保社債	100,000,000	101,537,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第１８回無担保社債	100,000,000	101,316,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第１９回無担保社債	200,000,000	202,130,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第２１回無担保社債	100,000,000	100,600,000	
	株式会社みずほコーポレート銀行第２３回無担保社債	100,000,000	100,087,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第５７回無担保社債	200,000,000	218,974,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第８３回無担保社債	200,000,000	213,694,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第８７回無担保社債	100,000,000	107,029,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第９８回無担保社債	100,000,000	101,058,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第１００回無担保社債	100,000,000	101,561,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第１０４回無担保社債	200,000,000	204,664,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第１０６回無担保社債	300,000,000	304,689,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第１０７回無担保社債	100,000,000	105,697,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第１０９回無担保社債	100,000,000	101,361,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第１１６回無担保社債	100,000,000	100,585,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第３回２号無担保社債	200,000,000	202,172,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第２８回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,587,000	
	株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行第３２回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	101,556,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	株式会社三井住友銀行第４４回無担保社債	100,000,000	101,542,000	
	株式会社三井住友銀行第４５回無担保社債	200,000,000	203,712,000	
	株式会社三井住友銀行第４７回無担保社債	100,000,000	101,551,000	
	株式会社三井住友銀行第４８回無担保社債	100,000,000	101,323,000	
	株式会社三井住友銀行第５０回無担保社債	100,000,000	100,583,000	
	株式会社三井住友銀行第５１回無担保社債	100,000,000	100,015,000	
	株式会社三井住友銀行第５２回無担保社債	100,000,000	100,726,000	
	株式会社三井住友銀行第２２回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	100,667,000	
	株式会社三井住友銀行第２３回無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	203,792,000	
	株式会社三井住友銀行第２４回無担保社債（劣後特約付）	200,000,000	202,376,000	
	株式会社みずほ銀行第３回無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	104,452,000	
	ＮＴＴファイナンス株式会社第３７回無担保社債	100,000,000	101,236,000	
	トヨタファイナンス株式会社第２１回無担保社債	100,000,000	106,983,000	
	トヨタファイナンス株式会社第２５回無担保社債	100,000,000	102,814,000	
	野村ホールディングス株式会社第２２回無担保社債	100,000,000	100,149,000	
	野村ホールディングス株式会社第２３回無担保社債	100,000,000	100,986,000	
	大和証券キャピタル・マーケッツ株式会社第２回無担保社債	100,000,000	99,068,000	
	三菱地所株式会社第４８回無担保社債	100,000,000	112,426,000	

	三菱地所株式会社第７０回無担保社債	100,000,000	102,946,000	
	三菱地所株式会社第７９回無担保社債	100,000,000	106,535,000	
	三菱地所株式会社第８３回無担保社債	100,000,000	108,399,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第７回社債（一般担保付）	200,000,000	229,982,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第１３回社債（一般担保付）	100,000,000	113,354,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第１５回社債（一般担保付）	100,000,000	113,893,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第２１回無担保社債	100,000,000	107,990,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第２７回無担保普通社債	100,000,000	101,874,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第３３回無担保普通社債	100,000,000	103,695,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第３７回無担保普通社債	100,000,000	103,372,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第４３回無担保普通社債	100,000,000	107,350,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第５０回無担保普通社債	100,000,000	107,271,000	
	東日本旅客鉄道株式会社第５２回無担保普通社債	100,000,000	106,075,000	
	西日本旅客鉄道株式会社第７回社債（一般担保付）	100,000,000	111,355,000	
	西日本旅客鉄道株式会社第１１回無担保社債	100,000,000	109,257,000	
	東海旅客鉄道株式会社第５回普通社債（一般担保付）	100,000,000	113,318,000	
	東海旅客鉄道株式会社第１０回無担保普通社債	100,000,000	104,836,000	
	東海旅客鉄道株式会社第２０回無担保普通社債	200,000,000	213,512,000	
	東海旅客鉄道株式会社第２５回無担保普通社債	100,000,000	106,732,000	
	東海旅客鉄道株式会社第５１回無担保普通社債	100,000,000	105,206,000	
	東京地下鉄株式会社第３回社債（一般担保付）	100,000,000	106,647,000	
	東京地下鉄株式会社第８回社債（一般担保付）	100,000,000	107,798,000	
	日本郵船株式会社第２７回無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	107,073,000	
	日本電信電話株式会社第４８回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	103,419,000	
	日本電信電話株式会社第５０回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	104,375,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	日本電信電話株式会社第５１回電信電話債券（一般担保付）	200,000,000	214,064,000	
	日本電信電話株式会社第５２回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	106,516,000	
	日本電信電話株式会社第５３回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	105,633,000	
	日本電信電話株式会社第５９回電信電話債券（一般担保付）	100,000,000	106,698,000	
	株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第１５回無担保社債	100,000,000	108,229,000	
	株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第１６回無担保社債	100,000,000	101,864,000	
	東京電力株式会社第４５７回社債	100,000,000	76,837,000	
	東京電力株式会社第５０７回社債	100,000,000	92,907,000	
	東京電力株式会社第５１１回社債	100,000,000	90,885,000	
	東京電力株式会社第５１３回社債	100,000,000	90,761,000	
	東京電力株式会社第５１４回社債	100,000,000	89,142,000	
	東京電力株式会社第５１５回社債	100,000,000	87,699,000	
	東京電力株式会社第５１６回社債	100,000,000	86,812,000	
	東京電力株式会社第５１８回社債	100,000,000	85,449,000	
	東京電力株式会社第５１９回社債	100,000,000	84,724,000	
	東京電力株式会社第５２１回社債	100,000,000	83,904,000	
	東京電力株式会社第５２２回社債	100,000,000	83,650,000	
	東京電力株式会社第５３９回社債	100,000,000	76,736,000	
	東京電力株式会社第５４１回社債	100,000,000	94,588,000	
	東京電力株式会社第５４２回社債	100,000,000	76,512,000	
	東京電力株式会社第５４４回社債	100,000,000	77,807,000	
	中部電力株式会社第４０５回社債	100,000,000	111,038,000	
	中部電力株式会社第４０６回社債	200,000,000	220,348,000	

	中部電力株式会社第４２６回社債	100,000,000	111,202,000	
	中部電力株式会社第４６６回社債	100,000,000	102,693,000	
	中部電力株式会社第４７８回社債	100,000,000	104,990,000	
	中部電力株式会社第４８０回社債	100,000,000	104,750,000	
	中部電力株式会社第４８４回社債	100,000,000	102,185,000	
	関西電力株式会社第４３３回社債（一般担保付）	100,000,000	102,013,000	
	関西電力株式会社第４３５回社債（一般担保付）	100,000,000	101,769,000	
	関西電力株式会社第４４３回社債（一般担保付）	100,000,000	102,622,000	
	関西電力株式会社第４４８回社債（一般担保付）	100,000,000	107,075,000	
	関西電力株式会社第４５４回社債（一般担保付）	100,000,000	102,077,000	
	関西電力株式会社第４６３回社債（一般担保付）	100,000,000	103,923,000	
	関西電力株式会社第４６６回社債（一般担保付）	100,000,000	101,281,000	
	中国電力株式会社第２９８回社債（一般担保付）	100,000,000	111,171,000	
	中国電力株式会社第３０６回社債（一般担保付）	100,000,000	112,926,000	
	中国電力株式会社第３１１回社債（一般担保付）	100,000,000	111,035,000	
	中国電力株式会社第３５０回社債（一般担保付）	100,000,000	102,683,000	
	中国電力株式会社第３５４回社債（一般担保付）	100,000,000	105,656,000	
	北陸電力株式会社第２７７回社債（一般担保付）	100,000,000	102,559,000	
	北陸電力株式会社第２８３回社債（一般担保付）	100,000,000	105,953,000	
	北陸電力株式会社第２８８回社債（一般担保付）	100,000,000	105,471,000	
	東北電力株式会社第３８３回社債（一般担保付）	100,000,000	110,760,000	
	東北電力株式会社第４１４回社債（一般担保付）	100,000,000	100,524,000	
	東北電力株式会社第４１６回社債（一般担保付）	100,000,000	98,578,000	

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
社債券	東北電力株式会社第４２０回社債（一般担保付）	100,000,000	101,447,000	
	東北電力株式会社第４３５回社債（一般担保付）	100,000,000	104,591,000	
	四国電力株式会社第２５３回社債（一般担保付）	100,000,000	93,355,000	
	四国電力株式会社第２５７回社債（一般担保付）	100,000,000	102,429,000	
	九州電力株式会社第３７１回社債（一般担保付）	100,000,000	98,025,000	
	九州電力株式会社第３７２回社債（一般担保付）	100,000,000	100,337,000	
	九州電力株式会社第３７６回社債（一般担保付）	100,000,000	101,798,000	
	九州電力株式会社第３８４回社債（一般担保付）	100,000,000	103,285,000	
	九州電力株式会社第３８７回社債（一般担保付）	100,000,000	103,878,000	
	九州電力株式会社第３９１回社債（一般担保付）	100,000,000	104,942,000	
	九州電力株式会社第３９９回社債（一般担保付）	100,000,000	101,794,000	
	九州電力株式会社第４０５回社債（一般担保付）	100,000,000	104,864,000	
	北海道電力株式会社第２５７回社債（一般担保付）	100,000,000	112,662,000	
	北海道電力株式会社第２８２回社債（一般担保付）	100,000,000	101,653,000	
	北海道電力株式会社第２８４回社債（一般担保付）	100,000,000	102,990,000	
	北海道電力株式会社第２８５回社債（一般担保付）	100,000,000	103,933,000	
	沖縄電力株式会社第９回社債（一般担保付）	100,000,000	100,725,000	
	電源開発株式会社第１４回無担保社債	100,000,000	103,035,000	
	電源開発株式会社第１６回無担保社債	100,000,000	105,042,000	
	電源開発株式会社第１７回無担保社債	100,000,000	105,288,000	
	電源開発株式会社第１９回無担保社債	100,000,000	105,161,000	
	電源開発株式会社第２１回無担保社債	100,000,000	103,878,000	
	電源開発株式会社第２９回無担保社債	100,000,000	101,077,000	
	電源開発株式会社第３０回無担保社債	100,000,000	100,453,000	
	東京瓦斯株式会社第３０回無担保社債	100,000,000	104,336,000	
	大阪瓦斯株式会社第７回無担保社債	100,000,000	114,586,000	
	大阪瓦斯株式会社第９回無担保社債	100,000,000	113,563,000	
	大阪瓦斯株式会社第２５回無担保社債	100,000,000	102,842,000	
	株式会社エヌ・ティ・ティ・データ第２０回無担保社債（社債間限定同順位特約付）	200,000,000	202,204,000	
	株式会社エヌ・ティ・ティ・データ第２１回無担保社債	100,000,000	105,909,000	

	株式会社エヌ・ティ・ティ・データ第２４回無担保社債	100,000,000	101,079,000	
社債券 小計		23,800,000,000	24,453,976,000	
合計		341,252,565,000	355,584,866,017	

（注）代用有価証券で額面 50,000,000円 担保差入
なお、代用有価証券の担保差入券面額には、約定未受渡券面額を含んでおります。

② 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表
該当事項はありません。

⑤ 商品明細表
該当事項はありません。

⑥ 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

⑦ その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表
該当事項はありません。

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24年２月27日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	3,710,538,657
コール・ローン	1,871,403,613
株式	267,097,527,369
投資信託受益証券	154,262,329
投資証券	5,167,171,826
派生商品評価勘定	539,652,398
未収入金	4,339,604,443
未収配当金	532,128,821
未収利息	3,734
差入委託証拠金	1,225,701,145
流動資産合計	284,637,994,335
資産合計	284,637,994,335
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,913,325
未払金	297,581,937
未払解約金	148,638,973
流動負債合計	448,134,235
負債合計	448,134,235
純資産の部	
元本等	
元本	279,008,406,959
剰余金	
剰余金	5,181,453,141
純資産合計	284,189,860,100
負債・純資産合計	284,637,994,335

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成24年２月27日現在
１．有価証券の評価基準及び評価方法	（１）株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

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

（貸借対照表に関する注記）

	平成24年２月27日現在
１．計算日における受益権総数	279,008,406,959 口
２．１口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	1.0186 円 （ 10,186 円）

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

平成24年２月27日現在

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

２．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク
当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、株価変動リスク、為替変動リスク、信用リスク、カントリーリスク及び流動性リスク等に晒されております。
また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。

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

２．金融商品の時価等に関する事項

平成24年２月27日現在

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

２．時価の算定方法
（１）株式、投資信託受益証券及び投資証券
「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。
（２）デリバティブ取引
「（その他の注記）」の「３．デリバティブ取引関係」に記載しております。
（３）コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務
短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

３．金融商品の時価等に関する事項の補足説明
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

４．金銭債権の計算日後の償還予定額
金銭債権は全て１年以内に償還予定であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

平成24年２月27日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

平成24年２月27日現在
該当事項はありません。

（その他の注記）
１．元本の変動

平成24年２月27日現在	
特定期間／計算期間の期首元本額	282,079,469,684 円
特定期間／計算期間中の追加設定元本額	27,534,773,398 円
特定期間／計算期間中の一部解約元本額	30,605,836,123 円
計算日の元本額	279,008,406,959 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	4,604,089,949 円
中央三井ＤＣ外国株式インデックスファンド	3,803,770,647 円
中央三井ＤＣ外国株式インデックスファンドＬ	18,203,111,757 円
中央三井ＤＣバランスファンド３０	178,662,319 円
中央三井ＤＣバランスファンド５０	529,996,121 円
中央三井ＤＣバランスファンド７０	312,697,174 円
ベスタ・世界６資産ファンド（毎月決算型）	216,576,032 円
ベスタ・世界６資産ファンド（１年決算型）	137,816,105 円
新生・４分散ファンド	177,862,551 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	711,103,254 円
４資産インデックスバランスオープン（分配型）	57,869,733 円
４資産インデックスバランスオープン（成長型）	167,877,402 円
ＣＭＡＭ外国株式インデックスｅ	3,976,122,890 円
中央三井インデックスコレクション（外国株式）	2,084,899,784 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式３０）	186,129,428 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式５０）	512,208,740 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式７０）	448,523,456 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）	20,878,282,959 円
中央三井バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	5,705,417,175 円
中央三井バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	41,459,447,006 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）	29,767,064,606 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）	4,725,808,112 円
中央三井ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	408,292,476 円
為替ヘッジ付外国株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,938,052,266 円
中央三井ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	30,761,434,328 円
中央三井バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	3,549,631,697 円

中央三井バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	1,869,891,828 円
中央三井バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	31,867,682,821 円
中央三井バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	2,428,045,485 円
中央三井ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	46,001,440,819 円
中央三井ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	6,042,743,226 円
中央三井ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	208,819,931 円
中央三井バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	2,888,891,062 円
中央三井ＶＡバランス株式４０（適格機関投資家専用）	2,296,360,271 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）	977,512,601 円
ＣＭＡＭ・ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	2,356,385,260 円
中央三井バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	1,564,476,528 円
中央三井ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	2,737,568,652 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）	729,360,536 円
ＣＭＡＭ・ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	1,365,844,007 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）	53,528,625 円

２．有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成24年２月27日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	3,848,480,821
投資信託受益証券	2,312,053
投資証券	△72,558,444
合計	3,778,234,430

（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24年２月８日から平成24年２月27日まで）に対応するものです。

３．デリバティブ取引関係

Ⅰ．ヘッジ会計が適用されていないもの

株式関連

区分	種類	平成24年２月27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	11,247,324,534	―	11,694,829,481	447,504,947
合計		11,247,324,534	―	11,694,829,481	447,504,947

（注）１．時価の算定方法

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

２．株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

３．計算日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

区分	種類	平成24年２月27日現在		
		契約額等（円）	時価	評価損益

			うち１年超	（円）	（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買 建				
	米ドル	1,271,106,513	—	1,329,739,740	58,633,227
	カナダドル	107,548,520	—	107,548,520	0
	ユーロ	474,534,809	—	493,693,800	19,158,991
	英ポンド	235,147,689	—	247,847,420	12,699,731
	スイスフラン	49,398,464	—	49,411,520	13,056
	スウェーデンクローナ	7,995,260	—	7,992,040	△3,220
	ノルウェークローネ	5,355,998	—	5,354,530	△1,468
	デンマーククローネ	3,781,241	—	3,780,470	△771
	オーストラリアドル	64,504,800	—	64,527,120	22,320
	ニュージーランドドル	1,831,356	—	1,830,600	△756
	香港ドル	15,920,639	—	15,919,120	△1,519
	シンガポールドル	7,881,566	—	7,883,640	2,074
	イスラエルシェケル	9,210,560	—	9,180,600	△29,960
	計	2,254,217,415	—	2,344,709,120	90,491,705
	売 建				
	米ドル	601,737,500	—	601,959,680	△222,180
	英ポンド	50,165,051	—	50,200,450	△35,399
	計	651,902,551	—	652,160,130	△257,579
合計		2,906,119,966	—	2,996,869,250	90,234,126

（注）時価の算定方法

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

① 計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

② 計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年２月27日現在
該当事項はありません。

次へ

（３）附属明細表（平成24年２月27日現在）

① 有価証券明細表

A．株式

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	32,900	20.46	673,134.00	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	74,400	87.30	6,495,120.00	
	APACHE CORP	57,412	111.57	6,405,456.84	
	ARCH COAL INC	31,600	14.29	451,564.00	
	BAKER HUGHES INC	65,159	51.96	3,385,661.64	
	CABOT OIL & GAS CORP	31,200	35.69	1,113,528.00	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	36,600	56.85	2,080,710.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	98,500	25.45	2,506,825.00	
	CHEVRON CORP	297,342	109.08	32,434,065.36	
	CIMAREX ENERGY CO	12,800	86.41	1,106,048.00	
	COBALT INTERNATIONAL ENERGY	20,500	30.50	625,250.00	
	CONCHO RESOURCES INC	14,900	113.43	1,690,107.00	
	CONOCOPHILLIPS	188,300	75.95	14,301,385.00	
	CONSOL ENERGY INC	33,900	36.33	1,231,587.00	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,800	94.75	644,300.00	
	DENBURY RESOURCES INC	58,500	20.91	1,223,235.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	57,300	75.19	4,308,387.00	
	DIAMOND OFFSHORE DRILLING	10,700	67.19	718,933.00	
	EL PASO CORP	115,200	27.16	3,128,832.00	
	ENERGEN CORP	11,100	54.91	609,501.00	
	EOG RESOURCES INC	40,200	117.55	4,725,510.00	
	EQT CORP	21,200	54.04	1,145,648.00	
	EXXON MOBIL CORPORATION	715,502	87.34	62,491,944.68	
	FMC TECHNOLOGIES INC	35,600	52.27	1,860,812.00	
	HALLIBURTON CO	137,400	38.51	5,291,274.00	
	HELMERICH & PAYNE	16,000	62.72	1,003,520.00	
	HESS CORP	45,700	67.00	3,061,900.00	
	HOLLYFRONTIER CORP	31,600	33.89	1,070,924.00	
	KINDER MORGAN INC	17,000	33.24	565,080.00	
	KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	13,261	81.65	1,082,760.65	
	MARATHON OIL CORP	105,100	35.01	3,679,551.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	53,300	42.86	2,284,438.00	
	MURPHY OIL CORP	27,800	64.76	1,800,328.00	
	NABORS INDUSTRIES INC	43,000	22.31	959,330.00	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	63,321	86.04	5,448,138.84	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	20,600	36.60	753,960.00	
	NOBLE CORP	39,500	38.94	1,538,130.00	
	NOBLE ENERGY INC	26,400	104.57	2,760,648.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	121,180	103.86	12,585,754.80	
	PEABODY ENERGY CORP	40,900	36.33	1,485,897.00	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16,400	116.24	1,906,336.00	
	PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION CO	21,100	46.50	981,150.00	
	QEP RESOURCES INC	27,100	34.32	930,072.00	
	RANGE RESOURCES CORP	24,400	65.94	1,608,936.00	
	ROWAN COMPANIES INC	18,700	38.78	725,186.00	
	SCHLUMBERGER LIMITED	200,334	79.85	15,996,669.90	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	SOUTHWESTERN ENERGY CO	52,000	35.21	1,830,920.00	

	SPECTRA ENERGY CORP	97,078	31.73	3,080,284.94	
	SUNOCO INC	16,000	39.39	630,240.00	
	SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	23,500	30.09	707,115.00	
	ULTRA PETROLEUM CORP	23,500	23.84	560,240.00	
	VALERO ENERGY CORP	83,564	24.39	2,038,125.96	
	WEATHERFORD INTL LTD	114,448	16.50	1,888,392.00	
	WHITING PETROLEUM CORP	17,600	62.47	1,099,472.00	
	WILLIAMS COS INC	88,020	29.31	2,579,866.20	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	31,500	91.94	2,896,110.00	
	AIRGAS INC	10,900	81.85	892,165.00	
	ALCOA INC	160,600	10.43	1,675,058.00	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	15,500	44.21	685,255.00	
	BALL CORP	23,500	39.78	934,830.00	
	CELANESE CORP-SERIES A	23,600	48.52	1,145,072.00	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9,800	183.88	1,802,024.00	
	CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	21,400	67.86	1,452,204.00	
	CROWN HOLDINGS INC	22,900	36.60	838,140.00	
	DOW CHEMICAL COMPANY	176,402	33.82	5,965,915.64	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	137,946	50.99	7,033,866.54	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	20,600	53.80	1,108,280.00	
	ECOLAB INC	44,900	62.69	2,814,781.00	
	FMC CORP	10,600	98.56	1,044,736.00	
	FREEPORT-MCMORAN COPPER-B	141,576	43.91	6,216,602.16	
	INTERNATIONAL PAPER CO	62,000	32.92	2,041,040.00	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	12,336	57.63	710,923.68	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	43,200	44.15	1,907,280.00	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	6,900	87.73	605,337.00	
	MEADWESTVACO CORP	26,000	30.51	793,260.00	
	MONSANTO CO	80,000	79.52	6,361,600.00	
	MOSAIC CO/THE	45,700	58.68	2,681,676.00	
	NEWMONT MINING CORP HOLDING CO	73,950	62.51	4,622,614.50	
	NUCOR CORP	47,300	43.86	2,074,578.00	
	OWENS-ILLINOIS INC	24,800	24.50	607,600.00	
	PPG INDUSTRIES INC.	23,100	91.67	2,117,577.00	
	PRAXAIR INC	44,814	109.89	4,924,610.46	
	ROCK-TENN COMPANY-CL A	10,900	68.00	741,200.00	
	SEALED AIR CORP	25,200	19.83	499,716.00	
	SHERWIN-WILLIAMS CO	13,200	101.06	1,333,992.00	
	SIGMA-ALDRICH	18,000	72.60	1,306,800.00	
	UNITED STATES STEEL CORP	22,100	28.13	621,673.00	
	VULCAN MATERIALS COMPANY	19,300	46.17	891,081.00	
	WALTER ENERGY INC	9,600	66.31	636,576.00	
	3M COMPANY	99,438	88.20	8,770,431.60	
	AGCO CORP	14,900	52.67	784,783.00	
	AMETEK INC	23,900	48.25	1,153,175.00	
	BOEING COMPANY	105,395	76.06	8,016,343.70	
	CATERPILLAR INC	96,600	116.00	11,205,600.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	23,600	60.17	1,420,012.00	
	CUMMINS INC	27,400	121.78	3,336,772.00	
	DANAHER CORP	87,104	53.32	4,644,385.28	
	DEERE & CO	61,826	83.27	5,148,251.02	
	DOVER CORP	27,700	65.67	1,819,059.00	
	EATON CORP	47,400	51.75	2,452,950.00	

	EMERSON ELECTRIC CO	109,900	50.88	5,591,712.00	
	FASTENAL CO	41,900	51.97	2,177,543.00	
	FLOWSERVE CORP	8,300	119.29	990,107.00	
	FLUOR CORP	25,400	63.40	1,610,360.00	
	GENERAL DYNAMICS CORPORATION	45,200	72.40	3,272,480.00	
	GENERAL ELECTRIC	1,575,845	19.24	30,319,257.80	
	GOODRICH CORP	18,700	125.88	2,353,956.00	
	GRAINGER (W.W.) INC	9,000	207.29	1,865,610.00	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	109,700	59.27	6,501,919.00	
	ILLINOIS TOOL WORKS	64,976	55.92	3,633,457.92	
	INGERSOLL-RAND PLC	46,668	40.48	1,889,120.64	
	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	19,500	47.19	920,205.00	
	JOY GLOBAL INC	15,900	90.65	1,441,335.00	
	KBR INC	22,300	36.56	815,288.00	
	L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	15,000	70.28	1,054,200.00	
	LOCKHEED MARTIN CORPORATION	41,100	89.53	3,679,683.00	
	MASCO CORP	54,400	11.57	629,408.00	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	37,100	59.92	2,223,032.00	
	PACCAR INC	48,175	45.84	2,208,342.00	
	PALL CORP	17,200	63.41	1,090,652.00	
	PARKER HANNIFIN CORP	22,650	89.63	2,030,119.50	
	PENTAIR INC	14,800	38.83	574,684.00	
	PRECISION CASTPARTS CORP	21,600	168.77	3,645,432.00	
	QUANTA SERVICES INC	31,300	21.07	659,491.00	
	RAYTHEON COMPANY	51,700	50.78	2,625,326.00	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	21,200	82.67	1,752,604.00	
	ROCKWELL COLLONS	22,600	59.88	1,353,288.00	
	ROPER INDUSTRIES INC	14,500	94.58	1,371,410.00	
	SPX CORP	7,700	75.71	582,967.00	
	STANLEY BLACK AND DECKER INC	24,137	74.85	1,806,654.45	
	TEXTRON INC	41,900	27.65	1,158,535.00	
	TYCO INTERNATIONAL LTD	69,032	51.15	3,530,986.80	
	UNITED TECHNOLOGIES CORP	128,500	83.97	10,790,145.00	
	URS CORP	11,900	46.62	554,778.00	
	XYLEM INC	26,400	27.26	719,664.00	
	AVERY DENNISON CORP	15,200	30.80	468,160.00	
	CINTAS CORP	17,900	38.80	694,520.00	
	DUN & BRADSTREET CORP	7,500	82.36	617,700.00	
	EQUIFAX INC	18,500	42.39	784,215.00	
	IHS INC-CLASS A	6,500	93.52	607,880.00	
	IRON MOUNTAIN INC	20,800	31.44	653,952.00	
	MANPOWERGROUP	12,400	45.27	561,348.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	NIELSEN HOLDINGS NV	14,100	27.90	393,390.00	
	PITNEY BOWES INC	29,806	18.00	536,508.00	
	REPUBLIC SERVICES INC	44,270	29.84	1,321,016.80	
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	20,300	28.87	586,061.00	
	STERICYCLE INC	12,100	89.23	1,079,683.00	
	VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	20,700	42.00	869,400.00	
	WASTE MANAGEMENT INC	65,300	35.64	2,327,292.00	
	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	24,900	67.21	1,673,529.00	
	CSX CORP	156,800	21.66	3,396,288.00	
	DELTA AIR LINES INC	33,200	9.53	316,396.00	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	32,100	43.34	1,391,214.00	

	FEDEX CORP	44,995	90.24	4,060,348.80	
	HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	40,900	14.55	595,095.00	
	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	14,000	50.80	711,200.00	
	KANSAS CITY SOUTHERN	16,600	69.24	1,149,384.00	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	53,200	70.03	3,725,596.00	
	SOUTHWEST AIRLINES	31,100	8.68	269,948.00	
	UNION PACIFIC CORPORATION	72,160	112.62	8,126,659.20	
	UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	13,000	20.41	265,330.00	
	UNITED PARCEL SERVICE -CL B	108,020	76.50	8,263,530.00	
	AUTOLIV INC	13,700	68.21	934,477.00	
	BORGWARNER INC	16,600	82.43	1,368,338.00	
	FORD MOTOR CO	528,870	12.23	6,468,080.10	
	GENERAL MOTORS CO	116,800	26.07	3,044,976.00	
	GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	36,500	13.11	478,515.00	
	HARLEY-DAVIDSON INC	34,700	47.04	1,632,288.00	
	JOHNSON CONTROLS INC	101,642	33.19	3,373,497.98	
	TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	15,900	45.82	728,538.00	
	COACH INC	43,700	75.28	3,289,736.00	
	DR HORTON INC	43,000	13.98	601,140.00	
	FOSSIL INC	8,000	121.78	974,240.00	
	GARMIN LTD	17,400	48.05	836,070.00	
	HASBRO INC	17,400	34.86	606,564.00	
	LEGGETT & PLATT INC	21,400	22.59	483,426.00	
	LULULEMON ATHLETICA INC	15,200	66.59	1,012,168.00	
	MATTEL INC	50,600	32.16	1,627,296.00	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	8,800	62.41	549,208.00	
	NEWELL RUBBERMAID INC	43,300	18.38	795,854.00	
	NIKE INC. CLASS B	53,000	106.29	5,633,370.00	
	RALPH LAUREN CORP	9,200	173.32	1,594,544.00	
	TOLL BROTHERS INC	22,500	22.62	508,950.00	
	VF CORP	13,300	146.42	1,947,386.00	
	WHIRLPOOL CORP	11,700	71.30	834,210.00	
	APOLLO GROUP INC-CL A	17,500	52.14	912,450.00	
	CARNIVAL CORP	66,700	29.97	1,998,999.00	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,700	387.42	1,820,874.00	
	DARDEN RESTAURANTS INC	19,700	49.19	969,043.00	
	H&R BLOCK INC	46,800	16.38	766,584.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	INTL GAME TECHNOLOGY	44,500	15.25	678,625.00	
	LAS VEGAS SANDS CORP	54,700	53.35	2,918,245.00	
	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	40,074	34.73	1,391,770.02	
	MC DONALD'S CORPORATION	152,756	100.32	15,324,481.92	
	MGM RESORTS INTERNATIONAL	51,700	14.00	723,800.00	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	21,300	28.49	606,837.00	
	STARBUCKS CORP	111,300	48.30	5,375,790.00	
	STARWOOD HOTELS & RESORTS	29,520	54.99	1,623,304.80	
	WYNN RESORTS LTD	12,300	118.10	1,452,630.00	
	YUM BRANDS INC	68,800	65.54	4,509,152.00	
	CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	30,300	15.62	473,286.00	
	CBS CORP-CL B	91,270	29.75	2,715,282.50	
	COMCAST CORP-CL A	312,423	29.19	9,119,627.37	
	COMCAST CORP-SPECIAL CL A	97,050	28.31	2,747,485.50	
	DIRECTV-CLASS A	105,369	45.61	4,805,880.09	
	DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	21,384	44.53	952,229.52	

	DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	17,484	41.14	719,291.76	
	DISH NETWORK CORP-A	31,700	28.80	912,960.00	
	INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES	68,860	11.62	800,153.20	
	LIBERTY GLOBAL INC-A	20,753	49.25	1,022,085.25	
	LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	17,100	47.03	804,213.00	
	LIBERTY MEDIA CORP - LIBER-A	16,400	88.28	1,447,792.00	
	MCGRAW-HILL INC	43,800	46.03	2,016,114.00	
	NEWS CORP INC CLASS A	257,105	19.56	5,028,973.80	
	NEWS CORP INC CLASS B	65,565	20.17	1,322,446.05	
	OMNICOM GROUP	41,200	48.61	2,002,732.00	
	SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	13,100	44.99	589,369.00	
	SIRIUS XM RADIO INC	566,100	2.20	1,245,420.00	
	THE WALT DISNEY CO.	254,758	41.31	10,524,052.98	
	TIME WARNER CABLE	47,641	78.21	3,726,002.61	
	TIME WARNER INC	149,462	37.69	5,633,222.78	
	VIACOM INC-CLASS B	74,770	47.45	3,547,836.50	
	VIRGIN MEDIA INC	42,750	25.10	1,073,025.00	
	WASHINGTON POST -CL B	800	397.56	318,048.00	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	13,500	48.14	649,890.00	
	ADVANCE AUTO PARTS	10,850	84.58	917,693.00	
	AMAZON.COM INC	54,400	179.13	9,744,672.00	
	AUTOZONE INC	3,600	359.80	1,295,280.00	
	BED BATH & BEYOND INC	36,600	60.35	2,208,810.00	
	BEST BUY CO INC	46,050	24.99	1,150,789.50	
	CARMAX INC	33,800	30.18	1,020,084.00	
	DOLLAR GENERAL CORP	25,200	41.67	1,050,084.00	
	DOLLAR TREE INC	17,850	87.82	1,567,587.00	
	EXPEDIA INC	14,425	32.97	475,592.25	
	FAMILY DOLLAR STORES	14,900	54.33	809,517.00	
	GAMESTOP CORP-CLASS A	20,700	22.73	470,511.00	
	GAP INC/THE	47,400	22.57	1,069,818.00	
	GENUINE PARTS CO	23,300	62.23	1,449,959.00	

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	230,104	46.98	10,810,285.92	
	J.C. PENNEY CO INC (HLDG CO)	24,200	41.72	1,009,624.00	
	KOHLS CORP	36,020	49.44	1,780,828.80	
	LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	83,847	18.39	1,541,946.33	
	LIMITED BRANDS	38,330	46.26	1,773,145.80	
	LOWE'S COS INC	188,196	27.16	5,111,403.36	
	MACY'S INC	62,852	37.06	2,329,295.12	
	NETFLIX INC	7,900	111.67	882,193.00	
	NORDSTROM INC	25,100	53.17	1,334,567.00	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	19,200	85.67	1,644,864.00	
	PETSMART INC	16,700	54.78	914,826.00	
	PRICELINE.COM INC	7,500	590.41	4,428,075.00	
	ROSS STORES INC	34,600	52.79	1,826,534.00	
	SEARS HOLDING CORP	6,385	68.31	436,159.35	
	STAPLES INC	104,450	15.28	1,595,996.00	
	TARGET CORP	95,320	55.22	5,263,570.40	
	TIFFANY & CO	18,300	64.68	1,183,644.00	
	TJX COMPANIES INC	112,600	35.97	4,050,222.00	
	URBAN OUTFITTERS INC	19,100	29.62	565,742.00	
	COSTCO WHOLESALE CORP	64,700	84.40	5,460,680.00	
	CVS CAREMARK CORP	194,283	44.07	8,562,051.81	

	KROGER CO	84,700	23.54	1,993,838.00	
	SAFEWAY INC	50,800	20.93	1,063,244.00	
	SYSCO CORP	88,090	29.27	2,578,394.30	
	WAL-MART STORES	283,026	58.79	16,639,098.54	
	WALGREEN CO	131,106	33.86	4,439,249.16	
	WHOLE FOODS MARKET INC	22,800	81.10	1,849,080.00	
	ALTRIA GROUP INC	306,975	29.99	9,206,180.25	
	ARCHER DANIELS MIDLAND COMPANY	99,710	31.96	3,186,731.60	
	BEAM INC	20,900	55.60	1,162,040.00	
	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,480	81.10	1,012,128.00	
	BUNGE LIMITED	21,800	67.91	1,480,438.00	
	CAMPBELL SOUP	29,100	33.71	980,961.00	
	COCA-COLA CO/THE	305,134	69.00	21,054,246.00	
	COCA-COLA ENTERPRISES	46,600	28.71	1,337,886.00	
	CONAGRA FOODS INC	62,650	26.84	1,681,526.00	
	CONSTELLATION BRANDS INC-A	26,700	21.57	575,919.00	
	DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	32,086	38.59	1,238,198.74	
	GENERAL MILLS INC	96,080	38.15	3,665,452.00	
	GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	19,700	66.18	1,303,746.00	
	HEINZ (H.J.) CO	47,800	53.43	2,553,954.00	
	HERSHEY CO/THE	24,600	61.11	1,503,306.00	
	HORMEL FOODS CORP	22,500	28.77	647,325.00	
	JM SMUCKER CO/THE	17,000	74.74	1,270,580.00	
	KELLOGG CO	37,600	52.75	1,983,400.00	
	KRAFT FOODS INC-A	250,618	37.88	9,493,409.84	
	LORILLARD INC	20,187	130.01	2,624,511.87	
	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,100	50.28	910,068.00	

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	30,400	78.02	2,371,808.00	
	MOLSON COORS BREWING CO -B	23,600	43.92	1,036,512.00	
	MONSTER BEVERAGE CORP	22,100	56.38	1,245,998.00	
	PEPSICO INC	233,421	63.31	14,777,883.51	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	259,275	83.02	21,525,010.50	
	RALCORP HOLDINGS INC	8,400	74.66	627,144.00	
	REYNOLDS AMERICAN INC	52,800	41.28	2,179,584.00	
	SARA LEE CORP	84,500	20.27	1,712,815.00	
	TYSON FOODS INC-CL A	44,800	18.99	850,752.00	
	AVON PRODUCTS,INC	64,340	18.92	1,217,312.80	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	21,400	47.86	1,024,204.00	
	CLOROX COMPANY	19,900	67.79	1,349,021.00	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	72,300	93.30	6,745,590.00	
	ENERGIZER HOLDINGS INC	10,000	77.33	773,300.00	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	34,900	56.84	1,983,716.00	
	HERBALIFE LTD	17,400	66.45	1,156,230.00	
	KIMBERLY-CLARK CORP	58,847	71.81	4,225,803.07	
	PROCTER & GAMBLE CO	410,715	66.71	27,398,797.65	
	AETNA INC	54,100	46.89	2,536,749.00	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	38,600	37.70	1,455,220.00	
	BARD (C.R.) INC	13,100	94.07	1,232,317.00	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	84,210	57.64	4,853,864.40	
	BECTON DICKINSON & CO	32,100	77.28	2,480,688.00	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	221,186	6.25	1,382,412.50	
	CARDINAL HEALTH INC	52,054	42.05	2,188,870.70	
	CAREFUSION CORP	34,277	25.89	887,431.53	

	CERNER CORP	21,500	73.76	1,585,840.00	
	CIGNA CORP	43,100	45.09	1,943,379.00	
	COVENTRY HEALTH CARE INC	21,550	32.42	698,651.00	
	COVIDIEN PLC	72,032	52.88	3,809,052.16	
	DAVITA INC	14,100	86.80	1,223,880.00	
	DENTSPLY INTERNATIONAL INC	21,600	38.40	829,440.00	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17,100	74.26	1,269,846.00	
	EXPRESS SCRIPTS INC	68,900	52.41	3,611,049.00	
	HCA HOLDINGS INC	26,400	26.74	705,936.00	
	HENRY SCHEIN INC	13,500	74.74	1,008,990.00	
	HOLOGIC INC	40,144	21.33	856,271.52	
	HUMANA INC	24,500	89.00	2,180,500.00	
	INTUITIVE SURGICAL INC	5,900	512.76	3,025,284.00	
	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	14,800	89.08	1,318,384.00	
	MCKESSON CORP	36,700	82.00	3,009,400.00	
	MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	57,810	64.14	3,707,933.40	
	MEDTRONIC,INCORPORATED	157,645	38.12	6,009,427.40	
	OMNICARE INC	17,500	34.75	608,125.00	
	PATTERSON COS INC	14,500	32.14	466,030.00	
	QUEST DIAGNOSTICS INC	23,900	57.24	1,368,036.00	
	ST JUDE MEDICAL INC	47,700	43.23	2,062,071.00	
	STRYKER CORP	42,900	54.78	2,350,062.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	UNITEDHEALTH GROUP INC	159,168	55.65	8,857,699.20	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	16,900	66.56	1,124,864.00	
	WELLPOINT INC	51,998	66.11	3,437,587.78	
	ZIMMER HOLDINGS INC	26,800	62.21	1,667,228.00	
	ABBOTT LABORATORIES	232,553	56.70	13,185,755.10	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	51,900	43.02	2,232,738.00	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	27,900	84.63	2,361,177.00	
	ALLERGAN INC	45,600	87.42	3,986,352.00	
	AMGEN INC	118,462	67.73	8,023,431.26	
	BIOGEN IDEC INC	34,457	116.39	4,010,450.23	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	252,975	32.60	8,246,985.00	
	CELGENE CORP	66,300	74.89	4,965,207.00	
	COVANCE INC	9,400	47.84	449,696.00	
	ELI LILLY & CO	155,533	39.05	6,073,563.65	
	FOREST LABORATORIES INC	39,900	32.29	1,288,371.00	
	GILEAD SCIENCES INC	112,200	45.26	5,078,172.00	
	HOSPIRA INC	24,615	36.16	890,078.40	
	ILLUMINA INC	18,800	51.22	962,936.00	
	JOHNSON & JOHNSON	407,670	64.46	26,278,408.20	
	LIFE TECHNOLOGIES CORP	26,600	47.69	1,268,554.00	
	MERCK & CO. INC.	455,019	38.20	17,381,725.80	
	MYLAN INC	64,400	23.48	1,512,112.00	
	PERRIGO CO	12,700	96.24	1,222,248.00	
	PFIZER	1,147,372	21.18	24,301,338.96	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	56,500	56.66	3,201,290.00	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	31,700	38.39	1,216,963.00	
	WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	22,000	16.33	359,260.00	
	WATERS CORPORATION	13,400	88.56	1,186,704.00	
	WATSON PHARMACEUTICALS INC	19,000	58.17	1,105,230.00	
	BB&T CORPORATION	104,100	29.48	3,068,868.00	
	CIT GROUP INC	28,800	40.34	1,161,792.00	

	COMERICA INC	29,700	29.32	870,804.00	
	FIFTH THIRD BANCORP	138,843	13.60	1,888,264.80	
	HUDSON CITY BANCORP INC	70,900	6.89	488,501.00	
	KEYCORP	142,240	8.06	1,146,454.40	
	M & T BANK CORP	16,900	81.77	1,381,913.00	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP	65,300	12.88	841,064.00	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN	53,900	12.46	671,594.00	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	78,588	59.38	4,666,555.44	
	REGIONS FINANCIAL CORP	187,937	5.80	1,090,034.60	
	SUNTRUST BANKS INC	81,108	22.30	1,808,708.40	
	US BANCORP	284,857	28.73	8,183,941.61	
	WELLS FARGO & COMPANY	747,820	30.18	22,569,207.60	
	AMERICAN EXPRESS COMPANY	156,101	53.33	8,324,866.33	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	33,780	56.41	1,905,529.80	
	BANK OF AMERICA CORP	1,512,900	7.88	11,921,652.00	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	181,092	21.67	3,924,263.64	
	BLACKROCK INC	15,600	196.00	3,057,600.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	82,684	49.29	4,075,494.36	
	CITIGROUP INC	436,476	32.35	14,119,998.60	
	CME GROUP INC	9,500	292.39	2,777,705.00	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	82,357	30.19	2,486,357.83	
	EATON VANCE CORP	17,900	28.77	514,983.00	
	FRANKLIN RESOURCES INC	23,100	118.84	2,745,204.00	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	69,900	115.87	8,099,313.00	
	INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	10,900	139.74	1,523,166.00	
	INVESCO LTD	68,111	24.88	1,694,601.68	
	JPMORGAN CHASE & CO	567,187	38.28	21,711,918.36	
	LEGG MASON INC	19,900	26.94	536,106.00	
	LEUCADIA NATIONAL CORP	31,100	28.80	895,680.00	
	MOODY'S CORP	29,900	38.88	1,162,512.00	
	MORGAN STANLEY	215,814	18.49	3,990,400.86	
	NASDAQ OMX GROUP	18,600	26.67	496,062.00	
	NORTHERN TRUST CORP	32,800	43.86	1,438,608.00	
	NYSE GROUP INC	39,200	30.84	1,208,928.00	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	162,600	13.52	2,198,352.00	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	22,100	19.76	436,696.00	
	SLM CORP	76,000	16.19	1,230,440.00	
	STATE STREET CORP	73,473	40.53	2,977,860.69	
	T ROWE PRICE GROUP INC	37,778	61.03	2,305,591.34	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	32,800	17.93	588,104.00	
	ACE LTD	50,300	73.13	3,678,439.00	
	AFLAC INC	69,710	46.90	3,269,399.00	
	ALLSTATE CORP	75,460	31.36	2,366,425.60	
	AMERICAN INT'L GROUP	71,613	28.41	2,034,525.33	
	AON CORP	43,500	47.53	2,067,555.00	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,100	37.19	747,519.00	
	ASSURANT INC	13,800	42.95	592,710.00	
	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	18,900	31.75	600,075.00	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	135,400	80.04	10,837,416.00	
	CHUBB CORP	41,518	68.60	2,848,134.80	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	23,071	35.76	825,018.96	
	EVEREST RE GROUP LTD	8,100	88.94	720,414.00	

	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC CL-A	32,065	17.60	564,344.00	
	GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	75,300	9.14	688,242.00	
	HARTFORD FINANCIAL SERVICES GR	63,900	20.48	1,308,672.00	
	LINCOLN NATIONAL CORP	45,107	25.08	1,131,283.56	
	LOEWS CORP	47,390	39.14	1,854,844.60	
	MARSH & MCLENNAN COS	80,339	31.77	2,552,370.03	
	METLIFE INC	157,940	37.76	5,963,814.40	
	PARTNERRE LTD	9,800	64.62	633,276.00	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	45,600	27.85	1,269,960.00	
	PROGRESSIVE CORP	87,500	21.43	1,875,125.00	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	70,186	61.09	4,287,662.74	
	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	7,900	73.03	576,937.00	
	TORCHMARK CORP	15,300	48.80	746,640.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	TRAVELERS COS INC/THE	61,613	58.60	3,610,521.80	
	UNUM GROUP	43,700	23.18	1,012,966.00	
	WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	24,900	35.27	878,223.00	
	WR BERKLEY CORP	17,450	36.25	632,562.50	
	XL GROUP PLC	47,800	20.08	959,824.00	
	CBRE GROUP INC	44,900	18.51	831,099.00	
	WEYERHAEUSER CO	80,112	21.06	1,687,158.72	
	ACCENTURE PLC-CL A	95,700	59.65	5,708,505.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	77,600	12.11	940,124.00	
	ADOBE SYSTEMS INC	73,300	33.41	2,448,953.00	
	AKAMAI TECHNOLOGIES	26,800	37.21	997,228.00	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	7,500	121.88	914,100.00	
	AUTODESK INC	33,900	37.62	1,275,318.00	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	73,000	53.82	3,928,860.00	
	BMC SOFTWARE INC	25,500	39.15	998,325.00	
	CA INC	59,000	26.93	1,588,870.00	
	CITRIX SYSTEMS INC	27,900	75.16	2,096,964.00	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	45,100	72.18	3,255,318.00	
	COMPUTER SCIENCES CORP	23,800	32.09	763,742.00	
	EBAY INC	173,472	36.36	6,307,441.92	
	ELECTRONIC ARTS INC	50,610	16.93	856,827.30	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION	35,823	31.07	1,113,020.61	
	FISERV INC	21,400	66.87	1,431,018.00	
	GOOGLE INC-CLASS A	38,300	609.90	23,359,170.00	
	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE	175,978	197.76	34,801,409.28	
	INTUIT INC	42,200	58.06	2,450,132.00	
	MASTERCARD INC-CLASS A	16,400	415.61	6,816,004.00	
	MICROSOFT CORP	1,130,091	31.48	35,575,264.68	
	NUANCE COMMUNICATIONS INC	36,000	25.08	902,880.00	
	ORACLE CORP	602,376	29.25	17,619,498.00	
	PAYCHEX INC	49,300	31.42	1,549,006.00	
	RED HAT INC	29,200	50.01	1,460,292.00	
	SAIC INC	40,800	12.60	514,080.00	
	SALESFORCE.COM INC	19,200	143.64	2,757,888.00	
	SYMANTEC CORP	110,100	17.88	1,968,588.00	
	SYNOPSYS INC	21,400	30.69	656,766.00	
	TERADATA CORP	25,000	65.48	1,637,000.00	
	TOTAL SYSTEM SERVICES INC	24,775	21.96	544,059.00	
	VERISIGN INC	22,600	37.64	850,664.00	

	VISA INC-CLASS A SHARES	77,900	117.54	9,156,366.00	
	VMWARE INC-CLASS A	12,800	100.52	1,286,656.00	
	WESTERN UNION CO	92,448	17.88	1,652,970.24	
	YAHOO! INC	175,900	14.89	2,619,151.00	
	AMPHENOL CORP-CL A	24,800	56.30	1,396,240.00	
	APPLE INC	138,800	522.41	72,510,508.00	
	ARROW ELECTRONICS INC	16,700	40.64	678,688.00	
	AVNET INC	22,200	36.27	805,194.00	
	CISCO SYSTEMS INC	802,413	20.14	16,160,597.82	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	CORNING INC	234,600	13.75	3,225,750.00	
	DELL INC	241,358	17.43	4,206,869.94	
	DOLBY LABORATORIES INC-CL A	7,600	38.89	295,564.00	
	EMC CORP/MASS	304,500	27.52	8,379,840.00	
	F5 NETWORKS INC	11,900	127.48	1,517,012.00	
	FLEXTRONICS INTL LTD	106,500	7.17	763,605.00	
	FLIR SYSTEMS INC	23,300	26.07	607,431.00	
	HARRIS CORP	17,300	43.11	745,803.00	
	HEWLETT-PACKARD CO	296,600	26.64	7,901,424.00	
	JUNIPER NETWORKS INC	78,600	23.72	1,864,392.00	
	MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS I	42,762	39.73	1,698,934.26	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	41,371	49.43	2,044,968.53	
	NETAPP INC	55,060	43.08	2,371,984.80	
	QUALCOMM INC	250,938	63.44	15,919,506.72	
	SANDISK CORP	36,100	49.14	1,773,954.00	
	SEAGATE TECHNOLOGY	62,700	27.49	1,723,623.00	
	TE CONNECTIVITY LTD	63,432	35.97	2,281,649.04	
	WESTERN DIGITAL CORP	35,200	39.78	1,400,256.00	
	XEROX CORP	207,112	8.36	1,731,456.32	
	AT&T INC	884,552	30.34	26,837,307.68	
	CENTURYLINK INC	92,267	39.92	3,683,298.64	
	CROWN CASTLE INTL CORP	42,500	52.55	2,233,375.00	
	FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	150,185	4.64	696,858.40	
	LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	23,920	23.58	564,033.60	
	METROPCS COMMUNICATIONS INC	39,500	12.01	474,395.00	
	NII HOLDINGS INC	26,100	20.25	528,525.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	16,400	46.84	768,176.00	
	SPRINT NEXTEL CORP	447,238	2.47	1,104,677.86	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	422,648	38.14	16,119,794.72	
	WINDSTREAM CORP	87,100	12.16	1,059,136.00	
	AES CORP	97,400	13.80	1,344,120.00	
	ALLIANT ENERGY CORP	17,000	43.29	735,930.00	
	AMEREN CORPORATION	36,500	32.24	1,176,760.00	
	AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY	72,100	37.73	2,720,333.00	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	26,200	33.92	888,704.00	
	CALPINE CORP	48,600	15.60	758,160.00	
	CENTERPOINT ENERGY INC	60,400	18.80	1,135,520.00	
	CONSOLIDATED EDISON INC	43,800	58.84	2,577,192.00	
	CONSTELLATION ENERGY GROUP	28,900	36.49	1,054,561.00	
	DOMINION RESOURCES INC	85,100	51.32	4,367,332.00	
	DTE ENERGY COMPANY	25,600	54.85	1,404,160.00	
	DUKE ENERGY CORP	198,956	21.10	4,197,971.60	
	EDISON INTERNATIONAL	46,200	42.23	1,951,026.00	
	ENTERGY CORP	26,300	67.14	1,765,782.00	

	EXELON CORP	99,000	39.27	3,887,730.00	
	FIRSTENERGY CORP	62,475	44.07	2,753,273.25	
	INTEGRYS ENERGY GROUP INC	11,900	54.41	647,479.00	
	MDU RESOURCES GROUP INC	28,500	22.03	627,855.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル	NEXTERA ENERGY INC	59,994	60.77	3,645,835.38	
	NISOURCE INC	42,400	23.68	1,004,032.00	
	NORTHEAST UTILITIES	26,700	35.86	957,462.00	
	NRG ENERGY INC	34,400	17.85	614,040.00	
	NSTAR	15,900	46.82	744,438.00	
	ONEOK INC	14,900	83.87	1,249,663.00	
	P G & E CORP	60,700	41.75	2,534,225.00	
	PEPCO HOLDINGS INC	34,700	19.84	688,448.00	
	PINNACLE WEST CAPITAL	16,700	47.51	793,417.00	
	PPL CORPORATION	86,400	28.85	2,492,640.00	
	PROGRESS ENERGY INC	44,500	53.69	2,389,205.00	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	75,600	30.43	2,300,508.00	
	SCANA CORP	18,700	45.35	848,045.00	
	SEMPRA ENERGY	34,400	58.04	1,996,576.00	
	SOUTHERN COMPANY	128,732	44.54	5,733,723.28	
	WISCONSIN ENERGY CORP	34,600	34.37	1,189,202.00	
	XCEL ENERGY INC	73,200	26.48	1,938,336.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES	89,692	7.46	669,102.32	
	ALTERA CORPORATION	47,900	38.88	1,862,352.00	
	ANALOG DEVICES	44,500	38.85	1,728,825.00	
	APPLIED MATERIALS INC	196,700	12.63	2,484,321.00	
	AVAGO TECHNOLOGIES LTD	33,400	36.32	1,213,088.00	
	BROADCOM CORP-CL A	72,635	36.75	2,669,336.25	
	CREE INC	16,800	29.35	493,080.00	
	FIRST SOLAR INC	8,600	35.58	305,988.00	
	INTEL CORP	760,065	26.70	20,293,735.50	
	KLA-TENCOR CORPORATION	24,961	47.75	1,191,887.75	
	LAM RESEARCH CORP	17,900	40.56	726,024.00	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	34,425	33.34	1,147,729.50	
	LSI CORP	84,200	8.50	715,700.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	76,900	15.46	1,188,874.00	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	43,600	28.37	1,236,932.00	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	28,800	36.37	1,047,456.00	
	MICRON TECHNOLOGY INC	132,700	7.95	1,054,965.00	
	NVIDIA CORP	91,100	15.79	1,438,469.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	170,627	33.32	5,685,291.64	
	XILINX INC	39,200	37.23	1,459,416.00	
米ドル 小計		44,859,991	—	1,871,846,505.90 (152,162,402,464)	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	43,900	25.42	1,115,938.00	
	ATHABASCA OIL SANDS CORP	46,100	12.30	567,030.00	
	BAYTEX ENERGY CORP	17,700	58.13	1,028,901.00	
	BONAVISTA ENERGY CORP	21,900	23.18	507,642.00	
	CAMECO CORP	59,600	25.20	1,501,920.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	163,440	38.00	6,210,720.00	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	73,200	23.66	1,731,912.00	
	CENOVUS ENERGY INC	112,540	39.11	4,401,439.40	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	42,700	46.21	1,973,167.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
カナダドル	ENBRIDGE INC	111,040	38.41	4,265,046.40	
	ENCANA CORP	109,840	19.70	2,163,848.00	
	ENERPLUS CORP	27,500	24.01	660,275.00	
	HUSKY ENERGY INC	50,200	26.73	1,341,846.00	
	IMPERIAL OIL LTD	44,300	48.80	2,161,840.00	
	MEG ENERGY CORP	19,100	43.98	840,018.00	
	NEXEN INC	79,600	21.18	1,685,928.00	
	NIKO RESOURCES LTD	7,300	47.38	345,874.00	
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	39,100	29.66	1,159,706.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	25,300	28.36	717,508.00	
	PENGROWTH ENERGY CORP	53,600	9.91	531,176.00	
	PENN WEST PETROLEUM LTD	70,878	21.56	1,528,129.68	
	PRECISION DRILLING CORP	36,000	12.17	438,120.00	
	PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	29,000	11.30	327,700.00	
	SUNCOR ENERGY INC	235,032	36.97	8,689,133.04	
	TALISMAN ENERGY INC	154,000	14.24	2,192,960.00	
	TOURMALINE OIL CORP	18,600	25.32	470,952.00	
	TRANSCANADA CORP	105,050	42.00	4,412,100.00	
	VERMILION ENERGY INC	13,700	48.61	665,957.00	
	AGNICO-EAGLE MINES	25,600	36.90	944,640.00	
	AGRIUM INC	23,800	83.66	1,991,108.00	
	BARRICK GOLD CORP	149,300	48.85	7,293,305.00	
	CENTERRA GOLD INC	24,700	21.43	529,321.00	
	ELDORADO GOLD CORPORATION	82,900	15.05	1,247,645.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	71,900	22.94	1,649,386.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	19,400	44.21	857,674.00	
	GOLDCORP INC	120,940	48.64	5,882,521.60	
	IAMGOLD CORP	56,700	15.90	901,530.00	
	INMET MINING CORPORATION	7,800	68.50	534,300.00	
	IVANHOE MINES LTD	42,900	17.52	751,608.00	
	KINROSS GOLD CORP	171,520	11.18	1,917,593.60	
	NEW GOLD INC	65,600	11.81	774,736.00	
	OSISKO MINING CORP	52,800	12.54	662,112.00	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	15,100	25.56	385,956.00	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	127,900	46.58	5,957,582.00	
	SILVER WHEATON CORP	52,800	38.76	2,046,528.00	
	SINO-FOREST CORPORATION	34,700	0.01	347.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	86,845	40.66	3,531,117.70	
	YAMANA GOLD INC	112,500	17.72	1,993,500.00	
	BOMBARDIER INC CL B	214,740	4.81	1,032,899.40	
	CAE INC	40,400	10.76	434,704.00	
	FINNING INTERNATIONAL INC	26,300	28.95	761,385.00	
	SNC-LAVALIN GROUP INC	22,800	48.25	1,100,100.00	
	RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	14,000	25.82	361,480.00	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	66,400	76.87	5,104,168.00	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	25,610	75.23	1,926,640.30	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	31,900	47.36	1,510,784.00	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	17,300	25.03	433,019.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
カナダドル	TIM HORTONS INC	23,703	52.81	1,251,755.43	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	56,240	20.24	1,138,297.60	

	THOMSON REUTERS CORP	55,653	28.53	1,587,780.09	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	12,000	63.96	767,520.00	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	17,800	30.01	534,178.00	
	EMPIRE CO LTD 'A'	4,200	55.32	232,344.00	
	LOBLAW COMPANIES LTD	17,300	34.65	599,445.00	
	METRO INC	15,300	50.22	768,366.00	
	SHOPPERS DRUG MART CORP	32,100	40.52	1,300,692.00	
	WESTON (GEORGE) LTD	8,100	63.52	514,512.00	
	SAPUTO INC	21,000	40.51	850,710.00	
	VITERRA INC	57,000	10.32	588,240.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTE	42,300	48.01	2,030,823.00	
	BANK OF MONTREAL	95,462	58.10	5,546,342.20	
	BANK OF NOVA SCOTIA	162,700	53.51	8,706,077.00	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	59,800	76.51	4,575,298.00	
	NATIONAL BANK OF CANADA	24,000	76.59	1,838,160.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	214,700	54.66	11,735,502.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	134,150	79.30	10,638,095.00	
	CI FINANCIAL CORP	23,500	22.04	517,940.00	
	IGM FINANCIAL INC	17,300	45.14	780,922.00	
	ONEX CORPORATION	14,300	36.87	527,241.00	
	TMX GROUP INC	11,600	42.60	494,160.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,000	393.49	1,180,470.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	42,600	23.31	993,006.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	13,200	26.83	354,156.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	19,600	59.33	1,162,868.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	267,800	12.50	3,347,500.00	
	POWER CO OF CANADA	52,800	25.14	1,327,392.00	
	POWER FINANCIAL CORP	37,400	27.44	1,026,256.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	87,600	21.28	1,864,128.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT-CL A	83,625	31.51	2,635,023.75	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	38,625	17.52	676,710.00	
	CGI GROUP INC	34,700	20.94	726,618.00	
	OPEN TEXT CORP	8,800	61.79	543,752.00	
	RESEARCH IN MOTION	71,200	14.73	1,048,776.00	
	BCE INC	38,792	40.07	1,554,395.44	
	BELL ALIANT INC	11,800	27.22	321,196.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	59,900	38.17	2,286,383.00	
	TELUS CORP	7,300	57.22	417,706.00	
	TELUS CORPORATION -NON VOTE	23,700	56.71	1,344,027.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	13,400	63.56	851,704.00	
	FORTIS INC	28,200	32.04	903,528.00	
	TRANSALTA CORP	32,000	21.04	673,280.00	
カナダドル 小計		5,711,625	—	188,917,752.63 (15,347,678,223)	
ユーロ	CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	21,767	23.29	506,953.43	
	ENI SPA	358,702	17.57	6,302,394.14	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	FUGRO NV-CVA	10,472	54.39	569,572.08	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	35,508	13.25	470,658.54	
	NESTE OIL OYJ	18,111	9.68	175,405.03	
	OMV AG	24,425	28.85	704,661.25	
	REPSOL YPF SA	118,447	20.63	2,443,561.61	
	SAIPEM	39,519	37.87	1,496,584.53	
	SBM OFFSHORE NV	26,520	13.30	352,716.00	

	TECHNIP S.A.	14,972	81.32	1,217,523.04	
	TENARIS SA	71,253	15.22	1,084,470.66	
	TOTAL SA	316,831	42.06	13,327,496.01	
	ACERINOX SA	14,331	10.68	153,126.73	
	AIR LIQUIDE	42,352	97.49	4,128,896.48	
	AKZO NOBEL	34,956	43.48	1,519,886.88	
	ARCELORMITTAL	128,140	16.09	2,062,413.30	
	ARKEMA	8,261	69.19	571,578.59	
	BASF SE	137,092	64.70	8,869,852.40	
	CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	28,479	5.04	143,648.07	
	CRH PLC	108,106	16.22	1,753,479.32	
	HEIDELBERGCEMENT AG	20,990	39.73	834,037.65	
	IMERYS SA	5,070	45.15	228,910.50	
	K+S AG	25,993	38.62	1,003,979.62	
	KONINKLIJKE DSM NV	23,018	42.24	972,395.41	
	LAFARGE SA	30,340	35.39	1,073,884.30	
	LANXESS	12,419	57.24	710,863.56	
	LINDE AG	25,488	126.35	3,220,408.80	
	SALZGITTER AG	6,046	45.92	277,662.55	
	SOLVAY SA	8,850	91.00	805,350.00	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	87,783	5.73	502,996.59	
	THYSSENKRUPP AG	58,224	20.53	1,195,629.84	
	UMICORE	17,016	39.42	670,770.72	
	UPM-KYMMENE OYJ	79,805	10.60	845,933.00	
	VOESTALPINE AG	16,865	27.01	455,523.65	
	WACKER CHEMIE AG	2,460	76.35	187,821.00	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,733	22.75	494,534.41	
	ALSTOM	31,107	32.35	1,006,311.45	
	BEKAERT NV	6,120	24.72	151,286.40	
	BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	10,410	28.04	291,896.40	
	BOUYGUES SA	28,507	24.71	704,550.50	
	BRENNTAG AG	5,138	84.15	432,362.70	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	59,954	36.05	2,161,641.47	
	EIFFAGE	5,821	29.51	171,777.71	
	EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	61,210	27.06	1,656,342.60	
	FERROVIAL SA	56,290	9.55	537,569.50	
	FIAT INDUSTRIAL	115,375	7.98	921,269.37	
	FINMECCANICA SPA	63,634	4.15	264,208.36	
	FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	7,217	19.55	141,092.35	
	GEA GROUP AG	26,064	25.55	665,935.20	
	HOCHTIEF AG	6,322	55.36	349,985.92	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	KONE OYJ-B	23,240	45.55	1,058,582.00	
	LEGRAND SA	33,768	27.59	931,827.96	
	MAN SE	9,469	85.61	810,641.09	
	METSO OYJ	19,075	35.81	683,075.75	
	PHILIPS ELECTRONICS NV	150,599	15.85	2,387,747.14	
	PRYSMIAN SPA	30,401	13.00	395,213.00	
	SAFRAN S.A.	24,899	24.22	603,053.78	
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	73,067	51.05	3,730,070.35	
	SIEMENS AG-REG	122,808	75.02	9,213,056.16	
	THALES SA	15,278	27.53	420,603.34	
	VALLOUREC	17,071	53.61	915,176.31	
	VINCI S.A.	67,471	38.62	2,606,067.37	

	WARTSILA OYJ	25,025	26.60	665,665.00	
	WENDEL	4,906	63.89	313,444.34	
	ZARDOYA OTIS SA	22,525	10.22	230,205.50	
	BIC	4,472	75.17	336,160.24	
	BUREAU VERITAS SA	8,385	62.54	524,397.90	
	EDENRED	24,270	20.29	492,438.30	
	RANDSTAD HOLDING NV	18,359	28.24	518,458.16	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	57,912	12.70	735,771.96	
	ADP	5,170	61.06	315,680.20	
	ATLANTIA SPA	47,040	12.76	600,230.40	
	DEUTSCHE POST AG-REG	126,320	13.16	1,662,371.20	
	FRAPORT AG	5,777	47.79	276,082.83	
	GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	81,054	6.43	521,582.49	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED A	145,865	1.89	276,122.44	
	LUFTHANSA (REGD)	35,142	10.42	366,179.64	
	TNT EXPRESS NV - W/I	54,083	9.39	507,839.37	
	VOPAK (KON)	10,609	41.62	441,599.62	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	49,420	70.32	3,475,214.40	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	7,791	44.98	350,478.13	
	CONTINENTAL AG	11,942	68.64	819,698.88	
	DAIMLER AG	135,282	47.44	6,418,454.49	
	FIAT SPA	117,392	4.56	535,777.08	
	MICHELIN CLASS B (BROWN BDS)	26,867	53.03	1,424,757.01	
	NOKIAN RENKAAT OYJ	16,891	33.80	570,915.80	
	PEUGEOT SA	22,708	15.85	360,035.34	
	PIRELLI & CO SPA	37,402	7.92	296,410.85	
	PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PFD	23,105	48.55	1,121,747.75	
	RENAULT SA	29,004	39.94	1,158,419.76	
	VOLKSWAGEN AG	4,404	126.60	557,546.40	
	VOLKSWAGEN AG (PREF)	21,587	139.25	3,005,989.75	
	ADIDAS-SALOMON AG	31,228	58.75	1,834,645.00	
	CHRISTIAN DIOR	8,227	116.30	956,800.10	
	LUXOTTICA GROUP SPA	17,618	25.58	450,668.44	
	LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	37,893	126.35	4,787,780.55	
	ACCOR SA	22,014	26.13	575,225.82	
	AUTOGRILL SPA	16,968	7.67	130,229.40	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	OPAP SA	35,111	6.77	237,701.47	
	SODEXO	14,226	57.70	820,840.20	
	AXEL SPRINGER AG	5,908	35.99	212,628.92	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	19,712	28.42	560,215.04	
	JC DECAUX SA	10,079	20.52	206,871.47	
	KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	13,434	43.00	577,662.00	
	LAGARDERE S.C.A.	18,114	22.38	405,481.89	
	MEDIASET SPA	111,438	2.35	262,325.05	
	PROSIEBEN SAT1 MEDIA AG-PFD	11,005	18.83	207,279.17	
	PUBLICIS GROUPE	21,705	40.81	885,889.57	
	REED ELSEVIER NV	103,790	9.35	970,747.87	
	SANOMAWSOY OYJ	11,628	10.25	119,187.00	
	SES	44,731	17.85	798,672.00	
	TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	17,287	9.10	157,467.28	
	WOLTERS KLUWER	45,838	14.29	655,254.21	
	INDITEX	32,564	69.03	2,247,892.92	
	PPR	11,483	127.80	1,467,527.40	

	CARREFOUR SA	86,188	18.32	1,578,964.16	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	8,250	71.98	593,835.00	
	COLRUYT SA	11,623	28.80	334,800.51	
	DELHAIZE GROUP	15,202	40.91	621,989.83	
	DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	86,188	3.54	305,881.21	
	JERONIMO MARTINS	33,804	13.21	446,550.84	
	KESKO OYJ-B SHS	10,520	25.32	266,366.40	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	173,423	10.31	1,787,991.13	
	METRO AG	19,351	29.38	568,532.38	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	119,831	49.23	5,899,280.13	
	COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	28,125	14.04	394,875.00	
	DANONE	87,164	50.70	4,419,214.80	
	HEINEKEN HOLDING NV	17,197	33.39	574,207.83	
	HEINEKEN NV	38,689	39.42	1,525,120.38	
	KERRY GROUP PLC-A	20,960	31.55	661,288.00	
	PERNOD-RICARD	29,635	76.79	2,275,671.65	
	SUEDZUCKER AG	10,421	21.66	225,770.96	
	UNILEVER NV-CVA	243,142	24.91	6,056,667.22	
	BEIERSDORF AG	15,046	46.83	704,679.41	
	HENKEL AG & CO KGAA	19,389	40.02	775,947.78	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	26,883	47.55	1,278,286.65	
	L'OREAL	35,882	85.00	3,049,970.00	
	CELESIO AG	12,054	14.29	172,311.93	
	ESSILOR INTERNATIONAL	30,012	59.70	1,791,716.40	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	31,514	53.77	1,694,507.78	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	17,159	77.96	1,337,715.64	
	BAYER AG	123,430	55.90	6,899,737.00	
	ELAN CORP PLC	75,477	9.35	705,709.95	
	GRIFOLS SA	20,672	15.20	314,214.40	
	MERCK KGAA	9,646	79.48	766,664.08	
	ORION OYJ	14,834	16.35	242,535.90	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	QIAGEN N.V.	35,866	11.98	429,854.01	
	SANOFI	170,052	56.30	9,573,927.60	
	UCB SA	15,479	30.63	474,121.77	
	BANCA CARIGE SPA	91,616	1.21	111,496.67	
	BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	760,546	0.39	298,134.03	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	691,609	6.77	4,684,959.36	
	BANCO DE SABADELL SA	216,845	2.41	523,246.98	
	BANCO ESPIRITO SANTO-REG	109,052	1.64	179,826.74	
	BANCO POPOLARE SPA	270,667	1.42	385,700.47	
	BANCO POPULAR ESPANOL	149,046	3.04	454,292.20	
	BANCO SANTANDER SA	1,277,064	6.28	8,023,793.11	
	BANKIA SAU	132,958	3.05	405,521.90	
	BANKINTER SA	30,197	4.97	150,079.09	
	BNP PARIBAS	144,213	36.92	5,324,343.96	
	CAIXABANK	113,827	3.59	409,435.71	
	COMMERZBANK AG	540,093	1.94	1,048,320.51	
	CREDIT AGRICOLE SA	151,050	4.89	739,842.90	
	ERSTE GROUP BANK AG	29,021	18.50	536,888.50	
	INTESA SANPAOLO	1,503,911	1.49	2,240,827.39	
	INTESA SANPAOLO-RNC	134,006	1.24	166,569.45	
	IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	126,938	0.01	1,269.38	
	KBC GROUP	24,721	17.21	425,448.41	

	NATIONAL BANK OF GREECE	146,741	2.40	352,178.40	
	NATIXIS	137,179	2.62	360,643.59	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	7,024	26.47	185,925.28	
	SOCIETE GENERALE	98,462	24.43	2,405,426.66	
	UNICREDIT SPA	604,141	3.89	2,352,525.05	
	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	124,903	3.58	447,902.15	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	138,737	34.85	4,835,678.13	
	DEUTSCHE BOERSE AG	29,106	50.32	1,464,613.92	
	EURAZEO	4,301	34.96	150,362.96	
	EXOR SPA	9,213	19.07	175,691.91	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,043	55.37	666,820.91	
	ING GROEP NV-CVA	571,697	6.63	3,792,066.20	
	MEDIOBANCA SPA	79,300	4.96	393,962.40	
	POHJOLA BANK PLC	21,721	8.70	188,972.70	
	AEGON NV	259,332	3.92	1,018,137.43	
	AGEAS	333,850	1.62	542,840.10	
	ALLIANZ SE-REG	67,839	91.17	6,184,881.63	
	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	174,284	12.22	2,129,750.48	
	AXA	259,762	12.12	3,149,614.25	
	CNP ASSURANCES	21,876	10.62	232,323.12	
	DELTA LLOYD NV	15,951	14.31	228,258.81	
	HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	9,001	42.59	383,397.59	
	MAPFRE SA	118,404	2.54	300,864.56	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	26,769	109.60	2,933,882.40	
	SAMPO OYJ-A SHS	63,383	21.30	1,350,057.90	
	SCOR SE	25,931	20.04	519,786.89	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	VIENNA INSURANCE GROUP AG	5,519	33.25	183,506.75	
	IMMOFINANZ AG	142,559	2.63	375,500.40	
	AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	47,275	13.96	660,195.37	
	ATOS	7,397	43.22	319,698.34	
	CAP GEMINI SA	22,088	32.88	726,363.88	
	DASSAULT SYSTEMS SA	8,810	62.86	553,796.60	
	INDRA SISTEMAS SA	14,343	10.60	152,035.80	
	SAP AG	137,337	50.29	6,906,677.73	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,952	14.77	250,465.80	
	ALCATEL-LUCENT	350,104	1.95	683,753.11	
	NEOPOST SA	5,071	52.01	263,742.71	
	NOKIA OYJ	558,969	4.32	2,419,217.83	
	BELGACOM SA	23,346	23.67	552,599.82	
	DEUTSCHE TELEKOM AG (REGD)	419,248	8.79	3,686,447.66	
	ELISA CORPORATION-A SHS	21,104	17.18	362,566.72	
	FRANCE TELECOM SA	276,757	11.73	3,246,359.61	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	34,621	2.40	83,090.40	
	ILIAD SA	3,010	96.25	289,712.50	
	KONINKLIJKE KPN NV	220,535	8.10	1,787,656.71	
	MOBISTAR SA	4,718	36.08	170,225.44	
	PORTUGAL TELECOM SGPS SA (REGD	103,197	3.98	410,724.06	
	TELECOM ITALIA SPA	1,417,119	0.86	1,228,642.17	
	TELECOM ITALIA-RNC	899,454	0.70	633,215.61	
	TELEFONICA S.A.	613,097	12.86	7,884,427.42	
	TELEKOM AUSTRIA AG	50,994	8.80	448,747.20	
	VIVENDI SA	186,129	16.49	3,069,267.21	
	A2A SPA	157,578	0.75	119,128.96	

	ACCIONA S.A.	3,744	59.65	223,329.60	
	E.ON AG	268,801	16.96	4,558,864.96	
	EDP RENOVAVEIS SA	31,340	4.03	126,300.20	
	ELECTRICITE DE FRANCE	36,501	18.59	678,553.59	
	ENAGAS	27,481	15.13	415,924.93	
	ENEL GREEN POWER SPA	268,590	1.49	401,273.46	
	ENEL SPA	982,477	3.05	2,996,554.85	
	ENERGIAS DE PORTUGAL SA	284,868	2.17	620,442.50	
	FORTUM OYJ	67,023	18.50	1,239,925.50	
	GAS NATURAL SDG SA	52,372	12.63	661,720.22	
	GDF SUEZ	184,868	19.67	3,637,277.90	
	IBERDROLA SA	570,711	4.50	2,572,765.18	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	16,153	36.10	583,123.30	
	RWE AG	73,045	33.24	2,428,015.80	
	RWE AG-NON VTG PFD	5,510	31.01	170,865.10	
	SNAM SPA	239,865	3.61	865,912.65	
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	41,762	10.54	440,171.48	
	TERNA SPA	184,046	2.79	513,856.43	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	54,295	9.06	491,912.70	
	VERBUND AG	10,707	22.52	241,121.64	
	ASML HOLDING NV	64,375	34.55	2,224,156.25	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
ユーロ	INFINEON TECHNOLOGIES AG	163,978	7.58	1,243,937.10	
	STMICROELECTRONICS NV	97,805	5.45	533,330.66	
ユーロ 小計		25,942,455	—	329,898,163.59 (36,094,158,078)	
英ポンド	AMEC PLC	49,585	11.23	556,839.55	
	BG GROUP PLC	506,554	15.43	7,816,128.22	
	BP PLC	2,830,448	4.96	14,044,682.97	
	ESSAR ENERGY PLC	46,829	1.26	59,004.54	
	PETROFAC LTD	38,713	15.94	617,085.22	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	543,494	23.22	12,619,930.68	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	397,366	23.53	9,350,021.98	
	TULLOW OIL PLC	135,022	15.43	2,083,389.46	
	ANGLO AMERICAN PLC	197,530	26.93	5,320,470.55	
	ANTOFAGASTA PLC	59,503	13.36	794,960.08	
	BHP BILLITON PLC	315,247	20.73	6,535,070.31	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES	37,931	7.39	280,310.09	
	FRESNILLO PLC	27,519	18.64	512,954.16	
	GLENCORE INTERNATIONAL-W/I	206,656	4.36	901,640.12	
	JOHNSON MATTHEY PLC	32,043	23.36	748,524.48	
	KAZAKHMYS PLC	32,859	11.63	382,150.17	
	LONMIN PLC	25,471	10.85	276,360.35	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	13,805	73.35	1,012,596.75	
	REXAM PLC	130,897	4.17	545,840.49	
	RIO TINTO PLC	204,746	36.70	7,515,201.93	
	VEDANTA RESOURCES PLC	17,850	15.00	267,750.00	
	XSTRATA PLC	309,756	12.15	3,763,535.40	
	BAE SYSTEMS PLC	483,886	3.16	1,533,434.73	
	BALFOUR BEATTY PLC	102,589	2.85	293,096.77	
	BUNZL PLC	50,702	9.30	471,782.11	
	COBHAM PLC	166,630	1.88	313,431.03	
	INVENSYS PLC	124,280	2.12	263,473.60	
	MEGGITT PLC	117,278	3.88	455,155.91	

	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	279,449	8.10	2,264,934.14	
	SMITHS GROUP PLC	58,592	10.81	633,379.52	
	WEIR GROUP PLC/THE	31,545	22.36	705,346.20	
	WOLSELEY PLC	42,991	24.44	1,050,700.04	
	AGGREKO PLC	40,136	22.50	903,060.00	
	BABCOCK INTL GROUP PLC	55,104	7.45	410,524.80	
	CAPITA PLC	92,542	7.47	691,751.45	
	EXPERIAN PLC	149,987	9.45	1,418,127.08	
	G4S PLC	210,556	2.86	604,085.16	
	INTERTEK GROUP PLC	23,906	22.86	546,491.16	
	SERCO GROUP PLC	75,727	5.62	425,585.74	
	GKN PLC	231,821	2.35	545,938.45	
	BURBERRY GROUP PLC	65,466	14.21	930,271.86	
	CARNIVAL PLC	26,980	18.72	505,065.60	
	COMPASS GROUP PLC	283,554	6.36	1,803,403.44	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	43,350	14.05	609,067.50	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
英ポンド	TUI TRABEL PLC	75,914	2.00	152,511.22	
	WHITBREAD PLC	27,191	17.03	463,062.73	
	BRITISH SKY BROADCASTING PLC	169,936	6.88	1,169,159.68	
	ITV PLC	557,486	0.80	446,546.28	
	PEARSON PLC	121,738	12.51	1,522,942.38	
	REED ELSEVIER PLC	183,553	5.56	1,020,554.68	
	WPP PLC	188,320	8.01	1,509,384.80	
	KINGFISHER PLC	356,729	2.81	1,002,765.21	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	239,209	3.53	845,364.60	
	NEXT PLC	25,720	27.60	709,872.00	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	323,779	2.89	937,016.42	
	SAINSBURY (J) PLC	182,145	3.01	549,167.17	
	TESCO PLC	1,196,705	3.18	3,807,915.31	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	53,755	12.19	655,273.45	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	293,971	31.27	9,192,473.17	
	DIAGEO PLC	372,910	14.94	5,573,139.95	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	150,446	25.08	3,773,185.68	
	SABMILLER PLC	142,378	25.73	3,663,385.94	
	TATE & LYLE PLC	70,524	6.97	491,552.28	
	UNILEVER PLC	191,569	20.50	3,927,164.50	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	92,434	34.21	3,162,167.14	
	SMITH & NEPHEW PLC	134,708	6.28	846,639.78	
	ASTRAZENECA PLC	194,476	28.56	5,554,234.56	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	753,464	14.03	10,574,867.24	
	SHIRE PLC	83,954	22.22	1,865,457.88	
	BARCLAYS PLC	1,729,406	2.47	4,282,873.95	
	HSBC HLDGS PLC	2,666,938	5.74	15,332,226.56	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,154,847	0.35	2,199,126.83	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,680,981	0.28	764,883.87	
	STANDARD CHARTERED PLC	355,440	16.38	5,822,107.20	
	3I GROUP PLC	148,984	1.96	292,008.64	
	ICAP PLC	82,261	3.95	324,930.95	
	INVESTEC PLC	76,017	4.02	306,120.45	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	23,445	9.38	220,031.32	
	MAN GROUP PLC	284,541	1.34	382,423.10	
	SCHRODERS PLC	16,868	15.72	265,164.96	
	ADMIRAL GROUP PLC	31,120	10.47	325,826.40	

	AVIVA PLC	432,000	3.73	1,614,816.00	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	885,946	1.22	1,081,740.06	
	OLD MUTUAL PLC	834,105	1.60	1,339,572.63	
	PRUDENTIAL PLC	380,291	7.22	2,745,701.02	
	RESOLUTION LTD	205,409	2.65	544,333.85	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	531,852	1.08	578,654.97	
	STANDARD LIFE PLC	356,927	2.35	840,206.15	
	SAGE GROUP PLC	196,437	3.08	605,615.27	
	BT GROUP PLC	1,160,392	2.16	2,512,248.68	
	INMARSAT PLC	66,872	4.80	320,985.60	
	VODAFONE GROUP PLC	7,504,059	1.71	12,888,221.33	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
英ポンド	CENTRICA PLC	772,107	2.98	2,305,511.50	
	INTERNATIONAL POWER PLC	230,583	3.45	796,664.26	
	NATIONAL GRID PLC	531,322	6.45	3,429,683.51	
	SEVERN TRENT PLC	35,462	15.40	546,114.80	
	SSE PLC	140,060	12.78	1,789,966.80	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	102,873	6.03	620,324.19	
	ARM HOLDINGS PLC	203,509	5.74	1,168,141.66	
英ポンド 小計		43,920,963	—	223,044,584.35 (28,786,134,056)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	49,844	45.88	2,286,842.72	
	GIVAUDAN-REG	1,241	876.00	1,087,116.00	
	HOLCIM LTD-REG	36,616	58.65	2,147,528.40	
	SIKA AG-BR	314	1,990.00	624,860.00	
	SYNGENTA AG	14,120	299.20	4,224,704.00	
	ABB LTD	327,194	18.79	6,147,975.26	
	GEBERIT AG-REG	5,908	194.80	1,150,878.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,386	109.80	371,782.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,256	111.30	807,592.80	
	SULZER AG-REG	3,580	125.50	449,290.00	
	ADECCO SA-REG	19,775	46.82	925,865.50	
	SGS SA	827	1,719.00	1,421,613.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	8,149	123.20	1,003,956.80	
	CIE FINANC RICHEMONT-BR A	77,914	54.45	4,242,417.30	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,604	404.30	1,861,397.20	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	6,481	70.50	456,910.50	
	ARYZTA AG	12,968	44.70	579,669.60	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	282	904.00	254,928.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	134	2,758.00	369,572.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	17	32,770.00	557,090.00	
	NESTLE SA-REGISTERD	492,556	55.45	27,312,230.20	
	SONOVA HOLDING AG	7,334	102.50	751,735.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,124	143.70	161,518.80	
	SYNTHES INC	9,853	157.00	1,546,921.00	
	ACTELION LTD-REG	16,984	34.81	591,213.04	
	LONZA GROUP AG-REG	7,504	49.53	371,673.12	
	NOVARTIS AG-REG SHS	348,338	51.50	17,939,407.00	
	ROCHE HLDGS AG GENUSSCHINE	104,864	159.30	16,704,835.20	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	170,302	24.92	4,243,925.84	
	GAM HOLDING LTD	29,620	12.20	361,364.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	31,179	36.24	1,129,926.96	
	PARGESA HOLDING SA-BR	4,249	67.35	286,170.15	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,081	169.60	352,937.60	

	UBS AG REG	543,212	12.88	6,996,570.56	
	BALOISE HOLDING AG-REG	7,186	71.35	512,721.10	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	4,678	101.80	476,220.40	
	SWISS RE LTD	51,534	53.85	2,775,105.90	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	21,975	226.50	4,977,337.50	
	SWISSCOM AG (REG)	3,518	362.10	1,273,867.80	
スイスフラン 小計		2,438,701	—	119,737,671.45 (10,876,970,074)	

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	LUNDIN PETROLEUM AB	33,579	153.50	5,154,376.50	
	BOLIDEN AB	41,978	117.20	4,919,821.60	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,461	194.00	1,447,434.00	
	SSAB AB-A SHARES	23,359	71.25	1,664,328.75	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	87,176	114.50	9,981,652.00	
	ALFA LAVAL AB	50,087	135.30	6,776,771.10	
	ASSA ABLOY AB B	46,893	197.50	9,261,367.50	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	100,230	172.90	17,329,767.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	58,244	154.10	8,975,400.40	
	SANDVIK AB	149,914	103.80	15,561,073.20	
	SCANIA AB-B SHS	47,763	129.00	6,161,427.00	
	SKANSKA AB-B SHS	59,693	120.40	7,187,037.20	
	SKF AB-B SHS	59,062	170.50	10,070,071.00	
	VOLVO AB-B SHS	207,719	94.60	19,650,217.40	
	SECURITAS AB-B SHS	46,737	64.35	3,007,525.95	
	ELECTROLUX AB-SER B	35,907	140.40	5,041,342.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	69,587	40.02	2,784,871.74	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	7,294	327.20	2,386,596.80	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	152,614	239.70	36,581,575.80	
	SWEDISH MATCH AB	31,793	248.70	7,906,919.10	
	GETINGE AB-B SHS	29,874	187.00	5,586,438.00	
	NORDEA BANK AB	392,661	63.20	24,816,175.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK-A	212,831	48.94	10,415,949.14	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	73,115	218.90	16,004,873.50	
	SWEDBANK AB - A SHARES	122,142	112.10	13,692,118.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	16,631	100.20	1,666,426.20	
	INVESTOR AB-B SHS	68,728	147.70	10,151,125.60	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	31,030	148.30	4,601,749.00	
	RATOS AB-B SHS	29,254	87.65	2,564,113.10	
	ERICSSON(L.M.)TEL CLASS B	449,509	67.70	30,431,759.30	
	HEXAGON AB-B SHS	37,826	133.80	5,061,118.80	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	11,521	731.00	8,421,851.00	
	TELE2 AB -B SHS	47,379	133.30	6,315,620.70	
	TELIASONERA AB	323,153	48.10	15,543,659.30	
スウェーデンクローナ 小計		3,162,744	—	337,122,553.88 (4,187,062,119)	
ノルウェークローネ	AKER SOLUTIONS ASA	23,626	97.50	2,303,535.00	
	SEADRILL LTD	49,028	227.60	11,158,772.80	
	STATOIL ASA	166,578	157.10	26,169,403.80	
	SUBSEA 7 SA	42,007	132.60	5,570,128.20	
	NORSK HYDRO ASA	138,968	34.24	4,758,264.32	
	YARA INTERNATIONAL ASA	28,329	279.00	7,903,791.00	
	ORKLA ASA	116,441	46.68	5,435,465.88	
	DNB ASA	147,461	70.10	10,337,016.10	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	31,447	64.80	2,037,765.60	

	TELENOR ASA	108,017	103.00	11,125,751.00	
ノルウェークローネ 小計		851,902	—	86,799,893.70 (1,267,278,448)	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
デンマーク クローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	34,415	168.30	5,792,044.50	
	VESTAS WIND SYSTEM AS	31,264	58.35	1,824,254.40	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	84	43,560.00	3,659,040.00	
	A P MOLLER MAERSK A/S	199	45,520.00	9,058,480.00	
	DSV A/S	28,360	128.00	3,630,080.00	
	CARLSBERG AS-B	15,967	448.00	7,153,216.00	
	COLOPLAST-B	3,436	905.00	3,109,580.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	3,438	498.90	1,715,218.20	
	NOVO NORDISK AS-B	63,475	794.00	50,399,150.00	
	DANSKE BANK AS	98,413	95.95	9,442,727.35	
	TRYG A/S	3,675	299.90	1,102,132.50	
	TDC A/S	56,979	43.49	2,478,016.71	
デンマーククローネ 小計		339,705	—	99,363,939.66 (1,461,643,552)	
オーストラリ アドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	19,071	12.98	247,541.58	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	160,694	14.03	2,254,536.82	
	SANTOS	142,262	14.07	2,001,626.34	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	95,752	37.86	3,625,170.72	
	WORLEYPARSONS LTD	28,862	29.60	854,315.20	
	ALUMINA LTD	374,521	1.24	464,406.04	
	AMCOR LTD	185,228	7.10	1,315,118.80	
	BHP BILLITON LTD	479,346	36.54	17,515,302.84	
	BORAL LIMITED	114,770	4.47	513,021.90	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	185,906	5.39	1,002,033.34	
	ILUKA RESOURCES LIMITED	63,178	16.65	1,051,913.70	
	INCITEC PIVOT LTD	243,103	3.33	809,532.99	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	65,986	7.59	500,833.74	
	LYNAS CORP LTD	261,311	1.29	337,091.19	
	NEWCREST MINING LIMITED	114,258	34.55	3,947,613.90	
	ORICA LIMITED	54,919	26.62	1,461,943.78	
	OZ MINERALS LTD	47,202	10.92	515,445.84	
	RIO TINTO LTD	65,041	68.09	4,428,641.69	
	SIMS METAL MANAGEMENT LTD	25,836	15.02	388,056.72	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	23,242	25.66	596,389.72	
	BRAMBLES LTD	223,339	7.26	1,621,441.14	
	CAMPBELL BROTHERS LTD	10,076	59.00	594,484.00	
	ASCIANO LTD	149,699	4.90	733,525.10	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	159,503	1.68	267,965.04	
	QR NATIONAL LTD	254,935	3.93	1,001,894.55	
	TOLL HOLDINGS LIMITED	101,794	5.68	578,189.92	
	TRANSURBAN GROUP	197,024	5.64	1,111,215.36	
	CROWN LTD	59,796	8.30	496,306.80	
	ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	107,693	4.30	463,079.90	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	107,693	2.80	301,540.40	
	TATTS GROUP LTD	202,391	2.55	516,097.05	
	FAIRFAX MEDIA LTD	351,320	0.79	279,299.40	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	76,332	2.15	164,113.80	
	METCASH LTD	116,059	4.20	487,447.80	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
オーストラリアドル	WESFARMERS LTD	150,140	29.23	4,388,592.20	
	WOOLWORTHS LIMITED	183,570	25.16	4,618,621.20	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	85,030	12.15	1,033,114.50	
	COCHLEAR LIMITED	8,709	60.44	526,371.96	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	20,653	18.16	375,058.48	
	SONIC HEALTHCARE LTD	56,635	11.85	671,124.75	
	CSL LIMITED	78,123	32.90	2,570,246.70	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	393,265	22.20	8,730,483.00	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	56,379	7.89	444,830.31	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	235,193	49.70	11,689,092.10	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	329,000	23.52	7,738,080.00	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	452,366	20.78	9,400,165.48	
	ASX LTD	26,141	32.10	839,126.10	
	MACQUARIE GROUP LTD	52,024	27.01	1,405,168.24	
	AMP LIMITED	424,254	4.19	1,777,624.26	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	310,315	3.25	1,008,523.75	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	164,870	11.61	1,914,140.70	
	SUNCORP GROUP LTD	194,134	8.26	1,603,546.84	
	COMPUTERSHARE LTD	68,227	7.74	528,076.98	
	TELSTRA CORPORATION LTD	650,035	3.26	2,119,114.10	
	AGL ENERGY LTD	70,723	13.67	966,783.41	
	SP AUSNET	219,745	1.00	219,745.00	
オーストラリアドル 小計		9,097,673	—	117,014,767.17 (10,152,201,199)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	104,147	6.40	666,540.80	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	145,568	2.47	359,552.96	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	87,272	3.82	333,379.04	
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	295,397	2.16	638,057.52	
	CONTACT ENERGY LIMITED	56,144	4.83	271,175.52	
ニュージーランドドル 小計		688,528	—	2,268,705.84 (153,863,630)	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA LTD	319,000	76.80	24,499,200.00	
	NWS HOLDINGS LTD	213,500	12.98	2,771,230.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	186,000	14.72	2,737,920.00	
	MTR CORPORATION	222,000	26.90	5,971,800.00	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	31,500	53.15	1,674,225.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	116,500	25.65	2,988,225.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	190,000	19.02	3,613,800.00	
	SANDS CHINA LTD	364,400	28.65	10,440,060.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	212,000	18.52	3,926,240.00	
	SJM HOLDINGS LTD	254,000	15.58	3,957,320.00	
	WYNN MACAU LTD	238,800	19.90	4,752,120.00	
	LI & FUNG LTD	856,400	18.00	15,415,200.00	
	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	89,500	19.92	1,782,840.00	
	BANK OF EAST ASIA LIMITED	237,020	30.25	7,169,855.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	558,500	21.75	12,147,375.00	
	HANG SENG BANK LTD	115,400	103.10	11,897,740.00	
	WING HANG BANK LIMITED	27,000	74.10	2,000,700.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
香港ドル	FIRST PACIFIC CO	332,000	8.38	2,782,160.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	153,200	144.50	22,137,400.00	
	AIA GROUP LTD	1,258,400	28.30	35,612,720.00	

	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	208,000	111.00	23,088,000.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	131,000	53.65	7,028,150.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	368,000	28.75	10,580,000.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	144,585	48.05	6,947,309.25	
	HOPEWELL HOLDINGS	82,000	22.80	1,869,600.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	99,000	33.90	3,356,100.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	106,000	35.75	3,789,500.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	537,000	10.46	5,617,020.00	
	SINO LAND CO	446,600	13.92	6,216,672.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	211,000	119.40	25,193,400.00	
	SWIRE PACIFIC CL A	108,500	86.50	9,385,250.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	229,000	46.25	10,591,250.00	
	WHEELOCK & CO LTD	137,000	25.80	3,534,600.00	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	309,000	5.52	1,705,680.00	
	PCCW LTD	622,000	3.00	1,866,000.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	71,000	44.55	3,163,050.00	
	CLP HOLDINGS LTD	287,500	66.45	19,104,375.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	715,973	19.18	13,732,362.14	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	209,500	56.10	11,752,950.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	29,600	109.40	3,238,240.00	
香港ドル 小計		11,027,378	—	350,037,638.39 (3,668,394,450)	
シンガポールドル	COSCO CORP SINGAPORE LTD	143,000	1.21	173,030.00	
	FRASER & NEAVE LTD	139,500	6.60	920,700.00	
	KEPPEL CORP LTD	215,500	10.93	2,355,415.00	
	NOBLE GROUP LTD	590,145	1.39	823,252.27	
	SEMBCORP INDUSTRIES LIMITED	151,000	5.17	780,670.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	125,400	5.26	659,604.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	229,000	3.13	716,770.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	272,000	1.33	363,120.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	296,000	1.51	446,960.00	
	NEPTUNE ORIENT LINES LTD	140,000	1.34	187,600.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	82,600	10.70	883,820.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	910,400	1.63	1,488,504.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	235,250	3.74	879,835.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	16,000	45.28	724,480.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	228,800	2.32	530,816.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,007,720	0.75	755,790.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	290,000	5.12	1,484,800.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	264,000	14.16	3,738,240.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	384,000	8.99	3,452,160.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	188,000	18.11	3,404,680.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	128,000	7.16	916,480.00	
	CAPITALAND LIMITED	383,000	3.10	1,187,300.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	196,000	1.56	306,740.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額 単価	評価額 金額	備考
シンガポールドル	CITY DEVELOPMENTS LTD	77,000	11.23	864,710.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	275,000	2.15	591,250.00	
	KEPPEL LAND LTD	105,000	3.47	364,350.00	
	UOL GROUP LTD	67,400	4.79	322,846.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,189,880	3.12	3,712,425.60	
	STARHUB LTD	87,000	2.92	254,040.00	
シンガポールドル 小計		8,416,595	—	33,290,387.87 (2,151,557,768)	

イスラエルシェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	68,212	40.98	2,795,327.76	
	ISRAEL CORP LTD	327	2,300.00	752,100.00	
	DELEK GROUP LTD	633	695.00	439,935.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,688	136.00	501,568.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	141,901	166.30	23,598,136.30	
	BANK HAPOALIM BM	162,589	12.03	1,955,945.67	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	180,928	11.12	2,011,919.36	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	112,026	4.90	548,927.40	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	19,485	30.20	588,447.00	
	NICE SYSTEMS LTD	9,047	128.00	1,158,016.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	269,518	6.15	1,657,535.70	
	CELLCOM ISRAEL LTD	7,107	51.81	368,213.67	
	PARTNER COMMUNICATIONS CO	12,263	28.70	351,948.10	
イスラエルシェケル 小計		987,724	—	36,728,019.96 (788,183,308)	
合計		157,445,984	—	267,097,527,369 (267,097,527,369)	

B．株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	789,000	627,255.00	
	米ドル 小計		789,000	627,255.00 (50,989,558)	
	オーストラリアドル	APA GROUP	81,113	390,153.53	
		LEND LEASE GROUP	83,243	630,981.94	
		SYDNEY AIRPORT	61,192	160,323.04	
	オーストラリアドル 小計		225,548	1,181,458.51 (102,503,340)	
	香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	13,521	73,419.03	
	香港ドル 小計		13,521	73,419.03 (769,431)	
投資信託受益証券 合計			1,028,069	154,262,329 (154,262,329)	
投資証券	米ドル	AMERICAN TOWER CORP	58,700	3,766,192.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	144,800	2,408,024.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,229	1,892,457.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	22,200	2,278,164.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,700	1,111,403.00	
		DUKE REALTY CORP	37,800	527,688.00	

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	米ドル	EQUITY RESIDENTIAL	44,300	2,572,058.00	
		FED REALTY INVS TRUST	9,600	931,872.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	62,897	1,052,266.81	
		HCP INC	60,900	2,379,972.00	
		HEALTH CARE REIT INC	31,400	1,705,020.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	106,581	1,703,164.38	
		KIMCO REALTY CORP	60,800	1,136,960.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	17,700	600,915.00	
		MACERICH CO	20,000	1,086,800.00	
		PLUM CREEK TIMBER CO	24,100	941,105.00	
		PROLOGIS INC	68,440	2,318,747.20	
		PUBLIC STORAGE INC	21,900	3,002,928.00	
		RAYONIER INC	18,400	820,272.00	
		REGENCY CENTERS CORP	13,800	593,124.00	

		SIMON PROPERTY GROUP INC	43,865	5,994,590.90	
		VENTAS INC	43,000	2,408,000.00	
		VORNADO REALTY TRUST	25,049	2,122,401.77	
	米ドル 小計		966,161	43,354,125.06 (3,524,256,826)	
	カナダドル	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	12,000	283,200.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	20,000	534,800.00	
	カナダドル 小計		32,000	818,000.00 (66,454,320)	
	ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	0.00	
		CORIO NV	9,207	331,498.03	
		FONCIERE DES REGIONS	4,215	233,005.20	
		GECINA SA	3,446	252,901.94	
		ICADE	3,666	224,872.44	
		KLEPIERRE	16,009	379,253.21	
		UNIBAIL	13,721	1,995,033.40	
	ユーロ 小計		1,655,848	3,416,564.22 (373,806,291)	
	英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	127,416	610,067.80	
		CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	85,721	290,422.74	
		HAMMERSON PLC	101,570	406,381.57	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	116,066	794,471.77	
		SEGRO PLC	106,565	251,067.14	
	英ポンド 小計		537,338	2,352,411.02 (303,602,166)	
	オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	282,061	504,889.19	
		DEXUS PROPERTY GROUP	742,693	672,137.16	
		GOODMAN GROUP	1,048,570	702,541.90	
		GPT GROUP	263,865	820,620.15	
		MIRVAC GROUP	524,429	624,070.51	
		STOCKLAND	346,379	1,080,702.48	
		WESTFIELD GROUP	327,406	2,864,802.50	
		WESTFIELD RETAIL TRUST	433,070	1,065,352.20	
	オーストラリアドル 小計		3,968,473	8,335,116.09 (723,154,671)	

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	香港ドル	LINK REIT	339,500	9,760,625.00	
	香港ドル 小計		339,500	9,760,625.00 (102,291,350)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	271,000	544,710.00	
		CAPITAMALL TRUST	337,600	594,176.00	
	シンガポールドル 小計		608,600	1,138,886.00 (73,606,202)	
投資証券 合計			8,107,920	5,167,171,826 (5,167,171,826)	
合計			—	5,321,434,155 (5,321,434,155)	

（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	587	97.7%	0.0%	2.3%	57.2%
カナダドル	103	99.6%	—	0.4%	5.7%
ユーロ	251	99.0%	—	1.0%	13.4%
英ポンド	104	99.0%	—	1.0%	10.7%
スイスフラン	39	100.0%	—	—	4.0%
スウェーデンクローナ	34	100.0%	—	—	1.5%
ノルウェークローネ	10	100.0%	—	—	0.5%
デンマーククローネ	12	100.0%	—	—	0.5%
オーストラリアドル	67	92.5%	0.9%	6.6%	4.0%
ニュージーランドドル	5	100.0%	—	—	0.1%
香港ドル	42	97.3%	0.0%	2.7%	1.4%
シンガポールドル	31	96.7%	—	3.3%	0.8%
イスラエルシェケル	13	100.0%	—	—	0.3%
合計	1,298	98.0%	0.1%	1.9%	100.0%

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

② 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表
該当事項はありません。

⑤ 商品明細表
該当事項はありません。

⑥ 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

⑦ その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表
該当事項はありません。

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24年２月27日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,109,387,875
コール・ローン	4,756,577,135
国債証券	414,354,154,239
派生商品評価勘定	312,211,962
未収利息	4,536,246,797
前払費用	214,486,781
差入委託証拠金	136,346,256
流動資産合計	425,419,411,045
資産合計	425,419,411,045
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	43,033,634
未払解約金	219,007,107
流動負債合計	262,040,741
負債合計	262,040,741
純資産の部	
元本等	
元本	269,111,984,462
剰余金	
剰余金	156,045,385,842
純資産合計	425,157,370,304
負債・純資産合計	425,419,411,045

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成24年２月27日現在
１．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。

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

（貸借対照表に関する注記）

	平成24年２月27日現在
１．計算日における受益権総数	269,111,984,462 口
２．１口当たり純資産額 （１万口当たり純資産額）	1.5799 円 (15,799 円)

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

平成24年２月27日現在
１．金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

２．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

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

３．金融商品に係るリスク管理体制

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

平成24年２月27日現在
１．貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２．時価の算定方法 （１）国債証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 （２）デリバティブ取引 「（その他の注記）」の「３．デリバティブ取引関係」に記載しております。 （３）コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 ３．金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 ４．金銭債権の計算日後の償還予定額 金銭債権は全て１年以内に償還予定であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

平成24年２月27日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

平成24年２月27日現在
該当事項はありません。

（その他の注記）

１．元本の変動

平成24年２月27日現在	
特定期間／計算期間の期首元本額	276,106,206,555 円
特定期間／計算期間中の追加設定元本額	11,400,841,765 円
特定期間／計算期間中の一部解約元本額	18,395,063,858 円
計算日の元本額	269,111,984,462 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	5,849,355,739 円
中央三井ＤＣ外国債券インデックスファンド	1,856,358,606 円
中央三井ＤＣ外国債券インデックスファンドＬ	8,773,417,521 円
物価連動債組入世界債券ファンド	100,199,185 円
中央三井ＤＣバランスファンド３０	108,882,041 円
中央三井ＤＣバランスファンド５０	161,756,967 円
中央三井ＤＣバランスファンド７０	32,148,428 円
ベスタ・世界６資産ファンド（毎月決算型）	135,449,939 円
ベスタ・世界６資産ファンド（１年決算型）	85,502,002 円
新生・４分散ファンド	107,778,324 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	442,115,417 円
４資産インデックスバランスオープン（分配型）	34,409,947 円
４資産インデックスバランスオープン（成長型）	99,757,267 円
ＣＭＡＭ外国債券インデックスｅ	625,890,087 円
中央三井インデックスコレクション（外国債券）	1,043,049,261 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式３０）	106,497,699 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式５０）	150,255,606 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式７０）	46,211,576 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）	458,463,139 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）	17,599,571,690 円
中央三井バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	7,991,075,126 円
中央三井バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	25,719,743,509 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）	90,465,531,832 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）	4,786,371,940 円
中央三井ＶＡバランス株式３０（適格機関投資家専用）	119,845,317 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）	9,736,329,998 円
中央三井バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	7,500,828,365 円
中央三井バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	2,127,913,081 円
中央三井バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	20,100,968,777 円
中央三井バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	734,626,676 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）	33,976,194,576 円
中央三井ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	5,737,282,123 円
中央三井ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	528,836,028 円

中央三井バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	2,675,509,451 円
中央三井ＶＡバランス株式４０（適格機関投資家専用）	2,723,100,257 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）	412,623,262 円
ＣＭＡＭ・ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	165,730,796 円
中央三井バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	3,740,838,756 円
中央三井ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	6,931,920,391 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）	964,259,758 円
中央三井世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	307,197,571 円
ＣＭＡＭ・ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	3,749,236,404 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）	48,316,878 円
中央三井世界バランスＶＡ２０（適格機関投資家専用）	1,794,975 円

２．有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成24年２月27日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△763,369,170
合計	△763,369,170

（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24年２月８日から平成24年２月27日まで）に対応するものです。

３．デリバティブ取引関係

Ⅰ．ヘッジ会計が適用されていないもの

債券関連

区分	種類	平成24年２月27日現在			
		契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引 買 建	3,202,998,156	―	3,205,658,484	2,660,328
合計		3,202,998,156	―	3,205,658,484	2,660,328

（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24年２月27日現在			
		契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買 建				
	米ドル	2,408,281,500	―	2,519,370,000	111,088,500
	カナダドル	263,763,500	―	276,046,000	12,282,500
	ユーロ	2,443,022,400	―	2,603,482,000	160,459,600
	英ポンド	465,154,200	―	490,276,000	25,121,800
	計	5,580,221,600	―	5,889,174,000	308,952,400
	売 建				
	米ドル	612,362,850	―	625,779,000	△13,416,150
	カナダドル	63,765,250	―	64,952,000	△1,186,750
	ユーロ	632,225,800	―	656,340,000	△24,114,200
	英ポンド	131,753,700	―	135,471,000	△3,717,300
	計	1,440,107,600	―	1,482,542,000	△42,434,400
合計		7,020,329,200	―	7,371,716,000	266,518,000

（注）時価の算定方法

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

① 計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値によって評価しております。

② 計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

Ⅱ．ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年２月27日現在
該当事項はありません。

次へ

（３）附属明細表（平成24年２月27日現在）

① 有価証券明細表

A．株式

該当事項はありません。

B．株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B	0.625%	2013/01/31	6,570,000	6,596,690.62	
		US TREASURY N/B	2.875%	2013/01/31	17,740,000	18,177,956.25	
		US TREASURY N/B	1.375%	2013/02/15	1,000,000	1,011,328.13	
		US TREASURY N/B	3.875%	2013/02/15	9,650,000	9,992,273.43	
		US TREASURY N/B	0.625%	2013/02/28	27,450,000	27,567,949.35	
		US TREASURY N/B	2.750%	2013/02/28	15,630,000	16,029,297.73	
		US TREASURY N/B	1.375%	2013/03/15	9,880,000	9,998,096.92	
		US TREASURY N/B	0.750%	2013/03/31	8,200,000	8,246,125.00	
		US TREASURY N/B	1.750%	2013/04/15	24,000,000	24,406,875.12	
		US TREASURY N/B	0.625%	2013/04/30	13,700,000	13,761,007.88	
		US TREASURY N/B	3.125%	2013/04/30	12,700,000	13,136,562.50	
		US TREASURY N/B	1.375%	2013/05/15	10,000,000	10,137,500.00	
		US TREASURY N/B	3.625%	2013/05/15	10,000,000	10,410,937.50	
		US TREASURY N/B	0.500%	2013/05/31	14,970,000	15,016,781.25	
		US TREASURY N/B	1.125%	2013/06/15	11,410,000	11,537,471.15	
		US TREASURY N/B	0.375%	2013/06/30	1,000,000	1,001,640.63	
		US TREASURY N/B	1.000%	2013/07/15	17,030,000	17,204,291.49	
		US TREASURY N/B	0.375%	2013/07/31	5,000,000	5,007,812.50	
		US TREASURY N/B	3.375%	2013/07/31	17,810,000	18,603,101.56	
		US TREASURY N/B	0.750%	2013/08/15	15,000,000	15,104,296.95	
		US TREASURY N/B	4.250%	2013/08/15	6,930,000	7,334,971.87	
		US TREASURY N/B	0.125%	2013/08/31	9,600,000	9,578,250.04	
		US TREASURY N/B	3.125%	2013/08/31	3,210,000	3,347,929.68	
		US TREASURY N/B	0.750%	2013/09/15	15,000,000	15,101,953.20	
		US TREASURY N/B	0.125%	2013/09/30	21,000,000	20,947,500.00	
		US TREASURY N/B	0.500%	2013/10/15	13,700,000	13,746,023.50	
		US TREASURY N/B	0.250%	2013/10/31	10,000,000	9,992,968.80	
		US TREASURY N/B	2.750%	2013/10/31	21,600,000	22,497,750.00	
		US TREASURY N/B	0.500%	2013/11/15	32,000,000	32,100,000.00	
		US TREASURY N/B	4.250%	2013/11/15	2,140,000	2,284,450.00	
		US TREASURY N/B	0.250%	2013/11/30	12,400,000	12,389,343.81	
		US TREASURY N/B	2.000%	2013/11/30	6,500,000	6,693,476.59	
		US TREASURY N/B	0.750%	2013/12/15	2,000,000	2,015,312.50	
		US TREASURY N/B	0.125%	2013/12/31	1,000,000	996,640.63	
		US TREASURY N/B	1.500%	2013/12/31	40,120,000	40,994,490.82	
		US TREASURY N/B	1.750%	2014/01/31	18,900,000	19,416,796.87	
		US TREASURY N/B	4.000%	2014/02/15	4,000,000	4,288,125.00	
		US TREASURY N/B	1.875%	2014/02/28	2,000,000	2,061,562.50	
		US TREASURY N/B	1.250%	2014/03/15	15,100,000	15,383,125.00	
		US TREASURY N/B	1.750%	2014/03/31	13,000,000	13,381,875.00	
		US TREASURY N/B	1.250%	2014/04/15	5,110,000	5,207,808.61	
		US TREASURY N/B	1.875%	2014/04/30	6,880,000	7,106,287.53	
		US TREASURY N/B	1.000%	2014/05/15	4,900,000	4,969,671.87	
		US TREASURY N/B	4.750%	2014/05/15	9,300,000	10,203,843.75	
		US TREASURY N/B	2.250%	2014/05/31	5,000,000	5,211,718.75	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B	0.750%	2014/06/15	10,000,000	10,087,500.00	
		US TREASURY N/B	2.625%	2014/06/30	13,000,000	13,686,562.50	

		US TREASURY N/B	0.625%	2014/07/15	2,000,000	2,011,562.50	
		US TREASURY N/B	2.625%	2014/07/31	32,650,000	34,417,691.56	
		US TREASURY N/B	0.500%	2014/08/15	13,000,000	13,034,531.25	
		US TREASURY N/B	4.250%	2014/08/15	12,550,000	13,736,367.18	
		US TREASURY N/B	2.375%	2014/08/31	26,000,000	27,277,656.38	
		US TREASURY N/B	0.250%	2014/09/15	18,000,000	17,929,687.50	
		US TREASURY N/B	2.375%	2014/09/30	12,150,000	12,765,093.75	
		US TREASURY N/B	0.500%	2014/10/15	5,100,000	5,111,156.25	
		US TREASURY N/B	2.375%	2014/10/31	15,950,000	16,774,914.06	
		US TREASURY N/B	0.375%	2014/11/15	14,000,000	13,982,500.00	
		US TREASURY N/B	4.250%	2014/11/15	9,230,000	10,184,728.12	
		US TREASURY N/B	2.125%	2014/11/30	11,400,000	11,925,468.75	
		US TREASURY N/B	0.250%	2014/12/15	6,100,000	6,069,976.59	
		US TREASURY N/B	2.625%	2014/12/31	3,480,000	3,693,421.89	
		US TREASURY N/B	0.250%	2015/01/15	9,000,000	8,954,296.92	
		US TREASURY N/B	2.250%	2015/01/31	14,900,000	15,675,265.62	
		US TREASURY N/B	11.250%	2015/02/15	2,550,000	3,359,226.56	
		US TREASURY N/B	4.000%	2015/02/15	10,020,000	11,064,271.87	
		US TREASURY N/B	2.375%	2015/02/28	5,500,000	5,812,382.84	
		US TREASURY N/B	2.500%	2015/03/31	12,820,000	13,613,237.50	
		US TREASURY N/B	2.500%	2015/04/30	8,930,000	9,493,008.63	
		US TREASURY N/B	4.125%	2015/05/15	7,040,000	7,851,800.00	
		US TREASURY N/B	2.125%	2015/05/31	6,950,000	7,311,617.18	
		US TREASURY N/B	1.875%	2015/06/30	23,900,000	24,968,031.25	
		US TREASURY N/B	1.750%	2015/07/31	8,000,000	8,326,250.00	
		US TREASURY N/B	4.250%	2015/08/15	500,000	563,125.00	
		US TREASURY N/B	1.250%	2015/08/31	11,990,000	12,279,446.14	
		US TREASURY N/B	1.250%	2015/09/30	21,980,000	22,496,873.54	
		US TREASURY N/B	1.250%	2015/10/31	10,000,000	10,234,375.00	
		US TREASURY N/B	4.500%	2015/11/15	12,160,000	13,896,600.00	
		US TREASURY N/B	1.375%	2015/11/30	25,000,000	25,701,172.00	
		US TREASURY N/B	2.125%	2015/12/31	11,000,000	11,629,062.50	
		US TREASURY N/B	2.000%	2016/01/31	3,000,000	3,157,031.25	
		US TREASURY N/B	4.500%	2016/02/15	7,700,000	8,858,609.37	
		US TREASURY N/B	2.625%	2016/02/29	22,900,000	24,674,750.00	
		US TREASURY N/B	2.250%	2016/03/31	9,150,000	9,731,882.81	
		US TREASURY N/B	2.375%	2016/03/31	7,900,000	8,439,421.87	
		US TREASURY N/B	2.000%	2016/04/30	6,090,000	6,414,007.06	
		US TREASURY N/B	2.625%	2016/04/30	13,580,000	14,649,425.00	
		US TREASURY N/B	5.125%	2016/05/15	22,000,000	26,021,875.00	
		US TREASURY N/B	7.250%	2016/05/15	1,670,000	2,124,292.18	
		US TREASURY N/B	1.750%	2016/05/31	10,960,000	11,431,793.80	
		US TREASURY N/B	1.500%	2016/06/30	21,960,000	22,663,406.25	
		US TREASURY N/B	3.250%	2016/06/30	9,000,000	9,959,062.50	
		US TREASURY N/B	1.500%	2016/07/31	9,950,000	10,264,824.26	
		US TREASURY N/B	3.250%	2016/07/31	3,560,000	3,944,925.00	
		US TREASURY N/B	4.875%	2016/08/15	3,750,000	4,424,414.06	
		US TREASURY N/B	1.000%	2016/08/31	11,000,000	11,105,703.18	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B	3.000%	2016/08/31	1,030,000	1,130,907.81	
		US TREASURY N/B	1.000%	2016/09/30	10,000,000	10,088,281.30	
		US TREASURY N/B	3.000%	2016/09/30	4,000,000	4,396,250.00	
		US TREASURY N/B	1.000%	2016/10/31	9,000,000	9,075,234.42	
		US TREASURY N/B	3.125%	2016/10/31	5,400,000	5,969,531.25	
		US TREASURY N/B	4.625%	2016/11/15	2,450,000	2,879,515.62	

		US TREASURY N/B	7.500%	2016/11/15	8,250,000	10,804,921.87	
		US TREASURY N/B	0.875%	2016/11/30	2,000,000	2,003,593.76	
		US TREASURY N/B	2.750%	2016/11/30	15,500,000	16,880,468.75	
		US TREASURY N/B	0.875%	2016/12/31	9,500,000	9,508,164.11	
		US TREASURY N/B	3.250%	2016/12/31	9,800,000	10,910,156.25	
		US TREASURY N/B	3.125%	2017/01/31	5,000,000	5,539,843.75	
		US TREASURY N/B	4.625%	2017/02/15	18,500,000	21,858,906.25	
		US TREASURY N/B	3.000%	2017/02/28	31,550,000	34,798,664.06	
		US TREASURY N/B	3.250%	2017/03/31	15,300,000	17,073,843.75	
		US TREASURY N/B	3.125%	2017/04/30	4,900,000	5,440,531.25	
		US TREASURY N/B	4.500%	2017/05/15	15,530,000	18,335,106.25	
		US TREASURY N/B	8.750%	2017/05/15	2,700,000	3,779,578.12	
		US TREASURY N/B	2.750%	2017/05/31	9,900,000	10,811,109.37	
		US TREASURY N/B	2.500%	2017/06/30	2,200,000	2,373,593.75	
		US TREASURY N/B	2.375%	2017/07/31	2,000,000	2,144,687.50	
		US TREASURY N/B	1.875%	2017/08/31	2,000,000	2,090,312.50	
		US TREASURY N/B	1.875%	2017/09/30	1,210,000	1,263,504.68	
		US TREASURY N/B	1.875%	2017/10/31	4,900,000	5,116,671.87	
		US TREASURY N/B	4.250%	2017/11/15	4,350,000	5,119,406.25	
		US TREASURY N/B	2.250%	2017/11/30	2,000,000	2,130,937.50	
		US TREASURY N/B	2.750%	2017/12/31	11,000,000	12,022,656.25	
		US TREASURY N/B	2.625%	2018/01/31	25,250,000	27,443,593.75	
		US TREASURY N/B	3.500%	2018/02/15	4,000,000	4,546,250.00	
		US TREASURY N/B	2.750%	2018/02/28	290,000	317,414.06	
		US TREASURY N/B	2.875%	2018/03/31	4,800,000	5,286,000.00	
		US TREASURY N/B	2.625%	2018/04/30	5,600,000	6,083,875.00	
		US TREASURY N/B	3.875%	2018/05/15	2,040,000	2,370,862.50	
		US TREASURY N/B	2.375%	2018/05/31	1,100,000	1,176,828.12	
		US TREASURY N/B	2.375%	2018/06/30	4,960,000	5,307,975.00	
		US TREASURY N/B	2.250%	2018/07/31	15,000,000	15,918,750.00	
		US TREASURY N/B	1.500%	2018/08/31	6,500,000	6,587,343.75	
		US TREASURY N/B	1.375%	2018/09/30	10,520,000	10,561,093.75	
		US TREASURY N/B	1.750%	2018/10/31	16,630,000	17,095,120.31	
		US TREASURY N/B	3.750%	2018/11/15	5,040,000	5,836,162.50	
		US TREASURY N/B	1.375%	2018/11/30	9,000,000	9,018,281.25	
		US TREASURY N/B	2.750%	2019/02/15	2,000,000	2,183,750.00	
		US TREASURY N/B	3.125%	2019/05/15	15,520,000	17,333,900.00	
		US TREASURY N/B	3.625%	2019/08/15	18,400,000	21,197,375.00	
		US TREASURY N/B	8.125%	2019/08/15	3,600,000	5,319,562.50	
		US TREASURY N/B	3.375%	2019/11/15	25,070,000	28,462,284.37	
		US TREASURY N/B	3.625%	2020/02/15	25,030,000	28,905,739.06	
		US TREASURY N/B	3.500%	2020/05/15	26,650,000	30,526,742.18	
		US TREASURY N/B	2.625%	2020/08/15	15,000,000	16,106,250.00	
		US TREASURY N/B	8.750%	2020/08/15	1,800,000	2,821,500.00	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B	2.625%	2020/11/15	15,000,000	16,075,781.25	
		US TREASURY N/B	3.625%	2021/02/15	31,230,000	36,046,251.56	
		US TREASURY N/B	3.125%	2021/05/15	9,190,000	10,200,900.00	
		US TREASURY N/B	2.125%	2021/08/15	25,400,000	25,904,031.25	
		US TREASURY N/B	2.000%	2021/11/15	24,320,000	24,437,800.00	
		US TREASURY N/B	8.000%	2021/11/15	6,100,000	9,464,531.25	
		US TREASURY N/B	7.250%	2022/08/15	1,000,000	1,502,343.75	
		US TREASURY N/B	7.125%	2023/02/15	1,450,000	2,175,679.68	
		US TREASURY N/B	6.250%	2023/08/15	10,080,000	14,308,875.00	
		US TREASURY N/B	7.500%	2024/11/15	4,690,000	7,400,673.43	

		US TREASURY N/B	7.625%	2025/02/15	800,000	1,277,625.00	
		US TREASURY N/B	6.875%	2025/08/15	6,340,000	9,632,837.50	
		US TREASURY N/B	6.000%	2026/02/15	1,040,000	1,477,125.00	
		US TREASURY N/B	6.500%	2026/11/15	2,150,000	3,208,203.12	
		US TREASURY N/B	6.625%	2027/02/15	2,500,000	3,781,250.00	
		US TREASURY N/B	6.375%	2027/08/15	3,940,000	5,863,212.50	
		US TREASURY N/B	6.125%	2027/11/15	2,700,000	3,938,203.12	
		US TREASURY N/B	5.500%	2028/08/15	5,250,000	7,263,867.18	
		US TREASURY N/B	5.250%	2028/11/15	3,350,000	4,524,593.75	
		US TREASURY N/B	5.250%	2029/02/15	1,600,000	2,164,750.00	
		US TREASURY N/B	6.125%	2029/08/15	2,200,000	3,263,906.25	
		US TREASURY N/B	6.250%	2030/05/15	3,520,000	5,327,300.00	
		US TREASURY N/B	5.375%	2031/02/15	7,480,000	10,417,068.75	
		US TREASURY N/B	4.500%	2036/02/15	8,320,000	10,559,900.00	
		US TREASURY N/B	5.000%	2037/05/15	5,830,000	7,947,018.75	
		US TREASURY N/B	4.375%	2038/02/15	3,200,000	4,006,500.00	
		US TREASURY N/B	4.500%	2038/05/15	9,500,000	12,128,828.12	
		US TREASURY N/B	3.500%	2039/02/15	4,770,000	5,182,157.81	
		US TREASURY N/B	4.250%	2039/05/15	15,510,000	19,072,453.12	
		US TREASURY N/B	4.500%	2039/08/15	19,450,000	24,853,453.12	
		US TREASURY N/B	4.375%	2039/11/15	14,800,000	18,562,437.50	
		US TREASURY N/B	4.625%	2040/02/15	14,700,000	19,165,125.00	
		US TREASURY N/B	4.375%	2040/05/15	11,800,000	14,816,375.00	
		US TREASURY N/B	3.875%	2040/08/15	26,910,000	31,148,325.00	
		US TREASURY N/B	4.250%	2040/11/15	14,820,000	18,242,493.75	
		US TREASURY N/B	4.750%	2041/02/15	7,900,000	10,514,406.25	
		US TREASURY N/B	4.375%	2041/05/15	13,550,000	17,034,890.62	
		US TREASURY N/B	3.750%	2041/08/15	12,440,000	14,076,637.50	
		US TREASURY N/B	3.125%	2041/11/15	2,700,000	2,716,453.12	
	米ドル 小計				1,912,450,000	2,087,621,452.04 (169,702,747,836)	
カナダドル	国債証券	CANADA-GOV'T	1.750%	2013/03/01	6,900,000	6,948,645.00	
		CANADA-GOV'T	3.500%	2013/06/01	2,590,000	2,668,891.40	
		CANADA-GOV'T	5.250%	2013/06/01	5,760,000	6,060,960.00	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2013/08/01	4,120,000	4,174,590.00	
		CANADA-GOV'T	2.500%	2013/09/01	4,020,000	4,106,028.00	
		CANADA-GOV'T	1.500%	2013/11/01	2,150,000	2,165,050.00	
		CANADA-GOV'T	1.000%	2014/02/01	280,000	279,594.00	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2014/03/01	3,380,000	3,440,704.80	
		CANADA-GOV'T	3.000%	2014/06/01	8,100,000	8,439,390.00	

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	5.000%	2014/06/01	2,790,000	3,030,916.50	
		CANADA-GOV'T	2.250%	2014/08/01	3,800,000	3,900,776.00	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2014/12/01	8,010,000	8,187,741.90	
		CANADA-GOV'T	1.000%	2015/02/01	3,850,000	3,828,324.50	
		CANADA-GOV'T	2.500%	2015/06/01	4,530,000	4,713,465.00	
		CANADA-GOV'T	4.500%	2015/06/01	3,100,000	3,422,741.00	
		CANADA-GOV'T	3.000%	2015/12/01	2,210,000	2,349,848.80	
		CANADA-GOV'T	2.000%	2016/06/01	1,200,000	1,232,712.00	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2016/06/01	6,470,000	7,179,176.70	
		CANADA-GOV'T	2.750%	2016/09/01	4,910,000	5,204,600.00	
		CANADA-GOV'T	1.500%	2017/03/01	2,410,000	2,418,194.00	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2017/06/01	4,950,000	5,582,709.00	
		CANADA-GOV'T	4.250%	2018/06/01	3,150,000	3,648,645.00	
		CANADA-GOV'T	3.750%	2019/06/01	8,670,000	9,843,918.00	

		CANADA-GOV'T	3.500%	2020/06/01	3,730,000	4,182,672.80	
		CANADA-GOV'T	3.250%	2021/06/01	3,560,000	3,925,968.00	
		CANADA-GOV'T	2.750%	2022/06/01	960,000	1,011,360.00	
		CANADA-GOV'T	8.000%	2023/06/01	1,900,000	2,999,967.00	
		CANADA-GOV'T	9.000%	2025/06/01	860,000	1,517,117.40	
		CANADA-GOV'T	8.000%	2027/06/01	2,050,000	3,512,388.00	
		CANADA-GOV'T	5.750%	2029/06/01	4,760,000	6,900,572.00	
		CANADA-GOV'T	5.750%	2033/06/01	4,970,000	7,481,390.70	
		CANADA-GOV'T	5.000%	2037/06/01	5,280,000	7,523,419.20	
		CANADA-GOV'T	4.000%	2041/06/01	6,180,000	7,885,680.00	
		CANADA-GOV'T	3.500%	2045/12/01	1,200,000	1,423,968.00	
	カナダドル 小計				132,800,000	151,192,124.70 (12,282,848,210)	
メキシコペソ	国債証券	MEXICAN BONOS	9.000%	2013/06/20	44,110,000	46,499,438.70	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2013/12/19	35,830,000	37,823,939.50	
		MEXICAN BONOS	7.000%	2014/06/19	28,270,000	29,593,036.00	
		MEXICAN BONOS	9.500%	2014/12/18	38,070,000	42,613,273.80	
		MEXICAN BONOS	6.000%	2015/06/18	26,600,000	27,383,370.00	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2015/12/17	22,840,000	25,072,153.20	
		MEXICAN BONOS	6.250%	2016/06/16	12,770,000	13,256,153.90	
		MEXICAN BONOS	7.250%	2016/12/15	21,990,000	23,795,379.00	
		MEXICAN BONOS	7.750%	2017/12/14	22,600,000	25,106,566.00	
		MEXICAN BONOS	8.500%	2018/12/13	17,750,000	20,525,567.50	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2020/06/11	38,260,000	42,855,791.20	
		MEXICAN BONOS	6.500%	2021/06/10	30,530,000	30,905,213.70	
		MEXICAN BONOS	8.000%	2023/12/07	10,140,000	11,387,017.20	
		MEXICAN BONOS	10.000%	2024/12/05	32,410,000	42,075,958.40	
		MEXICAN BONOS	7.500%	2027/06/03	36,430,000	38,150,224.60	
		MEXICAN BONOS	8.500%	2029/05/31	37,340,000	42,168,062.00	
		MEXICAN BONOS	7.750%	2031/05/29	8,000,000	8,293,680.00	
		MEXICAN BONOS	10.000%	2036/11/20	28,160,000	35,517,926.40	
		MEXICAN BONOS	8.500%	2038/11/18	35,130,000	38,543,582.10	
	メキシコペソ 小計				527,230,000	581,566,333.20 (3,658,052,235)	
ユーロ	国債証券 （ベルギー）	BELGIAN 0282	8.000%	2015/03/28	2,160,000	2,553,552.00	
		BELGIAN 0291	5.500%	2028/03/28	5,780,000	6,778,206.00	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券 （ベルギー）	BELGIAN 0300	5.500%	2017/09/28	2,720,000	3,096,992.00	
		BELGIAN 0301	4.250%	2013/09/28	4,420,000	4,621,994.00	
		BELGIAN 0303	4.250%	2014/09/28	4,250,000	4,517,750.00	
		BELGIAN 0304	5.000%	2035/03/28	6,080,000	6,821,760.00	
		BELGIAN 0306	3.750%	2015/09/28	6,920,000	7,328,280.00	
		BELGIAN 0307	3.250%	2016/09/28	5,400,000	5,601,960.00	
		BELGIAN 0308	4.000%	2022/03/28	5,340,000	5,488,986.00	
		BELGIAN 0309	4.000%	2017/03/28	5,110,000	5,450,326.00	
		BELGIAN 0310	4.000%	2013/03/28	5,770,000	5,962,141.00	
		BELGIAN 0312	4.000%	2018/03/28	4,330,000	4,600,192.00	
		BELGIAN 0314	4.000%	2014/03/28	5,930,000	6,222,349.00	
		BELGIAN 0315	4.000%	2019/03/28	3,880,000	4,098,444.00	
		BELGIAN 0316	3.500%	2015/03/28	1,930,000	2,022,254.00	
		BELGIAN 0318	3.750%	2020/09/28	7,610,000	7,794,162.00	
		BELGIAN 0319	2.750%	2016/03/28	2,600,000	2,654,860.00	
		BELGIAN 0320	4.250%	2041/03/28	3,630,000	3,675,375.00	
		BELGIAN 0321	4.250%	2021/09/28	4,060,000	4,259,752.00	
		BELGIAN 0323	3.500%	2017/06/28	1,750,000	1,816,325.00	

		BELGIAN 0324	4.500%	2026/03/28	1,790,000	1,889,345.00	
		BELGIAN 0325	4.250%	2022/09/28	1,640,000	1,703,140.00	
	国債証券（イタリア）	BTPS	4.750%	2013/02/01	10,080,000	10,333,108.80	
		BTPS	4.250%	2013/04/15	4,760,000	4,863,577.60	
		BTPS	2.000%	2013/06/01	7,930,000	7,893,204.80	
		BTPS	4.250%	2013/08/01	10,360,000	10,588,748.80	
		BTPS	2.250%	2013/11/01	9,430,000	9,351,259.50	
		BTPS	3.750%	2013/12/15	8,210,000	8,323,544.30	
		BTPS	3.000%	2014/04/01	240,000	239,544.00	
		BTPS	3.500%	2014/06/01	12,020,000	12,113,756.00	
		BTPS	4.250%	2014/07/01	2,410,000	2,463,743.00	
		BTPS	4.250%	2014/08/01	4,170,000	4,265,493.00	
		BTPS	6.000%	2014/11/15	2,700,000	2,881,170.00	
		BTPS	4.250%	2015/02/01	12,230,000	12,529,635.00	
		BTPS	3.000%	2015/04/15	15,970,000	15,797,524.00	
		BTPS	3.000%	2015/06/15	1,880,000	1,852,552.00	
		BTPS	3.750%	2015/08/01	12,040,000	12,098,996.00	
		BTPS	3.000%	2015/11/01	4,200,000	4,095,000.00	
		BTPS	3.750%	2016/04/15	1,330,000	1,320,690.00	
		BTPS	3.750%	2016/08/01	8,430,000	8,349,915.00	
		BTPS	4.750%	2016/09/15	8,560,000	8,751,744.00	
		BTPS	4.000%	2017/02/01	9,060,000	8,982,084.00	
		BTPS	5.250%	2017/08/01	13,570,000	14,077,518.00	
		BTPS	4.500%	2018/02/01	6,360,000	6,359,364.00	
		BTPS	4.500%	2018/08/01	6,770,000	6,722,610.00	
		BTPS	4.250%	2019/02/01	9,520,000	9,281,048.00	
		BTPS	4.500%	2019/03/01	11,620,000	11,432,918.00	
		BTPS	4.250%	2019/09/01	15,790,000	15,166,295.00	
		BTPS	4.500%	2020/02/01	5,620,000	5,449,152.00	
		BTPS	4.250%	2020/03/01	6,310,000	6,010,275.00	
		BTPS	4.000%	2020/09/01	4,250,000	3,937,200.00	
		BTPS	3.750%	2021/03/01	5,240,000	4,750,584.00	

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	3.750%	2021/08/01	14,100,000	12,627,960.00	
		BTPS	4.750%	2021/09/01	9,980,000	9,607,746.00	
		BTPS	5.000%	2022/03/01	5,700,000	5,531,280.00	
		BTPS	4.750%	2023/08/01	6,830,000	6,396,295.00	
		BTPS	9.000%	2023/11/01	3,920,000	4,915,680.00	
		BTPS	5.000%	2025/03/01	8,470,000	7,982,128.00	
		BTPS	4.500%	2026/03/01	7,000,000	6,232,800.00	
		BTPS	7.250%	2026/11/01	4,000,000	4,558,400.00	
		BTPS	6.500%	2027/11/01	9,810,000	10,339,740.00	
		BTPS	5.250%	2029/11/01	9,480,000	8,904,564.00	
		BTPS	6.000%	2031/05/01	12,650,000	12,743,610.00	
		BTPS	5.750%	2033/02/01	6,480,000	6,343,272.00	
		BTPS	5.000%	2034/08/01	8,250,000	7,388,700.00	
		BTPS	4.000%	2037/02/01	9,000,000	7,045,200.00	
		BTPS	5.000%	2039/08/01	9,210,000	8,156,376.00	
		BTPS	5.000%	2040/09/01	6,140,000	5,414,866.00	
	国債証券（ドイツ）	BUNDESOBL-152	3.500%	2013/04/12	8,050,000	8,347,850.00	
		BUNDESOBL-153	4.000%	2013/10/11	10,750,000	11,405,320.00	
		BUNDESOBL-154	2.250%	2014/04/11	10,940,000	11,403,856.00	
		BUNDESOBL-155	2.500%	2014/10/10	4,000,000	4,225,200.00	
		BUNDESOBL-156	2.500%	2015/02/27	6,970,000	7,404,231.00	
		BUNDESOBL-157	2.250%	2015/04/10	9,650,000	10,193,295.00	

		BUNDESOBL-158	1.750%	2015/10/09	7,930,000	8,276,541.00	
		BUNDESOBL-159	2.000%	2016/02/26	6,180,000	6,518,664.00	
		BUNDESOBL-160	2.750%	2016/04/08	540,000	585,684.00	
		BUNDESOBL-161	1.250%	2016/10/14	5,620,000	5,738,020.00	
		BUNDESOBL-162	0.750%	2017/02/24	570,000	566,836.50	
		BUNDESSCHATZANW	1.500%	2013/03/15	5,640,000	5,717,832.00	
		BUNDESSCHATZANW	1.750%	2013/06/14	4,320,000	4,405,968.00	
		BUNDESSCHATZANW	0.750%	2013/09/13	1,370,000	1,381,097.00	
		BUNDESSCHATZANW	0.250%	2013/12/13	1,310,000	1,310,131.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.750%	2013/07/04	10,450,000	10,944,180.50	
		DEUTSCHLAND REP	4.250%	2014/01/04	13,440,000	14,433,216.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.250%	2014/07/04	4,610,000	5,035,964.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.750%	2015/01/04	11,140,000	12,202,756.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.250%	2015/07/04	7,850,000	8,580,050.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.500%	2016/01/04	11,440,000	12,707,552.00	
		DEUTSCHLAND REP	6.000%	2016/06/20	1,850,000	2,254,040.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.000%	2016/07/04	7,600,000	8,666,280.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.750%	2017/01/04	7,400,000	8,424,160.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.250%	2017/07/04	7,010,000	8,210,112.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.000%	2018/01/04	6,320,000	7,363,432.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.250%	2018/07/04	9,340,000	11,084,712.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.750%	2019/01/04	9,190,000	10,663,157.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.500%	2019/07/04	10,400,000	11,909,040.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.250%	2020/01/04	12,020,000	13,556,156.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.000%	2020/07/04	6,720,000	7,440,384.00	
		DEUTSCHLAND REP	2.250%	2020/09/04	13,530,000	14,171,322.00	
		DEUTSCHLAND REP	2.500%	2021/01/04	5,000,000	5,319,500.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.250%	2021/07/04	4,250,000	4,777,425.00	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券（ドイツ）	DEUTSCHLAND REP	2.250%	2021/09/04	2,620,000	2,713,534.00	
		DEUTSCHLAND REP	2.000%	2022/01/04	1,500,000	1,514,850.00	
		DEUTSCHLAND REP	6.250%	2024/01/04	3,930,000	5,628,153.00	
		DEUTSCHLAND REP	6.500%	2027/07/04	5,360,000	8,139,696.00	
		DEUTSCHLAND REP	5.625%	2028/01/04	2,870,000	4,041,534.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.750%	2028/07/04	7,140,000	9,281,286.00	
		DEUTSCHLAND REP	6.250%	2030/01/04	3,920,000	5,987,800.00	
		DEUTSCHLAND REP	5.500%	2031/01/04	5,330,000	7,654,946.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.750%	2034/07/04	8,380,000	11,473,058.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.000%	2037/01/04	8,200,000	10,414,000.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.250%	2039/07/04	5,790,000	7,774,812.00	
		DEUTSCHLAND REP	4.750%	2040/07/04	5,770,000	8,384,964.00	
		DEUTSCHLAND REP	3.250%	2042/07/04	4,850,000	5,648,795.00	
	国債証券（フィンランド）	FINNISH GOV'T	5.375%	2013/07/04	2,270,000	2,422,544.00	
		FINNISH GOV'T	3.125%	2014/09/15	2,530,000	2,697,486.00	
		FINNISH GOV'T	4.250%	2015/07/04	2,280,000	2,534,904.00	
		FINNISH GOV'T	1.750%	2016/04/15	2,010,000	2,066,481.00	
		FINNISH GOV'T	1.875%	2017/04/15	1,250,000	1,277,625.00	
		FINNISH GOV'T	3.875%	2017/09/15	2,450,000	2,749,635.00	
		FINNISH GOV'T	4.375%	2019/07/04	2,030,000	2,353,176.00	
		FINNISH GOV'T	3.375%	2020/04/15	2,680,000	2,915,036.00	
		FINNISH GOV'T	3.500%	2021/04/15	1,920,000	2,103,168.00	
		FINNISH GOV'T	4.000%	2025/07/04	2,410,000	2,752,461.00	
	国債証券（フランス）	BTAN-2YR ISSUE	2.000%	2013/09/25	4,190,000	4,280,085.00	
		BTAN-5YR ISSUE	4.500%	2013/07/12	8,190,000	8,631,441.00	
		BTAN-5YR ISSUE	2.500%	2014/01/12	11,890,000	12,287,126.00	

		BTAN-5YR ISSUE	3.000%	2014/07/12	15,830,000	16,612,002.00	
		BTAN-5YR ISSUE	2.500%	2015/01/15	5,600,000	5,825,120.00	
		BTAN-5YR ISSUE	2.000%	2015/07/12	9,390,000	9,617,238.00	
		BTAN-5YR ISSUE	2.250%	2016/02/25	7,740,000	7,968,330.00	
		BTAN-5YR ISSUE	2.500%	2016/07/25	5,310,000	5,499,567.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2013/04/25	5,720,000	5,944,796.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2013/10/25	8,800,000	9,272,560.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2014/04/25	12,760,000	13,630,232.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2014/10/25	3,960,000	4,274,028.00	
		FRANCE O.A.T.	3.500%	2015/04/25	11,320,000	12,138,436.00	
		FRANCE O.A.T.	3.000%	2015/10/25	14,790,000	15,627,114.00	
		FRANCE O.A.T.	3.250%	2016/04/25	9,300,000	9,936,120.00	
		FRANCE O.A.T.	5.000%	2016/10/25	10,860,000	12,445,560.00	
		FRANCE O.A.T.	3.750%	2017/04/25	10,340,000	11,286,110.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250%	2017/10/25	9,550,000	10,672,125.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2018/04/25	8,780,000	9,693,998.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250%	2018/10/25	8,470,000	9,470,307.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250%	2019/04/25	10,400,000	11,600,160.00	
		FRANCE O.A.T.	3.750%	2019/10/25	16,450,000	17,747,905.00	
		FRANCE O.A.T.	8.500%	2019/10/25	4,010,000	5,664,125.00	
		FRANCE O.A.T.	3.500%	2020/04/25	9,960,000	10,527,720.00	
		FRANCE O.A.T.	2.500%	2020/10/25	11,690,000	11,404,764.00	
		FRANCE O.A.T.	3.750%	2021/04/25	12,220,000	13,037,518.00	
		FRANCE O.A.T.	3.250%	2021/10/25	2,270,000	2,326,977.00	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券（フランス）	FRANCE O.A.T.	8.500%	2023/04/25	4,090,000	6,121,094.00	
		FRANCE O.A.T.	4.250%	2023/10/25	13,500,000	14,885,100.00	
		FRANCE O.A.T.	6.000%	2025/10/25	5,040,000	6,451,200.00	
		FRANCE O.A.T.	3.500%	2026/04/25	9,050,000	9,134,165.00	
		FRANCE O.A.T.	5.500%	2029/04/25	9,710,000	12,107,399.00	
		FRANCE O.A.T.	5.750%	2032/10/25	8,580,000	11,238,084.00	
		FRANCE O.A.T.	4.750%	2035/04/25	7,330,000	8,612,750.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2038/10/25	9,190,000	9,762,537.00	
		FRANCE O.A.T.	4.500%	2041/04/25	7,680,000	8,845,056.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2055/04/25	5,880,000	6,279,252.00	
		FRANCE O.A.T.	4.000%	2060/04/25	3,230,000	3,459,653.00	
	国債証券（アイルランド）	IRISH GOVT	5.000%	2013/04/18	2,160,000	2,167,020.00	
		IRISH GOVT	4.000%	2014/01/15	4,550,000	4,530,207.50	
		IRISH GOVT	4.600%	2016/04/18	3,950,000	3,884,627.50	
		IRISH GOVT	4.500%	2018/10/18	3,550,000	3,223,045.00	
		IRISH GOVT	4.400%	2019/06/18	3,540,000	3,138,564.00	
		IRISH GOVT	5.900%	2019/10/18	2,570,000	2,437,259.50	
		IRISH GOVT	4.500%	2020/04/18	4,160,000	3,572,608.00	
		IRISH GOVT	5.000%	2020/10/18	2,600,000	2,274,610.00	
		IRISH GOVT	5.400%	2025/03/13	3,180,000	2,770,257.00	
	国債証券（オランダ）	NETHERLANDS GOVT	4.250%	2013/07/15	5,640,000	5,943,996.00	
		NETHERLANDS GOVT	1.000%	2014/01/15	5,690,000	5,753,159.00	
		NETHERLANDS GOVT	3.750%	2014/07/15	6,000,000	6,458,400.00	
		NETHERLANDS GOVT	2.750%	2015/01/15	5,740,000	6,077,512.00	
		NETHERLANDS GOVT	0.750%	2015/04/15	470,000	469,577.00	
		NETHERLANDS GOVT	3.250%	2015/07/15	5,040,000	5,441,688.00	
		NETHERLANDS GOVT	4.000%	2016/07/15	6,170,000	6,922,123.00	
		NETHERLANDS GOVT	2.500%	2017/01/15	2,810,000	2,968,765.00	
		NETHERLANDS GOVT	4.500%	2017/07/15	6,180,000	7,147,788.00	
		NETHERLANDS GOVT	4.000%	2018/07/15	5,600,000	6,376,720.00	

		NETHERLANDS GOVT	4.000%	2019/07/15	8,030,000	9,176,684.00	
		NETHERLANDS GOVT	3.500%	2020/07/15	4,450,000	4,936,385.00	
		NETHERLANDS GOVT	3.250%	2021/07/15	4,210,000	4,570,376.00	
		NETHERLANDS GOVT	3.750%	2023/01/15	4,120,000	4,651,892.00	
		NETHERLANDS GOVT	7.500%	2023/01/15	1,120,000	1,667,680.00	
		NETHERLANDS GOVT	5.500%	2028/01/15	4,790,000	6,507,694.00	
		NETHERLANDS GOVT	4.000%	2037/01/15	4,770,000	5,920,524.00	
		NETHERLANDS GOVT	3.750%	2042/01/15	4,420,000	5,443,672.00	
	国債証券（オーストリア）	REP OF AUSTRIA	3.800%	2013/10/20	4,570,000	4,805,812.00	
		REP OF AUSTRIA	4.300%	2014/07/15	4,030,000	4,362,072.00	
		REP OF AUSTRIA	3.400%	2014/10/20	4,310,000	4,597,477.00	
		REP OF AUSTRIA	3.500%	2015/07/15	4,930,000	5,298,271.00	
		REP OF AUSTRIA	4.000%	2016/09/15	4,360,000	4,804,720.00	
		REP OF AUSTRIA	3.200%	2017/02/20	3,170,000	3,371,295.00	
		REP OF AUSTRIA	4.300%	2017/09/15	2,530,000	2,823,986.00	
		REP OF AUSTRIA	4.650%	2018/01/15	4,440,000	5,034,960.00	
		REP OF AUSTRIA	4.350%	2019/03/15	4,670,000	5,223,395.00	
		REP OF AUSTRIA	3.900%	2020/07/15	4,410,000	4,796,316.00	
		REP OF AUSTRIA	3.500%	2021/09/15	5,490,000	5,791,401.00	
		REP OF AUSTRIA	3.650%	2022/04/20	2,300,000	2,443,290.00	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
ユーロ	国債証券（オーストリア）	REP OF AUSTRIA	3.400%	2022/11/22	1,120,000	1,160,992.00	
		REP OF AUSTRIA	4.850%	2026/03/15	3,350,000	3,943,285.00	
		REP OF AUSTRIA	6.250%	2027/07/15	2,730,000	3,686,046.00	
		REP OF AUSTRIA	4.150%	2037/03/15	4,580,000	5,141,508.00	
	国債証券（スペイン）	SPANISH GOV'T	6.150%	2013/01/31	6,550,000	6,829,030.00	
		SPANISH GOV'T	2.300%	2013/04/30	9,610,000	9,676,309.00	
		SPANISH GOV'T	4.200%	2013/07/30	2,450,000	2,525,705.00	
		SPANISH GOV'T	2.500%	2013/10/31	3,990,000	4,006,359.00	
		SPANISH GOV'T	4.250%	2014/01/31	4,840,000	5,001,656.00	
		SPANISH GOV'T	3.400%	2014/04/30	2,610,000	2,653,326.00	
		SPANISH GOV'T	4.750%	2014/07/30	4,860,000	5,092,308.00	
		SPANISH GOV'T	3.300%	2014/10/31	11,170,000	11,339,784.00	
		SPANISH GOV'T	4.400%	2015/01/31	7,070,000	7,390,978.00	
		SPANISH GOV'T	3.000%	2015/04/30	5,360,000	5,376,080.00	
		SPANISH GOV'T	4.000%	2015/07/30	3,160,000	3,253,220.00	
		SPANISH GOV'T	3.150%	2016/01/31	9,820,000	9,793,486.00	
		SPANISH GOV'T	3.250%	2016/04/30	4,310,000	4,280,045.50	
		SPANISH GOV'T	4.250%	2016/10/31	3,380,000	3,459,092.00	
		SPANISH GOV'T	3.800%	2017/01/31	4,780,000	4,778,566.00	
		SPANISH GOV'T	5.500%	2017/07/30	7,140,000	7,663,362.00	
		SPANISH GOV'T	4.100%	2018/07/30	6,420,000	6,407,802.00	
		SPANISH GOV'T	4.600%	2019/07/30	5,950,000	6,031,515.00	
		SPANISH GOV'T	4.300%	2019/10/31	4,550,000	4,507,230.00	
		SPANISH GOV'T	4.000%	2020/04/30	8,910,000	8,589,240.00	
		SPANISH GOV'T	4.850%	2020/10/31	6,810,000	6,877,419.00	
		SPANISH GOV'T	5.500%	2021/04/30	8,080,000	8,465,012.00	
		SPANISH GOV'T	5.850%	2022/01/31	760,000	807,728.00	
		SPANISH GOV'T	4.800%	2024/01/31	5,930,000	5,667,894.00	
		SPANISH GOV'T	4.650%	2025/07/30	5,950,000	5,479,950.00	
		SPANISH GOV'T	5.900%	2026/07/30	2,350,000	2,418,855.00	
		SPANISH GOV'T	6.000%	2029/01/31	7,160,000	7,398,428.00	
		SPANISH GOV'T	5.750%	2032/07/30	4,800,000	4,820,160.00	
		SPANISH GOV'T	4.200%	2037/01/31	5,890,000	4,701,398.00	
		SPANISH GOV'T	4.900%	2040/07/30	4,980,000	4,358,994.00	

		SPANISH GOV'T	4.700%	2041/07/30	4,520,000	3,853,300.00	
	ユーロ 小計				1,469,800,000	1,560,722,568.80 (170,758,656,252)	
英ポンド	国債証券	TREASURY	4.500%	2013/03/07	15,330,000	15,966,149.01	
		TREASURY	2.250%	2014/03/07	5,230,000	5,427,694.00	
		TREASURY	5.000%	2014/09/07	9,490,000	10,585,430.70	
		TREASURY	2.750%	2015/01/22	12,500,000	13,318,875.00	
		TREASURY	4.750%	2015/09/07	9,990,000	11,443,744.80	
		TREASURY	8.000%	2015/12/07	2,280,000	2,907,912.00	
		TREASURY	2.000%	2016/01/22	8,500,000	8,924,320.00	
		TREASURY	4.000%	2016/09/07	6,700,000	7,641,350.00	
		TREASURY	1.750%	2017/01/22	10,630,000	11,033,514.80	
		TREASURY	8.750%	2017/08/25	1,920,000	2,718,120.96	
		TREASURY	5.000%	2018/03/07	7,420,000	9,056,110.00	
		TREASURY	4.500%	2019/03/07	5,210,000	6,274,246.70	
		TREASURY	3.750%	2019/09/07	12,760,000	14,696,330.00	

通貨	種類	銘柄			券面総額	評価額	備考
英ポンド	国債証券	TREASURY	4.750%	2020/03/07	4,620,000	5,664,997.80	
		TREASURY	3.750%	2020/09/07	8,920,000	10,253,540.00	
		TREASURY	8.000%	2021/06/07	5,970,000	9,035,595.00	
		TREASURY	3.750%	2021/09/07	8,140,000	9,315,416.00	
		TREASURY	4.000%	2022/03/07	4,850,000	5,648,795.00	
		TREASURY	5.000%	2025/03/07	6,480,000	8,270,424.00	
		TREASURY	4.250%	2027/12/07	6,390,000	7,608,304.62	
		TREASURY	6.000%	2028/12/07	3,600,000	5,177,664.00	
		TREASURY	4.750%	2030/12/07	6,430,000	8,083,538.80	
		TREASURY	4.250%	2032/06/07	7,030,000	8,298,001.10	
		TREASURY	4.500%	2034/09/07	3,960,000	4,833,298.80	
		TREASURY	4.250%	2036/03/07	8,570,000	10,127,597.50	
		TREASURY	4.750%	2038/12/07	6,060,000	7,747,407.00	
		TREASURY	4.250%	2039/09/07	6,610,000	7,823,067.20	
		TREASURY	4.250%	2040/12/07	6,650,000	7,888,097.00	
		TREASURY	4.500%	2042/12/07	5,070,000	6,295,322.67	
		TREASURY	4.250%	2046/12/07	6,860,000	8,257,999.40	
		TREASURY	4.250%	2049/12/07	7,220,000	8,748,185.20	
		TREASURY	3.750%	2052/07/22	2,090,000	2,304,454.90	
		TREASURY	4.250%	2055/12/07	6,220,000	7,664,097.40	
		TREASURY	4.000%	2060/01/22	4,540,000	5,382,170.00	
	英ポンド 小計				234,240,000	274,421,771.36 (35,416,873,811)	
スイス フラン	国債証券	SWISS (GOVT)	4.000%	2013/02/11	2,420,000	2,512,686.00	
		SWISS (GOVT)	4.250%	2014/01/06	1,910,000	2,061,845.00	
		SWISS (GOVT)	2.500%	2016/03/12	2,490,000	2,729,040.00	
		SWISS (GOVT)	4.250%	2017/06/05	2,350,000	2,839,035.00	
		SWISS (GOVT)	3.000%	2018/01/08	2,260,000	2,611,430.00	
		SWISS (GOVT)	3.000%	2019/05/12	2,160,000	2,551,176.00	
		SWISS (GOVT)	4.000%	2023/02/11	1,710,000	2,276,865.00	
		SWISS (GOVT)	4.000%	2028/04/08	2,100,000	3,026,520.00	
	スイスフラン 小計				17,400,000	20,608,597.00 (1,872,084,951)	
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDEN GOVT	6.750%	2014/05/05	32,150,000	36,081,945.00	
		SWEDEN GOVT	4.500%	2015/08/12	22,990,000	25,564,880.00	
		SWEDEN GOVT	3.000%	2016/07/12	18,050,000	19,365,845.00	
		SWEDEN GOVT	3.750%	2017/08/12	19,050,000	21,351,240.00	
		SWEDEN GOVT	4.250%	2019/03/12	21,610,000	25,359,335.00	

		SWEDEN GOVT	5.000%	2020/12/01	29,200,000	36,683,960.00	
		SWEDEN GOVT	3.500%	2022/06/01	22,000,000	25,250,720.00	
		SWEDEN GOVT	3.500%	2039/03/30	15,440,000	18,741,072.00	
	スウェーデンクローナ 小計				180,490,000	208,398,997.00 (2,588,315,542)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOV'T	6.500%	2013/05/15	25,000,000	26,432,500.00	
		NORWEGIAN GOV'T	5.000%	2015/05/15	20,540,000	22,680,268.00	
		NORWEGIAN GOV'T	4.250%	2017/05/19	16,770,000	18,639,855.00	
		NORWEGIAN GOV'T	4.500%	2019/05/22	10,890,000	12,528,945.00	
		NORWEGIAN GOV'T	3.750%	2021/05/25	11,170,000	12,432,210.00	
	ノルウェークローネ 小計				84,370,000	92,713,778.00 (1,353,621,158)	

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	5.000%	2013/11/15	32,050,000	34,626,820.00	
		DENMARK - BULLET	2.000%	2014/11/15	12,170,000	12,698,178.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2015/11/15	36,170,000	40,575,506.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2017/11/15	20,930,000	24,358,334.00	
		DENMARK - BULLET	4.000%	2019/11/15	34,580,000	40,755,988.00	
		DENMARK - BULLET	3.000%	2021/11/15	19,190,000	21,116,676.00	
		DENMARK - BULLET	7.000%	2024/11/10	9,980,000	15,289,360.00	
		DENMARK - BULLET	4.500%	2039/11/15	39,670,000	56,103,297.50	
	デンマーククローネ 小計				204,740,000	245,524,159.50 (3,611,660,386)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVT BOND	5.250%	2013/04/25	8,480,000	8,551,232.00	
		POLAND GOVT BOND	0.000%	2013/07/25	4,560,000	4,288,680.00	
		POLAND GOVT BOND	5.000%	2013/10/24	9,650,000	9,713,690.00	
		POLAND GOVT BOND	0.000%	2014/01/25	3,750,000	3,438,000.00	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2014/04/25	12,190,000	12,445,990.00	
		POLAND GOVT BOND	5.500%	2015/04/25	10,150,000	10,358,582.50	
		POLAND GOVT BOND	6.250%	2015/10/24	12,440,000	13,014,728.00	
		POLAND GOVT BOND	5.000%	2016/04/25	8,410,000	8,430,184.00	
		POLAND GOVT BOND	4.750%	2016/10/25	2,590,000	2,566,301.50	
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2017/10/25	10,570,000	10,644,518.50	
		POLAND GOVT BOND	5.500%	2019/10/25	9,740,000	9,816,459.00	
		POLAND GOVT BOND	5.250%	2020/10/25	9,060,000	8,924,553.00	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2021/10/25	3,710,000	3,773,070.00	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2022/09/23	9,800,000	9,951,900.00	
		POLAND GOVT BOND	5.750%	2029/04/25	2,600,000	2,605,980.00	
	ポーランドズロチ 小計				117,700,000	118,523,868.50 (3,107,695,832)	
オーストラリアドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVT.	6.500%	2013/05/15	6,680,000	6,884,408.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2013/12/15	3,360,000	3,462,916.80	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.250%	2014/06/15	5,150,000	5,434,589.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.500%	2014/10/21	3,850,000	3,926,037.50	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.250%	2015/04/15	5,710,000	6,134,481.40	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.750%	2015/10/21	1,970,000	2,035,896.50	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.750%	2016/06/15	4,190,000	4,351,901.60	
		AUSTRALIAN GOVT.	6.000%	2017/02/15	5,920,000	6,510,520.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.250%	2017/07/21	1,480,000	1,509,156.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2018/01/21	2,960,000	3,217,460.80	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.250%	2019/03/15	5,880,000	6,360,984.00	
		AUSTRALIAN GOVT.	4.500%	2020/04/15	6,760,000	6,992,746.80	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.750%	2021/05/15	5,040,000	5,684,767.20	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.750%	2022/07/15	3,180,000	3,599,537.40	
		AUSTRALIAN GOVT.	5.500%	2023/04/21	2,030,000	2,249,422.70	

		AUSTRALIAN GOVT.	4.750%	2027/04/21	1,350,000	1,390,068.00	
	オーストラリアドル 小計				65,510,000	69,744,893.70 (6,051,066,977)	
シンガポールドル	国債証券	SPR GOV'T	1.625%	2013/04/01	2,200,000	2,232,802.00	
		SPR GOV'T	2.250%	2013/07/01	2,360,000	2,423,743.60	
		SPR GOV'T	3.625%	2014/07/01	2,110,000	2,272,744.30	
		SPR GOV'T	1.375%	2014/10/01	700,000	718,655.00	
		SPR GOV'T	2.875%	2015/07/01	1,720,000	1,859,750.00	

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	1.125%	2016/04/01	780,000	800,631.00	
		SPR GOV'T	3.750%	2016/09/01	1,660,000	1,894,475.00	
		SPR GOV'T	2.375%	2017/04/01	710,000	769,916.90	
		SPR GOV'T	4.000%	2018/09/01	1,390,000	1,659,951.90	
		SPR GOV'T	2.500%	2019/06/01	620,000	677,021.40	
		SPR GOV'T	3.250%	2020/09/01	1,920,000	2,194,771.20	
		SPR GOV'T	2.250%	2021/06/01	1,270,000	1,351,826.10	
		SPR GOV'T	3.125%	2022/09/01	1,390,000	1,582,959.80	
		SPR GOV'T	3.000%	2024/09/01	1,150,000	1,278,259.50	
		SPR GOV'T	3.500%	2027/03/01	1,490,000	1,713,455.30	
		SPR GOV'T	2.875%	2030/09/01	1,060,000	1,143,623.40	
	シンガポールドル 小計				22,530,000	24,574,586.40 (1,588,255,519)	
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIAN GOV'T	3.702%	2013/02/25	3,420,000	3,448,967.40	
		MALAYSIAN GOV'T	3.210%	2013/05/31	3,300,000	3,315,444.00	
		MALAYSIAN GOV'T	3.461%	2013/07/31	7,010,000	7,067,832.50	
		MALAYSIAN GOV'T	5.094%	2014/04/30	9,680,000	10,118,697.60	
		MALAYSIAN GOV'T	3.434%	2014/08/15	2,280,000	2,305,080.00	
		MALAYSIAN GOV'T	3.741%	2015/02/27	5,790,000	5,898,794.10	
		MALAYSIAN GOV'T	3.835%	2015/08/12	5,630,000	5,767,935.00	
		MALAYSIAN GOV'T	4.262%	2016/09/15	8,060,000	8,421,088.00	
		MALAYSIAN GOV'T	3.814%	2017/02/15	4,280,000	4,388,712.00	
		MALAYSIAN GOV'T	4.240%	2018/02/07	9,470,000	9,919,919.70	
		MALAYSIAN GOV'T	3.580%	2018/09/28	4,010,000	4,059,844.30	
		MALAYSIAN GOV'T	4.378%	2019/11/29	9,560,000	10,179,296.80	
		MALAYSIAN GOV'T	4.160%	2021/07/15	4,610,000	4,856,404.50	
		MALAYSIAN GOV'T	4.392%	2026/04/15	3,910,000	4,183,700.00	
		MALAYSIAN GOV'T	3.502%	2027/05/31	1,680,000	1,603,714.56	
		MALAYSIAN GOV'T	5.248%	2028/09/15	1,910,000	2,216,260.86	
	マレーシアリンギット 小計				84,600,000	87,751,691.32 (2,362,275,530)	
国債証券 合計						414,354,154,239 (414,354,154,239)	
合計						414,354,154,239 (414,354,154,239)	

（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	184	100.0%	41.0%

カナダドル	34	100.0%	3.0%
メキシコペソ	19	100.0%	0.9%
ユーロ	237	100.0%	41.2%
英ポンド	34	100.0%	8.5%
スイスフラン	8	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	8	100.0%	0.6%
ノルウェークローネ	5	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	8	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	15	100.0%	0.8%
オーストラリアドル	16	100.0%	1.5%
シンガポールドル	16	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	16	100.0%	0.6%
合計	600	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。

② 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

③ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

④ 不動産等明細表
該当事項はありません。

⑤ 商品明細表
該当事項はありません。

⑥ 商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

⑦ その他特定資産の明細表
該当事項はありません。

⑧ 借入金明細表
該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】平成24年３月30日
（４資産インデックスバランスオープン（分配型））

Ⅰ 資産総額	207,444,731 円
Ⅱ 負債総額	126,461 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	207,318,270 円
Ⅳ 発行済口数	246,529,313 口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8409 円
１万口当たり純資産額	8,409 円

（４資産インデックスバランスオープン（成長型））

Ⅰ 資産総額	630,632,866 円
Ⅱ 負債総額	1,589,661 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	629,043,205 円
Ⅳ 発行済口数	703,836,768 口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8937 円
１万口当たり純資産額	8,937 円

＜参考＞
マザーファンドの現況（平成24年３月30日）
純資産額計算書
（中央三井日本株式マザーファンド）

Ⅰ 資産総額	264,840,494,511 円
Ⅱ 負債総額	303,680,500 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	264,536,814,011 円
Ⅳ 発行済口数	337,972,852,532 口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.7827 円
１万口当たり純資産額	7,827 円

（中央三井日本債券マザーファンド）

Ⅰ 資産総額	376,914,062,293 円
Ⅱ 負債総額	9,689,697,454 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	367,224,364,839 円
Ⅳ 発行済口数	305,367,452,055 口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2026 円
１万口当たり純資産額	12,026 円

（中央三井外国株式マザーファンド）

Ⅰ 資産総額	280,283,778,854 円
Ⅱ 負債総額	456,144,279 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	279,827,634,575 円
Ⅳ 発行済口数	269,465,716,048 口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0385 円
１万口当たり純資産額	10,385 円

（中央三井外国債券マザーファンド）

Ⅰ 資産総額	423,138,491,156 円
Ⅱ 負債総額	333,918,435 円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	422,804,572,721 円
Ⅳ 発行済口数	266,028,109,258 口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5893 円
１万口当たり純資産額	15,893 円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）投資信託受益証券の名義書換等

委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、該当事項はありません。

（２）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限

該当事項はありません。

（４）振替受益権に関する記載

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

① 受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

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

② 受益権の譲渡

Ａ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

Ｂ．上記Ａ．の申請のある場合には、上記Ａ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記Ａ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。

Ｃ．上記Ａ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

③ 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

④ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

⑤ 償還金

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

⑥ 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

本書提出日現在の資本金の額：３億円
会社の発行可能株式総数： 12,000株
発行済株式総数： 3,000株
最近５年間における資本金の額の増減：なし

（２）委託会社の機構

① 会社の意思決定機構

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

取締役及び監査役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

監査役の任期は、選任後4年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会終結の時までとします。

取締役会は、その決議をもって、取締役の中から、代表取締役若干名を選定します。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役の中から、会長1名及び副社長、専務取締役、常務取締役若干名を選定することができます。

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

取締役会を招集するには、各取締役及び各監査役に対して会日の3日前までに招集通知を発します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役及び監査役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

② 投資運用の意思決定機構

［PLAN（計画）］

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

［DO（実行）］

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

［CHECK（検証・評価）］

運用各部の長は、運用が運用計画に沿って行われているかの確認を行います。

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

委託会社の機構は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに、金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

平成24年3月30日現在、住信アセットマネジメント株式会社が運用の指図を行っている証券投資信託は次のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	167	1,340,512
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	167	1,340,512

（ご参考）平成24年3月30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	130	2,484,167
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	726
単位型公社債投資信託	0	0
合計	135	2,484,893

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

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

(1)【貸借対照表】

（単位：千円）

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

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

（単位：千円）

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

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

(2)【損益計算書】

（単位：千円）

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

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

（単位：千円）

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

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

(3)【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

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

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

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

会計方針の変更

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

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

（損益計算書関係）

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

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

２．自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

３．当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成21年6月29日定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成21年3月31日	平成21年6月29日

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

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

当事業年度（自　平成22年4月1日　至　平成23年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

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

２．自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

３．当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

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

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

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

（1）配当金の総額　30,000千円

（2）配当金の原資　利益剰余金

（3）１株当たり配当額　5,000円

（4）基準日　平成23年3月31日

（5）効力発生日　平成23年6月29日

（リース取引関係）

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

（金融商品関係）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

（追加情報）

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

１．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

２．金融商品の時価に関する事項

平成22年3月31日（当社の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注２）を参照ください）。

（単位:千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券取引に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

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

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

１．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

２．金融商品の時価に関する事項

平成23年3月31日（当社の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注２）を参照ください）。

（単位:千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券取引に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位:千円）

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

（有価証券関係）

前事業年度（平成22年3月31日現在）

１．その他有価証券

（単位:千円）

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

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

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

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

（単位：千円）

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

当事業年度（平成23年3月31日現在）

１．その他有価証券

（単位：千円）

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

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

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

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
7,639	756	480

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）
当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）
当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度	当事業年度
（自　平成21年4月1日	（自　平成22年4月1日

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

（税効果会計関係）

前事業年度 （平成22年3月31日現在）	当事業年度 （平成23年3月31日現在）
1．繰延税金資産の発生の主な原因別の内訳 （繰延税金資産） 未払事業税　15,392千円 賞与引当金損金算入限度超過額　28,726千円 退職給付引当金損金算入限度超過額　50,008千円 有価証券評価差額　4,321千円 その他　1,025千円 繰延税金資産 合計　99,475千円	1．繰延税金資産の発生の主な原因別の内訳 （繰延税金資産） 未払事業税　17,667千円 賞与引当金損金算入限度超過額　32,484千円 退職給付引当金損金算入限度超過額　69,626千円 有価証券評価差額　5,832千円 その他　4,558千円 繰延税金資産 合計　130,169千円
2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。	2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳 同左

（持分法損益等）

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

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

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

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

（関連情報）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（1）売上高

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

（2）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

（追加情報）

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

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

（関連当事者情報）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	住友信託銀行(株)	大阪市中央区	342,037	信託業務及び銀行業務	直接30%,間接70%	営業上の取引役員の兼任	投信販売代行手数料	4,065,257	未払手数料	353,462
							投資助言費用の支払	609,879	未払費用	119,557

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 投信販売代行手数料

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

② 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所及び大阪証券取引所に上場）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）

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

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

① 投信販売代行手数料

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

② 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

住友信託銀行株式会社（非上場）

（１株当たり情報）

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

（注）1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

期中平均株式数	6,000株	6,000株

（重要な後発事象）

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

中間貸借対照表

（単位：千円）

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

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

（単位：千円）

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

中間損益計算書

（単位：千円）

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

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

中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

第26期中間会計期間

（自　平成23年4月1日

至　平成23年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定率法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

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

3．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

（2）退職給付引当金

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

4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

追加情報

第26期中間会計期間

（自　平成23年4月1日

至　平成23年9月30日）

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第26期中間会計期間末
（平成23年9月30日）

※1　有形固定資産の減価償却累計額

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

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

（中間損益計算書関係）

第26期中間会計期間
（自　平成23年4月1日
至　平成23年9月30日）

※1　減価償却実施額

有形固定資産	20,670千円
無形固定資産	15,864千円

※2　営業外収益の主要項目

受取利息	10,373千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項

配当金支払額

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

（リース取引関係）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

平成23年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注２）を参照ください）。

（単位：千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

（有価証券関係）

第26期中間会計期間末（平成23年9月30日）

その他有価証券

（単位:千円）

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

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

（デリバティブ取引関係）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

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

（関連情報）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

(1)売上高

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

(2)有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

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

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

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

（１株当たり情報）

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

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）
　該当事項はありません。

次へ

＜参考＞中央三井アセットマネジメント株式会社の経理状況

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

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

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

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

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

次へ

独立監査人の監査報告書

平成２２年６月１０日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取　締　役　会　　御中

有限責任監査法人 ト ー マ ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　松 崎 雅 則　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　平 木 達 也　印

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

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

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

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

以 上

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

次へ

独立監査人の監査報告書

平成２３年６月１０日

中央三井アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御中

有限責任監査法人 ト ー マ ツ

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　松 崎 雅 則　印

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　平 木 達 也　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている中央三井アセットマネジメント株式会社の平成２２年４月１日から平成２３年３月３１日までの第２５期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、中央三井アセットマネジメント株式会社の平成２３年３月３１日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

次へ

（１）貸借対照表

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

科目	第24期 平成22年３月31日 金額（千円）		第25期 平成23年３月31日 金額（千円）	
（負債の部）				
Ⅰ 流動負債				
１．預り金		3,792		3,682
２．未払金				
(1) 未払手数料	327,341		298,465	
(2) その他未払金	56,890	384,231	109,112	407,578
３．未払費用		279,266		365,151
４．未払法人税等		114,387		82,266
５．賞与引当金		46,407		50,180
６．資産除去債務		－		16,345
流動負債 計		828,085		925,203
Ⅱ 固定負債				
１．退職給付引当金		22,905		18,693
２．役員退職慰労引当金		31,800		－
３．繰延税金負債		－		1,600
４．その他		－		20,700
固定負債 計		54,705		40,993
負 債 合 計		882,791		966,197
（純資産の部）				
Ⅰ 株主資本				
１．資本金		300,000		300,000
２．資本剰余金				
(1) 資本準備金		50,000		50,000
資本剰余金 計		50,000		50,000
３．利益剰余金				
(1) 利益準備金		25,401		25,401
(2) その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		2,086,808		2,364,106
利益剰余金 計		2,112,210		2,389,507
株主資本計		2,462,210		2,739,507
Ⅱ 評価・換算差額等				
１．その他有価証券評価差額金		△103		1,142
評価・換算差額等計		△103		1,142
純資産合計		2,462,107		2,740,649
負債・純資産合計		3,344,898		3,706,847

（２）損益計算書

科目	第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで) 金額（千円）		第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで) 金額（千円）	
Ⅰ 営業収益				
１．委託者報酬		9,668,856		9,561,211
営業収益 計		9,668,856		9,561,211
Ⅱ 営業費用				
１．支払手数料		3,855,512		3,634,705
２．広告宣伝費		89,996		83,750
３．調査費				
(1) 調査費	234,896		232,183	
(2) 委託調査費	2,921,144	3,156,040	3,098,589	3,330,773
４．営業雑経費				
(1) 通信費	14,562		14,141	
(2) 印刷費	192,040		206,247	
(3) 協会費	11,699		12,069	
(4) 諸会費	389	218,692	507	232,966
営業費用 計		7,320,241		7,282,194
Ⅲ 一般管理費				
１．給料				
(1) 役員報酬	57,119		62,111	
(2) 給料・手当	609,618		633,310	
(3) 賞与	132,613	799,351	158,866	854,287
２．福利厚生費		211,448		232,228
３．交際費		1,056		770
４．旅費交通費		20,394		21,590
５．租税公課		11,448		11,095
６．不動産賃借料		112,953		116,174
７．退職給付費用		6,497		7,250
８．役員退職慰労引当金繰入		12,900		8,250
９．賞与引当金繰入		46,407		50,180
10．減価償却費		56,560		53,926
11．諸経費		520,606		540,822
一般管理費 計		1,799,626		1,896,577
営業利益		548,988		382,439

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

（３）株主資本等変動計算書

		第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
株主資本		（単位：千円）	（単位：千円）
資本金	前期末残高	300,000	300,000
	当期変動額	－	－
	当期末残高	300,000	300,000
資本剰余金			
資本準備金	前期末残高	50,000	50,000
	当期変動額	－	－
	当期末残高	50,000	50,000
資本剰余金合計	前期末残高	50,000	50,000
	当期変動額	－	－
	当期末残高	50,000	50,000
利益剰余金			
利益準備金	前期末残高	25,401	25,401
	当期変動額	－	－
	当期末残高	25,401	25,401
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金	前期末残高	1,771,709	2,086,808
	当期変動額　当期純利益	315,099	277,297
	当期末残高	2,086,808	2,364,106
利益剰余金合計	前期末残高	1,797,110	2,112,210
	当期変動額	315,099	277,297
	当期末残高	2,112,210	2,389,507
株主資本合計	前期末残高	2,147,110	2,462,210
	当期変動額	315,099	277,297
	当期末残高	2,462,210	2,739,507
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金	前期末残高	－	△103
	当期変動額　（純額）	△103	1,245
	当期末残高	△103	1,142
評価・換算差額等合計	前期末残高	－	△103
	当期変動額	△103	1,245
	当期末残高	△103	1,142
純資産合計	前期末残高	2,147,110	2,462,107
	当期変動額	314,996	278,542
	当期末残高	2,462,107	2,740,649

重要な会計方針

期別 項目	第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
１．有価証券の評価基準及び評価方法	その他有価証券 (1) 時価のないもの 移動平均法に基づく原価法を採用しております。 (2) 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額については全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。	その他有価証券 (1) 時価のないもの 同左 (2) 時価のあるもの 同左
２．固定資産の減価償却の方法		
(1) 有形固定資産	定率法を採用しております。 なお、耐用年数は、建物については主として15年～18年、器具備品については主として５年～20年であります。	同左
(2) 無形固定資産	定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、利用可能期間（５年）を耐用年数としております。	同左
３．引当金の計上基準		
(1) 貸倒引当金	一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。	同左
(2) 賞与引当金	従業員への賞与の支給に充てるため、支給見込額のうち当期負担分を計上しております。	同左
(3) 退職給付引当金	従業員への退職金支給に充てるため、自己都合退職による期末退職給付債務相当額を計上しております。	同左
(4) 役員退職慰労引当金	役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づき期末要支給額を計上しております。	―
４．その他財務諸表作成の基本となる重要な事項	消費税等の会計処理は税抜方式を採用しております。	同左

会計方針の変更

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

追加情報

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

注記事項

１．貸借対照表関係

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

２．損益計算書関係

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
※１　関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。 雑損失（臨時経営指導料）　4,490千円 統合関連費用　9,577千円	※１　関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。 統合関連費用　51,394千円 ※２　当事業年度において、以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

用途	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

(経緯)

上記の資産グループについては、当社グループの経営統合に伴い、将来の使用見込みがなく除却される可能性が高い資産について、除去予定時の帳簿価額を減損損失として特別損失に計上しました。

(減損損失の金額)

建物	15,615千円
器具備品	2,007千円
合計	17,622千円

(グルーピングの方法)

当社は、基本的に全ての資産が一体となってキャッシュ・フローを生成しておりますが、将来使用見込みがなく処分される可能性が高いものについては、処分予定資産としてグルーピングしております。

３．株主資本等変動計算書関係

<table>
<tr><th>期別
項目</th><th>第24期
(平成21年４月１日から
平成22年３月31日まで)</th></tr>
<tr><td>１．発行済株式に関する事項</td><td><table><tr><th>株式の種類</th><th>前事業年度末</th><th>増加</th><th>減少</th><th>当事業年度末</th></tr><tr><td>普通株式（株）</td><td>5,050</td><td>－</td><td>－</td><td>5,050</td></tr></table></td></tr>
<tr><td>２．自己株式に関する事項</td><td>該当事項はありません。</td></tr>
<tr><td>３．新株予約権等に関する事項</td><td>該当事項はありません。</td></tr>
<tr><td>４．配当に関する事項</td><td>(1) 配当金支払額
該当事項はありません。
(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの
該当事項はありません。</td></tr>
</table>

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

４．リース取引関係

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
リース取引は重要性が乏しく、１件当たりの金額が少額なため、注記を省略しております。	当社はリース取引を全く行っていないため、該当事項はありません。

５．金融商品関係

第24期（平成21年４月１日から平成22年３月31日まで）

１．金融商品の状況に関する事項

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

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

投資有価証券については、定期的な時価の把握及び社内の報告体制を敷いております。

２．金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（＊）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び（4）未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	65,000

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

（追加情報）

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

第25期（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）

１．金融商品の状況に関する事項

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

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

投資有価証券については、定期的な時価の把握及び社内の報告体制を敷いております。

２．金融商品の時価等に関する事項

平成23年３月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額は、次のとおりであります。

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

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

（＊）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び（4）未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

６．有価証券関係

第24期（平成22年３月31日）

１．その他有価証券

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの

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

２．当事業年度中に売却したその他有価証券

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

３．時価評価されていない有価証券

内容	貸借対照表計上額（千円）
その他有価証券	
非上場株式	65,000

４．その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

該当事項はありません。

第25期（平成23年３月31日）

１．その他有価証券

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの

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

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの

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

２．当事業年度中に売却したその他有価証券

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

３．時価評価されていない有価証券

内容	貸借対照表計上額（千円）
その他有価証券	
非上場株式	10,000

４．その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額

該当事項はありません。

７．デリバティブ関係

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。	同左

８．退職給付関係

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
１．採用している退職給付制度の概要 当社は、退職金規定に基づく社内積立の退職一時金制度を採用しております。	１．採用している退職給付制度の概要 同左
２．退職給付債務に関する事項（平成22年３月31日現在） 退職給付債務　△22,905千円 退職給付引当金　△22,905千円 （注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。	２．退職給付債務に関する事項（平成23年３月31日現在） 退職給付債務　△18,693千円 退職給付引当金　△18,693千円 （注）退職給付債務は、簡便法により算定しております。
３．退職給付費用に関する事項 （平成21年４月１日から平成22年３月31日まで） 勤務費用　6,497千円 退職給付費用　6,497千円 （注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。	３．退職給付費用に関する事項 （平成22年４月１日から平成23年３月31日まで） 勤務費用　7,250千円 退職給付費用　7,250千円 （注）退職給付費用は、簡便法により算定しております。

９．税効果会計関係

第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 繰延税金資産 貸倒引当金繰入超過額　16,271千円 賞与引当金繰入超過額　18,883千円 未払事業税　9,168千円 その他　25,501千円 繰延税金資産小計　69,823千円 評価性引当額　△39,576千円 繰延税金資産合計　30,247千円	１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 繰延税金資産 貸倒引当金繰入超過額　15,294千円 賞与引当金繰入超過額　20,418千円 資産除去債務　6,650千円 移転による除却予定資産減損　7,170千円 未払事業税　6,824千円 その他　19,740千円 繰延税金資産小計　76,099千円 評価性引当額　△32,440千円 繰延税金資産合計　43,658千円 繰延税金負債 その他有価証券評価差額金　△793千円 その他　△806千円 繰延税金負債合計　△1,600千円
２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため、記載を省略しております。	２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの当該差異の原因となった主な項目別の内訳 法定実効税率　40.7% （調整） 受取配当金等永久に益金に算入されない項目　△2.9% 評価性引当額の減少　△1.6% 住民税均等割　0.1% その他　0.4% 税効果会計適用後の法人税等の負担率　36.7%

10. 資産除去債務関係

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

11. セグメント情報等

第25期
(平成22年４月１日から
平成23年３月31日まで)

（セグメント情報）

第24期（平成21年４月１日から平成22年３月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

第25期（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

（関連情報）

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

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

（追加情報）

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

12. 関連当事者との取引関係

Ⅰ 第24期（平成21年４月１日から平成22年３月31日まで）

１．関連当事者との取引

当社と同一の親会社を持つ会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
同一の親会社を持つ会社	中央三井信託銀行株式会社 （注）親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	399,697	銀行業務・信託業務	該当なし	投資信託販売	投資信託に係る営業費用の支払（注１） 支払代行手数料	3,600,680	未払手数料	300,655
同一の親会社を持つ会社	中央三井アセット信託銀行株式会社 （注）親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	11,000	信託業務	該当なし	投資信託委託 投資顧問	支払投資顧問料（注１） 調査費（支払投資顧問料） 建物の賃借（注２）	2,778,495 ―	未払費用 前払費用 長期差入保証金	235,031 49,803 71,548
同一の親会社を持つ会社	中央三井インフォメーションテクノロジー株式会社 （注）親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都目黒区	200	情報処理サービス業	該当なし	システムの管理・開発委託	ソフトウェアの購入（注２） ソフトウェア	45,122	―	―

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注１）報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

（注２）取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

Ⅱ 第25期（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）

１．関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	中央三井トラスト・ホールディングス株式会社	東京都港区	261,608	グループの業務執行管理	（被所有）直接100%	持株会社経営指導	統合関連費用の支払 統合関連費用	51,394	未払金	15,680

(2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
同一の親会社を持つ会社	中央三井信託銀行株式会社 （注）親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	399,697	銀行業務・信託業務	該当なし	投資信託販売	投資信託に係る営業費用の支払（注１） 支払代行手数料	3,100,880	未払手数料	243,621
同一の親会社を持つ会社	中央三井アセット信託銀行株式会社 （注）親会社中央三井トラスト・ホールディングス株式会社の子会社	東京都港区	11,000	信託業務	該当なし	投資信託委託 投資顧問	支払投資顧問料（注１） 調査費（支払投資顧問料） 建物の賃借（注２）	2,425,966 ―	未払費用 前払費用 長期差入保証金	201,863 11,088 72,681

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注１）報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

（注２）取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

13. １株当たり情報

項目	第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
１．１株当たり純資産額	487,545円94銭	542,702円95銭
２．１株当たり当期純利益	62,395円92銭 （注）潜在株式調整後１株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。	54,910円36銭 （注）潜在株式調整後１株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

１株当たり当期純損益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

項目	第24期 (平成21年４月１日から 平成22年３月31日まで)	第25期 (平成22年４月１日から 平成23年３月31日まで)
当期純利益（千円）	315,099	277,297
普通株主に帰属しない金額（千円）	－	－
普通株式に係る当期純利益（千円）	315,099	277,297
普通株式の期中平均株式数（株）	5,050	5,050

14. 重要な後発事象

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

次へ

独立監査人の中間監査報告書

平成２３年１２月１４日

中央三井アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御中

有限責任監査法人 ト ー マ ツ

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　木 村 充 男　　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　松 崎 雅 則　　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている中央三井アセットマネジメント株式会社の平成２３年４月１日から平成２４年３月３１日までの第２６期事業年度の中間会計期間（平成２３年４月１日から平成２３年９月３０日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

次へ

（４）中間貸借対照表

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

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

（５）中間損益計算書

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

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

（６）中間株主資本等変動計算書

第26期中間会計期間（平成23年４月１日から平成23年９月30日まで）

（単位：千円）

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

重要な会計方針

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

追加情報

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

項目	第26期中間会計期間 （平成23年４月１日から 平成23年９月30日まで）
１．発行済株式に関する事項	
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。

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	5,050	－	－	5,050

リース取引関係

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

金融商品関係

第26期中間会計期間
（平成23年４月１日から
平成23年９月30日まで）

金融商品の時価等に関する事項

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

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

（＊）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び（4）未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内　　容	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

有価証券関係

第26期中間会計期間末
（平成23年９月30日）

１．その他有価証券

中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの

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

中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの

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

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

デリバティブ関係

第26期中間会計期間
（平成23年４月１日から
平成23年９月30日まで）

当社はデリバティブ取引を全く行っていないため、該当事項はありません。

資産除去債務関係

第26期中間会計期間末
（平成23年９月30日）

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減

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

セグメント情報等

第26期中間会計期間
（平成23年４月１日から
平成23年９月30日まで）

（セグメント情報）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

（関連情報）

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

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

１株当たり情報

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

（注）１株当たり中間純利益算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

重要な後発事象

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

4 【利害関係人との取引制限】

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

（1）自己又はその役員との取引

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

（2）運用財産相互間の取引

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

（3）通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

（4）親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

（5）その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記（3）及び（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

（1）定款の変更

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

（2）訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

① 名称　　：三井住友信託銀行株式会社

② 資本金の額：342,037百万円（平成24年４月１日現在）

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

（２）販売会社

名称	資本金の額（百万円）（平成23年９月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社※１	342,037※１	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、「金融機関の信託業務の兼営等に関する法律」に基づき信託業務を営んでいます。
株式会社中国銀行※２	15,149	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	47,937	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

※１：資本金の額は平成24年４月１日現在です。

※２：株式会社中国銀行は、４資産インデックスバランスオープン（分配型）のご解約及び収益分配金の再投資の取扱い並びに４資産インデックスバランスオープン（成長型）の募集・販売・ご解約の取扱いを行います。

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【参考情報】

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

提出日	書類名
平成23年９月６日	臨時報告書
平成23年11月25日	有価証券報告書
平成23年11月25日	有価証券届出書の訂正届出書
平成23年12月７日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成２４年４月２７日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御中

有限責任監査法人 ト ー マ ツ

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　松 崎 雅 則　　印

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　山 田 信 之　　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている４資産インデックスバランスオープン（分配型）の平成２３年８月２７日から平成２４年２月２７日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、４資産インデックスバランスオープン（分配型）の平成２４年２月２７日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示して

いるものと認める。

利害関係

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

以 上

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

次へ

独立監査人の監査報告書

平成２４年４月２７日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御中

有限責任監査法人 ト ー マ ツ

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　松 崎 雅 則　　印

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　山 田 信 之　　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている４資産インデックスバランスオープン（成長型）の平成２３年８月２７日から平成２４年２月２７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。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、４資産インデックスバランスオープン（成長型）の平成２４年２月２７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。

利害関係

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

以 上

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

次へ

独立監査人の監査報告書

平成23年６月27日

住信アセットマネジメント株式会社
　取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている住信アセットマネジメント株式会社の平成22年４月１日から平成23年３月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

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

以　上

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

次へ

独立監査人の中間監査報告書

平成23年12月14日

住信アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成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。