

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成24年4月23日
【計算期間】	第2期（自 平成23年 1 月25日 至 平成24年 1 月23日）
【ファンド名】	日本株式インデックス e
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 鈴木 郁也
【本店の所在の場所】	東京都中央区八重洲2丁目3番1号 （平成24年5月21日より、東京都港区芝3丁目33番1号（予定））
【事務連絡者氏名】	ファンド・レポーティング部長 橋詰 廣志
【連絡場所】	東京都中央区八重洲2丁目3番1号 （平成24年5月21日より、東京都港区芝3丁目33番1号（予定））
【電話番号】	03-6259-3801
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

当ファンドは、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

信託金限度額

上限：1兆円

基本的性格

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

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

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単 位 型	国 内	株 式	インデックス型
	海 外	債 券	
		不動産投信	
追 加 型		その他資産 ()	特 殊 型
	内 外	資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

（用語の定義について）

当ファンドが該当する商品分類に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

< 単位型投信・追加型投信 >

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

< 投資対象地域 >

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

< 投資対象資産（収益の源泉） >

- ・株 式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉と

する旨の記載があるものをいいます。

< 補足分類 >

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年 1 回 年 2 回 年 4 回	グローバル () 日本		日経 2 2 5
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年 6 回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	TOPIX
不動産投信	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド ・オブ・ ファンズ	その他 ()
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))		中近東 (中東)		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(用語の定義について)

当ファンドが該当する属性区分に係る用語の定義は以下のとおりです。

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

< 投資対象資産 >

- ・その他資産 (投資信託証券)

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

- ・株式 一般...大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。

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

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

益の源泉となる資産（実質基準）を記載するのに対して、属性区分表では組入れている資産そのもの（形式基準）を記載することとなっているためです。

< 決算頻度 >

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

< 投資対象地域 >

- ・日本...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日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

< 投資形態 >

- ・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。

< インデックスファンドにおける対象インデックス >

- ・T O P I X
...当ファンドの対象インデックスであるT O P I X（東証株価指数、配当込み）は、株式会社東京証券取引所が算出、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。

T O P I X（東証株価指数）の著作権等について

- 1．T O P I Xの指数値及びT O P I Xの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）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T O P I Xに関する全ての権利・ノウハウ及びT O P I Xの商標に関する全ての権利は東証が有しています。
- 2．東証は、T O P I Xの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、T O P I Xの指数値の算出もしくは公表の停止又はT O P I X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。
- 3．東証は、T O P I Xの指数値及びT O P I Xの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のT O P I Xの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- 4．東証は、T O P I Xの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、東証は、T O P I X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。
- 5．当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。
- 6．東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- 7．東証は、委託会社又は当ファンドの購入者のニーズを、T O P I Xの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 8．以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

ファンドの特色

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行い、T O P I X（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標とします。

（２）【ファンドの沿革】

平成22年4月6日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

平成24年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継

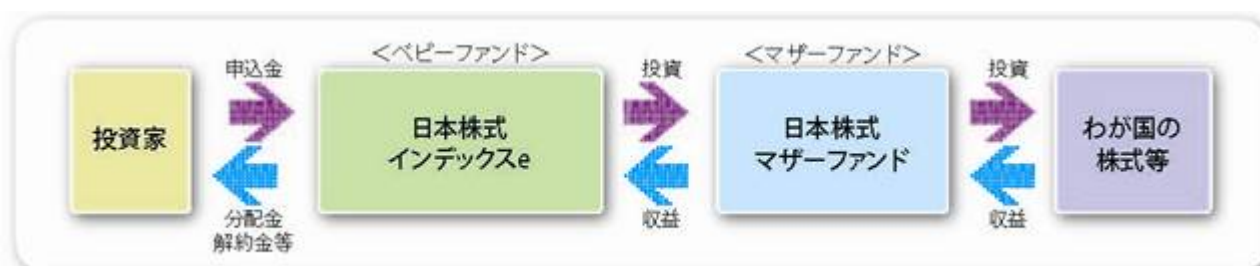
当ファンドの名称をC M A M日本株式インデックスeから日本株式インデックスeに変更

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に変更

（３）【ファンドの仕組み】

ファミリーファンド方式での運用

ファミリーファンド方式とは、投資家から投資された資金をまとめてベビーファンド（日本株式インデックスe）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）に投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



ファンドの関係法人

委託会社 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

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

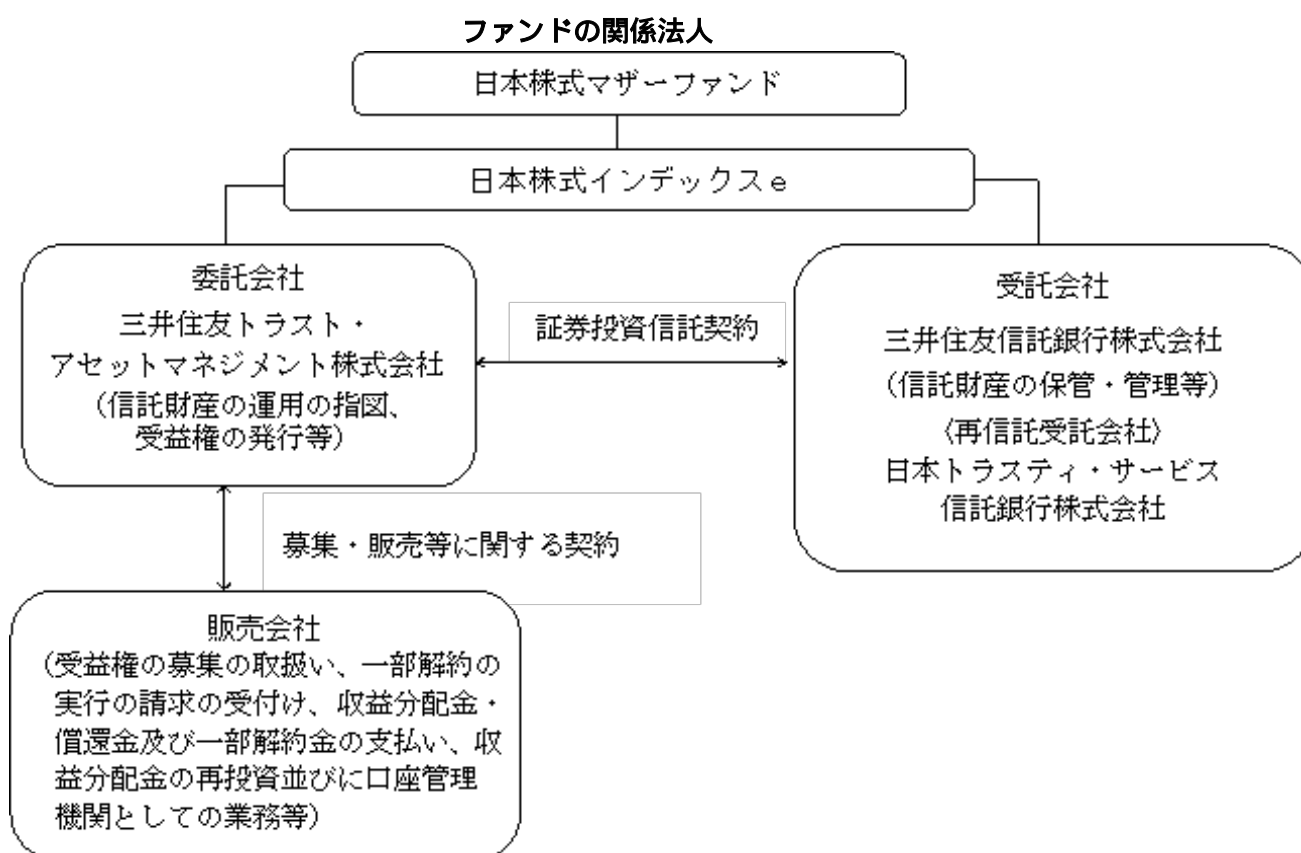
受託会社 三井住友信託銀行株式会社

（再信託受託会社 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

販売会社

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



委託会社と関係法人との契約の概要

	概 要
--	-----

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

委託会社の概況

A．資本金の額：3億円（平成24年4月1日現在）

B．委託会社の沿革

昭和61年11月1日：住信キャピタルマネジメント株式会社設立

昭和62年2月20日：投資顧問業の登録

昭和62年9月9日：投資一任契約に係る業務の認可

平成2年10月1日：住信投資顧問株式会社に商号変更

平成11年2月15日：住信アセットマネジメント株式会社に商号変更

平成11年3月25日：証券投資信託委託業の認可

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

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

C．大株主の状況（平成24年4月1日現在）

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

運用方針

当ファンドは、主としてわが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所）で有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式に投資する日本株式マザーファンド（以下「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券を主要投資対象とし、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。このほか、株式等に直接投資することもあります。

投資態度

- A．株式への実質投資は、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。
- B．株式への実質投資割合は、原則として高位（90%以上）とします。
- C．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。
- D．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- E．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。
- F．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、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これらの取引と類似の取引を行うことができます。
- G．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- H．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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」の受益証券及び次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）（本邦通貨表示のものに限ります。）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。

運用指図できる金融商品

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

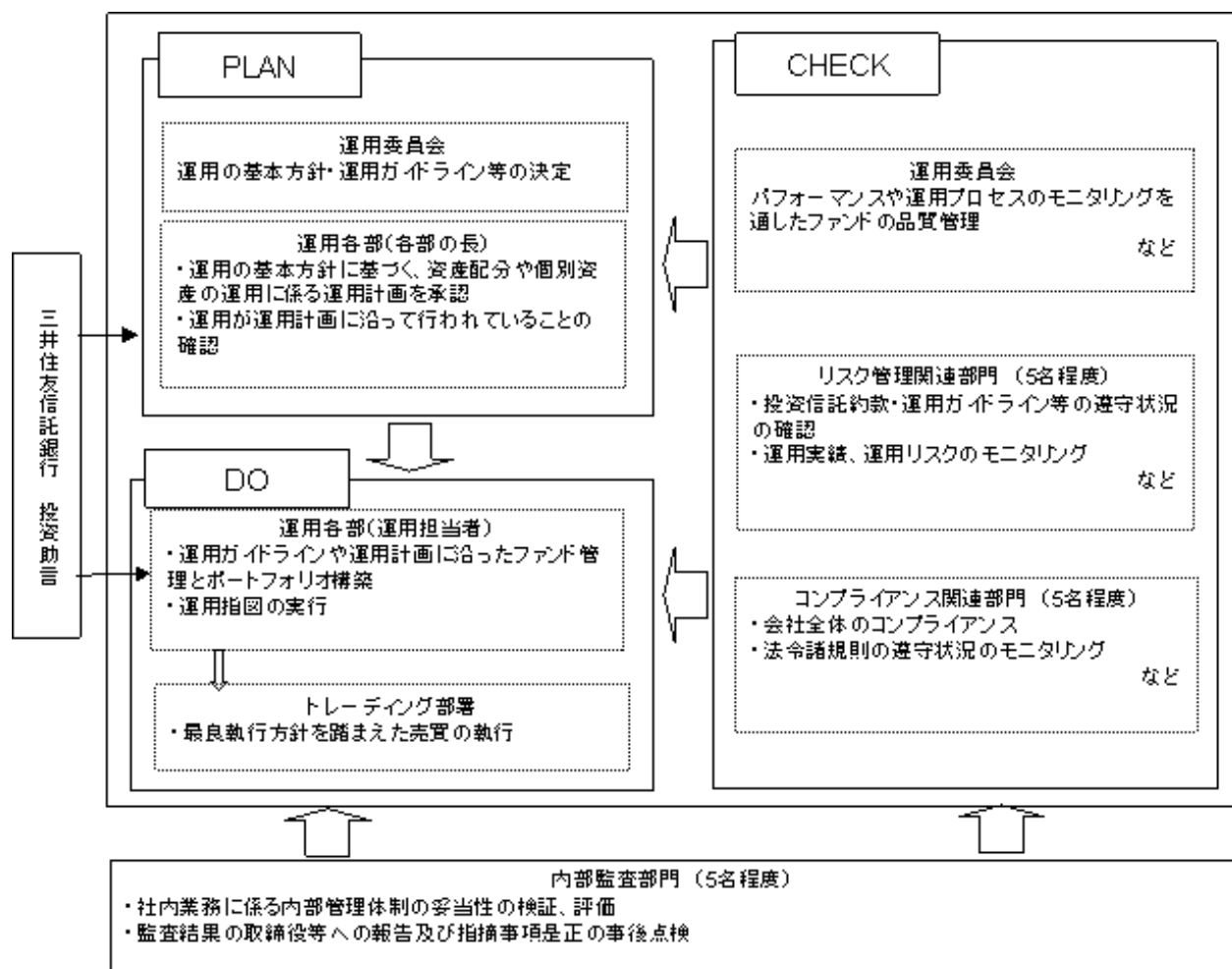
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で上記5. の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

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

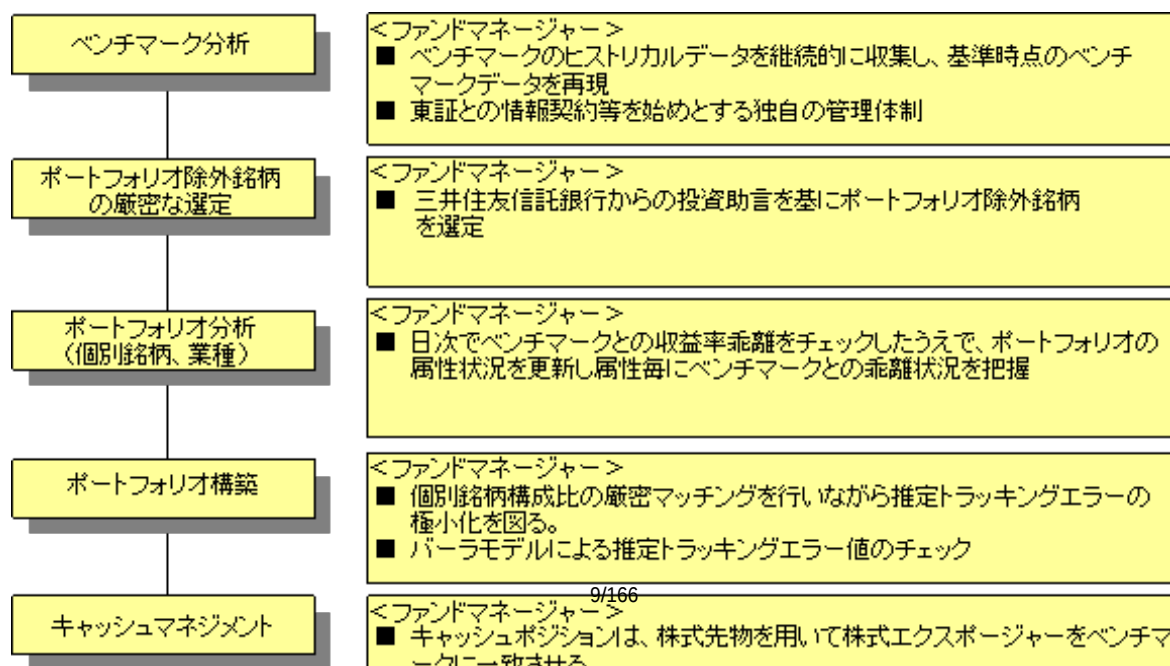
（３）【運用体制】

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



<マザーファンドのポートフォリオ構築プロセス>

- ・ポートフォリオの構築は、ベンチマーク分析、ポートフォリオ分析等の段階を踏んで実施します。
- ・運用に際しては、三井住友信託銀行との投資顧問契約に基づき、三井住友信託銀行の運用部門から投資助言（売買案）の提供を受け活用します。また、運用評価・リスク管理についてはリスク管理関連部門が行います。



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

（４）【分配方針】

分配方針

年１回の毎決算時（決算日は１月22日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

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

分配収益の計算

- A．信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。
 - イ．配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料及びこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）とみなし配当等収益との合計額は、諸経費（後記「４ 手数料等及び税金（４）その他の手数料等」の記載をご参照ください。）、監査費用、当該監査費用に係る消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 - ロ．売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬及び当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
 - ハ．上記イ．及びロ．においてみなし配当等収益とは、マザーファンドの配当等収益にマザーファンドの受益権総口数に占める信託財産に属するマザーファンドの受益権口数の割合を乗じて得た額をいいます。
 - 二．収益分配金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
 - ホ．「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額（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、上記二．に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。
 - B．毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。
- 収益分配金の支払い

A．支払時期と場所

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

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

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

B．時効

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】**約款に定める投資制限****A．株式への投資割合**

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

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２０％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（マザーファンド及び上場投資信託を除きます。）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、わが国の金融商品取引所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、信託財産の効率的な運用に資するため、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、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

K．スワップ取引の運用指図

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

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

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

ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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．金利先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引の評価は、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、金利先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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。

- ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．a．及びb．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

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○．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。
- ．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□．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。

○．公社債の借入れの指図及び範囲

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ．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□．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。
- 二．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．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。

Q．再投資の指図

委託会社は、上記P．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。

R．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。
- ．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、解約代金及び償還金の合計額を限度とします。
- ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

S．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。

T．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イ．からR．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イ．からR．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託会社は、委託会社の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。

二．上記イ．からハ．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。

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

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、「T O P I X」（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

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

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
- 信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。
- 投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下のとおりです。

株価変動リスク

株価は、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。

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。

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>

ファンドは、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。が、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。

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

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

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

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

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

（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

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

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

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

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

「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。

なお、マザーファンドにおいては、申込手数料はかかりません。

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

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

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

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

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

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

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

・お問い合わせ窓口

電 話：０１２０－６６８００１（フリーダイヤル）

受付時間：営業日の午前９時から午後５時まで

・ホームページ アドレス：http://www.smtam.jp/

（２）【換金（解約）手数料】

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

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

マザーファンド名	A 欄	B 欄
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%

税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になることがあります。

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率 0.3885%（税抜 0.37%）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 0.147%	（税抜 0.14%）
------	-----------	------------

販売会社	年率 0.1995%	（税抜 0.19%）
受託会社	年率 0.042%	（税抜 0.04%）

なお、マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

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

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

（４）【その他の手数料等】

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、受益者の負担とし、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに信託財産中から支弁します。

なお、マザーファンドにおいては、監査報酬はかかりません。

借入金の利息は、原則として借入金返済時に信託財産中から支弁します。

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

手数料等の合計額については、ファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個別元本について

- A．追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- B．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- C．ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については各販売会社毎に、個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」の両コースで取得する場合はコース別に、個別元本の算出が行われる場合があります。
- D．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「収益分配金の課税について」をご参照ください。）

一部解約時及び償還時の課税について

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

収益分配金の課税について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

個人の受益者に対する課税

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

なお、原則として、確定申告により、配当控除の適用が可能です。

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

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

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

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

詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めいたします。

法人の受益者に対する課税

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

なお、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。

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

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

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

5【運用状況】

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

以下の記載事項は、平成24年2月29日現在の状況について記載してあります。

（１）【投資状況】

資産の種類		国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託	中央三井日本株式マザーファンド	日本	714,513,814	99.87
受益証券	親投資信託受益証券合計		714,513,814	99.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）			928,446	0.13
合計（純資産総額）			715,442,260	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	253,781,935,690	97.49
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,546,661,542	2.51
合計（純資産総額）		260,328,597,232	100.00

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

種類	銘柄	口数	簿価（円）		評価額（円）		投資 比率 （％）
			単価	金額	単価	金額	
親投資信託 受益証券	中央三井日本株式 マザーファンド	943,003,583	0.6874	648,242,372	0.7577	714,513,814	99.87

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

<参考>

当ファンドが主要投資対象としている親投資信託の状況

（中央三井日本株式マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄

A．主要銘柄の明細

順位	銘柄名	業種	株数	簿価（円）		評価額（円）		投資 比率 （％）
				単価	金額	単価	金額	
1	トヨタ自動車	輸送用機器	2,886,400	2,720.00	7,851,008,000	3,355.00	9,683,872,000	3.72

2	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	16,630,900	355.00	5,903,969,500	420.00	6,984,978,000	2.68
3	本田技研工業	輸送用機器	1,877,900	2,673.00	5,019,626,700	3,095.00	5,812,100,500	2.23
4	キヤノン	電気機器	1,382,700	3,390.00	4,687,353,000	3,680.00	5,088,336,000	1.95
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,661,400	2,397.00	3,982,375,800	2,757.00	4,580,479,800	1.76
6	日本電信電話	情報・通信業	1,011,600	3,835.00	3,879,486,000	3,835.00	3,879,486,000	1.49
7	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	28,226,400	117.00	3,302,488,800	136.00	3,838,790,400	1.47
8	ファナック	電気機器	231,700	12,950.00	3,000,515,000	14,730.00	3,412,941,000	1.31
9	武田薬品工業	医薬品	873,200	3,245.00	2,833,534,000	3,670.00	3,204,644,000	1.23
10	三菱商事	卸売業	1,599,900	1,698.00	2,716,630,200	1,991.00	3,185,400,900	1.22
11	三井物産	卸売業	1,896,300	1,267.00	2,402,612,100	1,399.00	2,652,923,700	1.02
12	小松製作所	機械	1,087,300	2,093.00	2,275,718,900	2,422.00	2,633,440,600	1.01
13	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	18,101	138,000.00	2,497,938,000	138,800.00	2,512,418,800	0.97
14	ソニー	電気機器	1,388,700	1,422.00	1,974,731,400	1,737.00	2,412,171,900	0.93
15	ソフトバンク	情報・通信業	995,300	2,239.00	2,228,476,700	2,421.00	2,409,621,300	0.93
16	日本たばこ産業	食料品	5,529	380,000.00	2,101,020,000	432,000.00	2,388,528,000	0.92
17	日立製作所	電気機器	4,999,000	430.00	2,149,570,000	473.00	2,364,527,000	0.91
18	日産自動車	輸送用機器	2,812,000	717.00	2,016,204,000	832.00	2,339,584,000	0.90
19	三菱地所	不動産業	1,538,000	1,276.00	1,962,488,000	1,470.00	2,260,860,000	0.87
20	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	919,000	2,114.00	1,942,766,000	2,246.00	2,064,074,000	0.79
21	東日本旅客鉄道	陸運業	387,000	4,670.00	1,807,290,000	5,210.00	2,016,270,000	0.77
22	パナソニック	電気機器	2,543,100	644.00	1,637,756,400	759.00	1,930,212,900	0.74
23	東京海上ホールディングス	保険業	834,100	1,860.00	1,551,426,000	2,245.00	1,872,554,500	0.72
24	信越化学工業	化学	418,100	3,970.00	1,659,857,000	4,355.00	1,820,825,500	0.70
25	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	4,755,500	286.00	1,360,073,000	375.00	1,783,312,500	0.69
26	K D D I	情報・通信業	3,410	482,500.00	1,645,325,000	516,000.00	1,759,560,000	0.68
27	国際石油開発帝石	鉱業	3,032	506,000.00	1,534,192,000	577,000.00	1,749,464,000	0.67
28	アステラス製薬	医薬品	517,500	3,015.00	1,560,262,500	3,340.00	1,728,450,000	0.66
29	東芝	電気機器	4,686,000	341.00	1,597,926,000	356.00	1,668,216,000	0.64
30	三菱電機	電気機器	2,226,000	771.00	1,716,246,000	729.00	1,622,754,000	0.62
合計			88,415,072		80,798,866,000		91,660,797,300	35.21

（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	0.76
	建設業	2.28
	食料品	3.39
	繊維製品	0.88
	パルプ・紙	0.37
	化学	5.74
	医薬品	4.61
	石油・石炭製品	0.83
	ゴム製品	0.76
	ガラス・土石製品	1.12
	鉄鋼	1.91
	非鉄金属	1.19
	金属製品	0.67
	機械	5.06
	電気機器	13.31
	輸送用機器	10.28
	精密機器	1.37
	その他製品	1.56
	電気・ガス業	2.96
	陸運業	3.76
	海運業	0.41
	空運業	0.29
	倉庫・運輸関連業	0.23
	情報・通信業	5.95
	卸売業	5.57
	小売業	3.93
	銀行業	9.61
	証券、商品先物取引業	1.20
	保険業	2.39
	その他金融業	0.78
	不動産業	2.43
	サービス業	1.80
	合計	97.49

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

銘柄名	国／地域	数量 （枚）	簿価 （円）	時価 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物取引 買建 ＴＯＰＩＸ先物取引	日本	581	4,828,715,025	4,842,635,000	1.86

（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。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額（円）	1万口当たりの 基準価額（円）
第１期計算期間（平成23年１月24日現在）	137,532,224	9,515
第２期計算期間（平成24年１月23日現在）	620,369,491	7,945
平成23年２月末日	170,137,018	9,857
平成23年３月末日	259,083,039	9,049
平成23年４月末日	284,270,201	8,866
平成23年５月末日	316,110,919	8,725
平成23年６月末日	366,011,951	8,838
平成23年７月末日	377,312,052	8,755
平成23年８月末日	435,334,021	8,026
平成23年９月末日	471,302,978	8,001
平成23年10月末日	507,892,738	8,025
平成23年11月末日	533,548,216	7,647
平成23年12月末日	577,087,591	7,656
平成24年１月末日	639,690,841	7,931
平成24年２月末日	715,442,260	8,775

（注）決算日における基準価額は、分配付、分配落とも同一です。

【分配の推移】

	1万口当たりの収益分配金
第１期計算期間	０円
第２期計算期間	０円

【収益率の推移】

	収益率
第１期計算期間	4.9 %
第２期計算期間	16.5 %

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済み口数
第１期計算期間	216,306,192	71,761,202	144,544,990
第２期計算期間	852,928,428	216,614,101	780,859,317

（注１）設定及び解約の実績は、全て本邦内における実績です。

（注２）第１期計算期間の設定口数には、当初自己設定の設定口数を含みます。

（参考情報）交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

2012年2月29日 現在（基準日）

〈基準価額・純資産の推移〉



・基準価額及び基準価額（分配金再投資）は、決算期終了後の値です。
 ・基準価額（分配金再投資）は、分配金（配当金）を分配時に再投資したものとみなして算出した値です。
 ・ベンチマーク（TOPIX（東証株価指数、配当込み））は、設定日の基準価額に合わせて指数化しています。

〈分配の推移〉

2012年1月	0円
2011年1月	0円
-	-
-	-
-	-
設定来累計	0円

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

〈主な資産の状況〉

資産別投資比率

資産	比率
株式	97.35%
その他資産	2.65%
合計	100.00%

・比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の評価金額の比率をいいます。
 ・ファンドはマザーファンドを組入れますので、実質比率を記載しています。

業種別投資比率（中央三井日本株式マザーファンド）

業種	比率
電気機器	13.31%
輸送用機器	10.28%
銀行業	9.61%
情報・通信業	5.95%
化学	5.74%
その他	52.60%
合計	97.49%

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

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	3.72%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.68%
本田技研工業	輸送用機器	2.23%
キヤノン	電気機器	1.95%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.76%
日本電信電話	情報・通信業	1.49%
みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.47%
ファナック	電気機器	1.31%
武田薬品工業	医薬品	1.23%
三菱商事	卸売業	1.22%
合計		19.08%

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

〈年間収益率の推移〉



・年間収益率は「期間中の基準価額増減＋分配金（税引前）」/前年末の基準価額で算出しています。
 ・2010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。ベンチマークの騰落率も同様です。
 ・2012年（直近年）は年初から基準日までの分配金（税引前）を含む基準価額の騰落率を表示しています。ベンチマークの騰落率も同様です。
 ・ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しているものであり、ファンドの運用実績ではありません。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

（1）申込みの受付

申込期間中において、毎営業日お申込みいただけます。

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

ただし、分配金再投資に関する契約（下記（4））をご参照ください。）に基づいて収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

（2）募集取扱いの単位

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

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

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

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

（4）その他

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

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

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

2【換金（解約）手続等】

（1）受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し販売会社が定める単位をもって一部解約の実

行を請求することができます。

詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記（４）に記載の照会先にお問い合わせください。

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

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

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

なお、一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、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基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

解約価額は委託会社の営業日において日々算出され、日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ

（<http://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

なお、受益者の手取額は、当該解約価額から税額を差引いた金額となります。

販売会社の詳細につきましては、以下の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

・お問い合わせ窓口

電 話：０１２０－６６８００１（フリーダイヤル）

受付時間：営業日の午前９時から午後５時まで

・ホームページ アドレス：<http://www.smtam.jp/>

（５）委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、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、及び既に受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取消することができます。

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

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

（８）解約に係る手数料については、徴収しません。

（９）当ファンドの規模及び商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、上記（４）に記載の照会先までお問い合わせください。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

基準価額

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

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

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

A．親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド）

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。

（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22年４月６日）から無期限とします。ただし、委託会社は、下記（５）の事項に該当することとなった場合は、この信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年１月23日から翌年１月22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22年４月６日から平成23年１月24日までとします。

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

（５）【その他】

信託の終了

この信託契約を解約し信託を終了させる場合は下記のとおりです。

A．委託会社の所定の手続きを経て信託を終了させる場合

イ．受益権の口数が30億口を下回った場合

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30億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發します。
- c. 上記b. の書面決議において、受益者（委託会社及び当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下c. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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も適用しません。
- B. 監督官庁の命令
- イ. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。
- ロ. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款の変更をしようとするときは、下記 の規定に従います。
- C. 委託会社の登録取消等に伴う取扱い
- イ. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ロ. 上記イ. の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、下記 の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- D. 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い
- イ. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、下記 の規定に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- ロ. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

委託会社の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い

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

信託約款の変更等

- A. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更すること又は当ファンドと他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更又は併合しようとする旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- 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發します。

C．上記B．の書面決議において、受益者（委託会社及び当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下C．において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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。

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 A．ハ．b．又は B．に規定する書面に付記します。

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

信託財産の管理

A．信託業務の委託等

イ．受託会社は、委託会社と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準の全てに適合するもの（受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下、下記ハ．及び 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．委託会社のみの方針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

において同じ。）から、売買代金及び償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

C．信託財産の登記等及び記載等の留保等

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

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

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

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

運用報告書

委託会社は、毎決算時及び償還時に運用報告書を作成し、販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

関係法人との契約の更改等に関する手続き、変更した場合の開示方法

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

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

信託事務処理の再委託

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

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次のとおりです。

（1）収益分配金に対する請求権

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

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

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

り増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

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

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

（２）償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

（３）一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

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

一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

（４）投資信託約款等重要事項変更時の反対者の買取請求権

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

（５）受益権均等分割

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

（６）帳簿閲覧権

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

（７）他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

第3【ファンドの経理状況】

- （１）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- （２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（平成22年4月6日から平成23年1月24日まで）及び第2期計算期間（平成23年1月25日から平成24年1月23日まで）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

- （３）当ファンドは、平成24年4月1日付にてファンドの名称を「CMAM日本株式インデックスe」から「日本株式インデックスe」に変更しました。また、当ファンドの主要投資対象である「中央三井日本株式マザーファンド」については、平成24年4月1日付にて「日本株式マザーファンド」に名称を変更しました。以下では、変更前の名称で表示しています。

1【財務諸表】

CMAM日本株式インデックスe

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第 1 期 (平成23年1月24日現在)	第 2 期 (平成24年1月23日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,040,478	1,818,698
親投資信託受益証券	137,531,109	620,298,558
未収入金	3,890,603	5,013,485
未収利息	4	3
流動資産合計	143,462,194	627,130,744
資産合計	143,462,194	627,130,744
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,804,408	5,796,478
未払受託者報酬	13,399	102,925
未払委託者報酬	110,524	849,047
その他未払費用	1,639	12,803
流動負債合計	5,929,970	6,761,253
負債合計	5,929,970	6,761,253
純資産の部		
元本等		
元本	144,544,990	780,859,317
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,012,766	160,489,826
純資産合計	137,532,224	620,369,491
負債純資産合計	143,462,194	627,130,744

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 1 期 自 平成22年 4 月 6 日 至 平成23年 1 月24日	第 2 期 自 平成23年 1 月25日 至 平成24年 1 月23日
営業収益		
受取利息	636	1,909
有価証券売買等損益	6,991,099	44,514,593
営業収益合計	6,991,735	44,512,684
営業費用		
受託者報酬	23,169	157,866
委託者報酬	191,102	1,302,252
その他費用	2,800	19,604
営業費用合計	217,071	1,479,722
営業利益又は営業損失（ ）	6,774,664	45,992,406
経常利益又は経常損失（ ）	6,774,664	45,992,406
当期純利益又は当期純損失（ ）	6,774,664	45,992,406
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（ ）	384,190	10,276,546
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	7,012,766
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,286,967	21,333,285
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,286,967	21,333,285
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,690,207	139,094,485
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,690,207	139,094,485
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,012,766	160,489,826

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	第 1 期 自 平成22年 4 月 6 日 至 平成23年 1 月24日	第 2 期 自 平成23年 1 月25日 至 平成24年 1 月23日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額 で評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2．その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則 として、毎年 1 月23日から翌年 1 月22日までとなっておりますが、 第 1 期計算期間は信託約款の定 めにより、平成22年 4 月 6 日から 平成23年 1 月24日までとなって おります。	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則 として、毎年 1 月23日から翌年 1 月22日までとなっておりますが、 前計算期間末日及び当計算期間 末日が休業日のため、第 2 期計算 期間は平成23年 1 月25日から平 成24年 1 月23日までとなって おります。

（貸借対照表に関する注記）

	第 1 期 （平成23年 1 月24日現在）	第 2 期 （平成24年 1 月23日現在）
1．当該計算期間の末日における受益権総数	144,544,990 口	780,859,317 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 7,012,766 円	元本の欠損 160,489,826 円
3．1 口当たり純資産額 （1 万口当たり純資産額）	0.9515 円 （ 9,515 円）	0.7945 円 （ 7,945 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 1 期 自 平成22年 4 月 6 日 至 平成23年 1 月24日	第 2 期 自 平成23年 1 月25日 至 平成24年 1 月23日
費用控除後の配当等収益額	A	770,490 円 （ 796,033 円）	6,681,232 円 （ 8,159,053 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	5,619,984 円	— 円
収益調整金額	C	119,070 円	33,731,140 円
分配準備積立金額	D	— 円	3,349,822 円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,509,544 円	43,762,194 円

当ファンドの期末残存口数	F	144,544,990 口	780,859,317 口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	450.34 円	560.43 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 1 期 自 平成22年 4 月 6 日 至 平成23年 1 月24日	第 2 期 自 平成23年 1 月25日 至 平成24年 1 月23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、それぞれ剰余金減少額と増加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 1 期 自 平成22年 4 月 6 日 至 平成23年 1 月24日	第 2 期 自 平成23年 1 月25日 至 平成24年 1 月23日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク等に晒されております。	同左

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

2．金融商品の時価等に関する事項

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第 1 期 自 平成22年 4 月 6 日 至 平成23年 1 月24日	第 2 期 自 平成23年 1 月25日 至 平成24年 1 月23日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

第 1 期 自 平成22年 4 月 6 日 至 平成23年 1 月24日	第 2 期 自 平成23年 1 月25日 至 平成24年 1 月23日
該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1．本書における開示対象ファンドの当該計算期間における元本額の変動

	第 1 期 自 平成22年 4 月 6 日 至 平成23年 1 月24日	第 2 期 自 平成23年 1 月25日 至 平成24年 1 月23日
期首元本額	1,000,000 円	144,544,990 円
期中追加設定元本額	215,306,192 円	852,928,428 円
期中一部解約元本額	71,761,202 円	216,614,101 円

2．有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 1 期 (平成23年 1 月24日現在)	第 2 期 (平成24年 1 月23日現在)
	最終の計算期間（自 平成22年 4 月 6 日 至 平成23年 1 月24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 1 月 25日 至 平成24年 1 月23日）の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	7,262,149	28,121,178
合計	7,262,149	28,121,178

3．デリバティブ取引関係

第 1 期 (平成23年 1 月24日現在)	第 2 期 (平成24年 1 月23日現在)
当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。	同左

（4）【附属明細表】

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	904,752,856	620,298,558	
合計		904,752,856	620,298,558	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

[次へ](#)

< 参考 >

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

同マザーファンドの平成24年1月23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1月23日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,960,074,554
株式	233,961,988,670
派生商品評価勘定	189,735,900
未収入金	308,862,222
未収配当金	254,263,275
未収利息	13,981
流動資産合計	241,674,938,602
資産合計	241,674,938,602
負債の部	
流動負債	
前受金	159,931,000
未払金	346,618,100
未払解約金	151,094,955
流動負債合計	657,644,055
負債合計	657,644,055
純資産の部	
元本等	
元本	351,531,797,251
剰余金	
欠損金	110,514,502,704
純資産合計	241,017,294,547
負債・純資産合計	241,674,938,602

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	平成24年1月23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 1 月23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 2,072,900,000 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	351,531,797,251 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 110,514,502,704 円
4．1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.6856 円 （ 6,856 円）

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

平成24年 1 月23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1月23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 1 月23日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

平成24年 1 月23日現在
該当事項はありません。

（その他の注記）

1．元本の変動

平成24年 1 月23日現在	
計算期間の期首元本額	320,819,161,488 円
計算期間中の追加設定元本額	73,095,277,707 円
計算期間中の一部解約元本額	42,382,641,944 円
計算日の元本額	351,531,797,251 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	2,476,238,102 円
中央三井D C 日本株式インデックスファンド	355,711,109 円
中央三井D C 日本株式インデックスファンドL	45,898,652,311 円
中央三井D C 日本株式インデックスファンドA	1,624,624,598 円
中央三井D C バランスファンド3 0	467,026,896 円
中央三井D C バランスファンド5 0	1,042,268,889 円
中央三井D C バランスファンド7 0	554,305,014 円
ベスタ・世界6 資産ファンド（毎月決算型）	280,744,888 円
ベスタ・世界6 資産ファンド（1 年決算型）	179,346,043 円
新生・4 分散ファンド	228,102,854 円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	929,167,650 円
4 資産インデックスバランスオープン（分配型）	72,783,679 円
4 資産インデックスバランスオープン（成長型）	216,184,463 円
日本債券・株式バランスファンド（資産配分調整型）	91,412,374 円
C M A M 日本株式インデックスe	904,752,856 円
中央三井インデックスコレクション（国内株式）	2,997,569,285 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式3 0）	484,925,572 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式5 0）	1,015,625,514 円
中央三井インデックスコレクション（バランス株式7 0）	798,147,666 円
中央三井日本株式インデックスファンドV A（適格機関投資家専用）	33,116,281,528 円
中央三井バランスV A 3 0（適格機関投資家専用）	6,930,544,216 円
中央三井バランスV A 5 0（適格機関投資家専用）	52,942,503,737 円
中央三井V A バランスファンド（株2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	42,130,854,593 円
中央三井V A バランスファンド（株5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	6,611,576,125 円
中央三井V A バランス株式3 0（適格機関投資家専用）	1,015,373,789 円
中央三井V A バランスファンド（株6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	8,566,837,605 円
中央三井バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	6,901,608,205 円
中央三井バランスV A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	2,764,290,807 円
中央三井バランスV A 5 0 L（適格機関投資家専用）	40,597,735,802 円
中央三井バランスV A 7 5（適格機関投資家専用）	2,700,203,347 円

中央三井V Aバランスファンド（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	21,526,948,452 円
中央三井V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	8,483,255,551 円
中央三井V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	295,635,179 円
中央三井バランスV A 40（適格機関投資家専用）	3,645,507,713 円
中央三井V Aバランス株式40（適格機関投資家専用）	2,803,255,161 円
C M A M・バランスファンドV A（適格機関投資家専用）	8,606,646,219 円
中央三井V Aバランスファンド2（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	462,510,720 円
C M A M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
C M A M・V Aバランス50 - 50（適格機関投資家専用）	364,415,378 円
中央三井バランスV A 20（適格機関投資家専用）	1,843,014,566 円
中央三井V Aファンド25（適格機関投資家専用）	3,856,100,650 円
C M A M・バランスファンドV A 2（適格機関投資家専用）	3,379,923,567 円
中央三井バランスV A 20 L（適格機関投資家専用）	143,985,671 円
中央三井バランスV A 25 L（適格機関投資家専用）	2,211,488,886 円
C M A M・バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	26,137,130,283 円
中央三井世界バランスV A 25（適格機関投資家専用）	690,341,671 円
中央三井国内バランスV A 30（適格機関投資家専用）	262,661,588 円
中央三井国内バランスV A 25（適格機関投資家専用）	82,160,249 円
C M A M・V Aバランス20 - 80（適格機関投資家専用）	604,150,977 円
私募日本株式インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	14,327,138 円
中央三井世界バランスV A 20（適格機関投資家専用）	5,316,720 円

2．有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成24年1月23日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	44,110,223,790
合計	44,110,223,790

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、「中央三井日本株式マザーファンド」の期首から計算日までの期間（平成23年1月25日から平成24年1月23日まで）に対応するものです。

3．デリバティブ取引関係

・ヘッジ会計が適用されていないもの

株式関連

区分	種類	平成24年1月23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	6,721,674,100	—	6,911,410,000	189,735,900
	合計	6,721,674,100	—	6,911,410,000	189,735,900

（注）1．時価の算定方法

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

・ヘッジ会計が適用されているもの

平成24年 1 月23日現在

該当事項はありません。

[次へ](#)

(3) 附属明細表（平成24年 1 月23日現在）

有価証券明細表

A . 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
極洋	101,000	185	18,685,000	
日本水産	293,000	272	79,696,000	
マルハニチロホールディングス	503,000	139	69,917,000	
サカタのタネ	37,700	1,072	40,414,400	
ホクト	26,000	1,678	43,628,000	
住石ホールディングス	81,100	90	7,299,000	
日鉄鉱業	66,000	349	23,034,000	
三井松島産業	169,000	155	26,195,000	
国際石油開発帝石	3,092	506,000	1,564,552,000	
日本海洋掘削	6,500	2,483	16,139,500	
関東天然瓦斯開発	27,000	419	11,313,000	
石油資源開発	36,300	3,335	121,060,500	
ショーボンドホールディングス	23,700	1,941	46,001,700	
ミライト・ホールディングス	75,600	615	46,494,000	
ダイセキ環境ソリューション	22	165,700	3,645,400	
間組	123,000	224	27,552,000	
東急建設	116,330	219	25,476,270	
コムシスホールディングス	123,500	828	102,258,000	
ミサワホーム	33,700	657	22,140,900	
高松コンストラクショングループ	23,200	1,249	28,976,800	
東建コーポレーション	9,880	2,703	26,705,640	
ヤマウラ	15,500	231	3,580,500	
大成建設	1,286,000	217	279,062,000	
大林組	763,000	371	283,073,000	
清水建設	778,000	348	270,744,000	
長谷工コーポレーション	1,590,000	57	90,630,000	
松井建設	44,000	319	14,036,000	
鹿島建設	1,192,000	261	311,112,000	
鉄建建設	166,000	122	20,252,000	
太平工業	49,000	430	21,070,000	
前田建設工業	174,000	320	55,680,000	
ナカノフドー建設	48,500	185	8,972,500	
奥村組	241,000	328	79,048,000	

大和小田急建設	36,500	216	7,884,000	
東鉄工業	36,000	757	27,252,000	
戸田建設	273,000	312	85,176,000	
青木あすなろ建設	22,000	420	9,240,000	
北野建設	82,000	189	15,498,000	
植木組	43,000	200	8,600,000	
三井ホーム	45,000	405	18,225,000	
矢作建設工業	34,000	384	13,056,000	
ピーエス三菱	24,900	505	12,574,500	
大東建託	96,600	6,940	670,404,000	
新日本建設	35,400	232	8,212,800	
N I P P O	60,000	845	50,700,000	
東亜道路工業	61,000	229	13,969,000	
前田道路	75,000	925	69,375,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日本道路	85,000	325	27,625,000	
東亜建設工業	237,000	170	40,290,000	
五洋建設	322,500	274	88,365,000	
大林道路	41,000	259	10,619,000	
住友林業	175,000	692	121,100,000	
日本基礎技術	36,600	351	12,846,600	
日成ビルド工業	107,000	188	20,116,000	
巴コーポレーション	38,700	292	11,300,400	
パナホーム	97,000	537	52,089,000	
大和ハウス工業	634,000	961	609,274,000	
ライト工業	57,700	494	28,503,800	
積水ハウス	716,000	725	519,100,000	
日特建設	82,000	123	10,086,000	
北陸電気工事	23,000	227	5,221,000	
ユアテック	39,000	400	15,600,000	
西部電気工業	27,000	356	9,612,000	
四電工	27,000	332	8,964,000	
中電工	39,100	850	33,235,000	
関電工	121,000	397	48,037,000	
きんでん	169,000	658	111,202,000	
東京エネシス	26,000	502	13,052,000	

トーエネック	41,000	432	17,712,000	
住友電設	22,100	531	11,735,100	
日本電設工業	49,000	772	37,828,000	
協和エクシオ	85,700	732	62,732,400	
新日本空調	24,400	449	10,955,600	
日本電話施設	50,000	257	12,850,000	
九電工	51,000	493	25,143,000	
三機工業	63,000	423	26,649,000	
日揮	237,000	2,021	478,977,000	
中外炉工業	82,000	271	22,222,000	
ヤマト	29,000	307	8,903,000	
太平電業	33,000	580	19,140,000	
高砂熱学工業	75,500	630	47,565,000	
三晃金属工業	37,000	255	9,435,000	
朝日工業社	32,000	342	10,944,000	
大気社	40,100	1,728	69,292,800	
ダイダン	38,000	550	20,900,000	
日比谷総合設備	33,500	838	28,073,000	
東芝プラントシステム	41,000	880	36,080,000	
東洋エンジニアリング	136,000	313	42,568,000	
千代田化工建設	202,000	866	174,932,000	
新興プランテック	52,200	654	34,138,800	
日本製粉	160,000	342	54,720,000	
日清製粉グループ本社	230,500	920	212,060,000	
日東富士製粉	20,000	300	6,000,000	
昭和産業	105,000	247	25,935,000	
鳥越製粉	22,200	673	14,940,600	
協同飼料	90,000	96	8,640,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
中部飼料	22,800	502	11,445,600	
日本配合飼料	79,000	111	8,769,000	
東洋精糖	40,000	97	3,880,000	
日本甜菜製糖	141,000	170	23,970,000	
三井製糖	90,000	264	23,760,000	
森永製菓	249,000	181	45,069,000	
中村屋	59,000	400	23,600,000	

江崎グリコ	92,000	863	79,396,000	
名糖産業	11,400	989	11,274,600	
不二家	146,000	153	22,338,000	
山崎製パン	186,000	987	183,582,000	
モロゾフ	39,000	277	10,803,000	
カルビー	13,700	3,825	52,402,500	
森永乳業	215,000	296	63,640,000	
ヤクルト本社	136,400	2,358	321,631,200	
明治ホールディングス	75,300	3,190	240,207,000	
雪印メグミルク	54,800	1,465	80,282,000	
プリマハム	144,000	135	19,440,000	
日本ハム	193,000	963	185,859,000	
伊藤ハム	140,000	314	43,960,000	
丸大食品	122,000	281	34,282,000	
米久	22,500	769	17,302,500	
S F o o d s	16,000	692	11,072,000	
サッポロホールディングス	416,000	297	123,552,000	
アサヒグループホールディングス	477,100	1,708	814,886,800	
麒麟ホールディングス	1,020,000	941	959,820,000	
宝ホールディングス	215,000	489	105,135,000	
オエノンホールディングス	66,000	181	11,946,000	
養命酒製造	19,000	750	14,250,000	
三国コカ・コーラボトリング	26,600	683	18,167,800	
コカ・コーラウエスト	86,100	1,308	112,618,800	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	28,700	985	28,269,500	
ダイドードリンコ	11,700	3,105	36,328,500	
伊藤園	77,100	1,302	100,384,200	
キーコーヒー	22,300	1,443	32,178,900	
ユニカフェ	6,300	354	2,230,200	
ジャパンフーズ	3,400	792	2,692,800	
日清オイリオグループ	98,000	326	31,948,000	
不二製油	61,700	1,067	65,833,900	
J - オイルミルズ	95,000	225	21,375,000	
キッコーマン	208,000	870	180,960,000	
味の素	670,000	919	615,730,000	
キューピー	129,400	1,113	144,022,200	
ハウス食品	90,300	1,437	129,761,100	
カゴメ	98,300	1,511	148,531,300	
焼津水産化学工業	12,100	711	8,603,100	

アリアケジャパン	23,200	1,473	34,173,600	
ニチレイ	285,000	373	106,305,000	
東洋水産	109,000	1,857	202,413,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日清食品ホールディングス	99,300	2,938	291,743,400	
永谷園	24,000	878	21,072,000	
フジッコ	27,000	983	26,541,000	
ロック・フィールド	12,400	1,320	16,368,000	
日本たばこ産業	5,638	380,000	2,142,440,000	
わらべや日洋	14,200	1,082	15,364,400	
なとり	11,800	853	10,065,400	
ミヨシ油脂	81,000	106	8,586,000	
片倉工業	29,900	718	21,468,200	
グンゼ	178,000	233	41,474,000	
東洋紡績	1,004,000	110	110,440,000	
ユニチカ	528,000	47	24,816,000	
富士紡ホールディングス	100,000	173	17,300,000	
日清紡ホールディングス	151,000	746	112,646,000	
倉敷紡績	244,000	152	37,088,000	
シキボウ	155,000	113	17,515,000	
日本毛織	81,000	548	44,388,000	
トーア紡コーポレーション	103,000	58	5,974,000	
ダイドーリミテッド	29,400	687	20,197,800	
帝国繊維	26,000	472	12,272,000	
帝人	972,000	253	245,916,000	
東レ	1,725,000	568	979,800,000	
サカイオーベックス	68,000	130	8,840,000	
住江織物	66,000	158	10,428,000	
日本フエルト	13,200	393	5,187,600	
イチカワ	16,000	159	2,544,000	
日本バイリーン	30,000	342	10,260,000	
日東製網	30,000	149	4,470,000	
芦森工業	56,000	113	6,328,000	
アツギ	187,000	95	17,765,000	
ダイニック	49,000	150	7,350,000	
セーレン	59,400	441	26,195,400	

東海染工	34,000	88	2,992,000	
小松精練	37,000	365	13,505,000	
ワコールホールディングス	141,000	981	138,321,000	
ホギメディカル	15,000	3,210	48,150,000	
レナウン	52,100	148	7,710,800	
クラウディア	3,300	1,022	3,372,600	
T S Iホールディングス	106,400	379	40,325,600	
三陽商会	116,000	186	21,576,000	
オンワードホールディングス	146,000	592	86,432,000	
ルック	40,000	203	8,120,000	
ゴールドウイン	55,000	387	21,285,000	
デサント	60,000	398	23,880,000	
ヤマトインターナショナル	14,600	370	5,402,000	
特種東海製紙	150,000	181	27,150,000	
王子製紙	1,050,000	377	395,850,000	
三菱製紙	338,000	74	25,012,000	
北越紀州製紙	147,500	510	75,225,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
中越パルプ工業	90,000	146	13,140,000	
巴川製紙所	41,000	175	7,175,000	
大王製紙	100,000	504	50,400,000	
日本製紙グループ本社	114,700	1,602	183,749,400	
レンゴー	191,000	524	100,084,000	
トーモク	75,000	219	16,425,000	
ザ・パックス	14,000	1,141	15,974,000	
クラレ	377,800	1,124	424,647,200	
旭化成	1,384,000	487	674,008,000	
共和レザー	14,200	312	4,430,400	
コープケミカル	43,000	116	4,988,000	
昭和電工	1,477,000	169	249,613,000	
住友化学	1,633,000	320	522,560,000	
日本化成	50,000	144	7,200,000	
住友精化	47,000	348	16,356,000	
日産化学工業	180,800	772	139,577,600	
ラサ工業	101,000	125	12,625,000	
クレハ	156,000	375	58,500,000	

テイカ	42,000	308	12,936,000	
片倉チッカリン	20,000	200	4,000,000	
日本曹達	143,000	348	49,764,000	
東ソー	636,000	221	140,556,000	
トクヤマ	370,000	274	101,380,000	
セントラル硝子	227,000	364	82,628,000	
東亜合成	298,000	336	100,128,000	
ダイソー	98,000	249	24,402,000	
関東電化工業	55,000	306	16,830,000	
電気化学工業	499,000	309	154,191,000	
信越化学工業	426,300	3,970	1,692,411,000	
日本カーバイド工業	81,000	123	9,963,000	
堺化学工業	76,000	303	23,028,000	
エア・ウォーター	194,000	995	193,030,000	
太陽日酸	312,000	525	163,800,000	
日本化学工業	100,000	140	14,000,000	
日本パーカライジング	57,000	984	56,088,000	
高圧ガス工業	37,000	481	17,797,000	
チタン工業	27,000	385	10,395,000	
四国化成工業	36,000	426	15,336,000	
戸田工業	32,000	694	22,208,000	
ステラ ケミファ	11,600	2,255	26,158,000	
保土谷化学工業	50,000	259	12,950,000	
日本触媒	177,000	873	154,521,000	
大日精化工業	87,000	351	30,537,000	
カネカ	296,000	435	128,760,000	
三菱瓦斯化学	409,000	448	183,232,000	
三井化学	1,008,000	249	250,992,000	
J S R	216,400	1,498	324,167,200	
東京応化工業	42,700	1,606	68,576,200	
三菱ケミカルホールディングス	1,486,000	459	682,074,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日本合成化学工業	50,000	476	23,800,000	
ダイセル	309,000	482	148,938,000	
住友ベークライト	204,000	459	93,636,000	
積水化学工業	494,000	654	323,076,000	

日本ゼオン	222,000	662	146,964,000	
アイカ工業	63,200	1,071	67,687,200	
宇部興産	996,000	225	224,100,000	
積水樹脂	36,000	819	29,484,000	
タキロン	56,000	261	14,616,000	
旭有機材工業	84,000	217	18,228,000	
日立化成工業	102,800	1,411	145,050,800	
ニチバン	23,000	258	5,934,000	
リケンテクノス	42,000	222	9,324,000	
大倉工業	57,000	245	13,965,000	
積水化成品工業	61,000	296	18,056,000	
群栄化学工業	67,000	202	13,534,000	
タイガースポリマー	12,200	300	3,660,000	
日本カーリット	20,700	400	8,280,000	
日本化薬	167,000	728	121,576,000	
日本精化	21,100	523	11,035,300	
A D E K A	102,300	768	78,566,400	
日油	189,000	392	74,088,000	
ハリマ化成	21,400	623	13,332,200	
花王	630,400	2,084	1,313,753,600	
第一工業製薬	46,000	235	10,810,000	
三洋化成工業	76,000	511	38,836,000	
大日本塗料	145,000	88	12,760,000	
日本ペイント	224,000	579	129,696,000	
関西ペイント	269,000	718	193,142,000	
中国塗料	75,000	490	36,750,000	
日本特殊塗料	18,600	314	5,840,400	
藤倉化成	31,900	400	12,760,000	
太陽ホールディングス	19,700	2,043	40,247,100	
D I C	907,000	151	136,957,000	
サカタインクス	46,000	351	16,146,000	
東洋インキＳＣホールディングス	216,000	307	66,312,000	
富士フイルムホールディングス	507,500	1,958	993,685,000	
資生堂	394,700	1,364	538,370,800	
ライオン	274,000	460	126,040,000	
高砂香料工業	80,000	372	29,760,000	
マンダム	23,800	1,983	47,195,400	
ミルボン	12,600	2,322	29,257,200	
ファンケル	59,700	1,048	62,565,600	

コーセー	38,400	1,910	73,344,000	
ドクターシーラボ	143	385,500	55,126,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	24,200	1,980	47,916,000	
エステー	14,600	1,008	14,716,800	
コニシ	17,900	1,085	19,421,500	
長谷川香料	30,700	1,207	37,054,900	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
小林製薬	33,000	3,960	130,680,000	
荒川化学工業	19,500	694	13,533,000	
メック	19,600	286	5,605,600	
日本高純度化学	70	204,100	14,287,000	
荏原ユーザライト	3,600	1,935	6,966,000	
アース製薬	17,100	2,879	49,230,900	
イハラケミカル工業	43,000	323	13,889,000	
北興化学工業	27,000	232	6,264,000	
大成ラミック	6,900	2,434	16,794,600	
クミアイ化学工業	58,000	331	19,198,000	
日本農薬	57,000	319	18,183,000	
アキレス	198,000	113	22,374,000	
有沢製作所	39,500	294	11,613,000	
日東電工	195,900	2,878	563,800,200	
レック	7,100	1,195	8,484,500	
きもと	19,500	515	10,042,500	
藤森工業	17,700	1,125	19,912,500	
前澤化成工業	22,800	830	18,924,000	
J S P	15,900	1,236	19,652,400	
エフピコ	10,500	5,080	53,340,000	
天馬	19,100	703	13,427,300	
信越ポリマー	46,600	349	16,263,400	
東リ	95,000	161	15,295,000	
ニフコ	53,000	2,060	109,180,000	
日本バルカー工業	93,000	214	19,902,000	
ユニ・チャーム	131,300	3,815	500,909,500	
協和発酵キリン	325,000	920	299,000,000	
武田薬品工業	890,400	3,245	2,889,348,000	代用有価証券で 200,000株 担保差入

アステラス製薬	527,700	3,015	1,591,015,500	
大日本住友製薬	168,300	836	140,698,800	
塩野義製薬	371,200	979	363,404,800	
田辺三菱製薬	237,400	1,066	253,068,400	
わかもと製薬	27,000	233	6,291,000	
あすか製薬	28,000	473	13,244,000	
日本新薬	50,000	905	45,250,000	
中外製薬	276,100	1,210	334,081,000	
科研製薬	93,000	1,001	93,093,000	
エーザイ	292,600	3,130	915,838,000	
ロート製薬	100,000	923	92,300,000	
小野薬品工業	116,300	4,215	490,204,500	
久光製薬	73,800	3,325	245,385,000	
有機合成薬品工業	21,000	177	3,717,000	
持田製薬	84,000	845	70,980,000	
参天製薬	79,800	3,105	247,779,000	
扶桑薬品工業	80,000	203	16,240,000	
日本ケミファ	36,000	291	10,476,000	
ツムラ	64,800	2,219	143,791,200	
日医工	40,200	1,797	72,239,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
キッセイ薬品工業	44,100	1,555	68,575,500	
生化学工業	45,400	850	38,590,000	
栄研化学	18,400	1,042	19,172,800	
日水製薬	9,500	695	6,602,500	
鳥居薬品	16,200	1,401	22,696,200	
東和薬品	12,100	3,375	40,837,500	
沢井製薬	15,600	7,950	124,020,000	
ゼリア新薬工業	34,000	1,310	44,540,000	
第一三共	799,500	1,440	1,151,280,000	
キョーリン製薬ホールディングス	58,000	1,314	76,212,000	
大幸薬品	11,000	807	8,877,000	
ダイト	6,600	1,193	7,873,800	
大塚ホールディングス	471,800	2,117	998,800,600	
大正製薬ホールディングス	57,200	6,480	370,656,000	
日本コークス工業	196,000	114	22,344,000	

昭和シェル石油	212,500	534	113,475,000	
コスモ石油	657,000	224	147,168,000	
ニチレキ	37,000	422	15,614,000	
東燃ゼネラル石油	358,000	736	263,488,000	
ユシロ化学工業	13,400	853	11,430,200	
ピーピー・カストロール	10,900	331	3,607,900	
AOCホールディングス	56,000	540	30,240,000	
MORESCO	5,900	783	4,619,700	
出光興産	28,200	8,240	232,368,000	
JXホールディングス	2,638,000	460	1,213,480,000	
横浜ゴム	290,000	445	129,050,000	
東洋ゴム工業	180,000	188	33,840,000	
ブリヂストン	744,900	1,699	1,265,585,100	
住友ゴム工業	185,400	901	167,045,400	
藤倉ゴム工業	15,400	291	4,481,400	
オカモト	87,000	295	25,665,000	
フコク	10,100	710	7,171,000	
ニッタ	23,600	1,447	34,149,200	
東海ゴム工業	44,200	891	39,382,200	
三ツ星ベルト	63,000	411	25,893,000	
バンドー化学	85,000	299	25,415,000	
日東紡績	175,000	257	44,975,000	
旭硝子	1,171,000	688	805,648,000	
日本板硝子	1,019,000	156	158,964,000	
石塚硝子	33,000	143	4,719,000	
日本山村硝子	96,000	212	20,352,000	
日本電気硝子	456,000	790	360,240,000	
オハラ	9,300	799	7,430,700	
住友大阪セメント	482,000	239	115,198,000	
太平洋セメント	1,396,000	169	235,924,000	
デイ・シイ	23,200	259	6,008,800	
日本ヒューム	30,000	359	10,770,000	
日本コンクリート工業	48,000	296	14,208,000	
東海カーボン	206,000	408	84,048,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日本カーボン	110,000	218	23,980,000	

東洋炭素	13,200	3,210	42,372,000	
ノリタケカンパニーリミテド	124,000	234	29,016,000	
T O T O	367,000	625	229,375,000	
日本碍子	309,000	984	304,056,000	
日本特殊陶業	205,000	967	198,235,000	
M A R U W A	7,000	3,370	23,590,000	
品川リフラクトリーズ	61,000	237	14,457,000	
黒崎播磨	53,000	277	14,681,000	
東京窯業	30,000	196	5,880,000	
ニッカトー	8,900	456	4,058,400	
フジミインコーポレーテッド	21,900	1,009	22,097,100	
ニチアス	117,000	438	51,246,000	
ニチハ	32,200	892	28,722,400	
新日本製鐵	6,236,000	203	1,265,908,000	
住友金属工業	4,403,000	145	638,435,000	
神戸製鋼所	3,293,000	133	437,969,000	
日新製鋼	841,000	124	104,284,000	
中山製鋼所	120,000	95	11,400,000	
合同製鐵	133,000	199	26,467,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	562,900	1,460	821,834,000	
東京製鐵	120,200	622	74,764,400	
共英製鋼	25,300	1,439	36,406,700	
大和工業	54,300	2,439	132,437,700	
東京鐵鋼	46,000	258	11,868,000	
大阪製鐵	14,900	1,476	21,992,400	
淀川製鋼所	169,000	360	60,840,000	
東洋鋼鈑	57,000	291	16,587,000	
住友鋼管	13,800	651	8,983,800	
丸一鋼管	72,900	1,829	133,334,100	
モリ工業	36,000	269	9,684,000	
大同特殊鋼	398,000	509	202,582,000	
日本高周波鋼業	93,000	124	11,532,000	
日本金属工業	183,000	71	12,993,000	
日本冶金工業	174,500	128	22,336,000	
山陽特殊製鋼	118,000	446	52,628,000	
愛知製鋼	126,000	428	53,928,000	
日立金属	155,000	876	135,780,000	
日本金属	57,000	145	8,265,000	
大平洋金属	166,000	428	71,048,000	

日本電工	86,000	378	32,508,000	
栗本鐵工所	113,000	188	21,244,000	
日本鑄鉄管	26,000	184	4,784,000	
三菱製鋼	143,000	224	32,032,000	
日亜鋼業	36,000	209	7,524,000	
日本精線	16,000	403	6,448,000	
シンニッタン	20,900	347	7,252,300	
新家工業	93,000	130	12,090,000	
日本軽金属	538,000	111	59,718,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
大紀アルミニウム工業所	37,000	342	12,654,000	
三井金属鉱業	646,000	220	142,120,000	
東邦亜鉛	134,000	310	41,540,000	
三菱マテリアル	1,483,000	236	349,988,000	
住友金属鉱山	615,000	1,089	669,735,000	
DOWAホールディングス	284,000	507	143,988,000	
古河機械金属	399,000	71	28,329,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,300	3,610	84,113,000	
東邦チタニウム	38,500	1,356	52,206,000	
住友軽金属工業	574,000	77	44,198,000	
古河スカイ	96,000	214	20,544,000	
古河電気工業	747,000	202	150,894,000	
住友電気工業	839,300	893	749,494,900	
フジクラ	356,000	244	86,864,000	
昭和電線ホールディングス	333,000	85	28,305,000	
タツタ電線	50,000	365	18,250,000	
日立電線	196,000	185	36,260,000	
沖電線	25,000	174	4,350,000	
カナレ電気	3,000	1,192	3,576,000	
平河ヒューテック	4,600	723	3,325,800	
リョービ	133,000	309	41,097,000	
アサヒホールディングス	33,200	1,575	52,290,000	
稲葉製作所	11,900	937	11,150,300	
トーカロ	13,400	1,674	22,431,600	
アルファＣｏ	8,000	950	7,600,000	
SUMCO	145,300	662	96,188,600	

川田テクノロジーズ	7,200	1,309	9,424,800	
東洋製罐	167,900	1,104	185,361,600	
ホッカンホールディングス	58,000	231	13,398,000	
コロナ	11,300	1,233	13,932,900	
横河ブリッジホールディングス	52,000	563	29,276,000	
駒井ハルテック	57,000	326	18,582,000	
高田機工	32,000	269	8,608,000	
三和ホールディングス	257,000	263	67,591,000	
文化シャッター	80,000	302	24,160,000	
東洋シャッター	20,500	387	7,933,500	
住生活グループ	308,900	1,601	494,548,900	
日本フィルコン	17,500	405	7,087,500	
ノーリツ	46,500	1,353	62,914,500	
長府製作所	25,300	1,978	50,043,400	
リンナイ	38,200	5,230	199,786,000	
ダイニチ工業	12,800	740	9,472,000	
日東精工	32,000	207	6,624,000	
三洋工業	63,000	165	10,395,000	
岡部	59,300	394	23,364,200	
東プレ	45,800	780	35,724,000	
高周波熱錬	31,800	631	20,065,800	
東京製網	162,000	199	32,238,000	
パイオラックス	10,200	1,744	17,788,800	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日本発條	172,000	706	121,432,000	
中央発條	31,000	278	8,618,000	
三益半導体工業	20,000	668	13,360,000	
アタカ大機	15,000	275	4,125,000	
日本製鋼所	367,000	598	219,466,000	
日立ツール	14,500	869	12,600,500	
三浦工業	35,300	2,206	77,871,800	
タクマ	80,000	369	29,520,000	
ツガミ	59,000	520	30,680,000	
オークマ	144,000	553	79,632,000	
東芝機械	131,000	418	54,758,000	
アマダ	335,000	533	178,555,000	

アイダエンジニアリング	63,400	376	23,838,400	
牧野フライス製作所	120,000	541	64,920,000	
オーエスジー	104,600	1,132	118,407,200	
ダイジェット工業	33,000	162	5,346,000	
旭ダイヤモンド工業	59,200	1,029	60,916,800	
森精機製作所	125,200	759	95,026,800	
ディスコ	24,000	4,250	102,000,000	
日東工器	14,200	1,813	25,744,600	
豊和工業	134,000	72	9,648,000	
大阪機工	100,000	118	11,800,000	
東洋機械金属	21,300	199	4,238,700	
津田駒工業	62,000	208	12,896,000	
島精機製作所	31,500	1,449	45,643,500	
日阪製作所	31,000	876	27,156,000	
やまびこ	9,300	900	8,370,000	
ベガサスミシン製造	25,300	236	5,970,800	
ナブテスコ	98,600	1,597	157,464,200	
三井海洋開発	19,600	1,401	27,459,600	
レオン自動機	26,000	193	5,018,000	
S M C	70,900	12,960	918,864,000	
新川	18,400	414	7,617,600	
ホソカワミクロン	38,000	374	14,212,000	
ユニオンツール	13,600	1,370	18,632,000	
オイレス工業	26,400	1,548	40,867,200	
サトーホールディングス	24,900	975	24,277,500	
日本エアーテック	9,000	365	3,285,000	
日精樹脂工業	21,300	369	7,859,700	
ワイエイシイ	9,500	655	6,222,500	
小松製作所	1,126,200	2,093	2,357,136,600	
住友重機械工業	606,000	488	295,728,000	
日立建機	121,300	1,489	180,615,700	
日工	33,000	327	10,791,000	
巴工業	9,000	1,437	12,933,000	
井関農機	243,000	178	43,254,000	
T O W A	21,200	425	9,010,000	
丸山製作所	53,000	180	9,540,000	
北川鉄工所	109,000	154	16,786,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
クボタ	1,087,000	701	761,987,000	
荏原実業	5,600	1,199	6,714,400	
三菱化工機	78,000	148	11,544,000	
月島機械	35,000	613	21,455,000	
帝国電機製作所	8,500	1,409	11,976,500	
新東工業	52,900	727	38,458,300	
澁谷工業	14,300	898	12,841,400	
アイチ コーポレーション	39,200	345	13,524,000	
小森コーポレーション	68,800	548	37,702,400	
鶴見製作所	19,000	564	10,716,000	
住友精密工業	35,000	504	17,640,000	
酒井重工業	45,000	171	7,695,000	
荏原製作所	387,000	308	119,196,000	
石井鐵工所	35,000	164	5,740,000	
西島製作所	28,100	1,064	29,898,400	
ダイキン工業	289,200	2,232	645,494,400	
オルガノ	45,000	609	27,405,000	
トーヨーカネツ	127,000	180	22,860,000	
栗田工業	131,000	2,090	273,790,000	
椿本チエイン	122,000	449	54,778,000	
大同工業	52,000	151	7,852,000	
日本コンベヤ	73,000	86	6,278,000	
木村化工機	21,800	345	7,521,000	
アネスト岩田	40,000	354	14,160,000	
ダイフク	104,000	435	45,240,000	
加藤製作所	54,000	273	14,742,000	
油研工業	46,000	173	7,958,000	
タダノ	110,000	508	55,880,000	
フジテック	66,000	485	32,010,000	
シーケーディ	63,900	578	36,934,200	
キトー	109	58,300	6,354,700	
平和	49,200	1,330	65,436,000	
理想科学工業	16,400	1,115	18,286,000	
SANKYO	68,800	3,660	251,808,000	
日本金銭機械	20,900	592	12,372,800	
マースエンジニアリング	12,800	1,350	17,280,000	
福島工業	6,200	950	5,890,000	

オーイズミ	7,900	244	1,927,600	
ダイコク電機	10,400	756	7,862,400	
アマノ	68,800	677	46,577,600	
サンデン	119,000	261	31,059,000	
マックス	36,000	956	34,416,000	
グローリー	67,700	1,683	113,939,100	
大和冷機工業	33,000	409	13,497,000	
セガサミーホールディングス	243,900	1,613	393,410,700	
日本ピストンリング	83,000	164	13,612,000	
リケン	83,000	312	25,896,000	
T P R	25,200	994	25,048,800	
ホシザキ電機	45,700	1,690	77,233,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
大豊工業	16,100	739	11,897,900	
日本精工	505,000	572	288,860,000	
N T N	525,000	334	175,350,000	
ジェイテクト	217,000	833	180,761,000	
不二越	228,000	386	88,008,000	
日本トムソン	73,000	473	34,529,000	
T H K	150,900	1,673	252,455,700	
ユーシン精機	11,800	1,432	16,897,600	
前澤給装工業	13,200	1,064	14,044,800	
イーグル工業	28,000	699	19,572,000	
前澤工業	16,600	246	4,083,600	
日本ビラー工業	23,000	581	13,363,000	
キッツ	93,800	347	32,548,600	
日立工機	62,000	613	38,006,000	
マキタ	148,000	2,873	425,204,000	
日立造船	897,500	113	101,417,500	
三菱重工業	3,804,000	349	1,327,596,000	
I H I	1,551,000	204	316,404,000	
イビデン	148,800	1,580	235,104,000	
コニカミノルタホールディングス	599,500	565	338,717,500	
ブラザー工業	293,400	1,019	298,974,600	
ミネベア	338,000	345	116,610,000	
日立製作所	5,097,000	430	2,191,710,000	

東芝	4,778,000	341	1,629,298,000	
三菱電機	2,270,000	771	1,750,170,000	
富士電機	684,000	228	155,952,000	
東洋電機製造	39,000	302	11,778,000	
安川電機	267,000	686	183,162,000	
シンフォニアテクノロジー	136,000	189	25,704,000	
明電舎	225,000	281	63,225,000	
オリジン電気	33,000	263	8,679,000	
デンヨー	21,400	1,059	22,662,600	
東芝テック	142,000	280	39,760,000	
芝浦メカトロニクス	40,000	217	8,680,000	
マブチモーター	30,900	3,225	99,652,500	
日本電産	122,700	7,200	883,440,000	
高岳製作所	90,000	229	20,610,000	
ダイヘン	134,000	317	42,478,000	
J V C ケンウッド	137,500	330	45,375,000	
第一精工	5,300	2,248	11,914,400	
日新電機	46,000	504	23,184,000	
大崎電気工業	33,000	788	26,004,000	
オムロン	252,800	1,657	418,889,600	
日東工業	34,100	950	32,395,000	
I D E C	29,800	841	25,061,800	
エルピーダメモリ	306,500	351	107,581,500	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	437,000	452	197,524,000	
サクサホールディングス	60,000	195	11,700,000	
メルコホールディングス	12,700	2,103	26,708,100	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
テクノメディカ	17	285,000	4,845,000	
日本電気	3,121,000	166	518,086,000	
富士通	2,188,000	424	927,712,000	
沖電気工業	881,000	74	65,194,000	
岩崎通信機	105,000	80	8,400,000	
電気興業	71,000	343	24,353,000	
サンケン電気	115,000	280	32,200,000	
ナカヨ通信機	23,000	321	7,383,000	
アイホン	13,200	1,563	20,631,600	

ルネサスエレクトロニクス	58,800	507	29,811,600	
セイコーエプソン	154,900	990	153,351,000	
ワコム	450	112,700	50,715,000	
アルバック	42,500	1,099	46,707,500	
アクセル	10,500	1,566	16,443,000	
ナナオ	19,200	1,633	31,353,600	
日本信号	52,800	501	26,452,800	
京三製作所	49,000	351	17,199,000	
能美防災	30,000	524	15,720,000	
ホーチキ	21,000	400	8,400,000	
日本無線	51,000	224	11,424,000	
パナソニック	2,593,200	644	1,670,020,800	
シャープ	1,096,000	669	733,224,000	
アンリツ	108,000	789	85,212,000	
富士通ゼネラル	54,000	465	25,110,000	
日立国際電気	52,000	675	35,100,000	
ソニー	1,416,000	1,422	2,013,552,000	
T D K	118,700	3,590	426,133,000	
帝国通信工業	54,000	141	7,614,000	
ミツミ電機	80,300	617	49,545,100	
タムラ製作所	76,000	226	17,176,000	
アルプス電気	179,100	580	103,878,000	
パイオニア	321,700	366	117,742,200	
日本電波工業	17,600	924	16,262,400	
日本トリム	2,850	1,834	5,226,900	
ローランド ディー . ジー .	10,400	856	8,902,400	
フォスター電機	21,500	1,092	23,478,000	
クラリオン	140,000	145	20,300,000	
S M K	72,000	254	18,288,000	
ヨコオ	17,900	387	6,927,300	
東光	103,000	149	15,347,000	
ティアック	125,000	41	5,125,000	
ホシデン	61,500	556	34,194,000	
ヒロセ電機	39,500	7,350	290,325,000	
日本航空電子工業	52,000	564	29,328,000	
T O A	25,000	521	13,025,000	
ユニデン	68,000	284	19,312,000	
アルパイン	44,400	952	42,268,800	
スミダコーポレーション	14,100	510	7,191,000	

アイコム	12,700	2,020	25,654,000	
------	--------	-------	------------	--

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
船井電機	20,400	1,861	37,964,400	
横河電機	246,100	720	177,192,000	
新電元工業	80,000	365	29,200,000	
山武	58,200	1,640	95,448,000	
日本光電工業	45,200	1,827	82,580,400	
チノー	40,000	205	8,200,000	
共和電業	24,000	233	5,592,000	
日本電子材料	9,000	371	3,339,000	
堀場製作所	42,000	2,342	98,364,000	
アドバンテスト	168,800	761	128,456,800	
小野測器	25,000	215	5,375,000	
エスベック	23,500	509	11,961,500	
パナソニック電工 S U N X	19,900	398	7,920,200	
キーエンス	50,600	19,260	974,556,000	
日置電機	10,900	1,303	14,202,700	
シスメックス	79,800	2,459	196,228,200	
メガチップス	18,600	1,219	22,673,400	
O B A R A G R O U P	17,000	920	15,640,000	
日本電産コパル電子	23,400	477	11,161,800	
ミヤチテクノス	12,200	663	8,088,600	
東京電波	6,600	376	2,481,600	
澤藤電機	13,000	226	2,938,000	
コーセル	33,000	1,113	36,729,000	
日立メディコ	17,000	842	14,314,000	
新日本無線	14,000	239	3,346,000	
オプテックス	15,600	1,017	15,865,200	
千代田インテグレ	11,000	939	10,329,000	
東光電気	14,000	385	5,390,000	
スタンレー電気	152,200	1,219	185,531,800	
岩崎電気	83,000	183	15,189,000	
ウシオ電機	137,800	1,127	155,300,600	
岡谷電機産業	12,100	347	4,198,700	
ヘリオス テクノ ホールディング	24,400	157	3,830,800	
日本セラミック	14,800	1,420	21,016,000	

日本デジタル研究所	19,300	751	14,494,300	
古河電池	16,000	378	6,048,000	
双信電機	11,000	338	3,718,000	
山一電機	23,000	190	4,370,000	
図研	15,400	570	8,778,000	
日本電子	84,000	210	17,640,000	
カシオ計算機	216,300	467	101,012,100	
ファナック	236,300	12,950	3,060,085,000	
日本シイエムケイ	48,900	290	14,181,000	
エンブラス	11,500	1,669	19,193,500	
ローム	111,900	3,780	422,982,000	
浜松ホトニクス	88,500	2,724	241,074,000	
三井ハイテック	29,900	320	9,568,000	
新光電気工業	76,200	582	44,348,400	
京セラ	188,800	6,510	1,229,088,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
太陽誘電	101,900	692	70,514,800	
村田製作所	238,100	4,130	983,353,000	
ユーシン	31,700	624	19,780,800	
双葉電子工業	39,400	1,288	50,747,200	
北陸電気工業	91,000	122	11,102,000	
ニチコン	71,500	782	55,913,000	
日本ケミコン	131,000	277	36,287,000	
K O A	28,500	723	20,605,500	
市光工業	55,000	146	8,030,000	
小糸製作所	113,000	1,199	135,487,000	
ミツバ	42,000	618	25,956,000	
スター精密	37,500	737	27,637,500	
大日本スクリーン製造	215,000	635	136,525,000	
キャノン電子	20,800	1,987	41,329,600	
キャノン	1,409,900	3,390	4,779,561,000	
リコー	682,000	659	449,438,000	
日本電産サンキョー	54,000	522	28,188,000	
M U T O Hホールディングス	24,000	365	8,760,000	
東京エレクトロン	190,900	4,275	816,097,500	
トヨタ紡織	79,400	871	69,157,400	

鬼怒川ゴム工業	52,000	655	34,060,000	
ユニプレス	36,200	2,382	86,228,400	
豊田自動織機	206,700	2,187	452,052,900	
モリタホールディングス	36,000	468	16,848,000	
三櫻工業	29,000	559	16,211,000	
デンソー	560,700	2,189	1,227,372,300	
東海理化電機製作所	53,100	1,277	67,808,700	
三井造船	878,000	136	119,408,000	
佐世保重工業	148,000	135	19,980,000	
川崎重工業	1,650,000	223	367,950,000	
日本車輛製造	83,000	327	27,141,000	
日本輸送機	30,000	215	6,450,000	
近畿車輛	34,000	238	8,092,000	
日産自動車	2,867,400	717	2,055,925,800	
いすゞ自動車	1,435,000	381	546,735,000	
トヨタ自動車	2,943,100	2,720	8,005,232,000	代用有価証券で 500,000株 担保差入
日野自動車	324,000	498	161,352,000	
三菱自動車工業	5,074,000	91	461,734,000	
エフテック	8,000	943	7,544,000	
武蔵精密工業	22,000	1,767	38,874,000	
日産車体	67,000	802	53,734,000	
新明和工業	101,000	358	36,158,000	
極東開発工業	39,200	612	23,990,400	
日信工業	41,600	1,193	49,628,800	
トビー工業	170,000	215	36,550,000	
ティラド	83,000	306	25,398,000	
曙ブレーキ工業	115,300	380	43,814,000	
タチエス	29,700	1,428	42,411,600	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
N O K	109,800	1,426	156,574,800	
フタバ産業	64,400	474	30,525,600	
カヤバ工業	157,000	430	67,510,000	
シロキ工業	51,000	223	11,373,000	
大同メタル工業	35,000	888	31,080,000	
プレス工業	105,000	374	39,270,000	

カルソニックカンセイ	135,000	480	64,800,000	
太平洋工業	46,000	376	17,296,000	
ケーヒン	47,000	1,463	68,761,000	
河西工業	28,000	414	11,592,000	
アイシン精機	186,900	2,361	441,270,900	
富士機工	27,000	222	5,994,000	
マツダ	1,882,000	131	246,542,000	
ダイハツ工業	211,000	1,458	307,638,000	
愛知機械工業	51,000	286	14,586,000	
今仙電機製作所	16,800	894	15,019,200	
本田技研工業	1,914,900	2,673	5,118,527,700	
スズキ	474,500	1,645	780,552,500	
富士重工業	717,000	511	366,387,000	
ヤマハ発動機	369,700	1,048	387,445,600	
ショーワ	48,400	502	24,296,800	
T B K	23,000	381	8,763,000	
エクセディ	30,800	2,308	71,086,400	
豊田合成	64,100	1,245	79,804,500	
愛三工業	23,600	645	15,222,000	
ヨロズ	13,700	1,764	24,166,800	
エフ・シー・シー	37,200	1,626	60,487,200	
シマノ	85,900	3,690	316,971,000	
タカタ	41,000	1,808	74,128,000	
テイ・エス テック	48,000	1,358	65,184,000	
日本電産トーソク	11,000	955	10,505,000	
テルモ	160,500	3,570	572,985,000	
クリエートメディック	6,800	803	5,460,400	
日機装	74,000	685	50,690,000	
島津製作所	271,000	654	177,234,000	
J M S	34,000	241	8,194,000	
クボテック	49	22,050	1,080,450	
モリテックス	4,900	313	1,533,700	
長野計器	16,000	795	12,720,000	
ブイ・テクノロジー	30	310,500	9,315,000	
東京計器	78,000	155	12,090,000	
愛知時計電機	44,000	280	12,320,000	
東京精密	40,700	1,510	61,457,000	
ニコン	395,500	1,802	712,691,000	
トプコン	52,300	385	20,135,500	

オリンパス	267,500	1,297	346,947,500	
理研計器	18,300	586	10,723,800	
タムロン	19,900	1,931	38,426,900	
H O Y A	551,600	1,657	914,001,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ノーリツ鋼機	20,700	344	7,120,800	
エー・アンド・デイ	22,100	261	5,768,100	
日本電産コパル	17,700	851	15,062,700	
シチズンホールディングス	271,600	461	125,207,600	
リズム時計工業	106,000	152	16,112,000	
大研医器	2,800	815	2,282,000	
セイコーホールディングス	135,000	165	22,275,000	
ニプロ	90,000	670	60,300,000	
パラマウントベッドホールディングス	19,700	2,234	44,009,800	
S H O - B I	4,100	478	1,959,800	
S R I スポーツ	14,900	849	12,650,100	
バンダイナムコホールディングス	243,100	1,041	253,067,100	
共立印刷	27,400	259	7,096,600	
フランスベッドホールディングス	156,000	143	22,308,000	
パイロットコーポレーション	198	155,000	30,690,000	
トッパン・フォームズ	49,000	587	28,763,000	
フジシールインターナショナル	25,400	1,397	35,483,800	
タカラトミー	75,600	548	41,428,800	
廣済堂	20,300	203	4,120,900	
タカノ	10,000	450	4,500,000	
プロネクサス	25,500	394	10,047,000	
ウッドワン	57,000	280	15,960,000	
大建工業	113,000	253	28,589,000	
凸版印刷	690,000	602	415,380,000	
大日本印刷	691,000	791	546,581,000	
図書印刷	38,000	130	4,940,000	
共同印刷	77,000	189	14,553,000	
日本写真印刷	38,300	973	37,265,900	
光村印刷	22,000	256	5,632,000	
宝印刷	13,100	567	7,427,700	
アシックス	211,400	837	176,941,800	

ツツミ	11,600	1,792	20,787,200	
ローランド	24,100	680	16,388,000	
小松ウオール工業	9,100	812	7,389,200	
ヤマハ	166,800	699	116,593,200	
河合楽器製作所	88,000	155	13,640,000	
クリナップ	36,700	489	17,946,300	
ビジョン	20,000	2,885	57,700,000	
キングジム	19,000	599	11,381,000	
リンテック	43,300	1,489	64,473,700	
イトーキ	50,600	175	8,855,000	
任天堂	129,800	10,600	1,375,880,000	
三菱鉛筆	19,300	1,351	26,074,300	
タカラスタANDARD	113,000	615	69,495,000	
コクヨ	118,000	537	63,366,000	
ナカバヤシ	48,000	193	9,264,000	
グローブライド	115,000	92	10,580,000	
岡村製作所	80,000	555	44,400,000	
美津濃	114,000	407	46,398,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
アデランス	28,900	915	26,443,500	
東京電力	1,812,100	213	385,977,300	代用有価証券で 300,000株 担保差入
中部電力	747,900	1,443	1,079,219,700	
関西電力	926,200	1,253	1,160,528,600	
中国電力	313,800	1,410	442,458,000	
北陸電力	222,300	1,493	331,893,900	
東北電力	567,000	815	462,105,000	
四国電力	209,000	2,248	469,832,000	
九州電力	501,300	1,133	567,972,900	
北海道電力	212,400	1,124	238,737,600	
沖縄電力	13,600	3,275	44,540,000	
電源開発	140,900	2,036	286,872,400	
東京瓦斯	2,739,000	344	942,216,000	
大阪瓦斯	2,202,000	301	662,802,000	
東邦瓦斯	577,000	474	273,498,000	
北海道瓦斯	41,000	278	11,398,000	

西部瓦斯	256,000	211	54,016,000	
静岡瓦斯	59,000	512	30,208,000	
東武鉄道	1,289,000	395	509,155,000	
相鉄ホールディングス	363,000	241	87,483,000	
東京急行電鉄	1,336,000	370	494,320,000	
京浜急行電鉄	583,000	691	402,853,000	
小田急電鉄	727,000	737	535,799,000	
京王電鉄	634,000	546	346,164,000	
京成電鉄	365,000	550	200,750,000	
富士急行	62,000	480	29,760,000	
新京成電鉄	29,000	356	10,324,000	
東日本旅客鉄道	394,700	4,670	1,843,249,000	
西日本旅客鉄道	197,300	3,135	618,535,500	
東海旅客鉄道	1,970	641,000	1,262,770,000	
西日本鉄道	294,000	372	109,368,000	
ハマキョウレックス	6,500	2,286	14,859,000	
サカイ引越センター	4,100	1,675	6,867,500	
近畿日本鉄道	2,050,000	294	602,700,000	
阪急阪神ホールディングス	1,523,000	329	501,067,000	
南海電気鉄道	473,000	345	163,185,000	
京阪電気鉄道	509,000	374	190,366,000	
名糖運輸	9,300	612	5,691,600	
名古屋鉄道	792,000	212	167,904,000	
日本通運	898,000	300	269,400,000	
ヤマトホールディングス	461,800	1,237	571,246,600	
山九	276,000	298	82,248,000	
丸運	12,200	193	2,354,600	
丸全昭和運輸	76,000	258	19,608,000	
センコー	91,000	316	28,756,000	
トナミホールディングス	46,000	180	8,280,000	
日本梱包運輸倉庫	68,000	794	53,992,000	
日本石油輸送	26,000	192	4,992,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
福山通運	138,000	450	62,100,000	
セイノーホールディングス	176,000	587	103,312,000	
神奈川中央交通	27,000	419	11,313,000	

日立物流	47,300	1,270	60,071,000	
日本郵船	1,798,000	192	345,216,000	
商船三井	1,190,000	275	327,250,000	
川崎汽船	701,000	137	96,037,000	
N S ユナイテッド海運	98,000	120	11,760,000	
乾汽船	24,900	277	6,897,300	
明治海運	20,300	227	4,608,100	
飯野海運	109,600	358	39,236,800	
共栄タンカー	19,000	129	2,451,000	
第一中央汽船	149,000	102	15,198,000	
全日本空輸	3,025,000	222	671,550,000	
パスコ	22,000	292	6,424,000	
国際航業ホールディングス	19,000	196	3,724,000	
日新	86,000	204	17,544,000	
三菱倉庫	161,000	836	134,596,000	
三井倉庫	105,000	299	31,395,000	
住友倉庫	166,000	373	61,918,000	
澁澤倉庫	54,000	236	12,744,000	
東陽倉庫	36,000	175	6,300,000	
日本トランスシティ	47,000	279	13,113,000	
ケイヒン	41,000	93	3,813,000	
安田倉庫	17,700	494	8,743,800	
東洋埠頭	65,000	129	8,385,000	
宇徳	15,300	276	4,222,800	
上組	251,000	655	164,405,000	
サンリツ	5,900	515	3,038,500	
キムラユニティー	5,100	690	3,519,000	
キューソー流通システム	7,100	860	6,106,000	
郵船ロジスティクス	17,900	975	17,452,500	
近鉄エクスプレス	20,300	2,256	45,796,800	
東海運	14,300	248	3,546,400	
バンテック	26	231,700	6,024,200	
N E C ネットズエスアイ	22,800	1,185	27,018,000	
システナ	269	51,600	13,880,400	
新日鉄ソリューションズ	15,000	1,540	23,100,000	
コア	8,500	673	5,720,500	
ソフトクリエイト	2,500	1,100	2,750,000	
デジタルハーツ	19	137,900	2,620,100	
I T ホールディングス	68,200	900	61,380,000	

グリー	97,900	2,090	204,611,000	
コーエーテクモホールディングス	44,300	613	27,155,900	
三菱総合研究所	8,700	1,439	12,519,300	
ボルテージ	2,200	949	2,087,800	
ネクソン	30,500	1,112	33,916,000	
ダウンゴ	112	144,300	16,161,600	
ベリサーブ	14	133,000	1,862,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
マクロミル	26,200	749	19,623,800	
ティーガイア	146	144,600	21,111,600	
GMOペイメントゲートウェイ	49	315,000	15,435,000	
ザップラス	124	85,700	10,626,800	
インターネットイニシアティブ	131	251,300	32,920,300	
ソネットエンタテインメント	126	277,800	35,002,800	
SRAホールディングス	11,900	800	9,520,000	
JBSホールディングス	23,500	243	5,710,500	
朝日ネット	19,000	358	6,802,000	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	5,300	2,029	10,753,700	
フェイス	769	8,730	6,713,370	
野村総合研究所	126,900	1,695	215,095,500	
サイバネットシステム	187	20,580	3,848,460	
インテージ	6,700	1,474	9,875,800	
シンプレクス・ホールディングス	382	25,620	9,786,840	
クレスコ	5,700	678	3,864,600	
フジ・メディア・ホールディングス	2,333	113,600	265,028,800	
オービック	7,020	14,540	102,070,800	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	4,500	782	3,519,000	
ヤフー	16,401	24,570	402,972,570	
トレンドマイクロ	98,900	2,372	234,590,800	
日本オラクル	35,800	2,572	92,077,600	
アルファシステムズ	6,200	1,194	7,402,800	
フューチャーアーキテクト	272	30,400	8,268,800	
シーエーシー	15,300	633	9,684,900	
ソフトバンク・テクノロジー	5,400	600	3,240,000	

トーセ	5,500	522	2,871,000	
オービックビジネスコンサルタント	5,700	3,560	20,292,000	
日立ビジネスソリューション	7,000	1,005	7,035,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	26,400	3,440	90,816,000	
アイティフォー	25,200	288	7,257,600	
東計電算	4,000	1,026	4,104,000	
エクスネット	21	115,300	2,421,300	
大塚商会	17,900	5,330	95,407,000	
サイボウズ	413	22,320	9,218,160	
アグレックス	6,000	755	4,530,000	
電通国際情報サービス	13,900	702	9,757,800	
ウェザーニューズ	6,800	2,022	13,749,600	
C I J	22,600	300	6,780,000	
WOWOW	69	204,300	14,096,700	
ネットワンシステムズ	506	195,800	99,074,800	
アルゴグラフィックス	8,400	1,049	8,811,600	
エイベックス・グループ・ホールディングス	42,800	944	40,403,200	
日本ユニシス	54,300	480	26,064,000	
兼松エレクトロニクス	14,600	799	11,665,400	
東京放送ホールディングス	134,200	1,005	134,871,000	
日本テレビ放送網	19,660	11,570	227,466,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
テレビ朝日	567	128,700	72,972,900	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	1,700	38,300	65,110,000	
テレビ東京ホールディングス	14,300	1,052	15,043,600	
アイ・ティー・シーネットワーク	18,900	505	9,544,500	
イー・アクセス	1,714	18,790	32,206,060	
ＮＥＣモバイルینگ	8,300	2,627	21,804,100	
日本電信電話	1,031,600	3,835	3,956,186,000	
K D D I	3,477	482,500	1,677,652,500	
光通信	20,600	1,990	40,994,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	18,457	138,000	2,547,066,000	
G M Oインターネット	66,700	300	20,010,000	
学研ホールディングス	68,000	150	10,200,000	
ゼンリン	32,400	700	22,680,000	
昭文社	12,300	598	7,355,400	

角川グループホールディングス	21,200	2,543	53,911,600	
インプレスホールディングス	19,300	109	2,103,700	
アイネット	9,900	473	4,682,700	
松竹	147,000	761	111,867,000	
東宝	159,800	1,309	209,178,200	
東映	95,000	369	35,055,000	
葵プロモーション	10,500	411	4,315,500	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,384	243,600	337,142,400	
D T S	23,200	975	22,620,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	73,200	1,490	109,068,000	
シーイーシー	13,500	376	5,076,000	
カプコン	43,000	1,605	69,015,000	
ジャステック	14,400	452	6,508,800	
S C S K	45,700	1,226	56,028,200	
日本システムウエア	7,600	311	2,363,600	
アイネス	27,200	551	14,987,200	
T K C	18,900	1,603	30,296,700	
富士ソフト	30,300	1,397	42,329,100	
N S D	43,400	614	26,647,600	
コナミ	101,100	1,970	199,167,000	
福井コンピュータ	3,300	387	1,277,100	
J B C Cホールディングス	17,600	538	9,468,800	
ソフトバンク	1,014,900	2,239	2,272,361,100	
ハウスイ	19,000	116	2,204,000	
インターニックス	9,100	356	3,239,600	
高千穂交易	9,300	858	7,979,400	
伊藤忠食品	5,600	2,772	15,523,200	
エレマテック	17,900	1,363	24,397,700	
J A L U X	8,700	770	6,699,000	
トーメンデバイス	3,400	1,850	6,290,000	
東京エレクトロン デバイス	45	145,100	6,529,500	
双日	1,499,400	134	200,919,600	
アルフレッサ ホールディングス	58,600	3,230	189,278,000	
横浜冷凍	52,000	639	33,228,000	
神栄	29,000	165	4,785,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	

山下医科器械	1,800	949	1,708,200	
ラサ商事	14,500	365	5,292,500	
アルコニックス	7,000	1,600	11,200,000	
あい ホールディングス	40,100	325	13,032,500	
ダイワボウホールディングス	219,000	186	40,734,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	42,100	631	26,565,100	
U K Cホールディングス	13,300	792	10,533,600	
T O K A Iホールディングス	109,400	389	42,556,600	
ミタチ産業	5,200	368	1,913,600	
J F E 商事ホールディングス	156,000	349	54,444,000	
シップヘルスケアホールディングス	29,100	1,612	46,909,200	
協栄産業	27,000	147	3,969,000	
小野建	19,500	655	12,772,500	
佐島電機	16,400	494	8,101,600	
エコートレーディング	5,500	713	3,921,500	
伯東	13,600	760	10,336,000	
コンドーテック	26,400	487	12,856,800	
中山福	13,600	605	8,228,000	
ナガイレーベン	29,700	1,074	31,897,800	
三菱食品	20,600	2,056	42,353,600	
松田産業	17,800	1,207	21,484,600	
メディパルホールディングス	241,300	811	195,694,300	
アドヴァン	20,500	725	14,862,500	
S P K	5,300	1,339	7,096,700	
アズワン	14,700	1,634	24,019,800	
スズデン	8,700	535	4,654,500	
尾家産業	7,400	840	6,216,000	
シモジマ	13,700	1,048	14,357,600	
ドウシシャ	11,300	2,406	27,187,800	
高速	13,300	640	8,512,000	
黒田電気	27,600	824	22,742,400	
丸文	17,800	362	6,443,600	
ハピネット	17,500	682	11,935,000	
トーメンエレクトロニクス	10,300	978	10,073,400	
エクセル	10,200	778	7,935,600	
マルカキカイ	8,300	706	5,859,800	
ガリバーインターナショナル	6,810	2,891	19,687,710	
日本エム・ディ・エム	18,700	255	4,768,500	
進和	14,100	903	12,732,300	

エスケイジャパン	7,300	252	1,839,600	
ダイトエレクトロン	10,200	407	4,151,400	
シークス	14,200	936	13,291,200	
田中商事	18,800	436	8,196,800	
オーハシテクニカ	12,600	599	7,547,400	
マクニカ	11,500	1,797	20,665,500	
白銅	7,200	815	5,868,000	
伊藤忠商事	1,787,100	805	1,438,615,500	
丸紅	1,960,000	505	989,800,000	
高島	39,000	206	8,034,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
F & A アクアホールディングス	17,200	768	13,209,600	
長瀬産業	126,800	882	111,837,600	
蝶理	136,000	100	13,600,000	
豊田通商	249,500	1,430	356,785,000	
三共生興	38,500	284	10,934,000	
ツカモトコーポレーション	41,000	96	3,936,000	
三井物産	1,933,600	1,267	2,449,871,200	
日本紙パルプ商事	116,000	286	33,176,000	
日立ハイテクノロジーズ	67,900	1,771	120,250,900	
カメイ	30,000	861	25,830,000	
東都水産	38,000	144	5,472,000	
スターゼン	75,000	245	18,375,000	
山善	89,000	579	51,531,000	
椿本興業	24,000	223	5,352,000	
住友商事	1,322,000	1,087	1,437,014,000	
内田洋行	51,000	216	11,016,000	
三菱商事	1,631,400	1,698	2,770,117,200	
第一実業	52,000	379	19,708,000	
キャノンマーケティングジャパン	74,500	947	70,551,500	
西華産業	84,000	218	18,312,000	
佐藤商事	20,000	459	9,180,000	
菱洋エレクトロ	25,200	939	23,662,800	
東京産業	22,000	259	5,698,000	
ユアサ商事	244,000	123	30,012,000	
神鋼商事	66,000	209	13,794,000	

阪和興業	224,000	356	79,744,000	
カナデン	26,000	516	13,416,000	
菱電商事	36,000	480	17,280,000	
フルサト工業	14,400	685	9,864,000	
岩谷産業	255,000	267	68,085,000	
すてきナイスグループ	104,000	174	18,096,000	
昭光通商	93,000	126	11,718,000	
ニチモウ	43,000	174	7,482,000	
極東貿易	34,000	218	7,412,000	
イワキ	34,000	199	6,766,000	
三愛石油	55,000	351	19,305,000	
稲畑産業	63,500	475	30,162,500	
G S I クレオス	56,000	109	6,104,000	
明和産業	26,000	247	6,422,000	
東邦ホールディングス	71,700	1,059	75,930,300	
サンゲツ	39,700	2,081	82,615,700	
ミツウロコグループホールディングス	37,000	478	17,686,000	
シナネン	49,000	343	16,807,000	
伊藤忠エネクス	50,400	441	22,226,400	
サンリオ	56,500	3,380	190,970,000	
サンワテクノス	10,900	752	8,196,800	
リョーサン	36,500	1,682	61,393,000	
新光商事	24,500	632	15,484,000	
トーホー	47,000	315	14,805,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
三信電気	32,000	651	20,832,000	
東陽テクニカ	32,400	829	26,859,600	
モスフードサービス	29,500	1,545	45,577,500	
加賀電子	24,300	852	20,703,600	
ソーダニッカ	25,000	340	8,500,000	
立花エレテック	14,600	665	9,709,000	
P a l t a c	23,600	985	23,246,000	
ヤマタネ	113,000	120	13,560,000	
丸紅建材リース	23,000	173	3,979,000	
日鐵商事	50,000	217	10,850,000	
トラスコ中山	29,200	1,421	41,493,200	

オートバックスセブン	26,600	3,545	94,297,000	
加藤産業	32,400	1,494	48,405,600	
イノテック	13,500	538	7,263,000	
イエローハット	21,300	1,144	24,367,200	
富士エレクトロニクス	11,500	1,165	13,397,500	
J Kホールディングス	32,300	382	12,338,600	
日伝	9,300	2,277	21,176,100	
北沢産業	48,500	165	8,002,500	
杉本商事	13,100	724	9,484,400	
因幡電機産業	26,400	2,227	58,792,800	
住金物産	113,000	209	23,617,000	
ミスミグループ本社	82,800	1,816	150,364,800	
江守商事	5,300	900	4,770,000	
アルテック	14,700	220	3,234,000	
タキヒヨー	34,000	459	15,606,000	
スズケン	86,100	2,111	181,757,100	
ジェコス	31,300	352	11,017,600	
ローソン	70,700	4,490	317,443,000	
サンエー	7,700	3,035	23,369,500	
キリン堂	9,900	502	4,969,800	
ダイユーエイト	3,700	893	3,304,100	
カワチ薬品	15,700	1,610	25,277,000	
エービーシー・マート	31,800	2,732	86,877,600	
ハードオフコーポレーション	11,200	554	6,204,800	
アスクル	17,800	1,265	22,517,000	
ゲオホールディングス	374	81,800	30,593,200	
ポイント	18,920	3,130	59,219,600	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	16,000	160	2,560,000	
くらコーポレーション	11,900	1,038	12,352,200	
キャンドウ	120	84,600	10,152,000	
パル	6,600	3,410	22,506,000	
エディオン	89,700	591	53,012,700	
サーラコーポレーション	19,000	501	9,519,000	
あみやき亭	35	194,300	6,800,500	
ひらまつ	98	66,400	6,507,200	
ゲンキー	1,700	1,662	2,825,400	
ハニーズ	19,850	1,219	24,197,150	
アルペン	14,400	1,418	20,419,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ビックカメラ	855	44,100	37,705,500	
D C Mホールディングス	116,000	566	65,656,000	
M o n o t a R O	13,000	809	10,517,000	
J . フロント リテイリング	529,000	377	199,433,000	
ドトール・日レスホールディングス	35,900	1,043	37,443,700	
マツモトキヨシホールディングス	41,600	1,532	63,731,200	
物語コーポレーション	2,500	1,287	3,217,500	
ココカラファイン	23,400	1,968	46,051,200	
三越伊勢丹ホールディングス	445,100	859	382,340,900	
クリエイト S Dホールディングス	9,500	1,694	16,093,000	
丸善 C H Iホールディングス	7,600	211	1,603,600	
ブックオフコーポレーション	12,700	690	8,763,000	
あさひ	13,100	1,559	20,422,900	
サークルKサンクス	48,700	1,290	62,823,000	
日本調剤	3,020	2,638	7,966,760	
コスモス薬品	11,300	3,615	40,849,500	
セブン&アイ・ホールディングス	937,100	2,114	1,981,029,400	
ツルハホールディングス	20,100	4,105	82,510,500	
サンマルクホールディングス	6,500	2,949	19,168,500	
フェリシモ	6,600	1,075	7,095,000	
トリドール	19,600	714	13,994,400	
クスリのアオキ	3,400	1,426	4,848,400	
メディカルシステムネットワーク	4,400	811	3,568,400	
総合メディカル	5,500	2,520	13,860,000	
はるやま商事	9,800	403	3,949,400	
カッパ・クリエイト	16,550	1,771	29,310,050	
ライトオン	17,100	581	9,935,100	
良品計画	23,700	3,585	84,964,500	
三城ホールディングス	28,000	602	16,856,000	
コナカ	26,800	621	16,642,800	
ハウス オブ ローゼ	2,700	1,259	3,399,300	
G - 7ホールディングス	7,200	396	2,851,200	
イオン北海道	14,400	359	5,169,600	
コジマ	30,600	508	15,544,800	
コーナン商事	24,600	1,167	28,708,200	
エコス	7,900	484	3,823,600	

ワタミ	26,700	1,730	46,191,000	
マルシェ	5,700	705	4,018,500	
ドン・キホーテ	43,500	2,770	120,495,000	
メガネトップ	32,300	832	26,873,600	
西松屋チェーン	49,400	607	29,985,800	
ゼンショーホールディングス	85,300	1,031	87,944,300	
幸楽苑	13,900	1,218	16,930,200	
ハークスレイ	5,800	549	3,184,200	
サイゼリヤ	33,300	1,221	40,659,300	
ポプラ	6,000	478	2,868,000	
ユナイテッドアローズ	24,300	1,477	35,891,100	
ハイデイ日高	10,000	1,325	13,250,000	
京都きもの友禅	15,700	932	14,632,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
コロワイド	74,500	566	42,167,000	
壱番屋	9,100	2,226	20,256,600	
トップカルチャー	8,600	389	3,345,400	
スギホールディングス	40,200	2,134	85,786,800	
スクロール	29,800	288	8,582,400	
ファミリーマート	68,800	2,983	205,230,400	
木曽路	25,700	1,460	37,522,000	
千趣会	40,700	513	20,879,100	
タカキュー	19,000	153	2,907,000	
ケーヨー	42,400	503	21,327,200	
上新電機	49,000	857	41,993,000	
日本瓦斯	21,400	1,300	27,820,000	
マルエツ	46,000	293	13,478,000	
ロイヤルホールディングス	37,600	920	34,592,000	
東天紅	18,000	221	3,978,000	
いなげや	25,100	927	23,267,700	
島忠	50,700	1,756	89,029,200	
チヨダ	29,500	1,435	42,332,500	
ライフコーポレーション	14,200	1,376	19,539,200	
カスミ	46,100	515	23,741,500	
リンガーハット	20,400	1,063	21,685,200	
さが美	20,000	93	1,860,000	

Mr M a x	23,000	339	7,797,000	
テンアライド	17,700	277	4,902,900	
A O K Iホールディングス	21,000	1,225	25,725,000	
オークワ	32,000	1,104	35,328,000	
コメリ	30,700	2,241	68,798,700	
青山商事	61,700	1,338	82,554,600	
しまむら	26,000	7,840	203,840,000	
C F S コーポレーション	15,000	377	5,655,000	
高島屋	303,000	583	176,649,000	
松屋	45,400	452	20,520,800	
エイチ・ツー・オー リテイリング	117,000	619	72,423,000	
丸栄	38,000	93	3,534,000	
ニッセンホールディングス	45,300	362	16,398,600	
パルコ	40,900	579	23,681,100	
丸井グループ	291,900	615	179,518,500	
原信ナルスホールディングス	12,500	1,343	16,787,500	
ダイエー	138,750	275	38,156,250	
イズミヤ	78,000	403	31,434,000	
イオン	789,800	999	789,010,200	
ユニー	167,900	709	119,041,100	
イズミ	67,100	1,359	91,188,900	
東武ストア	30,000	273	8,190,000	
平和堂	41,400	989	40,944,600	
フジ	25,400	1,844	46,837,600	
ヤオコー	9,900	2,531	25,056,900	
ゼビオ	27,100	1,772	48,021,200	
ケーズホールディングス	55,900	2,748	153,613,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
O l y m p i c	15,000	762	11,430,000	
日産東京販売ホールディングス	34,000	143	4,862,000	
アインファーマシーズ	12,500	3,320	41,500,000	
元気寿司	7,100	977	6,936,700	
ヤマダ電機	108,980	4,915	535,636,700	
アークランドサカモト	14,700	1,387	20,388,900	
ニトリホールディングス	44,350	6,830	302,910,500	
グルメ杵屋	16,000	435	6,960,000	

愛眼	18,400	368	6,771,200	
吉野家ホールディングス	609	107,500	65,467,500	
松屋フーズ	10,900	1,609	17,538,100	
サガミチェーン	27,000	517	13,959,000	
ブレナス	25,200	1,312	33,062,400	
ミニストップ	16,700	1,403	23,430,100	
アークス	30,900	1,480	45,732,000	
パロー	44,700	1,188	53,103,600	
ベルク	11,200	1,217	13,630,400	
大庄	10,700	1,027	10,988,900	
ファーストリテイリング	52,300	14,720	769,856,000	
サンドラッグ	42,600	2,242	95,509,200	
ヤマザワ	5,900	1,385	8,171,500	
やまや	3,700	1,215	4,495,500	
ペルーナ	28,250	578	16,328,500	
新生銀行	1,744,000	85	148,240,000	
あおぞら銀行	698,000	213	148,674,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	16,958,100	355	6,020,125,500	
りそなホールディングス	1,949,600	347	676,511,200	
三井住友トラスト・ホールディングス	4,391,000	242	1,062,622,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,694,100	2,397	4,060,757,700	
第四銀行	291,000	256	74,496,000	
北越銀行	233,000	161	37,513,000	
西日本シティ銀行	786,000	222	174,492,000	
札幌北洋ホールディングス	337,800	285	96,273,000	
千葉銀行	884,000	484	427,856,000	
横浜銀行	1,439,000	361	519,479,000	
常陽銀行	863,000	341	294,283,000	
群馬銀行	512,000	418	214,016,000	
武蔵野銀行	36,100	2,619	94,545,900	
千葉興業銀行	42,900	418	17,932,200	
筑波銀行	93,100	273	25,416,300	
東京都民銀行	42,300	998	42,215,400	
七十七銀行	351,000	364	127,764,000	
青森銀行	167,000	244	40,748,000	
秋田銀行	154,000	232	35,728,000	
山形銀行	136,000	392	53,312,000	
岩手銀行	15,100	3,470	52,397,000	
東邦銀行	189,000	244	46,116,000	

東北銀行	121,000	141	17,061,000	
みちのく銀行	112,000	151	16,912,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ふくおかフィナンシャルグループ	909,000	330	299,970,000	
静岡銀行	676,000	787	532,012,000	
十六銀行	281,000	265	74,465,000	
スルガ銀行	218,000	694	151,292,000	
八十二銀行	413,000	455	187,915,000	
山梨中央銀行	137,000	344	47,128,000	
大垣共立銀行	299,000	257	76,843,000	
福井銀行	193,000	241	46,513,000	
北國銀行	268,000	302	80,936,000	
清水銀行	7,600	3,145	23,902,000	
滋賀銀行	210,000	522	109,620,000	
南都銀行	208,000	429	89,232,000	
百五銀行	202,000	322	65,044,000	
京都銀行	401,000	669	268,269,000	
三重銀行	93,000	183	17,019,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,569,000	157	246,333,000	
広島銀行	661,000	363	239,943,000	
山陰合同銀行	133,000	589	78,337,000	
中国銀行	183,000	1,052	192,516,000	
鳥取銀行	71,000	149	10,579,000	
伊予銀行	240,000	741	177,840,000	
百十四銀行	246,000	367	90,282,000	
四国銀行	162,000	307	49,734,000	
阿波銀行	197,000	524	103,228,000	
鹿児島銀行	145,000	534	77,430,000	
大分銀行	145,000	224	32,480,000	
宮崎銀行	149,000	197	29,353,000	
肥後銀行	174,000	448	77,952,000	
佐賀銀行	136,000	194	26,384,000	
十八銀行	143,000	221	31,603,000	
沖縄銀行	17,000	3,315	56,355,000	
琉球銀行	47,100	975	45,922,500	
八千代銀行	11,700	1,851	21,656,700	

みずほフィナンシャルグループ	28,775,400	117	3,366,721,800	
紀陽ホールディングス	893,000	120	107,160,000	
山口フィナンシャルグループ	224,000	737	165,088,000	
長野銀行	73,000	164	11,972,000	
名古屋銀行	202,000	263	53,126,000	
愛知銀行	8,100	4,620	37,422,000	
第三銀行	127,000	177	22,479,000	
中京銀行	92,000	206	18,952,000	
東日本銀行	107,000	168	17,976,000	
大光銀行	79,000	261	20,619,000	
愛媛銀行	141,000	229	32,289,000	
トマト銀行	86,000	136	11,696,000	
みなと銀行	203,000	147	29,841,000	
京葉銀行	184,000	389	71,576,000	
関西アーバン銀行	312,000	128	39,936,000	
栃木銀行	113,000	280	31,640,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
北日本銀行	7,000	1,955	13,685,000	
東和銀行	225,000	90	20,250,000	
福島銀行	259,000	51	13,209,000	
大東銀行	142,000	69	9,798,000	
トモニホールディングス	172,400	353	60,857,200	
フィデアホールディングス	128,900	219	28,229,100	
池田泉州ホールディングス	924,300	117	108,143,100	
S B Iホールディングス	23,654	6,070	143,579,780	
ジャフコ	29,000	1,480	42,920,000	
大和証券グループ本社	2,219,000	281	623,539,000	
野村ホールディングス	4,849,100	286	1,386,842,600	
岡三証券グループ	191,000	255	48,705,000	
丸三証券	75,800	267	20,238,600	
東洋証券	84,000	115	9,660,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	257,000	230	59,110,000	
光世証券	55,000	64	3,520,000	
水戸証券	66,000	106	6,996,000	
いちよし証券	50,300	381	19,164,300	
松井証券	133,000	408	54,264,000	

だいこう証券ビジネス	12,900	266	3,431,400	
マネックスグループ	1,809	12,280	22,214,520	
カブドットコム証券	91,700	254	23,291,800	
極東証券	30,200	502	15,160,400	
岩井コスモホールディングス	21,500	270	5,805,000	
N K S Jホールディングス	468,300	1,588	743,660,400	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	669,500	1,526	1,021,657,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	214,600	1,253	268,893,800	
第一生命保険	11,981	83,400	999,215,400	
東京海上ホールディングス	850,500	1,860	1,581,930,000	
T & Dホールディングス	816,500	788	643,402,000	
クレディセゾン	183,000	1,463	267,729,000	
芙蓉総合リース	22,300	2,812	62,707,600	
興銀リース	32,600	1,842	60,049,200	
東京センチュリーリース	60,100	1,497	89,969,700	
日本証券金融	99,400	400	39,760,000	
大阪証券金融	42,800	177	7,575,600	
ポケットカード	31,700	267	8,463,900	
リコーリース	16,800	1,810	30,408,000	
イオンクレジットサービス	99,600	1,126	112,149,600	
アコム	46,760	1,368	63,967,680	
ジャックス	146,000	242	35,332,000	
オリエントコーポレーション	359,000	78	28,002,000	
日立キャピタル	46,300	1,096	50,744,800	
オリックス	116,550	7,200	839,160,000	
三菱ＵＦＪリース	56,820	3,185	180,971,700	
アサックス	60	84,900	5,094,000	
N E Cキャピタルソリューション	9,800	1,226	12,014,800	
日本駐車場開発	2,710	3,520	9,539,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
昭栄	43,700	332	14,508,400	
東京建物不動産販売	14,000	217	3,038,000	
野村不動産ホールディングス	107,400	1,201	128,987,400	
常和ホールディングス	4,800	1,327	6,369,600	
ヒューリック	73,600	916	67,417,600	

パーク 2 4	115,500	951	109,840,500	
三井不動産	994,000	1,285	1,277,290,000	
三菱地所	1,568,000	1,276	2,000,768,000	
平和不動産	218,000	177	38,586,000	
東京建物	427,000	281	119,987,000	
ダイビル	67,900	521	35,375,900	
サンケイビル	41,800	457	19,102,600	
東急不動産	451,000	338	152,438,000	
京阪神ビルディング	29,600	343	10,152,800	
住友不動産	537,000	1,480	794,760,000	
東宝不動産	26,000	443	11,518,000	
大京	352,000	179	63,008,000	
テーオーシー	89,600	379	33,958,400	
東京楽天地	40,000	294	11,760,000	
フジ住宅	31,200	399	12,448,800	
空港施設	26,600	314	8,352,400	
明和地所	14,200	352	4,998,400	
住友不動産販売	8,390	3,290	27,603,100	
ゴールドクレスト	20,970	1,388	29,106,360	
東栄住宅	16,500	868	14,322,000	
リロ・ホールディング	7,700	2,004	15,430,800	
日本エスリード	10,300	704	7,251,200	
東急リバブル	22,000	627	13,794,000	
飯田産業	27,100	607	16,449,700	
日神不動産	15,700	476	7,473,200	
アーネストワン	38,300	837	32,057,100	
タカラレーベン	28,200	475	13,395,000	
サンヨーハウジング名古屋	108	78,500	8,478,000	
イオンモール	102,100	1,690	172,549,000	
フージャースコーポレーション	381	37,400	14,249,400	
タクトホーム	134	65,000	8,710,000	
トーセイ	275	20,570	5,656,750	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,392	59,200	82,406,400	
ランドビジネス	223	14,750	3,289,250	
日本空港ビルデング	71,400	1,027	73,327,800	
日本工営	80,000	290	23,200,000	
ネクスト	9,600	299	2,870,400	
日本M&Aセンター	47	387,000	18,189,000	
ノバレーゼ	55	50,400	2,772,000	

アコーディア・ゴルフ	974	54,600	53,180,400	
パソナグループ	238	70,400	16,755,200	
リンクアンドモチベーション	52	39,100	2,033,200	
テンプホールディングス	32,600	741	24,156,600	
学情	8,500	261	2,218,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
スタジオアリス	11,300	1,121	12,667,300	
シミックホールディングス	7,900	1,128	8,911,200	
NECフィールディング	19,300	1,012	19,531,600	
総合警備保障	86,300	850	73,355,000	
カカクコム	36,800	2,403	88,430,400	
ルネサンス	11,900	418	4,974,200	
新日本科学	15,600	202	3,151,200	
エムスリー	186	313,500	58,311,000	
ベストプライダル	59	71,400	4,212,600	
ディー・エヌ・エー	106,300	1,962	208,560,600	
博報堂DYホールディングス	30,120	4,580	137,949,600	
ぐるなび	17,100	828	14,158,800	
一休	170	33,050	5,618,500	
ジャパンベストレスキューシステム	37	75,100	2,778,700	
ジェイコムホールディングス	4,400	745	3,278,000	
PGMホールディングス	343	49,250	16,892,750	
イービーエス	129	140,600	18,137,400	
アミューズ	7,100	999	7,092,900	
ドリームインキュベータ	78	60,000	4,680,000	
TAC	16,300	164	2,673,200	
ケネディクス	2,674	10,240	27,381,760	
電通	215,700	2,455	529,543,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,126	5,400	6,080,400	
イオンファンタジー	8,100	1,243	10,068,300	
みらかホールディングス	61,900	2,854	176,662,600	
アルプス技研	10,600	623	6,603,800	
サニックス	36,800	226	8,316,800	
ダイオーズ	4,700	489	2,298,300	
日本空調サービス	6,100	718	4,379,800	
オリエンタルランド	64,100	7,930	508,313,000	

ダスキン	71,200	1,495	106,444,000	
明光ネットワークジャパン	22,300	690	15,387,000	
ファルコSDホールディングス	13,400	900	12,060,000	
秀英予備校	6,000	300	1,800,000	
田谷	4,400	677	2,978,800	
ラウンドワン	75,000	478	35,850,000	
リゾートトラスト	37,300	1,166	43,491,800	
ビー・エム・エル	15,600	1,815	28,314,000	
ワタベウェディング	7,800	718	5,600,400	
もしもしホットライン	39,500	688	27,176,000	
東急コミュニティー	6,300	2,456	15,472,800	
リソー教育	2,518	5,160	12,992,880	
ウェアハウス	6,200	256	1,587,200	
ユー・エス・エス	30,910	7,080	218,842,800	
東京個別指導学院	15,400	145	2,233,000	
テー・オー・ダブリュー	7,500	469	3,517,500	
セントラルスポーツ	7,800	1,005	7,839,000	
リゾートソリューション	23,000	150	3,450,000	
エイチ・アイ・エス	24,400	2,156	52,606,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
共立メンテナンス	12,100	1,424	17,230,400	
イチネンホールディングス	25,300	407	10,297,100	
建設技術研究所	13,300	526	6,995,800	
燦ホールディングス	5,500	1,418	7,799,000	
スバル興業	25,000	293	7,325,000	
東京テアトル	100,000	111	11,100,000	
ホリプロ	8,700	1,048	9,117,600	
よみうりランド	49,000	252	12,348,000	
東京都競馬	187,000	109	20,383,000	
カナモト	30,000	691	20,730,000	
東京ドーム	192,000	211	40,512,000	
トランス・コスモス	31,000	966	29,946,000	
乃村工藝社	47,000	254	11,938,000	
藤田観光	62,000	255	15,810,000	
日本管財	8,800	1,437	12,645,600	
トーカイ	9,800	1,701	16,669,800	

白洋舎	27,000	218	5,886,000	
セコム	230,200	3,490	803,398,000	
セントラル警備保障	10,700	793	8,485,100	
丹青社	48,000	227	10,896,000	
メイテック	37,200	1,461	54,349,200	
アサツー ディ・ケイ	41,400	2,103	87,064,200	
応用地質	24,900	902	22,459,800	
船井総合研究所	24,600	530	13,038,000	
進学会	13,200	300	3,960,000	
ベネッセホールディングス	73,400	3,545	260,203,000	
イオンディライト	26,900	1,514	40,726,600	
ナック	6,600	1,495	9,867,000	
ニチイ学館	46,900	934	43,804,600	
ダイセキ	38,300	1,360	52,088,000	
合計	342,420,045	—	233,961,988,670	

（注）代用有価証券の担保差入株数には、約定未受渡株数を含んでおります。

B．株式以外の有価証券

該当事項はありません。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項（デリバティブ取引関係）に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

商品明細表

該当事項はありません。

商品投資等取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

借入金明細表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】平成24年 2 月29日

資産総額	719,349,144 円
負債総額	3,906,884 円
純資産総額（ - ）	715,442,260 円
発行済口数	815,348,077 口
1 口当たり純資産額（ / ）	0.8775 円
1 万口当たり純資産額	8,775 円

< 参考 >

マザーファンドの現況（平成24年 2 月29日）

純資産額計算書

（中央三井日本株式マザーファンド）

資産総額	260,555,339,566 円
負債総額	226,742,334 円
純資産総額（ - ）	260,328,597,232 円
発行済口数	343,591,876,733 口
1 口当たり純資産額（ / ）	0.7577 円
1 万口当たり純資産額	7,577 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）投資信託受益証券の名義書換等

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

（２）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限

該当事項はありません。

（４）振替受益権に関する記載

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

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

受益権の譲渡

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

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

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

（1）資本金の額

本書提出日現在の資本金の額：3億円

会社の発行可能株式総数：12,000株

発行済株式総数：3,000株

最近5年間における資本金の額の増減：なし

（2）委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

取締役会は、社長が招集し、議長となります。

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

[DO（実行）]

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

[CHECK（検証・評価）]

運用各部の長は、運用が運用計画に沿って行われているかの確認を行います。

毎月開催される運用委員会では、パフォーマンスや運用プロセスのモニタリングを通じて、ファンドの品質管理を行います。

また、運用に関するリスク管理と法令遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理関連部門及びコンプライアンス関連部門が担当し、これを運用部門及び取締役等にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持するよう努めます。

さらに、内部監査部門は、委託会社の業務全般について内部管理体制の妥当性を検証、評価します。その評価結果を取締役等へ報告するとともに、指摘事項の是正状況の事後点検を行います。

委託会社の機構は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成24年2月29日現在、住信アセットマネジメント株式会社が運用の指図を行っている証券投資信託は次のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	167	1,334,466
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	167	1,334,466

（ご参考）平成24年2月29日現在、中央三井アセットマネジメント株式会社が運用の指図を行っている証券投資信託は次のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	133	2,511,956
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	701
単位型公社債投資信託	0	0
合計	138	2,512,657

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

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

(1)【貸借対照表】

（単位：千円）

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

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

（単位：千円）

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

純資産の部

株主資本

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

（単位：千円）

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

特別損失

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

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

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

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

会計方針の変更

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

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

（損益計算書関係）

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

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

2. 自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

３．当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

１．発行済株式の種類及び総数

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

２．自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

３．当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

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

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

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

- | | |
|-------------|------------|
| （１）配当金の総額 | 30,000千円 |
| （２）配当金の原資 | 利益剰余金 |
| （３）１株当たり配当額 | 5,000円 |
| （４）基準日 | 平成23年3月31日 |
| （５）効力発生日 | 平成23年6月29日 |

（リ－ス取引関係）

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

（金融商品関係）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

（追加情報）

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

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

（単位：千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券取引に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

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

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価に関する事項

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

（単位：千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券取引に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

（注3）金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

前事業年度（平成22年3月31日現在）

1．其他有価証券

（単位：千円）

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

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

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

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

（単位：千円）

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

当事業年度（平成23年3月31日現在）

１．その他有価証券

（単位：千円）

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

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

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

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
7,639	756	480

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度 (自 平成21年4月1日	当事業年度 (自 平成22年4月1日
-----------------------	-----------------------

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

(税効果会計関係)

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

（持分法損益等）

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

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

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

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

（関連情報）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）売上高

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

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

（追加情報）

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

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

（関連当事者情報）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

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

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所及び大阪証券取引所に上場）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

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

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

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

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

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

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

該当事項はありません。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

２ 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（１）親会社情報

住友信託銀行株式会社（非上場）

（１株当たり情報）

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

（注）1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

期中平均株式数	6,000株	6,000株
---------	--------	--------

（重要な後発事象）

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

中間貸借対照表

（単位：千円）

第26期中間会計期間末

（平成23年9月30日）

資産の部

流動資産

現金及び預金	6,348,503
未収委託者報酬	931,255
未収運用受託報酬	30,340
繰延税金資産	42,883
その他	46,838
流動資産合計	7,399,822

固定資産

有形固定資産

建物	25,631
器具備品	22,797

有形固定資産合計	1	48,428
----------	---	--------

無形固定資産	80,075
--------	--------

投資その他の資産

投資有価証券	230,782
敷金・保証金	222,422
繰延税金資産	95,717
その他	754

投資その他の資産合計	549,677
------------	---------

固定資産合計	678,181
--------	---------

資産合計	8,078,003
------	-----------

負債の部

流動負債

未払金		489,894
未払費用		119,669
未払法人税等		143,080
賞与引当金		76,075
その他	2	32,182
流動負債合計		860,902

固定負債

退職給付引当金		188,834
固定負債合計		188,834

負債合計		1,049,736
------	--	-----------

（単位：千円）

第26期中間会計期間末

（平成23年9月30日）

純資産の部

株主資本

資本金		300,000
利益剰余金		
利益準備金		56,500
その他利益剰余金		
別途積立金		5,100,000
繰越利益剰余金		1,583,847
利益剰余金合計		6,740,347
株主資本合計		7,040,347

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		12,079
評価・換算差額等合計		12,079

純資産合計		7,028,267
-------	--	-----------

負債純資産合計		8,078,003
---------	--	-----------

中間損益計算書

（単位：千円）

第26期中間会計期間

（自 平成23年4月1日

至 平成23年9月30日）

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

中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

第26期中間会計期間

（自 平成23年4月1日

至 平成23年9月30日）

1．資産の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。

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

時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

追加情報

第26期中間会計期間

（自 平成23年4月1日

至 平成23年9月30日）

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第26期中間会計期間末 （平成23年9月30日）	
1 有形固定資産の減価償却累計額	
建物	62,486千円
器具備品	119,721千円
計	182,208千円
2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

（中間損益計算書関係）

第26期中間会計期間 （自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	20,670千円
無形固定資産	15,864千円
2 営業外収益の主要項目	
受取利息	10,373千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

配当金支払額

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

（リ・ス取引関係）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

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

（単位：千円）

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

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

（有価証券関係）

第26期中間会計期間末（平成23年9月30日）

其他有価証券

（単位：千円）

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

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

（デリバティブ取引関係）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

（セグメント情報）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

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

（関連情報）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1)売上高

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

(2)有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

第26期中間会計期間（自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

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

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

< 参考 > 中央三井アセットマネジメント株式会社の経理状況

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

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

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

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

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月10日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 松崎雅則

印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 平木達也

印

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

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

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

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年6月10日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 松崎雅則 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 平木達也 印

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

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

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

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

以上

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

[次へ](#)

(1) 貸借対照表

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

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

(2) 損益計算書

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

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

(3) 株主資本等変動計算書

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

重要な会計方針

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

会計方針の変更

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

追加情報

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

注記事項

１．貸借対照表関係

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

２．損益計算書関係

第24期 (平成21年 4 月 1 日から 平成22年 3 月31日まで)	第25期 (平成22年 4 月 1 日から 平成23年 3 月31日まで)
1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれて おります。 雑損失（臨時経営指導料）	

３．株主資本等変動計算書関係

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

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

４．リース取引関係

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

５．金融商品関係

第24期（平成21年４月１日から平成22年３月31日まで）

１．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（＊）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び（４）未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	65,000

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

（追加情報）

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

第25期（平成22年４月１日から平成23年３月31日まで）

１．金融商品の状況に関する事項

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

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

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（＊）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び（４）未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内容	貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

６．有価証券関係

第24期 (平成22年 3 月31日)	第25期 (平成23年 3 月31日)																								
1. その他有価証券 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	1. その他有価証券 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの																								
<table><tr><th>区分</th><th>貸借対照表 計上額</th><th>取得原価</th><th>差額</th></tr><tr><td>その他</td><td>千円 9,897</td><td>千円 10,000</td><td>千円 103</td></tr><tr><td>計</td><td>9,897</td><td>10,000</td><td>103</td></tr></table>	区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額	その他	千円 9,897	千円 10,000	千円 103	計	9,897	10,000	103	<table><tr><th>区分</th><th>貸借対照表 計上額</th><th>取得原価</th><th>差額</th></tr><tr><td>その他</td><td>千円 58,149</td><td>千円 56,200</td><td>千円 1,949</td></tr><tr><td>計</td><td>58,149</td><td>56,200</td><td>1,949</td></tr></table>	区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額	その他	千円 58,149	千円 56,200	千円 1,949	計	58,149	56,200	1,949
区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額																						
その他	千円 9,897	千円 10,000	千円 103																						
計	9,897	10,000	103																						
区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額																						
その他	千円 58,149	千円 56,200	千円 1,949																						
計	58,149	56,200	1,949																						
	貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの																								
	<table><tr><th>区分</th><th>貸借対照表 計上額</th><th>取得原価</th><th>差額</th></tr><tr><td>その他</td><td>千円 986</td><td>千円 1,000</td><td>千円 13</td></tr><tr><td>計</td><td>986</td><td>1,000</td><td>13</td></tr></table>	区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額	その他	千円 986	千円 1,000	千円 13	計	986	1,000	13												
区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額																						
その他	千円 986	千円 1,000	千円 13																						
計	986	1,000	13																						
2. 当事業年度中に売却したその他有価証券	2. 当事業年度中に売却したその他有価証券																								
<table><tr><th>区分</th><th>売却額</th><th>売却益の 合計額</th><th>売却損の 合計額</th></tr><tr><td>その他</td><td>千円 64,901</td><td>千円 2,918</td><td>千円 17</td></tr><tr><td>計</td><td>64,901</td><td>2,918</td><td>17</td></tr></table>	区分	売却額	売却益の 合計額	売却損の 合計額	その他	千円 64,901	千円 2,918	千円 17	計	64,901	2,918	17	<table><tr><th>区分</th><th>売却額</th><th>売却益の 合計額</th><th>売却損の 合計額</th></tr><tr><td>その他</td><td>千円 128,650</td><td>千円 67,194</td><td>千円 344</td></tr><tr><td>計</td><td>128,650</td><td>67,194</td><td>344</td></tr></table>	区分	売却額	売却益の 合計額	売却損の 合計額	その他	千円 128,650	千円 67,194	千円 344	計	128,650	67,194	344
区分	売却額	売却益の 合計額	売却損の 合計額																						
その他	千円 64,901	千円 2,918	千円 17																						
計	64,901	2,918	17																						
区分	売却額	売却益の 合計額	売却損の 合計額																						
その他	千円 128,650	千円 67,194	千円 344																						
計	128,650	67,194	344																						
3. 時価評価されていない有価証券	3. 時価評価されていない有価証券																								
<table><tr><th>内容</th><th>貸借対照表計上額（千円）</th></tr><tr><td>その他有価証券 非上場株式</td><td>65,000</td></tr></table>	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	<table><tr><th>内容</th><th>貸借対照表計上額（千円）</th></tr><tr><td>その他有価証券 非上場株式</td><td>10,000</td></tr></table>	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																
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																								
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。	4. その他有価証券のうち満期があるものの決算日後における償還予定額 該当事項はありません。																								

7. デリバティブ関係

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

8. 退職給付関係

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

9．税効果会計関係

第24期 (平成21年4月1日から 平成22年3月31日まで)	第25期 (平成22年4月1日から 平成23年3月31日まで)																																												
1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 <table> <tr> <td colspan="2">繰延税金資産</td></tr> <tr> <td>貸倒引当金繰入超過額</td><td>16,271千円</td></tr> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td><td>18,883千円</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>9,168千円</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>25,501千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td><td>69,823千円</td></tr> <tr> <td>評価性引当額</td><td>39,576千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td><td>30,247千円</td></tr> </table>	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 <table> <tr> <td colspan="2">繰延税金資産</td></tr> <tr> <td>貸倒引当金繰入超過額</td><td>15,294千円</td></tr> <tr> <td>賞与引当金繰入超過額</td><td>20,418千円</td></tr> <tr> <td>資産除去債務</td><td>6,650千円</td></tr> <tr> <td>移転による除却予定資産減損</td><td>7,170千円</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>6,824千円</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>19,740千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td><td>76,099千円</td></tr> <tr> <td>評価性引当額</td><td>32,440千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td><td>43,658千円</td></tr> <tr> <td colspan="2">繰延税金負債</td></tr> <tr> <td> 其他有価証券評価差額金</td><td>793千円</td></tr> <tr> <td> その他</td><td>806千円</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td><td>1,600千円</td></tr> </table>	繰延税金資産		貸倒引当金繰入超過額	15,294千円	賞与引当金繰入超過額	20,418千円	資産除去債務	6,650千円	移転による除却予定資産減損	7,170千円	未払事業税	6,824千円	その他	19,740千円	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		其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
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																																												
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																																													
其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 <table> <tr> <td>法定実効税率</td><td>40.7%</td></tr> <tr> <td colspan="2">(調整)</td></tr> <tr> <td> 受取配当金等永久に益金に</td><td></td></tr> <tr> <td> 算入されない項目</td><td>2.9%</td></tr> <tr> <td> 評価性引当額の減少</td><td>1.6%</td></tr> <tr> <td> 住民税均等割</td><td>0.1%</td></tr> <tr> <td> その他</td><td>0.4%</td></tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td>36.7%</td></tr> </table>	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%																												
法定実効税率	40.7%																																												
(調整)																																													
受取配当金等永久に益金に																																													
算入されない項目	2.9%																																												
評価性引当額の減少	1.6%																																												
住民税均等割	0.1%																																												
その他	0.4%																																												
税効果会計適用後の法人税等の負担率	36.7%																																												

10．資産除去債務関係

第25期
平成23年3月31日

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

事業用に賃借している事務所等の不動産賃貸借契約に基づく原状回復義務であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

物件の耐用年数等を参考に使用期間を見積り、対応する期間の割引率を使用して、金額を算定しております。

3．当事業年度における当該資産除去債務の総額の増減

期首残高（注）	5,776千円
時の経過による調整額	79千円
見積りの変更による増加額	10,489千円
期末残高	<u>16,345千円</u>

当社グループの経営統合に伴い、当事業年度末において見積りの見直しを行ったもの

（注）当事業年度より「資産除去債務に関する会計基準」（企業会計基準第18号 平成20年3月31日）及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日）を適用したことによる期首時点における残高であります。

11. セグメント情報等

第25期
(平成22年4月1日から
平成23年3月31日まで)

(セグメント情報)

第24期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連情報)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

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

(追加情報)

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

12. 関連当事者との取引関係

第24期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）

1. 関連当事者との取引

当社と同一の親会社を持つ会社等

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

第25期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）

1．関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

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

(2) 当社と同一の親会社を持つ会社等

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

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 報酬率は、一般取引条件を勘案し対象ファンド毎に決定している。

(注2) 取引条件は、一般取引条件を勘案して決定している。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

13．１株当たり情報

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

１株当たり当期純損益の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

14．重要な後発事象

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成23年12月14日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 木村 充 男 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 松崎 雅 則 印

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

[次へ](#)

(4) 中間貸借対照表

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

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

(5) 中間損益計算書

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

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

(6) 中間株主資本等変動計算書

第26期中間会計期間（平成23年 4 月 1 日から平成23年 9 月30日まで）

（単位：千円）

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

重要な会計方針

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

追加情報

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

項目	第26期中間会計期間 (平成23年4月1日から 平成23年9月30日まで)				
	株式の種類	当事業 年度期首	増加	減少	当中間 会計期間末
1. 発行済株式に関する事項	普通株式(株)	5,050	-	-	5,050
2. 自己株式に関する事項	該当事項はありません。				
3. 新株予約権等に関する事項	該当事項はありません。				
4. 配当に関する事項	該当事項はありません。				

リース取引関係

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

金融商品関係

第26期中間会計期間
(平成23年4月1日から
平成23年9月30日まで)

金融商品の時価等に関する事項

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

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

(＊) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1) 現金・預金

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

(2) 未収委託者報酬及び(4) 未払金

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

(3) 投資有価証券

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

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

内 容	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	10,000

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

有価証券関係

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

デリバティブ関係

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

資産除去債務関係

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

セグメント情報等

第26期中間会計期間
（平成23年4月1日から
平成23年9月30日まで）

（セグメント情報）

当社は、投資信託委託業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

（関連情報）

１．製品及びサービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

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

1 株当たり情報

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

(注) 1株当たり中間純利益算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

重要な後発事象

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

4【利害関係人との取引制限】

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

（１）自己又はその役員との取引

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

（２）運用財産相互間の取引

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

（３）通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

（４）親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

（５）その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記（３）及び（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

（１）定款の変更

当社は、平成24年4月1日に中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、商号を三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に変更しました。

（２）訴訟事件その他の重要事項

本書提出日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（1）受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（平成24年4月1日現在）

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

（2）販売会社

名称	資本金の額（百万円） （平成23年9月末日現在）	事業の内容
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。
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。
カブドットコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

（1）受託会社

当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

（2）販売会社

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

3【資本関係】

（1）受託会社

該当事項はありません。

（2）販売会社

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成23年9月末日現在）

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

第3【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 1 月27日	有価証券届出書の訂正届出書
平成23年 4 月22日	有価証券報告書
平成23年 4 月22日	有価証券届出書
平成23年10月24日	半期報告書
平成23年10月24日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成24年3月23日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 松崎雅則

印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山田信之

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているCMAM日本株式インデックスeの平成23年1月25日から平成24年1月23日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、CMAM日本株式インデックスeの平成24年1月23日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成23年3月24日

中央三井アセットマネジメント株式会社

取締役会

御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 松崎雅則

印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 平木達也

印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているCMAM日本株式インデックスeの平成22年4月6日から平成23年1月24日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、CMAM日本株式インデックスeの平成23年1月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年 6 月29日

住信アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あ ず さ 監 査 法 人

指定社員 公認会計士 壁 谷 恵 嗣 印
業務執行社員

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

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

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

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

以 上

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