

～お申込をされる前に～

## 目論見書補完書面(投資信託)

(この書面は、金融商品取引法第37条の3の規定により、目論見書と一体としてお渡しするものです。  
この書面は、株式会社新生銀行が作成したものであり、目論見書の一部を構成するものではありません。)

この目論見書補完書面、および目論見書の内容をよくお読みください。

当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。

### 当ファンドにかかる金融商品取引契約の概要

当行は、当ファンドの販売会社として、募集の取扱いおよび販売等に関する事務を行います。

### 当行が行う登録金融機関業務の内容および方法の概要

当行が行う金融商品取引業務は、金融商品取引法第33条の2の規定に基づく登録金融機関業務であり、当行においてファンドのお取引や保護預りを行われる場合は、以下によります。

- ・お取引にあたっては、投資信託総合取引口座をあらかじめ開設されることが必要となります。
- ・お取引のご注文をいただいたときは、原則として、あらかじめ当該ご注文にかかる設定代金または設定代金概算額の全部(前受金)を預金決済口座から引き落としてお預りしたうえで、ご注文をお受けいたします。
- ・設定代金概算額と設定代金の確定額の差額は、設定日に精算していただきます。
- ・ご注文いただいたお取引が成立した場合(法令に定める場合を除きます)には、取引報告書をお客さまのお届出住所宛に送付します。

当行は上記の他に金融商品取引業として、以下の業務を行っています。

- ①法令により登録金融機関が取り扱うことを認められた有価証券等の募集、売り出し、私募の取扱い等の業務
- ②証券仲介業務
- ③デリバティブ業務
- ④保護預り業務
- ⑤社債等の振替業務

### 当ファンドの販売会社の概要




|       |                                   |
|-------|-----------------------------------|
| 商号等   | 株式会社新生銀行 登録金融機関 関東財務局長(登金)第10号    |
| 本店所在地 | 〒100-8501 東京都千代田区内幸町2-1-8         |
| 加入協会  | 日本証券業協会、(社)金融先物取引業協会              |
| 資本金   | 476,296,960,638円(2008年2月4日現在)     |
| 主な事業  | 銀行業                               |
| 設立年月  | 1952年12月1日                        |
| 連絡先   | 0120-456-860またはお取引のある本支店にご連絡ください。 |



### 当行取扱いの公募追加型投資信託のお申込手数料一覧



















次ページ以降をご確認ください。

























## 当行取扱いの公募追加型投資信託のお申込手数料一覧

(※)約定金額とは、お申込金額からお申込手数料およびお申込手数料に対する消費税等の相当額を控除した金額(「約定日の基準価額×約定した口数」)をいいます。お申込手数料は、下記の手数料率を約定金額に乘じた金額とします。また、消費税等の相当額とは消費税および地方消費税相当額の合計金額を示し、各お申込手数料に対して5%がかかります。(「お申込金額=約定金額+お申込手数料+お申込手数料に対する消費税等の相当額」)










取扱窓口  店頭 /  電話 (新生パワーコール) /  インターネット (新生パワーダイレクト)












〔 電話 (新生パワーコール)、 インターネット (新生パワーダイレクト) は、パワーフレックス口座をお持ちの個人のお客さまのみのお取り扱いになります。〕
















| ファンド名                                  | 運用会社               | 取扱コース             | 約定金額(※)に対するお申込手数料率     |                  | お申込単位         | 取扱窓口  |
|--|--------------------|-------------------|------------------------|------------------|---------------|---|
| 大同のMMF<br>(マネー・マネージメント・ファンド)           | T&Dアセット<br>マネジメント  | 累積投資<br>専用        | なし                     |                  | 1万円以上<br>1円単位 |          |
| 225インデックス<br>ファンド                      | T&Dアセット<br>マネジメント  | 自動継続<br>投資コース     | 5億円未満                  | 1.05% (税抜 1.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |       |
|  |                    |                   | 5億円以上                  | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| インデックス<br>ファンド225                      | 日興アセット<br>マネジメント   | 分配金<br>再投資<br>コース | 一律                     | 1.05% (税抜 1.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
| ダイワ・<br>バリュー株・<br>オープン<br>(愛称:底力)      | 大和証券<br>投資信託<br>委託 | 分配金<br>再投資<br>コース | 1,000万円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|  |                    |                   | 1,000万円以上<br>5億円未満     | 2.1% (税抜 2.0%)   |               |   |
|  |                    |                   | 5億円以上<br>10億円未満        | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                    |                   | 10億円以上                 | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| フィデリティ・<br>日本成長株・<br>ファンド              | フィデリティ<br>投信       | 累積<br>投資コース       | 1,000万円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|  |                    |                   | 1,000万円以上<br>5,000万円未満 | 2.1% (税抜 2.0%)   |               |   |
|  |                    |                   | 5,000万円以上<br>1億円未満     | 1.575% (税抜 1.5%) |               |   |
|  |                    |                   | 1億円以上                  | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
| フィデリティ・<br>日本配当<br>成長株・ファンド<br>(分配重視型) | フィデリティ<br>投信       | 累積<br>投資コース       | 一律                     | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |

| ファンド名                               | 運用会社                                | 取扱コース                      | 約定金額(※)に対するお申込手数料率  | お申込単位         | 取扱窓口  |
|-------------------------------------|-------------------------------------|----------------------------|---|---------------|---|
| クレディ・スイス・<br>ジャパン・<br>グロース・<br>ファンド | クレディ・<br>スイス投信                      | 自動<br>けいぞく<br>投資専用         | 1,000万円未満 3.15% (税抜 3.0%)   | 1万円以上<br>1円単位 |          |
|                                     |                                     |                            | 1,000万円以上<br>5,000万円未満 2.1% (税抜 2.0%)                                 |               |   |
|                                     |                                     |                            | 5,000万円以上<br>1億円未満 1.575% (税抜 1.5%)                                   |               |   |
|                                     |                                     |                            | 1億円以上<br>5億円未満 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|                                     |                                     |                            | 5億円以上 0.525% (税抜 0.5%)  |               |   |
| アメリカン・<br>ドリーム・ファンド                 | 新生インベスト<br>メント・<br>マネジメント           | 自動<br>けいぞく<br>投資コース        | 1億円未満 3.15% (税抜 3.0%)   | 1万円以上<br>1円単位 |          |
|                                     |                                     |                            | 1億円以上<br>3億円未満 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|                                     |                                     |                            | 3億円以上 0.525% (税抜 0.5%)  |               |   |
| ガリレオ                                | ゴールドマン・<br>サックス・<br>アセット・<br>マネジメント | 自動<br>けいぞく<br>投資専用         | 1億円未満 2.1% (税抜 2.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|                                     |                                     |                            | 1億円以上<br>10億円未満 1.05% (税抜 1.0%)                                       |               |   |
|                                     |                                     |                            | 10億円以上 0.525% (税抜 0.5%)   |               |   |
| グローバル・<br>ソブリン・<br>オープン<br>(毎月決算型)  | 国際投信<br>投資顧問                        | 分配金<br>複利<br>けいぞく<br>投資コース | 1億口未満 1.575% (税抜 1.5%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|                                     |                                     |                            | 1億口以上<br>3億口未満 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|                                     |                                     |                            | 3億口以上 0.525% (税抜 0.5%)  |               |   |
|                                     |                                     |                            | お申込手数料の段階区分が「口数」<br>であるため、当ファンドについては「約<br>定した口数」に応じた手数料率を記<br>載しています。 |               |   |
| 世界のサイフ                              | 日興アセット<br>マネジメント                    | 分配金<br>再投資<br>コース          | 一律 2.10% (税抜 2.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
| LM・<br>オーストラリア<br>毎月分配型<br>ファンド     | レグ・<br>メイソン・<br>アセット・<br>マネジメント     | 自動<br>けいぞく<br>投資コース        | 1,000万円未満 2.1% (税抜 2.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|                                     |                                     |                            | 1,000万円以上<br>1億円未満 1.575% (税抜 1.5%)                                   |               |   |
|                                     |                                     |                            | 1億円以上 1.05% (税抜 1.0%)   |               |   |
| ニッセイ/<br>パトナム・<br>インカムオープン          | ニッセイ<br>アセット<br>マネジメント              | 自動<br>けいぞく<br>投資コース        | 一律 1.575% (税抜 1.5%)   | 1万円以上<br>1円単位 |    |
| エマージング・<br>ソブリン・オープン<br>(毎月決算型)     | 国際投信<br>投資顧問                        | 自動<br>けいぞく<br>投資コース        | 5億円未満 2.1% (税抜 2.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|                                     |                                     |                            | 5億円以上 1.05% (税抜 1.0%)   |               |   |

| ファンド名                                  | 運用会社                       | 取扱コース               | 約定金額(※)に対するお申込手数料率     |                  | お申込単位         | 取扱窓口 |
|--|----------------------------|---------------------|------------------------|------------------|---------------|------|
| 高利回り社債オープン                             | 野村アセットマネジメント               | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                     | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |      |
| 高利回り社債オープン・<br>為替ヘッジ                   | 野村アセットマネジメント               | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                     | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |      |
| エマージング・<br>カレンシー・<br>債券ファンド<br>(毎月分配型) | 新生インベスト<br>メント・<br>マネジメント  | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 1億円未満                  | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |      |
|  |                            |                     | 1億円以上                  | 1.575% (税抜 1.5%) |               |      |
| JPMワールド・<br>CB・<br>オープン                | JPモルガン・<br>アセット・<br>マネジメント | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                     | 2.1% (税抜 2.0%)   | 1万円以上<br>1円単位 |      |
| ドイツ・ライフ・<br>プラン<br>30                  | ドイツ・<br>アセット・<br>マネジメント    | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 5,000万円未満              | 2.1% (税抜 2.0%)   | 1万円以上<br>1円単位 |      |
|  |                            |                     | 5,000万円以上<br>1億円未満     | 1.575% (税抜 1.5%) |               |      |
|  |                            |                     | 1億円以上                  | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |      |
| ドイツ・ライフ・<br>プラン<br>50                  | ドイツ・<br>アセット・<br>マネジメント    | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 5,000万円未満              | 2.1% (税抜 2.0%)   | 1万円以上<br>1円単位 |      |
|  |                            |                     | 5,000万円以上<br>1億円未満     | 1.575% (税抜 1.5%) |               |      |
|  |                            |                     | 1億円以上                  | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |      |
| ドイツ・ライフ・<br>プラン<br>70                  | ドイツ・<br>アセット・<br>マネジメント    | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 5,000万円未満              | 2.1% (税抜 2.0%)   | 1万円以上<br>1円単位 |      |
|  |                            |                     | 5,000万円以上<br>1億円未満     | 1.575% (税抜 1.5%) |               |      |
|  |                            |                     | 1億円以上                  | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |      |
| フィデリティ・<br>バランス・<br>ファンド               | フィデリティ<br>投信               | 累積投資<br>コース         | 1,000万円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |      |
|  |                            |                     | 1,000万円以上<br>5,000万円未満 | 2.1% (税抜 2.0%)   |               |      |
|  |                            |                     | 5,000万円以上<br>1億円未満     | 1.575% (税抜 1.5%) |               |      |
|  |                            |                     | 1億円以上                  | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |      |
| 新生・4分散<br>ファンド                         | 中央三井<br>アセット<br>マネジメント     | 分配金<br>再投資<br>コース   | 1億円未満                  | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |      |
|  |                            |                     | 1億円以上<br>3億円未満         | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |      |
|  |                            |                     | 3億円以上                  | 0.525% (税抜 0.5%) |               |      |

| ファンド名                                    | 運用会社                       | 取扱コース               | 約定金額(※)に対するお申込手数料率 |                  | お申込単位         | 取扱窓口  |
|--|----------------------------|---------------------|--------------------|------------------|---------------|---|
| 新生・世界分散ファンド<br>(複利効果重視型)                 | 新生インベストメント・マネジメント          | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 1億円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|  |                            |                     | 1億円以上<br>3億円未満     | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                            |                     | 3億円以上              | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| 新生・世界分散ファンド<br>(分配重視型)                   | 新生インベストメント・マネジメント          | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 1億円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|  |                            |                     | 1億円以上<br>3億円未満     | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                            |                     | 3億円以上              | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| 世界の財産<br>3分法ファンド<br>(不動産・債券・株式)<br>毎月分配型 | 日興アセット<br>マネジメント           | 分配金<br>再投資<br>コース   | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
| 新生・世界株式<br>ファンド<br>(複利効果重視型)             | 新生インベストメント・マネジメント          | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 1億円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
|  |                            |                     | 1億円以上<br>3億円未満     | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                            |                     | 3億円以上              | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| 新生・世界株式<br>ファンド<br>(分配重視型)               | 新生インベストメント・マネジメント          | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 1億円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
|  |                            |                     | 1億円以上<br>3億円未満     | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                            |                     | 3億円以上              | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| グローバル・<br>ハイインカム・<br>ストック・ファンド           | 野村アセット<br>マネジメント           | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
| 世界好配当<br>インフラ株<br>ファンド<br>(毎月分配型)        | 日興アセット<br>マネジメント           | 分配金<br>再投資<br>コース   | 1億円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
|  |                            |                     | 1億円以上<br>3億円未満     | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                            |                     | 3億円以上              | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| JFアジア株・<br>アクティブ・<br>オープン                | JPモルガン・<br>アセット・<br>マネジメント | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
| JPM・BRICS5・<br>ファンド(愛称:<br>ブリックス・ファイブ)   | JPモルガン・<br>アセット・<br>マネジメント | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |

| ファンド名                                    | 運用会社                            | 取扱コース               | 約定金額(※)に対するお申込手数料率 |                  | お申込単位         | 取扱窓口  |
|--|---------------------------------|---------------------|--------------------|------------------|---------------|---|
| 新生・フラトン<br>VPIC<br>ファンド                  | 新生インベスト<br>メント・<br>マネジメント       | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 1億円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|  |                                 |                     | 1億円以上<br>3億円未満     | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                                 |                     | 3億円以上              | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| HSBCチャイナ<br>オープン                         | HSBC投信                          | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
| HSBCインド<br>オープン                          | HSBC投信                          | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
| 新生・UTI<br>インドファンド                        | 新生インベスト<br>メント・<br>マネジメント       | 分配金<br>再投資<br>コース   | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
| 新生・UTIインド<br>インフラ関連株式<br>ファンド            | 新生インベスト<br>メント・<br>マネジメント       | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 1億円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |    |
|  |                                 |                     | 1億円以上<br>3億円未満     | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                                 |                     | 3億円以上              | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| HSBCブラジル<br>オープン                         | HSBC投信                          | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
| SGロシア<br>東欧株ファンド                         | ソシエテ<br>ジェネラル<br>アセット<br>マネジメント | 分配金<br>再投資<br>コース   | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
| 新生・トロイカ<br>ロシアファンド                       | 新生インベスト<br>メント・<br>マネジメント       | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 1億円未満              | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |
|  |                                 |                     | 1億円以上<br>3億円未満     | 1.05% (税抜 1.0%)  |               |   |
|  |                                 |                     | 3億円以上              | 0.525% (税抜 0.5%) |               |   |
| フィデリティ・<br>USリート・<br>ファンド A<br>(為替ヘッジあり) | フィデリティ<br>投信                    | 累積投資<br>コース         | 一律                 | 2.1% (税抜 2.0%)   | 1万円以上<br>1円単位 |  |
| フィデリティ・<br>USリート・<br>ファンド B<br>(為替ヘッジなし) | フィデリティ<br>投信                    | 累積投資<br>コース         | 一律                 | 2.1% (税抜 2.0%)   | 1万円以上<br>1円単位 |  |
| ラサール・<br>グローバルREIT<br>ファンド<br>(毎月分配型)    | 日興アセット<br>マネジメント                | 分配金<br>再投資<br>コース   | 一律                 | 3.15% (税抜 3.0%)  | 1万円以上<br>1円単位 |  |

| ファンド名   | 運用会社                                     | 取扱コース               | 約定金額(※)に対するお申込手数料率                         | お申込単位          | 取扱窓口  |
|---|--|---------------------|--|----------------|---|
| ゴールドマン・サックス<br>日本株式マーケット・<br>ニュートラル・ファンド<br>(愛称:GS ジャパン・<br>ニュートラル)   | ゴールドマン・<br>サックス・<br>アセット・<br>マネジメント      | 自動<br>けいぞく<br>投資専用  | 5,000万円未満 2.1% (税抜 2.0%)                   | 1万円以上<br>1円単位  |    |
|   |  |                     | 5,000万円以上<br>1億円未満 1.575% (税抜 1.5%)        |                |   |
|   |  |                     | 1億円以上 1.05% (税抜 1.0%)                      |                |   |
| ゴールドマン・サックス<br>米国株式マーケット・<br>ニュートラル・ファンド<br>(愛称:GS US<br>ニュートラル)  | ゴールドマン・<br>サックス・<br>アセット・<br>マネジメント      | 自動<br>けいぞく<br>投資専用  | 5,000万円未満 2.1% (税抜 2.0%)                   | 1万円以上<br>1円単位  |    |
|   |  |                     | 5,000万円以上<br>1億円未満 1.575% (税抜 1.5%)        |                |   |
|   |  |                     | 1億円以上 1.05% (税抜 1.0%)                      |                |   |
| MHAM物価<br>連動国債ファンド<br>(愛称:未来予想)   | みずほ<br>投信投資<br>顧問                        | 分配金<br>再投資<br>コース   | 一律 1.05% (税抜 1.0%)                         | 1万円以上<br>1円単位  |    |
| インベスコ<br>店頭・成長株<br>オープン   | インベスコ<br>投信投資<br>顧問                      | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律 2.1% (税抜 2.0%)                          | 1万円以上<br>1円単位  |    |
| ドイチェ・ヨーロッパ<br>インカムオープン  | ドイチェ・<br>アセット・<br>マネジメント                 | 自動<br>けいぞく<br>投資コース | 一律 1.575% (税抜 1.5%)                        | 1万円以上<br>1円単位  |    |
| MSCIインデックス・<br>セレクト・ファンド<br>コクサイ・<br>ポートフォリオ  | モルガン・<br>スタンレー・<br>アセット・<br>マネジメント<br>投信 | 分配金<br>再投資<br>コース   | 一律 1.05% (税抜 1.0%)                         | 1万円以上<br>1円単位  |    |
| ダイワJ-REIT<br>オープン   | 大和証券<br>投資信託<br>委託                       | 分配金<br>再投資<br>コース   | 一律 1.05% (税抜 1.0%)                         | 1万円以上<br>1円単位  |    |
| 日本トレンド・セレクト<br>ハイパー・ウェイブ  | 日興アセット<br>マネジメント                         | 自動<br>けいぞく<br>投資専用  | 一律 1.05% (税抜 1.0%)                         | 1万円以上<br>1円単位  |    |
| 日本トレンド・セレクト<br>リバース・トレンド・<br>オープン   |  |                     | 一律 1.05% (税抜 1.0%)                         |                |   |
| 日本トレンド・セレクト<br>日本トレンド・<br>マネーポートフォリオ  |  |                     | 日本トレンド・セレクトの他のポートフォリオからのスイッチングでのみご購入いただけます |                |   |
| 日本トレンド・セレクトは手数料無しで3つのポートフォリオ間のスイッチングができます(信託財産留保額はかかる場合があります。詳しくは目論見書でご確認ください)。スイッチングによる購入申込単位は、1円以上1円単位です。 |  |                     |  |                |   |
| 日本債券ベア  | T&D<br>アセット<br>マネジメント                    | 自動継続<br>投資コース       | 一律 1.05% (税抜 1.0%)                         | 10万円以上<br>1円単位 |    |

### <償還乗換優遇制度について>

償還乗換優遇制度とは、投資信託の償還金をもって、その支払を受けた販売会社で一定期間内に新たに別の投資信託をご購入いただく場合に、お申込手数料が無料となるなどの優遇制度です。当行では、お客さまが、下記の優遇対象となる償還(予定)ファンドの償還金をもって、本お申込手数料一覧記載のいずれかの投資信託(「大同のMMF」は除く。)をお申し込みされる場合に、手数料を無料とさせていただきます。\*なお、償還乗換の際に償還金の支払を受けたことを証する書類を呈示していただくことがあります。

※以下の場合には優遇制度の対象外となります。

- ・「償還するファンド」「償還金をもってお申し込みされるファンド」のいずれかまたは両方が、外国籍投資信託である場合
- ・インターネット(新生パワーダイレクト)でお申し込みされる場合

| 優遇対象となる償還(予定)ファンド   | 償還(予定)日 | 優遇期限 |
|---------------------|---------|------|
| —                   | —       | —    |
| 優遇対象とならない償還(予定)ファンド | 償還(予定)日 |      |
| —                   | —       |      |

Color your life





# 新生・4分散ファンド

追加型株式投資信託 / バランス型

<設定・運用は>

 中央三井アセットマネジメント

\*本情報は金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

# 新生・4分散ファンド

## 追加型株式投資信託 / バランス型

### 投資信託説明書（交付目論見書）訂正事項分

2008年8月

新生・4分散ファンドは、実質的に国内外の株式や公社債を主要投資対象としています。組入れた有価証券の値動き、為替相場の変動等の影響や組入れた有価証券の発行体の経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化等により、ファンドの基準価額も変動し、これにより投資元本を割り込むことがあります。

従って、当ファンドは元本保証のある商品ではありません。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資家の皆様に帰属します。

ご投資家の皆様におかれましては、当投資信託説明書（交付目論見書）本文をよくお読みいただき、商品の内容・リスクを十分ご理解のうえ、お申込みいただきますようお願い申し上げます。

この目論見書により行う新生・4分散ファンドの募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条の規定により有価証券届出書を平成19年10月5日に関東財務局長に提出しており、平成19年10月21日に届出の効力が生じております。また、委託会社は、金融商品取引法第7条の規定により、有価証券届出書の訂正届出書を平成20年8月26日関東財務局長に提出しております。

中央三井アセットマネジメント株式会社

投資信託説明書（交付目論見書）は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

## ・投資信託説明書（交付目論見書）の訂正理由

新生・4分散ファンドの投資信託説明書（交付目論見書）（以下「原交付目論見書」といいます。）の記載事項のうち、有価証券報告書及び有価証券届出書の訂正届出書を提出したことに伴う追加・訂正事項がありましたので、関係事項を下記のとおり訂正するものです。

## ・訂正箇所及び訂正事項（訂正後の内容を記載しております。）

### ファンドの特徴

### ファンドの性格

### ファンドの特色（原交付目論見書4頁）

（前略）

中央三井外国株式マザーファンド：「MSCIコクサイ指数（円ベース）」

（中略）

MSCIコクサイ指数について

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

（後略）

### ファンドの仕組み（原交付目論見書5頁）

（前略）

<委託会社の概況>

1．資本金の額：3億円（平成20年8月26日現在）

（中略）

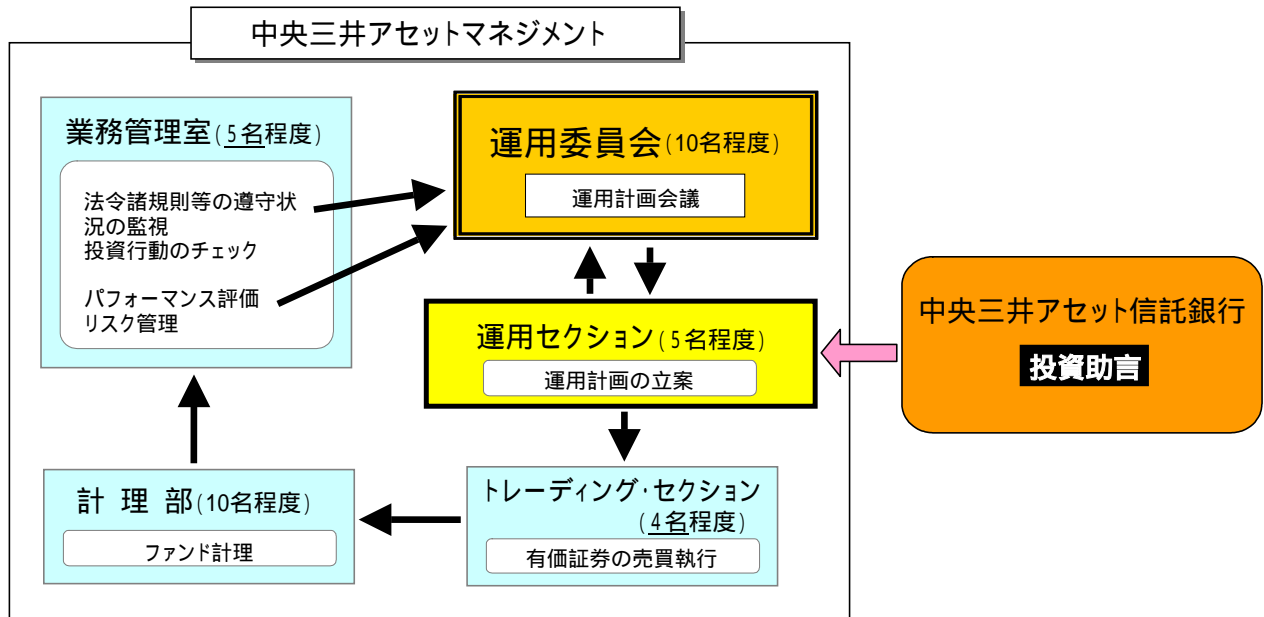
3．大株主の状況（平成20年8月26日現在）

（後略）

# 投資方針

## 運用体制（原交付目論見書 8 頁）

当ファンドの運用体制は以下のとおりです。



運用計画案を策定のうえ、  
運用計画会議・運用委員会に提出  
運用計画案承認  
発注指示  
約定連絡

発注伝票の回覧・チェック  
コンプライアンス・チェックの報告  
パフォーマンス評価、  
リスク分析等の報告

（後略）

## 投資リスク

### ファンドのリスク (原交付目論見書12頁)

当ファンドは、マザーファンドを通じて主に国内外の株式や公社債を投資対象としています。組入れた株式や公社債の値動きや為替レートの変動等により基準価額が変動しますので、元本保証はなく、投資元本を割り込むことがあり収益（投資利回り）は未確定です。また、組入れた株式や公社債の発行体の経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化等により、投資元本を割り込むことがあり収益（投資利回り）は未確定です。

(中略)

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

(中略)

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

|         |   |
|---------|---|
| 為替変動リスク | 為替変動リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に、投資している国の通貨（ ）が円に対して弱く（円高に）なれば基準価額の下落要因となり、強く（円安に）なれば基準価額の上昇要因となります。<br>米ドル、カナダドル、ユーロ、英ポンド、スイスフラン、スウェーデンクローナ、ノルウェークローネ、デンマーククローネ、ポーランドズロチ、オーストラリアドル、ニュージーランドドル、香港ドル、マレ・シアリングット、シンガポールドル（平成20年6月末現在・マザーファンドベース） |
|---------|---|

(後略)

## 投資の手引き 手数料等及び税金

収益分配時・一部解約時・償還時などの税金等（原交付目論見書17頁）

| 時期    | 項目       | 内容   |                                    |
|-------|----------|--|------------------------------------|
|       |          | 個人受益者                                      | 法人受益者                              |
| 収益分配時 | 所得税及び地方税 | 普通分配金に対して10%<br>(所得税7%及び地方税3%)             | 普通分配金に対して7%<br>(所得税のみ)             |
| 一部解約時 | 所得税及び地方税 | 解約価額の受益者毎の個別元本超過額に対して10%<br>(所得税7%及び地方税3%) | 解約価額の受益者毎の個別元本超過額に対して7%<br>(所得税のみ) |
| 償還時   | 所得税及び地方税 | 償還価額の受益者毎の個別元本超過額に対して10%<br>(所得税7%及び地方税3%) | 償還価額の受益者毎の個別元本超過額に対して7%<br>(所得税のみ) |

(注) < 個人の受益者に対する課税 >

平成21年1月1日以降の取扱いにつきましては、後記「課税上の取扱い」中の「個人の受益者に対する課税」(当交付目論見書(訂正事項分)5ページ)をご覧ください。

< 法人の受益者に対する課税 >

平成21年4月1日以降は、上記の7%(所得税のみ)の税率は15%(所得税のみ)となります。

(後記「課税上の取扱い」をあわせてご参照ください。)

課税上の取扱い（原交付目論見書19頁）

|                          |  |
|--------------------------|--|
| <p>個人の受益者<br/>に対する課税</p> | <p>個人の受益者が支払いを受ける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、<u>10%（所得税7%及び地方税3%）の税率（ ）による源泉徴収（申告不要）が行われます。確定申告を行えば、総合課税を選択することもできます。また、一部解約時及び償還時の損失については、確定申告により、株式等譲渡益との損益通算が可能となります。</u></p> <p><u>平成21年1月1日以降は、以下の取扱いとなります。</u></p> <p><u>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、平成22年12月31日までは10%（所得税7%及び地方税3%）、平成23年1月1日以降は20%（所得税15%及び地方税5%）となります。ただし、平成21年及び平成22年において、他の上場株式等を含めた配当所得（年間の支払金額が1万円以下の銘柄に係るものを除きます。）の合計額が年間100万円を超える場合には確定申告が必要となります（申告分離課税も選択できます。）。</u></p> <p><u>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。）。</u>その税率は、平成21年及び平成22年においては、その年における他の上場株式等を含めた譲渡所得の合計額のうち500万円以下の部分については10%（所得税7%及び地方税3%）、500万円を超える部分については、20%（所得税15%及び地方税5%）となります。平成23年以降は金額に関らず20%（所得税15%及び地方税5%）となります。</p> <p><u>なお、平成21年及び平成22年において、特定口座（源泉徴収選択口座）を利用している場合でも、その年における他の上場株式等を含めた譲渡所得の合計額が500万円を超える場合には確定申告が必要となります。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>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。</u></p> |
| <p>法人の受益者<br/>に対する課税</p> | <p>法人の受益者が支払いを受ける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、<u>7%（所得税のみ）の税率（ ）による源泉徴収が行われます。</u></p> <p><u>平成21年4月1日以降は、上記の7%（所得税のみ）の税率は15%（所得税のみ）となります。</u></p>   |

（後略）

## 運用の状況

### 運用状況 (原交付目論見書23頁)

以下の記載事項は、平成20年6月30日現在の状況について記載してあります。

### 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<br>受益証券 | 中央三井日本株式マザーファンド | 日本   | 309,890,124   | 24.71         |
|               | 中央三井日本債券マザーファンド | 日本   | 322,241,738   | 25.69         |
|               | 中央三井外国株式マザーファンド | 日本   | 302,684,575   | 24.13         |
|               | 中央三井外国債券マザーファンド | 日本   | 320,174,353   | 25.53         |
|               | 親投資信託受益証券合計     |      |               | 1,254,990,790 |
| その他の資産(負債控除後) |                 |      | 692,676       | 0.06          |
| 合計(純資産総額)     |                 |      | 1,254,298,114 | 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   | 271,768,277,880 | 97.69   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) |      | 6,440,336,673   | 2.31    |
| 合計(純資産総額)             |      | 278,208,614,553 | 100.00  |

#### (中央三井日本債券マザーファンド)

| 資産の種類                 | 国/地域 | 時価合計(円)         | 投資比率(%) |
|-----------------------|------|-----------------|---------|
| 公社債                   | 日本   | 256,443,962,756 | 98.78   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) |      | 3,168,393,482   | 1.22    |
| 合計(純資産総額)             |      | 259,612,356,238 | 100.00  |

#### (中央三井外国株式マザーファンド)

| 資産の種類                 | 国/地域    | 時価合計(円)         | 投資比率(%) |
|-----------------------|---------|-----------------|---------|
| 株式                    | アメリカ    | 151,763,051,653 | 48.17   |
|                       | イギリス    | 34,723,220,658  | 11.02   |
|                       | カナダ     | 15,964,753,240  | 5.07    |
|                       | フランス    | 15,804,858,757  | 5.02    |
|                       | ドイツ     | 14,946,797,380  | 4.74    |
|                       | その他     | 67,665,794,936  | 21.48   |
|                       | 小計      | 300,868,476,624 | 95.49   |
| 投資信託受益証券、<br>投資証券     | アメリカ    | 2,254,973,635   | 0.72    |
|                       | オーストラリア | 906,651,018     | 0.29    |
|                       | その他     | 1,822,022,980   | 0.58    |
|                       | 小計      | 4,983,647,633   | 1.58    |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) |         | 9,226,203,459   | 2.93    |
| 合計(純資産総額)             |         | 315,078,327,716 | 100.00  |



(中央三井外国債券マザーファンド)

| 資産の種類                 | 国/地域    | 時価合計(円)         | 投資比率(%) |
|-----------------------|---------|-----------------|---------|
| 国債証券                  | アメリカ    | 133,774,707,351 | 25.82   |
|                       | ドイツ     | 69,883,642,625  | 13.49   |
|                       | イタリア    | 65,412,367,136  | 12.62   |
|                       | フランス    | 58,740,224,024  | 11.34   |
|                       | イギリス    | 40,747,302,248  | 7.86    |
|                       | その他     | 133,616,551,499 | 25.79   |
|                       | 小計      | 502,174,794,883 | 96.91   |
| 特殊債券                  | オーストラリア | 2,463,557,714   | 0.48    |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) |         | 13,550,745,268  | 2.62    |
| 合計(純資産総額)             |         | 518,189,097,865 | 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。

## 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<br>受益証券 | 中央三井日本株式マザーファンド | 278,653,111 | 1.1641 | 324,380,087 | 1.1121 | 309,890,124 | 24.71   |
|               | 中央三井日本債券マザーファンド | 293,801,731 | 1.0826 | 318,069,754 | 1.0968 | 322,241,738 | 25.69   |
|               | 中央三井外国株式マザーファンド | 234,711,985 | 1.3726 | 322,172,475 | 1.2896 | 302,684,575 | 24.13   |
|               | 中央三井外国債券マザーファンド | 174,272,999 | 1.8222 | 317,560,259 | 1.8372 | 320,174,353 | 25.53   |

(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      | 2,054,700  | 4,931   | 10,131,027,600 | 5,010     | 10,294,047,000  | 3.70     |
| 2  | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業        | 9,169,600  | 874     | 8,012,884,016  | 941       | 8,628,593,600   | 3.10     |
| 3  | 任天堂               | その他製品      | 91,500     | 51,255  | 4,689,874,500  | 59,900    | 5,480,850,000   | 1.97     |
| 4  | キヤノン              | 電気機器       | 993,400    | 4,285   | 4,256,434,700  | 5,460     | 5,423,964,000   | 1.95     |
| 5  | 三井住友フィナンシャルグループ   | 銀行業        | 6,662      | 712,336 | 4,745,579,293  | 799,000   | 5,322,938,000   | 1.91     |
| 6  | 本田技研工業            | 輸送用機器      | 1,366,800  | 2,950   | 4,032,001,700  | 3,610     | 4,934,148,000   | 1.77     |
| 7  | みずほフィナンシャルグループ    | 銀行業        | 9,621      | 430,079 | 4,137,790,299  | 496,000   | 4,772,016,000   | 1.72     |
| 8  | ソニー               | 電気機器       | 897,900    | 5,076   | 4,557,324,500  | 4,640     | 4,166,256,000   | 1.50     |
| 9  | 三菱商事              | 卸売業        | 1,178,500  | 2,327   | 2,741,896,800  | 3,500     | 4,124,750,000   | 1.48     |
| 10 | 松下電器産業            | 電気機器       | 1,705,000  | 1,993   | 3,398,212,000  | 2,290     | 3,904,450,000   | 1.40     |
| 11 | 日本電信電話            | 情報・通信業     | 7,256      | 483,941 | 3,511,474,352  | 520,000   | 3,773,120,000   | 1.36     |
| 12 | 武田薬品工業            | 医薬品        | 619,900    | 5,987   | 3,711,192,524  | 5,400     | 3,347,460,000   | 1.20     |
| 13 | 三井物産              | 卸売業        | 1,266,000  | 1,755   | 2,221,263,000  | 2,345     | 2,968,770,000   | 1.07     |
| 14 | ミレアホールディングス       | 保険業        | 679,200    | 3,392   | 2,303,570,285  | 4,140     | 2,811,888,000   | 1.01     |
| 15 | 東京電力              | 電気・ガス業     | 1,007,700  | 2,698   | 2,718,330,000  | 2,730     | 2,751,021,000   | 0.99     |
| 16 | 新日本製鐵             | 鉄鋼         | 4,732,000  | 601     | 2,845,461,000  | 575       | 2,720,900,000   | 0.98     |
| 17 | 三菱地所              | 不動産業       | 1,098,000  | 2,261   | 2,482,898,000  | 2,430     | 2,668,140,000   | 0.96     |
| 18 | 野村ホールディングス        | 証券・商品先物取引業 | 1,659,700  | 1,420   | 2,357,532,900  | 1,573     | 2,610,708,100   | 0.94     |
| 19 | 東日本旅客鉄道           | 陸運業        | 2,980      | 876,147 | 2,610,917,120  | 865,000   | 2,577,700,000   | 0.93     |
| 20 | エヌ・ティ・ティ・コム       | 情報・通信業     | 15,598     | 151,910 | 2,369,499,832  | 156,000   | 2,433,288,000   | 0.87     |
| 21 | ジェイ エフ イーホールディングス | 鉄鋼         | 427,200    | 4,803   | 2,052,053,100  | 5,350     | 2,285,520,000   | 0.82     |
| 22 | 小松製作所             | 機械         | 744,000    | 2,251   | 1,674,454,200  | 2,960     | 2,202,240,000   | 0.79     |
| 23 | 日立製作所             | 電気機器       | 2,676,000  | 702     | 1,879,234,000  | 766       | 2,049,816,000   | 0.74     |
| 24 | セブン&アイ・ホールディングス   | 小売業        | 665,000    | 2,595   | 1,725,631,300  | 3,030     | 2,014,950,000   | 0.72     |
| 25 | 東芝                | 電気機器       | 2,412,000  | 699     | 1,686,638,000  | 783       | 1,888,596,000   | 0.68     |
| 26 | 信越化学工業            | 化学         | 279,000    | 5,537   | 1,544,774,600  | 6,580     | 1,835,820,000   | 0.66     |
| 27 | 日本たばこ産業           | 食料品        | 3,973      | 588,113 | 2,336,571,994  | 453,000   | 1,799,769,000   | 0.65     |
| 28 | 三菱電機              | 電気機器       | 1,493,000  | 876     | 1,307,695,000  | 1,145     | 1,709,485,000   | 0.61     |
| 29 | 東海旅客鉄道            | 陸運業        | 1,446      | 929,082 | 1,343,451,990  | 1,170,000 | 1,691,820,000   | 0.61     |
| 30 | 関西電力              | 電気・ガス業     | 669,300    | 2,603   | 1,742,187,200  | 2,485     | 1,663,210,500   | 0.60     |
|    | 合計                |            | 37,932,936 |         | 95,127,855,805 |           | 104,856,234,200 | 37.69    |

(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。

(注) 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     | 0.09     |
|    | 鉱業         | 0.46     |
|    | 建設業        | 1.72     |
|    | 食料品        | 2.87     |
|    | 繊維製品       | 0.79     |
|    | パルプ・紙      | 0.33     |
|    | 化学         | 5.18     |
|    | 医薬品        | 3.95     |
|    | 石油・石炭製品    | 0.73     |
|    | ゴム製品       | 0.46     |
|    | ガラス・土石製品   | 1.21     |
|    | 鉄鋼         | 3.22     |
|    | 非鉄金属       | 1.15     |
|    | 金属製品       | 0.57     |
|    | 機械         | 4.54     |
|    | 電気機器       | 14.29    |
|    | 輸送用機器      | 9.01     |
|    | 精密機器       | 1.36     |
|    | その他製品      | 3.05     |
|    | 電気・ガス業     | 4.19     |
|    | 陸運業        | 3.45     |
|    | 海運業        | 0.98     |
|    | 空運業        | 0.41     |
|    | 倉庫・運輸関連業   | 0.20     |
|    | 情報・通信業     | 4.98     |
|    | 卸売業        | 5.31     |
|    | 小売業        | 3.06     |
|    | 銀行業        | 10.86    |
|    | 証券、商品先物取引業 | 1.57     |
|    | 保険業        | 2.65     |
|    | その他金融業     | 1.22     |
|    | 不動産業       | 2.40     |
|    | サービス業      | 1.40     |
|    | 合計         | 97.69    |

(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

その他の投資資産として、次のとおり株価指数先物取引を利用しております。

| 銘柄名                     | 国/地域 | 数量  | 簿価金額 (円)      | 評価金額 (円)      | 投資比率 (%) |
|-------------------------|------|-----|---------------|---------------|----------|
| 先物取引<br>買建<br>TOPIX先物取引 | 日本   | 520 | 7,007,121,750 | 6,856,200,000 | 2.46     |

(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評価金額の比率をいいます。

## (中央三井日本債券マザーファンド)

## 投資有価証券の主要銘柄

## A. 主要銘柄の明細

| 順位 | 銘柄名                  | 利率<br>(%) | 償還日        | 額面金額<br>(円)    | 簿価(円)  |                | 評価額(円) |                | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----------------------|-----------|------------|----------------|--------|----------------|--------|----------------|-----------------|
|    |                      |           |            |                | 単価     | 金額             | 単価     | 金額             |                 |
| 1  | 利付国庫債券(2年)<br>第268回  | 0.7       | 2010/5/15  | 3,300,000,000  | 99.65  | 3,288,767,000  | 99.88  | 3,296,040,000  | 1.27            |
| 2  | 利付国庫債券(10年)<br>第289回 | 1.5       | 2017/12/20 | 3,300,000,000  | 101.09 | 3,336,294,000  | 99.38  | 3,279,606,000  | 1.26            |
| 3  | 利付国庫債券(5年)<br>第60回   | 1.2       | 2011/9/20  | 3,200,000,000  | 101.94 | 3,262,176,000  | 100.79 | 3,225,440,000  | 1.24            |
| 4  | 利付国庫債券(5年)<br>第42回   | 0.6       | 2009/12/20 | 2,970,000,000  | 100.15 | 2,974,455,000  | 99.77  | 2,963,317,500  | 1.14            |
| 5  | 利付国庫債券(5年)<br>第63回   | 1.2       | 2012/3/20  | 2,900,000,000  | 101.85 | 2,953,898,000  | 100.64 | 2,918,647,000  | 1.12            |
| 6  | 利付国庫債券(5年)<br>第69回   | 0.9       | 2012/12/20 | 2,900,000,000  | 100.23 | 2,906,876,000  | 99.00  | 2,871,029,000  | 1.11            |
| 7  | 利付国庫債券(10年)<br>第285回 | 1.7       | 2017/3/20  | 2,800,000,000  | 103.70 | 2,903,603,000  | 101.73 | 2,848,636,000  | 1.10            |
| 8  | 利付国庫債券(10年)<br>第288回 | 1.7       | 2017/9/20  | 2,500,000,000  | 103.65 | 2,591,300,000  | 101.33 | 2,533,300,000  | 0.98            |
| 9  | 利付国庫債券(5年)<br>第62回   | 1.3       | 2011/12/20 | 2,400,000,000  | 102.35 | 2,456,544,000  | 101.05 | 2,425,320,000  | 0.93            |
| 10 | 利付国庫債券(5年)<br>第52回   | 0.8       | 2010/12/20 | 2,100,000,000  | 100.68 | 2,114,330,000  | 99.91  | 2,098,215,000  | 0.81            |
| 11 | 利付国庫債券(5年)<br>第70回   | 0.8       | 2013/3/20  | 2,100,000,000  | 99.85  | 2,096,873,000  | 98.36  | 2,065,749,000  | 0.80            |
| 12 | 利付国庫債券(5年)<br>第50回   | 0.8       | 2010/9/20  | 2,000,000,000  | 100.64 | 2,012,800,000  | 100.00 | 2,000,000,000  | 0.77            |
| 13 | 利付国庫債券(5年)<br>第64回   | 1.5       | 2012/6/20  | 1,900,000,000  | 103.19 | 1,960,798,000  | 101.73 | 1,932,908,000  | 0.74            |
| 14 | 利付国庫債券(5年)<br>第57回   | 1.4       | 2011/6/20  | 1,900,000,000  | 102.48 | 1,947,138,000  | 101.48 | 1,928,253,000  | 0.74            |
| 15 | 利付国庫債券(5年)<br>第71回   | 1.3       | 2013/3/20  | 1,900,000,000  | 99.81  | 1,896,485,000  | 100.67 | 1,912,730,000  | 0.74            |
| 16 | 利付国庫債券(10年)<br>第284回 | 1.7       | 2016/12/20 | 1,850,000,000  | 104.31 | 1,929,735,000  | 101.96 | 1,886,278,500  | 0.73            |
| 17 | 利付国庫債券(10年)<br>第234回 | 1.4       | 2011/9/20  | 1,840,000,000  | 102.71 | 1,889,900,800  | 101.45 | 1,866,698,400  | 0.72            |
| 18 | 利付国庫債券(10年)<br>第264回 | 1.5       | 2014/9/20  | 1,830,000,000  | 103.63 | 1,896,520,500  | 101.26 | 1,853,167,800  | 0.71            |
| 19 | 利付国庫債券(10年)<br>第273回 | 1.5       | 2015/9/20  | 1,800,000,000  | 103.48 | 1,862,640,000  | 101.21 | 1,821,942,000  | 0.70            |
| 20 | 利付国庫債券(10年)<br>第256回 | 1.4       | 2013/12/20 | 1,640,000,000  | 103.06 | 1,690,200,400  | 100.94 | 1,655,547,200  | 0.64            |
| 21 | 利付国庫債券(2年)<br>第260回  | 0.9       | 2009/9/15  | 1,600,000,000  | 100.62 | 1,610,000,000  | 100.22 | 1,603,520,000  | 0.62            |
| 22 | 利付国庫債券(5年)<br>第65回   | 1.4       | 2012/6/20  | 1,500,000,000  | 101.21 | 1,518,181,000  | 101.35 | 1,520,265,000  | 0.59            |
| 23 | 利付国庫債券(5年)<br>第67回   | 1.3       | 2012/9/20  | 1,500,000,000  | 102.47 | 1,537,080,000  | 100.84 | 1,512,690,000  | 0.58            |
| 24 | 利付国庫債券(10年)<br>第240回 | 1.3       | 2012/6/20  | 1,470,000,000  | 102.42 | 1,505,706,300  | 100.97 | 1,484,259,000  | 0.57            |
| 25 | 利付国庫債券(10年)<br>第290回 | 1.4       | 2018/3/20  | 1,500,000,000  | 101.10 | 1,516,560,000  | 98.36  | 1,475,400,000  | 0.57            |
| 26 | 利付国庫債券(10年)<br>第280回 | 1.9       | 2016/6/20  | 1,400,000,000  | 105.78 | 1,480,942,000  | 103.95 | 1,455,370,000  | 0.56            |
| 27 | 利付国庫債券(10年)<br>第268回 | 1.5       | 2015/3/20  | 1,400,000,000  | 103.68 | 1,451,520,000  | 101.17 | 1,416,408,000  | 0.55            |
| 28 | 利付国庫債券(10年)<br>第267回 | 1.3       | 2014/12/20 | 1,410,000,000  | 102.26 | 1,441,950,600  | 99.94  | 1,409,154,000  | 0.54            |
| 29 | 利付国庫債券(5年)<br>第53回   | 1.0       | 2010/12/20 | 1,400,000,000  | 101.25 | 1,417,584,000  | 100.41 | 1,405,740,000  | 0.54            |
| 30 | 利付国庫債券(10年)<br>第259回 | 1.5       | 2014/3/20  | 1,380,000,000  | 103.64 | 1,430,314,800  | 101.38 | 1,399,126,800  | 0.54            |
| 合計 |                      |           |            | 61,690,000,000 |        | 62,881,172,400 |        | 62,064,757,200 | 23.91           |

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

(注) 国/地域は全て日本、種類は全て国債証券です。

#### B. 種類別の投資比率

| 種類    | 投資比率 (%) |
|-------|----------|
| 国債証券  | 73.01    |
| 地方債証券 | 6.09     |
| 特殊債券  | 11.20    |
| 社債券   | 8.48     |
| 合計    | 98.78    |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

| 銘柄名                  | 国/地域 | 数量(枚) | 簿価金額(円)       | 評価金額(円)       | 投資比率 (%) |
|----------------------|------|-------|---------------|---------------|----------|
| 先物取引<br>買建<br>長期国債先物 | 日本   | 11    | 1,467,806,170 | 1,489,950,000 | 0.57     |

(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評価金額の比率をいいます。

## (中央三井外国株式マザーファンド)

## 投資有価証券の主要銘柄

## A. 主要銘柄の明細

| 順位 | 国/地域    | 銘柄名                            | 業種                     | 株数        | 簿価(円)     |                | 評価額(円)    |                | 投資比率(%) |
|----|---------|--------------------------------|------------------------|-----------|-----------|----------------|-----------|----------------|---------|
|    |         |                                |                        |           | 単価        | 金額             | 単価        | 金額             |         |
| 1  | アメリカ    | EXXON MOBIL CORPORATION        | エネルギー                  | 672,376   | 8,722.78  | 5,864,991,350  | 9,210.65  | 6,193,020,676  | 1.97    |
| 2  | アメリカ    | GENERAL ELECTRIC               | 資本財                    | 1,254,945 | 3,626.10  | 4,550,559,476  | 2,794.58  | 3,507,055,743  | 1.11    |
| 3  | アメリカ    | MICROSOFT CORP                 | ソフトウェア・サービス            | 1,052,691 | 3,027.59  | 3,187,124,446  | 2,940.38  | 3,095,316,404  | 0.98    |
| 4  | イギリス    | BP PLC                         | エネルギー                  | 2,372,484 | 1,154.37  | 2,738,739,629  | 1,200.30  | 2,847,712,414  | 0.90    |
| 5  | アメリカ    | CHEVRON CORP                   | エネルギー                  | 261,042   | 8,369.06  | 2,184,678,366  | 10,407.87 | 2,716,892,766  | 0.86    |
| 6  | アメリカ    | AT&T INC                       | 電気通信サービス               | 758,552   | 3,866.27  | 2,932,773,360  | 3,486.31  | 2,644,554,401  | 0.84    |
| 7  | アメリカ    | PROCTER & GAMBLE CO            | 家庭用品・パーソナル用品           | 386,815   | 6,958.47  | 2,691,643,477  | 6,437.34  | 2,490,061,915  | 0.79    |
| 8  | イギリス    | HSBC HLDGS PLC                 | 銀行                     | 1,491,390 | 1,596.37  | 2,380,810,559  | 1,652.08  | 2,463,900,065  | 0.78    |
| 9  | フランス    | TOTAL SA                       | エネルギー                  | 270,962   | 8,207.38  | 2,223,889,527  | 8,892.58  | 2,409,552,264  | 0.76    |
| 10 | アメリカ    | JOHNSON & JOHNSON              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 355,970   | 6,714.27  | 2,390,079,709  | 6,765.11  | 2,408,179,552  | 0.76    |
| 11 | スイス     | NESTLE SA-REGISTERD            | 食品・飲料・タバコ              | 49,401    | 49,859.72 | 2,463,120,462  | 47,206.87 | 2,332,067,078  | 0.74    |
| 12 | アメリカ    | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 174,078   | 11,176.44 | 1,945,572,390  | 12,775.72 | 2,223,971,960  | 0.71    |
| 13 | イギリス    | VODAFONE GROUP PLC             | 電気通信サービス               | 6,676,844 | 365.76    | 2,442,167,805  | 300.89    | 2,009,062,024  | 0.64    |
| 14 | アメリカ    | APPLE INC                      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 110,500   | 13,213.21 | 1,460,060,040  | 18,100.97 | 2,000,158,046  | 0.63    |
| 15 | イギリス    | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS    | エネルギー                  | 447,481   | 3,765.73  | 1,685,095,697  | 4,278.85  | 1,914,705,195  | 0.61    |
| 16 | アメリカ    | CISCO SYSTEMS INC              | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 749,213   | 2,467.94  | 1,849,019,245  | 2,512.57  | 1,882,454,752  | 0.60    |
| 17 | オーストラリア | BHP BILLITON LTD               | 素材                     | 421,789   | 3,778.96  | 1,593,923,789  | 4,391.07  | 1,852,108,482  | 0.59    |
| 18 | アメリカ    | CONOCOPHILLIPS                 | エネルギー                  | 186,400   | 8,706.96  | 1,622,978,959  | 9,752.32  | 1,817,834,088  | 0.58    |
| 19 | アメリカ    | WAL-MART STORES                | 食品・生活必需品小売り            | 302,026   | 5,231.55  | 1,580,067,115  | 5,991.44  | 1,809,572,469  | 0.57    |
| 20 | ドイツ     | E.ON AG                        | 公益事業                   | 79,637    | 21,611.07 | 1,721,041,245  | 21,307.91 | 1,696,898,395  | 0.54    |
| 21 | アンティル   | SCHLUMBERGER LIMITED           | エネルギー                  | 150,540   | 8,158.90  | 1,228,241,105  | 11,269.87 | 1,696,567,434  | 0.54    |
| 22 | アメリカ    | GOOGLE INC-CLASS A             | ソフトウェア・サービス            | 29,800    | 53,109.93 | 1,582,676,159  | 56,197.20 | 1,674,676,840  | 0.53    |
| 23 | スイス     | NOVARTIS AG-REG SHS            | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 291,528   | 5,627.57  | 1,640,596,298  | 5,723.31  | 1,668,505,700  | 0.53    |
| 24 | アメリカ    | INTEL CORP                     | 半導体・半導体製造装置            | 727,465   | 2,128.15  | 1,548,160,497  | 2,286.96  | 1,663,687,575  | 0.53    |
| 25 | イギリス    | GLAXOSMITHKLINE PLC            | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 687,430   | 2,465.19  | 1,694,647,013  | 2,361.33  | 1,623,250,456  | 0.52    |
| 26 | アメリカ    | JPMORGAN CHASE & CO            | 各種金融                   | 433,987   | 4,612.59  | 2,001,805,060  | 3,730.02  | 1,618,780,623  | 0.51    |
| 27 | スイス     | ROCHE HLDGS AG GENUSSCHINE     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 88,297    | 20,451.19 | 1,805,779,539  | 18,287.44 | 1,614,726,442  | 0.51    |
| 28 | アメリカ    | PFIZER                         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 858,386   | 2,382.87  | 2,045,428,945  | 1,838.93  | 1,578,518,290  | 0.50    |
| 29 | イギリス    | RIO TINTO PLC                  | 素材                     | 125,390   | 11,547.55 | 1,447,948,243  | 12,407.61 | 1,555,790,280  | 0.49    |
| 30 | スペイン    | BANCO SANTANDER SA             | 銀行                     | 786,034   | 1,958.18  | 1,539,202,593  | 1,964.73  | 1,544,351,104  | 0.49    |
| 合計 |         |                                |                        |           |           | 66,042,822,098 |           | 66,553,933,433 | 21.12   |

(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。

(注) 種類は全て株式です。

B. 種類別及び業種別の投資比率

| 種類            | 業種                     | 投資比率 (%) |
|---------------|------------------------|----------|
| 株式            | エネルギー                  | 14.00    |
|               | 銀行                     | 8.68     |
|               | 素材                     | 8.43     |
|               | 資本財                    | 7.52     |
|               | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 6.37     |
|               | 食品・飲料・タバコ              | 5.24     |
|               | 公益事業                   | 4.99     |
|               | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 4.90     |
|               | 各種金融                   | 4.82     |
|               | 保険                     | 4.42     |
|               | 電気通信サービス               | 4.35     |
|               | ソフトウェア・サービス            | 3.74     |
|               | メディア                   | 2.43     |
|               | ヘルスケア機器・サービス           | 2.23     |
|               | 食品・生活必需品小売り            | 2.21     |
|               | 小売                     | 1.92     |
|               | 運輸                     | 1.63     |
|               | 家庭用品・パーソナル用品           | 1.50     |
|               | 半導体・半導体製造装置            | 1.42     |
|               | 自動車・自動車部品              | 1.15     |
|               | 耐久消費財・アパレル             | 1.14     |
|               | 消費者サービス                | 1.07     |
|               | 商業サービス・用品              | 0.73     |
| 不動産           | 0.59                   |          |
|               | 小計                     | 95.49    |
| 投資信託受益証券、投資証券 |                        | 1.58     |
| 合計            |                        | 97.07    |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 取引名          | 国/地域 | 資産名           | 種類 | 数量<br>(枚) | 簿価金額<br>(円)   | 評価金額<br>(円)   | 投資比率<br>(%) |
|--------------|------|---------------|----|-----------|---------------|---------------|-------------|
| 株価指数<br>先物取引 | アメリカ | S&P 500 FUTU  | 買建 | 167       | 5,846,096,872 | 5,687,084,800 | 1.80        |
|              | ドイツ  | DJ EURO STOXX | 買建 | 360       | 2,099,648,089 | 2,038,420,188 | 0.65        |
|              | イギリス | FTSE 100 IDX  | 買建 | 106       | 1,279,702,323 | 1,248,692,322 | 0.40        |

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

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

## (中央三井外国債券マザーファンド)

## 投資有価証券の主要銘柄

## A. 主要銘柄の明細

| 順位 | 国/<br>地域 | 銘柄名                | 利率<br>(%) | 償還日        | 額面金額       | 簿価(円)  |                 | 評価額(円) |                 | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----------|--------------------|-----------|------------|------------|--------|-----------------|--------|-----------------|-----------------|
|    |          |                    |           |            |            | 単価     | 金額              | 単価     | 金額              |                 |
| 1  | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 4.000     | 2010/3/15  | 66,390,000 | 11,087 | 7,360,528,111   | 10,909 | 7,242,406,400   | 1.40            |
| 2  | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 3.500     | 2009/11/15 | 60,000,000 | 10,930 | 6,557,799,937   | 10,807 | 6,483,971,062   | 1.25            |
| 3  | フランス     | FRANCE O.A.T.      | 4.000     | 2009/10/25 | 33,670,000 | 16,973 | 5,714,940,177   | 16,674 | 5,614,211,456   | 1.08            |
| 4  | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 6.000     | 2009/8/15  | 48,120,000 | 11,285 | 5,430,234,596   | 11,062 | 5,322,967,132   | 1.03            |
| 5  | ドイツ      | DEUTSCHLAND<br>REP | 3.750     | 2015/1/4   | 29,060,000 | 16,940 | 4,922,698,702   | 16,143 | 4,691,191,689   | 0.91            |
| 6  | フランス     | FRANCE O.A.T.      | 5.500     | 2010/10/25 | 26,650,000 | 17,708 | 4,719,143,410   | 17,145 | 4,569,094,716   | 0.88            |
| 7  | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 6.500     | 2010/2/15  | 40,000,000 | 11,591 | 4,636,253,833   | 11,321 | 4,528,503,583   | 0.87            |
| 8  | イタリア     | BTPS               | 4.250     | 2009/11/1  | 25,210,000 | 17,041 | 4,295,939,621   | 16,725 | 4,216,495,033   | 0.81            |
| 9  | ドイツ      | DEUTSCHLAND<br>REP | 4.500     | 2009/7/4   | 23,700,000 | 17,049 | 4,040,617,929   | 16,790 | 3,979,275,741   | 0.77            |
| 10 | ドイツ      | DEUTSCHLAND<br>REP | 5.000     | 2011/7/4   | 23,200,000 | 17,691 | 4,104,323,182   | 17,066 | 3,959,272,049   | 0.76            |
| 11 | イタリア     | BTPS               | 2.750     | 2010/6/15  | 23,110,000 | 16,538 | 3,821,952,136   | 16,198 | 3,743,299,158   | 0.72            |
| 12 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 3.625     | 2010/6/15  | 33,680,000 | 10,918 | 3,677,073,730   | 10,852 | 3,654,790,041   | 0.71            |
| 13 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 4.625     | 2011/8/31  | 31,700,000 | 11,475 | 3,637,596,892   | 11,149 | 3,534,283,026   | 0.68            |
| 14 | イタリア     | BTPS               | 5.250     | 2011/8/1   | 20,670,000 | 17,710 | 3,660,561,070   | 16,994 | 3,512,568,376   | 0.68            |
| 15 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 4.750     | 2014/5/15  | 29,400,000 | 11,700 | 3,439,667,332   | 11,395 | 3,350,204,694   | 0.65            |
| 16 | フランス     | FRANCE O.A.T.      | 3.750     | 2017/4/25  | 21,240,000 | 16,488 | 3,501,968,369   | 15,718 | 3,338,483,319   | 0.64            |
| 17 | ドイツ      | DEUTSCHLAND<br>REP | 5.000     | 2012/1/4   | 18,700,000 | 17,753 | 3,319,854,776   | 17,081 | 3,194,138,416   | 0.62            |
| 18 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 6.125     | 2027/11/15 | 25,100,000 | 13,108 | 3,290,095,684   | 12,721 | 3,192,849,421   | 0.62            |
| 19 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 5.125     | 2016/5/15  | 27,000,000 | 11,899 | 3,212,753,287   | 11,606 | 3,133,736,437   | 0.60            |
| 20 | イギリス     | TREASURY           | 5.000     | 2025/3/7   | 14,380,000 | 22,549 | 3,242,549,334   | 21,118 | 3,036,798,238   | 0.59            |
| 21 | ドイツ      | DEUTSCHLAND<br>REP | 5.000     | 2012/7/4   | 17,500,000 | 17,881 | 3,129,169,277   | 17,093 | 2,991,225,825   | 0.58            |
| 22 | ドイツ      | BUNDESUBL-147      | 2.500     | 2010/10/8  | 18,410,000 | 16,464 | 3,031,047,658   | 16,131 | 2,969,783,118   | 0.57            |
| 23 | ドイツ      | DEUTSCHLAND<br>REP | 6.000     | 2016/6/20  | 16,050,000 | 19,420 | 3,116,988,404   | 18,442 | 2,959,992,536   | 0.57            |
| 24 | フランス     | FRANCE O.A.T.      | 3.500     | 2015/4/25  | 18,740,000 | 16,528 | 3,097,347,912   | 15,738 | 2,949,315,217   | 0.57            |
| 25 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 5.000     | 2011/2/15  | 25,960,000 | 11,537 | 2,994,899,575   | 11,232 | 2,915,904,674   | 0.56            |
| 26 | フランス     | BTAN-5YR<br>ISSUE  | 3.500     | 2011/7/12  | 17,640,000 | 16,770 | 2,958,214,860   | 16,306 | 2,876,405,106   | 0.56            |
| 27 | イタリア     | BTPS               | 6.500     | 2027/11/1  | 14,850,000 | 20,795 | 3,088,102,213   | 19,160 | 2,845,257,030   | 0.55            |
| 28 | ドイツ      | BUNDESUBL-145      | 3.500     | 2009/10/9  | 17,060,000 | 16,852 | 2,875,015,840   | 16,599 | 2,831,719,999   | 0.55            |
| 29 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 4.500     | 2012/4/30  | 25,370,000 | 11,475 | 2,911,225,020   | 11,147 | 2,827,908,566   | 0.55            |
| 30 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 4.500     | 2017/5/15  | 25,530,000 | 11,015 | 2,812,206,448   | 11,076 | 2,827,701,283   | 0.55            |
| 合計 |          |                    |           |            |            |        | 116,600,769,315 |        | 113,293,753,341 | 21.86           |



(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。

(注) 種類は全て国債証券です。

B. 種類別の投資比率

| 種類   | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 国債証券 | 96.91    |
| 特殊債券 | 0.48     |
| 合計   | 97.38    |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 取引名    | 国/地域 | 資産名          | 種類 | 数量<br>(枚) | 簿価金額<br>(円) | 評価金額<br>(円) | 投資比率<br>(%) |
|--------|------|--------------|----|-----------|-------------|-------------|-------------|
| 債券先物取引 | アメリカ | US 5YR NOTE  | 買建 | 17        | 198,100,661 | 199,796,898 | 0.04        |
| 債券先物取引 | アメリカ | US 10YR NOTE | 買建 | 12        | 143,837,366 | 145,363,075 | 0.03        |
| 債券先物取引 | アメリカ | US LONG BOND | 買建 | 13        | 157,311,615 | 160,005,795 | 0.03        |
| 債券先物取引 | ドイツ  | EURO-SCHATZ  | 買建 | 19        | 326,864,384 | 327,619,691 | 0.06        |
| 債券先物取引 | ドイツ  | EURO-BOBL FU | 買建 | 23        | 408,907,082 | 411,474,856 | 0.08        |
| 債券先物取引 | ドイツ  | EURO-BUND FU | 買建 | 43        | 798,005,099 | 804,872,103 | 0.16        |

(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。

## 運用実績

### 純資産の推移

|                       | 純資産総額（円）      | 1万口当たりの<br>基準価額（円） |
|-----------------------|---------------|--------------------|
| 第1期計算期間（平成20年6月10日現在） | 1,309,148,844 | 9,162              |
| 平成19年10月末日            | 475,027,190   | 10,000             |
| 平成19年11月末日            | 1,052,901,215 | 9,646              |
| 平成19年12月末日            | 1,258,075,321 | 9,691              |
| 平成20年1月末日             | 1,238,933,032 | 9,014              |
| 平成20年2月末日             | 1,287,107,382 | 9,008              |
| 平成20年3月末日             | 1,240,301,541 | 8,642              |
| 平成20年4月末日             | 1,292,745,453 | 9,091              |
| 平成20年5月末日             | 1,314,509,267 | 9,224              |
| 平成20年6月末日             | 1,254,298,114 | 8,962              |

（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           |

### 収益率の推移

|         | 収益率  |
|---------|------|
| 第1期計算期間 | 8.4% |

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

## 財務ハイライト情報（原交付目論見書32頁を以下の情報に更新します。）

（1）当ファンドの財務ハイライト情報は、有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報」の「第4 ファンドの経理状況」の「財務諸表」に記載している「（1）貸借対照表」、「（2）損益及び剰余金計算書」及び「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5の規定により注記される事項を抜粋して記載しております。

なお、財務ハイライト情報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19年10月31日から平成20年6月10日まで）の財務諸表について、監査法人トーマツによる監査を受けております。

その監査報告書は、有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報」の「第4 ファンドの経理状況」の「財務諸表」の該当箇所に添付しております。

## 新生・4分散ファンド

### 1 貸借対照表

| 項目        | 第 1 期<br>(平成20年6月10日現在)<br>金額(円) |
|-----------|----------------------------------|
| 資産の部      |                                  |
| 流動資産      |                                  |
| 親投資信託受益証券 | 1,310,601,775                    |
| 未収入金      | 368,023                          |
| 流動資産合計    | 1,310,969,798                    |
| 資産合計      | 1,310,969,798                    |
| 負債の部      |                                  |
| 流動負債      |                                  |
| 未払解約金     | 368,023                          |
| 未払受託者報酬   | 92,251                           |
| 未払委託者報酬   | 1,353,007                        |
| その他未払費用   | 7,673                            |
| 流動負債合計    | 1,820,954                        |
| 負債合計      | 1,820,954                        |
| 純資産の部     |                                  |
| 元本等       |                                  |
| 元本        | 1,428,855,625                    |
| 剰余金       |                                  |
| 期末欠損金     | 119,706,781                      |
| 純資産合計     | 1,309,148,844                    |
| 負債・純資産合計  | 1,310,969,798                    |

## 2 損益及び剰余金計算書

| 項目                  | 第 1 期                                     |
|---------------------|---|
|                     | 自 平成19年10月31日<br>至 平成20年 6 月10日<br>金額 (円) |
| 営業収益                |   |
| 受取利息                | 9,018                                     |
| 有価証券売買等損益           | 70,740,920                                |
| 営業収益合計              | 70,731,902                                |
| 営業費用                |   |
| 受託者報酬               | 452,588                                   |
| 委託者報酬               | 6,637,859                                 |
| その他費用               | 37,647                                    |
| 営業費用合計              | 7,128,094                                 |
| 営業損失金額              | 77,859,996                                |
| 経常損失金額              | 77,859,996                                |
| 当期純損失金額             | 77,859,996                                |
| 一部解約に伴う当期純損失金額分配額   | 6,096,305                                 |
| 剰余金増加額              | 2,532,536                                 |
| ( 当期一部解約に伴う剰余金増加額 ) | ( 2,532,536 )                             |
| 剰余金減少額              | 50,475,626                                |
| ( 当期追加信託に伴う剰余金減少額 ) | ( 50,475,626 )                            |
| 期末欠損金               | 119,706,781                               |

### ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

|                     | 第 1 期  |
|---------------------|--|
|                     | 自 平成19年10月31日<br>至 平成20年 6 月10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<br>移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、基準価額で評価しております。  |
| 2 . その他             | ファンドの計算期間<br>当ファンドの計算期間は、原則として、毎年 6 月11日から翌年 6 月10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19年10月31日から平成20年 6 月10日までとなっております。 |

<参考>

「新生・4分散ファンド」は、「中央三井日本株式マザーファンド」、「中央三井日本債券マザーファンド」、「中央三井外国株式マザーファンド」及び「中央三井外国債券マザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。

各マザーファンドの平成20年6月10日現在（以下、「計算日」といいます。）の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

「中央三井日本株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 項目       | 平成20年6月10日現在<br>金額(円) |
|----------|-----------------------|
| 資産の部     |                       |
| 流動資産     |                       |
| コール・ローン  | 6,835,827,182         |
| 株式       | 279,559,217,474       |
| 派生商品評価勘定 | 663,837,650           |
| 未収配当金    | 2,015,078,461         |
| 未収利息     | 93,227                |
| 流動資産合計   | 289,074,053,994       |
| 資産合計     | 289,074,053,994       |
| 負債の部     |                       |
| 流動負債     |                       |
| 派生商品評価勘定 | 1,481,825             |
| 前受金      | 765,020,000           |
| 未払解約金    | 122,505,476           |
| 流動負債合計   | 889,007,301           |
| 負債合計     | 889,007,301           |
| 純資産の部    |                       |
| 元本等      |                       |
| 元本       | 247,569,994,601       |
| 剰余金      |                       |
| 剰余金      | 40,615,052,092        |
| 純資産合計    | 288,185,046,693       |
| 負債・純資産合計 | 289,074,053,994       |

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                      | 平成20年6月10日現在  |
|----------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法   | 株式<br>移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。  |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 株価指数先物取引<br>個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。<br><br>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<br>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。<br><br>(2) 派生商品取引等損益の計上基準<br>約定日基準で計上しております。 |

「中央三井日本債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 項目       | 平成20年6月10日現在<br>金額(円) |
|----------|-----------------------|
| 資産の部     |                       |
| 流動資産     |                       |
| コール・ローン  | 3,801,781,900         |
| 国債証券     | 183,171,994,400       |
| 地方債証券    | 15,393,297,119        |
| 特殊債証券    | 28,284,319,816        |
| 社債証券     | 21,987,049,740        |
| 未収利息     | 1,039,423,415         |
| 前払費用     | 108,121,766           |
| 流動資産合計   | 253,785,988,156       |
| 資産合計     | 253,785,988,156       |
| 負債の部     |                       |
| 流動負債     |                       |
| 派生商品評価勘定 | 1,286,460             |
| 前受金      | 13,300,000            |
| 未払金      | 8,172,920             |
| 未払解約金    | 91,122,123            |
| 流動負債合計   | 113,881,503           |
| 負債合計     | 113,881,503           |
| 純資産の部    |                       |
| 元本等      |                       |
| 元本       | 234,283,534,118       |
| 剰余金      |                       |
| 剰余金      | 19,388,572,535        |
| 純資産合計    | 253,672,106,653       |
| 負債・純資産合計 | 253,785,988,156       |

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                      | 平成20年6月10日現在  |
|----------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法   | 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券<br>移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。<br>ただし、買付後の最初の利払いまでは個別法によっております。 |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 国債先物取引<br>個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。<br>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。          |
| 3. 収益及び費用の計上基準       | 派生商品取引等損益の計上基準<br>約定日基準で計上しております。   |



「中央三井外国株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 項目       | 平成20年6月10日現在<br>金額(円) |
|----------|-----------------------|
| 資産の部     |                       |
| 流動資産     |                       |
| 預金       | 7,664,263,917         |
| コール・ローン  | 1,510,696,883         |
| 株式       | 312,782,031,860       |
| 投資信託受益証券 | 79,414,497            |
| 投資証券     | 5,141,958,376         |
| 派生商品評価勘定 | 58,251,098            |
| 未収配当金    | 777,757,319           |
| 未収利息     | 20,603                |
| 差入委託証拠金  | 2,246,191,337         |
| 流動資産合計   | 330,260,585,890       |
| 資産合計     | 330,260,585,890       |
| 負債の部     |                       |
| 流動負債     |                       |
| 派生商品評価勘定 | 319,214,250           |
| 未払解約金    | 67,436,263            |
| 流動負債合計   | 386,650,513           |
| 負債合計     | 386,650,513           |
| 純資産の部    |                       |
| 元本等      |                       |
| 元本       | 240,232,205,493       |
| 剰余金      |                       |
| 剰余金      | 89,641,729,884        |
| 純資産合計    | 329,873,935,377       |
| 負債・純資産合計 | 330,260,585,890       |

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                        | 平成20年6月10日現在   |
|------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | 株式、投資信託受益証券及び投資証券<br>移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。  |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法   | (1) 株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。<br>(2) 為替予約取引<br>個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。<br><br>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。 |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。   |
| 4. 収益及び費用の計上基準         | (1) 受取配当金<br>原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。<br>(2) 派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準<br>約定日基準で計上しております。  |
| 5. その他                 | 外貨建資産等の会計処理<br>外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。  |

「中央三井外国債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 項目       | 平成20年6月10日現在<br>金額(円) |
|----------|-----------------------|
| 資産の部     |                       |
| 流動資産     |                       |
| 預金       | 837,045,184           |
| コール・ローン  | 3,545,931,979         |
| 国債証券     | 500,944,803,218       |
| 特殊債券     | 2,433,899,033         |
| 派生商品評価勘定 | 226,225,350           |
| 未収利息     | 8,096,043,931         |
| 前払費用     | 712,023,325           |
| 差入委託証拠金  | 238,593,439           |
| 流動資産合計   | 517,034,565,459       |
| 資産合計     | 517,034,565,459       |
| 負債の部     |                       |
| 流動負債     |                       |
| 派生商品評価勘定 | 107,456,937           |
| 未払解約金    | 188,439,885           |
| 流動負債合計   | 295,896,822           |
| 負債合計     | 295,896,822           |
| 純資産の部    |                       |
| 元本等      |                       |
| 元本       | 283,562,076,317       |
| 剰余金      |                       |
| 剰余金      | 233,176,592,320       |
| 純資産合計    | 516,738,668,637       |
| 負債・純資産合計 | 517,034,565,459       |

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                        | 平成20年6月10日現在   |
|------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | 国債証券及び特殊債券<br>移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。<br>ただし、買付後の最初の利払いまでは個別法によっております。  |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法   | (1) 国債先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。<br>(2) 為替予約取引<br>個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。<br><br>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。 |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。   |
| 4. 収益及び費用の計上基準         | 派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準<br>約定日基準で計上しております。  |
| 5. その他                 | 外貨建資産等の会計処理<br>外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。  |

## その他の情報

### ファンドの詳細情報の項目(原交付目論見書34頁)

(前略)

#### 第4 ファンドの経理状況

##### 1 財務諸表

##### (1) 貸借対照表

##### (2) 損益及び剰余金計算書

##### (3) 注記表

##### (4) 附属明細表

##### 2 ファンドの現況

##### 純資産額計算書

#### 第5 設定及び解約の実績

原交付目論見書の添付資料である約款の記載内容に次のとおり変更があります。

## 中央三井外国株式マザーファンド 約款

### 運用の基本方針

約款第14条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

(中略)

#### 2. 運用方法

(中略)

#### (2) 投資態度

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

(後略)

# 新生・4分散ファンド

追加型株式投資信託 / バランス型

投資信託説明書  
( 交付目論見書 )  
2007年10月

中央三井アセットマネジメント株式会社

本情報は金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

新生・4分散ファンドは、実質的に国内外の株式や公社債を主要投資対象としています。組入れた有価証券の値動き、為替相場の変動等の影響や組入れた有価証券の発行体の経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化等により、ファンドの基準価額も変動し、これにより投資元本を割り込むことがあります。

従って、当ファンドは元本保証のある商品ではありません。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資家の皆様に帰属します。

ご投資家の皆様におかれましては、当投資信託説明書（交付目論見書）本文をよくお読みいただき、商品の内容・リスクを十分ご理解のうえ、お申込みいただきますようお願い申し上げます。

#### 委託会社のお客さま相談窓口

お電話によるお問合せ先

電話番号 03 - 5440 - 0190

受付時間 営業日の午前9時から午後5時まで

（本邦金融商品取引所が半日立会いの場合、午前9時から正午まで）

委託会社のホームページ アドレス <http://www.cmam.co.jp/>

本書「投資信託説明書（交付目論見書）」は、金融商品取引法第15条第2項本文に規定する投資家にあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書です。

この目論見書により行う新生・4分散ファンドの募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条の規定により有価証券届出書を平成19年10月5日に関東財務局長に提出しており、平成19年10月21日に届出の効力が生じております。

金融商品取引法第15条第3項に規定する投資信託説明書（請求目論見書）は、投資家のご請求に基づき販売会社を通じてお渡しします（記載項目等につきましては、本書34ページをご参照ください。）。

なお、販売会社に「投資信託説明書（請求目論見書）」の交付をご請求された場合は、その旨をご自身でも記録しておくようにしてください。

|                     |                    |
|---------------------|--------------------|
| 発行者名                | 中央三井アセットマネジメント株式会社 |
| 本店の所在の場所            | 東京都港区芝三丁目23番1号     |
| 有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所 | 該当事項はありません。        |

下記の事項は、この投資信託(以下「当ファンド」といいます。)をお申込みされるご投資家の皆様にあらかじめ、ご確認いただきたい重要な事項としてお知らせするものです。

お申込みの際には、下記の事項及び投資信託説明書(交付目論見書)の内容をよくお読みください。

## 記

### 当ファンドに係るリスクについて

当ファンドは、主に国内外の株式や公社債を実質的な投資対象としますので、組入れた有価証券の価格の下落や、組入れた有価証券の発行会社の倒産や財務状況の悪化等の影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産にも投資するため、円と投資対象通貨の為替レートの変動により損失を被ることがあります。従って、ご投資家の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資家の皆様に帰属します。

当ファンドの基準価額の変動要因としては、主に「株価変動リスク」、「金利変動リスク」、「信用リスク」、「流動性リスク」、「カントリーリスク」、「為替変動リスク」などがあります。

詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)の「投資リスク」をご覧ください。

### 当ファンドに係る手数料等について

#### 申込手数料

お申込受付日の翌営業日の基準価額(当初申込期間中は1口当たり1円)に3.15%(税抜3.0%)以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳しくは販売会社もしくは申込手数料を記載した書面にてご確認ください。

#### 換金(解約)手数料

当ファンドには換金(解約)手数料はありません。

#### 信託報酬

ファンドの純資産総額に年0.987%(税抜年0.94%)の率を乗じて得た額とします。

#### 信託財産留保額

ご解約受付日の翌営業日の基準価額に0.15%の率を乗じて得た金額とします。

#### その他の費用(\*)

- ・組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料
- ・監査費用
- ・外貨建資産の保管等に要する費用 等

詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)の「手数料等及び税金」をご覧ください。

(\*)「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

当該手数料等の合計額については、ご投資家の皆様が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。



## 投資信託説明書（交付目論見書） 目次

|         |   |       |    |
|---------|---|-------|----|
| ファンドの概要 | <div style="border: 1px solid black; padding: 2px;">ファンドの基本情報</div> | ..... | 1  |
|         | ファンドの基本情報   | ..... | 1  |
|         | その他のファンド情報  | ..... | 3  |
| ファンドの特徴 | <div style="border: 1px solid black; padding: 2px;">ファンドの性格</div>   | ..... | 4  |
|         | ファンドの目的及び基本的性格  | ..... | 4  |
|         | ファンドの特色   | ..... | 4  |
|         | ファンドの仕組み  | ..... | 5  |
|         | <div style="border: 1px solid black; padding: 2px;">投資方針</div>      | ..... | 7  |
|         | 投資方針  | ..... | 7  |
|         | 投資対象  | ..... | 7  |
|         | 運用体制  | ..... | 8  |
|         | 分配方針  | ..... | 9  |
|         | 投資制限  | ..... | 9  |
| 投資リスク   | <div style="border: 1px solid black; padding: 2px;">ファンドのリスク</div>  | ..... | 12 |
| 投資の手引き  | <div style="border: 1px solid black; padding: 2px;">手続等の概要</div>    | ..... | 14 |
|         | 申込み（販売）手続等  | ..... | 14 |
|         | 換金（解約）手続等   | ..... | 15 |
|         | <div style="border: 1px solid black; padding: 2px;">手数料等及び税金</div>  | ..... | 16 |
|         | 申込手数料・解約手数料等  | ..... | 16 |
|         | 収益分配時・一部解約時・償還時などの税金等   | ..... | 17 |
|         | 信託報酬等   | ..... | 18 |
|         | その他の手数料等  | ..... | 18 |
|         | 課税上の取扱い   | ..... | 19 |
|         | <div style="border: 1px solid black; padding: 2px;">管理及び運営の概要</div> | ..... | 20 |
| 運用の状況   | <div style="border: 1px solid black; padding: 2px;">運用状況</div>      | ..... | 23 |
|         | 投資状況  | ..... | 23 |
|         | 投資資産  | ..... | 23 |
|         | 運用実績  | ..... | 23 |
|         | <div style="border: 1px solid black; padding: 2px;">財務ハイライト情報</div> | ..... | 32 |
| その他の情報  | 内国投資信託受益証券事務の概要   | ..... | 33 |
|         | ファンドの詳細情報の項目  | ..... | 34 |
| 約款      |   |       |    |
| 用語解説    |   |       |    |

## ファンドの基本情報

### ファンドの基本情報

|         |  |
|---------|--|
| ファンドの名称 | 新生・4分散ファンド   |
| 基本的性格   | 追加型株式投資信託/バランス型  |
| ファンドの目的 | 当ファンドは、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。   |
| 主な投資対象  | 中央三井日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンド及び中央三井外国債券マザーファンドの各受益証券を主要投資対象とします。 |
| ベンチマーク  | ありません。   |
| 投資方針    | 詳細につきましては「投資方針」(7ページ)をご参照ください。   |
| 主な投資制限  | 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。<br>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。          |
| 収益分配    | 毎決算時に原則として約款に定める収益分配方針に基づき分配を行います。   |

### ファンドの保有に伴いご負担いただく費用等(ファンドの費用に関する情報)

|           |  |
|-----------|--|
| 申込手数料     | <p>お申込価額(注1)、お申込金額(注2)、お申込口数等に応じて、3.15%(税抜3.0%)の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を「お申込受付日の翌営業日の基準価額(当初申込期間中は1口当たり1円)×取得口数」に乗じて得た額とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。</p> <p>(注1) お申込受付日の翌営業日の基準価額(当初申込期間中は1口当たり1円)に取得口数を乗じて得た額をいいます。</p> <p>(注2) お申込価額に申込手数料及び申込手数料に係る消費税等相当額を加えた総額をいいます。</p> <p>「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。</p> <p>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。(「償還乗換え優遇制度」)詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。</p> |
| 解約手数料     | ありません。   |
| 信託財産留保額   | ご解約受付日の翌営業日の基準価額に0.15%の率を乗じて得た金額とします。  |
| 課税上の取扱い   | 詳細につきましては「課税上の取扱い」(19ページ)をご参照ください。   |
| 信託報酬      | 純資産総額に対し年0.987%(税抜年0.94%)  |
| ファンドの監査費用 | 受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。   |
| その他の費用    | 詳細につきましては「その他の手数料等」(18ページ)をご参照ください。  |

その他の基本情報

|          |   |
|----------|---|
| 信託期間     | 平成19年10月31日から無期限（ただし、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合等には、信託を終了させることがあります。）   |
| 決算日      | 毎年6月10日（休業日の場合は翌営業日）  |
| 発行価額の総額  | 当初募集額 上限 300億円<br>継続募集額 上限 10兆円   |
| 申込期間     | 当初申込期間<br>平成19年10月22日から平成19年10月30日までの間、原則として毎営業日お申込みいただけます。<br>継続申込期間<br>平成19年10月31日から平成20年9月10日までの間、原則として毎営業日お申込みいただけます。<br>（なお、継続申込期間は、継続申込期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。） |
| 申込単位     | 販売会社が定める単位とします。<br>詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。<br>（「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は1口単位）  |
| 申込受付時間   | 営業日の午後3時まで（本邦金融商品取引所が半日立会いの場合は午前11時まで）<br>この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。   |
| 発行価格     | 当初申込期間：1口当たり1円です。<br>継続申込期間：取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。<br>（「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は、各計算期間終了日の基準価額）   |
| 申込代金の支払い | 販売会社が定める期日までにお支払いください。  |
| 一部解約の受付  | 原則として、毎営業日一部解約の受付をいたします。  |
| 解約単位     | 1口単位  |
| 解約受付時間   | 営業日の午後3時まで（本邦金融商品取引所が半日立会いの場合は午前11時まで）<br>この時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。   |
| 解約価額     | ご解約受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を控除した価額とします。   |
| 解約代金の支払い | 原則としてご解約受付日から起算して5営業日目から。   |

当投資信託説明書（交付目論見書）中で用いている専門的な用語については、巻末に「用語解説」を設けてありますので、併せてご参照ください。

申込取扱場所及び払込取扱場所

販売会社でお取り扱いしております。

販売会社につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

|                    |   |
|--------------------|---|
| 中央三井アセットマネジメント株式会社 |   |
| お客様相談窓口            | 電話番号 03-5440-0190   |
|                    | <受付時間> 営業日の午前9時から午後5時まで<br>(本邦金融商品取引所が半日立会いの場合、午前9時から正午まで)  |
| ホームページ             | <a href="http://www.cmam.co.jp/">http://www.cmam.co.jp/</a> |

その他のファンド情報

|   |   |
|---|---|
| <p>内国投資信託受益証券の形態等</p>                             | <p>契約型の追加型証券投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。<br/>         1口当たりの元本は1円です。<br/>         格付は取得していません。<br/>         当ファンドの受益権は、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。</p> |
| <p>発行価額の総額の払込み</p>                                | <p>当初申込みに係る発行価額の総額は、設定日（平成19年10月31日）に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社である中央三井アセット信託銀行株式会社の指定する当ファンド口座に払い込まれます。<br/>         継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定する当ファンド口座に払い込まれます。</p>  |
| <p>申込証拠金</p>                                      | <p>該当事項はありません。</p>  |
| <p>日本以外の地域における発行</p>                              | <p>該当事項はありません。</p>  |
| <p>振替機関に関する事項</p>                                 | <p>振替機関は下記のとおりです。<br/>         株式会社証券保管振替機構</p>   |
| <p>振替受益権について</p>                                  | <p>当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。<br/>         当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。<br/>         （後記「その他の情報」（33ページ）もあわせてご参照ください。）</p>   |
| <p>有価証券届出書の写しの縦覧場所<br/>         （訂正届出書を含みます。）</p> | <p>該当事項はありません。</p>  |

## ファンドの性格

### ファンドの目的及び基本的性格

|         |  |
|---------|--|
| ファンドの目的 | 当ファンドは、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。   |
| 基本的性格   | 当ファンドは、委託会社である中央三井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、中央三井アセット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証券投資信託で、追加型株式投資信託・バランス型( )に属します。 |
| 信託金限度額  | 上限 1兆円   |

「バランス型」とは、社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、「約款上の株式組入限度70%未満のファンドで、株式・公社債等のバランス運用、あるいは、公社債中心の運用を行うもの。」として分類されるファンドをいいます。

### ファンドの特色

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行い、中央三井日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンド及び中央三井外国債券マザーファンド(以下これらを「マザーファンド」又は「親投資信託」という場合があります。)の各受益証券への投資を通じて、国内外の株式及び公社債へ分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。

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

中央三井日本株式マザーファンド：「TOPIX」(東証株価指数)

中央三井日本債券マザーファンド：「NOMURA - BPI総合」

中央三井外国株式マザーファンド：「モルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル・コクサイ指数(MSCIコクサイ指数)(円ベース)」

中央三井外国債券マザーファンド：「シティグループ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」

「TOPIX」(東証株価指数)について

TOPIXの指数値及びTOPIX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TOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東証が有しています。東証は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。東証は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

NOMURA - BPI総合について

野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。この指数は野村證券株式会社の知的財産であり、野村證券株式会社は、中央三

井日本債券マザーファンドの運用成果に関し、一切責任はありません。

MSCIコクサイ指数について

MSCI（モルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル）が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権及びその他の一切の権利はMSCIに帰属します。また、MSCIは同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

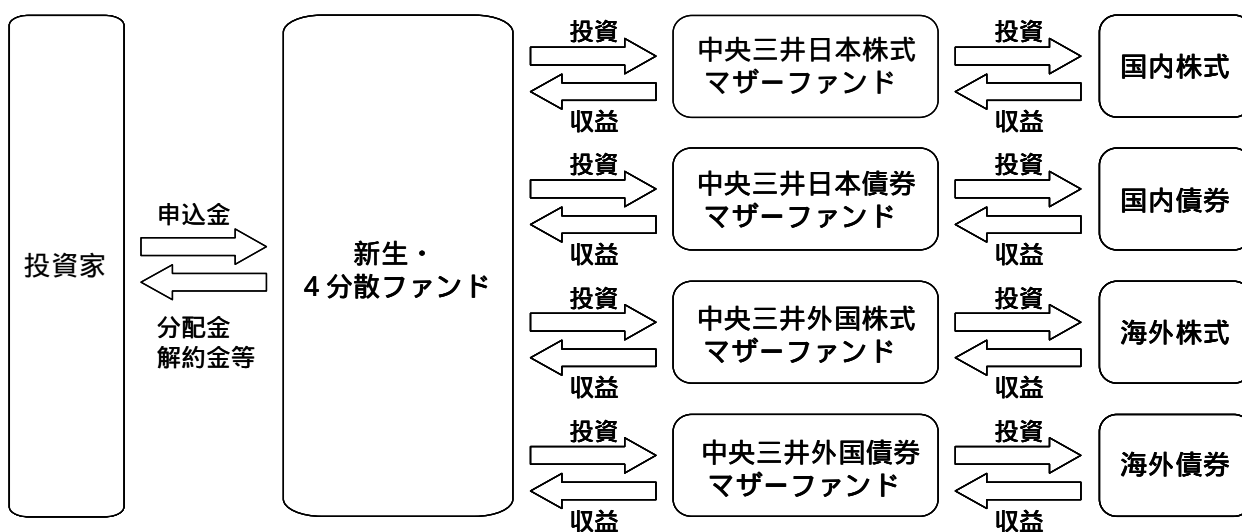
シティグループ世界国債インデックスについて

シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

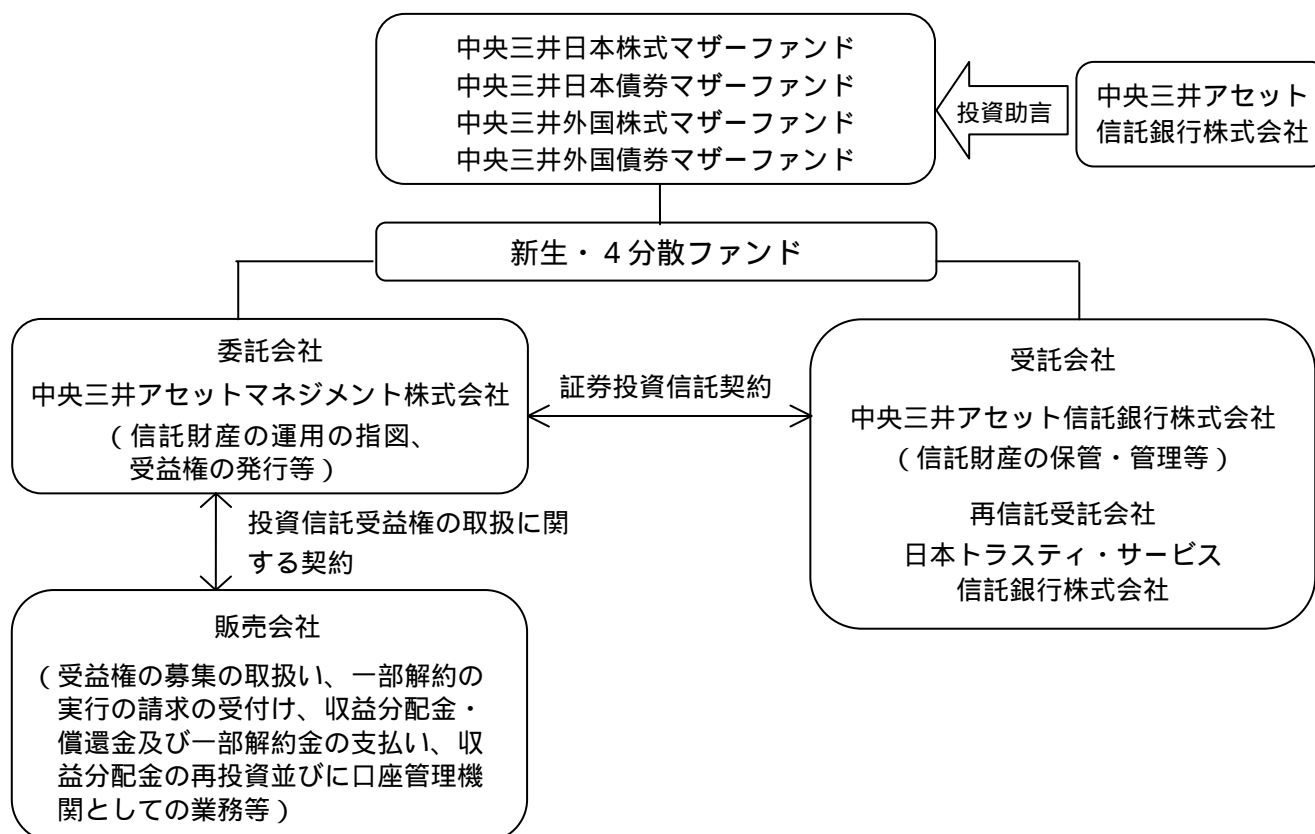
## ファンドの仕組み

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（新生・4分散ファンド）とし、その資金をマザーファンド（中央三井日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンド及び中央三井外国債券マザーファンド）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



委託会社と関係法人との契約の概要

|                                     |   |
|-------------------------------------|---|
| 委託会社と受託会社との契約<br>「証券投資信託契約」         | 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。<br>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締結されます。 |
| 委託会社と販売会社との契約<br>「投資信託受益権の取扱に関する契約」 | 販売会社の受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資並びに口座管理機関としての業務等に係る事務の内容等が定められています。                               |

< 委託会社の概況 >

1. 資本金の額：3億円（平成19年10月5日現在）

2. 委託会社の沿革

昭和61年9月：三信投資顧問株式会社（三井信託銀行グループの投資顧問会社）として設立

昭和62年2月：投資顧問業法に基づく登録

昭和62年9月：投資一任業務の認可取得

平成11年7月：中信投資顧問株式会社（中央信託銀行グループの投資顧問会社）と合併し「中央三井アセットマネジメント株式会社」に社名変更

平成12年3月：証券投資信託委託業務認可取得

3. 大株主の状況（平成19年10月5日現在）

| 株主名                   | 住所             | 持株数    | 持株比率   |
|-----------------------|----------------|--------|--------|
| 中央三井トラスト・ホールディングス株式会社 | 東京都港区芝三丁目33番1号 | 5,050株 | 100.0% |

## 投資方針

### 投資方針

中央三井日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンド及び中央三井外国債券マザーファンドの各受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

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

#### < 投資態度 >

1. 主として、マザーファンド受益証券に投資し、国内外の株式・公社債への分散投資をすることにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。
2. 基本配分比率は国内株式25%、国内債券25%、海外株式25%、海外債券25%とします。
3. 上記の基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設け、一定以上乖離した場合にはリバランスを行います。また、市況動向等の変化に応じて、当該基本配分比率の見直しを行う場合があります。
4. 実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。
5. 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引及び債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式及び債券の組入総額と株価指数先物取引及び債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
6. 株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の75%以下とします。
7. ただし、資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
8. 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、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
9. 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。
10. 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

### 投資対象

中央三井日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンド及び中央三井外国債券マザーファンドの各受益証券を主要投資対象とします。

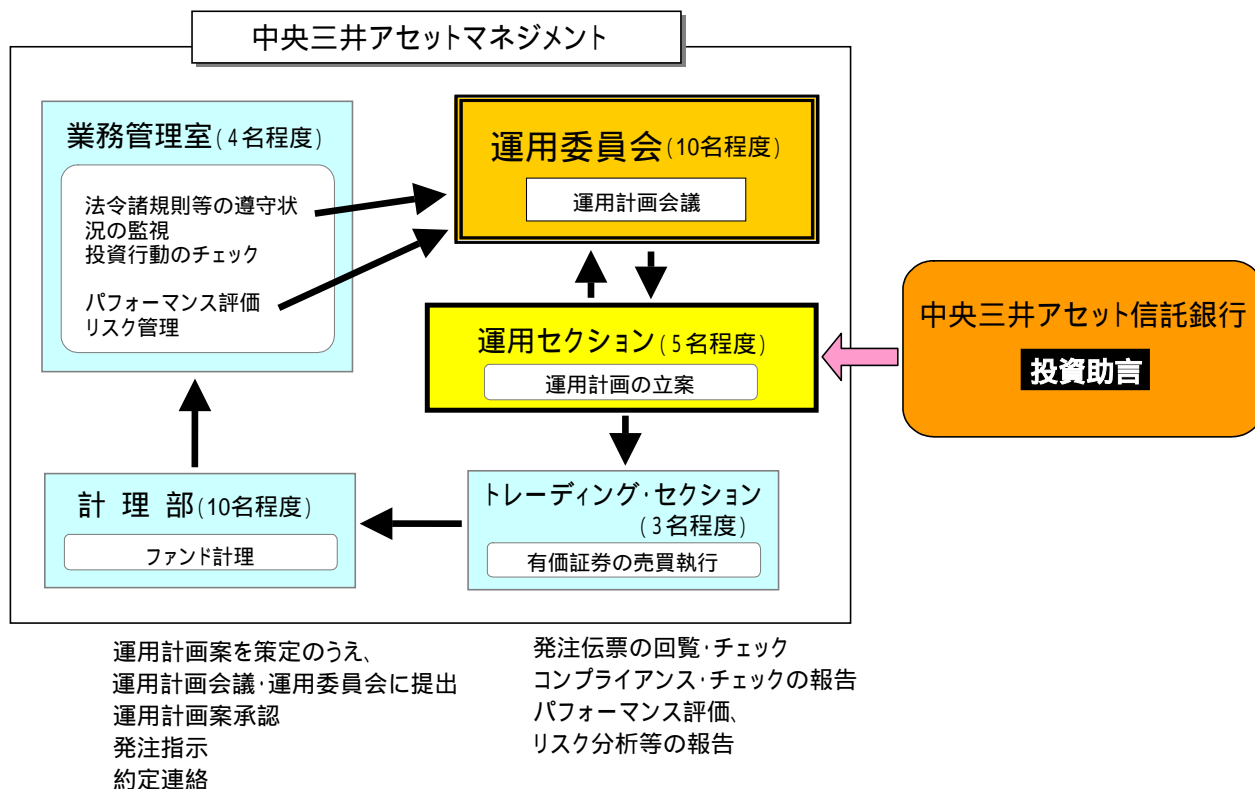
各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の株式・公社債に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。

(当ファンドの投資対象の詳細につきましては、巻末にある当ファンド約款の第15条及び第16条をご参照ください。)

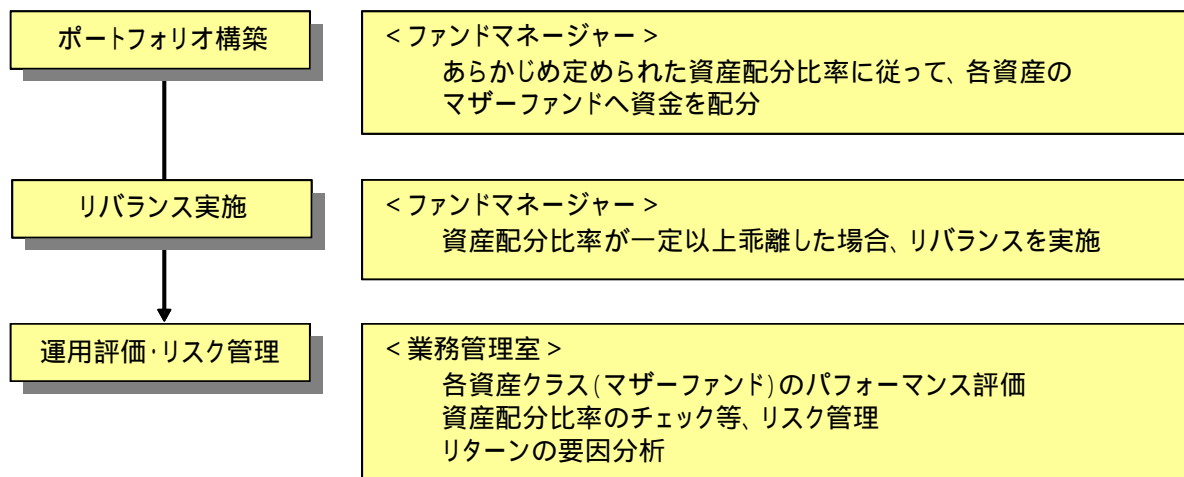


運用体制

当ファンドの運用体制は以下のとおりです。



具体的なポートフォリオ構築プロセスは、以下のとおりです。



上記運用体制における組織名称等は、委託会社の組織変更等により変更となる場合があります。この場合においても、ファンドの基本的な運用方針が変更されるものではありません。

委託会社のファンドの運用に関する社内規定として、信託財産等運用管理規程があり、委託会社がファンドの運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を定めています。また、ファンドの運用におけるリスク管理に関する基本的な事項を定めた社内規定として運用リスク管理規程があります。

委託会社は、ファンドの関係法人である再信託受託会社に対する管理・統制としては、モニタリングの一環として外部監査法人による内部統制監査報告書入手し査閲するなど、“外部業務委託の適切性”に関する定期的確認を基本的枠組として運営しています。

## 分配方針

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

1. 分配対象額は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）及び売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額。）等の全額とします。なお、前期から繰り越された分配準備積立金及び収益調整金、その他の調整金は、全額分配に使用することがあります。
2. 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。
3. 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。（巻末の当ファンドの約款第43条、第44条及び第45条をあわせてご参照ください。）

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。

## 投資制限

### 1. 約款に定める投資制限

|                     |  |
|---------------------|--|
| 株式への投資割合            | 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。  |
| 外貨建資産への投資割合         | 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。   |
| 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。   |
| 同一銘柄の株式への投資割合       | 同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。  |
| 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。   |
| 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。   |
| 投資信託証券への投資割合        | 投資信託証券（マザーファンドを除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。  |
| 投資する株式等の範囲          | 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。<br>上記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。 |

金融商品取引所等とは、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所では有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場では有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。

|                     |  |
|---------------------|--|
| 先物取引等の運用指図          | <p>委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（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。）、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。）及び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。）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。）。</p> <p>委託会社は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。</p> <p>委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。</p> |
| 有価証券の貸付の指図及び範囲      | 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約款第26条の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。  |
| 公社債の借入れの指図及び範囲      | 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認められたときは、担保の提供の指図を行うものとします。  |
| 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限 | 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。  |
| 外国為替予約取引の指図         | 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。   |
| 資金の借入れ              | 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。   |

詳細及びその他の約款上の投資制限については、巻末の当ファンドの約款をご参照ください。

2. 関連法令に基づく投資制限

|   |  |
|---|--|
| <p>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<br/>(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)</p> | <p>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。</p>   |
| <p>同一の法人の発行する株式への投資制限<br/>(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)</p>                                      | <p>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。<br/>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<br/>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</p> |

(参考) マザーファンドの概要

「中央三井日本株式マザーファンド」、「中央三井日本債券マザーファンド」、「中央三井外国株式マザーファンド」及び「中央三井外国債券マザーファンド」の概要

巻末にある当該各ファンドの約款「運用の基本方針」をご参照ください。

## ファンドのリスク

当ファンドは、マザーファンドを通じて主に国内外の株式や公社債を投資対象としています。組入れた株式や公社債の値動きや為替レートの変動等により基準価額が変動しますので、これにより投資元本を割り込むことがあり収益（投資利回り）は未確定です。また、組入れた株式や公社債の発行体の経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化等により、投資元本を割り込むことがあり収益（投資利回り）は未確定です。

当ファンドの主なリスクは以下のとおりです。

|          |   |
|----------|---|
| 株価変動リスク  | 株価変動リスクとは、経済情勢の変化等により株価が変動するリスクをいいます。一般に、企業業績、国内外の景気、経済、社会情勢の変化等の影響を受け、株価が下落（上昇）した場合には基準価額の下落（上昇）要因となります。   |
| 金利変動リスク  | 金利変動リスクとは、金利変動により債券価格が変動するリスクをいいます。一般に、金利が上昇（低下）した場合には債券価格は下落（上昇）し、基準価額の下落（上昇）要因となります。  |
| 信用リスク    | 信用リスクとは、有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払いや償還金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなるリスクをいいます。一般に、信用リスクが顕在化した場合、またはそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。  |
| 流動性リスク   | 流動性リスクとは、短期間に相当金額の解約申込みがあった場合等、当ファンドの保有資産を大量に売却せざるを得ない場合に、市況動向や取引量等の状況により基準価額が大きく変動するリスクをいいます。一般に、売却資産の市場における流動性が低いときには、期待する価格での取引ができないことや、取引に相応の時間を要することがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。   |
| カントリーリスク | カントリーリスクとは、投資対象国・地域において、政治・経済情勢、外国為替規制、資本規制、税制変更等による影響を受けるリスクをいいます。一般に、このようなリスクが顕在化した場合、またはそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。  |
| 為替変動リスク  | 為替変動リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に、投資している国の通貨（ ）が円に対して弱く（円高に）なれば基準価額の下落要因となり、強く（円安に）なれば基準価額の上昇要因となります。<br>米ドル、カナダドル、ユーロ、英ポンド、スイスフラン、スウェーデンクローナ、ノルウェークローネ、デンマーククローネ、ポーランドズロチ、オーストラリアドル、ニュージーランドドル、香港ドル、マレ - シアリングット、シンガポールドル（平成19年8月末現在・マザーファンドベース） |

当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等に伴う資金変動があり、その結果、当該マザーファンドにおいて有価証券の売買等が行われた場合等には、その売買による組入有価証券等の価格の変化や売買手数料等の負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。この影響が、当ファンドの基準価額の変動要因となる可能性があります。

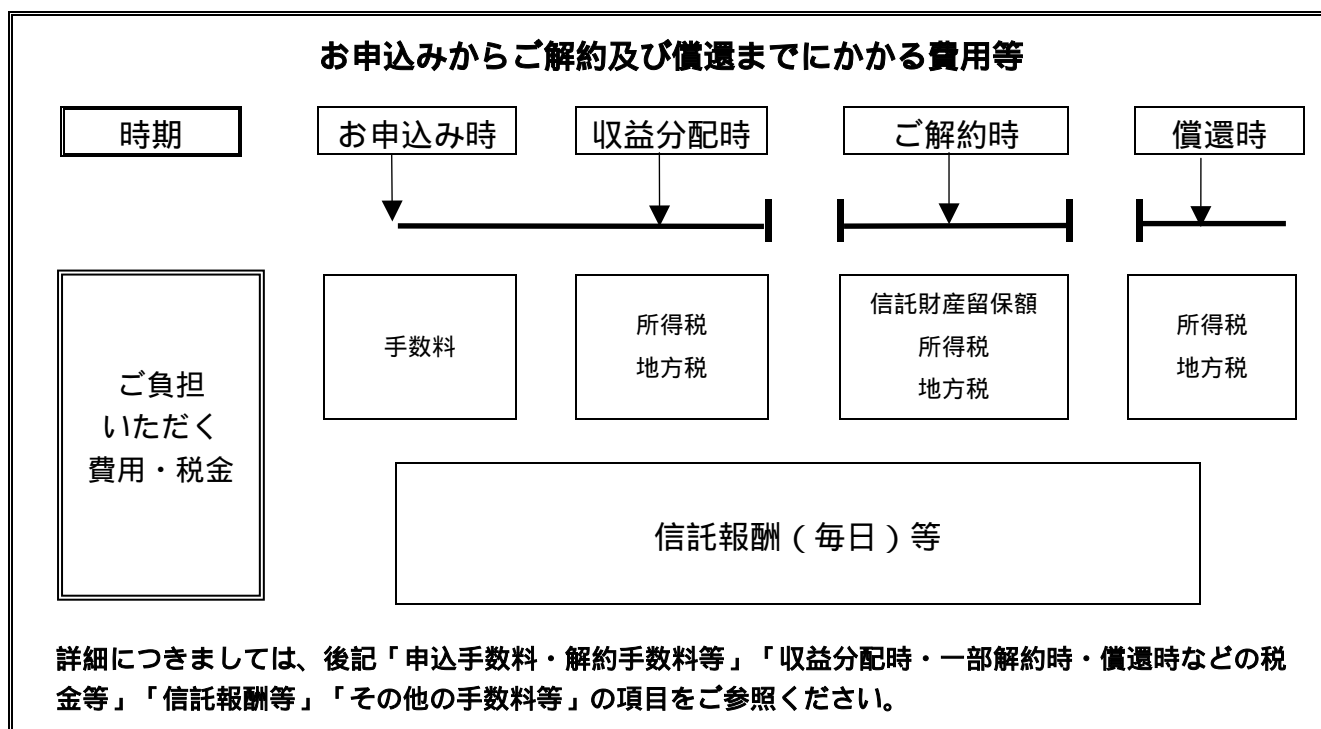
信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資家の皆様に帰属します。

### <投資リスクに対する管理体制>

当ファンドの運用制限の遵守状況のチェック、リスク分析については運用セクションから組織的に独立したセクションが行い、その分析結果を運用委員会に報告する体制としております。

1. 法令諸規則、約款等に定められた運用制限の遵守状況は、業務管理室が日々チェックしております。指摘事項については、運用担当者に連絡され速やかに是正を図るとともに、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. 業務管理室において、リスクのモニタリング、パフォーマンス分析等を行っております。問題が生じた場合は、運用担当者に連絡され速やかに是正を図るとともに、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。

手続等の概要



申込み（販売）手続等

|      |   |
|------|---|
| 申込期間 | 当初申込期間：平成19年10月22日から平成19年10月30日まで<br>継続申込期間：平成19年10月31日から平成20年9月10日まで   |
| 受付時間 | 営業日の午後3時まで（本邦金融商品取引所が半日立会の場合は午前11時まで）<br>なお、この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。   |
| 申込単位 | 販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。<br>（ただし、「分配金再投資コース」の分配金再投資の場合は1口単位とします。）<br>申込方法には、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。なお、平成19年10月22日現在で、「分配金受取りコース」を取扱う販売会社はありません。                                 |
| 販売価額 | 取得申込受付日の翌営業日の基準価額（当初申込期間中は1口当たり1円）に、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。<br>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。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（ <a href="http://www.cmam.co.jp/">http://www.cmam.co.jp/</a> ）でご覧いただけるほか、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に（[中央三井AM]の「4分散」の略号にて）掲載される予定です。 |
| 払込期日 | 販売会社が定める期日までにお申込金額を販売会社に支払うものとします。  |

1. 継続申込期間は、継続申込期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。
2. 分配金再投資に関する契約（下記6.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の受益権の販売価額は、原則として、各計算期間終了日の基準価額とします。
3. 「基準価額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を

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

4. 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、分配金再投資に関する契約に基づく収益分配金の再投資をする場合を除き、販売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。
5. 受益権の取得申込者は、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有価証券取引に係る「総合取引約款」その他の約款（以下「総合約款」といいます。）を取得申込者に交付し、取得申込者は総合約款に基づく取引口座の設定を申込み旨の申込書を提出していただきます。
6. 「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、「自動けいぞく投資約款」（別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含みます。以下「自動けいぞく約款」といいます。）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。
7. 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当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、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き換えに、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、信託契約締結により生じた受益権については信託設定時に、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。

### 換金（解約）手続等

|          |   |
|----------|---|
| 解約単位     | 1口単位  |
| 受付時間     | 営業日の午後3時まで（本邦金融商品取引所が半日立会の場合は午前11時まで）<br>なお、この時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。   |
| 解約価額     | 一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、解約時における信託財産留保額（「申込手数料・解約手数料等」（16ページ）をご参照ください。）を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。<br>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（ <a href="http://www.cmam.co.jp/">http://www.cmam.co.jp/</a> ）に掲載する予定です。<br>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。 |
| 解約代金の支払日 | 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。  |

1. 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、
2. 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。
3. 委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することができます。
4. 上記3.により一部解約の実行の請求の受付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「解約価額」の記載に準じて計算された価額とします。



5. 解約に係る手数料については、徴収しません。
6. 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。

## 手数料等及び税金

### 申込手数料・解約手数料等

| 時期    | 項目    | 内容   |
|-------|-------|--|
| 申込み時  | 申込手数料 | <p>「分配金受取りコース」、「分配金再投資コース」とも、お申込価額（ 1 ）、お申込金額（ 2 ）、お申込口数等に応じて、3.15%（税抜（ 3 ） 3.0%）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を「お申込受付日の翌営業日の基準価額（当初申込期間中は1口当たり1円）×取得口数」に乗じて得た額とします（注）。</p> <p>詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。</p> <p>なお、マザーファンドでは、申込手数料はかかりません。</p> <p>「分配金再投資コース」において収益分配金を再投資する場合については無手数料とします。</p> <p>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」（ 4 ））詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。</p> <p>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。</p> |
| 一部解約時 | 解約手数料 | <p>解約手数料はありませんが、以下の信託財産留保額が控除されます。</p>   |

（一部解約時の信託財産留保額）

当ファンド：一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額に0.15%の率を乗じて得た金額

マザーファンド：下表のA欄の金額にB欄の率を乗じて得た金額

| マザーファンド名        | A 欄   | B 欄   |
|-----------------|---|-------|
| 中央三井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 | 0.20% |
| 中央三井日本債券マザーファンド |   | 0.10% |
| 中央三井外国株式マザーファンド |   | 0.20% |
| 中央三井外国債券マザーファンド |   | 0.10% |

（注）平成19年10月22日現在で、「分配金受取りコース」を取扱う販売会社はありません。

- 1：お申込受付日の翌営業日の基準価額（当初申込期間中は1口当たり1円）に取得口数を乗じて得た額をいいます（以下同じ。）。
- 2：お申込価額に申込手数料及び申込手数料に係る消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加えた総額をいいます（以下同じ。）。
- 3：「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます（以下同じ。）。
- 4：「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等のことをいいます。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。

## 収益分配時・一部解約時・償還時などの税金等

| 時期    | 項目       | 内容  |                                     |
|-------|----------|---|-------------------------------------|
|       |          | 個人受益者                                       | 法人受益者                               |
| 収益分配時 | 所得税及び地方税 | 普通分配金に対して20%<br>（所得税15%及び地方税5%）             | 普通分配金に対して15%<br>（所得税のみ）             |
| 一部解約時 | 所得税及び地方税 | 解約価額の受益者毎の個別元本超過額に対して20%<br>（所得税15%及び地方税5%） | 解約価額の受益者毎の個別元本超過額に対して15%<br>（所得税のみ） |
| 償還時   | 所得税及び地方税 | 償還価額の受益者毎の個別元本超過額に対して20%<br>（所得税15%及び地方税5%） | 償還価額の受益者毎の個別元本超過額に対して15%<br>（所得税のみ） |

（注）＜個人の受益者に対する課税＞

平成21年3月31日までは、上記の20%（所得税15%及び地方税5%）の税率は10%（所得税7%及び地方税3%）に優遇されます。

＜法人の受益者に対する課税＞

平成21年3月31日までは、上記の15%（所得税のみ）の税率は7%（所得税のみ）に優遇されます。

（後記「課税上の取扱い」をあわせてご参照ください。）

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

販売会社につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

### 申込取扱場所及び払込取扱場所の照会先

|                    |   |
|--------------------|---|
| 中央三井アセットマネジメント株式会社 |   |
| お客様相談窓口            | 電話番号：03-5440-0190<br><受付時間> 営業日の午前9時から午後5時まで<br>(本邦金融商品取引所が半日立会いの場合、午前9時から正午まで) |
| ホームページ             | <a href="http://www.cmam.co.jp/">http://www.cmam.co.jp/</a>                     |

## 信託報酬等

| 時期 | 項目        | 費用                               |                   |
|----|-----------|----------------------------------|-------------------|
| 毎日 | 信託報酬      | 信託財産の純資産総額に対し年0.987% (税抜 年0.94%) |                   |
|    | (信託報酬の配分) | (委託会社)                           | 0.294% (税抜 0.28%) |
|    |           | (販売会社)                           | 0.630% (税抜 0.60%) |
|    |           | (受託会社)                           | 0.063% (税抜 0.06%) |

1. 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するものとします。
2. 信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。
3. マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

## 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。

課税上の取扱い

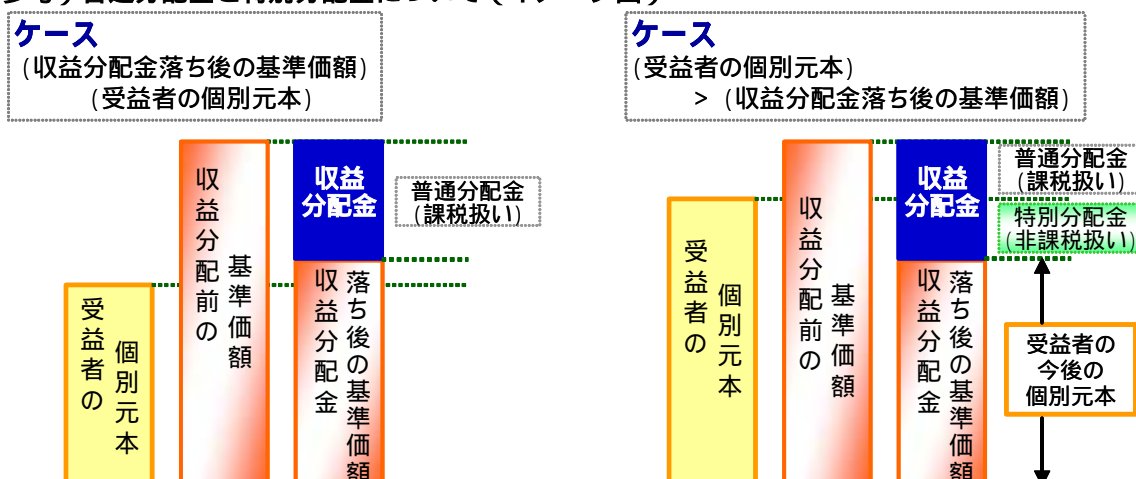
|                          |  |
|--------------------------|--|
| <p>個人の受益者<br/>に対する課税</p> | <p>個人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、20%（所得税15%及び地方税5%）の税率（ ）による源泉徴収（申告不要）が行われます。確定申告を行えば、総合課税を選択することもできます。また、一部解約時及び償還時の損失については、確定申告により、株式等譲渡益との損益通算が可能となります。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金は課税されません。</p> <p>平成21年3月31日までは、上記の20%（所得税15%及び地方税5%）の税率は10%（所得税7%及び地方税3%）に優遇されます。</p> |
| <p>法人の受益者<br/>に対する課税</p> | <p>法人の受益者が支払いを受ける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、15%（所得税のみ）の税率（ ）による源泉徴収が行われます。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金は課税されません。</p> <p>平成21年3月31日までは、上記の15%（所得税のみ）の税率は7%（所得税のみ）に優遇されます。</p>  |

|                               |   |
|-------------------------------|---|
| <p>個別元本について</p>               | <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 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）にあたります。</li> <li>2. 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。</li> <li>3. 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。</li> <li>4. 受益者が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。（「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。）</li> </ol> |
| <p>一部解約時及び償還<br/>時の課税について</p> | <p>一部解約時及び償還時の個別元本超過額が課税対象となります。</p>  |

|                     |   |
|---------------------|---|
| <p>収益分配金の課税について</p> | <p>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「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。</p> <p>受益者が収益分配金を受け取る際、</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 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ます。</li> <li>2. 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特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。</li> </ol> <p>なお、受益者が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。（「普通分配金」と「特別分配金」につきましては、下記イメージ図もあわせてご参照ください。）</p> |
|---------------------|---|

税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になる場合があります。

（ご参考）普通分配金と特別分配金について（イメージ図）



本図は、収益分配金が支払われた場合の課税関係をご説明するために作成したイメージ図です。本図はイメージ図であり、個別元本、基準価額及び収益分配金の水準を示唆するものではありません。また、基準価額が受益者の個別元本を下回る場合があることにご留意ください。

管理及び運営の概要

|              |   |
|--------------|---|
| <p>資産の評価</p> | <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 親投資信託受益証券（中央三井日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンド及び中央三井外国債券マザーファンド）<br/>移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、基準価額で評価します。</li> <li>2. 株式、投資信託受益証券及び投資証券<br/>移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価します。</li> <li>3. 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券<br/>移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価します。ただし、買付後の最初の利払いまでは個別法によります。</li> </ol> |
|--------------|---|

|                 |  |
|-----------------|--|
| 保管              | 該当事項はありません。  |
| 信託期間            | 当ファンドの信託期間は、信託契約締結日（平成19年10月31日）から無期限とします。ただし、下記「繰上償還に係る条件並びに手続き」に該当することとなった場合には、委託会社は、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。   |
| 計算期間            | <p>1．当ファンドの計算期間は、毎年6月11日から翌年6月10日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成19年10月31日から平成20年6月10日までとし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。</p> <p>2．上記1．の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。</p>  |
| 繰上償還に係る条件並びに手続き | <p>1．委託会社の所定の手続きを経て信託を終了させる場合</p> <p>イ．委託会社は、次のいずれかの事由に該当する場合、受託会社と合意のうえ、下記ロ．の所定の手続きを経て、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。</p> <p>    a．信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が10億口を下回るようになった場合</p> <p>    b．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</p> <p>    c．やむを得ない事情が発生したとき</p> <p>ロ．所定の手続き<br/>委託会社は、上記イ．の繰上償還を行う場合には、以下の手続きによります。</p> <div data-bbox="331 1034 1439 1478" data-label="Diagram"> </div> <p>（上記規定は、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すべ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、上記手続きを行うことが困難な場合には適用しません。）</p> <p>2．委託会社は、次のいずれかの事由に該当する場合、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。</p> <p>    a．監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたとき</p> <p>    b．監督官庁より投資信託委託会社の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</p> <p>        ただし、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「信託約款の変更等に係る条件並びに手続き」の「重大な約款変更の実施」に該当する場合には、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。</p> <p>    c．受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合又は裁判所が受託会社を解任した場合において委託会社が新受託会社を選任できないとき</p> |

|                            |   |
|----------------------------|---|
| <p>信託約款の変更等に係る条件並びに手続き</p> | <p>1. 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この信託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「信託約款の変更等に係る条件並びに手続き」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、</p> <p>2. 委託会社は、上記1.の事項（上記1.の変更事項にあつては、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。）については以下の手続きにより行います。</p> <div data-bbox="331 609 1439 1160" style="border: 1px solid black; padding: 10px;"> <p>1: 委託会社及びこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属する時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。</p> <p>2: 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。</p> </div> <p>（上記規定は、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すべ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。）</p> |
| <p>反対者の買取請求権</p>           | <p>信託契約の解約又は重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約又は重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容及び買取請求の手続きに関する事項は、上記「繰上償還に係る条件並びに手続き」の1.ロ.又は「信託約款の変更等に係る条件並びに手続き」の2.に規定する書面に付記します。</p>   |
| <p>公告</p>                  | <p>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。</p>  |
| <p>運用報告書</p>               | <p>委託会社は、計算期間の終了毎に、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況等を記載した運用報告書を作成のうえ、販売会社を通じて、あらかじめ受益者からお申し出いただいた住所にお届けいたします。また、販売会社でもお受取りいただけます。</p>  |

詳細は、巻末の当ファンドの約款をご参照ください。

**運用状況****投資状況**

当ファンドは平成19年10月31日から運用を開始するため、該当事項はありません。

**投資資産**

当ファンドは平成19年10月31日から運用を開始するため、該当事項はありません。

**運用実績**

当ファンドは平成19年10月31日から運用を開始するため、該当事項はありません。

**(参考情報) マザーファンドの投資状況及び投資資産**

当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドの平成19年8月31日現在の投資状況及び投資資産は次のとおりです。

**(1) 投資状況****(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   | 275,558,680,095 | 96.82   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) |      | 9,061,735,448   | 3.18    |
| 合計(純資産総額)             |      | 284,620,415,543 | 100.00  |

**(中央三井日本債券マザーファンド)**

| 資産の種類                 | 国/地域 | 時価合計(円)         | 投資比率(%) |
|-----------------------|------|-----------------|---------|
| 公社債                   | 日本   | 228,083,287,697 | 98.65   |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) |      | 3,126,752,638   | 1.35    |
| 合計(純資産総額)             |      | 231,210,040,335 | 100.00  |



## (中央三井外国株式マザーファンド)

| 資産の種類                 | 国/地域    | 時価合計(円)         | 投資比率(%) |
|-----------------------|---------|-----------------|---------|
| 株式                    | アメリカ    | 172,396,634,843 | 47.95   |
|                       | イギリス    | 40,287,999,468  | 11.21   |
|                       | フランス    | 17,023,755,744  | 4.74    |
|                       | ドイツ     | 15,044,712,292  | 4.18    |
|                       | カナダ     | 14,037,494,083  | 3.90    |
|                       | スイス     | 12,058,761,762  | 3.35    |
|                       | その他     | 61,205,966,794  | 17.02   |
|                       | 小計      | 332,055,324,986 | 92.36   |
| 投資信託受益証券、投資証券         | アメリカ    | 2,771,340,241   | 0.77    |
|                       | オーストラリア | 1,341,618,275   | 0.37    |
|                       | その他     | 1,889,791,790   | 0.53    |
|                       | 小計      | 6,002,750,306   | 1.67    |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) |         | 21,461,151,210  | 5.97    |
| 合計(純資産総額)             |         | 359,519,226,502 | 100.00  |

## (中央三井外国債券マザーファンド)

| 資産の種類                 | 国/地域    | 時価合計(円)         | 投資比率(%) |
|-----------------------|---------|-----------------|---------|
| 国債証券                  | アメリカ    | 138,551,614,293 | 27.92   |
|                       | ドイツ     | 64,368,792,307  | 12.97   |
|                       | イタリア    | 59,447,372,244  | 11.98   |
|                       | フランス    | 54,081,416,974  | 10.90   |
|                       | イギリス    | 39,747,018,011  | 8.01    |
|                       | その他     | 123,263,605,054 | 24.84   |
|                       | 小計      | 479,459,818,883 | 96.62   |
| 特殊債券                  | オーストラリア | 2,265,452,067   | 0.46    |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) |         | 14,482,722,261  | 2.92    |
| 合計(純資産総額)             |         | 496,207,993,211 | 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

(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      | 1,803,300  | 7,902     | 14,250,219,630  | 6,760     | 12,190,308,000  | 4.28    |
| 2  | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業        | 7,234      | 1,519,469 | 10,991,835,627  | 1,110,000 | 8,029,740,000   | 2.82    |
| 3  | みずほフィナンシャルグループ    | 銀行業        | 8,217      | 897,085   | 7,371,351,094   | 733,000   | 6,023,061,000   | 2.12    |
| 4  | キヤノン              | 電気機器       | 832,700    | 6,460     | 5,379,485,226   | 6,620     | 5,512,474,000   | 1.94    |
| 5  | 三井住友フィナンシャルグループ   | 銀行業        | 5,473      | 1,247,939 | 6,829,972,110   | 915,000   | 5,007,795,000   | 1.76    |
| 6  | 武田薬品工業            | 医薬品        | 555,300    | 7,956     | 4,418,059,400   | 7,920     | 4,397,976,000   | 1.55    |
| 7  | ソニー               | 電気機器       | 752,200    | 5,739     | 4,316,522,495   | 5,580     | 4,197,276,000   | 1.47    |
| 8  | 本田技研工業            | 輸送用機器      | 1,069,300  | 4,699     | 5,024,948,584   | 3,820     | 4,084,726,000   | 1.44    |
| 9  | 任天堂               | その他製品      | 70,800     | 33,965    | 2,404,722,100   | 53,700    | 3,801,960,000   | 1.34    |
| 10 | 日本電信電話            | 情報・通信業     | 6,083      | 611,256   | 3,718,267,712   | 538,000   | 3,272,654,000   | 1.15    |
| 11 | 新日本製鐵             | 鉄鋼         | 3,967,000  | 683       | 2,707,686,000   | 812       | 3,221,204,000   | 1.13    |
| 12 | 三菱商事              | 卸売業        | 985,100    | 2,336     | 2,301,215,100   | 3,260     | 3,211,426,000   | 1.13    |
| 13 | ジェイ エフ イーホールディングス | 鉄鋼         | 383,300    | 6,365     | 2,439,742,140   | 7,560     | 2,897,748,000   | 1.02    |
| 14 | 松下電器産業            | 電気機器       | 1,430,000  | 2,401     | 3,434,125,000   | 2,020     | 2,888,600,000   | 1.01    |
| 15 | 野村ホールディングス        | 証券、商品先物取引業 | 1,309,400  | 2,373     | 3,107,063,500   | 2,050     | 2,684,270,000   | 0.94    |
| 16 | 三菱地所              | 不動産業       | 863,000    | 3,384     | 2,920,722,865   | 3,100     | 2,675,300,000   | 0.94    |
| 17 | ミレアホールディングス       | 保険業        | 583,500    | 4,604     | 2,686,624,900   | 4,480     | 2,614,080,000   | 0.92    |
| 18 | 東京電力              | 電気・ガス業     | 844,700    | 3,832     | 3,237,294,200   | 3,040     | 2,567,888,000   | 0.90    |
| 19 | 三井物産              | 卸売業        | 1,055,000  | 1,869     | 1,971,440,504   | 2,410     | 2,542,550,000   | 0.89    |
| 20 | エヌ・ティ・ティ・ドコモ      | 情報・通信業     | 13,369     | 188,693   | 2,522,631,500   | 177,000   | 2,366,313,000   | 0.83    |
| 21 | 東日本旅客鉄道           | 陸運業        | 2,331      | 865,935   | 2,018,494,128   | 923,000   | 2,151,513,000   | 0.76    |
| 22 | 日本たばこ産業           | 食料品        | 3,330      | 590,710   | 1,967,064,398   | 643,000   | 2,141,190,000   | 0.75    |
| 23 | 東芝                | 電気機器       | 2,020,000  | 824       | 1,664,904,000   | 1,044     | 2,108,880,000   | 0.74    |
| 24 | 小松製作所             | 機械         | 582,000    | 2,521     | 1,467,038,800   | 3,570     | 2,077,740,000   | 0.73    |
| 25 | KDDI              | 情報・通信業     | 2,240      | 824,444   | 1,846,754,051   | 895,000   | 2,004,800,000   | 0.70    |
| 26 | 信越化学工業            | 化学         | 233,800    | 8,027     | 1,876,737,900   | 8,380     | 1,959,244,000   | 0.69    |
| 27 | アステラス製薬           | 医薬品        | 345,600    | 5,366     | 1,854,500,222   | 5,370     | 1,855,872,000   | 0.65    |
| 28 | セブン&アイ・ホールディングス   | 小売業        | 564,000    | 3,729     | 2,102,905,800   | 3,090     | 1,742,760,000   | 0.61    |
| 29 | 三菱電機              | 電気機器       | 1,251,000  | 1,107     | 1,384,732,000   | 1,361     | 1,702,611,000   | 0.60    |
| 30 | 日立製作所             | 電気機器       | 2,243,000  | 822       | 1,844,201,000   | 748       | 1,677,764,000   | 0.59    |
|    | 合計                |            | 23,792,277 |           | 110,061,261,986 |           | 103,609,723,000 | 36.40   |

(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。

(注) 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     | 0.08     |
|       | 鉱業         | 0.28     |
|       | 建設業        | 1.76     |
|       | 食料品        | 2.65     |
|       | 繊維製品       | 1.02     |
|       | パルプ・紙      | 0.32     |
|       | 化学         | 5.32     |
|       | 医薬品        | 4.12     |
|       | 石油・石炭製品    | 0.86     |
|       | ゴム製品       | 0.56     |
|       | ガラス・土石製品   | 1.26     |
|       | 鉄鋼         | 3.66     |
|       | 非鉄金属       | 1.34     |
|       | 金属製品       | 0.62     |
|       | 機械         | 4.52     |
|       | 電気機器       | 13.87    |
|       | 輸送用機器      | 9.12     |
|       | 精密機器       | 1.46     |
|       | その他製品      | 2.32     |
|       | 電気・ガス業     | 3.96     |
|       | 陸運業        | 3.09     |
|       | 海運業        | 0.97     |
|       | 空運業        | 0.39     |
|       | 倉庫・運輸関連業   | 0.22     |
|       | 情報・通信業     | 4.87     |
|       | 卸売業        | 4.74     |
|       | 小売業        | 2.94     |
|       | 銀行業        | 10.78    |
|       | 証券、商品先物取引業 | 1.85     |
|       | 保険業        | 2.42     |
|       | その他金融業     | 1.31     |
| 不動産業  | 2.87       |          |
| サービス業 | 1.26       |          |
|       | 合計         | 96.82    |

(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                     | 国名 | 数量  | 簿価金額 (円)      | 評価金額 (円)      | 投資比率 (%) |
|-------------------------|----|-----|---------------|---------------|----------|
| 先物取引<br>買建<br>TOPIX先物取引 | 日本 | 594 | 9,340,441,850 | 9,572,310,000 | 3.36     |

(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評価金額の比率をいいます。

(中央三井日本債券マザーファンド)

投資有価証券の主要銘柄

A. 主要銘柄の明細

| 順位 | 銘柄名                  | 利率<br>(%) | 償還日        | 額面金額<br>(円)    | 簿価(円)  |                | 評価額(円) |                | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----------------------|-----------|------------|----------------|--------|----------------|--------|----------------|-----------------|
|    |                      |           |            |                | 単価     | 金額             | 単価     | 金額             |                 |
| 1  | 利付国庫債券(5年)<br>第42回   | 0.6       | 2009/12/20 | 2,970,000,000  | 99.27  | 2,948,431,800  | 99.36  | 2,950,992,000  | 1.28            |
| 2  | 利付国庫債券(10年)<br>第286回 | 1.8       | 2017/6/20  | 2,800,000,000  | 100.91 | 2,825,680,000  | 101.64 | 2,846,172,000  | 1.23            |
| 3  | 利付国庫債券(5年)<br>第60回   | 1.2       | 2011/9/20  | 2,800,000,000  | 100.33 | 2,809,268,000  | 100.40 | 2,811,368,000  | 1.22            |
| 4  | 利付国庫債券(5年)<br>第63回   | 1.2       | 2012/3/20  | 2,600,000,000  | 99.76  | 2,593,890,000  | 100.23 | 2,606,162,000  | 1.13            |
| 5  | 利付国庫債券(10年)<br>第284回 | 1.7       | 2016/12/20 | 2,450,000,000  | 100.43 | 2,460,709,500  | 101.05 | 2,475,823,000  | 1.07            |
| 6  | 利付国庫債券(5年)<br>第62回   | 1.3       | 2011/12/20 | 2,400,000,000  | 100.62 | 2,414,900,000  | 100.73 | 2,417,664,000  | 1.05            |
| 7  | 利付国庫債券(10年)<br>第285回 | 1.7       | 2017/3/20  | 2,300,000,000  | 100.26 | 2,306,176,000  | 100.91 | 2,320,930,000  | 1.00            |
| 8  | 利付国庫債券(10年)<br>第234回 | 1.4       | 2011/9/20  | 1,840,000,000  | 101.23 | 1,862,779,200  | 101.23 | 1,862,797,600  | 0.81            |
| 9  | 利付国庫債券(5年)<br>第64回   | 1.5       | 2012/6/20  | 1,800,000,000  | 100.83 | 1,814,950,000  | 101.54 | 1,827,756,000  | 0.79            |
| 10 | 利付国庫債券(10年)<br>第273回 | 1.5       | 2015/9/20  | 1,800,000,000  | 99.73  | 1,795,184,000  | 100.36 | 1,806,480,000  | 0.78            |
| 11 | 利付国庫債券(10年)<br>第268回 | 1.5       | 2015/3/20  | 1,700,000,000  | 99.71  | 1,695,075,000  | 100.75 | 1,712,750,000  | 0.74            |
| 12 | 利付国庫債券(5年)<br>第54回   | 1.1       | 2011/3/20  | 1,700,000,000  | 100.17 | 1,703,058,000  | 100.27 | 1,704,641,000  | 0.74            |
| 13 | 利付国庫債券(2年)<br>第257回  | 1.0       | 2009/6/15  | 1,700,000,000  | 100.01 | 1,700,331,000  | 100.24 | 1,704,148,000  | 0.74            |
| 14 | 利付国庫債券(2年)<br>第249回  | 0.7       | 2008/10/15 | 1,700,000,000  | 100.04 | 1,700,714,000  | 99.92  | 1,698,776,000  | 0.73            |
| 15 | 利付国庫債券(5年)<br>第52回   | 0.8       | 2010/12/20 | 1,700,000,000  | 99.19  | 1,686,281,000  | 99.36  | 1,689,154,000  | 0.73            |
| 16 | 利付国庫債券(5年)<br>第38回   | 0.9       | 2009/6/20  | 1,680,000,000  | 100.24 | 1,684,060,200  | 100.10 | 1,681,764,000  | 0.73            |
| 17 | 利付国庫債券(10年)<br>第258回 | 1.3       | 2014/3/20  | 1,680,000,000  | 99.56  | 1,672,659,000  | 99.90  | 1,678,471,200  | 0.73            |
| 18 | 利付国庫債券(10年)<br>第256回 | 1.4       | 2013/12/20 | 1,640,000,000  | 100.16 | 1,642,654,400  | 100.61 | 1,650,004,000  | 0.71            |
| 19 | 利付国庫債券(10年)<br>第264回 | 1.5       | 2014/9/20  | 1,630,000,000  | 100.36 | 1,635,893,200  | 100.96 | 1,645,713,200  | 0.71            |
| 20 | 利付国庫債券(20年)<br>第95回  | 2.3       | 2027/6/20  | 1,500,000,000  | 101.85 | 1,527,793,000  | 102.93 | 1,544,085,000  | 0.67            |
| 21 | 利付国庫債券(2年)<br>第252回  | 0.8       | 2009/1/15  | 1,530,000,000  | 100.16 | 1,532,463,300  | 99.97  | 1,529,586,900  | 0.66            |
| 22 | 利付国庫債券(10年)<br>第240回 | 1.3       | 2012/6/20  | 1,470,000,000  | 100.38 | 1,475,695,300  | 100.63 | 1,479,334,500  | 0.64            |
| 23 | 利付国庫債券(10年)<br>第280回 | 1.9       | 2016/6/20  | 1,400,000,000  | 102.53 | 1,435,490,000  | 103.10 | 1,443,484,000  | 0.62            |
| 24 | 利付国庫債券(5年)<br>第55回   | 1.4       | 2011/3/20  | 1,400,000,000  | 100.68 | 1,409,620,000  | 101.29 | 1,418,158,000  | 0.61            |
| 25 | 利付国庫債券(10年)<br>第282回 | 1.7       | 2016/9/20  | 1,400,000,000  | 100.38 | 1,405,348,000  | 101.22 | 1,417,206,000  | 0.61            |
| 26 | 利付国庫債券(10年)<br>第267回 | 1.3       | 2014/12/20 | 1,410,000,000  | 97.88  | 1,380,133,100  | 99.47  | 1,402,527,000  | 0.61            |
| 27 | 利付国庫債券(5年)<br>第53回   | 1.0       | 2010/12/20 | 1,400,000,000  | 99.75  | 1,396,513,000  | 100.01 | 1,400,210,000  | 0.61            |
| 28 | 利付国庫債券(2年)<br>第251回  | 0.8       | 2008/12/15 | 1,400,000,000  | 100.17 | 1,402,464,000  | 99.98  | 1,399,818,000  | 0.61            |
| 29 | 利付国庫債券(10年)<br>第259回 | 1.5       | 2014/3/20  | 1,380,000,000  | 100.59 | 1,388,186,200  | 101.11 | 1,395,359,400  | 0.60            |
| 30 | 利付国庫債券(10年)<br>第270回 | 1.3       | 2015/6/20  | 1,400,000,000  | 98.25  | 1,375,501,000  | 99.08  | 1,387,232,000  | 0.60            |
| 合計 |                      |           |            | 54,580,000,000 |        | 54,681,901,200 |        | 54,908,566,800 | 23.75           |

(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。

(注) 国/地域は全て日本、種類は全て国債証券です。

#### B. 種類別の投資比率

| 種類    | 投資比率 (%) |
|-------|----------|
| 国債証券  | 72.50    |
| 地方債証券 | 5.97     |
| 特殊債券  | 11.67    |
| 社債券   | 8.51     |
| 合計    | 98.65    |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

| 銘柄名                  | 国名 | 数量<br>(枚) | 簿価金額 (円)      | 評価金額 (円)      | 投資比率<br>(%) |
|----------------------|----|-----------|---------------|---------------|-------------|
| 先物取引<br>買建<br>長期国債先物 | 日本 | 13        | 1,762,759,110 | 1,759,550,000 | 0.76        |

(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評価金額の比率をいいます。

(中央三井外国株式マザーファンド)

投資有価証券の主要銘柄

## A. 主要銘柄の明細

| 順位 | 国/地域   | 銘柄名                            | 業種                 | 株数        | 簿価(円)  |                | 評価額(円) |                | 投資比率(%) |
|----|--------|--------------------------------|--------------------|-----------|--------|----------------|--------|----------------|---------|
|    |        |                                |                    |           | 単価     | 金額             | 単価     | 金額             |         |
| 1  | アメリカ   | EXXON MOBIL CORPORATION        | エネルギー              | 670,076   | 8,840  | 5,923,448,880  | 9,912  | 6,642,046,600  | 1.85    |
| 2  | アメリカ   | GENERAL ELECTRIC               | 資本財                | 1,202,745 | 4,226  | 5,082,854,564  | 4,457  | 5,360,740,306  | 1.49    |
| 3  | アメリカ   | MICROSOFT CORP                 | ソフトウェア・サービス        | 1,030,791 | 3,411  | 3,515,741,949  | 3,302  | 3,403,869,278  | 0.95    |
| 4  | アメリカ   | AT&T INC                       | 電気通信サービス           | 730,352   | 4,375  | 3,195,643,466  | 4,615  | 3,370,532,996  | 0.94    |
| 5  | アメリカ   | CITIGROUP INC                  | 各種金融               | 573,366   | 6,305  | 3,615,331,026  | 5,366  | 3,076,633,850  | 0.86    |
| 6  | アメリカ   | BANK OF AMERICA CORP           | 銀行                 | 521,425   | 6,146  | 3,204,929,831  | 5,828  | 3,038,799,565  | 0.85    |
| 7  | イギリス   | BP PLC                         | エネルギー              | 2,264,503 | 1,255  | 2,841,404,351  | 1,288  | 2,916,594,945  | 0.81    |
| 8  | イギリス   | HSBC HLDGS PLC                 | 銀行                 | 1,355,105 | 2,173  | 2,944,894,515  | 2,071  | 2,806,456,332  | 0.78    |
| 9  | アメリカ   | PROCTER & GAMBLE CO            | 家庭用品・パーソナル用品       | 369,015   | 7,490  | 2,764,084,745  | 7,546  | 2,784,480,433  | 0.77    |
| 10 | アメリカ   | CHEVRON CORP                   | エネルギー              | 254,942   | 8,628  | 2,199,724,857  | 10,120 | 2,580,049,573  | 0.72    |
| 11 | アメリカ   | CISCO SYSTEMS INC              | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 706,413   | 3,185  | 2,249,893,659  | 3,648  | 2,577,051,207  | 0.72    |
| 12 | アメリカ   | JOHNSON & JOHNSON              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフ  | 338,470   | 7,611  | 2,576,013,308  | 7,150  | 2,420,030,714  | 0.67    |
| 13 | アメリカ   | PFIZER                         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフ  | 843,386   | 3,090  | 2,606,232,133  | 2,850  | 2,403,244,009  | 0.67    |
| 14 | アメリカ   | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 176,078   | 11,673 | 2,055,386,393  | 13,391 | 2,357,859,776  | 0.66    |
| 15 | スイス    | NESTLE SA-REGISTERD            | 食品・飲料・タバコ          | 46,870    | 44,590 | 2,089,951,211  | 50,094 | 2,347,900,155  | 0.65    |
| 16 | イギリス   | VODAFONE GROUP PLC             | 電気通信サービス           | 6,179,430 | 348    | 2,149,625,912  | 370    | 2,285,106,868  | 0.64    |
| 17 | フランス   | TOTAL SA                       | エネルギー              | 251,873   | 8,369  | 2,108,044,447  | 8,607  | 2,167,916,147  | 0.60    |
| 18 | アメリカ   | JPMORGAN CHASE & CO            | 各種金融               | 404,887   | 5,868  | 2,375,850,518  | 5,104  | 2,066,380,442  | 0.57    |
| 19 | イギリス   | GLAXOSMITHKLINE PLC            | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフ  | 672,721   | 3,271  | 2,200,796,469  | 2,990  | 2,011,208,746  | 0.56    |
| 20 | アメリカ   | INTEL CORP                     | 半導体・半導体製造装置        | 674,465   | 2,494  | 1,682,032,047  | 2,934  | 1,979,048,656  | 0.55    |
| 21 | アメリカ   | ALTRIA GROUP INC               | 食品・飲料・タバコ          | 245,275   | 7,638  | 1,873,368,742  | 8,038  | 1,971,483,045  | 0.55    |
| 22 | アメリカ   | AMERICAN INT'L GROUP           | 保険                 | 258,476   | 8,033  | 2,076,328,786  | 7,614  | 1,968,085,891  | 0.55    |
| 23 | イギリス   | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS    | エネルギー              | 430,598   | 4,054  | 1,745,623,378  | 4,437  | 1,910,380,321  | 0.53    |
| 24 | フィンランド | NOKIA OYJ                      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 478,959   | 2,759  | 1,321,412,267  | 3,806  | 1,822,764,687  | 0.51    |
| 25 | アメリカ   | HEWLETT-PACKARD CO             | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 315,900   | 4,911  | 1,551,516,410  | 5,622  | 1,776,125,889  | 0.49    |
| 26 | アメリカ   | VERIZON COMMUNICATIONS INC     | 電気通信サービス           | 340,548   | 4,444  | 1,513,489,563  | 4,867  | 1,657,384,148  | 0.46    |
| 27 | スイス    | NOVARTIS AG-REG SHS            | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフ  | 271,305   | 7,000  | 1,899,053,097  | 6,105  | 1,656,287,181  | 0.46    |
| 28 | スイス    | ROCHE HLDGS AG GENUSSCHINE     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフ  | 82,172    | 22,741 | 1,868,678,427  | 20,086 | 1,650,491,343  | 0.46    |
| 29 | アメリカ   | APPLE INC                      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 100,800   | 10,251 | 1,033,309,340  | 15,815 | 1,594,105,380  | 0.44    |
| 30 | アメリカ   | GOOGLE INC-CLASS A             | ソフトウェア・サービス        | 26,100    | 55,017 | 1,435,944,067  | 59,358 | 1,549,248,967  | 0.43    |
| 合計 |        |                                |                    |           |        | 73,700,608,358 |        | 76,152,307,450 | 21.18   |

(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。

(注) 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            | 銀行                 | 10.65    |
|               | エネルギー              | 9.87     |
|               | 資本財                | 7.49     |
|               | 素材                 | 5.95     |
|               | 医薬品・バイオテクノ・ライフ     | 5.92     |
|               | 各種金融               | 5.82     |
|               | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 5.14     |
|               | 食品・飲料・タバコ          | 4.81     |
|               | 保険                 | 4.79     |
|               | 電気通信サービス           | 4.59     |
|               | 公益事業               | 4.18     |
|               | ソフトウェア・サービス        | 3.30     |
|               | メディア               | 2.96     |
|               | 小売                 | 2.43     |
|               | ヘルスケア機器・サービス       | 2.37     |
|               | 食品・生活必需品小売り        | 2.07     |
|               | 半導体・半導体製造装置        | 1.67     |
|               | 運輸                 | 1.50     |
|               | 消費者サービス            | 1.43     |
|               | 耐久消費財・アパレル         | 1.38     |
|               | 家庭用品・パーソナル用品       | 1.34     |
|               | 自動車・自動車部品          | 1.23     |
|               | 商業サービス・用品          | 0.86     |
| 不動産           | 0.60               |          |
|               | 小計                 | 92.36    |
| 投資信託受益証券、投資証券 |                    | 1.67     |
| 合計            |                    | 94.03    |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

| 取引名          | 地域   | 資産名           | 種類 | 数量<br>(枚) | 簿価(円)          | 時価(円)          | 投資比率<br>(%) |
|--------------|------|---------------|----|-----------|----------------|----------------|-------------|
| 株価指数<br>先物取引 | アメリカ | S&P 500 FUTU  | 買建 | 337       | 14,193,586,608 | 14,292,836,586 | 3.98        |
|              | ドイツ  | DJ EURO STOXX | 買建 | 758       | 5,019,607,874  | 5,116,746,271  | 1.42        |
|              | イギリス | FTSE 100 IDX  | 買建 | 224       | 3,185,278,752  | 3,257,053,794  | 0.91        |

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

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

(中央三井外国債券マザーファンド)

投資有価証券の主要銘柄

A. 主要銘柄の明細

| 順位 | 国/<br>地域 | 銘柄名                | 利率<br>(%) | 償還日        | 額面金額       | 簿価(円)  |                 | 評価額(円) |                 | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----------|--------------------|-----------|------------|------------|--------|-----------------|--------|-----------------|-----------------|
|    |          |                    |           |            |            | 単価     | 金額              | 単価     | 金額              |                 |
| 1  | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 6.000     | 2009/8/15  | 78,300,000 | 11,921 | 9,333,948,595   | 12,011 | 9,404,240,813   | 1.90            |
| 2  | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 4.000     | 2010/3/15  | 73,900,000 | 11,419 | 8,438,961,843   | 11,569 | 8,549,427,838   | 1.72            |
| 3  | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 3.500     | 2009/11/15 | 60,000,000 | 11,215 | 6,729,158,250   | 11,451 | 6,870,618,562   | 1.38            |
| 4  | フランス     | FRANCE<br>O.A.T.   | 4.000     | 2009/10/25 | 42,850,000 | 15,874 | 6,801,922,309   | 15,844 | 6,789,288,720   | 1.37            |
| 5  | フランス     | FRANCE<br>O.A.T.   | 5.500     | 2010/10/25 | 40,630,000 | 16,688 | 6,780,296,532   | 16,501 | 6,704,272,683   | 1.35            |
| 6  | ドイツ      | DEUTSCHLAND<br>REP | 4.500     | 2009/7/4   | 31,710,000 | 16,062 | 5,093,119,185   | 15,987 | 5,069,486,388   | 1.02            |
| 7  | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 6.500     | 2010/2/15  | 40,000,000 | 12,155 | 4,861,882,123   | 12,233 | 4,893,075,937   | 0.99            |
| 8  | フランス     | FRANCE<br>O.A.T.   | 3.500     | 2015/4/25  | 31,000,000 | 15,269 | 4,733,298,643   | 15,097 | 4,680,209,407   | 0.94            |
| 9  | イタリア     | BTPS               | 4.500     | 2009/5/1   | 27,240,000 | 16,052 | 4,372,498,613   | 15,953 | 4,345,579,453   | 0.88            |
| 10 | ドイツ      | DEUTSCHLAND<br>REP | 3.750     | 2015/1/4   | 27,000,000 | 15,608 | 4,214,172,177   | 15,424 | 4,164,508,053   | 0.84            |
| 11 | イタリア     | BTPS               | 4.250     | 2009/11/1  | 26,010,000 | 15,997 | 4,160,700,470   | 15,912 | 4,138,841,119   | 0.83            |
| 12 | ドイツ      | DEUTSCHLAND<br>REP | 4.250     | 2014/7/4   | 24,850,000 | 16,090 | 3,998,389,328   | 15,932 | 3,958,984,683   | 0.80            |
| 13 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 4.875     | 2009/5/15  | 33,500,000 | 11,611 | 3,889,560,107   | 11,747 | 3,935,126,650   | 0.79            |
| 14 | ドイツ      | DEUTSCHLAND<br>REP | 5.000     | 2011/7/4   | 23,200,000 | 16,512 | 3,830,759,431   | 16,361 | 3,795,810,603   | 0.76            |
| 15 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 4.625     | 2011/8/31  | 31,700,000 | 11,544 | 3,659,297,176   | 11,795 | 3,738,922,121   | 0.75            |
| 16 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 4.750     | 2014/5/15  | 29,400,000 | 11,596 | 3,409,258,820   | 11,897 | 3,497,769,450   | 0.70            |
| 17 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 4.750     | 2008/11/15 | 29,460,000 | 11,574 | 3,409,805,075   | 11,684 | 3,442,129,316   | 0.69            |
| 18 | イタリア     | BTPS               | 5.250     | 2011/8/1   | 20,670,000 | 16,672 | 3,446,112,693   | 16,448 | 3,399,897,942   | 0.69            |
| 19 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 6.125     | 2027/11/15 | 25,100,000 | 13,361 | 3,353,547,033   | 13,479 | 3,383,135,816   | 0.68            |
| 20 | イギリス     | TREASURY           | 4.750     | 2020/3/7   | 14,550,000 | 23,165 | 3,370,452,937   | 22,989 | 3,344,944,968   | 0.67            |
| 21 | イタリア     | BTPS               | 6.500     | 2027/11/1  | 16,990,000 | 20,234 | 3,437,677,086   | 19,322 | 3,282,766,089   | 0.66            |
| 22 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 5.125     | 2016/5/15  | 27,000,000 | 11,906 | 3,214,685,601   | 12,140 | 3,277,853,071   | 0.66            |
| 23 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 5.000     | 2011/2/15  | 25,960,000 | 11,723 | 3,043,308,972   | 11,938 | 3,099,099,845   | 0.62            |
| 24 | ドイツ      | DEUTSCHLAND<br>REP | 5.000     | 2012/1/4   | 18,700,000 | 16,574 | 3,099,288,706   | 16,415 | 3,069,636,116   | 0.62            |
| 25 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 4.500     | 2012/4/30  | 25,370,000 | 11,442 | 2,902,941,032   | 11,749 | 2,980,814,450   | 0.60            |
| 26 | アメリカ     | US TREASURY<br>N/B | 4.375     | 2010/12/15 | 25,300,000 | 11,441 | 2,894,587,211   | 11,691 | 2,957,907,037   | 0.60            |
| 27 | イギリス     | TREASURY           | 4.750     | 2038/12/7  | 12,030,000 | 25,086 | 3,017,851,815   | 24,450 | 2,941,365,075   | 0.59            |
| 28 | イタリア     | BTPS               | 2.750     | 2010/6/15  | 18,970,000 | 15,176 | 2,878,795,892   | 15,273 | 2,897,375,817   | 0.58            |
| 29 | イギリス     | TREASURY           | 4.750     | 2010/6/7   | 12,500,000 | 22,891 | 2,861,392,187   | 23,099 | 2,887,396,875   | 0.58            |
| 30 | ドイツ      | DEUTSCHLAND<br>REP | 5.000     | 2012/7/4   | 17,500,000 | 16,623 | 2,909,006,292   | 16,477 | 2,883,476,522   | 0.58            |
| 合計 |          |                    |           |            |            |        | 128,146,676,134 |        | 128,383,961,419 | 25.87           |



(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。

(注) 種類は全て国債証券です。

#### B. 種類別の投資比率

| 種類   | 投資比率 (%) |
|------|----------|
| 国債証券 | 96.62    |
| 特殊債券 | 0.46     |
| 合計   | 97.08    |

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

| 取引名    | 地域   | 資産名          | 種類 | 数量<br>(枚) | 簿価<br>(円)     | 時価<br>(円)     | 投資比率<br>(%) |
|--------|------|--------------|----|-----------|---------------|---------------|-------------|
| 債券先物取引 | アメリカ | US 5YR NOTE  | 買建 | 34        | 419,959,018   | 422,139,335   | 0.09        |
| 債券先物取引 | アメリカ | US 10YR NOTE | 買建 | 26        | 328,060,059   | 330,262,676   | 0.07        |
| 債券先物取引 | アメリカ | US LONG BOND | 買建 | 25        | 323,159,192   | 324,814,640   | 0.07        |
| 債券先物取引 | ドイツ  | EURO-SCHATZ  | 買建 | 44        | 719,915,094   | 721,360,301   | 0.15        |
| 債券先物取引 | ドイツ  | EURO-BOBL FU | 買建 | 51        | 870,792,546   | 874,495,314   | 0.18        |
| 債券先物取引 | ドイツ  | EURO-BUND FU | 買建 | 83        | 1,489,897,080 | 1,497,625,464 | 0.30        |

(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。

## 財務ハイライト情報

当ファンドは、平成19年10月31日から運用を開始する予定であり、有価証券届出書提出日現在、記載すべき貸借対照表、損益及び剰余金計算書はありません。

当ファンドの会計監査は、監査法人トーマツが行います。

## 内国投資信託受益証券事務の概要

|                |  |
|----------------|--|
| 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。  |
| 受益者等に対する特典     | 該当事項はありません。  |
| 譲渡制限           | 該当事項はありません。  |
| 振替受益権に関する記載    | <p>当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。</p> <p><b>受益証券の不発行</b><br/>委託会社は、この信託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。</p> <p>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。</p> <p><b>受益権の譲渡</b><br/>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。<br/>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。<br/>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。</p> <p><b>受益権の譲渡の対抗要件</b><br/>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。</p> <p><b>受益権の再分割</b><br/>委託会社は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、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。</p> <p><b>償還金</b><br/>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扱います。）に支払います。</p> <p><b>質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて</b><br/>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。</p> |

## ファンドの詳細情報の項目

「ファンドの詳細情報」は「投資信託説明書（請求目論見書）」に掲載しております。

「ファンドの詳細情報」に掲載されている項目は以下のとおりです。

### 第1 ファンドの沿革

#### 第2 手続等

- 1 申込（販売）手続等
- 2 換金（解約）手続等

#### 第3 管理及び運営

- 1 資産管理等の概要
  - （1）資産の評価
  - （2）保管
  - （3）信託期間
  - （4）計算期間
  - （5）その他
- 2 受益者の権利等

#### 第4 ファンドの経理状況

#### 第5 設定及び解約の実績

追加型証券投資信託  
新生・4分散ファンド  
約 款

追加型証券投資信託  
新生・4分散ファンド

運用の基本方針

約款第18条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

中央三井日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンドおよび中央三井外国債券マザーファンド（以下これらを「マザーファンド」といいます。）の各受益証券を主要投資対象とします。このほか、国内外の株式・公社債等に直接投資することもあります。

(2) 投資態度

主として、マザーファンド受益証券に投資し、国内外の株式・公社債への分散投資をすることにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。

基本配分比率は国内株式25%、国内債券25%、外国株式25%、外国債券25%とします。

上記の基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設け、一定以上乖離した場合にはリバランスを行います。また、市況動向等の変化に応じて、当該基本配分比率の見直しを行う場合があります。

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。

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

株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の75%以下とします。

ただし、資金動向、市況動向に急激な変化が生じたときおよ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。

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、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

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

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

### 3. 投資制限

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

新株引受権証券およ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。

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

同一銘柄の転換社債、なら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号および第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。

同一銘柄の新株引受権証券およ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。

投資信託証券（親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。

### 4. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。

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。）および売買益（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および収益調整金、その他の調整金は、全額分配に使用することがあります。

分配金額については、委託者が基準価額水準・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。

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。

追加型証券投資信託  
 新生・4分散ファンド  
 約款

**(信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託)**

第1条 この信託は、証券投資信託であり、中央三井アセットマネジメント株式会社を委託者とし、中央三井アセット信託銀行株式会社を受託者とします。

この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。

受託者は、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（受託者の利害関係人（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。以下この条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。

前項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。

**(信託の目的および金額)**

第2条 委託者は、金300億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

**(信託金の限度額)**

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、金1兆円を限度として信託金を追加することができます。

委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

**(信託期間)**

第4条 この信託の信託期間は、信託契約締結日から第47条第7項、第49条第1項、第50条第1項、第51条第1項および第53条第2項の規定による信託期間終了の日までとします。

**(受益権の取得申込みの勧誘の種類)**

第5条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われ

ます。

**(当初の受益者)**

第6条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第7条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

**(受益権の分割および再分割)**

第7条 委託者は、第2条の規定による受益権については300億口を上限として、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、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。

**(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)**

第8条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第28条に規定する借入公社債を除きます。）を法令および社団法人投資信託協会規則にしたが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。

信託財産に属する外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

第30条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

**(信託日時の異なる受益権の内容)**

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にす

ることにより差異を生ずることはありません。

**(受益権の帰属と受益証券の不発行)**

第10条 この信託の全ての受益権は、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

委託者は、この信託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また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、委託者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。

委託者は、第7条の規定により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または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

**(受益権の設定に係る受託者の通知)**

第11条 受託者は、この信託契約締結により生じた受益権については信託設定時に、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。

**(受益権の申込単位、価額および手数料等)**

第12条 販売会社（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および金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関のうち、委託者の指定する者をいいます。以下同じ。）は、第7条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、販売会社が定める申込単位をもって取得の申込みに応ずることができるものとします。ただし、別に定める自動けいぞく投資約款にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対しては、1口の整数倍をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

この約款において「自動けいぞく投資約款」とは、この信託について、受益権取得申込者と販売会社が締結する「自動けいぞく投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「自動けいぞく投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

前項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、手数料および当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みに係る受益権の価額は、1口につき1円に手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

前項の手数料の額は、販売会社が別に定めるところによるものとします。

前2項の規定にかかわらず、受益者が別に定め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価額は、原則として、第39条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

第1項の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託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また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（第2項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）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または記録を行うことができます。

第1項の規定にかかわらず、第4項に該当する場合を除き、金融商品取引所等（金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所）で金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）および外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場で金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、販売会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受けた取得申込みを取り消すことができます。

**（受益権の譲渡に係る記載または記録）**

第13条 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また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。

前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとします。ただし、前項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。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載また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、委託者が必要と認めるときまた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）**

第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

**（投資の対象とする資産の種類）**

第15条 この信託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。

1. 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。）

イ. 有価証券

ロ. 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、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限りません。）

ハ. 金銭債権（上記イ、ロおよび下記ニに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ. 約束手形（上記イに掲げるものに該当するものを除きます。）

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

**（運用の指図範囲等）**

第16条 委託者は、信託金を、主として中央三井アセットマネジメント株式会社を委託者とし、中央三井アセット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「中央三井日本株式マザーファンド」、「中央三井日本債券マザーファンド」、「中央三井外国株式マザーファンド」および「中央三井外国債券マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の各受益証券ならびに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

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

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券または優先出資引



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また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。）および新株予約権証券
- 12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- 13．投資信託また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せん。）
- 14．投資証券または外国投資証券（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または証書（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前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、

第13号の証券および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託者は、信託金を、前項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前号の権利の性質を有するもの

第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項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。

委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

委託者は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドを除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

前2項において信託財産に属するとみなした額とは、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資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### （利害関係人等との取引等）

第17条 受託者は、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ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託

財産と、受託者（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、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人（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。以下本項、次項および第31条において同じ。）、第31条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等ならびに第22条ないし第28条、第30条、第34条ないし第36条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。

受託者は、受託者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、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができます。なお、受託者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。

委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第5項および同条第6項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等ならびに第22条ないし第28条、第30条、第34条ないし第36条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、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

#### （運用の基本方針）

第18条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

#### （投資する株式等の範囲）

第19条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場

において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

#### （同一銘柄の株式等への投資制限）

第20条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

前2項において信託財産に属するとみなした額とは、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株式、当該新株引受権証券および当該新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### （同一銘柄の転換社債等への投資制限）

第21条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、なら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号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、取得

時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

前項において信託財産に属するとみなした額とは、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転換社債ならびに当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

**(信用取引の指図範囲)**

第22条 委託者は、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、株券の引渡しまた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。

前項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の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。

第2項において信託財産に属するとみなした額とは、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。

**(先物取引等の運用指図)**

第23条 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、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。）および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。）なら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。）。

委託者は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることが

できます。

委託者は、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引なら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。

**(スワップ取引の運用指図)**

第24条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利また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。）を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第4条に定める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。

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。

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

**(金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図)**

第25条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第4条に定める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。

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

委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

**(有価証券の貸付の指図および範囲)**

第26条 委託者は、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および公社債を次の各号の範囲内で貸付けることの指図をする

ことができます。

1. 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。
2. 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、前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。

委託者は、有価証券の貸付にあたり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

**(公社債の空売りの指図および範囲)**

第27条 委託者は、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または第28条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また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。

前項の売付けの指図は、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。

信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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および範囲)**

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

前項の借入れの指図は、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。

信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。

第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

**(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)**

第29条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

**(外国為替予約取引の指図)**

第30条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

第2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

**(信託業務の委託等)**

第31条 受託者は、委託者と協議のうえ、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(受託者の利害関係人を含みます。)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

受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号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。

前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者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において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およ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. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

**（混蔵寄託）**

第32条 金融機関また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およ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。以下本条において同じ。）から、売買代金およ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またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関また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また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。

**（信託財産の登記等および記載等の留保等）**

第33条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することができます。

前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

信託財産に属する旨の記載また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また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、受託者が認める場合は、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。

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。

**（一部解約の請求および有価証券の売却等の指図）**

第34条 委託者は、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およ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。

**（再投資の指図）**

第35条 委託者は、前条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、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

**（資金の借入れ）**

第36条 委託者は、信託財産の効率的な運用なら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、また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また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、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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。

借入金の利息は信託財産中から支弁します。

**（損益の帰属）**

第37条 委託者の指図に基づく行為により信託財産

に生じた利益および損失は、全て受益者に帰属します。

**(受託者による資金の立替え)**

第38条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

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、株式の配当金およ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、受託者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。

前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

**(信託の計算期間)**

第39条 この信託の計算期間は、毎年6月11日から翌年6月10日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成19年10月31日から平成20年6月10日までとし、最終計算期間の終了日は、第4条に定める信託期間の終了日とします。

前項の規定にかかわらず、前項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。

**(信託財産に関する報告等)**

第40条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。

受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

**(信託事務の諸費用)**

第41条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息(以下「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、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および当該費用に係る消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

**(信託報酬等の額および支弁の方法)**

第42条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第39条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の94の率を乗じて得た額とします。

前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者間の配分は別に定めます。

第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

**(収益の分配)**

第43条 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。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およ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。)との合計額は、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、信託報酬およ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。
2. 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、信託報酬およ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。

前項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。

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、償還金および一部解約金の支払い)**

第44条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払います。

前項の規定にかかわらず、別に定め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、受託者が委託者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、別に定める契約に基づき、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、第10条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金(信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。)は、信託終了日後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(信託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、当該信託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または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をする

のと引換えに、当該償還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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。

一部解約金は、第47条第1項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から当該受益者に支払います。

第1項、第3項および第4項に規定する収益分配金、償還金および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。

収益分配金、償還金および一部解約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。

前項に規定する「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、第12条第3項に規定する手数料およ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、前項に規定する「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。

**(収益分配金および償還金の時効)**

第45条 受益者が、収益分配金については前条第1項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、ならびに信託終了による償還金については前条第3項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、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

**(収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)**

第46条 受託者は、収益分配金については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については第44条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第44条第4項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払

いにつき、その責に任じません。

**(信託契約の一部解約)**

第47条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し1口単位の整数倍をもって一部解約の実行を請求することができます。

受益者が前項の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。

委託者は、第1項の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、第1項の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者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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。

前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.15%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。

委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。

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

委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合は、受託者と合意のうえ、あらかじめ、監督官庁に届け出ることにより、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、第49条の規定を準用するものとします。

**(質権口記載または記録の受益権の取扱い)**

第48条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載また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け付け、一部

解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

**(信託契約の解約)**

第49条 委託者は、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、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

委託者は、前項の事項について、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、書面決議の日なら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っ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。

前項の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の信託財産にこの信託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者を除きます。以下本項において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っ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。

第2項の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

第2項から前項までの規定は、委託者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すべての受益者が書面また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、第2項から前項までの手続きを行うことが困難な場合には適用しません。

**(信託契約に関する監督官庁の命令)**

第50条 委託者は、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、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

委託者は、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、第54条の規定にしたがいます。

**(委託者の登録取消等に伴う取扱い)**

第51条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

前項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者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、この信託は、第54条第4項に該当する場合には、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

**(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)**

第52条 委託者は、事業の全部また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。

委託者は、分割により事業の全部また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。

**(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)**

第53条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者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、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第54条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

**(信託約款の変更等)**

第54条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託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、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以

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。

委託者は、前項の事項（前項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、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およ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っ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。

前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託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者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができません。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っ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。

第2項の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

第2項から前項までの規定は、委託者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すべての受益者が書面また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。

前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一また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)**

第55条 第49条に規定する信託契約の解約または前条に規定する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または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續きに関する

る事項は、第49条第2項または前条第2項に規定する書面に付記します。

**(他の受益者の氏名等の開示の請求の制限)**

第56条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、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. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

**(公告)**

第57条 委託者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。

**(信託約款に関する疑義の取扱い)**

第58条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

**(付則)**

第1条 第25条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第2条 第25条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るス

ワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成19年10月31日

委託者 中央三井アセットマネジメント株式会社

受託者 中央三井アセット信託銀行株式会社

## 親投資信託

### 中央三井日本株式マザーファンド

## 約 款

< 親投資信託 中央三井日本株式マザーファンド >

#### 運用の基本方針

約款第14条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

#### 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（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所での有価証券の売買また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および当該市場を開設するものをいいます。）に上場されている株式を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

株式への投資は、原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、「TOPIX」（東証株価指数）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、中央三井アセット信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、中央三井アセット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なら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および金利に係るオプション取引なら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およびわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利また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。

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。

新株引受権証券およ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、なら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号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券およ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、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。

#### 親投資信託(中央三井日本株式マザーファンド)約款

##### (信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託であり、中央三井アセットマネジメント株式会社を委託者とし、中央三井アセット信託銀行株式会社を受託者とします。

この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法(大正11年法律第62号)の適用を受けます。

##### (信託事務の委託)

第1条の2 受託者は、信託法第26条第1項に基づき、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と信託契約を締結し、これを委託することができます。

##### (信託の目的および金額)

第2条 委託者は、金200億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

##### (追加信託金限度額)

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、金2兆円を上限として信託金を追加することができます。

追加信託が行われたときは、受託者は、その引受けを証する書面を委託者に交付します。

委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限

度額を変更することができます。

##### (信託期間)

第4条 この信託の期間は、信託契約締結日から第42条第1項、第42条第2項、第43条第1項、第44条第1項および第46条第2項の規定による信託終了の日までとします。

##### (受益証券の取得申込みの勧誘の種類)

第5条 この信託にかかる受益証券の取得申込みの勧誘は、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第9項で定める適格機関投資家私募により行われます。

##### (受益者)

第6条 この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とする中央三井アセットマネジメント株式会社の証券投資信託の受託者である信託業務を営む銀行とします。

##### (受益権の分割および再分割)

第7条 委託者は、第2条に規定する信託によって生じた受益権については、これを200億口を限度に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど、第8条の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

委託者は、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

##### (追加信託金の計算方法)

第8条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業

日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第24条に規定する借入れ公社債を除きます。）を法令および社団法人投資信託協会規則にしたが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。

#### （信託日時の変化する受益権の内容）

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

#### （受益証券の発行）

第10条 委託者は、第7条の規定により分割された受益権を表示する記名式の受益証券を発行します。

委託者が発行する受益証券は、1口の整数倍の口数を表示した受益証券とします。

受益者は、当該受益証券を他に譲渡することはできません。

#### （受益証券の発行についての受託者の認証）

第11条 委託者は、前条第1項により受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

#### （投資の対象とする資産の種類）

第12条 この信託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。

1. 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。）

A. 有価証券

B. 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、約款第19条、第20条および第21条に定めるものに限りません。）

C. 金銭債権（上記A、Bおよび下記Dに掲げるものに該当するものを除きます。）

D. 約束手形（上記Aに掲げるものに該当するものを除く。）

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

A. 為替手形

#### （運用の指図範囲等）

第13条 委託者は、信託金を、主として次の有価証券（本邦通貨表示のものに限りません。）（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

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

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券または優先出資引受権を表示する証券

9. 資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券（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。）および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証券で、前各号の証券または証券の性質を有するもの

13. 証券投資信託または外国証券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. 投資証券または外国投資証券（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または証券（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。）

17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券ならびに第12号および第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託者は、信託金を、前項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前号の権利の性質を有するもの

第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項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。

委託者は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

委託者は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

#### （運用の基本方針）

第14条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがってその指

図を行います。

#### （投資する株式等の範囲）

第15条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、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）で買付た有価証券の売買また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および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所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、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。

前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

#### （同 銘柄の株式等への投資制限）

第16条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

#### （同一銘柄の転換社債等への投資制限）

第17条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、なら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号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

#### （信用取引の指図範囲）

第18条 委託者は、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、株券の引渡しまた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。

前項の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は、すみ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。

#### (先物取引等の運用指図)

第19条 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、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。）および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。）なら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。）。

委託者は、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引なら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。

#### (スワップ取引の運用指図)

第20条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利また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。）を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第4条に定める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。

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。

委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### (金利先渡取引の運用指図)

第21条 委託者は、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。

金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第4条に定める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。

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。

委託者は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### (有価証券の貸付の指図および範囲)

第22条 委託者は、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および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1. 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。
2. 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。

前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。

委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### (公社債の空売り)

第23条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売りつ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、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡しまた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。

前項の売付けの指図は、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。

信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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)**

第24条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れを指図することができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

前項の指図は、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。

信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れ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。

第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

**(保管業務の委任)**

第25条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

**(有価証券の保管)**

第26条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

**(混蔵寄託)**

第27条 金融機関また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およ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。以下本条において同じ。)から、売買代金およ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またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関また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または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

**(一括登録)**

第28条 削除

**(信託財産の登記等および記載等の留保等)**

第29条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することができます。

前項ただし書きにかかわらず、受益者保護の

ために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

信託財産に属する旨の記載また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また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、受託者が認める場合は、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。

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。

**(有価証券の売却および再投資の指図)**

第30条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図をすることができます。

委託者は、前項の規定による売却代金、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、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することを指図することができます。

**(損益の帰属)**

第31条 委託者の指示に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

**(受託者による資金の立替え)**

第32条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

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、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者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。

前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

**(信託の計算期間)**

第33条 この信託の計算期間は、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。

前項の規定にかかわらず、前項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、第4条に定



める信託期間の終了日とします。

**(信託財産に関する報告)**

第34条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成してこれを委託者に提出します。

受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成してこれを委託者に提出します。

**(信託事務の諸費用)**

第35条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息(以下「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

**(信託報酬)**

第36条 委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

**(利益の留保)**

第37条 信託財産から生ずる利益は、信託終了日まで信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

**(追加信託金および一部解約金の計理処理)**

第38条 追加信託金または信託の一部解約金は、当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託にあっては追加信託差金、信託の一部解約にあっては解約差金として処理します。

**(償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責)**

第39条 受託者は、信託が終了したときは、償還金(信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。)の全額を委託者に交付します。

受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

**(償還金の支払い)**

第40条 委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引換えに受益者に当該償還金を支払います。

**(一部解約)**

第41条 委託者は、受益者の請求があった場合には、信託の一部を解約します。

解約金は、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から、当該金額に0.20%の率を乗じて得た金額を一部解約時の信託財産留保額として控除した金額に、当該一部解約にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

**(信託契約の解約)**

第42条 委託者は、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、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

委託者は、この信託の受益証券を投資対象とすることを信託約款において定める全ての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

委託者は、前2項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る受益証券を主要投資対象とする信託の知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る当該各信託の全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。

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

第4項から前項までの規定は、第2項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。

**(信託契約に関する監督官庁の命令)**

第43条 委託者は、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、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第47条の規定にしたがいます。

**(委託者の登録取消等に伴う取扱い)**

第44条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき

は、委託者は、この信託契約を解約し信託を終了させます。

前項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者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第47条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

**(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)**

第45条 委託者は、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。

委託者は、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。

**(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)**

第46条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第47条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し信託を終了させます。

**(信託約款の変更)**

第47条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る受益証券を主要投資対象とする信託の知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る当該各信託の全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超

えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

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

**(反対者の買取り請求権)**

第48条 第42条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第42条第4項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

**(公告)**

第49条 委託者が行う公告は、日本経済新聞に掲載します。

**(信託約款に関する疑義の取扱い)**

第50条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

**(付則)**

第1条 第21条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成13年1月23日

委託者 中央三井アセットマネジメント株式会社

受託者 中央三井信託銀行株式会社

## 親投資信託

### 中央三井日本債券マザーファンド

## 約 款

< 親投資信託 中央三井日本債券マザーファンド >

#### 運用の基本方針

約款第14条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

#### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

運用に際しては、中央三井アセット信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、中央三井アセット信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

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

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等なら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および金利に係るオプション取引なら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および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利また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。

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

#### 3. 投資制限

株式への投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

外貨建資産への投資は、行いません。

投資信託証券への投資は、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。

親投資信託（中央三井日本債券マザーファンド）約款

**（信託の種類、委託者および受託者）**

第1条 この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託であり、中央三井アセットマネジメント株式会社を委託者とし、中央三井アセット信託銀行株式会社を受託者とします。

この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

**（信託事務の委託）**

第1条の2 受託者は、信託法第26条第1項に基づき、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と信託契約を締結し、これを委託することができます。

**（信託の目的および金額）**

第2条 委託者は、金200億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

**（追加信託金限度額）**

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、金2兆円を上限として信託金を追加することができます。追加信託が行われたときは、受託者は、その引受けを証する書面を委託者に交付します。委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。

**（信託期間）**

第4条 この信託の期間は、信託契約締結日から第40条第1項、第40条第2項、第41条第1項、第42条第1項、および第44条第2項の規定による信託終了の日または信託契約解約の日とします。

**（受益証券の取得申込みの勧誘の種類）**

第5条 この信託にかかる受益証券の取得申込みの勧誘は、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第9項で定める適格機関投資家私募により行われます。

**（受益者）**

第6条 この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を対象とする中央三井アセットマネジメント株式会社の証券投資信託の受託者である信託業務を営む銀行とします。

**（受益権の分割および再分割）**

第7条 委託者は、第2条に規定する信託によって

生じた受益権については、これを200億口を限度に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど、第8条の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

委託者は、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

**（追加信託金の計算方法）**

第8条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第23条に規定する借入れ公社債を除きます。）を法令および社団法人投資信託協会規則にしたが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。

**（信託日時の異なる受益権の内容）**

第9条 この信託の受益者は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

**（受益証券の発行）**

第10条 委託者は、第7条の規定により分割された受益権を表示する記名式の受益証券を発行します。

委託者が発行する受益証券は、1口の整数倍の口数を表示した受益証券とします。

受益者は、当該受益証券を他に譲渡することはできません。

**（受益証券の発行についての受託者の認証）**

第11条 委託者は、前条第1項により受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

**（投資の対象とする資産の種類）**

第12条 この信託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。

1. 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。）

- A. 有価証券
  - B. 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、約款第18条、第19条および第20条に定めるものに限りません。）
  - C. 金銭債権（上記A、Bおよび下記Dに該当するものを除く。）
  - D. 約束手形（上記Aに掲げるものに該当するものを除く。）
2. 次に掲げる特定資産以外の資産

A. 為替手形

(運用の指図範囲等)

第13条 委託者は、信託金を、主として次の有価証券（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. 国債証券
- 2. 地方債証券
- 3. 特別の法律により法人の発行する債券
- 4. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（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。）
- 5. 資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 6. 転換社債の転換および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得した株券
- 7. コマーシャル・ペーパー
- 8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- 9. 証券投資信託または外国証券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。）

- 10. 投資証券または外国投資証券（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。）
- 11. 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。）
- 12. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 13. 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。）
- 14. 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。）
- 15. 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
- 16. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第6号の証券または証書および第8号の証券または証書のうち第6号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第1号から第5号までの証券および第8号の証券または証書のうち第1号から第5号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第9号の証券および第10号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託者は、信託金を、前項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前号の権利の性質を有するもの

第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項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。

委託者は、信託財産に属する投資信託証券の

時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

**(運用の基本方針)**

第14条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがってその指図を行います。

**(投資する株式等の範囲)**

第15条 委託者が投資することを指図する株式は、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の有価証券の売買また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および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所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、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

**(同一銘柄の株式等への投資制限)**

第16条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

**(転換社債等への投資制限)**

第17条 委託者は、信託財産に属する転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

**(先物取引等の運用指図)**

第18条 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、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。）および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。）なら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を指図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。）

委託者は、わが国の取引所における金利に係

る先物取引およびオプション取引なら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。

**(スワップ取引の運用指図)**

第19条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利また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。）を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第4条に定める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。

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。

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

**(金利先渡取引の運用指図)**

第20条 委託者は、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を指図することができます。

金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として第4条に定める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可能なものについてはこの限りではありません。

金利先渡取引の評価は、当該取引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。

委託者は、金利先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

**(有価証券の貸付の指図および範囲)**

第21条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。ただし、当該貸付は、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。

前項に定める限度額を超えることとなった場

合には、委託者は速やかに、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。

委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### (公社債の空売り)

第22条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない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、公社債(信託財産により借入れた公社債を含みます。)の引渡しまた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。

前項の売付けの指図は、当該売付けにかか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。

信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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)

第23条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

前項の指図は、当該借入れにかか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。

信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。

第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

#### (保管業務の委任)

第24条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任する

ことができます。

#### (有価証券の保管)

第24条の2 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

#### (混蔵寄託)

第25条 金融機関また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およ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。以下本条において同じ。)から、売買代金およ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またはコマースヤル・ペーパーは、当該金融機関また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または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

#### (一括登録)

第26条 削除

#### (信託財産の登記等および記載等の留保等)

第27条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することができます。

前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

信託財産に属する旨の記載また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また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、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することができます。

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

#### (有価証券の売却および再投資の指図)

第28条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

委託者は、前項の規定による売却代金、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、株式の配当およびその他の収入金を再投資することを指図することができます。

**(損益の帰属)**

第29条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

**(受託者による資金の立替え)**

第30条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

信託財産に属する有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等およ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もりうるものがあるときは、受託者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。

前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

**(信託の計算期間)**

第31条 この信託の計算期間は、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。

前項の規定にかかわらず、前項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、第4条に定める信託期間の終了日とします。

**(信託財産に関する報告)**

第32条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成してこれを委託者に提出します。

受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成してこれを委託者に提出します。

**(信託事務の諸費用)**

第33条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息(以下「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

**(信託報酬)**

第34条 委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

**(利益の留保)**

第35条 信託財産から生ずる利益は、信託終了日まで信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

**(追加信託金および一部解約金の計理処理)**

第36条 追加信託金または信託の一部解約金は、当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託にあっては追加信託差金、信託の一部解約にあっては解約差金として処理します。

**(償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責)**

第37条 受託者は、信託が終了したときは、償還金(信託終了日における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。)の全額を委託者に交付します。

受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

**(償還金の支払い)**

第38条 委託者は受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引換えに受益者に当該償還金を支払います。

**(一部解約)**

第39条 委託者は、受益者の請求があった場合には、信託の一部を解約します。

解約金は、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から、当該金額に0.10%の率を乗じて得た金額を、一部解約時の信託財産留保額として控除した金額に、当該一部解約にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

**(信託契約の解約)**

第40条 委託者は、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、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

委託者は、この信託の受益証券を投資対象とすることを信託約款において定める全ての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。



委託者は、前2項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る受益証券を主要投資対象とする信託の知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る当該各信託の全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。

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

第4項から前項までの規定は、第2項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。

#### (信託契約に関する監督官庁の命令)

第41条 委託者は、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、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

委託者は、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、第45条の規定にしたがいます。

#### (委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第42条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し信託を終了させます。

前項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者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第45条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

#### (委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第43条 委託者は、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。

委託者は、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。

#### (受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第44条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第45条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し信託を終了させます。

#### (信託約款の変更)

第45条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る受益証券を主要投資対象とする信託の知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る当該各信託の全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

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

**(反対者の買取り請求権)**

第46条 第40条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第40条第4項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

**(公告)**

第47条 委託者が行う公告は、日本経済新聞に掲載します。

**(信託約款に関する疑義の取扱い)**

第48条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

**(付則)**

第1条 第20条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成13年1月23日

委託者 中央三井アセットマネジメント株式会社

受託者 中央三井信託銀行株式会社

親投資信託  
中央三井外国株式マザーファンド  
約 款

< 親投資信託 中央三井外国株式マザーファンド >

運用の基本方針

約款第14条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

モルガン・スタンレー・キャピタル・インタ - ナショナル・コクサイ指数 (MSCIコクサイ指数) に採用されている国の株式に投資を行い、同指数 (円ベース) と連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用に際しては、中央三井アセット信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、中央三井アセット信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

株式の組入比率は、原則として高位 (90%以上) とします。

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

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

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等なら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および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引 (以下「有価証券先物取引等」といいます。) を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利また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。

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

### 3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

同一銘柄の転換社債、なら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号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券およ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。

親投資信託(中央三井外国株式マザーファンド)約款

**(信託の種類、委託者および受託者)**

第1条 この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託であり、中央三井アセットマネジメント株式会社を委託者とし、中央三井アセット信託銀行株式会社を受託者とします。

この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法(大正11年法律第62号)の適用を受けます。

**(信託事務の委託)**

第1条の2 受託者は、信託法第26条第1項に基づき、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と信託契約を締結し、これを委託することができます。

**(信託の目的および金額)**

第2条 委託者は、金200億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

**(追加信託金限度額)**

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、金2兆円を上限として信託金を追加することができます。

追加信託が行われたときは、受託者は、その引受けを証する書面を委託者に交付します。

委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。

**(信託期間)**

第4条 この信託の期間は、信託契約締結日から第44条第1項、第44条第2項、第45条第1項、第46条第1項および第48条第2項の規定による信託終了の日までとします。

**(受益証券の取得申込みの勧誘の種類)**

第5条 この信託にかかる受益証券の取得申込みの勧誘は、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第9項で定める適格機関投資家私募により行われます。

**(受益者)**

第6条 この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とする中央三井アセットマネジメント株式会社の証券投資信託の受託者である信託業務を営む銀行とします。

**(受益権の分割および再分割)**

第7条 委託者は、第2条に規定する信託によって生じた受益権については、これを200億口を限

度に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど、第8条の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

委託者は、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

**(追加信託金の計算方法)**

第8条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および第24条に規定する借入れ公社債を除きます。)を法令および社団法人投資信託協会規則にしたが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。

信託財産に属する外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。)、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

第26条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

**(信託日時の異なる受益権の内容)**

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

**(受益証券の発行)**

第10条 委託者は、第7条の規定により分割された受益権を表示する記名式の受益証券を発行します。

委託者が発行する受益証券は、1口の整数倍の口数を表示した受益証券とします。

受益者は、当該受益証券を他に譲渡することはできません。

**(受益証券の発行についての受託者の認証)**

第11条 委託者は、前条第1項により受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

**(投資の対象とする資産の種類)**

第12条 この信託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。

1. 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。)

A. 有価証券

B. 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、約款第19条、第20条および第21条に定めるものに限る。)

C. 金銭債権(上記A、Bおよび下記Dに該当するものを除く。以下同じ。)

D. 約束手形(上記Aに掲げるものに該当するものを除く。)

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

A. 為替手形

**(運用の指図範囲等)**

第13条 委託者は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)

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

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)

8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券または優先出資引受権を表示する証券

9. 資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券(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。))および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証券で、前各号の証券または証券の性質を有するもの

13. 投資信託また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せん。)

14. 投資証券または外国投資証券(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または証券(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)

17. 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

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前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証券ならびに第12号および第17号の証券または証券のうち第1号の証券または証券の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券ならびに第12号および第17号の証券または証券のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託者は、信託金を、前項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前号の権利の性質を有するもの

第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項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。

委託者は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

委託者は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

#### (運用の基本方針)

第14条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがってその指図を行います。

#### (投資する株式等の範囲)

第15条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所等(金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所)で有価証券の売買また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および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。))および外国金融商品市場(金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場で有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。))をいいます。以下同じ。)に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。

前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者

が投資することを指図することができるものとします。

#### (同一銘柄の株式等への投資制限)

第16条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

#### (同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第17条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、なら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号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の時価総額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

#### (信用取引の指図範囲)

第18条 委託者は、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す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、株券の引渡また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。

前項の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は、すみ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します。

#### (先物取引等の運用指図)

第19条 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、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。))および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号八に掲げるものをいいます。)なら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。)

委託者は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

委託者は、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引なら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。

#### (スワップ取引の運用指図)

第20条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利また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。)を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第4条に定める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。

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。

委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### (金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図)

第21条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第4条に定める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。

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

委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### (有価証券の貸付の指図および範囲)

第22条 委託者は、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および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1. 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。
2. 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。

前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。

委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### (公社債の空売り)

第23条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売りつ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、公社債(信託財産により借入れた公社債を含みます。)の引渡しまた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。

前項の売付けの指図は、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。

信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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)

第24条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れを指図することができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。



前項の指図は、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。

信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。

第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

**(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)**

第25条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

**(外国為替予約取引の指図)**

第26条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

**(保管業務の委任)**

第27条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

**(有価証券の保管)**

第28条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

**(混蔵寄託)**

第29条 金融機関また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およ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。以下本条において同じ。)から、売買代金およ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またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関また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または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

**(括登録)**

第30条 削除

**(信託財産の登記等および記載等の留保等)**

第31条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することができます。

前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

信託財産に属する旨の記載また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また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、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することができます。

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

**(有価証券の売却および再投資の指図)**

第32条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図をすることができます。

委託者は、前項の規定による売却代金、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、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することを指図することができます。

**(損益の帰属)**

第33条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

**(受託者による資金の立替え)**

第34条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

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、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者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。

前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

#### (信託の計算期間)

第35条 この信託の計算期間は、毎年2月8日から翌年2月7日までとすることを原則とします。

前項の規定にかかわらず、前項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、第4条に定める信託期間の終了日とします。

#### (信託財産に関する報告)

第36条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成してこれを委託者に提出します。

受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成してこれを委託者に提出します。

#### (信託事務の諸費用)

第37条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息(以下「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

#### (信託報酬)

第38条 委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

#### (利益の留保)

第39条 信託財産から生ずる利益は、信託終了日まで信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

#### (追加信託金および一部解約金の計理処理)

第40条 追加信託金または信託の一部解約金は、当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託にあつては追加信託差金、信託の一部解約にあつては解約差金として処理します。

#### (償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責)

第41条 受託者は、信託が終了したときは、償還金(信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同

じ。)の全額を委託者に交付します。

受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

#### (償還金の支払い)

第42条 委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引換えに受益者に当該償還金を支払います。

#### (一部解約)

第43条 委託者は、受益者の請求があつた場合には、信託の一部を解約します。

解約金は、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から、当該金額に0.20%の率を乗じて得た金額を一部解約時の信託財産留保額として控除した金額に、当該一部解約にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

#### (信託契約の解約)

第44条 委託者は、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、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

委託者は、この信託の受益証券を投資対象とすることを信託約款において定める全ての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

委託者は、前2項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。

委託者は、この信託契約の解約をしないこと

としたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

第4項から前項までの規定は、第2項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。

**(信託契約に関する監督官庁の命令)**

第45条 委託者は、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、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第49条の規定にしたがいます。

**(委託者の登録取消等に伴う取扱い)**

第46条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し信託を終了させます。

前項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者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第49条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

**(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)**

第47条 委託者は、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。

委託者は、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。

**(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)**

第48条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第49条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

**(信託約款の変更)**

第49条 委託者は、受益者の利益のため必要と認め

るときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

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

前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

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

**(反対者の買取り請求権)**

第50条 第44条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第44条第4項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

**(公告)**

第51条 委託者が行う公告は、日本経済新聞に掲載します。

**(信託約款に関する疑義の取扱い)**

第52条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

**(付則)**

第1条 第21条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間に係る国内また

は海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第2条 第21条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成13年2月22日

委託者 中央三井アセットマネジメント株式会社

受託者 中央三井信託銀行株式会社

親投資信託  
中央三井外国債券マザーファンド  
約 款

< 親投資信託 中央三井外国債券マザーファンド >

運用の基本方針

約款第14条に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

運用に際しては、中央三井アセット信託銀行株式会社との投資顧問契約に基づき、中央三井アセット信託銀行株式会社の運用部門から投資情報の提供を受け活用します。

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

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

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等なら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および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利また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。

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

3. 投資制限

株式への投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞ

れ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）を行使したものに限り、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

## 親投資信託（中央三井外国債券マザーファンド）約款

### （信託の種類、委託者および受託者）

第1条 この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託であり、中央三井アセットマネジメント株式会社を委託者とし、中央三井アセット信託銀行株式会社を受託者とします。

この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

### （信託事務の委託）

第1条の2 受託者は、信託法第26条第1項に基づき、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と信託契約を締結し、これを委託することができます。

### （信託の目的および金額）

第2条 委託者は、金200億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

### （追加信託金限度額）

第3条 委託者は、受託者と合意のうえ、金2兆円を上限として信託金を追加することができます。追加信託が行われたときは、受託者は、その引受けを証する書面を委託者に交付します。委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。

### （信託期間）

第4条 この信託の期間は、信託契約締結日から第42条第1項、第42条第2項、第43条第1項、第44条第1項および第46条第2項の規定による信託期間終了の日までとします。

### （受益証券の取得申込みの勧誘の種類）

第5条 この信託にかかる受益証券の取得申込みの勧誘は、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第9項で定める適格機関投資家私募により

行われます。

### （受益者）

第6条 この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とする中央三井アセットマネジメント株式会社の証券投資信託の受託者である信託業務を営む銀行とします。

### （受益権の分割および再分割）

第7条 委託者は、第2条に規定する信託によって生じた受益権については、これを200億口を限度に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど、第8条の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

委託者は、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

### （追加信託金の計算方法）

第8条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第22条に規定する借入れ公社債を除きます。）を法令および社団法人投資信託協会規則にしたが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。

信託財産に属する外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

第24条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

### （信託日時異なる受益権の内容）

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

**(受益証券の発行)**

第10条 委託者は、第7条の規定により分割された受益権を表示する記名式の受益証券を発行します。

委託者が発行する受益証券は、1口の整数倍の口数を表示した受益証券とします。

受益者は、当該受益証券を他に譲渡することはできません。

**(受益証券の発行についての受託者の認証)**

第11条 委託者は、前条第1項により受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

**(投資の対象とする資産の種類)**

第12条 この信託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。

1. 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。)

A. 有価証券

B. 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、約款第17条、第18条および第19条に定めるものに限りません。)

C. 金銭債権(上記A、Bおよび下記Dに該当するものを除く。以下同じ。)

D. 約束手形(上記Aに掲げるものに該当するものを除く。)

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

A. 為替手形

**(運用の指図範囲等)**

第13条 委託者は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 国債証券

2. 地方債証券

3. 特別の法律により法人の発行する債券

4. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(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。)

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

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

7. コマーシャル・ペーパー

8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

9. 投資信託また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。)

10. 投資証券または外国投資証券(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。)

11. 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。)

12. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

13. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)

14. 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。)

15. 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

16. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第6号の証券または証書および第8号の証券または証書のうち第6号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第1号から第5号までの証券および第8号の証券または証書のうち第1号から第5号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第9号の証券および第10号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託者は、信託金を、前項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前号の権利の性質を有するもの

第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前項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。

委託者は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

#### (運用の基本方針)

第14条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがってその指図を行います。

#### (投資する株式等の範囲)

第15条 委託者が投資することを指図する株式は、金融商品取引所等(金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所)で有価証券の売買また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および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)および外国金融商品市場(金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場で有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。)をいいます。以下同じ。)に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式についてはこの限りではありません。

前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができます。

#### (同 銘柄の株式等への投資制限)

第16条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

#### (先物取引等の運用指図)

第17条 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、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。)および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。)なら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。)

委託者は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

委託者は、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引なら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。

#### (スワップ取引の運用指図)

第18条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利また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。)を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第4条に定める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。

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。

委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### (金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図)

第19条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替



先渡取引を行うことの指図をすることができます。

金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第4条に定める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。

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

委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### (有価証券の貸付の指図および範囲)

第20条 委託者は、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および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1. 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。
2. 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。

前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。

委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### (公社債の空売り)

第21条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売りつ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、公社債(信託財産により借入れた公社債を含みます。)の引渡また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。

前項の売付けの指図は、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。

信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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)

第22条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れを指図することができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

前項の指図は、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。

信託財産の一部解約等の事由により、前項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、委託者は速やかに、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。

第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

#### (特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第23条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### (外国為替予約取引の指図)

第24条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

前項の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

#### (保管業務の委任)

第25条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

#### (有価証券の保管)

第26条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、

法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

**(混蔵寄託)**

第27条 金融機関また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およ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。以下本条において同じ。）から、売買代金およ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またはコマース・ペーパーは、当該金融機関また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または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

**(一括登録)**

第28条 削除

**(信託財産の登記等および記載等の留保等)**

第29条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することができます。

前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

信託財産に属する旨の記載また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また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、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することができます。

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

**(有価証券の売却および再投資の指図)**

第30条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図をすることができます。

委託者は、前項の規定による売却代金、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、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することを指図することができます。

**(損益の帰属)**

第31条 委託者の指図に基づく行為により信託財産

に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

**(受託者による資金の立替え)**

第32条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

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、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者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。

前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議により、そのつど別にこれを定めます。

**(信託の計算期間)**

第33条 この信託の計算期間は、毎年2月8日から翌年2月7日までとすることを原則とします。

前項の規定にかかわらず、前項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、第4条に定める信託期間の終了日とします。

**(信託財産に関する報告)**

第34条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成してこれを委託者に提出します。

受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成してこれを委託者に提出します。

**(信託事務の諸費用)**

第35条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

**(信託報酬)**

第36条 委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を受取しません。

**(利益の留保)**

第37条 信託財産から生ずる利益は、信託終了日まで信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

**(追加信託金および一部解約金の計理処理)**

第38条 追加信託金または信託の一部解約金は、当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加

信託にあっては追加信託差金、信託の一部解約にあっては解約差金として処理します。

**(償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責)**

第39条 受託者は、信託が終了したときは、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）の全額を委託者に交付します。

受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

**(償還金の支払い)**

第40条 委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引換えに受益者に当該償還金を支払います。

**(一部解約)**

第41条 委託者は、受益者の請求があった場合には、信託の一部を解約します。

解約金は、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から、当該金額に0.10%の率を乗じて得た金額を一部解約時の信託財産留保額として控除した金額に、当該一部解約にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

**(信託契約の解約)**

第42条 委託者は、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、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

委託者は、この信託の受益証券を投資対象とすることを信託約款において定める全ての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

委託者は、前2項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間

は一月を下らないものとします。

前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。

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

第4項から前項までの規定は、第2項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。

**(信託契約に関する監督官庁の命令)**

第43条 委託者は、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、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第47条の規定にしたがいます。

**(委託者の登録取消等に伴う取扱い)**

第44条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し信託を終了させます。

前項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者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第47条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

**(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)**

第45条 委託者は、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。

委託者は、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。

**(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)**

第46条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第47条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

**(信託約款の変更)**

第47条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

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

前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

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

**(反対者の買取り請求権)**

第48条 第42条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第42条第4項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

**(公告)**

第49条 委託者が行う公告は、日本経済新聞に掲載します。

**(信託約款に関する疑義の取扱い)**

第50条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

**(付則)**

第1条 第19条に規定する「金利先渡取引」は、当

事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第2条 第19条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成13年2月22日

委託者 中央三井アセットマネジメント株式会社

受託者 中央三井信託銀行株式会社

## あ行

運用報告書

運用報告書とは、ファンドの運用状況・実績等を受益者に説明するための報告書です。委託会社が決算日毎（計算期間が6ヶ月未満の場合には、6ヶ月毎）に作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付することが義務づけられているものです。

## か行

解約価額

解約価額とは、投資信託（ファンド）を解約するときの価格のことです。  
解約価額 = 基準価額 - 信託財産留保額

解約金

解約金とは、受益者が信託期間の途中で受益証券（振替受益権を含みます。）を換金する場合に、受益者に支払われるものです。解約を請求した日の数営業日後（ファンドによって異なります）に、販売会社で支払われます。

解約請求

解約請求は、委託会社に対して投資信託の一部解約を請求する方法です。この場合、受益者は委託会社に対して直接、解約請求をするのではなく、販売会社を通じて解約請求をすることとなります。

基準価額

基準価額とは、投資信託（ファンド）の受益権1口当たりの価格（時価）のことです。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。

## さ行

収益分配金

収益分配金とは、計算期間中の投資信託の運用収益について、計算期末に受益権口数に応じて受益者に支払われるものです。その金額は、委託会社が収益分配方針に基づいて決定します。場合によっては、分配金が全く支払われないこともあります。

受益者

受益者とは、投資信託の利益を受ける権利（受益権）を有する者のことをいいます。

償還金

償還金とは、投資信託の信託終了日に、終了時の信託財産（純資産総額）を受益権口数に応じて分割して、全ての受益者に支払われるものです。

償還乗換優遇制度

過去に購入したファンドが償還を迎えて、償還後3ヶ月以内にその償還金で新たに別のファンドを購入する場合等には、同じ販売会社を利用すると、募集・販売手数料が優遇される場合があります。

|          |   |
|----------|---|
| 証券投資信託契約 | 証券投資信託契約とは、投資信託の法的根拠となる契約のことをいい、投資信託会社（委託者）と信託銀行（受託者）の間で締結されます。このような契約に基づいて設立される投資信託は契約型投資信託といわれ、わが国の投資信託の大半はこの契約型となっています。  |
| 信託財産留保額  | 投資信託を解約する際には、その投資信託で保有する株式・債券などの売却などに係る費用が発生します。信託財産留保額は、この費用相当額を、費用が発生する契機となった解約者にご負担いただき、信託財産に残すという趣旨から設けられたものです。<br>信託財産留保額を解約者にご負担いただくことで、投資信託を保有し続ける受益者と解約請求する受益者との間の公平性を保つとともに、短期解約防止による信託財産の安定を図ることを目的とするものです。信託財産留保額は、基準価額に一定率を掛けた額となります。 |
| 信託報酬     | 信託報酬とは、委託者（投資信託会社）と受託者（受託銀行）が、投資信託において行う業務（サービス）の対価のことをいい、委託者報酬と受託者報酬の2つに分かれます。   |
| 信託約款     | 信託約款とは、証券投資信託契約の具体的内容を規定したものであり、実質的には証券投資信託契約と同じものです。   |

## は行

|          |  |
|----------|--|
| 募集・販売手数料 | 投資信託の募集・販売による購入時に販売会社に対して支払う手数料です。手数料率は、ファンドによって異なり、また、申込金額（口数）に応じて格差があるのが一般的です。 |
|----------|--|

## ま行

|      |   |
|------|---|
| 目論見書 | 目論見書とは、ファンドを投資家に募集・販売するにあたって、投資家（受益者）のために投信会社が作成し、販売会社を通じて投資家に交付することが義務づけられている説明書のことです。ファンドの特色、運用方針、収益分配方針などが記載されています。<br>目論見書には、投資家にあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（「交付目論見書」といいます。）と投資家から交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（「請求目論見書」といいます。）があります。 |
|------|---|

# 新生・4分散ファンド

## 追加型株式投資信託 / バランス型

### 投資信託説明書（請求目論見書）訂正事項分

2008年8月

新生・4分散ファンドは、実質的に国内外の株式や公社債を主要投資対象としております。組入れた有価証券の値動き、為替相場の変動等の影響や組入れた有価証券の発行体の経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化等により、ファンドの基準価額も変動し、これにより投資元本を割り込むことがあります。

従って、当ファンドは元本保証のある商品ではありません。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資家の皆様に帰属します。

ご投資家の皆様におかれましては、投資信託説明書（交付目論見書）も併せてよくお読みいただき、商品の内容・リスクを十分ご理解のうえ、お申込みいただきますようお願い申し上げます。

新生・4分散ファンドの募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条の規定により有価証券届出書を平成19年10月5日に関東財務局長に提出しており、平成19年10月21日に届出の効力が生じております。また、委託会社は、金融商品取引法第7条の規定により、有価証券届出書の訂正届出書を平成20年8月26日関東財務局長に提出しております。

中央三井アセットマネジメント株式会社

投資信託説明書（請求目論見書）は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

## ・投資信託説明書（請求目論見書）の訂正理由

新生・4分散ファンドの投資信託説明書（請求目論見書）（以下「原請求目論見書」といいます。）の記載事項のうち、有価証券報告書及び有価証券届出書の訂正届出書を提出したことに伴う追加・訂正事項がありましたので、関係事項を下記のとおり訂正するものです。

## ・訂正箇所及び訂正事項（訂正後の内容を記載しております。）

### 【ファンドの詳細情報】

#### 第4【ファンドの経理状況】（原請求目論見書9頁を以下の情報に更新します。）

（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19年10月31日から平成20年6月10日まで）の財務諸表について、監査法人トーマツによる監査を受けております。



# 独立監査人の監査報告書

平成20年8月8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

監査法人 トーマツ

指定社員  
業務執行社員

公認会計士

浅子正明

印

指定社員  
業務執行社員

公認会計士

木村充男

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」に掲げられている新生・4分散ファンドの平成19年10月31日から平成20年6月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新生・4分散ファンドの平成20年6月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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。

# 1【財務諸表】

## 新生・4分散ファンド

### (1)【貸借対照表】

| 項目        | 第 1 期<br>(平成20年6月10日現在)<br>金額(円) |
|-----------|----------------------------------|
| 資産の部      |                                  |
| 流動資産      |                                  |
| 親投資信託受益証券 | 1,310,601,775                    |
| 未収入金      | 368,023                          |
| 流動資産合計    | 1,310,969,798                    |
| 資産合計      | 1,310,969,798                    |
| 負債の部      |                                  |
| 流動負債      |                                  |
| 未払解約金     | 368,023                          |
| 未払受託者報酬   | 92,251                           |
| 未払委託者報酬   | 1,353,007                        |
| その他未払費用   | 7,673                            |
| 流動負債合計    | 1,820,954                        |
| 負債合計      | 1,820,954                        |
| 純資産の部     |                                  |
| 元本等       |                                  |
| 元本        | 1,428,855,625                    |
| 剰余金       |                                  |
| 期末欠損金     | 119,706,781                      |
| 純資産合計     | 1,309,148,844                    |
| 負債・純資産合計  | 1,310,969,798                    |

( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

| 項目                  | 第 1 期                                       |
|---------------------|---|
|                     | 自 平成19年10月31日<br>至 平成20年 6 月10日<br>金額 ( 円 ) |
| 営業収益                |   |
| 受取利息                | 9,018                                       |
| 有価証券売買等損益           | 70,740,920                                  |
| 営業収益合計              | 70,731,902                                  |
| 営業費用                |   |
| 受託者報酬               | 452,588                                     |
| 委託者報酬               | 6,637,859                                   |
| その他費用               | 37,647                                      |
| 営業費用合計              | 7,128,094                                   |
| 営業損失金額              | 77,859,996                                  |
| 経常損失金額              | 77,859,996                                  |
| 当期純損失金額             | 77,859,996                                  |
| 一部解約に伴う当期純損失金額分配額   | 6,096,305                                   |
| 剰余金増加額              | 2,532,536                                   |
| ( 当期一部解約に伴う剰余金増加額 ) | ( 2,532,536 )                               |
| 剰余金減少額              | 50,475,626                                  |
| ( 当期追加信託に伴う剰余金減少額 ) | ( 50,475,626 )                              |
| 期末欠損金               | 119,706,781                                 |

( 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19年10月31日<br>至 平成20年 6 月10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<br>移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、基準価額で評価しております。  |
| 2 . その他             | ファンドの計算期間<br>当ファンドの計算期間は、原則として、毎年 6 月11日<br>から翌年 6 月10日までとなっておりますが、第 1 期計算<br>期間は信託約款の定めにより、平成19年10月31日から平<br>成20年 6 月10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<br>(平成20年6月10日現在) |
|--|-------------------------|
| 1. 当該計算期間の末日における受益権総数                                | 1,428,855,625 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<br>119,706,781 円  |
| 3. 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額)                         | 0.9162 円<br>(9,162 円)   |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

|               | 第 1 期<br>自 平成19年10月31日<br>至 平成20年6月10日  |
|---------------|---|
| 1. 分配金の計算過程   | 計算期間末における費用控除後の配当等収益(11,951,690円)(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19,070,766円を含みます。)、費用控除後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(1,775,276円)より分配対象収益は、13,726,966円(1万口当たり96.06円)ですが、長期的な信託財産の成長に資するため、分配を行っておりません。 |
| 2. 剰余金増加額・減少額 | 当期一部解約に伴う剰余金増加額及び当期追加信託に伴う剰余金減少額は、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。  |

## (関連当事者との取引に関する注記)

| 第 1 期<br>自 平成19年10月31日<br>至 平成20年6月10日 |
|--|
| 該当事項はありません。                            |

## (重要な後発事象に関する注記)

| 第 1 期<br>自 平成19年10月31日<br>至 平成20年6月10日 |
|--|
| 該当事項はありません。                            |

(その他の注記)

1. 本書における開示対象ファンドの当該計算期間における元本額の変動

|           | 第 1 期<br>自 平成19年10月31日<br>至 平成20年 6 月10日 |
|-----------|--|
| 期首元本額     | 475,020,555 円                            |
| 期中追加設定元本額 | 1,040,544,685 円                          |
| 期中一部解約元本額 | 86,709,615 円                             |

2. 有価証券関係  
売買目的有価証券

|           | 第 1 期<br>(平成20年 6 月10日現在) |  |
|-----------|---------------------------|--|
| 種類        | 貸借対照表計上額<br>(円)           | 最終の計算期間(自 平成19年10月31日 至 平成20年 6 月10日)の損益に含まれた評価差額(円) |
| 親投資信託受益証券 | 1,310,601,775             | 63,070,602   |
| 合計        | 1,310,601,775             | 63,070,602   |

3. デリバティブ取引関係

第1期(自 平成19年10月31日 至 平成20年 6 月10日)

当ファンドは、デリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

(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<br>受益証券 | 中央三井日本株式マザーファンド | 286,822,009   | 333,889,500   |    |
|               | 中央三井日本債券マザーファンド | 297,220,841   | 321,830,726   |    |
|               | 中央三井外国株式マザーファンド | 239,733,320   | 329,177,821   |    |
|               | 中央三井外国債券マザーファンド | 178,732,222   | 325,703,728   |    |
| 合計            |                 | 1,002,508,392 | 1,310,601,775 |    |

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。

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。

<参考>

「新生・4分散ファンド」は、「中央三井日本株式マザーファンド」、「中央三井日本債券マザーファンド」、「中央三井外国株式マザーファンド」及び「中央三井外国債券マザーファンド」の受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている「親投資信託受益証券」は、各マザーファンドの受益証券であります。

各マザーファンドの平成20年6月10日現在（以下、「計算日」といいます。）の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

「中央三井日本株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 項目       | 平成20年6月10日現在<br>金額(円) |
|----------|-----------------------|
| 資産の部     |                       |
| 流動資産     |                       |
| コール・ローン  | 6,835,827,182         |
| 株式       | 279,559,217,474       |
| 派生商品評価勘定 | 663,837,650           |
| 未収配当金    | 2,015,078,461         |
| 未収利息     | 93,227                |
| 流動資産合計   | 289,074,053,994       |
| 資産合計     | 289,074,053,994       |
| 負債の部     |                       |
| 流動負債     |                       |
| 派生商品評価勘定 | 1,481,825             |
| 前受金      | 765,020,000           |
| 未払解約金    | 122,505,476           |
| 流動負債合計   | 889,007,301           |
| 負債合計     | 889,007,301           |
| 純資産の部    |                       |
| 元本等      |                       |
| 元本       | 247,569,994,601       |
| 剰余金      |                       |
| 剰余金      | 40,615,052,092        |
| 純資産合計    | 288,185,046,693       |
| 負債・純資産合計 | 289,074,053,994       |

( 2 ) 注記表

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

| 平成20年 6 月10日現在        |   |
|-----------------------|---|
| 1 . 有価証券の評価基準及び評価方法   | 株式<br>移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。  |
| 2 . デリバティブの評価基準及び評価方法 | 株価指数先物取引<br>個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。<br><br>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<br>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。<br><br>( 2 ) 派生商品取引等損益の計上基準<br>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20年 6 月10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。<br>株式 1,355,000,000 円<br><br>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                  | 247,569,994,601 口   |
| 3 . 1 口当たり純資産額<br>( 1 万口当たり純資産額 ) | 1.1641 円<br>( 11,641 円 )  |

( 関連当事者との取引に関する注記 )

| 平成20年 6 月10日現在 |
|----------------|
| 該当事項はありません。    |

( 重要な後発事象に関する注記 )

| 平成20年 6 月10日現在 |
|----------------|
| 該当事項はありません。    |

(その他の注記)

1. 本書における開示対象ファンドの当該計算期間における「中央三井日本株式マザーファンド」の元本額の変動

| 平成20年6月10日現在  |                          |
|---|--------------------------|
| 「新生・4分散ファンド」の第1期計算期間(平成19年10月31日から平成20年6月10日まで)における「中央三井日本株式マザーファンド」の元本額の変動及び計算日の元本額の内訳 |                          |
| 同計算期間の期首元本額   | 219,846,161,274 円        |
| 同計算期間中の追加設定元本額  | 42,795,870,475 円         |
| 同計算期間中の一部解約元本額  | <u>15,072,037,148 円</u>  |
| 計算日の元本額   | <u>247,569,994,601 円</u> |
| 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  | 1,951,796,665 円          |
| 中央三井DC日本株式インデックスファンド  | 246,687,797 円            |
| 中央三井DC日本株式インデックスファンドL   | 28,132,733,209 円         |
| 中央三井DC日本株式インデックスファンドA   | 1,394,395,326 円          |
| 中央三井DCバランスファンド30  | 62,471,897 円             |
| 中央三井DCバランスファンド50  | 176,054,660 円            |
| 中央三井DCバランスファンド70  | 136,855,896 円            |
| ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)  | 487,735,034 円            |
| ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)  | 262,721,011 円            |
| 新生・4分散ファンド  | 286,822,009 円            |
| ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド   | 146,293,605 円            |
| 4資産インデックスバランスオープン(分配型)  | 70,966,821 円             |
| 4資産インデックスバランスオープン(成長型)  | 122,891,271 円            |
| 中央三井日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)   | 43,568,754,653 円         |
| 中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)   | 6,703,900,995 円          |
| 中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)   | 55,201,919,199 円         |
| 中央三井VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)  | 39,400,108,366 円         |
| 中央三井VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)  | 6,194,804,663 円          |
| 中央三井VAバランス株式30(適格機関投資家専用)   | 734,602,566 円            |
| 中央三井VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)  | 7,211,815,474 円          |
| 中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)   | 4,118,018,633 円          |
| 中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)   | 1,397,211,432 円          |
| 中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)  | 31,190,346,387 円         |
| 中央三井バランスVA75(適格機関投資家専用)   | 1,593,263,090 円          |
| 中央三井VL株式30(適格機関投資家専用)   | 11,146,631 円             |
| 中央三井VL株式50(適格機関投資家専用)   | 19,929,879 円             |
| 中央三井VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)  | 13,357,654,060 円         |
| 中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)  | 1,721,287,727 円          |
| 中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)  | 69,599,168 円             |
| 中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)   | 1,038,347,635 円          |
| 中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)   | 553,499,955 円            |
| CMAM・バランスファンドVA(適格機関投資家専用)  | 5,358,887 円              |



2. 有価証券関係  
 売買目的有価証券

| 平成20年6月10日現在 |                 |   |
|--------------|-----------------|---|
| 種類           | 貸借対照表計上額(円)     | 「新生・4分散ファンド」の第1期計算期間において、「中央三井日本株式マザーファンド」の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式           | 279,559,217,474 | 31,482,701,596  |
| 合計           | 279,559,217,474 | 31,482,701,596  |

(注) 評価差額は、「中央三井日本株式マザーファンド」の期首(平成20年1月23日)から計算日までの期間に対応するものです。

3. デリバティブ取引関係  
 取引の状況に関する事項

| 平成20年6月10日現在             |  |
|--------------------------|--|
| 1. 取引の内容                 | 当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株式関連の株価指数先物取引であります。  |
| 2. 取引に対する取組方針            | 株価指数先物取引は、ファンド運用の効率化を図ること及び将来の株価の変動によるリスク回避を目的としており、投機的な取引は行わない方針であります。  |
| 3. 取引の利用目的               | 株価指数先物取引は、ファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、キャッシュ運用の効率化、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用しております。               |
| 4. 取引に係るリスクの内容           | 株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。   |
| 5. 取引に係るリスク管理体制          | 組織的な管理体制により、日々のポジション、評価金額及び評価損益の管理を行っております。また、リスク管理は、デリバティブ取引に限定することなく、デリバティブ取引と現物資産等を総合的に勘案し、各ファンド全体でのリスク管理を、リスクの種類ごとに実施しております。 |
| 6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 | 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、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。                                |

・取引の時価等に関する事項  
 デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益  
 株式関連

| 区分   | 種類             | 平成20年6月10日現在  |       |               |             |
|------|----------------|---------------|-------|---------------|-------------|
|      |                | 契約額等(円)       |       | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|      |                |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買建 | 8,012,189,175 |       | 8,674,545,000 | 662,355,825 |
|      | 合計             | 8,012,189,175 |       | 8,674,545,000 | 662,355,825 |

(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、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は証拠金算定基準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。

## (3) 附属明細表(平成20年6月10日現在)

## 有価証券明細表

## A. 株式

| 銘柄               | 株式数     | 評価額       |               | 備考 |
|------------------|---------|-----------|---------------|----|
|                  |         | 単価(円)     | 金額(円)         |    |
| 極洋               | 75,000  | 214       | 16,050,000    |    |
| 日本水産             | 189,200 | 453       | 85,707,600    |    |
| マルハニチロホールディングス   | 322,000 | 196       | 63,112,000    |    |
| サカタのタネ           | 32,300  | 1,681     | 54,296,300    |    |
| ホクト              | 14,600  | 2,185     | 31,901,000    |    |
| 日鉄鉱業             | 48,000  | 479       | 22,992,000    |    |
| 国際石油開発帝石ホールディングス | 805     | 1,330,000 | 1,070,650,000 |    |
| 関東天然瓦斯開発         | 22,000  | 745       | 16,390,000    |    |
| 石油資源開発           | 16,700  | 7,510     | 125,417,000   |    |
| ショーボンドホールディングス   | 18,200  | 1,413     | 25,716,600    |    |
| ダイセキ環境ソリューション    | 13      | 272,000   | 3,536,000     |    |
| 東急建設             | 72,550  | 361       | 26,190,550    |    |
| コムシスホールディングス     | 93,000  | 943       | 87,699,000    |    |
| 高松建設             | 17,400  | 1,265     | 22,011,000    |    |
| 東建コーポレーション       | 6,960   | 3,860     | 26,865,600    |    |
| ヤマウラ             | 25,000  | 222       | 5,550,000     |    |
| オリエンタル白石         | 17,500  | 248       | 4,340,000     |    |
| 大成建設             | 779,000 | 275       | 214,225,000   |    |
| 大林組              | 492,000 | 519       | 255,348,000   |    |
| 清水建設             | 500,000 | 528       | 264,000,000   |    |
| 長谷工コーポレーション      | 780,500 | 154       | 120,197,000   |    |
| 松井建設             | 30,000  | 328       | 9,840,000     |    |
| 鹿島建設             | 722,000 | 395       | 285,190,000   |    |
| 太平工業             | 35,000  | 442       | 15,470,000    |    |
| 西松建設             | 206,000 | 293       | 60,358,000    |    |
| 前田建設工業           | 121,000 | 409       | 49,489,000    |    |
| 奥村組              | 156,000 | 468       | 73,008,000    |    |
| 小田急建設            | 26,000  | 237       | 6,162,000     |    |
| 東鉄工業             | 24,000  | 667       | 16,008,000    |    |
| 戸田建設             | 173,000 | 427       | 73,871,000    |    |
| 青木あすなろ建設         | 18,500  | 555       | 10,267,500    |    |
| 北野建設             | 59,000  | 239       | 14,101,000    |    |
| 三井ホーム            | 31,000  | 549       | 17,019,000    |    |
| 矢作建設工業           | 33,000  | 578       | 19,074,000    |    |
| ピーエス三菱           | 17,800  | 231       | 4,111,800     |    |
| 大東建託             | 72,400  | 5,460     | 395,304,000   |    |
| 新日本建設            | 22,300  | 208       | 4,638,400     |    |
| NIPPOコーポレーション    | 38,000  | 580       | 22,040,000    |    |
| 前田道路             | 52,000  | 769       | 39,988,000    |    |
| 日本道路             | 68,000  | 170       | 11,560,000    |    |
| 五洋建設             | 204,000 | 191       | 38,964,000    |    |
| 大成ロテック           | 41,000  | 162       | 6,642,000     |    |
| 大林道路             | 31,000  | 166       | 5,146,000     |    |
| 福田組              | 38,000  | 369       | 14,022,000    |    |
| 住友林業             | 121,100 | 837       | 101,360,700   |    |
| 日本基礎技術           | 28,100  | 234       | 6,575,400     |    |
| 巴コーポレーション        | 32,800  | 200       | 6,560,000     |    |
| パナホーム            | 58,000  | 591       | 34,278,000    |    |
| 大和ハウス工業          | 439,000 | 1,232     | 540,848,000   |    |
| ライト工業            | 42,700  | 248       | 10,589,600    |    |
| 積水ハウス            | 495,000 | 1,081     | 535,095,000   |    |

| 銘柄            | 株式数     | 評価額   |             | 備考 |
|---------------|---------|-------|-------------|----|
|               |         | 単価(円) | 金額(円)       |    |
| 北陸電気工事        | 14,000  | 326   | 4,564,000   |    |
| コミュニチュア       | 18,000  | 666   | 11,988,000  |    |
| ユアテック         | 30,000  | 636   | 19,080,000  |    |
| 西部電気工業        | 18,000  | 488   | 8,784,000   |    |
| 四電工           | 18,000  | 591   | 10,638,000  |    |
| 中電工           | 26,300  | 1,810 | 47,603,000  |    |
| 関電工           | 83,000  | 674   | 55,942,000  |    |
| 大明            | 28,000  | 1,003 | 28,084,000  |    |
| きんでん          | 104,000 | 1,021 | 106,184,000 |    |
| 東京エネシス        | 22,000  | 600   | 13,200,000  |    |
| トーエネック        | 28,000  | 550   | 15,400,000  |    |
| 住友電設          | 16,900  | 704   | 11,897,600  |    |
| 日本電設工業        | 34,000  | 894   | 30,396,000  |    |
| 協和エクシオ        | 65,000  | 1,003 | 65,195,000  |    |
| 新日本空調         | 16,200  | 697   | 11,291,400  |    |
| 東電通           | 33,000  | 227   | 7,491,000   |    |
| 日本電話施設        | 34,000  | 293   | 9,962,000   |    |
| 九電工           | 39,000  | 695   | 27,105,000  |    |
| 三機工業          | 44,000  | 818   | 35,992,000  |    |
| 日揮            | 177,000 | 2,135 | 377,895,000 |    |
| 中外炉工業         | 65,000  | 510   | 33,150,000  |    |
| ヤマト           | 24,000  | 258   | 6,192,000   |    |
| 太平電業          | 28,000  | 934   | 26,152,000  |    |
| 高砂熱学工業        | 52,000  | 933   | 48,516,000  |    |
| 日立プラントテクノロジー  | 48,000  | 394   | 18,912,000  |    |
| 三晃金属工業        | 29,000  | 238   | 6,902,000   |    |
| NEC ネットズエスアイ  | 15,600  | 1,374 | 21,434,400  |    |
| 朝日工業社         | 24,000  | 389   | 9,336,000   |    |
| 大気社           | 27,100  | 1,531 | 41,490,100  |    |
| ダイダン          | 27,000  | 491   | 13,257,000  |    |
| 日比谷総合設備       | 28,000  | 893   | 25,004,000  |    |
| 東芝プラントシステム    | 29,000  | 930   | 26,970,000  |    |
| 東洋エンジニアリング    | 103,000 | 601   | 61,903,000  |    |
| 千代田化工建設       | 132,000 | 1,149 | 151,668,000 |    |
| 新興プランテック      | 31,700  | 1,568 | 49,705,600  |    |
| 日本製粉          | 110,000 | 448   | 49,280,000  |    |
| 日清製粉グループ本社    | 162,500 | 1,271 | 206,537,500 |    |
| 日東富士製粉        | 16,000  | 320   | 5,120,000   |    |
| 昭和産業          | 79,000  | 280   | 22,120,000  |    |
| 鳥越製粉          | 14,000  | 720   | 10,080,000  |    |
| 日本農産工業        | 57,000  | 282   | 16,074,000  |    |
| 協同飼料          | 61,000  | 170   | 10,370,000  |    |
| 中部飼料          | 17,000  | 926   | 15,742,000  |    |
| 日本配合飼料        | 49,000  | 203   | 9,947,000   |    |
| ユニ・チャーム ペットケア | 10,000  | 3,110 | 31,100,000  |    |
| 東洋精糖          | 29,000  | 122   | 3,538,000   |    |
| 日本甜菜製糖        | 97,000  | 248   | 24,056,000  |    |
| 三井製糖          | 76,000  | 379   | 28,804,000  |    |
| 森永製菓          | 185,000 | 205   | 37,925,000  |    |
| 明治製菓          | 263,000 | 466   | 122,558,000 |    |
| 中村屋           | 41,000  | 450   | 18,450,000  |    |
| 江崎グリコ         | 64,000  | 1,136 | 72,704,000  |    |
| 名糖産業          | 9,300   | 2,140 | 19,902,000  |    |

| 銘柄                 | 株式数     | 評価額     |               | 備考 |
|--------------------|---------|---------|---------------|----|
|                    |         | 単価(円)   | 金額(円)         |    |
| 不二家                | 95,000  | 151     | 14,345,000    |    |
| 山崎製パン              | 129,000 | 1,098   | 141,642,000   |    |
| 第一屋製パン             | 23,000  | 136     | 3,128,000     |    |
| モロゾフ               | 27,000  | 324     | 8,748,000     |    |
| 明治乳業               | 225,000 | 559     | 125,775,000   |    |
| 雪印乳業               | 192,500 | 328     | 63,140,000    |    |
| 森永乳業               | 149,000 | 291     | 43,359,000    |    |
| ヤクルト本社             | 94,300  | 2,885   | 272,055,500   |    |
| プリマハム              | 98,000  | 127     | 12,446,000    |    |
| 日本ハム               | 134,000 | 1,458   | 195,372,000   |    |
| 伊藤ハム               | 113,000 | 517     | 58,421,000    |    |
| 林兼産業               | 56,000  | 129     | 7,224,000     |    |
| 丸大食品               | 71,000  | 227     | 16,117,000    |    |
| 米久                 | 15,500  | 1,305   | 20,227,500    |    |
| S Foods            | 9,500   | 740     | 7,030,000     |    |
| サッポロホールディングス       | 230,000 | 763     | 175,490,000   |    |
| アサヒビール             | 353,600 | 1,836   | 649,209,600   |    |
| キリンホールディングス        | 768,000 | 1,680   | 1,290,240,000 |    |
| 宝ホールディングス          | 159,000 | 714     | 113,526,000   |    |
| オエノンホールディングス       | 45,000  | 231     | 10,395,000    |    |
| メルシャン              | 52,000  | 242     | 12,584,000    |    |
| 養命酒製造              | 14,000  | 1,002   | 14,028,000    |    |
| 三国コカ・コーラボトリング      | 26,100  | 1,110   | 28,971,000    |    |
| 四国コカ・コーラボトリング      | 8,200   | 1,196   | 9,807,200     |    |
| コカ・コーラウエストホールディングス | 54,200  | 2,640   | 143,088,000   |    |
| コカ・コーラ セントラル ジャパン  | 39      | 843,000 | 32,877,000    |    |
| ダイトードリンコ           | 8,100   | 3,790   | 30,699,000    |    |
| 伊藤園                | 48,900  | 1,790   | 87,531,000    |    |
| キーコーヒー             | 14,200  | 1,544   | 21,924,800    |    |
| ユニカフェ              | 4,000   | 1,356   | 5,424,000     |    |
| ジャパンフーズ            | 2,500   | 1,155   | 2,887,500     |    |
| 日清オイリオグループ         | 76,000  | 463     | 35,188,000    |    |
| 不二製油               | 47,000  | 1,002   | 47,094,000    |    |
| J-オイルミルズ           | 65,000  | 345     | 22,425,000    |    |
| キッコーマン             | 135,000 | 1,266   | 170,910,000   |    |
| 味の素                | 478,000 | 1,045   | 499,510,000   |    |
| キュービー              | 90,900  | 966     | 87,809,400    |    |
| ハウス食品              | 64,900  | 1,725   | 111,952,500   |    |
| カゴメ                | 68,000  | 1,585   | 107,780,000   |    |
| 焼津水産化学工業           | 8,900   | 1,006   | 8,953,400     |    |
| アリアケジャパン           | 14,400  | 1,602   | 23,068,800    |    |
| ニチレイ               | 212,000 | 481     | 101,972,000   |    |
| 東洋水産               | 76,000  | 2,155   | 163,780,000   |    |
| 日清食品               | 68,300  | 3,700   | 252,710,000   |    |
| 永谷園                | 15,000  | 835     | 12,525,000    |    |
| フジッコ               | 20,000  | 1,148   | 22,960,000    |    |
| ロック・フィールド          | 8,400   | 1,466   | 12,314,400    |    |
| 日本たばこ産業            | 3,899   | 477,000 | 1,859,823,000 |    |
| わらべや日洋             | 8,900   | 1,356   | 12,068,400    |    |
| なとり                | 7,600   | 802     | 6,095,200     |    |
| 紀文フードケミファ          | 11,000  | 1,090   | 11,990,000    |    |
| ミヨシ油脂              | 56,000  | 165     | 9,240,000     |    |
| 片倉工業               | 20,600  | 1,775   | 36,565,000    |    |

| 銘柄             | 株式数       | 評価額     |             | 備考 |
|----------------|-----------|---------|-------------|----|
|                |           | 単価(円)   | 金額(円)       |    |
| グンゼ            | 133,000   | 523     | 69,559,000  |    |
| 川島織物セルコン       | 60,000    | 111     | 6,660,000   |    |
| 東洋紡績           | 545,000   | 222     | 120,990,000 |    |
| ユニチカ           | 394,000   | 118     | 46,492,000  |    |
| 富士紡ホールディングス    | 79,000    | 218     | 17,222,000  |    |
| 日清紡績           | 126,000   | 1,351   | 170,226,000 |    |
| 倉敷紡績           | 169,000   | 226     | 38,194,000  |    |
| 大和紡績           | 113,000   | 256     | 28,928,000  |    |
| シキボウ           | 106,000   | 161     | 17,066,000  |    |
| 日本毛織           | 56,000    | 904     | 50,624,000  |    |
| 大東紡織           | 25,000    | 101     | 2,525,000   |    |
| トーア紡コーポレーション   | 60,000    | 98      | 5,880,000   |    |
| ダイドーリミテッド      | 20,200    | 1,047   | 21,149,400  |    |
| 御幸ホールディングス     | 16,000    | 282     | 4,512,000   |    |
| 帝国繊維           | 18,000    | 406     | 7,308,000   |    |
| 帝人             | 720,000   | 380     | 273,600,000 |    |
| 東レ             | 1,025,000 | 640     | 656,000,000 |    |
| 三菱レイヨン         | 380,000   | 345     | 131,100,000 |    |
| サカイオーベックス      | 47,000    | 140     | 6,580,000   |    |
| 住江織物           | 41,000    | 223     | 9,143,000   |    |
| 日本フェルト         | 11,800    | 541     | 6,383,800   |    |
| イチカワ           | 14,000    | 346     | 4,844,000   |    |
| 日本バイリーン        | 22,000    | 522     | 11,484,000  |    |
| 日東製網           | 19,000    | 175     | 3,325,000   |    |
| 芦森工業           | 39,000    | 229     | 8,931,000   |    |
| アツギ            | 142,000   | 157     | 22,294,000  |    |
| ダイニック          | 32,000    | 228     | 7,296,000   |    |
| セーレン           | 34,700    | 700     | 24,290,000  |    |
| 東海染工           | 23,000    | 130     | 2,990,000   |    |
| 小松精練           | 27,000    | 421     | 11,367,000  |    |
| ワコールホールディングス   | 101,000   | 1,323   | 133,623,000 |    |
| ホギメディカル        | 8,000     | 5,360   | 42,880,000  |    |
| サンエー・インターナショナル | 7,800     | 1,767   | 13,782,600  |    |
| レナウン           | 27,900    | 346     | 9,653,400   |    |
| クラウドディア        | 1,100     | 1,285   | 1,413,500   |    |
| 三陽商会           | 73,000    | 607     | 44,311,000  |    |
| ナイガイ           | 50,000    | 71      | 3,550,000   |    |
| オンワードホールディングス  | 110,000   | 1,204   | 132,440,000 |    |
| シルバーオックス       | 13,000    | 121     | 1,573,000   |    |
| ルック            | 27,000    | 208     | 5,616,000   |    |
| ゴールドウイン        | 35,000    | 379     | 13,265,000  |    |
| 東京スタイル         | 65,000    | 1,044   | 67,860,000  |    |
| デサント           | 49,000    | 606     | 29,694,000  |    |
| ヤマトインターナショナル   | 9,900     | 546     | 5,405,400   |    |
| 特種東海ホールディングス   | 103,000   | 211     | 21,733,000  |    |
| 王子製紙           | 674,000   | 521     | 351,154,000 |    |
| 三菱製紙           | 241,000   | 277     | 66,757,000  |    |
| 北越製紙           | 97,000    | 461     | 44,717,000  |    |
| 中越パルプ工業        | 71,000    | 210     | 14,910,000  |    |
| 大王製紙           | 71,000    | 875     | 62,125,000  |    |
| 日本製紙グループ本社     | 766       | 299,000 | 229,034,000 |    |
| レンゴー           | 154,000   | 745     | 114,730,000 |    |
| トーモク           | 60,000    | 227     | 13,620,000  |    |

| 銘柄             | 株式数       | 評価額   |               | 備考 |
|----------------|-----------|-------|---------------|----|
|                |           | 単価(円) | 金額(円)         |    |
| ザ・パック          | 11,300    | 1,496 | 16,904,800    |    |
| クラレ            | 261,500   | 1,311 | 342,826,500   |    |
| 旭化成            | 1,026,000 | 602   | 617,652,000   |    |
| 共和レザー          | 9,700     | 545   | 5,286,500     |    |
| コープケミカル        | 22,000    | 236   | 5,192,000     |    |
| 昭和電工           | 852,000   | 309   | 263,268,000   |    |
| 住友化学           | 1,130,000 | 707   | 798,910,000   |    |
| 日本化成           | 31,000    | 214   | 6,634,000     |    |
| 住友精化           | 34,000    | 411   | 13,974,000    |    |
| 日産化学工業         | 124,000   | 1,398 | 173,352,000   |    |
| ラサ工業           | 58,000    | 208   | 12,064,000    |    |
| クレハ            | 107,000   | 599   | 64,093,000    |    |
| テイカ            | 28,000    | 345   | 9,660,000     |    |
| 石原産業           | 265,000   | 157   | 41,605,000    |    |
| 片倉チッカリン        | 13,000    | 362   | 4,706,000     |    |
| 日本曹達           | 105,000   | 349   | 36,645,000    |    |
| 東ソー            | 410,000   | 449   | 184,090,000   |    |
| トクヤマ           | 202,000   | 735   | 148,470,000   |    |
| セントラル硝子        | 168,000   | 419   | 70,392,000    |    |
| 東亜合成           | 180,000   | 364   | 65,520,000    |    |
| ダイソー           | 64,000    | 317   | 20,288,000    |    |
| 関東電化工業         | 39,000    | 633   | 24,687,000    |    |
| 電気化学工業         | 321,000   | 414   | 132,894,000   |    |
| 信越化学工業         | 273,800   | 6,540 | 1,790,652,000 |    |
| 日本カーバイド工業      | 36,000    | 177   | 6,372,000     |    |
| 堺化学工業          | 51,000    | 435   | 22,185,000    |    |
| エア・ウォーター       | 117,000   | 1,198 | 140,166,000   |    |
| 大陽日酸           | 255,000   | 910   | 232,050,000   |    |
| 日本化学工業         | 57,000    | 351   | 20,007,000    |    |
| 日本パーカライジング     | 39,000    | 1,709 | 66,651,000    |    |
| 高压ガス工業         | 27,000    | 622   | 16,794,000    |    |
| チタン工業          | 22,000    | 161   | 3,542,000     |    |
| 四国化成工業         | 26,000    | 478   | 12,428,000    |    |
| 戸田工業           | 28,000    | 430   | 12,040,000    |    |
| ステラ ケミファ       | 7,200     | 2,690 | 19,368,000    |    |
| 保土谷化学工業        | 41,000    | 271   | 11,111,000    |    |
| 日本触媒           | 104,000   | 803   | 83,512,000    |    |
| 大日精化工業         | 59,000    | 414   | 24,426,000    |    |
| カネカ            | 192,000   | 749   | 143,808,000   |    |
| 三菱瓦斯化学         | 283,000   | 807   | 228,381,000   |    |
| 三井化学           | 502,000   | 592   | 297,184,000   |    |
| J S R          | 162,100   | 2,225 | 360,672,500   |    |
| 東京応化工業         | 32,500    | 1,928 | 62,660,000    |    |
| 三菱ケミカルホールディングス | 881,000   | 695   | 612,295,000   |    |
| 日本合成化学工業       | 48,000    | 561   | 26,928,000    |    |
| ダイセル化学工業       | 231,000   | 615   | 142,065,000   |    |
| 住友ベークライト       | 156,000   | 649   | 101,244,000   |    |
| 積水化学工業         | 394,000   | 777   | 306,138,000   |    |
| 日本ゼオン          | 142,000   | 465   | 66,030,000    |    |
| アイカ工業          | 47,700    | 887   | 42,309,900    |    |
| 宇部興産           | 689,000   | 368   | 253,552,000   |    |
| 積水樹脂           | 29,000    | 828   | 24,012,000    |    |
| タキロン           | 39,000    | 307   | 11,973,000    |    |

| 銘柄             | 株式数     | 評価額     |               | 備考 |
|----------------|---------|---------|---------------|----|
|                |         | 単価(円)   | 金額(円)         |    |
| 旭有機材工業         | 54,000  | 312     | 16,848,000    |    |
| 日立化成工業         | 81,300  | 2,195   | 178,453,500   |    |
| ニチバン           | 16,000  | 302     | 4,832,000     |    |
| リケンテクノス        | 29,000  | 258     | 7,482,000     |    |
| 大倉工業           | 39,000  | 268     | 10,452,000    |    |
| 積水化成成品工業       | 49,000  | 311     | 15,239,000    |    |
| 群栄化学工業         | 48,000  | 226     | 10,848,000    |    |
| タイガースポリマー      | 8,300   | 525     | 4,357,500     |    |
| 日本カーリット        | 11,000  | 513     | 5,643,000     |    |
| 日本化薬           | 125,000 | 662     | 82,750,000    |    |
| 日本精化           | 16,000  | 614     | 9,824,000     |    |
| A D E K A      | 65,700  | 894     | 58,735,800    |    |
| 日油             | 147,000 | 451     | 66,297,000    |    |
| ハリマ化成          | 14,000  | 490     | 6,860,000     |    |
| 花王             | 455,000 | 2,835   | 1,289,925,000 |    |
| 第一工業製薬         | 27,000  | 253     | 6,831,000     |    |
| 三洋化成工業         | 46,000  | 633     | 29,118,000    |    |
| 大日本塗料          | 94,000  | 140     | 13,160,000    |    |
| 日本ペイント         | 168,000 | 458     | 76,944,000    |    |
| 関西ペイント         | 186,000 | 750     | 139,500,000   |    |
| トウペ            | 14,000  | 114     | 1,596,000     |    |
| 中国塗料           | 40,000  | 782     | 31,280,000    |    |
| 日本特殊塗料         | 14,000  | 508     | 7,112,000     |    |
| 藤倉化成           | 16,400  | 998     | 16,367,200    |    |
| 太陽インキ製造        | 12,500  | 2,240   | 28,000,000    |    |
| D I C          | 541,000 | 330     | 178,530,000   |    |
| サカタインクス        | 34,000  | 426     | 14,484,000    |    |
| 東洋インキ製造        | 163,000 | 369     | 60,147,000    |    |
| 富士フイルムホールディングス | 401,400 | 3,900   | 1,565,460,000 |    |
| 資生堂            | 300,000 | 2,480   | 744,000,000   |    |
| ライオン           | 204,000 | 476     | 97,104,000    |    |
| 高砂香料工業         | 59,000  | 666     | 39,294,000    |    |
| マンダム           | 16,500  | 2,740   | 45,210,000    |    |
| ミルボン           | 6,700   | 2,070   | 13,869,000    |    |
| ファンケル          | 34,200  | 1,210   | 41,382,000    |    |
| コーセー           | 29,500  | 2,425   | 71,537,500    |    |
| ドクターシーラボ       | 109     | 160,000 | 17,440,000    |    |
| エステー           | 11,500  | 1,192   | 13,708,000    |    |
| コニシ            | 13,900  | 961     | 13,357,900    |    |
| 長谷川香料          | 18,400  | 1,520   | 27,968,000    |    |
| 小林製薬           | 22,800  | 3,150   | 71,820,000    |    |
| 荒川化学工業         | 12,800  | 1,119   | 14,323,200    |    |
| メック            | 6,800   | 911     | 6,194,800     |    |
| 日本高純度化学        | 43      | 326,000 | 14,018,000    |    |
| 荏原ユーザライト       | 1,200   | 2,265   | 2,718,000     |    |
| アース製薬          | 12,600  | 2,730   | 34,398,000    |    |
| イハラケミカル工業      | 30,000  | 331     | 9,930,000     |    |
| 北興化学工業         | 18,000  | 390     | 7,020,000     |    |
| 大成ラミック         | 4,700   | 2,385   | 11,209,500    |    |
| クミアイ化学工業       | 38,000  | 335     | 12,730,000    |    |
| 日本農薬           | 38,000  | 1,060   | 40,280,000    |    |
| アキレス           | 135,000 | 163     | 22,005,000    |    |
| 有沢製作所          | 26,700  | 728     | 19,437,600    |    |



| 銘柄       | 株式数       | 評価額   |               | 備考 |
|----------|-----------|-------|---------------|----|
|          |           | 単価(円) | 金額(円)         |    |
| 日東電工     | 135,500   | 4,700 | 636,850,000   |    |
| スルガ      | 4,200     | 1,267 | 5,321,400     |    |
| アロン化成    | 12,000    | 397   | 4,764,000     |    |
| きもと      | 15,000    | 1,395 | 20,925,000    |    |
| シーアイ化成   | 15,000    | 304   | 4,560,000     |    |
| 藤森工業     | 11,000    | 1,319 | 14,509,000    |    |
| 前澤化成工業   | 13,800    | 1,117 | 15,414,600    |    |
| J S P    | 11,000    | 969   | 10,659,000    |    |
| エフピコ     | 8,200     | 3,150 | 25,830,000    |    |
| 天馬       | 15,400    | 1,550 | 23,870,000    |    |
| 信越ポリマー   | 32,200    | 708   | 22,797,600    |    |
| 東リ       | 61,000    | 198   | 12,078,000    |    |
| ニフコ      | 36,700    | 2,435 | 89,364,500    |    |
| 日本バルカー工業 | 68,000    | 326   | 22,168,000    |    |
| 日本マタイ    | 26,000    | 176   | 4,576,000     |    |
| ユニ・チャーム  | 33,600    | 7,180 | 241,248,000   |    |
| 協和醗酵工業   | 270,000   | 1,002 | 270,540,000   |    |
| 武田薬品工業   | 650,200   | 5,830 | 3,790,666,000 |    |
| アステラス製薬  | 354,100   | 4,390 | 1,554,499,000 |    |
| 大日本住友製薬  | 116,000   | 859   | 99,644,000    |    |
| 塩野義製薬    | 274,000   | 2,140 | 586,360,000   |    |
| 田辺三菱製薬   | 192,000   | 1,375 | 264,000,000   |    |
| わかもと製薬   | 19,000    | 373   | 7,087,000     |    |
| あすか製薬    | 18,000    | 770   | 13,860,000    |    |
| 日本新薬     | 41,000    | 1,277 | 52,357,000    |    |
| 中外製薬     | 218,200   | 1,650 | 360,030,000   |    |
| 科研製薬     | 78,000    | 811   | 63,258,000    |    |
| エーザイ     | 202,400   | 3,790 | 767,096,000   |    |
| ロート製薬    | 68,000    | 1,217 | 82,756,000    |    |
| 小野薬品工業   | 82,500    | 5,900 | 486,750,000   |    |
| 久光製薬     | 46,400    | 4,330 | 200,912,000   |    |
| 有機合成薬品工業 | 14,000    | 290   | 4,060,000     |    |
| 持田製薬     | 70,000    | 1,145 | 80,150,000    |    |
| 大正製薬     | 156,000   | 1,895 | 295,620,000   |    |
| 参天製薬     | 59,300    | 2,795 | 165,743,500   |    |
| エスエス製薬   | 42,000    | 535   | 22,470,000    |    |
| 扶桑薬品工業   | 55,000    | 327   | 17,985,000    |    |
| 日本ケミファ   | 28,000    | 504   | 14,112,000    |    |
| ツムラ      | 51,700    | 2,495 | 128,991,500   |    |
| キッセイ薬品工業 | 33,000    | 2,300 | 75,900,000    |    |
| 生化学工業    | 31,400    | 1,086 | 34,100,400    |    |
| 栄研化学     | 10,400    | 884   | 9,193,600     |    |
| 日水製薬     | 6,600     | 667   | 4,402,200     |    |
| 鳥居薬品     | 9,800     | 1,544 | 15,131,200    |    |
| 東和薬品     | 6,700     | 4,180 | 28,006,000    |    |
| 沢井製薬     | 11,500    | 4,490 | 51,635,000    |    |
| ゼリア新薬工業  | 24,000    | 1,036 | 24,864,000    |    |
| 第一三共     | 537,400   | 2,835 | 1,523,529,000 |    |
| キョーリン    | 44,000    | 1,268 | 55,792,000    |    |
| 新日本石油    | 1,071,000 | 739   | 791,469,000   |    |
| 昭和シェル石油  | 128,600   | 1,121 | 144,160,600   |    |
| コスモ石油    | 455,000   | 440   | 200,200,000   |    |
| ニチレキ     | 25,000    | 319   | 7,975,000     |    |

| 銘柄                 | 株式数       | 評価額    |               | 備考 |
|--------------------|-----------|--------|---------------|----|
|                    |           | 単価(円)  | 金額(円)         |    |
| 東燃ゼネラル石油           | 220,000   | 1,012  | 222,640,000   |    |
| ユシロ化学工業            | 8,500     | 1,912  | 16,252,000    |    |
| ビービー・カストロール        | 7,800     | 304    | 2,371,200     |    |
| 新日鉱ホールディングス        | 679,000   | 658    | 446,782,000   |    |
| AOCホールディングス        | 38,900    | 1,402  | 54,537,800    |    |
| 出光興産               | 17,500    | 10,940 | 191,450,000   |    |
| 横浜ゴム               | 200,000   | 530    | 106,000,000   |    |
| 東洋ゴム工業             | 143,000   | 409    | 58,487,000    |    |
| ブリヂストン             | 515,200   | 1,791  | 922,723,200   |    |
| 住友ゴム工業             | 128,200   | 860    | 110,252,000   |    |
| 藤倉ゴム工業             | 10,600    | 474    | 5,024,400     |    |
| オカモト               | 70,000    | 373    | 26,110,000    |    |
| フコク                | 6,900     | 820    | 5,658,000     |    |
| ニッタ                | 16,300    | 2,240  | 36,512,000    |    |
| クリエートメディック         | 4,800     | 935    | 4,488,000     |    |
| 東海ゴム工業             | 30,500    | 1,350  | 41,175,000    |    |
| 三ツ星ベルト             | 51,000    | 530    | 27,030,000    |    |
| バンドー化学             | 65,000    | 397    | 25,805,000    |    |
| 日東紡績               | 167,000   | 217    | 36,239,000    |    |
| 旭硝子                | 810,000   | 1,390  | 1,125,900,000 |    |
| 日本板硝子              | 522,000   | 503    | 262,566,000   |    |
| 石塚硝子               | 31,000    | 212    | 6,572,000     |    |
| 日本山村硝子             | 85,000    | 219    | 18,615,000    |    |
| 日本電気硝子             | 291,000   | 1,990  | 579,090,000   |    |
| オハラ                | 7,500     | 2,015  | 15,112,500    |    |
| 住友大阪セメント           | 333,000   | 236    | 78,588,000    |    |
| 太平洋セメント            | 648,000   | 234    | 151,632,000   |    |
| デイ・シイ              | 19,800    | 317    | 6,276,600     |    |
| 日本ヒューム             | 18,000    | 320    | 5,760,000     |    |
| 日本コンクリート工業         | 33,000    | 178    | 5,874,000     |    |
| 東海カーボン             | 130,000   | 1,235  | 160,550,000   |    |
| 日本カーボン             | 79,000    | 542    | 42,818,000    |    |
| 東洋炭素               | 7,100     | 7,850  | 55,735,000    |    |
| ノリタケカンパニーリミテド      | 97,000    | 420    | 40,740,000    |    |
| TOTO               | 254,000   | 800    | 203,200,000   |    |
| 日本碍子               | 198,000   | 2,190  | 433,620,000   |    |
| 日本特殊陶業             | 123,000   | 1,266  | 155,718,000   |    |
| ダントーホールディングス       | 41,000    | 196    | 8,036,000     |    |
| MARUWA             | 4,300     | 1,336  | 5,744,800     |    |
| 日本セラテック            | 28        | 83,600 | 2,340,800     |    |
| 品川白煉瓦              | 55,000    | 311    | 17,105,000    |    |
| 黒崎播磨               | 47,000    | 306    | 14,382,000    |    |
| 東京窯業               | 31,000    | 227    | 7,037,000     |    |
| ニッカトー              | 9,400     | 601    | 5,649,400     |    |
| フジインコーポレーテッド       | 13,600    | 1,747  | 23,759,200    |    |
| ニチハ                | 22,200    | 982    | 21,800,400    |    |
| 新日本製鐵              | 4,645,000 | 639    | 2,968,155,000 |    |
| 住友金属工業             | 3,045,000 | 505    | 1,537,725,000 |    |
| 神戸製鋼所              | 2,278,000 | 341    | 776,798,000   |    |
| 日新製鋼               | 582,000   | 375    | 218,250,000   |    |
| 中山製鋼所              | 93,000    | 303    | 28,179,000    |    |
| 合同製鐵               | 102,000   | 353    | 36,006,000    |    |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 419,300   | 5,850  | 2,452,905,000 |    |

| 銘柄             | 株式数     | 評価額   |             | 備考 |
|----------------|---------|-------|-------------|----|
|                |         | 単価(円) | 金額(円)       |    |
| 東京製鐵           | 90,700  | 1,319 | 119,633,300 |    |
| 共英製鋼           | 15,600  | 2,125 | 33,150,000  |    |
| 大和工業           | 38,900  | 5,190 | 201,891,000 |    |
| 東京鐵鋼           | 31,000  | 386   | 11,966,000  |    |
| 大阪製鐵           | 12,900  | 1,470 | 18,963,000  |    |
| 淀川製鋼所          | 127,000 | 541   | 68,707,000  |    |
| 東洋鋼鈑           | 36,000  | 470   | 16,920,000  |    |
| 住友鋼管           | 11,900  | 865   | 10,293,500  |    |
| 丸一鋼管           | 50,400  | 3,500 | 176,400,000 |    |
| モリ工業           | 31,000  | 393   | 12,183,000  |    |
| 大同特殊鋼          | 254,000 | 625   | 158,750,000 |    |
| 日本高周波鋼業        | 68,000  | 188   | 12,784,000  |    |
| 日本金属工業         | 123,000 | 347   | 42,681,000  |    |
| 日本冶金工業         | 78,500  | 791   | 62,093,500  |    |
| 山陽特殊製鋼         | 91,000  | 637   | 57,967,000  |    |
| 愛知製鋼           | 98,000  | 502   | 49,196,000  |    |
| 日立金属           | 125,000 | 1,581 | 197,625,000 |    |
| 日本金属           | 48,000  | 247   | 11,856,000  |    |
| 大平洋金属          | 105,000 | 917   | 96,285,000  |    |
| 日本電工           | 76,000  | 1,360 | 103,360,000 |    |
| 日本鑄鉄管          | 22,000  | 175   | 3,850,000   |    |
| 三菱製鋼           | 109,000 | 482   | 52,538,000  |    |
| 日亜鋼業           | 27,000  | 403   | 10,881,000  |    |
| 日本精線           | 14,000  | 421   | 5,894,000   |    |
| シンニッタン         | 17,200  | 606   | 10,423,200  |    |
| 新家工業           | 50,000  | 252   | 12,600,000  |    |
| 日本軽金属          | 399,000 | 188   | 75,012,000  |    |
| 大紀アルミニウム工業所    | 24,000  | 486   | 11,664,000  |    |
| 三井金属鋳業         | 475,000 | 338   | 160,550,000 |    |
| 東邦亜鉛           | 81,000  | 529   | 42,849,000  |    |
| 三菱マテリアル        | 935,000 | 498   | 465,630,000 |    |
| 住友金属鋳山         | 425,000 | 1,687 | 716,975,000 |    |
| DOWAホールディングス   | 207,000 | 820   | 169,740,000 |    |
| 古河機械金属         | 299,000 | 183   | 54,717,000  |    |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 14,400  | 6,190 | 89,136,000  |    |
| 東邦チタニウム        | 26,700  | 2,340 | 62,478,000  |    |
| 住友軽金属工業        | 256,000 | 142   | 36,352,000  |    |
| 古河スカイ          | 69,000  | 272   | 18,768,000  |    |
| 古河電気工業         | 551,000 | 444   | 244,644,000 |    |
| 住友電気工業         | 538,800 | 1,394 | 751,087,200 |    |
| フジクラ           | 264,000 | 478   | 126,192,000 |    |
| 三菱電線工業         | 96,000  | 140   | 13,440,000  |    |
| 昭和電線ホールディングス   | 206,000 | 159   | 32,754,000  |    |
| 東京特殊電線         | 23,000  | 138   | 3,174,000   |    |
| タツタ電線          | 43,000  | 280   | 12,040,000  |    |
| 日立電線           | 131,000 | 433   | 56,723,000  |    |
| 沖電線            | 17,000  | 182   | 3,094,000   |    |
| カナレ電気          | 2,100   | 1,500 | 3,150,000   |    |
| 平河ヒューテック       | 4,600   | 1,437 | 6,610,200   |    |
| リョービ           | 100,000 | 407   | 40,700,000  |    |
| アサヒブリテック       | 25,000  | 3,140 | 78,500,000  |    |
| 稲葉製作所          | 8,100   | 1,250 | 10,125,000  |    |
| 三協・立山ホールディングス  | 232,000 | 132   | 30,624,000  |    |

| 銘柄             | 株式数     | 評価額   |             | 備考 |
|----------------|---------|-------|-------------|----|
|                |         | 単価(円) | 金額(円)       |    |
| トーカロ           | 10,400  | 1,880 | 19,552,000  |    |
| アルファC o        | 5,000   | 1,046 | 5,230,000   |    |
| SUMCO          | 86,800  | 2,530 | 219,604,000 |    |
| 東洋製罐           | 126,700 | 1,944 | 246,304,800 |    |
| ホッカンホールディングス   | 40,000  | 310   | 12,400,000  |    |
| コロナ            | 7,600   | 1,485 | 11,286,000  |    |
| 横河ブリッジホールディングス | 30,000  | 628   | 18,840,000  |    |
| 松尾橋梁           | 44,000  | 147   | 6,468,000   |    |
| 駒井鉄工           | 31,000  | 269   | 8,339,000   |    |
| ハルテック          | 28,000  | 113   | 3,164,000   |    |
| 高田機工           | 17,000  | 250   | 4,250,000   |    |
| 三和ホールディングス     | 145,000 | 419   | 60,755,000  |    |
| 文化シャッター        | 53,000  | 435   | 23,055,000  |    |
| 川田工業           | 63,000  | 174   | 10,962,000  |    |
| 東洋シャッター        | 7,300   | 951   | 6,942,300   |    |
| 住生活グループ        | 213,600 | 1,734 | 370,382,400 |    |
| 日本ファイルコン       | 12,100  | 575   | 6,957,500   |    |
| ノーリツ           | 32,500  | 1,294 | 42,055,000  |    |
| 長府製作所          | 19,200  | 2,140 | 41,088,000  |    |
| リンナイ           | 34,400  | 3,740 | 128,656,000 |    |
| ダイニチ工業         | 9,700   | 541   | 5,247,700   |    |
| 日東精工           | 24,000  | 495   | 11,880,000  |    |
| 三洋工業           | 44,000  | 212   | 9,328,000   |    |
| 岡部             | 41,200  | 517   | 21,300,400  |    |
| 中国工業           | 23,000  | 136   | 3,128,000   |    |
| 東プレ            | 31,700  | 944   | 29,924,800  |    |
| 高周波熱錬          | 26,300  | 1,150 | 30,245,000  |    |
| 東京製網           | 128,000 | 276   | 35,328,000  |    |
| パイオラックス        | 7,000   | 2,110 | 14,770,000  |    |
| 日本発條           | 119,000 | 910   | 108,290,000 |    |
| 中央発條           | 22,000  | 431   | 9,482,000   |    |
| アドバネクス         | 31,000  | 138   | 4,278,000   |    |
| 三益半導体工業        | 13,800  | 2,075 | 28,635,000  |    |
| アタカ大機          | 12,000  | 304   | 3,648,000   |    |
| 日本製鋼所          | 253,000 | 2,275 | 575,575,000 |    |
| 日立ツール          | 9,400   | 1,388 | 13,047,200  |    |
| 三浦工業           | 24,400  | 2,515 | 61,366,000  |    |
| タクマ            | 64,000  | 367   | 23,488,000  |    |
| ツガミ            | 46,000  | 398   | 18,308,000  |    |
| オークマ           | 107,000 | 1,213 | 129,791,000 |    |
| 東芝機械           | 81,000  | 778   | 63,018,000  |    |
| アマダ            | 255,000 | 917   | 233,835,000 |    |
| アイダエンジニアリング    | 46,000  | 569   | 26,174,000  |    |
| 牧野フライス製作所      | 64,000  | 789   | 50,496,000  |    |
| オーエスジー         | 62,700  | 1,317 | 82,575,900  |    |
| ダイジェット工業       | 20,000  | 228   | 4,560,000   |    |
| 旭ダイヤモンド工業      | 45,000  | 731   | 32,895,000  |    |
| 森精機製作所         | 64,200  | 2,010 | 129,042,000 |    |
| ディスコ           | 14,900  | 4,970 | 74,053,000  |    |
| 日東工器           | 8,500   | 2,140 | 18,190,000  |    |
| 豊和工業           | 92,000  | 106   | 9,752,000   |    |
| 大阪機工           | 51,000  | 219   | 11,169,000  |    |
| 石川製作所          | 37,000  | 82    | 3,034,000   |    |

| 銘柄           | 株式数     | 評価額    |               | 備考 |
|--------------|---------|--------|---------------|----|
|              |         | 単価(円)  | 金額(円)         |    |
| 東洋機械金属       | 8,100   | 448    | 3,628,800     |    |
| オーエム製作所      | 16,000  | 871    | 13,936,000    |    |
| 津田駒工業        | 40,000  | 229    | 9,160,000     |    |
| エンシュウ        | 43,000  | 145    | 6,235,000     |    |
| 島精機製作所       | 20,200  | 3,460  | 69,892,000    |    |
| 日本スピンドル製造    | 24,000  | 317    | 7,608,000     |    |
| 日阪製作所        | 18,000  | 2,340  | 42,120,000    |    |
| ペガサスミシン製造    | 9,400   | 453    | 4,258,200     |    |
| ナブテスコ        | 68,000  | 1,623  | 110,364,000   |    |
| 三井海洋開発       | 10,900  | 3,870  | 42,183,000    |    |
| レオン自動機       | 17,000  | 354    | 6,018,000     |    |
| S M C        | 49,000  | 12,360 | 605,640,000   |    |
| 新川           | 13,700  | 1,400  | 19,180,000    |    |
| ホソカワミクロン     | 29,000  | 753    | 21,837,000    |    |
| ユニオンツール      | 9,000   | 3,390  | 30,510,000    |    |
| オイレス工業       | 15,900  | 2,080  | 33,072,000    |    |
| サトー          | 17,600  | 1,300  | 22,880,000    |    |
| 日本エアテック      | 3,900   | 570    | 2,223,000     |    |
| 日精樹脂工業       | 13,000  | 463    | 6,019,000     |    |
| ワイエイシイ       | 5,300   | 963    | 5,103,900     |    |
| 小松製作所        | 730,200 | 3,150  | 2,300,130,000 |    |
| 住友重機械工業      | 472,000 | 836    | 394,592,000   |    |
| 日立建機         | 83,900  | 3,470  | 291,133,000   |    |
| 日工           | 25,000  | 244    | 6,100,000     |    |
| 巴工業          | 6,300   | 1,190  | 7,497,000     |    |
| 井関農機         | 155,000 | 329    | 50,995,000    |    |
| 共立           | 37,000  | 317    | 11,729,000    |    |
| T O W A      | 14,600  | 1,061  | 15,490,600    |    |
| 丸山製作所        | 37,000  | 278    | 10,286,000    |    |
| 北川鉄工所        | 75,000  | 229    | 17,175,000    |    |
| クボタ          | 756,000 | 836    | 632,016,000   |    |
| 荏原実業         | 3,600   | 1,382  | 4,975,200     |    |
| 三菱化工機        | 50,000  | 427    | 21,350,000    |    |
| 月島機械         | 24,000  | 896    | 21,504,000    |    |
| 帝国電機製作所      | 6,000   | 2,210  | 13,260,000    |    |
| 東京機械製作所      | 44,000  | 235    | 10,340,000    |    |
| 新東工業         | 33,100  | 1,123  | 37,171,300    |    |
| 澁谷工業         | 9,100   | 765    | 6,961,500     |    |
| アイチ コーポレーション | 27,100  | 810    | 21,951,000    |    |
| 小森コーポレーション   | 48,000  | 2,075  | 99,600,000    |    |
| 鶴見製作所        | 12,000  | 837    | 10,044,000    |    |
| 住友精密工業       | 26,000  | 421    | 10,946,000    |    |
| 酒井重工業        | 31,000  | 250    | 7,750,000     |    |
| 荏原製作所        | 350,000 | 368    | 128,800,000   |    |
| 石井鐵工所        | 26,000  | 204    | 5,304,000     |    |
| 西島製作所        | 14,600  | 2,005  | 29,273,000    |    |
| ダイキン工業       | 185,700 | 5,580  | 1,036,206,000 |    |
| オルガノ         | 25,000  | 1,373  | 34,325,000    |    |
| トーヨーカネツ      | 115,000 | 230    | 26,450,000    |    |
| 栗田工業         | 97,100  | 4,180  | 405,878,000   |    |
| 椿本チエイン       | 94,000  | 652    | 61,288,000    |    |
| 大同工業         | 32,000  | 240    | 7,680,000     |    |
| T C M        | 42,000  | 258    | 10,836,000    |    |

| 銘柄              | 株式数       | 評価額     |               | 備考 |
|-----------------|-----------|---------|---------------|----|
|                 |           | 単価(円)   | 金額(円)         |    |
| 日本コンベヤ          | 57,000    | 100     | 5,700,000     |    |
| 木村化工機           | 15,100    | 1,165   | 17,591,500    |    |
| アネスト岩田          | 29,000    | 440     | 12,760,000    |    |
| ダイフク            | 66,500    | 1,188   | 79,002,000    |    |
| 加藤製作所           | 40,000    | 451     | 18,040,000    |    |
| 油研工業            | 31,000    | 345     | 10,695,000    |    |
| タダノ             | 76,000    | 1,220   | 92,720,000    |    |
| フジテック           | 55,000    | 623     | 34,265,000    |    |
| シーケーディ          | 44,200    | 766     | 33,857,200    |    |
| キトー             | 39        | 212,000 | 8,268,000     |    |
| 平和              | 42,400    | 1,142   | 48,420,800    |    |
| 理想科学工業          | 13,800    | 1,526   | 21,058,800    |    |
| SANKYO          | 42,800    | 7,050   | 301,740,000   |    |
| 日本金銭機械          | 17,400    | 851     | 14,807,400    |    |
| マースエンジニアリング     | 10,000    | 1,728   | 17,280,000    |    |
| 福島工業            | 4,800     | 1,053   | 5,054,400     |    |
| キャノンファインテック     | 14,800    | 1,494   | 22,111,200    |    |
| オーイズミ           | 5,500     | 300     | 1,650,000     |    |
| ダイコク電機          | 5,800     | 1,215   | 7,047,000     |    |
| アマノ             | 44,100    | 1,061   | 46,790,100    |    |
| JUKI            | 82,000    | 363     | 29,766,000    |    |
| サンデン            | 89,000    | 507     | 45,123,000    |    |
| 蛇の目マシン工業        | 155,000   | 93      | 14,415,000    |    |
| シルバー精工          | 300,000   | 30      | 9,000,000     |    |
| マックス            | 24,000    | 1,286   | 30,864,000    |    |
| グローリー           | 46,200    | 2,560   | 118,272,000   |    |
| 大和冷機工業          | 25,000    | 515     | 12,875,000    |    |
| セガサミーホールディングス   | 179,500   | 1,031   | 185,064,500   |    |
| 日本ピストンリング       | 62,000    | 186     | 11,532,000    |    |
| リケン             | 68,000    | 517     | 35,156,000    |    |
| 帝国ピストンリング       | 19,100    | 991     | 18,928,100    |    |
| 大豊工業            | 11,000    | 1,441   | 15,851,000    |    |
| 日本精工            | 349,000   | 988     | 344,812,000   |    |
| NTN             | 275,000   | 744     | 204,600,000   |    |
| ジェイテクト          | 156,600   | 1,805   | 282,663,000   |    |
| 不二越             | 158,000   | 454     | 71,732,000    |    |
| 日本トムソン          | 48,000    | 749     | 35,952,000    |    |
| THK             | 97,900    | 2,230   | 218,317,000   |    |
| ユーシン精機          | 6,900     | 2,435   | 16,801,500    |    |
| 前澤給装工業          | 8,900     | 1,861   | 16,562,900    |    |
| イーグル工業          | 22,000    | 965     | 21,230,000    |    |
| 前澤工業            | 12,500    | 240     | 3,000,000     |    |
| 日本ピラー工業         | 19,000    | 555     | 10,545,000    |    |
| キッツ             | 82,000    | 647     | 53,054,000    |    |
| 日立工機            | 42,000    | 1,809   | 75,978,000    |    |
| マキタ             | 105,300   | 4,210   | 443,313,000   |    |
| 日立造船            | 698,500   | 139     | 97,091,500    |    |
| 三菱重工業           | 2,631,000 | 578     | 1,520,718,000 |    |
| IHI             | 1,073,000 | 250     | 268,250,000   |    |
| イビデン            | 110,300   | 4,470   | 493,041,000   |    |
| コニカミノルタホールディングス | 388,500   | 1,862   | 723,387,000   |    |
| ブラザー工業          | 202,900   | 1,555   | 315,509,500   |    |
| ミネベア            | 253,000   | 636     | 160,908,000   |    |

| 銘柄                | 株式数       | 評価額     |               | 備考 |
|-------------------|-----------|---------|---------------|----|
|                   |           | 単価(円)   | 金額(円)         |    |
| 日立製作所             | 2,627,000 | 763     | 2,004,401,000 |    |
| 東芝                | 2,367,000 | 902     | 2,135,034,000 |    |
| 三菱電機              | 1,465,000 | 1,172   | 1,716,980,000 |    |
| 富士電機ホールディングス      | 400,000   | 449     | 179,600,000   |    |
| 東洋電機製造            | 27,000    | 358     | 9,666,000     |    |
| 安川電機              | 172,000   | 1,180   | 202,960,000   |    |
| 神鋼電機              | 100,000   | 325     | 32,500,000    |    |
| 明電舎               | 133,000   | 343     | 45,619,000    |    |
| オリジン電気            | 21,000    | 641     | 13,461,000    |    |
| デンヨー              | 16,400    | 933     | 15,301,200    |    |
| エネサーブ             | 18,200    | 606     | 11,029,200    |    |
| 東芝テック             | 99,000    | 715     | 70,785,000    |    |
| 芝浦メカトロニクス         | 28,000    | 604     | 16,912,000    |    |
| マブチモーター           | 27,500    | 5,450   | 149,875,000   |    |
| 日本電産              | 84,800    | 8,110   | 687,728,000   |    |
| 高岳製作所             | 62,000    | 146     | 9,052,000     |    |
| ダイヘン              | 79,000    | 462     | 36,498,000    |    |
| 日新電機              | 42,000    | 513     | 21,546,000    |    |
| 大崎電気工業            | 24,000    | 713     | 17,112,000    |    |
| オムロン              | 175,100   | 2,185   | 382,593,500   |    |
| 日東工業              | 24,000    | 1,050   | 25,200,000    |    |
| I D E C           | 18,800    | 1,277   | 24,007,600    |    |
| エルピーダメモリ          | 75,900    | 4,030   | 305,877,000   |    |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 269,000   | 487     | 131,003,000   |    |
| サクサホールディングス       | 37,000    | 201     | 7,437,000     |    |
| メルコホールディングス       | 9,000     | 2,070   | 18,630,000    |    |
| テクノメディカ           | 12        | 274,000 | 3,288,000     |    |
| 日本電気              | 1,682,000 | 566     | 952,012,000   |    |
| 富士通               | 1,614,000 | 799     | 1,289,586,000 |    |
| 沖電気工業             | 534,000   | 173     | 92,382,000    |    |
| 岩崎通信機             | 69,000    | 117     | 8,073,000     |    |
| 電気興業              | 41,000    | 619     | 25,379,000    |    |
| サンケン電気            | 92,000    | 680     | 62,560,000    |    |
| エプソントヨコム          | 37,000    | 395     | 14,615,000    |    |
| ナカヨ通信機            | 16,000    | 252     | 4,032,000     |    |
| アイホン              | 12,400    | 1,606   | 19,914,400    |    |
| NECエレクトロニクス       | 30,100    | 2,400   | 72,240,000    |    |
| セイコーエプソン          | 124,400   | 2,730   | 339,612,000   |    |
| ワコム               | 307       | 274,000 | 84,118,000    |    |
| アルバック             | 25,100    | 4,130   | 103,663,000   |    |
| ピクセラ              | 5,900     | 388     | 2,289,200     |    |
| ディーアンドエムホールディングス  | 29,000    | 426     | 12,354,000    |    |
| ナナオ               | 13,300    | 2,510   | 33,383,000    |    |
| 日本信号              | 42,600    | 642     | 27,349,200    |    |
| 京三製作所             | 40,000    | 410     | 16,400,000    |    |
| 能美防災              | 21,000    | 680     | 14,280,000    |    |
| ホーチキ              | 17,000    | 790     | 13,430,000    |    |
| マスプロ電工            | 10,900    | 870     | 9,483,000     |    |
| 日本無線              | 81,000    | 340     | 27,540,000    |    |
| 松下電器産業            | 1,674,000 | 2,420   | 4,051,080,000 |    |
| シャープ              | 758,000   | 1,727   | 1,309,066,000 |    |
| アンリツ              | 69,000    | 347     | 23,943,000    |    |
| 富士通ゼネラル           | 50,000    | 535     | 26,750,000    |    |

| 銘柄           | 株式数       | 評価額    |               | 備考 |
|--------------|-----------|--------|---------------|----|
|              |           | 単価(円)  | 金額(円)         |    |
| 日立国際電気       | 41,000    | 1,039  | 42,599,000    |    |
| ソニー          | 881,300   | 5,250  | 4,626,825,000 |    |
| NEC トーキン     | 50,000    | 443    | 22,150,000    |    |
| TDK          | 82,100    | 6,790  | 557,459,000   |    |
| 帝国通信工業       | 35,000    | 346    | 12,110,000    |    |
| 三洋電機         | 1,460,000 | 269    | 392,740,000   |    |
| ケンウッド        | 327,000   | 120    | 39,240,000    |    |
| ミツミ電機        | 59,600    | 2,645  | 157,642,000   |    |
| タムラ製作所       | 48,000    | 432    | 20,736,000    |    |
| アルプス電気       | 132,700   | 1,092  | 144,908,400   |    |
| 池上通信機        | 46,000    | 165    | 7,590,000     |    |
| パイオニア        | 131,100   | 853    | 111,828,300   |    |
| 日本電波工業       | 12,100    | 2,745  | 33,214,500    |    |
| 日本トリム        | 2,350     | 2,920  | 6,862,000     |    |
| ローランド ディー・ジー | 5,200     | 3,400  | 17,680,000    |    |
| 日本ビクター       | 90,000    | 233    | 20,970,000    |    |
| フォスター電機      | 16,500    | 2,385  | 39,352,500    |    |
| クラリオン        | 85,000    | 211    | 17,935,000    |    |
| SMK          | 50,000    | 566    | 28,300,000    |    |
| ヨコオ          | 12,300    | 678    | 8,339,400     |    |
| 東光           | 67,000    | 213    | 14,271,000    |    |
| ティアック        | 72,000    | 98     | 7,056,000     |    |
| ホシデン         | 42,500    | 2,250  | 95,625,000    |    |
| ヒロセ電機        | 29,300    | 11,510 | 337,243,000   |    |
| 日本航空電子工業     | 36,000    | 968    | 34,848,000    |    |
| TOA          | 19,000    | 688    | 13,072,000    |    |
| 日立マクセル       | 29,600    | 1,390  | 41,144,000    |    |
| ユニデン         | 46,000    | 578    | 26,588,000    |    |
| アルパイン        | 34,500    | 1,258  | 43,401,000    |    |
| スミダ コーポレーション | 8,700     | 1,563  | 13,598,100    |    |
| 島田理化工業       | 9,400     | 177    | 1,663,800     |    |
| アイコム         | 8,000     | 2,620  | 20,960,000    |    |
| 船井電機         | 15,800    | 3,600  | 56,880,000    |    |
| 横河電機         | 157,100   | 1,016  | 159,613,600   |    |
| 新電元工業        | 55,000    | 347    | 19,085,000    |    |
| 山武           | 48,000    | 2,995  | 143,760,000   |    |
| 日本光電工業       | 31,300    | 1,974  | 61,786,200    |    |
| チノー          | 30,000    | 289    | 8,670,000     |    |
| 共和電業         | 16,000    | 333    | 5,328,000     |    |
| 日本電子材料       | 6,200     | 895    | 5,549,000     |    |
| 堀場製作所        | 20,700    | 3,420  | 70,794,000    |    |
| アドバンテスト      | 116,700   | 2,560  | 298,752,000   |    |
| 小野測器         | 18,000    | 594    | 10,692,000    |    |
| エスベック        | 16,300    | 1,038  | 16,919,400    |    |
| サンクス         | 13,700    | 539    | 7,384,300     |    |
| キーエンス        | 29,400    | 26,450 | 777,630,000   |    |
| 日置電機         | 6,900     | 2,425  | 16,732,500    |    |
| シスメックス       | 25,000    | 4,190  | 104,750,000   |    |
| メガチップス       | 12,600    | 1,301  | 16,392,600    |    |
| OBARA        | 6,100     | 1,521  | 9,278,100     |    |
| 日本電産コパル電子    | 19,400    | 641    | 12,435,400    |    |
| ミヤチテクノス      | 7,600     | 1,272  | 9,667,200     |    |
| 東京電波         | 4,500     | 1,112  | 5,004,000     |    |



| 銘柄                | 株式数     | 評価額    |               | 備考 |
|-------------------|---------|--------|---------------|----|
|                   |         | 単価(円)  | 金額(円)         |    |
| 澤藤電機              | 9,000   | 285    | 2,565,000     |    |
| コーセル              | 22,100  | 1,156  | 25,547,600    |    |
| 日立メディコ            | 12,000  | 811    | 9,732,000     |    |
| 新日本無線             | 11,000  | 380    | 4,180,000     |    |
| オブテックス            | 10,800  | 1,603  | 17,312,400    |    |
| 千代田インテグレ          | 9,000   | 1,727  | 15,543,000    |    |
| 東光電気              | 10,000  | 275    | 2,750,000     |    |
| スタンレー電気           | 110,100 | 2,735  | 301,123,500   |    |
| 岩崎電気              | 57,000  | 301    | 17,157,000    |    |
| ウシオ電機             | 95,300  | 1,875  | 178,687,500   |    |
| 岡谷電機産業            | 8,500   | 554    | 4,709,000     |    |
| フェニックス電機          | 15,000  | 256    | 3,840,000     |    |
| 日本セラミック           | 10,300  | 1,290  | 13,287,000    |    |
| 新神戸電機             | 15,000  | 906    | 13,590,000    |    |
| 日本デジタル研究所         | 13,200  | 1,279  | 16,882,800    |    |
| 古河電池              | 11,000  | 930    | 10,230,000    |    |
| 双信電機              | 6,800   | 544    | 3,699,200     |    |
| 山一電機              | 12,000  | 385    | 4,620,000     |    |
| 函研                | 12,200  | 1,001  | 12,212,200    |    |
| 日本電子              | 58,000  | 496    | 28,768,000    |    |
| カシオ計算機            | 163,200 | 1,337  | 218,198,400   |    |
| ファナック             | 151,800 | 11,090 | 1,683,462,000 |    |
| F D K             | 69,000  | 250    | 17,250,000    |    |
| 日本シイエムケイ          | 33,800  | 747    | 25,248,600    |    |
| エンプラス             | 12,400  | 1,270  | 15,748,000    |    |
| ローム               | 86,900  | 6,590  | 572,671,000   |    |
| 浜松ホトニクス           | 57,200  | 3,080  | 176,176,000   |    |
| 三井ハイテック           | 18,900  | 871    | 16,461,900    |    |
| 新光電気工業            | 46,100  | 1,543  | 71,132,300    |    |
| 京セラ               | 130,600 | 9,640  | 1,258,984,000 |    |
| 日本インター            | 15,400  | 273    | 4,204,200     |    |
| 太陽誘電              | 82,000  | 1,220  | 100,040,000   |    |
| 村田製作所             | 164,700 | 5,500  | 905,850,000   |    |
| ユーシン              | 17,300  | 835    | 14,445,500    |    |
| 双葉電子工業            | 27,700  | 1,876  | 51,965,200    |    |
| 北陸電気工業            | 77,000  | 190    | 14,630,000    |    |
| 松下電工              | 293,000 | 1,104  | 323,472,000   |    |
| ニチコン              | 57,000  | 925    | 52,725,000    |    |
| 日本ケミコン            | 81,000  | 467    | 37,827,000    |    |
| K O A             | 25,400  | 861    | 21,869,400    |    |
| 市光工業              | 42,000  | 256    | 10,752,000    |    |
| 小糸製作所             | 71,000  | 1,549  | 109,979,000   |    |
| ミツバ               | 29,000  | 676    | 19,604,000    |    |
| アロカ               | 10,400  | 1,423  | 14,799,200    |    |
| スター精密             | 31,900  | 1,918  | 61,184,200    |    |
| 大日本スクリーン製造        | 161,000 | 488    | 78,568,000    |    |
| キヤノン電子            | 14,200  | 2,910  | 41,322,000    |    |
| キヤノン              | 975,100 | 5,340  | 5,207,034,000 |    |
| リコー               | 508,000 | 1,816  | 922,528,000   |    |
| 日本電産サンキョー         | 56,000  | 738    | 41,328,000    |    |
| M U T O Hホールディングス | 23,000  | 338    | 7,774,000     |    |
| 東京エレクトロン          | 114,400 | 6,700  | 766,480,000   |    |
| トヨタ紡織             | 54,900  | 2,935  | 161,131,500   |    |

| 銘柄         | 株式数       | 評価額   |                | 備考                       |
|------------|-----------|-------|----------------|--------------------------|
|            |           | 単価(円) | 金額(円)          |                          |
| 鬼怒川ゴム工業    | 40,000    | 256   | 10,240,000     |                          |
| ユニプレス      | 23,800    | 1,016 | 24,180,800     |                          |
| ボッシュ       | 153,000   | 599   | 91,647,000     |                          |
| 豊田自動織機     | 142,900   | 3,620 | 517,298,000    |                          |
| モリタ        | 25,000    | 426   | 10,650,000     |                          |
| 三櫻工業       | 20,000    | 712   | 14,240,000     |                          |
| デンソー       | 387,800   | 3,890 | 1,508,542,000  |                          |
| 東海理化電機製作所  | 36,800    | 2,460 | 90,528,000     |                          |
| 三井造船       | 527,000   | 394   | 207,638,000    |                          |
| 佐世保重工業     | 103,000   | 372   | 38,316,000     |                          |
| 川崎重工業      | 1,139,000 | 337   | 383,843,000    |                          |
| 日本車輛製造     | 100,000   | 268   | 26,800,000     |                          |
| 日本輸送機      | 18,000    | 361   | 6,498,000      |                          |
| 近畿車輛       | 27,000    | 453   | 12,231,000     |                          |
| 日産自動車      | 1,762,800 | 936   | 1,649,980,800  |                          |
| いすゞ自動車     | 827,000   | 561   | 463,947,000    |                          |
| トヨタ自動車     | 2,016,600 | 5,420 | 10,929,972,000 | 代用有価証券で<br>250,000株 担保差入 |
| 日野自動車      | 224,000   | 703   | 157,472,000    |                          |
| 三菱自動車工業    | 3,509,000 | 202   | 708,818,000    |                          |
| エフテック      | 5,500     | 1,682 | 9,251,000      |                          |
| 武蔵精密工業     | 13,700    | 2,560 | 35,072,000     |                          |
| トヨタ車体      | 28,600    | 2,105 | 60,203,000     |                          |
| 日産車体       | 61,000    | 822   | 50,142,000     |                          |
| 関東自動車工業    | 27,300    | 1,407 | 38,411,100     |                          |
| 新明和工業      | 64,000    | 420   | 26,880,000     |                          |
| 極東開発工業     | 29,200    | 694   | 20,264,800     |                          |
| 日信工業       | 31,900    | 1,722 | 54,931,800     |                          |
| トピー工業      | 140,000   | 310   | 43,400,000     |                          |
| ティラド       | 47,000    | 512   | 24,064,000     |                          |
| 曙ブレーキ工業    | 43,400    | 752   | 32,636,800     |                          |
| タチエス       | 22,300    | 1,123 | 25,042,900     |                          |
| NOK        | 84,400    | 1,908 | 161,035,200    |                          |
| フタバ産業      | 34,200    | 2,565 | 87,723,000     |                          |
| カヤバ工業      | 130,000   | 481   | 62,530,000     |                          |
| シロキ工業      | 31,000    | 288   | 8,928,000      |                          |
| 大同メタル工業    | 31,000    | 571   | 17,701,000     |                          |
| プレス工業      | 67,000    | 534   | 35,778,000     |                          |
| カルソニックカンセイ | 107,000   | 404   | 43,228,000     |                          |
| 太平洋工業      | 32,000    | 428   | 13,696,000     |                          |
| ケーヒン       | 32,500    | 1,711 | 55,607,500     |                          |
| 河西工業       | 15,000    | 320   | 4,800,000      |                          |
| アイシン精機     | 143,600   | 3,730 | 535,628,000    |                          |
| 富士機工       | 18,000    | 185   | 3,330,000      |                          |
| マツダ        | 622,000   | 573   | 356,406,000    |                          |
| ダイハツ工業     | 167,000   | 1,209 | 201,903,000    |                          |
| 愛知機械工業     | 40,000    | 387   | 15,480,000     |                          |
| 今仙電機製作所    | 7,800     | 1,708 | 13,322,400     |                          |
| 本田技研工業     | 1,341,500 | 3,700 | 4,963,550,000  |                          |
| スズキ        | 317,400   | 2,645 | 839,523,000    |                          |
| 富士重工業      | 534,000   | 534   | 285,156,000    |                          |
| ヤマハ発動機     | 153,600   | 2,135 | 327,936,000    |                          |
| ショーワ       | 37,100    | 838   | 31,089,800     |                          |

| 銘柄              | 株式数     | 評価額     |             | 備考 |
|-----------------|---------|---------|-------------|----|
|                 |         | 単価(円)   | 金額(円)       |    |
| T B K           | 17,000  | 505     | 8,585,000   |    |
| エクセディ           | 19,000  | 3,150   | 59,850,000  |    |
| 豊田合成            | 44,400  | 3,370   | 149,628,000 |    |
| 愛三工業            | 16,300  | 1,038   | 16,919,400  |    |
| ヨロズ             | 9,500   | 1,506   | 14,307,000  |    |
| エフ・シー・シー        | 23,100  | 1,589   | 36,705,900  |    |
| シマノ             | 60,800  | 5,100   | 310,080,000 |    |
| タカタ             | 27,800  | 2,430   | 67,554,000  |    |
| テイ・エス テック       | 22,600  | 1,978   | 44,702,800  |    |
| 日本電産トーソク        | 4,800   | 892     | 4,281,600   |    |
| テルモ             | 113,100 | 5,270   | 596,037,000 |    |
| 日機装             | 46,000  | 815     | 37,490,000  |    |
| 島津製作所           | 188,000 | 1,154   | 216,952,000 |    |
| J M S           | 22,000  | 300     | 6,600,000   |    |
| モリテックス          | 9,600   | 532     | 5,107,200   |    |
| 長野計器            | 7,200   | 1,038   | 7,473,600   |    |
| トキメック           | 58,000  | 257     | 14,906,000  |    |
| 愛知時計電機          | 33,000  | 243     | 8,019,000   |    |
| 東京精密            | 29,400  | 1,827   | 53,713,800  |    |
| ニコン             | 273,000 | 3,410   | 930,930,000 |    |
| トプコン            | 31,700  | 1,094   | 34,679,800  |    |
| オリンパス           | 185,000 | 3,430   | 634,550,000 |    |
| 理研計器            | 13,900  | 726     | 10,091,400  |    |
| タムロン            | 15,200  | 2,320   | 35,264,000  |    |
| H O Y A         | 339,300 | 2,730   | 926,289,000 |    |
| ノーリツ鋼機          | 12,700  | 1,377   | 17,487,900  |    |
| エー・アンド・デイ       | 12,000  | 998     | 11,976,000  |    |
| 日本電産コパル         | 15,400  | 1,461   | 22,499,400  |    |
| シチズンホールディングス    | 241,000 | 852     | 205,332,000 |    |
| リズム時計工業         | 85,000  | 133     | 11,305,000  |    |
| セイコーホールディングス    | 63,000  | 533     | 33,579,000  |    |
| ニプロ             | 34,000  | 1,834   | 62,356,000  |    |
| S R I スポーツ      | 101     | 152,000 | 15,352,000  |    |
| バンダイナムコホールディングス | 174,800 | 1,321   | 230,910,800 |    |
| 共立印刷            | 15,700  | 288     | 4,521,600   |    |
| フランスベッドホールディングス | 107,000 | 156     | 16,692,000  |    |
| パイロットコーポレーション   | 148     | 185,000 | 27,380,000  |    |
| トッパン・フォームズ      | 34,200  | 1,183   | 40,458,600  |    |
| フジシールインターナショナル  | 17,600  | 1,949   | 34,302,400  |    |
| タカラトミー          | 47,200  | 708     | 33,417,600  |    |
| 廣濟堂             | 13,900  | 518     | 7,200,200   |    |
| アーク             | 41,500  | 315     | 13,072,500  |    |
| タカノ             | 6,200   | 863     | 5,350,600   |    |
| プロネクサス          | 21,800  | 741     | 16,153,800  |    |
| ホクシン            | 29,600  | 215     | 6,364,000   |    |
| ウッドワン           | 34,000  | 605     | 20,570,000  |    |
| 大建工業            | 87,000  | 190     | 16,530,000  |    |
| 凸版印刷            | 477,000 | 1,169   | 557,613,000 |    |
| 大日本印刷           | 478,000 | 1,584   | 757,152,000 |    |
| 図書印刷            | 36,000  | 267     | 9,612,000   |    |
| 共同印刷            | 55,000  | 310     | 17,050,000  |    |
| 日本写真印刷          | 28,500  | 5,880   | 167,580,000 |    |
| 光村印刷            | 16,000  | 371     | 5,936,000   |    |

| 銘柄            | 株式数       | 評価額       |               | 備考 |
|---------------|-----------|-----------|---------------|----|
|               |           | 単価(円)     | 金額(円)         |    |
| 宝印刷           | 8,100     | 779       | 6,309,900     |    |
| コンビ           | 10,000    | 702       | 7,020,000     |    |
| アシックス         | 146,000   | 1,214     | 177,244,000   |    |
| ツツミ           | 6,000     | 2,195     | 13,170,000    |    |
| ローランド         | 12,300    | 2,210     | 27,183,000    |    |
| 小松ウオール工業      | 5,500     | 1,283     | 7,056,500     |    |
| ヤマハ           | 140,900   | 2,075     | 292,367,500   |    |
| 河合楽器製作所       | 64,000    | 164       | 10,496,000    |    |
| クリナップ         | 26,000    | 694       | 18,044,000    |    |
| ピジョン          | 9,900     | 1,961     | 19,413,900    |    |
| パラマウントベッド     | 14,100    | 1,460     | 20,586,000    |    |
| キングジム         | 13,400    | 858       | 11,497,200    |    |
| リンテック         | 30,000    | 1,883     | 56,490,000    |    |
| イトーキ          | 35,900    | 573       | 20,570,700    |    |
| 任天堂           | 89,800    | 55,900    | 5,019,820,000 |    |
| 三菱鉛筆          | 15,000    | 1,402     | 21,030,000    |    |
| タカラスタンダード     | 87,000    | 501       | 43,587,000    |    |
| コクヨ           | 81,600    | 1,030     | 84,048,000    |    |
| ナカバヤシ         | 36,000    | 190       | 6,840,000     |    |
| ダイワ精工         | 79,000    | 172       | 13,588,000    |    |
| サンウエーブ工業      | 44,000    | 170       | 7,480,000     |    |
| 岡村製作所         | 61,000    | 816       | 49,776,000    |    |
| 美津濃           | 78,000    | 620       | 48,360,000    |    |
| アデランスホールディングス | 20,400    | 2,080     | 42,432,000    |    |
| 東京電力          | 989,100   | 2,610     | 2,581,551,000 |    |
| 中部電力          | 531,600   | 2,350     | 1,249,260,000 |    |
| 関西電力          | 657,000   | 2,280     | 1,497,960,000 |    |
| 中国電力          | 217,000   | 2,185     | 474,145,000   |    |
| 北陸電力          | 161,100   | 2,510     | 404,361,000   |    |
| 東北電力          | 392,200   | 2,195     | 860,879,000   |    |
| 四国電力          | 177,700   | 2,965     | 526,880,500   |    |
| 九州電力          | 346,700   | 2,225     | 771,407,500   |    |
| 北海道電力         | 146,900   | 2,095     | 307,755,500   |    |
| 沖縄電力          | 10,300    | 4,820     | 49,646,000    |    |
| 電源開発          | 113,700   | 4,270     | 485,499,000   |    |
| 東京瓦斯          | 2,005,000 | 417       | 836,085,000   |    |
| 大阪瓦斯          | 1,686,000 | 372       | 627,192,000   |    |
| 東邦瓦斯          | 414,000   | 563       | 233,082,000   |    |
| 北海道瓦斯         | 31,000    | 251       | 7,781,000     |    |
| 西部瓦斯          | 178,000   | 236       | 42,008,000    |    |
| 静岡瓦斯          | 44,500    | 534       | 23,763,000    |    |
| 東武鉄道          | 670,000   | 504       | 337,680,000   |    |
| 相模鉄道          | 205,000   | 390       | 79,950,000    |    |
| 東京急行電鉄        | 834,000   | 554       | 462,036,000   |    |
| 京浜急行電鉄        | 367,000   | 668       | 245,156,000   |    |
| 小田急電鉄         | 539,000   | 677       | 364,903,000   |    |
| 京王電鉄          | 407,000   | 551       | 224,257,000   |    |
| 京成電鉄          | 219,000   | 543       | 118,917,000   |    |
| 富士急行          | 43,000    | 380       | 16,340,000    |    |
| 新京成電鉄         | 20,000    | 335       | 6,700,000     |    |
| 東日本旅客鉄道       | 2,925     | 792,000   | 2,316,600,000 |    |
| 西日本旅客鉄道       | 1,462     | 474,000   | 692,988,000   |    |
| 東海旅客鉄道        | 1,419     | 1,100,000 | 1,560,900,000 |    |

| 銘柄           | 株式数       | 評価額   |               | 備考 |
|--------------|-----------|-------|---------------|----|
|              |           | 単価(円) | 金額(円)         |    |
| アートコーポレーション  | 3,200     | 1,584 | 5,068,800     |    |
| 西日本鉄道        | 205,000   | 355   | 72,775,000    |    |
| ハマキョウレックス    | 5,300     | 2,125 | 11,262,500    |    |
| サカイ引越センター    | 2,900     | 2,500 | 7,250,000     |    |
| 近畿日本鉄道       | 1,334,000 | 339   | 452,226,000   |    |
| 阪急阪神ホールディングス | 992,000   | 433   | 429,536,000   |    |
| 南海電気鉄道       | 329,000   | 423   | 139,167,000   |    |
| 京阪電気鉄道       | 353,000   | 432   | 152,496,000   |    |
| 名糖運輸         | 6,400     | 766   | 4,902,400     |    |
| 名古屋鉄道        | 550,000   | 301   | 165,550,000   |    |
| 日本通運         | 673,000   | 520   | 349,960,000   |    |
| ヤマトホールディングス  | 312,000   | 1,496 | 466,752,000   |    |
| 山九           | 200,000   | 531   | 106,200,000   |    |
| 丸運           | 11,300    | 252   | 2,847,600     |    |
| 丸全昭和運輸       | 48,000    | 337   | 16,176,000    |    |
| センコー         | 60,000    | 388   | 23,280,000    |    |
| トナミ運輸        | 36,000    | 232   | 8,352,000     |    |
| 日本梱包運輸倉庫     | 40,000    | 1,321 | 52,840,000    |    |
| 日本石油輸送       | 18,000    | 217   | 3,906,000     |    |
| 福山通運         | 109,000   | 377   | 41,093,000    |    |
| セイノーホールディングス | 121,000   | 626   | 75,746,000    |    |
| 神奈川中央交通      | 18,000    | 497   | 8,946,000     |    |
| 日立物流         | 32,700    | 1,283 | 41,954,100    |    |
| 日本郵船         | 839,000   | 1,033 | 866,687,000   |    |
| 商船三井         | 823,000   | 1,554 | 1,278,942,000 |    |
| 川崎汽船         | 342,000   | 1,124 | 384,408,000   |    |
| 新和海運         | 63,000    | 640   | 40,320,000    |    |
| 乾汽船          | 15,800    | 1,595 | 25,201,000    |    |
| 明治海運         | 14,000    | 638   | 8,932,000     |    |
| 飯野海運         | 70,400    | 917   | 64,556,800    |    |
| 太平洋海運        | 32,000    | 222   | 7,104,000     |    |
| 共栄タンカー       | 13,000    | 319   | 4,147,000     |    |
| 第一中央汽船       | 103,000   | 734   | 75,602,000    |    |
| 全日本空輸        | 1,521,000 | 396   | 602,316,000   |    |
| 日本航空         | 2,264,000 | 237   | 536,568,000   |    |
| パスコ          | 22,000    | 209   | 4,598,000     |    |
| 国際航業ホールディングス | 18,000    | 380   | 6,840,000     |    |
| 日新           | 59,000    | 308   | 18,172,000    |    |
| 三菱倉庫         | 111,000   | 1,238 | 137,418,000   |    |
| 三井倉庫         | 68,000    | 539   | 36,652,000    |    |
| 住友倉庫         | 124,000   | 549   | 68,076,000    |    |
| 澁澤倉庫         | 48,000    | 599   | 28,752,000    |    |
| 東陽倉庫         | 25,000    | 233   | 5,825,000     |    |
| 日本トランスシティ    | 39,000    | 408   | 15,912,000    |    |
| ケイヒン         | 29,000    | 180   | 5,220,000     |    |
| 安田倉庫         | 11,200    | 863   | 9,665,600     |    |
| 東洋埠頭         | 48,000    | 193   | 9,264,000     |    |
| 宇徳           | 11,300    | 604   | 6,825,200     |    |
| 上組           | 174,000   | 824   | 143,376,000   |    |
| サンリツ         | 3,300     | 855   | 2,821,500     |    |
| キムラユニティー     | 3,500     | 943   | 3,300,500     |    |
| キューソー流通システム  | 4,300     | 846   | 3,637,800     |    |
| 郵船航空サービス     | 12,300    | 1,782 | 21,918,600    |    |

| 銘柄                     | 株式数    | 評価額     |             | 備考 |
|------------------------|--------|---------|-------------|----|
|                        |        | 単価(円)   | 金額(円)       |    |
| 近鉄エクスプレス               | 14,000 | 2,780   | 38,920,000  |    |
| 東海運                    | 6,500  | 332     | 2,158,000   |    |
| バンテック・グループ・ホールディングス    | 72     | 137,000 | 9,864,000   |    |
| システムプロ                 | 113    | 65,200  | 7,367,600   |    |
| 新日鉄ソリューションズ            | 10,300 | 2,400   | 24,720,000  |    |
| コア                     | 5,800  | 630     | 3,654,000   |    |
| ITホールディングス             | 57,400 | 2,050   | 117,670,000 |    |
| ドワンゴ                   | 83     | 243,000 | 20,169,000  |    |
| ベリサーブ                  | 5      | 318,000 | 1,590,000   |    |
| マクロミル                  | 70     | 168,000 | 11,760,000  |    |
| テレパーク                  | 146    | 130,000 | 18,980,000  |    |
| インターネットイニシアティブ         | 104    | 376,000 | 39,104,000  |    |
| ソネットエンタテインメント          | 90     | 398,000 | 35,820,000  |    |
| SRAホールディングス            | 6,700  | 1,522   | 10,197,400  |    |
| JBIホールディングス            | 16,000 | 407     | 6,512,000   |    |
| 朝日ネット                  | 12,000 | 292     | 3,504,000   |    |
| 松下電工インフォメーションシステムズ     | 2,600  | 2,565   | 6,669,000   |    |
| フェイス                   | 696    | 8,900   | 6,194,400   |    |
| 野村総合研究所                | 76,800 | 2,500   | 192,000,000 |    |
| サイバネットシステム             | 126    | 44,850  | 5,651,100   |    |
| シンプレクス・テクノロジー          | 288    | 57,500  | 16,560,000  |    |
| クレスコ                   | 2,800  | 901     | 2,522,800   |    |
| フジテレビジョン               | 1,613  | 165,000 | 266,145,000 |    |
| オービック                  | 4,850  | 18,080  | 87,688,000  |    |
| ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング | 3,400  | 781     | 2,655,400   |    |
| ヤフー                    | 14,744 | 42,200  | 622,196,800 |    |
| トレンドマイクロ               | 68,000 | 3,540   | 240,720,000 |    |
| 日本オラクル                 | 24,800 | 4,410   | 109,368,000 |    |
| アルファシステムズ              | 4,200  | 2,465   | 10,353,000  |    |
| フューチャーアーキテクト           | 163    | 60,600  | 9,877,800   |    |
| シーエーシー                 | 9,600  | 1,040   | 9,984,000   |    |
| ソフトバンク・テクノロジー          | 5,100  | 830     | 4,233,000   |    |
| トーセ                    | 3,400  | 955     | 3,247,000   |    |
| オービックビジネスコンサルタント       | 4,900  | 4,680   | 22,932,000  |    |
| 日立ビジネスソリューション          | 4,900  | 659     | 3,229,100   |    |
| 伊藤忠テクノソリューションズ         | 19,600 | 3,540   | 69,384,000  |    |
| アイティフォー                | 17,200 | 402     | 6,914,400   |    |
| 東計電算                   | 3,200  | 1,335   | 4,272,000   |    |
| エクスネット                 | 16     | 130,000 | 2,080,000   |    |
| 大塚商会                   | 12,300 | 7,120   | 87,576,000  |    |
| サイボウズ                  | 225    | 38,000  | 8,550,000   |    |
| ソフトブレーン                | 226    | 8,780   | 1,984,280   |    |
| アグレックス                 | 3,100  | 1,179   | 3,654,900   |    |
| 電通国際情報サービス             | 11,100 | 863     | 9,579,300   |    |
| ウェザーニューズ               | 6,200  | 1,253   | 7,768,600   |    |
| C I J                  | 15,400 | 442     | 6,806,800   |    |
| ネットワンシステムズ             | 404    | 118,000 | 47,672,000  |    |
| エイベックス・グループ・ホールディングス   | 24,900 | 1,160   | 28,884,000  |    |
| 日本ユニシス                 | 37,400 | 1,488   | 55,651,200  |    |
| 富士通ビジネスシステム            | 10,300 | 1,436   | 14,790,800  |    |
| 兼松エレクトロニクス             | 8,400  | 817     | 6,862,800   |    |
| 東京放送                   | 83,500 | 2,265   | 189,127,500 |    |

| 銘柄               | 株式数     | 評価額     |               | 備考 |
|------------------|---------|---------|---------------|----|
|                  |         | 単価(円)   | 金額(円)         |    |
| 日本テレビ放送網         | 13,600  | 12,660  | 172,176,000   |    |
| テレビ朝日            | 400     | 156,000 | 62,400,000    |    |
| テレビ東京            | 6,300   | 4,250   | 26,775,000    |    |
| スカパーJ S A T      | 1,289   | 45,500  | 58,649,500    |    |
| アイ・ティー・シーネットワーク  | 21      | 200,000 | 4,200,000     |    |
| イー・アクセス          | 872     | 55,000  | 47,960,000    |    |
| N E C モバイリング     | 5,700   | 1,731   | 9,866,700     |    |
| 日本電信電話           | 7,122   | 508,000 | 3,617,976,000 |    |
| K D D I          | 2,405   | 675,000 | 1,623,375,000 |    |
| 光通信              | 22,700  | 3,520   | 79,904,000    |    |
| エヌ・ティ・ティ・ドコモ     | 15,333  | 159,000 | 2,437,947,000 |    |
| インボイス            | 8,696   | 1,554   | 13,513,584    |    |
| 学習研究社            | 66,000  | 274     | 18,084,000    |    |
| ゼンリン             | 22,900  | 2,005   | 45,914,500    |    |
| 昭文社              | 9,800   | 720     | 7,056,000     |    |
| 角川グループホールディングス   | 15,100  | 2,475   | 37,372,500    |    |
| インプレスホールディングス    | 228     | 19,030  | 4,338,840     |    |
| アイネット            | 7,400   | 550     | 4,070,000     |    |
| 松竹               | 86,000  | 660     | 56,760,000    |    |
| 東宝               | 110,500 | 2,220   | 245,310,000   |    |
| 東映               | 72,000  | 607     | 43,704,000    |    |
| 葵プロモーション         | 9,000   | 670     | 6,030,000     |    |
| エヌ・ティ・ティ・データ     | 1,094   | 409,000 | 447,446,000   |    |
| テクモ              | 12,100  | 1,012   | 12,245,200    |    |
| 光栄               | 13,400  | 1,441   | 19,309,400    |    |
| D T S            | 16,000  | 1,980   | 31,680,000    |    |
| スクウェア・エニックス      | 50,500  | 3,210   | 162,105,000   |    |
| シーイーシー           | 10,100  | 983     | 9,928,300     |    |
| 日立ソフトウェアエンジニアリング | 25,100  | 2,405   | 60,365,500    |    |
| カプコン             | 38,800  | 3,300   | 128,040,000   |    |
| ジャステック           | 8,000   | 667     | 5,336,000     |    |
| 住商情報システム         | 15,900  | 1,827   | 29,049,300    |    |
| C S K ホールディングス   | 46,000  | 2,180   | 100,280,000   |    |
| 日本システムウエア        | 5,800   | 546     | 3,166,800     |    |
| 日立情報システムズ        | 12,600  | 2,300   | 28,980,000    |    |
| アイネス             | 19,500  | 596     | 11,622,000    |    |
| T K C            | 16,000  | 2,025   | 32,400,000    |    |
| 富士ソフト            | 20,100  | 1,859   | 37,365,900    |    |
| ソラン              | 15,800  | 690     | 10,902,000    |    |
| 日本システムディベロップメント  | 29,900  | 1,252   | 37,434,800    |    |
| コナミ              | 77,000  | 3,650   | 281,050,000   |    |
| 福井コンピュータ         | 3,400   | 571     | 1,941,400     |    |
| J B C C ホールディングス | 14,800  | 780     | 11,544,000    |    |
| ソフトバンク           | 632,100 | 1,877   | 1,186,451,700 |    |
| ハウスイ             | 14,000  | 165     | 2,310,000     |    |
| インターニックス         | 6,300   | 450     | 2,835,000     |    |
| 高千穂交易            | 5,900   | 1,112   | 6,560,800     |    |
| 伊藤忠食品            | 4,400   | 3,350   | 14,740,000    |    |
| 高千穂電気            | 10,100  | 1,364   | 13,776,400    |    |
| J A L U X        | 4,400   | 1,418   | 6,239,200     |    |
| トーマンデバイス         | 2,000   | 1,600   | 3,200,000     |    |
| 双日               | 721,700 | 376     | 271,359,200   |    |
| アルフレッサ ホールディングス  | 30,900  | 6,890   | 212,901,000   |    |

| 銘柄                  | 株式数       | 評価額    |               | 備考 |
|---------------------|-----------|--------|---------------|----|
|                     |           | 単価(円)  | 金額(円)         |    |
| 横浜冷凍                | 33,000    | 757    | 24,981,000    |    |
| 神栄                  | 19,000    | 207    | 3,933,000     |    |
| 山下医科器械              | 900       | 1,471  | 1,323,900     |    |
| ラサ商事                | 5,000     | 526    | 2,630,000     |    |
| あい ホールディングス         | 39,600    | 594    | 23,522,400    |    |
| 三井鉱山                | 103,500   | 337    | 34,879,500    |    |
| ミタチ産業               | 3,200     | 698    | 2,233,600     |    |
| JFE商事ホールディングス       | 92,000    | 854    | 78,568,000    |    |
| グリーンホスピタルサプライ       | 112       | 71,700 | 8,030,400     |    |
| 協栄産業                | 19,000    | 303    | 5,757,000     |    |
| 小野建                 | 14,600    | 1,677  | 24,484,200    |    |
| 佐鳥電機                | 12,200    | 838    | 10,223,600    |    |
| エコートレーディング          | 3,200     | 906    | 2,899,200     |    |
| 伯東                  | 9,400     | 1,056  | 9,926,400     |    |
| 中山福                 | 10,000    | 575    | 5,750,000     |    |
| ナガイレーベン             | 9,300     | 1,800  | 16,740,000    |    |
| 菱食                  | 15,000    | 1,844  | 27,660,000    |    |
| 松田産業                | 10,200    | 2,425  | 24,735,000    |    |
| メディセオ・パルタックホールディングス | 166,000   | 1,921  | 318,886,000   |    |
| アドヴァン               | 16,100    | 648    | 10,432,800    |    |
| S P K               | 3,900     | 1,230  | 4,797,000     |    |
| アズワン                | 11,300    | 2,220  | 25,086,000    |    |
| スズデン                | 4,400     | 723    | 3,181,200     |    |
| 尾家産業                | 5,000     | 757    | 3,785,000     |    |
| シモジマ                | 10,600    | 984    | 10,430,400    |    |
| ドウシシャ               | 7,300     | 1,695  | 12,373,500    |    |
| 高速                  | 9,200     | 535    | 4,922,000     |    |
| 黒田電気                | 22,300    | 1,502  | 33,494,600    |    |
| 丸文                  | 13,700    | 685    | 9,384,500     |    |
| ハピネット               | 5,300     | 1,514  | 8,024,200     |    |
| トーメンエレクトロニクス        | 3,900     | 1,177  | 4,590,300     |    |
| エクセル                | 6,600     | 1,413  | 9,325,800     |    |
| マルカキカイ              | 4,500     | 969    | 4,360,500     |    |
| アルゴグラフィックス          | 6,300     | 1,410  | 8,883,000     |    |
| ガリバーインターナショナル       | 3,660     | 3,580  | 13,102,800    |    |
| 日本エム・ディ・エム          | 13,800    | 295    | 4,071,000     |    |
| 進和                  | 8,400     | 1,892  | 15,892,800    |    |
| エスケイジャパン            | 4,400     | 283    | 1,245,200     |    |
| ダイトエレクトロン           | 6,500     | 744    | 4,836,000     |    |
| シークス                | 11,100    | 767    | 8,513,700     |    |
| 田中商事                | 10,700    | 589    | 6,302,300     |    |
| オーハシテクニカ            | 11,100    | 782    | 8,680,200     |    |
| マクニカ                | 7,100     | 1,491  | 10,586,100    |    |
| 白銅                  | 4,900     | 1,311  | 6,423,900     |    |
| 伊藤忠商事               | 1,159,000 | 1,190  | 1,379,210,000 |    |
| 丸紅                  | 1,271,000 | 921    | 1,170,591,000 |    |
| 高島                  | 32,000    | 176    | 5,632,000     |    |
| F & A アクアホールディングス   | 13,400    | 711    | 9,527,400     |    |
| 長瀬産業                | 74,000    | 1,134  | 83,916,000    |    |
| 蝶理                  | 86,000    | 147    | 12,642,000    |    |
| 豊田通商                | 155,300   | 2,420  | 375,826,000   |    |
| 三共生興                | 23,400    | 286    | 6,692,400     |    |
| 兼松                  | 330,000   | 166    | 54,780,000    |    |



| 銘柄              | 株式数       | 評価額   |               | 備考 |
|-----------------|-----------|-------|---------------|----|
|                 |           | 単価(円) | 金額(円)         |    |
| ツカモトコーポレーション    | 25,000    | 128   | 3,200,000     |    |
| 三井物産            | 1,241,000 | 2,410 | 2,990,810,000 |    |
| 日本紙パルプ商事        | 84,000    | 372   | 31,248,000    |    |
| 日立ハイテクノロジーズ     | 53,700    | 2,490 | 133,713,000   |    |
| カメイ             | 20,000    | 495   | 9,900,000     |    |
| 東都水産            | 27,000    | 216   | 5,832,000     |    |
| スターゼン           | 51,000    | 233   | 11,883,000    |    |
| 山善              | 54,900    | 492   | 27,010,800    |    |
| 椿本興業            | 17,000    | 373   | 6,341,000     |    |
| 住友商事            | 853,400   | 1,469 | 1,253,644,600 |    |
| 内田洋行            | 29,000    | 433   | 12,557,000    |    |
| 三菱商事            | 1,156,100 | 3,540 | 4,092,594,000 |    |
| 第一実業            | 36,000    | 493   | 17,748,000    |    |
| キャノンマーケティングジャパン | 66,300    | 1,929 | 127,892,700   |    |
| 西華産業            | 66,000    | 269   | 17,754,000    |    |
| 佐藤商事            | 14,700    | 876   | 12,877,200    |    |
| 菱洋エレクトロ         | 17,200    | 1,094 | 18,816,800    |    |
| 東京産業            | 15,500    | 340   | 5,270,000     |    |
| ユアサ商事           | 181,000   | 161   | 29,141,000    |    |
| 神鋼商事            | 43,000    | 383   | 16,469,000    |    |
| 阪和興業            | 155,000   | 647   | 100,285,000   |    |
| カナデン            | 17,000    | 566   | 9,622,000     |    |
| 菱電商事            | 22,000    | 757   | 16,654,000    |    |
| フルサト工業          | 9,600     | 1,128 | 10,828,800    |    |
| 岩谷産業            | 172,000   | 315   | 54,180,000    |    |
| すてきなイスグループ      | 71,000    | 265   | 18,815,000    |    |
| 昭光通商            | 55,000    | 159   | 8,745,000     |    |
| ニチモウ            | 22,000    | 199   | 4,378,000     |    |
| 極東貿易            | 18,000    | 239   | 4,302,000     |    |
| イワキ             | 17,000    | 199   | 3,383,000     |    |
| 三愛石油            | 39,000    | 436   | 17,004,000    |    |
| 稲畑産業            | 38,100    | 611   | 23,279,100    |    |
| G S Iクレオス       | 41,000    | 119   | 4,879,000     |    |
| 明和産業            | 14,300    | 280   | 4,004,000     |    |
| 東邦薬品            | 37,500    | 1,912 | 71,700,000    |    |
| サンゲツ            | 24,700    | 1,875 | 46,312,500    |    |
| ミツウロコ           | 26,300    | 651   | 17,121,300    |    |
| シナネン            | 39,000    | 412   | 16,068,000    |    |
| 伊藤忠エネクス         | 42,300    | 710   | 30,033,000    |    |
| ザ・トーカイ          | 37,000    | 500   | 18,500,000    |    |
| サンリオ            | 38,900    | 1,039 | 40,417,100    |    |
| サンワテクノス         | 8,200     | 676   | 5,543,200     |    |
| リョーサン           | 24,900    | 2,360 | 58,764,000    |    |
| 新光商事            | 14,500    | 1,115 | 16,167,500    |    |
| トーホー            | 30,000    | 334   | 10,020,000    |    |
| 三信電気            | 20,300    | 1,157 | 23,487,100    |    |
| 東陽テクニカ          | 17,500    | 1,491 | 26,092,500    |    |
| モスフードサービス       | 21,900    | 1,321 | 28,929,900    |    |
| 加賀電子            | 19,600    | 1,440 | 28,224,000    |    |
| ソーダニッカ          | 15,000    | 392   | 5,880,000     |    |
| 立花エレテック         | 10,200    | 899   | 9,169,800     |    |
| ヤマタネ            | 83,000    | 196   | 16,268,000    |    |
| 丸紅建材リース         | 20,000    | 166   | 3,320,000     |    |

| 銘柄                | 株式数     | 評価額     |             | 備考 |
|-------------------|---------|---------|-------------|----|
|                   |         | 単価(円)   | 金額(円)       |    |
| トラスコ中山            | 16,100  | 1,592   | 25,631,200  |    |
| オートバックスセブン        | 24,900  | 3,240   | 80,676,000  |    |
| ユーエスシー            | 5,500   | 1,401   | 7,705,500   |    |
| 日商エレクトロニクス        | 8,400   | 585     | 4,914,000   |    |
| 加藤産業              | 24,200  | 1,188   | 28,749,600  |    |
| イエローハット           | 16,000  | 497     | 7,952,000   |    |
| 富士エレクトロニクス        | 8,800   | 1,027   | 9,037,600   |    |
| J Kホールディングス       | 20,200  | 578     | 11,675,600  |    |
| ユニダックス            | 8,500   | 502     | 4,267,000   |    |
| 日伝                | 7,100   | 2,680   | 19,028,000  |    |
| ダイワボウ情報システム       | 11,500  | 1,797   | 20,665,500  |    |
| バイタルネット           | 20,000  | 692     | 13,840,000  |    |
| 北沢産業              | 26,000  | 253     | 6,578,000   |    |
| 杉本商事              | 8,300   | 1,281   | 10,632,300  |    |
| 因幡電機産業            | 16,100  | 3,150   | 50,715,000  |    |
| 住金物産              | 80,000  | 428     | 34,240,000  |    |
| ミスミグループ本社         | 47,700  | 1,943   | 92,681,100  |    |
| 江守商事              | 3,100   | 985     | 3,053,500   |    |
| アルテック             | 6,600   | 326     | 2,151,600   |    |
| タキヒヨー             | 33,000  | 327     | 10,791,000  |    |
| スズケン              | 64,100  | 3,950   | 253,195,000 |    |
| ジェコス              | 18,200  | 439     | 7,989,800   |    |
| ローソン              | 49,500  | 4,960   | 245,520,000 |    |
| サンエー              | 5,300   | 3,980   | 21,094,000  |    |
| キリン堂              | 4,700   | 799     | 3,755,300   |    |
| ダイユーエイト           | 2,200   | 700     | 1,540,000   |    |
| カワチ薬品             | 10,800  | 2,935   | 31,698,000  |    |
| エービーシー・マート        | 16,300  | 2,620   | 42,706,000  |    |
| ハードオフコーポレーション     | 6,400   | 478     | 3,059,200   |    |
| アスクル              | 15,700  | 1,975   | 31,007,500  |    |
| ゲオ                | 286     | 89,000  | 25,454,000  |    |
| ポイント              | 13,940  | 4,000   | 55,760,000  |    |
| シー・ヴィ・エス・ベイエリア    | 10,000  | 181     | 1,810,000   |    |
| くらコーポレーション        | 46      | 270,000 | 12,420,000  |    |
| キャンドウ             | 70      | 81,600  | 5,712,000   |    |
| パル                | 4,600   | 1,526   | 7,019,600   |    |
| エディオン             | 67,000  | 934     | 62,578,000  |    |
| サーラコーポレーション       | 15,000  | 455     | 6,825,000   |    |
| パルス               | 86      | 158,000 | 13,588,000  |    |
| あみやき亭             | 31      | 200,000 | 6,200,000   |    |
| ハニーズ              | 12,300  | 1,240   | 15,252,000  |    |
| クリエイイトエス・ディー      | 4,100   | 2,220   | 9,102,000   |    |
| アルペン              | 11,900  | 1,959   | 23,312,100  |    |
| DCM Japanホールディングス | 77,900  | 664     | 51,725,600  |    |
| J .フロント リテイリング    | 366,000 | 635     | 232,410,000 |    |
| ドトール・日レスホールディングス  | 24,700  | 1,830   | 45,201,000  |    |
| マツモトキヨシホールディングス   | 26,100  | 2,455   | 64,075,500  |    |
| ココカラファイン ホールディングス | 10,600  | 2,320   | 24,592,000  |    |
| 三越伊勢丹ホールディングス     | 273,900 | 1,299   | 355,796,100 |    |
| ブックオフコーポレーション     | 9,600   | 863     | 8,284,800   |    |
| あさひ               | 1,900   | 1,480   | 2,812,000   |    |
| サークルKサンクス         | 29,400  | 1,810   | 53,214,000  |    |
| 日本調剤              | 2,950   | 3,420   | 10,089,000  |    |

| 銘柄              | 株式数     | 評価額    |               | 備考 |
|-----------------|---------|--------|---------------|----|
|                 |         | 単価(円)  | 金額(円)         |    |
| コスモス薬品          | 6,800   | 1,268  | 8,622,400     |    |
| セブン&アイ・ホールディングス | 652,700 | 3,170  | 2,069,059,000 |    |
| ツルハホールディングス     | 10,600  | 3,730  | 39,538,000    |    |
| サンマルクホールディングス   | 4,500   | 4,590  | 20,655,000    |    |
| フェリシモ           | 3,000   | 2,140  | 6,420,000     |    |
| はるやま商事          | 6,600   | 581    | 3,834,600     |    |
| カップ・クリエイト       | 10,300  | 2,030  | 20,909,000    |    |
| ライトオン           | 11,700  | 1,149  | 13,443,300    |    |
| ジーンズメイト         | 5,700   | 652    | 3,716,400     |    |
| 良品計画            | 16,400  | 6,350  | 104,140,000   |    |
| 三城              | 21,900  | 1,115  | 24,418,500    |    |
| コナカ             | 16,900  | 565    | 9,548,500     |    |
| G-7ホールディングス     | 4,800   | 503    | 2,414,400     |    |
| イオン北海道          | 9,700   | 345    | 3,346,500     |    |
| コジマ             | 21,100  | 583    | 12,301,300    |    |
| コーナン商事          | 16,700  | 1,516  | 25,317,200    |    |
| エコス             | 5,200   | 695    | 3,614,000     |    |
| ワタミ             | 20,400  | 1,699  | 34,659,600    |    |
| マルシェ            | 4,200   | 675    | 2,835,000     |    |
| ドン・キホーテ         | 35,200  | 2,050  | 72,160,000    |    |
| メガネトップ          | 12,500  | 1,277  | 15,962,500    |    |
| 西松屋チェーン         | 34,000  | 1,306  | 44,404,000    |    |
| ゼンショー           | 52,300  | 675    | 35,302,500    |    |
| 幸楽苑             | 9,600   | 1,087  | 10,435,200    |    |
| ユニマツライフ         | 6,500   | 1,036  | 6,734,000     |    |
| ハークスレイ          | 4,400   | 1,320  | 5,808,000     |    |
| サイゼリヤ           | 15,400  | 971    | 14,953,400    |    |
| ポプラ             | 4,900   | 652    | 3,194,800     |    |
| ユナイテッドアローズ      | 23,400  | 599    | 14,016,600    |    |
| ハイデイ日高          | 6,200   | 887    | 5,499,400     |    |
| 京都きもの友禅         | 82      | 98,000 | 8,036,000     |    |
| コロワイド           | 35,000  | 511    | 17,885,000    |    |
| 壱番屋             | 5,500   | 2,195  | 12,072,500    |    |
| トップカルチャー        | 5,200   | 380    | 1,976,000     |    |
| スギ薬局            | 24,700  | 2,715  | 67,060,500    |    |
| ムトウ             | 18,300  | 568    | 10,394,400    |    |
| ファミリーマート        | 47,600  | 4,070  | 193,732,000   |    |
| 木曽路             | 17,500  | 2,140  | 37,450,000    |    |
| 千趣会             | 30,300  | 778    | 23,573,400    |    |
| タカキュー           | 12,500  | 182    | 2,275,000     |    |
| ケーヨー            | 35,000  | 550    | 19,250,000    |    |
| 上新電機            | 34,000  | 865    | 29,410,000    |    |
| 日本瓦斯            | 18,000  | 1,033  | 18,594,000    |    |
| ベスト電器           | 53,000  | 632    | 33,496,000    |    |
| マルエツ            | 31,000  | 793    | 24,583,000    |    |
| ロイヤルホールディングス    | 24,000  | 1,158  | 27,792,000    |    |
| 東天紅             | 13,000  | 195    | 2,535,000     |    |
| いなげや            | 17,000  | 900    | 15,300,000    |    |
| 島忠              | 37,600  | 2,725  | 102,460,000   |    |
| チョダ             | 24,400  | 1,759  | 42,919,600    |    |
| 鈴丹              | 4,500   | 337    | 1,516,500     |    |
| ライフコーポレーション     | 9,900   | 1,498  | 14,830,200    |    |
| カスミ             | 35,000  | 672    | 23,520,000    |    |

| 銘柄               | 株式数     | 評価額     |             | 備考 |
|------------------|---------|---------|-------------|----|
|                  |         | 単価(円)   | 金額(円)       |    |
| 東急ストア            | 27,000  | 558     | 15,066,000  |    |
| リンガーハット          | 11,800  | 1,330   | 15,694,000  |    |
| さが美              | 13,000  | 122     | 1,586,000   |    |
| MrMax            | 17,600  | 399     | 7,022,400   |    |
| テナライド            | 10,700  | 326     | 3,488,200   |    |
| 相鉄ローゼン           | 10,000  | 446     | 4,460,000   |    |
| AOKIホールディングス     | 16,800  | 1,709   | 28,711,200  |    |
| オークワ             | 22,000  | 1,535   | 33,770,000  |    |
| コメリ              | 21,300  | 2,820   | 60,066,000  |    |
| 青山商事             | 42,700  | 2,035   | 86,894,500  |    |
| しまむら             | 16,000  | 7,730   | 123,680,000 |    |
| CFSコーポレーション      | 17,500  | 582     | 10,185,000  |    |
| 高島屋              | 226,000 | 1,054   | 238,204,000 |    |
| 丸善               | 80,000  | 116     | 9,280,000   |    |
| 松屋               | 26,000  | 2,215   | 57,590,000  |    |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 121,000 | 811     | 98,131,000  |    |
| 丸栄               | 26,000  | 328     | 8,528,000   |    |
| ニッセンホールディングス     | 37,200  | 552     | 20,534,400  |    |
| パルコ              | 40,200  | 1,379   | 55,435,800  |    |
| 丸井グループ           | 240,300 | 854     | 205,216,200 |    |
| 原信ナルスホールディングス    | 8,600   | 1,095   | 9,417,000   |    |
| 井筒屋              | 90,000  | 96      | 8,640,000   |    |
| ダイエー             | 71,700  | 799     | 57,288,300  |    |
| イズミヤ             | 51,000  | 674     | 34,374,000  |    |
| イオン              | 585,200 | 1,557   | 911,156,400 |    |
| ユニー              | 120,000 | 1,211   | 145,320,000 |    |
| イズミ              | 48,000  | 1,725   | 82,800,000  |    |
| 東武ストア            | 21,000  | 366     | 7,686,000   |    |
| 平和堂              | 28,500  | 1,692   | 48,222,000  |    |
| フジ               | 17,400  | 1,739   | 30,258,600  |    |
| ヤオコー             | 7,800   | 3,110   | 24,258,000  |    |
| ゼビオ              | 16,400  | 2,545   | 41,738,000  |    |
| ケーズホールディングス      | 29,700  | 1,811   | 53,786,700  |    |
| Olympic          | 11,400  | 560     | 6,384,000   |    |
| 東日カーライフグループ      | 22,000  | 119     | 2,618,000   |    |
| 元気寿司             | 4,400   | 1,242   | 5,464,800   |    |
| ヤマダ電機            | 75,170  | 8,060   | 605,870,200 |    |
| アークランドサカモト       | 10,200  | 1,100   | 11,220,000  |    |
| ニトリ              | 33,250  | 5,390   | 179,217,500 |    |
| グルメ杵屋            | 11,000  | 780     | 8,580,000   |    |
| 愛眼               | 12,500  | 694     | 8,675,000   |    |
| 吉野家ホールディングス      | 420     | 139,000 | 58,380,000  |    |
| 松屋フーズ            | 7,500   | 1,266   | 9,495,000   |    |
| サガミチェーン          | 17,000  | 1,123   | 19,091,000  |    |
| セシール             | 14,200  | 245     | 3,479,000   |    |
| ブレナス             | 17,400  | 1,490   | 25,926,000  |    |
| ミニストップ           | 11,500  | 2,135   | 24,552,500  |    |
| イマージュホールディングス    | 5,200   | 405     | 2,106,000   |    |
| アークス             | 20,000  | 1,384   | 27,680,000  |    |
| パロー              | 30,800  | 1,029   | 31,693,200  |    |
| 大庄               | 9,400   | 1,246   | 11,712,400  |    |
| ファーストリテイリング      | 36,200  | 10,260  | 371,412,000 |    |
| サンドラッグ           | 26,200  | 2,350   | 61,570,000  |    |

| 銘柄                | 株式数       | 評価額     |               | 備考 |
|-------------------|-----------|---------|---------------|----|
|                   |           | 単価(円)   | 金額(円)         |    |
| ヤマザワ              | 4,100     | 1,420   | 5,822,000     |    |
| やまや               | 3,100     | 613     | 1,900,300     |    |
| ペルーナ              | 16,650    | 838     | 13,952,700    |    |
| 新生銀行              | 1,308,000 | 404     | 528,432,000   |    |
| あおぞら銀行            | 643,000   | 266     | 171,038,000   |    |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 8,999,400 | 1,066   | 9,593,360,400 |    |
| りそなホールディングス       | 4,722     | 180,000 | 849,960,000   |    |
| 中央三井トラスト・ホールディングス | 818,000   | 745     | 609,410,000   |    |
| 三井住友フィナンシャルグループ   | 6,538     | 891,000 | 5,825,358,000 |    |
| 第四銀行              | 216,000   | 478     | 103,248,000   |    |
| 北越銀行              | 164,000   | 262     | 42,968,000    |    |
| 西日本シティ銀行          | 544,000   | 350     | 190,400,000   |    |
| 札幌北洋ホールディングス      | 234       | 788,000 | 184,392,000   |    |
| 千葉銀行              | 611,000   | 781     | 477,191,000   |    |
| 横浜銀行              | 1,069,000 | 770     | 823,130,000   |    |
| 常陽銀行              | 601,000   | 557     | 334,757,000   |    |
| 群馬銀行              | 369,000   | 746     | 275,274,000   |    |
| 武蔵野銀行             | 23,500    | 4,640   | 109,040,000   |    |
| 千葉興業銀行            | 32,500    | 1,488   | 48,360,000    |    |
| 関東つくば銀行           | 41,900    | 570     | 23,883,000    |    |
| 東京都民銀行            | 29,300    | 2,270   | 66,511,000    |    |
| 七十七銀行             | 262,000   | 658     | 172,396,000   |    |
| 青森銀行              | 98,000    | 427     | 41,846,000    |    |
| 秋田銀行              | 108,000   | 480     | 51,840,000    |    |
| 山形銀行              | 95,000    | 613     | 58,235,000    |    |
| 岩手銀行              | 10,500    | 6,470   | 67,935,000    |    |
| 東邦銀行              | 122,000   | 469     | 57,218,000    |    |
| 荘内銀行              | 79,000    | 233     | 18,407,000    |    |
| 東北銀行              | 86,000    | 172     | 14,792,000    |    |
| みちのく銀行            | 82,000    | 310     | 25,420,000    |    |
| ふくおかフィナンシャルグループ   | 629,000   | 537     | 337,773,000   |    |
| 静岡銀行              | 485,000   | 1,169   | 566,965,000   |    |
| 十六銀行              | 200,000   | 552     | 110,400,000   |    |
| スルガ銀行             | 181,000   | 1,505   | 272,405,000   |    |
| 八十二銀行             | 293,000   | 711     | 208,323,000   |    |
| 山梨中央銀行            | 105,000   | 609     | 63,945,000    |    |
| 大垣共立銀行            | 179,000   | 602     | 107,758,000   |    |
| 福井銀行              | 135,000   | 315     | 42,525,000    |    |
| 北國銀行              | 180,000   | 425     | 76,500,000    |    |
| 清水銀行              | 5,400     | 4,620   | 24,948,000    |    |
| 滋賀銀行              | 145,000   | 675     | 97,875,000    |    |
| 南都銀行              | 155,000   | 603     | 93,465,000    |    |
| 百五銀行              | 153,000   | 673     | 102,969,000   |    |
| 京都銀行              | 264,000   | 1,164   | 307,296,000   |    |
| 三重銀行              | 71,000    | 559     | 39,689,000    |    |
| 池田銀行              | 14,400    | 3,790   | 54,576,000    |    |
| ほくほくフィナンシャルグループ   | 1,085,000 | 330     | 358,050,000   |    |
| 広島銀行              | 457,000   | 501     | 228,957,000   |    |
| 山陰合同銀行            | 94,000    | 941     | 88,454,000    |    |
| 中国銀行              | 127,000   | 1,626   | 206,502,000   |    |
| 鳥取銀行              | 54,000    | 277     | 14,958,000    |    |
| 伊予銀行              | 177,000   | 1,335   | 236,295,000   |    |
| 百十四銀行             | 181,000   | 623     | 112,763,000   |    |

| 銘柄                  | 株式数       | 評価額     |               | 備考 |
|---------------------|-----------|---------|---------------|----|
|                     |           | 単価(円)   | 金額(円)         |    |
| 四国銀行                | 114,000   | 463     | 52,782,000    |    |
| 阿波銀行                | 140,000   | 592     | 82,880,000    |    |
| 鹿児島銀行               | 101,000   | 876     | 88,476,000    |    |
| 大分銀行                | 80,000    | 689     | 55,120,000    |    |
| 宮崎銀行                | 81,000    | 473     | 38,313,000    |    |
| 肥後銀行                | 123,000   | 688     | 84,624,000    |    |
| 佐賀銀行                | 96,000    | 387     | 37,152,000    |    |
| 十八銀行                | 107,000   | 404     | 43,228,000    |    |
| 沖縄銀行                | 12,100    | 3,960   | 47,916,000    |    |
| 琉球銀行                | 31,200    | 1,154   | 36,004,800    |    |
| 住友信託銀行              | 1,388,000 | 860     | 1,193,680,000 |    |
| みずほ信託銀行             | 1,470,000 | 214     | 314,580,000   |    |
| 八千代銀行               | 88        | 470,000 | 41,360,000    |    |
| みずほフィナンシャルグループ      | 9,443     | 553,000 | 5,221,979,000 |    |
| 紀陽ホールディングス          | 577,000   | 176     | 101,552,000   |    |
| 山口フィナンシャルグループ       | 155,000   | 1,568   | 243,040,000   |    |
| 長野銀行                | 60,000    | 266     | 15,960,000    |    |
| 名古屋銀行               | 143,000   | 677     | 96,811,000    |    |
| 愛知銀行                | 5,700     | 8,750   | 49,875,000    |    |
| 第三銀行                | 97,000    | 375     | 36,375,000    |    |
| 中京銀行                | 65,000    | 310     | 20,150,000    |    |
| 東日本銀行               | 82,000    | 435     | 35,670,000    |    |
| 愛媛銀行                | 98,000    | 369     | 36,162,000    |    |
| トマト銀行               | 63,000    | 218     | 13,734,000    |    |
| みなの銀行               | 163,000   | 210     | 34,230,000    |    |
| 京葉銀行                | 139,000   | 706     | 98,134,000    |    |
| 関西アーバン銀行            | 166,000   | 312     | 51,792,000    |    |
| 栃木銀行                | 84,000    | 696     | 58,464,000    |    |
| 北日本銀行               | 4,900     | 3,630   | 17,787,000    |    |
| 香川銀行                | 55,000    | 650     | 35,750,000    |    |
| 徳島銀行                | 43,000    | 579     | 24,897,000    |    |
| 福島銀行                | 205,000   | 93      | 19,065,000    |    |
| 大和証券グループ本社          | 1,095,000 | 1,098   | 1,202,310,000 |    |
| 野村ホールディングス          | 1,629,000 | 1,752   | 2,854,008,000 |    |
| 新光証券                | 395,000   | 367     | 144,965,000   |    |
| みずほインベスターズ証券        | 363,000   | 142     | 51,546,000    |    |
| 岡三ホールディングス          | 132,000   | 609     | 80,388,000    |    |
| コスモ証券               | 169,000   | 99      | 16,731,000    |    |
| 丸三証券                | 48,200    | 736     | 35,475,200    |    |
| 東洋証券                | 68,000    | 389     | 26,452,000    |    |
| 東海東京証券              | 181,000   | 447     | 80,907,000    |    |
| 光世証券                | 40,000    | 129     | 5,160,000     |    |
| 水戸証券                | 52,000    | 345     | 17,940,000    |    |
| いちよし証券              | 35,500    | 1,028   | 36,494,000    |    |
| 松井証券                | 105,500   | 749     | 79,019,500    |    |
| だいこう証券ビジネス          | 6,300     | 760     | 4,788,000     |    |
| マネックス・ビーンズ・ホールディングス | 800       | 76,300  | 61,040,000    |    |
| カブドットコム証券           | 431       | 139,000 | 59,909,000    |    |
| 極東証券                | 21,200    | 826     | 17,511,200    |    |
| 岩井証券                | 16,100    | 1,265   | 20,366,500    |    |
| 小林洋行                | 5,600     | 412     | 2,307,200     |    |
| 三井住友海上グループホールディングス  | 329,100   | 4,180   | 1,375,638,000 |    |
| ソニーフィナンシャルホールディングス  | 636       | 465,000 | 295,740,000   |    |

| 銘柄                | 株式数       | 評価額     |               | 備考 |
|-------------------|-----------|---------|---------------|----|
|                   |           | 単価(円)   | 金額(円)         |    |
| 日本興亜損害保険          | 604,000   | 1,067   | 644,468,000   |    |
| 損害保険ジャパン          | 770,000   | 1,163   | 895,510,000   |    |
| ニッセイ同和損害保険        | 176,000   | 631     | 111,056,000   |    |
| あいおい損害保険          | 369,000   | 652     | 240,588,000   |    |
| 富士火災海上保険          | 163,000   | 319     | 51,997,000    |    |
| ミレアホールディングス       | 667,700   | 4,360   | 2,911,172,000 |    |
| T & Dホールディングス     | 204,100   | 7,150   | 1,459,315,000 |    |
| クレディセゾン           | 132,800   | 2,380   | 316,064,000   |    |
| オーエムシーカード         | 53,900    | 359     | 19,350,100    |    |
| フィデック             | 55        | 84,900  | 4,669,500     |    |
| 芙蓉総合リース           | 16,400    | 3,300   | 54,120,000    |    |
| 興銀リース             | 23,700    | 2,195   | 52,021,500    |    |
| センチュリー・リーシング・システム | 26,100    | 1,239   | 32,337,900    |    |
| S B Iホールディングス     | 9,152     | 29,880  | 273,461,760   |    |
| 日本証券金融            | 70,900    | 1,054   | 74,728,600    |    |
| 大阪証券金融            | 21,000    | 331     | 6,951,000     |    |
| アイフル              | 82,600    | 1,725   | 142,485,000   |    |
| ポケットカード           | 17,000    | 286     | 4,862,000     |    |
| 武富士               | 107,690   | 1,864   | 200,734,160   |    |
| リコーリース            | 11,000    | 2,415   | 26,565,000    |    |
| イオンクレジットサービス      | 70,000    | 1,537   | 107,590,000   |    |
| アコム               | 70,580    | 3,420   | 241,383,600   |    |
| プロミス              | 72,850    | 3,270   | 238,219,500   |    |
| 東京リース             | 22,600    | 1,028   | 23,232,800    |    |
| 三菱UFJニコス          | 349,000   | 396     | 138,204,000   |    |
| ジャックス             | 96,000    | 254     | 24,384,000    |    |
| 日立キャピタル           | 37,000    | 1,792   | 66,304,000    |    |
| セントラルファイナンス       | 59,000    | 298     | 17,582,000    |    |
| オリックス             | 76,390    | 19,120  | 1,460,576,800 |    |
| 三菱UFJリース          | 44,160    | 4,730   | 208,876,800   |    |
| ジャフコ              | 26,400    | 4,480   | 118,272,000   |    |
| S F C G           | 3,640     | 12,820  | 46,664,800    |    |
| アサックス             | 18        | 135,000 | 2,430,000     |    |
| N E Cリース          | 6,700     | 1,640   | 10,988,000    |    |
| アゼル               | 42,000    | 141     | 5,922,000     |    |
| 昭栄                | 28,400    | 1,483   | 42,117,200    |    |
| 東京建物不動産販売         | 4,200     | 483     | 2,028,600     |    |
| 野村不動産ホールディングス     | 43,700    | 2,435   | 106,409,500   |    |
| パーク24             | 79,300    | 804     | 63,757,200    |    |
| 三井不動産             | 644,000   | 2,380   | 1,532,720,000 |    |
| 三菱地所              | 1,078,000 | 2,585   | 2,786,630,000 |    |
| 平和不動産             | 108,000   | 559     | 60,372,000    |    |
| 東京建物              | 217,000   | 778     | 168,826,000   |    |
| ダイビル              | 40,200    | 1,201   | 48,280,200    |    |
| サンケイビル            | 27,100    | 710     | 19,241,000    |    |
| 東急不動産             | 286,000   | 653     | 186,758,000   |    |
| 京阪神不動産            | 21,000    | 482     | 10,122,000    |    |
| 住友不動産             | 371,000   | 2,335   | 866,285,000   |    |
| 東宝不動産             | 16,700    | 594     | 9,919,800     |    |
| 藤和不動産             | 52,000    | 113     | 5,876,000     |    |
| 有楽土地              | 16,000    | 442     | 7,072,000     |    |
| 大京                | 153,000   | 193     | 29,529,000    |    |
| テーオーシー            | 60,500    | 549     | 33,214,500    |    |

| 銘柄                | 株式数     | 評価額     |             | 備考 |
|-------------------|---------|---------|-------------|----|
|                   |         | 単価(円)   | 金額(円)       |    |
| 東京楽天地             | 26,000  | 394     | 10,244,000  |    |
| レオパレス21           | 108,900 | 1,586   | 172,715,400 |    |
| フジ住宅              | 17,000  | 320     | 5,440,000   |    |
| 空港施設              | 16,500  | 713     | 11,764,500  |    |
| アーバンコーポレーション      | 121,800 | 429     | 52,252,200  |    |
| 明和地所              | 8,000   | 727     | 5,816,000   |    |
| 住友不動産販売           | 5,660   | 4,250   | 24,055,000  |    |
| ゴールドクレスト          | 12,340  | 1,978   | 24,408,520  |    |
| ジョイント・コーポレーション    | 24,000  | 632     | 15,168,000  |    |
| 東栄住宅              | 9,600   | 697     | 6,691,200   |    |
| 日本エスリード           | 6,300   | 983     | 6,192,900   |    |
| 日本綜合地所            | 27,800  | 791     | 21,989,800  |    |
| 東急リパブル            | 14,000  | 950     | 13,300,000  |    |
| 飯田産業              | 7,300   | 567     | 4,139,100   |    |
| 日神不動産             | 9,600   | 574     | 5,510,400   |    |
| クリード              | 109     | 114,000 | 12,426,000  |    |
| アーネストワン           | 29,700  | 385     | 11,434,500  |    |
| タカラレーベン           | 8,200   | 544     | 4,460,800   |    |
| パシフィックホールディングス    | 414     | 60,400  | 25,005,600  |    |
| サンヨーハウジング名古屋      | 65      | 110,000 | 7,150,000   |    |
| イオンモール            | 70,600  | 3,320   | 234,392,000 |    |
| フージャースコーポレーション    | 151     | 32,500  | 4,907,500   |    |
| サンシティ             | 281     | 15,310  | 4,302,110   |    |
| ゼクス               | 127     | 49,800  | 6,324,600   |    |
| タクトホーム            | 80      | 31,100  | 2,488,000   |    |
| ランド               | 52      | 40,500  | 2,106,000   |    |
| シーズクリエイティブ        | 157     | 10,510  | 1,650,070   |    |
| リサ・パートナーズ         | 204     | 209,000 | 42,636,000  |    |
| エヌ・ティ・ティ都市開発      | 1,123   | 150,000 | 168,450,000 |    |
| サンフロンティア不動産       | 106     | 84,100  | 8,914,600   |    |
| 大和システム            | 6,300   | 997     | 6,281,100   |    |
| ランドビジネス           | 76      | 52,600  | 3,997,600   |    |
| アトリウム             | 15,100  | 1,282   | 19,358,200  |    |
| 日本空港ビルデング         | 48,000  | 1,845   | 88,560,000  |    |
| 日本工営              | 61,000  | 293     | 17,873,000  |    |
| 日本M&Aセンター         | 22      | 464,000 | 10,208,000  |    |
| アコーディア・ゴルフ        | 513     | 116,000 | 59,508,000  |    |
| パソナグループ           | 177     | 75,700  | 13,398,900  |    |
| 学情                | 7,900   | 363     | 2,867,700   |    |
| スタジオアリス           | 6,800   | 1,283   | 8,724,400   |    |
| シミック              | 320     | 38,750  | 12,400,000  |    |
| NECフィールドディング      | 13,300  | 1,275   | 16,957,500  |    |
| 綜合警備保障            | 54,700  | 1,373   | 75,103,100  |    |
| カカコム              | 65      | 579,000 | 37,635,000  |    |
| アイロムホールディングス      | 375     | 11,380  | 4,267,500   |    |
| ルネサンス             | 7,400   | 436     | 3,226,400   |    |
| セキュアード・キャピタル・ジャパン | 42      | 191,000 | 8,022,000   |    |
| 新日本科学             | 8,000   | 1,379   | 11,032,000  |    |
| ソネット・エムスリー        | 51      | 393,000 | 20,043,000  |    |
| ディー・エヌ・エー         | 237     | 657,000 | 155,709,000 |    |
| 博報堂DYホールディングス     | 22,730  | 6,060   | 137,743,800 |    |
| 一休                | 108     | 73,600  | 7,948,800   |    |
| ジャパンベストレスキューシステム  | 22      | 45,900  | 1,009,800   |    |



| 銘柄                             | 株式数     | 評価額     |             | 備考 |
|--------------------------------|---------|---------|-------------|----|
|                                |         | 単価(円)   | 金額(円)       |    |
| ジェイコム                          | 14      | 187,000 | 2,618,000   |    |
| パシフィックゴルフグループインターナショナルホールディングス | 347     | 116,000 | 40,252,000  |    |
| テンプスタッフ                        | 185     | 102,000 | 18,870,000  |    |
| イーピーエス                         | 45      | 479,000 | 21,555,000  |    |
| アミューズ                          | 3,900   | 1,711   | 6,672,900   |    |
| ドリームインキュベータ                    | 58      | 133,000 | 7,714,000   |    |
| T A C                          | 7,900   | 368     | 2,907,200   |    |
| ケネディクス                         | 495     | 128,000 | 63,360,000  |    |
| 電通                             | 1,627   | 241,000 | 392,107,000 |    |
| テイクアンドギヴ・ニーズ                   | 437     | 11,110  | 4,855,070   |    |
| ぴあ                             | 4,000   | 1,514   | 6,056,000   |    |
| イオンファンタジー                      | 4,600   | 1,529   | 7,033,400   |    |
| ネクシィーズ                         | 741     | 4,320   | 3,201,120   |    |
| みらかホールディングス                    | 35,700  | 2,580   | 92,106,000  |    |
| アルプス技研                         | 7,100   | 1,131   | 8,030,100   |    |
| サニックス                          | 27,000  | 308     | 8,316,000   |    |
| ダイオーズ                          | 4,700   | 453     | 2,129,100   |    |
| 日本空調サービス                       | 4,400   | 837     | 3,682,800   |    |
| オリエンタルランド                      | 46,400  | 6,420   | 297,888,000 |    |
| ダスキン                           | 49,300  | 1,789   | 88,197,700  |    |
| 明光ネットワークジャパン                   | 17,300  | 526     | 9,099,800   |    |
| ファルコバイオシステムズ                   | 9,900   | 629     | 6,227,100   |    |
| 秀英予備校                          | 3,500   | 562     | 1,967,000   |    |
| 田谷                             | 2,900   | 736     | 2,134,400   |    |
| ラウンドワン                         | 248     | 132,000 | 32,736,000  |    |
| リゾートトラスト                       | 27,900  | 1,446   | 40,343,400  |    |
| ビー・エム・エル                       | 7,800   | 1,977   | 15,420,600  |    |
| ワタベウェディング                      | 5,500   | 1,009   | 5,549,500   |    |
| もしもしホットライン                     | 13,750  | 2,555   | 35,131,250  |    |
| 東急コミュニティー                      | 4,300   | 2,525   | 10,857,500  |    |
| リソー教育                          | 1,944   | 2,165   | 4,208,760   |    |
| シチエ                            | 4,000   | 701     | 2,804,000   |    |
| ユー・エス・エス                       | 20,720  | 7,290   | 151,048,800 |    |
| 東京個別指導学院                       | 26,200  | 210     | 5,502,000   |    |
| カルチュア・コンビニエンス・クラブ              | 75,400  | 506     | 38,152,400  |    |
| 総合メディカル                        | 4,100   | 2,900   | 11,890,000  |    |
| セントラルスポーツ                      | 5,200   | 1,044   | 5,428,800   |    |
| リゾートソリューション                    | 14,000  | 314     | 4,396,000   |    |
| エイチ・アイ・エス                      | 13,500  | 1,571   | 21,208,500  |    |
| 共立メンテナンス                       | 7,700   | 1,954   | 15,045,800  |    |
| イチネン                           | 16,300  | 566     | 9,225,800   |    |
| 建設技術研究所                        | 9,900   | 705     | 6,979,500   |    |
| 燦ホールディングス                      | 3,700   | 1,888   | 6,985,600   |    |
| スバル興業                          | 16,000  | 326     | 5,216,000   |    |
| 東京テアトル                         | 64,000  | 202     | 12,928,000  |    |
| 吉本興業                           | 22,900  | 1,300   | 29,770,000  |    |
| ホリプロ                           | 6,600   | 1,260   | 8,316,000   |    |
| オークネット                         | 5,700   | 2,085   | 11,884,500  |    |
| よみうりランド                        | 37,000  | 361     | 13,357,000  |    |
| 東京都競馬                          | 114,000 | 204     | 23,256,000  |    |
| カナモト                           | 19,000  | 605     | 11,495,000  |    |
| 東京ドーム                          | 113,000 | 463     | 52,319,000  |    |

| 銘柄           | 株式数         | 評価額   |                 | 備考 |
|--------------|-------------|-------|-----------------|----|
|              |             | 単価(円) | 金額(円)           |    |
| トランス・コスモス    | 21,400      | 1,012 | 21,656,800      |    |
| 乃村工藝社        | 34,000      | 388   | 13,192,000      |    |
| 藤田観光         | 36,000      | 703   | 25,308,000      |    |
| 近畿日本ツーリスト    | 48,000      | 195   | 9,360,000       |    |
| 日本管財         | 7,200       | 2,790 | 20,088,000      |    |
| 白洋舎          | 18,000      | 281   | 5,058,000       |    |
| セコム          | 170,600     | 5,100 | 870,060,000     |    |
| セントラル警備保障    | 7,800       | 1,002 | 7,815,600       |    |
| 丹青社          | 25,000      | 314   | 7,850,000       |    |
| メイテック        | 25,900      | 3,140 | 81,326,000      |    |
| アサツー ディ・ケイ   | 29,400      | 3,140 | 92,316,000      |    |
| 応用地質         | 19,200      | 1,200 | 23,040,000      |    |
| 船井総合研究所      | 18,400      | 611   | 11,242,400      |    |
| 進学会          | 8,300       | 464   | 3,851,200       |    |
| ベネッセコーポレーション | 57,000      | 4,270 | 243,390,000     |    |
| イオンディライト     | 10,300      | 1,919 | 19,765,700      |    |
| ナック          | 4,400       | 801   | 3,524,400       |    |
| ニチイ学館        | 17,900      | 1,454 | 26,026,600      |    |
| ダイセキ         | 26,600      | 3,270 | 86,982,000      |    |
| 合計           | 210,438,167 |       | 279,559,217,474 |    |

(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。

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。

「中央三井日本債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 項目       | 平成20年6月10日現在<br>金額(円) |
|----------|-----------------------|
| 資産の部     |                       |
| 流動資産     |                       |
| コール・ローン  | 3,801,781,900         |
| 国債証券     | 183,171,994,400       |
| 地方債証券    | 15,393,297,119        |
| 特殊債券     | 28,284,319,816        |
| 社債券      | 21,987,049,740        |
| 未収利息     | 1,039,423,415         |
| 前払費用     | 108,121,766           |
| 流動資産合計   | 253,785,988,156       |
| 資産合計     | 253,785,988,156       |
| 負債の部     |                       |
| 流動負債     |                       |
| 派生商品評価勘定 | 1,286,460             |
| 前受金      | 13,300,000            |
| 未払金      | 8,172,920             |
| 未払解約金    | 91,122,123            |
| 流動負債合計   | 113,881,503           |
| 負債合計     | 113,881,503           |
| 純資産の部    |                       |
| 元本等      |                       |
| 元本       | 234,283,534,118       |
| 剰余金      |                       |
| 剰余金      | 19,388,572,535        |
| 純資産合計    | 253,672,106,653       |
| 負債・純資産合計 | 253,785,988,156       |

( 2 ) 注記表

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

| 平成20年 6 月10日現在        |   |
|-----------------------|---|
| 1 . 有価証券の評価基準及び評価方法   | 国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券<br>移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。<br>ただし、買付後の最初の利払いまでは個別法によっております。 |
| 2 . デリバティブの評価基準及び評価方法 | 国債先物取引<br>個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。<br>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。          |
| 3 . 収益及び費用の計上基準       | 派生商品取引等損益の計上基準<br>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20年 6 月10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。<br>国債証券 49,928,000 円<br><br>なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおります。 |
| 2 . 計算日における受益権総数                  | 234,283,534,118 口  |
| 3 . 1 口当たり純資産額<br>( 1 万口当たり純資産額 ) | 1.0828 円<br>( 10,828 円 )   |

( 関連当事者との取引に関する注記 )

| 平成20年 6 月10日現在 |  |
|----------------|--|
| 該当事項はありません。    |  |

( 重要な後発事象に関する注記 )

| 平成20年 6 月10日現在 |  |
|----------------|--|
| 該当事項はありません。    |  |

(その他の注記)

1. 本書における開示対象ファンドの当該計算期間における「中央三井日本債券マザーファンド」の元本額の変動

| 平成20年6月10日現在  |                          |
|---|--------------------------|
| 「新生・4分散ファンド」の第1期計算期間(平成19年10月31日から平成20年6月10日まで)における「中央三井日本債券マザーファンド」の元本額の変動及び計算日の元本額の内訳 |                          |
| 同計算期間の期首元本額   | 223,912,686,480 円        |
| 同計算期間中の追加設定元本額  | 41,670,825,593 円         |
| 同計算期間中の一部解約元本額  | <u>31,299,977,955 円</u>  |
| 計算日の元本額   | <u>234,283,534,118 円</u> |
| 計算日の元本額の内訳  |                          |
| 中央三井日本債券インデックスファンド  | 1,626,594,119 円          |
| 中央三井DC日本債券インデックスファンド  | 1,564,203,259 円          |
| 中央三井DC日本債券インデックスファンドL   | 8,732,837,090 円          |
| 中央三井DCバランスファンド30  | 195,404,355 円            |
| 中央三井DCバランスファンド50  | 248,855,032 円            |
| 中央三井DCバランスファンド70  | 89,259,689 円             |
| ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)  | 470,543,204 円            |
| ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)  | 264,480,686 円            |
| 中央三井日本債券インデックスファンド(SMA専用)   | 246,919,151 円            |
| 新生・4分散ファンド  | 297,220,841 円            |
| 4資産インデックスバランスオープン(分配型)  | 78,154,398 円             |
| 4資産インデックスバランスオープン(成長型)  | 135,378,647 円            |
| 中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)   | 15,330,708,590 円         |
| 中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)   | 54,139,738,588 円         |
| 中央三井VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)  | 50,192,637,603 円         |
| 中央三井VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)  | 2,630,792,909 円          |
| 中央三井VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)  | 11,484,190,308 円         |
| 中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)   | 11,220,616,244 円         |
| 中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)   | 2,225,190,849 円          |
| 中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)  | 31,875,233,728 円         |
| 中央三井バランスVA75(適格機関投資家専用)   | 238,048,738 円            |
| 中央三井VL株式30(適格機関投資家専用)   | 36,518,579 円             |
| 中央三井VL株式50(適格機関投資家専用)   | 27,067,100 円             |
| 中央三井VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)  | 35,468,660,955 円         |
| 中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)  | 2,833,974,154 円          |
| 中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)  | 299,248,036 円            |
| 中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)   | 1,715,687,431 円          |
| 中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)   | 609,568,295 円            |
| CMAM・バランスファンドVA(適格機関投資家専用)  | 5,801,540 円              |

2. 有価証券関係  
 売買目的有価証券

| 平成20年6月10日現在 |                 |   |
|--------------|-----------------|---|
| 種類           | 貸借対照表計上額(円)     | 「新生・4分散ファンド」の第1期計算期間において、「中央三井日本債券マザーファンド」の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券         | 183,171,994,400 | 5,056,216,900   |
| 地方債証券        | 15,393,297,119  | 447,887,079   |
| 特殊債券         | 28,284,319,816  | 677,532,192   |
| 社債券          | 21,987,049,740  | 594,017,960   |
| 合計           | 248,836,661,075 | 6,775,654,131   |

(注) 評価差額は、「中央三井日本債券マザーファンド」の期首(平成20年1月23日)から計算日までの期間に対応するものです。

3. デリバティブ取引関係  
 . 取引の状況に関する事項

| 平成20年6月10日現在             |  |
|--------------------------|--|
| 1. 取引の内容                 | 当ファンドが利用している取引は、債券関連の国債先物取引であります。  |
| 2. 取引に対する取組方針            | 国債先物取引は、ファンド運用の効率化を図ること及び将来の価格変動リスクの回避を目的としており、投機的な取引は行わない方針であります。   |
| 3. 取引の利用目的               | 国債先物取引は、ファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、キャッシュ運用の効率化、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用しております。                     |
| 4. 取引に係るリスクの内容           | 国債先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。   |
| 5. 取引に係るリスク管理体制          | 組織的な管理体制により、日々のポジション、評価金額及び評価損益の管理を行っております。<br>また、リスク管理は、デリバティブ取引に限定することなく、デリバティブ取引と現物資産等を総合的に勘案し、各ファンド全体でのリスク管理を、リスクの種類ごとに実施しております。 |
| 6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 | 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、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。                                    |

・取引の時価等に関する事項  
債券関連

| 区分   | 種類           | 平成20年6月10日現在  |       |               |             |
|------|--------------|---------------|-------|---------------|-------------|
|      |              | 契約額等(円)       |       | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|      |              |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引 | 国債先物取引<br>買建 | 2,400,506,460 |       | 2,399,220,000 | 1,286,460   |
|      | 合計           | 2,400,506,460 |       | 2,399,220,000 | 1,286,460   |

(注) 1. 時価の算定方法

国債先物取引の時価については、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は証拠金算定基準値段で評価しております。

2. 国債先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

## (3) 附属明細表(平成20年6月10日現在)

## 有価証券明細表

## A. 株式

該当事項はありません。

## B. 株式以外の有価証券

| 種類   | 銘柄               | 券面総額(円)       | 評価額(円)        | 備考 |
|------|------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | 利付国庫債券(2年)第258回  | 800,000,000   | 802,064,000   |    |
|      | 利付国庫債券(2年)第259回  | 1,000,000,000 | 1,002,550,000 |    |
|      | 利付国庫債券(2年)第260回  | 1,600,000,000 | 1,601,984,000 |    |
|      | 利付国庫債券(2年)第261回  | 1,200,000,000 | 1,201,188,000 |    |
|      | 利付国庫債券(2年)第262回  | 300,000,000   | 299,766,000   |    |
|      | 利付国庫債券(2年)第263回  | 600,000,000   | 599,328,000   |    |
|      | 利付国庫債券(2年)第264回  | 1,300,000,000 | 1,296,009,000 |    |
|      | 利付国庫債券(2年)第265回  | 200,000,000   | 198,662,000   |    |
|      | 利付国庫債券(2年)第266回  | 400,000,000   | 397,788,000   |    |
|      | 利付国庫債券(2年)第267回  | 1,000,000,000 | 994,030,000   |    |
|      | 利付国庫債券(2年)第268回  | 3,300,000,000 | 3,285,678,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第39回   | 900,000,000   | 899,937,000   |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第40回   | 780,000,000   | 778,034,400   |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第41回   | 1,200,000,000 | 1,198,488,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第42回   | 2,970,000,000 | 2,957,496,300 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第43回   | 1,250,000,000 | 1,242,775,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第44回   | 1,370,000,000 | 1,364,629,600 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第45回   | 270,000,000   | 268,450,200   |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第46回   | 1,380,000,000 | 1,369,801,800 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第47回   | 900,000,000   | 891,792,000   |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第48回   | 1,350,000,000 | 1,343,034,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第49回   | 1,000,000,000 | 990,890,000   |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第50回   | 2,000,000,000 | 1,990,660,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第51回   | 1,200,000,000 | 1,199,724,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第52回   | 2,100,000,000 | 2,087,610,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第53回   | 1,400,000,000 | 1,398,796,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第54回   | 1,300,000,000 | 1,300,169,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第55回   | 1,300,000,000 | 1,310,816,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第56回   | 1,300,000,000 | 1,314,482,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第57回   | 1,900,000,000 | 1,914,687,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第58回   | 400,000,000   | 404,260,000   |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第59回   | 1,300,000,000 | 1,306,253,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第60回   | 3,200,000,000 | 3,200,992,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第61回   | 1,200,000,000 | 1,198,572,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第62回   | 2,400,000,000 | 2,405,664,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第63回   | 2,900,000,000 | 2,891,648,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第64回   | 1,800,000,000 | 1,812,708,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第65回   | 1,500,000,000 | 1,504,860,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第66回   | 1,200,000,000 | 1,186,920,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第67回   | 1,500,000,000 | 1,496,055,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第68回   | 1,100,000,000 | 1,085,964,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第69回   | 2,900,000,000 | 2,837,737,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第70回   | 2,100,000,000 | 2,040,486,000 |    |
|      | 利付国庫債券(5年)第71回   | 1,900,000,000 | 1,889,816,000 |    |
|      | 利付国庫債券(10年)第214回 | 900,000,000   | 911,286,000   |    |
|      | 利付国庫債券(10年)第215回 | 500,000,000   | 506,900,000   |    |
|      | 利付国庫債券(10年)第216回 | 420,000,000   | 425,208,000   |    |
|      | 利付国庫債券(10年)第217回 | 520,000,000   | 527,228,000   |    |
|      | 利付国庫債券(10年)第218回 | 350,000,000   | 355,390,000   |    |
|      | 利付国庫債券(10年)第219回 | 900,000,000   | 913,734,000   |    |
|      | 利付国庫債券(10年)第220回 | 910,000,000   | 922,294,100   |    |



| 種類               | 銘柄               | 券面総額(円)       | 評価額(円)        | 備考 |
|------------------|------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券             | 利付国庫債券(10年)第221回 | 450,000,000   | 458,433,000   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第222回 | 640,000,000   | 650,726,400   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第223回 | 1,060,000,000 | 1,076,472,400 |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第224回 | 410,000,000   | 417,375,900   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第225回 | 1,030,000,000 | 1,052,011,100 |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第226回 | 510,000,000   | 519,644,100   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第227回 | 600,000,000   | 608,388,000   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第228回 | 650,000,000   | 657,338,500   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第229回 | 340,000,000   | 342,879,800   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第230回 | 340,000,000   | 340,136,000   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第231回 | 610,000,000   | 612,934,100   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第232回 | 520,000,000   | 520,910,000   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第233回 | 410,000,000   | 413,107,800   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第234回 | 1,840,000,000 | 1,852,732,800 |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第235回 | 1,290,000,000 | 1,297,611,000 |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第236回 | 690,000,000   | 696,403,200   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第237回 | 1,120,000,000 | 1,129,464,000 |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第238回 | 1,190,000,000 | 1,195,771,500 |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第239回 | 910,000,000   | 912,775,500   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第240回 | 1,470,000,000 | 1,468,588,800 |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第241回 | 750,000,000   | 748,177,500   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第242回 | 730,000,000   | 725,284,200   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第243回 | 1,020,000,000 | 1,009,290,000 |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第244回 | 930,000,000   | 913,790,100   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第245回 | 1,030,000,000 | 1,007,669,600 |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第246回 | 680,000,000   | 662,231,600   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第247回 | 910,000,000   | 884,210,600   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第248回 | 170,000,000   | 164,424,000   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第249回 | 760,000,000   | 731,515,200   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第250回 | 600,000,000   | 572,790,000   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第251回 | 770,000,000   | 750,003,100   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第252回 | 730,000,000   | 714,458,300   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第253回 | 1,350,000,000 | 1,359,571,500 |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第254回 | 520,000,000   | 518,471,200   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第255回 | 710,000,000   | 711,384,500   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第256回 | 1,640,000,000 | 1,633,292,400 |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第257回 | 1,100,000,000 | 1,089,891,000 |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第258回 | 1,280,000,000 | 1,266,406,400 |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第259回 | 1,380,000,000 | 1,380,358,800 |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第260回 | 1,160,000,000 | 1,166,078,400 |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第261回 | 290,000,000   | 294,802,400   |    |
|                  | 利付国庫債券(10年)第262回 | 730,000,000   | 746,118,400   |    |
| 利付国庫債券(10年)第263回 | 750,000,000      | 753,645,000   |               |    |
| 利付国庫債券(10年)第264回 | 1,830,000,000    | 1,827,364,800 | 注             |    |
| 利付国庫債券(10年)第265回 | 730,000,000      | 728,262,600   |               |    |
| 利付国庫債券(10年)第266回 | 760,000,000      | 753,471,600   |               |    |
| 利付国庫債券(10年)第267回 | 1,410,000,000    | 1,389,117,900 |               |    |
| 利付国庫債券(10年)第268回 | 1,400,000,000    | 1,395,702,000 |               |    |
| 利付国庫債券(10年)第269回 | 940,000,000      | 925,035,200   |               |    |
| 利付国庫債券(10年)第270回 | 1,400,000,000    | 1,376,088,000 |               |    |
| 利付国庫債券(10年)第271回 | 1,200,000,000    | 1,171,548,000 |               |    |
| 利付国庫債券(10年)第272回 | 600,000,000      | 593,730,000   |               |    |
| 利付国庫債券(10年)第273回 | 1,800,000,000    | 1,793,520,000 |               |    |
| 利付国庫債券(10年)第274回 | 900,000,000      | 896,058,000   |               |    |
| 利付国庫債券(10年)第275回 | 900,000,000      | 889,704,000   |               |    |
| 利付国庫債券(10年)第276回 | 800,000,000      | 802,416,000   |               |    |

| 種類              | 銘柄               | 券面総額(円)       | 評価額(円)        | 備考 |
|-----------------|------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券            | 利付国庫債券(10年)第277回 | 1,300,000,000 | 1,302,249,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(10年)第278回 | 200,000,000   | 203,254,000   |    |
|                 | 利付国庫債券(10年)第279回 | 1,200,000,000 | 1,236,996,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(10年)第280回 | 1,400,000,000 | 1,430,352,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(10年)第281回 | 800,000,000   | 823,616,000   |    |
|                 | 利付国庫債券(10年)第282回 | 1,300,000,000 | 1,305,200,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(10年)第283回 | 1,300,000,000 | 1,315,145,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(10年)第284回 | 1,850,000,000 | 1,852,756,500 |    |
|                 | 利付国庫債券(10年)第285回 | 2,800,000,000 | 2,797,844,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(10年)第286回 | 1,300,000,000 | 1,307,605,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(10年)第287回 | 1,000,000,000 | 1,014,050,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(10年)第288回 | 2,500,000,000 | 2,487,050,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(10年)第289回 | 3,300,000,000 | 3,220,833,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(10年)第290回 | 1,500,000,000 | 1,448,955,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(10年)第291回 | 1,200,000,000 | 1,149,204,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(10年)第292回 | 1,300,000,000 | 1,291,342,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第1回   | 50,000,000    | 53,685,500    |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第2回   | 200,000,000   | 200,714,000   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第3回   | 130,000,000   | 127,856,300   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第4回   | 190,000,000   | 206,260,200   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第5回   | 180,000,000   | 173,392,200   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第6回   | 70,000,000    | 69,633,900    |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第7回   | 290,000,000   | 282,158,400   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第8回   | 170,000,000   | 149,450,400   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第9回   | 80,000,000    | 64,418,400    |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第10回  | 170,000,000   | 127,360,600   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第11回  | 110,000,000   | 94,562,600    |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第12回  | 170,000,000   | 158,365,200   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第13回  | 150,000,000   | 136,611,000   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第14回  | 250,000,000   | 246,275,000   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第15回  | 240,000,000   | 240,758,400   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第16回  | 150,000,000   | 150,357,000   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第17回  | 330,000,000   | 324,475,800   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第18回  | 260,000,000   | 250,455,400   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第19回  | 370,000,000   | 356,054,700   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第20回  | 240,000,000   | 240,194,400   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第21回  | 220,000,000   | 211,446,400   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第22回  | 650,000,000   | 650,000,000   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第24回  | 400,000,000   | 399,336,000   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第25回  | 300,000,000   | 287,139,000   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第26回  | 500,000,000   | 488,770,000   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第27回  | 1,000,000,000 | 997,470,000   |    |
|                 | 利付国庫債券(30年)第28回  | 100,000,000   | 99,914,000    |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第11回  | 400,000,000   | 421,052,000   |    |
| 利付国庫債券(20年)第13回 | 50,000,000       | 56,521,500    |               |    |
| 利付国庫債券(20年)第14回 | 90,000,000       | 105,324,300   |               |    |
| 利付国庫債券(20年)第15回 | 120,000,000      | 138,453,600   |               |    |
| 利付国庫債券(20年)第16回 | 80,000,000       | 94,368,800    |               |    |
| 利付国庫債券(20年)第17回 | 140,000,000      | 164,235,400   |               |    |
| 利付国庫債券(20年)第18回 | 100,000,000      | 118,445,000   |               |    |
| 利付国庫債券(20年)第19回 | 150,000,000      | 178,173,000   |               |    |
| 利付国庫債券(20年)第20回 | 70,000,000       | 82,279,400    |               |    |
| 利付国庫債券(20年)第21回 | 40,000,000       | 47,878,800    |               |    |
| 利付国庫債券(20年)第22回 | 170,000,000      | 200,389,200   |               |    |
| 利付国庫債券(20年)第23回 | 130,000,000      | 156,664,300   |               |    |
| 利付国庫債券(20年)第24回 | 160,000,000      | 188,526,400   |               |    |

| 種類              | 銘柄              | 券面総額(円)     | 評価額(円)      | 備考 |
|-----------------|-----------------|-------------|-------------|----|
| 国債証券            | 利付国庫債券(20年)第25回 | 80,000,000  | 91,599,200  |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第26回 | 50,000,000  | 58,994,000  |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第27回 | 410,000,000 | 496,018,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第28回 | 110,000,000 | 134,520,100 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第29回 | 100,000,000 | 118,328,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第30回 | 200,000,000 | 229,836,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第31回 | 280,000,000 | 319,746,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第32回 | 80,000,000  | 92,569,600  |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第33回 | 430,000,000 | 501,294,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第34回 | 70,000,000  | 80,225,600  |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第35回 | 270,000,000 | 305,523,900 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第37回 | 410,000,000 | 457,252,500 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第39回 | 640,000,000 | 686,521,600 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第40回 | 450,000,000 | 469,908,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第41回 | 820,000,000 | 791,382,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第42回 | 380,000,000 | 407,230,800 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第43回 | 340,000,000 | 374,166,600 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第44回 | 370,000,000 | 391,726,400 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第45回 | 470,000,000 | 492,597,600 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第46回 | 390,000,000 | 399,886,500 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第47回 | 370,000,000 | 378,595,100 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第48回 | 230,000,000 | 242,730,500 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第49回 | 280,000,000 | 282,559,200 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第50回 | 390,000,000 | 384,660,900 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第51回 | 340,000,000 | 338,252,400 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第52回 | 230,000,000 | 231,198,300 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第53回 | 350,000,000 | 350,738,500 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第54回 | 280,000,000 | 283,844,400 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第55回 | 790,000,000 | 780,725,400 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第56回 | 210,000,000 | 207,051,600 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第57回 | 260,000,000 | 253,268,600 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第58回 | 550,000,000 | 534,688,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第59回 | 240,000,000 | 226,668,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第60回 | 170,000,000 | 153,931,600 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第61回 | 490,000,000 | 417,710,300 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第62回 | 250,000,000 | 206,067,500 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第63回 | 570,000,000 | 543,335,400 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第64回 | 310,000,000 | 299,026,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第65回 | 770,000,000 | 741,556,200 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第66回 | 240,000,000 | 228,100,800 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第67回 | 160,000,000 | 153,840,000 |    |
|                 | 利付国庫債券(20年)第68回 | 230,000,000 | 230,133,400 |    |
| 利付国庫債券(20年)第69回 | 460,000,000     | 454,346,600 |             |    |
| 利付国庫債券(20年)第70回 | 400,000,000     | 410,688,000 |             |    |
| 利付国庫債券(20年)第71回 | 300,000,000     | 300,177,000 |             |    |
| 利付国庫債券(20年)第72回 | 820,000,000     | 807,749,200 |             |    |
| 利付国庫債券(20年)第73回 | 740,000,000     | 718,147,800 |             |    |
| 利付国庫債券(20年)第74回 | 210,000,000     | 206,703,000 |             |    |
| 利付国庫債券(20年)第75回 | 360,000,000     | 353,638,800 |             |    |
| 利付国庫債券(20年)第76回 | 230,000,000     | 219,530,400 |             |    |
| 利付国庫債券(20年)第77回 | 410,000,000     | 397,035,800 |             |    |
| 利付国庫債券(20年)第78回 | 200,000,000     | 190,446,000 |             |    |
| 利付国庫債券(20年)第79回 | 200,000,000     | 193,252,000 |             |    |
| 利付国庫債券(20年)第80回 | 650,000,000     | 637,214,500 |             |    |
| 利付国庫債券(20年)第81回 | 420,000,000     | 405,174,000 |             |    |
| 利付国庫債券(20年)第82回 | 610,000,000     | 596,763,000 |             |    |

| 種類               | 銘柄                   | 券面総額(円)         | 評価額(円)          | 備考 |
|------------------|----------------------|-----------------|-----------------|----|
| 国債証券             | 利付国庫債券(20年)第83回      | 530,000,000     | 517,730,500     |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第84回      | 500,000,000     | 480,965,000     |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第85回      | 350,000,000     | 340,952,500     |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第86回      | 270,000,000     | 270,853,200     |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第87回      | 900,000,000     | 889,767,000     |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第88回      | 400,000,000     | 401,020,000     |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第89回      | 400,000,000     | 395,152,000     |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第90回      | 1,200,000,000   | 1,183,032,000   |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第91回      | 300,000,000     | 300,192,000     |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第92回      | 1,000,000,000   | 968,980,000     |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第93回      | 700,000,000     | 666,785,000     |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第94回      | 1,000,000,000   | 968,070,000     |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第95回      | 1,300,000,000   | 1,296,568,000   |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第96回      | 200,000,000     | 193,300,000     |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第97回      | 800,000,000     | 784,080,000     |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第98回      | 300,000,000     | 289,473,000     |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第99回      | 1,100,000,000   | 1,059,652,000   |    |
|                  | 利付国庫債券(20年)第100回     | 800,000,000     | 782,744,000     |    |
| 利付国庫債券(20年)第101回 | 300,000,000          | 303,045,000     |                 |    |
|                  | 国債証券 小計              | 183,550,000,000 | 183,171,994,400 |    |
| 地方債証券            | 東京都公募公債第561回         | 100,000,000     | 101,391,000     |    |
|                  | 東京都公募公債第564回         | 100,000,000     | 101,481,000     |    |
|                  | 東京都公募公債第569回         | 100,000,000     | 101,311,000     |    |
|                  | 東京都公募公債第579回         | 100,000,000     | 99,827,000      |    |
|                  | 東京都公募公債第582回         | 100,000,000     | 100,369,000     |    |
|                  | 東京都公募公債第586回         | 100,000,000     | 99,788,000      |    |
|                  | 東京都公募公債第590回         | 100,000,000     | 99,149,000      |    |
|                  | 東京都公募公債第598回         | 103,000,000     | 97,659,450      |    |
|                  | 東京都公募公債第602回         | 200,000,000     | 197,912,000     |    |
|                  | 東京都公募公債第605回         | 100,000,000     | 98,813,000      |    |
|                  | 東京都公募公債第608回         | 100,000,000     | 99,709,000      |    |
|                  | 東京都公募公債第609回         | 100,000,000     | 99,392,000      |    |
|                  | 東京都公募公債第613回         | 100,000,000     | 99,395,000      |    |
|                  | 東京都公募公債第616回         | 100,000,000     | 98,320,000      |    |
|                  | 東京都公募公債第617回         | 200,000,000     | 196,522,000     |    |
|                  | 東京都公募公債第619回         | 100,000,000     | 98,967,000      |    |
|                  | 東京都公募公債第624回         | 100,000,000     | 98,590,000      |    |
|                  | 東京都公募公債第626回         | 200,000,000     | 198,564,000     |    |
|                  | 東京都公募公債第627回         | 200,000,000     | 197,460,000     |    |
|                  | 東京都公募公債第628回         | 200,000,000     | 198,254,000     |    |
|                  | 東京都公募公債第637回         | 180,000,000     | 179,989,200     |    |
|                  | 東京都公募公債第642回         | 100,000,000     | 99,997,000      |    |
|                  | 東京都公募公債第646回         | 100,000,000     | 100,883,000     |    |
|                  | 東京都公募公債第647回         | 100,000,000     | 100,728,000     |    |
|                  | 東京都公募公債(20年)第3回      | 100,000,000     | 98,845,000      |    |
|                  | 東京都公募公債(5年)第21回      | 100,000,000     | 100,493,000     |    |
|                  | 北海道平成13年度第1回公募公債     | 100,000,000     | 99,951,000      |    |
|                  | 北海道平成13年度第4回公募公債     | 100,000,000     | 99,998,000      |    |
|                  | 北海道平成17年度第1回公募公債     | 100,000,000     | 97,248,000      |    |
|                  | 北海道平成17年度第5回公募公債(5年) | 100,000,000     | 98,490,000      |    |
|                  | 北海道平成14年度第1回公募公債     | 100,000,000     | 99,503,000      |    |
|                  | 宮城県公募公債第28回1号        | 200,000,000     | 193,122,000     |    |
|                  | 神奈川県第113回公募公債        | 100,000,000     | 101,759,000     |    |
| 神奈川県第126回公募公債    | 100,000,000          | 99,097,000      |                 |    |
| 神奈川県第127回公募公債    | 100,000,000          | 100,718,000     |                 |    |
| 神奈川県第130回公募公債    | 100,000,000          | 98,105,000      |                 |    |

| 種類              | 銘柄                    | 券面総額(円)     | 評価額(円)      | 備考 |
|-----------------|-----------------------|-------------|-------------|----|
| 地方債<br>証券       | 神奈川県第135回公募公債         | 100,000,000 | 99,189,000  |    |
|                 | 神奈川県第143回公募公債         | 150,000,000 | 149,053,500 |    |
|                 | 神奈川県第144回公募公債         | 100,000,000 | 99,849,000  |    |
|                 | 神奈川県第14回5年公募公債        | 200,000,000 | 198,560,000 |    |
|                 | 神奈川県第21回5年公募公債        | 100,000,000 | 100,332,000 |    |
|                 | 第245回大阪府公募公債(10年)     | 100,000,000 | 100,139,000 |    |
|                 | 第250回大阪府公募公債(10年)     | 100,000,000 | 98,815,000  |    |
|                 | 第254回大阪府公募公債(10年)     | 100,000,000 | 94,936,000  |    |
|                 | 第267回大阪府公募公債(10年)     | 100,000,000 | 99,004,000  |    |
|                 | 第285回大阪府公募公債(10年)     | 100,000,000 | 97,706,000  |    |
|                 | 第286回大阪府公募公債(10年)     | 100,000,000 | 97,651,000  |    |
|                 | 第293回大阪府公募公債(10年)     | 100,000,000 | 101,445,000 |    |
|                 | 第298回大阪府公募公債(10年)     | 100,000,000 | 99,512,000  |    |
|                 | 第18回大阪府公募公債(5年)       | 100,000,000 | 99,124,000  |    |
|                 | 京都府平成12年度第2回公募公債      | 165,000,000 | 167,531,100 |    |
|                 | 京都府平成17年度第3回公募公債      | 100,000,000 | 98,427,000  |    |
|                 | 兵庫県平成14年度第4回公募公債      | 100,000,000 | 97,323,000  |    |
|                 | 兵庫県平成16年度第11回公募公債(5年) | 100,000,000 | 99,156,000  |    |
|                 | 兵庫県平成17年度第3回公募公債      | 100,000,000 | 96,673,000  |    |
|                 | 兵庫県平成18年度第3回公募公債      | 110,000,000 | 111,185,800 |    |
|                 | 兵庫県平成18年度第8回公募公債      | 100,000,000 | 101,548,000 |    |
|                 | 兵庫県平成18年度第10回公募公債     | 100,000,000 | 100,622,000 |    |
|                 | 静岡県平成11年度第1回公募公債      | 100,000,000 | 100,986,000 |    |
|                 | 静岡県平成15年度第3回公募公債      | 100,000,000 | 98,905,000  |    |
|                 | 静岡県平成17年度第7回公募公債      | 100,000,000 | 99,686,000  |    |
|                 | 静岡県平成19年度第4回公募公債      | 100,000,000 | 100,196,000 |    |
|                 | 愛知県平成11年度第2回公募公債      | 100,000,000 | 101,219,000 |    |
|                 | 愛知県平成12年度第1回公募公債      | 100,000,000 | 101,513,000 |    |
|                 | 愛知県平成13年度第1回公募公債      | 100,000,000 | 100,415,000 |    |
|                 | 愛知県平成13年度第2回公募公債      | 100,000,000 | 100,195,000 |    |
|                 | 愛知県平成18年度第4回公募公債(10年) | 129,000,000 | 128,739,420 |    |
|                 | 広島県平成14年度第1回公募公債      | 100,000,000 | 99,094,000  |    |
|                 | 広島県平成16年度第1回公募公債      | 100,000,000 | 97,355,000  |    |
|                 | 埼玉県平成13年度第3回公募公債      | 100,000,000 | 99,811,000  |    |
|                 | 埼玉県平成14年度第1回公募公債      | 100,000,000 | 99,870,000  |    |
|                 | 埼玉県平成15年度第5回公募公債      | 100,000,000 | 98,759,000  |    |
|                 | 埼玉県平成19年度第2回公募公債      | 300,000,000 | 300,909,000 |    |
|                 | 福岡県平成11年度第1回公募公債      | 100,000,000 | 101,343,000 |    |
|                 | 福岡県平成12年度第1回公募公債      | 110,000,000 | 111,871,100 |    |
|                 | 福岡県平成14年度第3回公募公債      | 100,000,000 | 96,593,000  |    |
|                 | 千葉県平成12年度第2回公募公債      | 100,000,000 | 101,285,000 |    |
|                 | 千葉県平成15年度第1回公募公債      | 200,000,000 | 189,540,000 |    |
|                 | 千葉県平成17年度第4回公募公債      | 100,000,000 | 98,768,000  |    |
|                 | 千葉県平成18年度第6回公募公債      | 175,000,000 | 172,924,500 |    |
|                 | 千葉県平成18年度第7回公募公債      | 100,000,000 | 99,432,000  |    |
|                 | 新潟県平成17年度第1回公募公債      | 100,000,000 | 97,068,000  |    |
|                 | 第1回共同発行市場公募地方債        | 100,000,000 | 95,918,000  |    |
|                 | 第5回共同発行市場公募地方債        | 100,000,000 | 96,510,000  |    |
|                 | 第6回共同発行市場公募地方債        | 355,700,000 | 355,596,847 |    |
|                 | 第9回共同発行市場公募地方債        | 200,000,000 | 198,678,000 |    |
| 第15回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000           | 99,578,000  |             |    |
| 第16回共同発行市場公募地方債 | 127,000,000           | 127,910,590 |             |    |
| 第17回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000           | 100,698,000 |             |    |
| 第18回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000           | 99,507,000  |             |    |
| 第19回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000           | 99,466,000  |             |    |
| 第23回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000           | 97,414,000  |             |    |

| 種類                 | 銘柄                   | 券面総額(円)           | 評価額(円)         | 備考             |  |
|--------------------|----------------------|-------------------|----------------|----------------|--|
| 地方債<br>証券          | 第29回共同発行市場公募地方債      | 100,000,000       | 97,858,000     |                |  |
|                    | 第30回共同発行市場公募地方債      | 100,000,000       | 97,171,000     |                |  |
|                    | 第31回共同発行市場公募地方債      | 150,000,000       | 147,748,500    |                |  |
|                    | 第35回共同発行市場公募地方債      | 160,000,000       | 158,417,600    |                |  |
|                    | 第38回共同発行市場公募地方債      | 100,000,000       | 101,753,000    |                |  |
|                    | 第48回共同発行市場公募地方債      | 100,000,000       | 98,560,000     |                |  |
|                    | 第53回共同発行市場公募地方債      | 200,000,000       | 198,114,000    |                |  |
|                    | 第54回共同発行市場公募地方債      | 100,000,000       | 98,106,000     |                |  |
|                    | 静岡市平成18年度第1回公募公債     | 100,000,000       | 100,456,000    |                |  |
|                    | 大阪市平成11年度第2回公募公債     | 100,000,000       | 100,875,000    |                |  |
|                    | 大阪市平成14年度第1回公募公債     | 100,000,000       | 96,109,000     |                |  |
|                    | 大阪市平成16年度第5回公募公債     | 100,000,000       | 98,805,000     |                |  |
|                    | 大阪市平成17年度第1回公募公債     | 100,000,000       | 96,505,000     |                |  |
|                    | 大阪市平成18年度第3回公募公債     | 200,000,000       | 202,970,000    |                |  |
|                    | 大阪市平成19年度第1回公募公債(5年) | 200,000,000       | 198,400,000    |                |  |
|                    | 名古屋市第12回や号公募公債       | 100,000,000       | 100,397,000    |                |  |
|                    | 名古屋市第12回て号公募公債       | 100,000,000       | 99,111,000     |                |  |
|                    | 名古屋市第12回し号公募公債       | 100,000,000       | 98,660,000     |                |  |
|                    | 名古屋市第12回こ号公募公債       | 100,000,000       | 99,811,000     |                |  |
|                    | 名古屋市第12回す号公募公債       | 200,000,000       | 199,424,000    |                |  |
|                    | 名古屋市第455回10年公募公債     | 186,700,000       | 188,447,512    |                |  |
|                    | 京都市平成11年度第2回公募公債     | 100,000,000       | 101,281,000    |                |  |
|                    | 横浜市平成12年度第3回公募公債     | 200,000,000       | 202,920,000    |                |  |
|                    | 横浜市平成13年度第3回公募公債     | 100,000,000       | 100,274,000    |                |  |
|                    | 横浜市平成11年度第6回公募公債     | 100,000,000       | 101,340,000    |                |  |
|                    | 横浜市平成15年度第2回公募公債     | 100,000,000       | 95,350,000     |                |  |
|                    | 横浜市平成17年度第3回公募公債     | 100,000,000       | 99,218,000     |                |  |
|                    | 札幌市平成14年度第3回公募公債     | 100,000,000       | 98,192,000     |                |  |
|                    | 札幌市平成16年度第5回公募公債(5年) | 100,000,000       | 99,424,000     |                |  |
|                    | 札幌市平成18年度第4回公募公債     | 200,000,000       | 199,700,000    |                |  |
|                    | 第79回川崎市公募公債          | 100,000,000       | 99,489,000     |                |  |
|                    | 北九州市平成14年度第2回公募公債    | 100,000,000       | 97,545,000     |                |  |
|                    | 福岡市平成17年度第1回公募公債(5年) | 100,000,000       | 98,687,000     |                |  |
|                    | 福岡市平成18年度第2回公募公債(5年) | 100,000,000       | 100,900,000    |                |  |
|                    | 福岡市平成19年度第2回公募公債(5年) | 100,000,000       | 100,329,000    |                |  |
|                    | 福岡市平成19年度第3回公募公債     | 100,000,000       | 99,408,000     |                |  |
|                    | 福岡市平成19年度第5回公募公債     | 100,000,000       | 96,011,000     |                |  |
|                    | 広島市平成17年度第1回公募公債     | 100,000,000       | 98,196,000     |                |  |
|                    | 地方債証券 小計             |                   | 15,501,400,000 | 15,393,297,119 |  |
|                    | 特殊<br>債券             | 政府保証第1回日本政策投資銀行債券 | 200,000,000    | 203,116,000    |  |
|                    |                      | 政府保証第4回日本政策投資銀行債券 | 201,000,000    | 203,277,330    |  |
| 政府保証第6回日本政策投資銀行債券  |                      | 100,000,000       | 96,741,000     |                |  |
| 政府保証第7回日本政策投資銀行債券  |                      | 202,000,000       | 198,818,500    |                |  |
| 政府保証第10回日本政策投資銀行債券 |                      | 100,000,000       | 98,238,000     |                |  |
| 政府保証第15回日本政策投資銀行債券 |                      | 110,000,000       | 107,574,500    |                |  |
| 政府保証第16回日本政策投資銀行債券 |                      | 100,000,000       | 99,883,000     |                |  |
| 第7回日本政策投資銀行債券      |                      | 100,000,000       | 96,148,000     |                |  |
| 第13回日本政策投資銀行債券     |                      | 100,000,000       | 99,288,000     |                |  |
| 第14回日本政策投資銀行債券     |                      | 200,000,000       | 199,962,000    |                |  |
| 第16回日本政策投資銀行債券     |                      | 100,000,000       | 98,491,000     |                |  |
| 第19回日本政策投資銀行債券     |                      | 100,000,000       | 97,458,000     |                |  |
| 第24回日本政策投資銀行債券     |                      | 100,000,000       | 98,929,000     |                |  |
| 第29回日本政策投資銀行債券     |                      | 200,000,000       | 198,742,000    |                |  |
| 第41回日本政策投資銀行債券     |                      | 100,000,000       | 97,611,000     |                |  |
| 第43回日本政策投資銀行債券     |                      | 100,000,000       | 97,611,000     |                |  |
| 第16回道路債券           | 200,000,000          | 194,110,000       |                |                |  |

| 種類              | 銘柄                        | 券面総額(円)     | 評価額(円)      | 備考 |
|-----------------|---------------------------|-------------|-------------|----|
| 特殊<br>債券        | 第24回道路債券                  | 100,000,000 | 99,875,000  |    |
|                 | 政府保証第307回道路債券             | 100,000,000 | 101,151,000 |    |
|                 | 政府保証第312回道路債券             | 136,000,000 | 136,799,680 |    |
|                 | 政府保証第313回道路債券             | 100,000,000 | 99,374,000  |    |
|                 | 政府保証第314回道路債券             | 100,000,000 | 97,857,000  |    |
|                 | 政府保証第319回道路債券             | 100,000,000 | 96,769,000  |    |
|                 | 政府保証第323回道路債券             | 100,000,000 | 99,620,000  |    |
|                 | 政府保証第325回道路債券             | 101,000,000 | 99,411,270  |    |
|                 | 政府保証第327回道路債券             | 100,000,000 | 99,449,000  |    |
|                 | 政府保証第329回道路債券             | 150,000,000 | 149,863,500 |    |
|                 | 政府保証第330回道路債券             | 100,000,000 | 101,057,000 |    |
|                 | 政府保証第334回道路債券             | 100,000,000 | 99,156,000  |    |
|                 | 政府保証第335回道路債券             | 100,000,000 | 98,519,000  |    |
|                 | 政府保証第336回道路債券             | 131,000,000 | 128,982,600 |    |
|                 | 政府保証第338回道路債券             | 100,000,000 | 99,050,000  |    |
|                 | 政府保証第346回道路債券             | 115,000,000 | 112,973,700 |    |
|                 | 第3回日本高速道路保有・債務返済機構債券      | 100,000,000 | 98,930,000  |    |
|                 | 第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券      | 150,000,000 | 148,702,500 |    |
|                 | 第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券     | 100,000,000 | 96,643,000  |    |
|                 | 政府保証第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 200,000,000 | 197,586,000 |    |
|                 | 政府保証第10回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 99,961,000  |    |
|                 | 政府保証第14回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 257,000,000 | 260,423,240 |    |
|                 | 政府保証第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 101,000,000 | 102,991,720 |    |
|                 | 政府保証第21回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 100,092,000 |    |
|                 | 政府保証第25回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 325,000,000 | 324,870,000 |    |
|                 | 政府保証第33回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 197,952,000 |    |
|                 | 政府保証第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 98,903,000  |    |
|                 | 政府保証第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 100,317,000 |    |
|                 | 第2回道路債券                   | 200,000,000 | 202,518,000 |    |
|                 | 第6回道路債券                   | 100,000,000 | 100,605,000 |    |
|                 | 第21回道路債券                  | 100,000,000 | 99,826,000  |    |
|                 | 第33回道路債券                  | 100,000,000 | 102,345,000 |    |
|                 | 第40回道路債券                  | 100,000,000 | 99,065,000  |    |
|                 | 第42回道路債券                  | 100,000,000 | 96,512,000  |    |
|                 | 政府保証第780回公営企業債券           | 200,000,000 | 202,804,000 |    |
|                 | 政府保証第783回公営企業債券           | 100,000,000 | 101,417,000 |    |
|                 | 政府保証第784回公営企業債券           | 110,000,000 | 111,439,900 |    |
|                 | 政府保証第785回公営企業債券           | 200,000,000 | 202,352,000 |    |
|                 | 政府保証第787回公営企業債券           | 100,000,000 | 101,541,000 |    |
|                 | 政府保証第789回公営企業債券           | 200,000,000 | 202,918,000 |    |
|                 | 政府保証第791回公営企業債券           | 100,000,000 | 101,322,000 |    |
|                 | 政府保証第795回公営企業債券           | 100,000,000 | 101,893,000 |    |
|                 | 政府保証第796回公営企業債券           | 100,000,000 | 101,674,000 |    |
|                 | 政府保証第797回公営企業債券           | 100,000,000 | 101,419,000 |    |
|                 | 政府保証第799回公営企業債券           | 100,000,000 | 101,156,000 |    |
| 政府保証第800回公営企業債券 | 100,000,000               | 100,602,000 |             |    |
| 政府保証第801回公営企業債券 | 100,000,000               | 100,569,000 |             |    |
| 政府保証第807回公営企業債券 | 100,000,000               | 100,357,000 |             |    |
| 政府保証第809回公営企業債券 | 100,000,000               | 100,268,000 |             |    |
| 政府保証第810回公営企業債券 | 100,000,000               | 100,207,000 |             |    |
| 政府保証第812回公営企業債券 | 100,000,000               | 100,531,000 |             |    |
| 政府保証第815回公営企業債券 | 100,000,000               | 99,998,000  |             |    |
| 政府保証第817回公営企業債券 | 204,000,000               | 202,961,640 |             |    |
| 政府保証第823回公営企業債券 | 100,000,000               | 96,899,000  |             |    |
| 政府保証第824回公営企業債券 | 100,000,000               | 96,829,000  |             |    |
| 政府保証第826回公営企業債券 | 200,000,000               | 192,326,000 |             |    |

| 種類                | 銘柄                | 券面総額(円)     | 評価額(円)      | 備考 |
|-------------------|-------------------|-------------|-------------|----|
| 特殊<br>債券          | 政府保証第829回公営企業債券   | 100,000,000 | 97,838,000  |    |
|                   | 政府保証第830回公営企業債券   | 200,000,000 | 193,538,000 |    |
|                   | 政府保証第833回公営企業債券   | 100,000,000 | 99,673,000  |    |
|                   | 政府保証第838回公営企業債券   | 100,000,000 | 99,475,000  |    |
|                   | 政府保証第839回公営企業債券   | 200,000,000 | 198,858,000 |    |
|                   | 政府保証第841回公営企業債券   | 100,000,000 | 101,084,000 |    |
|                   | 政府保証第843回公営企業債券   | 100,000,000 | 99,275,000  |    |
|                   | 政府保証第847回公営企業債券   | 200,000,000 | 196,980,000 |    |
|                   | 政府保証第850回公営企業債券   | 100,000,000 | 98,345,000  |    |
|                   | 政府保証第851回公営企業債券   | 100,000,000 | 97,646,000  |    |
|                   | 政府保証第852回公営企業債券   | 100,000,000 | 97,606,000  |    |
|                   | 政府保証第855回公営企業債券   | 100,000,000 | 97,555,000  |    |
|                   | 政府保証第859回公営企業債券   | 100,000,000 | 98,781,000  |    |
|                   | 政府保証第860回公営企業債券   | 200,000,000 | 198,896,000 |    |
|                   | 政府保証第862回公営企業債券   | 100,000,000 | 100,779,000 |    |
|                   | 政府保証第871回公営企業債券   | 100,000,000 | 99,997,000  |    |
|                   | 政府保証第876回公営企業債券   | 200,000,000 | 201,074,000 |    |
|                   | 政府保証第877回公営企業債券   | 300,000,000 | 301,398,000 |    |
|                   | 政府保証15年第2回公営企業債券  | 100,000,000 | 99,588,000  |    |
|                   | 20年第9回公営企業債券      | 100,000,000 | 98,595,000  |    |
|                   | 第1回公営企業債券         | 100,000,000 | 99,981,000  |    |
|                   | 第5回公営企業債券         | 200,000,000 | 192,366,000 |    |
|                   | 第6回公営企業債券         | 100,000,000 | 95,584,000  |    |
|                   | 第13回公営企業債券        | 100,000,000 | 98,722,000  |    |
|                   | 第19回公営企業債券        | 200,000,000 | 203,280,000 |    |
|                   | 政府保証第187回首都高速道路債券 | 100,000,000 | 99,594,000  |    |
|                   | 政府保証第189回首都高速道路債券 | 100,000,000 | 98,431,000  |    |
|                   | 政府保証第197回首都高速道路債券 | 200,000,000 | 197,986,000 |    |
|                   | 第9回首都高速道路債券       | 100,000,000 | 100,658,000 |    |
|                   | 政府保証第144回阪神高速道路債券 | 100,000,000 | 99,028,000  |    |
|                   | 政府保証第148回阪神高速道路債券 | 100,000,000 | 97,486,000  |    |
|                   | 政府保証第136回中小企業債券   | 100,000,000 | 101,451,000 |    |
|                   | 政府保証第142回中小企業債券   | 108,000,000 | 109,706,400 |    |
|                   | 政府保証第157回中小企業債券   | 100,000,000 | 99,849,000  |    |
|                   | 政府保証第165回中小企業債券   | 100,000,000 | 100,482,000 |    |
|                   | 政府保証第176回中小企業債券   | 100,000,000 | 100,216,000 |    |
|                   | 第9回中小企業債券         | 100,000,000 | 99,470,000  |    |
|                   | 第10回中小企業債券        | 100,000,000 | 99,381,000  |    |
|                   | 第14回中小企業債券        | 100,000,000 | 99,906,000  |    |
|                   | 第16回中小企業債券        | 100,000,000 | 99,380,000  |    |
|                   | 第22回中小企業債券        | 100,000,000 | 99,102,000  |    |
|                   | 第24回中小企業債券        | 100,000,000 | 100,654,000 |    |
|                   | 第28回中小企業債券        | 100,000,000 | 99,747,000  |    |
|                   | 第2回国際協力銀行債券       | 100,000,000 | 100,201,000 |    |
|                   | 第6回国際協力銀行債券       | 100,000,000 | 98,472,000  |    |
| 第12回国際協力銀行債券      | 100,000,000       | 99,446,000  |             |    |
| 第15回国際協力銀行債券      | 100,000,000       | 100,045,000 |             |    |
| 第19回国際協力銀行債券      | 100,000,000       | 94,774,000  |             |    |
| 第9回都市再生債券         | 100,000,000       | 97,614,000  |             |    |
| 第3回都市基盤整備債券       | 100,000,000       | 100,580,000 |             |    |
| 第8回都市基盤整備債券       | 100,000,000       | 99,973,000  |             |    |
| 政府保証第27回本州四国連絡橋債券 | 100,000,000       | 98,206,000  |             |    |
| 第2回本州四国連絡橋債券      | 100,000,000       | 100,710,000 |             |    |
| 政府保証第31回電源開発債券    | 172,000,000       | 173,979,720 |             |    |
| 政府保証第32回電源開発債券    | 100,000,000       | 101,570,000 |             |    |
| 政府保証第37回関西国際空港債券  | 100,000,000       | 100,373,000 |             |    |



| 種類          | 銘柄                    | 券面総額(円)     | 評価額(円)      | 備考 |
|-------------|-----------------------|-------------|-------------|----|
| 特殊<br>債券    | 政府保証第3回中部国際空港債券       | 100,000,000 | 100,575,000 |    |
|             | 政府保証第63回預金保険機構債券      | 200,000,000 | 197,660,000 |    |
|             | 政府保証第80回預金保険機構債券      | 100,000,000 | 99,750,000  |    |
|             | 政府保証第84回預金保険機構債券      | 100,000,000 | 100,193,000 |    |
|             | 政府保証第98回預金保険機構債券      | 100,000,000 | 99,706,000  |    |
|             | 政府保証第105回預金保険機構債券     | 100,000,000 | 99,606,000  |    |
|             | 政府保証第108回預金保険機構債券     | 100,000,000 | 100,758,000 |    |
|             | 政府保証第112回預金保険機構債券     | 200,000,000 | 199,492,000 |    |
|             | 政府保証第121回預金保険機構債券     | 100,000,000 | 98,888,000  |    |
|             | 政府保証第140回預金保険機構債券     | 100,000,000 | 97,504,000  |    |
|             | 政府保証第141回預金保険機構債券     | 200,000,000 | 198,758,000 |    |
|             | 政府保証第143回預金保険機構債券     | 100,000,000 | 97,788,000  |    |
|             | 政府保証第144回預金保険機構債券     | 100,000,000 | 99,421,000  |    |
|             | 政府保証第147回預金保険機構債券     | 100,000,000 | 98,035,000  |    |
|             | 政府保証第4回住宅金融公庫債券       | 136,000,000 | 138,224,960 |    |
|             | 政府保証第7回住宅金融公庫債券       | 100,000,000 | 100,325,000 |    |
|             | 貸付債権担保第18回住宅金融公庫債券    | 70,492,000  | 68,664,142  |    |
|             | 貸付債権担保S種第1回住宅金融支援機構債券 | 89,015,000  | 87,532,900  |    |
|             | 貸付債権担保第1回住宅金融支援機構債券   | 94,494,000  | 93,405,429  |    |
|             | 貸付債権担保S種第2回住宅金融支援機構債券 | 90,902,000  | 90,520,211  |    |
|             | 貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券   | 97,857,000  | 95,481,032  |    |
|             | 貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券   | 215,238,000 | 208,227,698 |    |
|             | 貸付債権担保S種第5回住宅金融公庫債券   | 75,015,000  | 72,122,421  |    |
|             | 貸付債権担保S種第7回住宅金融公庫債券   | 245,319,000 | 244,475,102 |    |
|             | 貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券     | 57,031,000  | 55,398,202  |    |
|             | 貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券    | 122,778,000 | 115,737,909 |    |
|             | 貸付債権担保第11回住宅金融公庫債券    | 65,212,000  | 59,238,580  |    |
|             | 貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券    | 67,200,000  | 64,550,976  |    |
|             | 貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券    | 149,314,000 | 148,112,022 |    |
|             | 貸付債権担保第25回住宅金融公庫債券    | 79,003,000  | 75,930,573  |    |
|             | 貸付債権担保第28回住宅金融公庫債券    | 80,933,000  | 78,022,649  |    |
|             | 貸付債権担保第29回住宅金融公庫債券    | 249,237,000 | 240,688,170 |    |
|             | 貸付債権担保第31回住宅金融公庫債券    | 84,534,000  | 80,784,917  |    |
|             | 貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券    | 257,070,000 | 245,506,991 |    |
|             | 貸付債権担保第36回住宅金融公庫債券    | 86,844,000  | 84,035,465  |    |
|             | 貸付債権担保第37回住宅金融公庫債券    | 87,031,000  | 84,204,233  |    |
|             | 貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券    | 262,986,000 | 253,602,659 |    |
|             | 貸付債権担保第41回住宅金融公庫債券    | 88,845,000  | 87,416,372  |    |
|             | 貸付債権担保第47回住宅金融公庫債券    | 90,965,000  | 89,921,631  |    |
|             | 貸付債権担保第51回住宅金融公庫債券    | 278,994,000 | 276,081,302 |    |
|             | 政府保証第8回国民生活債券         | 200,000,000 | 193,506,000 |    |
|             | 政府保証第9回国民生活債券         | 100,000,000 | 97,822,000  |    |
|             | 政府保証第12回国民生活債券        | 100,000,000 | 98,941,000  |    |
|             | 政府保証第19回国民生活債券        | 125,000,000 | 124,068,750 |    |
|             | 第11回農林漁業金融公庫債券        | 100,000,000 | 98,754,000  |    |
| 第4回日本学生支援債券 | 100,000,000           | 98,660,000  |             |    |
| い第653号商工債券  | 100,000,000           | 99,641,000  |             |    |
| い第654号商工債券  | 100,000,000           | 99,580,000  |             |    |
| い第659号商工債券  | 100,000,000           | 99,120,000  |             |    |
| い第662号商工債券  | 100,000,000           | 98,731,000  |             |    |
| い第676号商工債券  | 100,000,000           | 100,251,000 |             |    |
| い第652号農林債券  | 100,000,000           | 99,679,000  |             |    |
| い第657号農林債券  | 200,000,000           | 198,444,000 |             |    |
| い第660号農林債券  | 100,000,000           | 98,945,000  |             |    |
| い第661号農林債券  | 100,000,000           | 98,790,000  |             |    |
| い第662号農林債券  | 100,000,000           | 98,711,000  |             |    |

| 種類                             | 銘柄                   | 券面総額(円)     | 評価額(円)         | 備考             |  |
|--------------------------------|----------------------|-------------|----------------|----------------|--|
| 特殊<br>債券                       | い第665号農林債券           | 300,000,000 | 297,858,000    |                |  |
|                                | い第666号農林債券           | 100,000,000 | 99,462,000     |                |  |
|                                | い第670号農林債券           | 100,000,000 | 99,646,000     |                |  |
|                                | い第671号農林債券           | 130,000,000 | 130,917,800    |                |  |
|                                | い第675号農林債券           | 200,000,000 | 201,504,000    |                |  |
|                                | い第679号農林債券           | 200,000,000 | 200,164,000    |                |  |
|                                | い第681号農林債券           | 200,000,000 | 199,678,000    |                |  |
|                                | い第685号農林債券           | 100,000,000 | 100,170,000    |                |  |
|                                | い第686号農林債券           | 100,000,000 | 100,524,000    |                |  |
|                                | い第687号農林債券           | 200,000,000 | 200,592,000    |                |  |
|                                | い第689号農林債券           | 100,000,000 | 99,766,000     |                |  |
|                                | 第583回あおぞら債券          | 100,000,000 | 98,962,000     |                |  |
|                                | 第178回しんきん中金債券(5年)    | 100,000,000 | 99,704,000     |                |  |
|                                | 第181回しんきん中金債券(5年)    | 70,000,000  | 69,493,200     |                |  |
|                                | 第182回しんきん中金債券(5年)    | 200,000,000 | 198,404,000    |                |  |
|                                | 第187回しんきん中金債券(5年)    | 100,000,000 | 98,790,000     |                |  |
|                                | 第188回しんきん中金債券(5年)    | 200,000,000 | 197,422,000    |                |  |
|                                | 第191回しんきん中金債券(5年)    | 100,000,000 | 99,286,000     |                |  |
|                                | 第193回しんきん中金債券(5年)    | 200,000,000 | 198,586,000    |                |  |
|                                | 第196回しんきん中金債券(5年)    | 200,000,000 | 199,266,000    |                |  |
|                                | 第197回しんきん中金債券(5年)    | 100,000,000 | 100,706,000    |                |  |
|                                | 第199回しんきん中金債券(5年)    | 100,000,000 | 100,497,000    |                |  |
|                                | 第200回しんきん中金債券(5年)    | 100,000,000 | 101,231,000    |                |  |
|                                | 第201回信金中金債(5年)       | 100,000,000 | 100,752,000    |                |  |
|                                | 第204回信金中金債(5年)       | 200,000,000 | 199,920,000    |                |  |
|                                | 第208回信金中金債(5年)       | 100,000,000 | 99,458,000     |                |  |
|                                | 第212回信金中金債(5年)       | 200,000,000 | 201,126,000    |                |  |
|                                | 第213回信金中金債(5年)       | 200,000,000 | 200,672,000    |                |  |
|                                | い第661号みずほコーポレート銀行債券  | 100,000,000 | 99,808,000     |                |  |
|                                | い第664号みずほコーポレート銀行債券  | 100,000,000 | 99,595,000     |                |  |
|                                | い第668号みずほコーポレート銀行債券  | 200,000,000 | 198,556,000    |                |  |
|                                | い第672号みずほコーポレート銀行債券  | 100,000,000 | 98,649,000     |                |  |
|                                | い第674号みずほコーポレート銀行債券  | 100,000,000 | 98,698,000     |                |  |
|                                | い第677号みずほコーポレート銀行債券  | 100,000,000 | 99,219,000     |                |  |
|                                | い第679号みずほコーポレート銀行債券  | 200,000,000 | 198,944,000    |                |  |
|                                | 政府保証第5回東日本高速道路債券     | 100,000,000 | 101,856,000    |                |  |
|                                | 政府保証第8回中日本高速道路債券     | 100,000,000 | 101,879,000    |                |  |
|                                | 政府保証第10回中日本高速道路債券    | 172,000,000 | 172,139,320    |                |  |
|                                | 政府保証第3回西日本高速道路債券     | 100,000,000 | 100,053,000    |                |  |
|                                | 政府保証第9回銀行等保有株式取得機構債券 | 200,000,000 | 199,360,000    |                |  |
|                                |                      | 特殊債券 小計     | 28,492,309,000 | 28,284,319,816 |  |
|                                | 社債券                  | 第323回東京交通債券 | 100,000,000    | 115,126,000    |  |
| 第324回東京交通債券                    |                      | 100,000,000 | 111,648,000    |                |  |
| 第336回東京交通債券                    |                      | 100,000,000 | 101,851,000    |                |  |
| 第11回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク円貨社債   |                      | 100,000,000 | 90,593,000     |                |  |
| 第7回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債  |                      | 200,000,000 | 194,550,000    |                |  |
| 第9回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債  |                      | 200,000,000 | 190,428,000    |                |  |
| 第14回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債 |                      | 100,000,000 | 93,447,000     |                |  |
| 第5回JPモルガンチェースアンドカンパニー円貨債券      |                      | 100,000,000 | 97,397,000     |                |  |
| 第2回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債  |                      | 100,000,000 | 99,921,000     |                |  |
| 第6回モルガン・スタンレー円貨社債              |                      | 100,000,000 | 97,718,000     |                |  |

| 種類                     | 銘柄                           | 券面総額(円)     | 評価額(円)      | 備考 |
|------------------------|------------------------------|-------------|-------------|----|
| 社債券                    | 第6回シティグループ・インク円貨社債           | 100,000,000 | 98,039,000  |    |
|                        | 第11回シティグループ・インク円貨社債          | 100,000,000 | 90,395,000  |    |
|                        | 第15回シティグループ・インク円貨社債          | 100,000,000 | 92,768,000  |    |
|                        | 第17回シティグループ・インク円貨社債          | 100,000,000 | 81,947,000  |    |
|                        | 第22回シティグループ・インク円貨社債          | 100,000,000 | 94,327,000  |    |
|                        | 第4回ザ・ベアー・スターズ・カンパニーズ・インク円貨社債 | 100,000,000 | 97,916,000  |    |
|                        | 第6回ザ・ベアー・スターズ・カンパニーズ・インク円貨社債 | 100,000,000 | 90,960,000  |    |
|                        | 第3回ドイツ銀行AGロンドン支店円貨社債         | 100,000,000 | 96,201,000  |    |
|                        | 第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債  | 100,000,000 | 94,425,000  |    |
|                        | 第4回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債  | 200,000,000 | 194,938,000 |    |
|                        | 第5回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債  | 100,000,000 | 95,494,000  |    |
|                        | 第1回アメリカン・インターナショナル・インク円貨社債   | 100,000,000 | 93,232,000  |    |
|                        | 味の素株式会社第17回無担保社債             | 100,000,000 | 94,753,000  |    |
|                        | 住友化学株式会社第29回無担保社債            | 100,000,000 | 98,721,000  |    |
|                        | 三井化学株式会社第31回無担保社債            | 100,000,000 | 95,094,000  |    |
|                        | 新日本石油株式会社第21回無担保社債           | 100,000,000 | 99,291,000  |    |
|                        | 株式会社ブリヂストン第4回無担保社債           | 100,000,000 | 95,934,000  |    |
|                        | 新日本製鐵株式会社第32回無担保社債           | 100,000,000 | 102,063,000 |    |
|                        | JFEスチール株式会社第32回2号無担保社債       | 100,000,000 | 103,062,000 |    |
|                        | 三井金属鉱業株式会社第4回無担保社債           | 100,000,000 | 99,431,000  |    |
|                        | 株式会社豊田自動織機第7回無担保社債           | 100,000,000 | 101,035,000 |    |
|                        | 株式会社豊田自動織機第9回無担保社債           | 100,000,000 | 101,420,000 |    |
|                        | 株式会社豊田自動織機第12回無担保社債          | 200,000,000 | 196,318,000 |    |
|                        | 株式会社豊田自動織機第15回無担保社債          | 100,000,000 | 98,738,000  |    |
|                        | 豊田工機株式会社第3回無担保社債             | 100,000,000 | 98,500,000  |    |
|                        | 松下電器産業株式会社第5回無担保社債           | 100,000,000 | 100,404,000 |    |
|                        | ソニー株式会社第15回無担保社債             | 100,000,000 | 98,948,000  |    |
|                        | ソニー株式会社第16回無担保社債             | 100,000,000 | 97,996,000  |    |
|                        | ソニー株式会社第17回無担保社債             | 200,000,000 | 195,652,000 |    |
|                        | 三菱重工業株式会社第17回無担保社債           | 100,000,000 | 94,797,000  |    |
|                        | 日産自動車株式会社第45回無担保社債           | 100,000,000 | 99,276,000  |    |
|                        | アイシン精機株式会社第5回無担保社債           | 100,000,000 | 96,946,000  |    |
|                        | 大日本印刷株式会社第1回無担保社債            | 200,000,000 | 199,116,000 |    |
|                        | 三井物産株式会社第12回無担保社債            | 100,000,000 | 104,027,000 |    |
|                        | 住友商事株式会社第29回無担保社債            | 200,000,000 | 197,344,000 |    |
|                        | 三菱商事株式会社第45回無担保社債            | 100,000,000 | 98,270,000  |    |
|                        | 三菱商事株式会社第53回無担保社債            | 100,000,000 | 94,025,000  |    |
|                        | 株式会社三菱東京フィナンシャル・グループ第2回無担保社債 | 100,000,000 | 99,684,000  |    |
|                        | 株式会社三菱東京フィナンシャル・グループ第4回無担保社債 | 100,000,000 | 99,329,000  |    |
|                        | 株式会社みずほコーポレート銀行第3回無担保社債      | 100,000,000 | 100,067,000 |    |
|                        | 株式会社みずほコーポレート銀行第4回無担保社債      | 200,000,000 | 199,312,000 |    |
|                        | 株式会社みずほコーポレート銀行第9回無担保社債      | 100,000,000 | 99,225,000  |    |
|                        | 株式会社みずほコーポレート銀行第1回無担保社債      | 100,000,000 | 100,618,000 |    |
|                        | 株式会社三菱東京UFJ銀行第15回無担保社債       | 200,000,000 | 203,360,000 |    |
|                        | 株式会社三菱東京UFJ銀行第19回無担保社債       | 100,000,000 | 101,767,000 |    |
|                        | 株式会社三菱東京UFJ銀行第77回無担保社債       | 100,000,000 | 99,664,000  |    |
| 株式会社三菱東京UFJ銀行第80回無担保社債 | 200,000,000                  | 197,546,000 |             |    |
| 株式会社三菱東京UFJ銀行第83回無担保社債 | 200,000,000                  | 203,246,000 |             |    |
| 株式会社三菱東京UFJ銀行第85回無担保社債 | 200,000,000                  | 200,246,000 |             |    |

| 種類              | 銘柄                          | 券面総額(円)     | 評価額(円)      | 備考 |
|-----------------|-----------------------------|-------------|-------------|----|
| 社債券             | 株式会社三菱東京UFJ銀行第3回2号無担保社債     | 200,000,000 | 193,836,000 |    |
|                 | 株式会社静岡銀行第8回無担保社債            | 100,000,000 | 99,565,000  |    |
|                 | 株式会社三井住友銀行第21回無担保社債         | 100,000,000 | 100,000,000 |    |
|                 | 株式会社三井住友銀行第29回無担保社債         | 200,000,000 | 198,550,000 |    |
|                 | 株式会社三井住友銀行第35回無担保社債         | 300,000,000 | 302,094,000 |    |
|                 | 株式会社三井住友銀行第36回無担保社債         | 300,000,000 | 301,755,000 |    |
|                 | NTTファイナンス株式会社第32回無担保社債      | 100,000,000 | 100,341,000 |    |
|                 | 株式会社ホンダファイナンス第8回無担保社債       | 200,000,000 | 200,382,000 |    |
|                 | トヨタファイナンス株式会社第14回無担保社債      | 100,000,000 | 97,712,000  |    |
|                 | トヨタファイナンス株式会社第21回無担保社債      | 100,000,000 | 101,453,000 |    |
|                 | トヨタファイナンス株式会社第30回無担保社債      | 100,000,000 | 99,156,000  |    |
|                 | オリックス株式会社第87回無担保社債          | 100,000,000 | 99,090,000  |    |
|                 | オリックス株式会社第98回無担保社債          | 100,000,000 | 96,849,000  |    |
|                 | 野村ホールディングス株式会社第2回無担保社債      | 100,000,000 | 99,265,000  |    |
|                 | 野村證券株式会社第4回無担保社債            | 100,000,000 | 102,185,000 |    |
|                 | 三井住友海上火災保険株式会社第2回無担保社債      | 100,000,000 | 99,332,000  |    |
|                 | 三菱地所株式会社第30回無担保社債           | 100,000,000 | 106,433,000 |    |
|                 | 三菱地所株式会社第53回無担保社債           | 100,000,000 | 99,945,000  |    |
|                 | 三菱地所株式会社第70回無担保社債           | 100,000,000 | 99,455,000  |    |
|                 | 三菱地所株式会社第79回無担保社債           | 100,000,000 | 98,297,000  |    |
|                 | 東京急行電鉄株式会社第57回無担保社債         | 100,000,000 | 99,418,000  |    |
|                 | 東日本旅客鉄道株式会社第6回社債(一般担保付)     | 100,000,000 | 102,258,000 |    |
|                 | 東日本旅客鉄道株式会社第7回社債(一般担保付)     | 300,000,000 | 333,285,000 |    |
|                 | 東日本旅客鉄道株式会社第21回無担保社債        | 100,000,000 | 96,142,000  |    |
|                 | 東日本旅客鉄道株式会社第23回無担保普通社債      | 100,000,000 | 97,717,000  |    |
|                 | 東日本旅客鉄道株式会社第27回無担保普通社債      | 100,000,000 | 99,021,000  |    |
|                 | 東日本旅客鉄道株式会社第33回無担保普通社債      | 100,000,000 | 100,812,000 |    |
|                 | 東日本旅客鉄道株式会社第37回無担保普通社債      | 100,000,000 | 98,298,000  |    |
|                 | 東日本旅客鉄道株式会社第43回無担保普通社債      | 100,000,000 | 96,050,000  |    |
|                 | 東日本旅客鉄道株式会社第50回無担保普通社債      | 100,000,000 | 98,979,000  |    |
|                 | 西日本旅客鉄道株式会社第11回無担保社債        | 100,000,000 | 97,310,000  |    |
|                 | 東海旅客鉄道株式会社第5回普通社債(一般担保付)    | 100,000,000 | 104,511,000 |    |
|                 | 東海旅客鉄道株式会社第20回無担保普通社債       | 300,000,000 | 294,585,000 |    |
|                 | 東京地下鉄株式会社第3回社債(一般担保付)       | 100,000,000 | 100,065,000 |    |
|                 | 日本電信電話株式会社第43回電信電話債券(一般担保付) | 100,000,000 | 100,883,000 |    |
|                 | 日本電信電話株式会社第44回電信電話債券(一般担保付) | 200,000,000 | 200,534,000 |    |
|                 | 日本電信電話株式会社第47回電信電話債券(一般担保付) | 100,000,000 | 96,608,000  |    |
|                 | 日本電信電話株式会社第48回電信電話債券(一般担保付) | 100,000,000 | 99,226,000  |    |
|                 | 日本電信電話株式会社第51回電信電話債券(一般担保付) | 100,000,000 | 101,633,000 |    |
|                 | 日本電信電話株式会社第52回電信電話債券(一般担保付) | 200,000,000 | 197,356,000 |    |
|                 | 株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第7回無担保社債    | 200,000,000 | 200,932,000 |    |
|                 | 株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ第10回無担保社債   | 200,000,000 | 200,444,000 |    |
|                 | 東京電力株式会社第457回社債             | 100,000,000 | 99,938,000  |    |
| 東京電力株式会社第471回社債 | 100,000,000                 | 101,328,000 |             |    |
| 東京電力株式会社第478回社債 | 200,000,000                 | 202,142,000 |             |    |
| 東京電力株式会社第482回社債 | 100,000,000                 | 100,354,000 |             |    |
| 東京電力株式会社第489回社債 | 200,000,000                 | 199,850,000 |             |    |
| 東京電力株式会社第491回社債 | 110,000,000                 | 110,150,700 |             |    |
| 東京電力株式会社第493回社債 | 300,000,000                 | 299,994,000 |             |    |
| 東京電力株式会社第496回社債 | 100,000,000                 | 99,903,000  |             |    |

| 種類                      | 銘柄                     | 券面総額(円)     | 評価額(円)      | 備考 |
|-------------------------|------------------------|-------------|-------------|----|
| 社債券                     | 東京電力株式会社第498回社債        | 100,000,000 | 97,875,000  |    |
|                         | 東京電力株式会社第507回社債        | 100,000,000 | 99,006,000  |    |
|                         | 東京電力株式会社第511回社債        | 200,000,000 | 198,860,000 |    |
|                         | 東京電力株式会社第513回社債        | 100,000,000 | 100,715,000 |    |
|                         | 東京電力株式会社第514回社債        | 100,000,000 | 98,888,000  |    |
|                         | 東京電力株式会社第515回社債        | 100,000,000 | 97,919,000  |    |
|                         | 東京電力株式会社第516回社債        | 100,000,000 | 97,702,000  |    |
|                         | 東京電力株式会社第518回社債        | 200,000,000 | 194,394,000 |    |
|                         | 東京電力株式会社第519回社債        | 100,000,000 | 98,635,000  |    |
|                         | 東京電力株式会社第521回社債        | 100,000,000 | 101,007,000 |    |
|                         | 東京電力株式会社第522回社債        | 100,000,000 | 101,451,000 |    |
|                         | 東京電力株式会社第539回社債        | 200,000,000 | 192,968,000 |    |
|                         | 東京電力株式会社第542回社債        | 200,000,000 | 193,012,000 |    |
|                         | 中部電力株式会社第406回社債        | 100,000,000 | 112,957,000 |    |
|                         | 中部電力株式会社第426回社債        | 100,000,000 | 106,487,000 |    |
|                         | 中部電力株式会社第438回社債        | 100,000,000 | 101,447,000 |    |
|                         | 中部電力株式会社第452回社債        | 200,000,000 | 200,650,000 |    |
|                         | 中部電力株式会社第466回社債        | 100,000,000 | 99,251,000  |    |
|                         | 中部電力株式会社第472回社債        | 200,000,000 | 195,080,000 |    |
|                         | 中部電力株式会社第478回社債        | 100,000,000 | 100,067,000 |    |
|                         | 中部電力株式会社第480回社債        | 100,000,000 | 98,993,000  |    |
|                         | 中部電力株式会社第484回社債        | 100,000,000 | 98,029,000  |    |
|                         | 関西電力株式会社第432回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 99,473,000  |    |
|                         | 関西電力株式会社第433回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 97,214,000  |    |
|                         | 関西電力株式会社第435回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 99,397,000  |    |
|                         | 関西電力株式会社第443回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 97,571,000  |    |
|                         | 関西電力株式会社第448回社債(一般担保付) | 300,000,000 | 303,858,000 |    |
|                         | 中国電力株式会社第298回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 115,127,000 |    |
|                         | 中国電力株式会社第306回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 113,172,000 |    |
|                         | 中国電力株式会社第311回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 107,817,000 |    |
|                         | 中国電力株式会社第338回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 99,165,000  |    |
|                         | 中国電力株式会社第350回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 98,920,000  |    |
|                         | 北陸電力株式会社第268回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 100,027,000 |    |
|                         | 北陸電力株式会社第277回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 98,204,000  |    |
|                         | 北陸電力株式会社第283回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 101,839,000 |    |
|                         | 北陸電力株式会社第288回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 99,211,000  |    |
|                         | 東北電力株式会社第383回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 107,897,000 |    |
|                         | 東北電力株式会社第402回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 100,465,000 |    |
|                         | 東北電力株式会社第408回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 99,829,000  |    |
|                         | 東北電力株式会社第414回社債(一般担保付) | 200,000,000 | 188,064,000 |    |
|                         | 東北電力株式会社第416回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 89,234,000  |    |
|                         | 東北電力株式会社第420回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 98,224,000  |    |
|                         | 東北電力株式会社第435回社債(一般担保付) | 200,000,000 | 199,826,000 |    |
|                         | 四国電力株式会社第249回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 99,578,000  |    |
|                         | 四国電力株式会社第253回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 82,534,000  |    |
|                         | 四国電力株式会社第257回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 97,632,000  |    |
|                         | 九州電力株式会社第363回社債(一般担保付) | 208,000,000 | 208,287,040 |    |
|                         | 九州電力株式会社第366回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 99,904,000  |    |
|                         | 九州電力株式会社第371回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 88,568,000  |    |
|                         | 九州電力株式会社第372回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 95,743,000  |    |
|                         | 九州電力株式会社第384回社債(一般担保付) | 100,000,000 | 95,995,000  |    |
|                         | 九州電力株式会社第387回社債(一般担保付) | 200,000,000 | 198,408,000 |    |
| 九州電力株式会社第391回社債(一般担保付)  | 100,000,000            | 99,215,000  |             |    |
| 北海道電力株式会社第257回社債(一般担保付) | 100,000,000            | 114,885,000 |             |    |
| 北海道電力株式会社第282回社債(一般担保付) | 100,000,000            | 98,755,000  |             |    |
| 北海道電力株式会社第284回社債(一般担保付) | 100,000,000            | 97,723,000  |             |    |

| 種類     | 銘柄                        | 券面総額(円)         | 評価額(円)          | 備考 |
|--------|---------------------------|-----------------|-----------------|----|
| 社債券    | 北海道電力株式会社第285回社債(一般担保付)   | 100,000,000     | 98,930,000      |    |
|        | 沖縄電力株式会社第9回社債(一般担保付)      | 100,000,000     | 90,223,000      |    |
|        | 電源開発株式会社第14回無担保社債         | 100,000,000     | 98,320,000      |    |
|        | 電源開発株式会社第16回無担保社債         | 100,000,000     | 100,849,000     |    |
|        | 電源開発株式会社第17回無担保社債         | 100,000,000     | 101,445,000     |    |
|        | 電源開発株式会社第19回無担保社債         | 200,000,000     | 199,074,000     |    |
|        | 電源開発株式会社第21回無担保社債         | 200,000,000     | 194,392,000     |    |
|        | 東京瓦斯株式会社第20回無担保社債         | 100,000,000     | 101,807,000     |    |
|        | 大阪瓦斯株式会社第7回無担保社債          | 100,000,000     | 111,693,000     |    |
|        | 大阪瓦斯株式会社第9回無担保社債          | 100,000,000     | 107,877,000     |    |
|        | 株式会社エヌ・ティ・ティ・データ第14回無担保社債 | 100,000,000     | 101,318,000     |    |
| 社債券 小計 |                           | 22,118,000,000  | 21,987,049,740  |    |
| 合計     |                           | 249,661,709,000 | 248,836,661,075 |    |

(注) 代用有価証券で額面 50,000,000円 担保差入

なお、代用有価証券の担保差入券面額には、約定未受渡券面額を含んでおります。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記事項(デリバティブ取引関係)に記載したとおりであります。

不動産等明細表

該当事項はありません。

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。

「中央三井外国株式マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 項目       | 平成20年6月10日現在<br>金額(円) |
|----------|-----------------------|
| 資産の部     |                       |
| 流動資産     |                       |
| 預金       | 7,664,263,917         |
| コール・ローン  | 1,510,696,883         |
| 株式       | 312,782,031,860       |
| 投資信託受益証券 | 79,414,497            |
| 投資証券     | 5,141,958,376         |
| 派生商品評価勘定 | 58,251,098            |
| 未収配当金    | 777,757,319           |
| 未収利息     | 20,603                |
| 差入委託証拠金  | 2,246,191,337         |
| 流動資産合計   | 330,260,585,890       |
| 資産合計     | 330,260,585,890       |
| 負債の部     |                       |
| 流動負債     |                       |
| 派生商品評価勘定 | 319,214,250           |
| 未払解約金    | 67,436,263            |
| 流動負債合計   | 386,650,513           |
| 負債合計     | 386,650,513           |
| 純資産の部    |                       |
| 元本等      |                       |
| 元本       | 240,232,205,493       |
| 剰余金      |                       |
| 剰余金      | 89,641,729,884        |
| 純資産合計    | 329,873,935,377       |
| 負債・純資産合計 | 330,260,585,890       |

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

|                        | 平成20年6月10日現在   |
|------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法     | 株式、投資信託受益証券及び投資証券<br>移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。  |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法   | (1) 株価指数先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。<br>(2) 為替予約取引<br>個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。<br><br>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。 |
| 3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。   |
| 4. 収益及び費用の計上基準         | (1) 受取配当金<br>原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。<br>(2) 派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準<br>約定日基準で計上しております。  |
| 5. その他                 | 外貨建資産等の会計処理<br>外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。  |



(貸借対照表に関する注記)

|                              | 平成20年6月10日現在           |
|------------------------------|------------------------|
| 1. 計算日における受益権総数              | 240,232,205,493 口      |
| 2. 1口当たり純資産額<br>(1万口当たり純資産額) | 1.3731 円<br>(13,731 円) |

(関連当事者との取引に関する注記)

| 平成20年6月10日現在 |
|--------------|
| 該当事項はありません。  |

(重要な後発事象に関する注記)

| 平成20年6月10日現在 |
|--------------|
| 該当事項はありません。  |

(その他の注記)

1. 本書における開示対象ファンドの当該計算期間における「中央三井外国株式マザーファンド」の元本額の変動

| 平成20年6月10日現在  |                          |
|---|--------------------------|
| 「新生・4分散ファンド」の第1期計算期間(平成19年10月31日から平成20年6月10日まで)における「中央三井外国株式マザーファンド」の元本額の変動及び計算日の元本額の内訳 |                          |
| 同計算期間の期首元本額   | 233,283,999,555 円        |
| 同計算期間中の追加設定元本額  | 63,849,668,810 円         |
| 同計算期間中の一部解約元本額  | 56,901,462,872 円         |
| 計算日の元本額   | <u>240,232,205,493 円</u> |
| 計算日の元本額の内訳  |                          |
| 中央三井外国株式インデックスファンド  | 3,365,283,526 円          |
| 中央三井DC外国株式インデックスファンド  | 1,650,624,575 円          |
| 中央三井DC外国株式インデックスファンドL   | 10,258,358,704 円         |
| 中央三井DCバランスファンド30  | 26,073,484 円             |
| 中央三井DCバランスファンド50  | 97,991,489 円             |
| 中央三井DCバランスファンド70  | 85,684,601 円             |
| ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)  | 394,801,103 円            |
| ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)  | 218,085,181 円            |
| 新生・4分散ファンド  | 239,733,320 円            |
| ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド   | 127,972,989 円            |
| 4資産インデックスバランスオープン(分配型)  | 61,890,481 円             |
| 4資産インデックスバランスオープン(成長型)  | 107,530,174 円            |
| 中央三井外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)   | 26,893,351,488 円         |
| 中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)   | 5,509,407,788 円          |
| 中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)   | 45,418,435,371 円         |
| 中央三井VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)  | 33,445,338,964 円         |
| 中央三井VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)  | 5,258,065,180 円          |
| 中央三井VAバランス株式30(適格機関投資家専用)   | 310,310,385 円            |
| 為替ヘッジ付外国株式ファンド(適格機関投資家専用)   | 8,280,097,966 円          |
| 中央三井VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)  | 30,610,061,303 円         |
| 中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)   | 2,240,349,819 円          |
| 中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)   | 1,026,320,532 円          |
| 中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)  | 26,076,909,999 円         |
| 中央三井バランスVA75(適格機関投資家専用)   | 1,541,519,924 円          |
| 中央三井VL株式30(適格機関投資家専用)   | 4,728,405 円              |
| 中央三井VL株式50(適格機関投資家専用)   | 10,961,458 円             |
| 中央三井VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)  | 34,019,608,060 円         |
| 中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)  | 1,500,616,973 円          |
| 中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)  | 59,330,433 円             |
| 中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)   | 908,538,247 円            |
| 中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)   | 484,223,571 円            |

2. 有価証券関係  
 売買目的有価証券

| 平成20年6月10日現在 |                 |   |
|--------------|-----------------|---|
| 種類           | 貸借対照表計上額(円)     | 「新生・4分散ファンド」の第1期計算期間において、「中央三井外国株式マザーファンド」の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式           | 312,782,031,860 | 5,998,041,084   |
| 投資信託受益証券     | 79,414,497      | 5,936,872   |
| 投資証券         | 5,141,958,376   | 156,385,130   |
| 合計           | 318,003,404,733 | 6,160,363,086   |

(注) 評価差額は「中央三井外国株式マザーファンド」の期首(平成20年2月8日)から計算日までの期間に対応するものです。

3. デリバティブ取引関係  
 . 取引の状況に関する事項

| 平成20年6月10日現在             |   |
|--------------------------|---|
| 1. 取引の内容                 | 当ファンドの利用している取引は、株式関連では株価指数先物取引であり、また通貨関連では為替予約取引であります。  |
| 2. 取引に対する取組方針            | 株価指数先物取引は、ファンド運用の効率化を図ること及び将来の価格変動リスクの回避を目的としており、為替予約取引は、運用の効率化を図るため、将来の為替変動リスクの回避目的に限定せずに利用する場合があります。ただし、いずれのデリバティブ取引においても、投機目的の取引は行わない方針であります。    |
| 3. 取引の利用目的               | 株価指数先物取引は、ファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、キャッシュ運用の効率化、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用し、為替予約取引は、原則としてファンド運用の効率化を図るために利用しております。 |
| 4. 取引に係るリスクの内容           | 株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。<br>また、為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。                                |
| 5. 取引に係るリスク管理体制          | 組織的な管理体制により、日々のポジション、評価金額及び評価損益の管理を行っております。<br>また、リスク管理は、デリバティブ取引に限定することなく、デリバティブ取引と現物資産等を総合的に勘案し、各ファンド全体でのリスク管理を、リスクの種類ごとに実施しております。                |
| 6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 | 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、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。   |

・取引の時価等に関する事項  
 デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益  
 株式関連

| 区分   | 種類              | 平成20年6月10日現在   |       |                |             |
|------|-----------------|----------------|-------|----------------|-------------|
|      |                 | 契約額等(円)        |       | 時価<br>(円)      | 評価損益<br>(円) |
|      |                 |                | うち1年超 |                |             |
| 市場取引 | 株価指数先物取引<br>買 建 | 12,156,948,990 |       | 11,843,519,471 | 313,429,519 |
|      | 合計              | 12,156,948,990 |       | 11,843,519,471 | 313,429,519 |

(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、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

| 区分        | 種類            | 平成20年6月10日現在  |               |               |               |            |
|-----------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|------------|
|           |               | 契約額等(円)       |               | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円)   |            |
|           |               |               | うち1年超         |               |               |            |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引<br>売 建 |               |               |               |               |            |
|           | 米ドル           | 201,734,400   |               | 204,998,400   | 3,264,000     |            |
|           | カナダドル         | 206,400       |               | 208,680       | 2,280         |            |
|           | ユーロ           | 43,731,336    |               | 43,911,120    | 179,784       |            |
|           | 英ポンド          | 112,300,545   |               | 114,404,670   | 2,104,125     |            |
|           | スイスフラン        | 4,015,440     |               | 4,034,940     | 19,500        |            |
|           | スウェーデンクローナ    | 2,895,695     |               | 2,901,400     | 5,705         |            |
|           | ノルウェークローネ     | 3,844,312     |               | 3,849,280     | 4,968         |            |
|           | デンマーククローネ     | 10,317,887    |               | 10,320,270    | 2,383         |            |
|           | オーストラリアドル     | 11,220,990    |               | 11,248,740    | 27,750        |            |
|           | ニュージーランドドル    | 3,870,096     |               | 3,880,320     | 10,224        |            |
|           | 香港ドル          | 618,976       |               | 628,360       | 9,384         |            |
|           | シンガポールドル      | 924,300       |               | 936,600       | 12,300        |            |
|           |               | 計             | 395,680,377   |               | 401,322,780   | 5,642,403  |
|           |               | 買 建           |               |               |               |            |
|           |               | 米ドル           | 1,219,458,347 |               | 1,252,502,460 | 33,044,113 |
|           |               | ユーロ           | 447,817,411   |               | 462,349,170   | 14,531,759 |
|           |               | 英ポンド          | 263,607,867   |               | 274,140,830   | 10,532,963 |
|           |               | スウェーデンクローナ    | 427,560       |               | 427,200       | 360        |
|           |               | オーストラリアドル     | 6,686,394     |               | 6,687,120     | 726        |
|           | 香港ドル          | 806,471       |               | 805,940       | 531           |            |
|           | シンガポールドル      | 312,100       |               | 312,200       | 100           |            |
|           | 計             | 1,939,116,150 |               | 1,997,224,920 | 58,108,770    |            |
|           | 合計            | 2,334,796,527 |               | 2,398,547,700 | 52,466,367    |            |

(注) 時価の算定方法

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

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

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

## ( 3 ) 附属明細表 ( 平成20年 6 月10日現在 )

## 有価証券明細表

## A . 株式

| 通貨                      | 銘柄                                 | 株式数     | 評価額<br>単価     | 評価額<br>金額     | 備考 |
|-------------------------|------------------------------------|---------|---------------|---------------|----|
| 米ドル                     | ANADARKO PETROLEUM CORP            | 57,200  | 79.50         | 4,547,400.00  |    |
|                         | APACHE CORP                        | 40,812  | 141.99        | 5,794,895.88  |    |
|                         | ARCH COAL INC                      | 17,600  | 75.44         | 1,327,744.00  |    |
|                         | BAKER HUGHES INC                   | 38,023  | 89.56         | 3,405,339.88  |    |
|                         | BJ SERVICES CO                     | 36,000  | 31.97         | 1,150,920.00  |    |
|                         | CABOT OIL & GAS CORP               | 12,000  | 70.98         | 851,760.00    |    |
|                         | CAMERON INTERNATIONAL CORP         | 26,900  | 57.27         | 1,540,563.00  |    |
|                         | CHESAPEAKE ENERGY CORP             | 59,900  | 60.08         | 3,598,792.00  |    |
|                         | CHEVRON CORP                       | 254,642 | 101.20        | 25,769,770.40 |    |
|                         | CIMAREX ENERGY CO                  | 10,200  | 72.57         | 740,214.00    |    |
|                         | CONOCOPHILLIPS                     | 181,800 | 95.24         | 17,314,632.00 |    |
|                         | CONSOL ENERGY INC                  | 22,400  | 108.02        | 2,419,648.00  |    |
|                         | DENBURY RESOURCES INC              | 30,000  | 36.02         | 1,080,600.00  |    |
|                         | DEVON ENERGY CORPORATION           | 51,800  | 119.25        | 6,177,150.00  |    |
|                         | DIAMOND OFFSHORE DRILLING          | 8,600   | 135.42        | 1,164,612.00  |    |
|                         | DYNEGY INC-CL A                    | 61,400  | 9.24          | 567,336.00    |    |
|                         | EL PASO CORP                       | 85,900  | 21.27         | 1,827,093.00  |    |
|                         | ENSCO INTERNATIONAL INC            | 17,700  | 79.27         | 1,403,079.00  |    |
|                         | EOG RESOURCES INC                  | 30,300  | 131.89        | 3,996,267.00  |    |
|                         | EXTERRAN HOLDINGS INC              | 7,700   | 72.67         | 559,559.00    |    |
|                         | EXXON MOBIL CORPORATION            | 655,876 | 89.07         | 58,418,875.32 |    |
|                         | FMC TECHNOLOGIES INC               | 16,000  | 78.16         | 1,250,560.00  |    |
|                         | FOREST OIL CORP                    | 10,300  | 73.49         | 756,947.00    |    |
|                         | HALLIBURTON CO                     | 107,900 | 50.60         | 5,459,740.00  |    |
|                         | HELMERICH & PAYNE                  | 12,700  | 66.76         | 847,852.00    |    |
|                         | HESS CORP                          | 35,400  | 127.47        | 4,512,438.00  |    |
|                         | MARATHON OIL CORP                  | 87,100  | 50.62         | 4,409,002.00  |    |
|                         | MURPHY OIL CORP                    | 22,000  | 95.31         | 2,096,820.00  |    |
|                         | NABORS INDUSTRIES INC              | 34,800  | 44.93         | 1,563,564.00  |    |
|                         | NATIONAL OILWELL VARCO INC         | 50,821  | 86.56         | 4,399,065.76  |    |
|                         | NEWFIELD EXPLORATION CO            | 16,100  | 67.18         | 1,081,598.00  |    |
|                         | NOBLE CORP                         | 32,900  | 65.64         | 2,159,556.00  |    |
|                         | NOBLE ENERGY INC                   | 21,100  | 103.49        | 2,183,639.00  |    |
|                         | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP          | 100,880 | 93.56         | 9,438,332.80  |    |
|                         | PATTERSON-UTI ENERGY INC           | 18,900  | 33.32         | 629,748.00    |    |
|                         | PEABODY ENERGY CORP                | 32,600  | 81.40         | 2,653,640.00  |    |
|                         | PIONEER NATURAL RESOURCES CO       | 14,700  | 77.05         | 1,132,635.00  |    |
|                         | PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION CO | 13,900  | 76.42         | 1,062,238.00  |    |
|                         | PRIDE INTERNATIONAL INC            | 20,500  | 45.31         | 928,855.00    |    |
|                         | QUICKSILVER RESOURCES INC          | 12,600  | 42.30         | 532,980.00    |    |
|                         | RANGE RESOURCES CORP               | 18,400  | 67.97         | 1,250,648.00  |    |
|                         | ROWAN COMPANIES INC                | 13,700  | 45.99         | 630,063.00    |    |
| SANDRIDGE ENERGY INC    | 8,700                              | 61.14   | 531,918.00    |               |    |
| SCHLUMBERGER LIMITED    | 146,840                            | 104.81  | 15,390,300.40 |               |    |
| SMITH INTERNATIONAL INC | 24,600                             | 83.47   | 2,053,362.00  |               |    |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO  | 41,800                             | 48.69   | 2,035,242.00  |               |    |
| SUNOCO INC              | 14,500                             | 41.38   | 600,010.00    |               |    |
| TESORO CORP             | 16,800                             | 23.70   | 398,160.00    |               |    |
| TRANSOCEAN INC          | 39,024                             | 148.10  | 5,779,454.40  |               |    |
| ULTRA PETROLEUM CORP    | 18,700                             | 96.62   | 1,806,794.00  |               |    |
| VALERO ENERGY CORP      | 67,564                             | 45.35   | 3,064,027.40  |               |    |

| 通貨                  | 銘柄                             | 株式数     | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額    | 備考 |
|---------------------|--------------------------------|---------|--------------|--------------|----|
| 米ドル                 | WEATHERFORD INTL LTD           | 85,548  | 46.35        | 3,965,149.80 |    |
|                     | WILLIAMS COS INC               | 71,720  | 39.71        | 2,848,001.20 |    |
|                     | XTO ENERGY INC                 | 62,616  | 67.72        | 4,240,355.52 |    |
|                     | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC   | 26,300  | 103.41       | 2,719,683.00 |    |
|                     | AK STEEL HOLDING CORP          | 13,700  | 72.64        | 995,168.00   |    |
|                     | ALCOA INC                      | 99,900  | 42.17        | 4,212,783.00 |    |
|                     | ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC     | 11,200  | 67.92        | 760,704.00   |    |
|                     | BALL CORP                      | 11,400  | 51.50        | 587,100.00   |    |
|                     | CELANESE CORP-SERIES A         | 18,500  | 48.15        | 890,775.00   |    |
|                     | CF INDUSTRIES HOLDINGS INC     | 6,600   | 151.12       | 997,392.00   |    |
|                     | CLEVELAND-CLIFFS INC           | 11,100  | 106.60       | 1,183,260.00 |    |
|                     | DOMTAR CORP                    | 63,385  | 6.18         | 391,719.30   |    |
|                     | DOW CHEMICAL COMPANY           | 115,202 | 39.46        | 4,545,870.92 |    |
|                     | DU PONT (E.I.) DE NEMOURS      | 110,246 | 46.21        | 5,094,467.66 |    |
|                     | EASTMAN CHEMICAL COMPANY       | 9,800   | 74.96        | 734,608.00   |    |
|                     | ECOLAB INC                     | 22,800  | 44.74        | 1,020,072.00 |    |
|                     | FREEPORT-MCMORAN COPPER-B      | 46,838  | 118.26       | 5,539,061.88 |    |
|                     | HUNTSMAN CORP                  | 20,200  | 21.09        | 426,018.00   |    |
|                     | INTERNATIONAL PAPER CO         | 49,900  | 25.11        | 1,252,989.00 |    |
|                     | INTL FLAVORS & FRAGRANCES      | 9,036   | 41.72        | 376,981.92   |    |
|                     | MARTIN MARIETTA MATERIALS      | 5,100   | 113.61       | 579,411.00   |    |
|                     | MEADWESTVACO CORP              | 21,400  | 24.62        | 526,868.00   |    |
|                     | MONSANTO CO                    | 67,200  | 138.45       | 9,303,840.00 |    |
|                     | MOSAIC CO/THE                  | 19,100  | 141.01       | 2,693,291.00 |    |
|                     | NEWMONT MINING CORP HOLDING CO | 53,450  | 49.02        | 2,620,119.00 |    |
|                     | NUCOR CORP                     | 35,400  | 78.89        | 2,792,706.00 |    |
|                     | OWENS-ILLINOIS INC             | 19,300  | 53.21        | 1,026,953.00 |    |
|                     | PACTIV CORPORATION             | 16,000  | 23.37        | 373,920.00   |    |
|                     | PPG INDUSTRIES INC.            | 20,100  | 60.88        | 1,223,688.00 |    |
|                     | PRAXAIR INC                    | 38,414  | 96.89        | 3,721,932.46 |    |
|                     | ROHM + HAAS COMPANY            | 15,700  | 52.72        | 827,704.00   |    |
|                     | SEALED AIR CORP                | 19,800  | 22.55        | 446,490.00   |    |
|                     | SIGMA-ALDRICH                  | 15,900  | 57.88        | 920,292.00   |    |
|                     | STEEL DYNAMICS INC             | 19,600  | 38.97        | 763,812.00   |    |
|                     | UNITED STATES STEEL CORP       | 14,500  | 184.29       | 2,672,205.00 |    |
|                     | VULCAN MATERIALS COMPANY       | 13,300  | 71.35        | 948,955.00   |    |
|                     | WEYERHAEUSER CO                | 26,733  | 56.40        | 1,507,741.20 |    |
|                     | 3M COMPANY                     | 82,438  | 75.82        | 6,250,449.16 |    |
|                     | AGCO CORP                      | 11,200  | 56.13        | 628,656.00   |    |
|                     | BOEING COMPANY                 | 89,095  | 73.95        | 6,588,575.25 |    |
|                     | CATERPILLAR INC                | 76,500  | 80.81        | 6,181,965.00 |    |
|                     | COOPER INDUSTRIES INC-CL A     | 21,700  | 45.37        | 984,529.00   |    |
|                     | COVIDEN LTD                    | 60,832  | 48.25        | 2,935,144.00 |    |
|                     | CUMMINS INC                    | 23,600  | 65.59        | 1,547,924.00 |    |
| DANAHER CORP        | 31,302                         | 79.65   | 2,493,204.30 |              |    |
| DEERE & CO          | 53,526                         | 81.68   | 4,372,003.68 |              |    |
| DOVER CORP          | 23,600                         | 52.12   | 1,230,032.00 |              |    |
| EATON CORP          | 19,200                         | 95.52   | 1,833,984.00 |              |    |
| EMERSON ELECTRIC CO | 96,400                         | 56.26   | 5,423,464.00 |              |    |
| FASTENAL CO         | 15,600                         | 48.80   | 761,280.00   |              |    |
| FLOWERVE CORP       | 7,000                          | 137.54  | 962,780.00   |              |    |
| FLUOR CORP (NEW)    | 10,900                         | 186.70  | 2,035,030.00 |              |    |
| FOSTER WHEELER LTD  | 17,700                         | 76.33   | 1,351,041.00 |              |    |

| 通貨                            | 銘柄                           | 株式数       | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額     | 備考 |
|-------------------------------|------------------------------|-----------|--------------|---------------|----|
| 米ドル                           | GENERAL DYNAMICS CORPORATION | 42,000    | 86.13        | 3,617,460.00  |    |
|                               | GENERAL ELECTRIC             | 1,224,145 | 30.06        | 36,797,798.70 |    |
|                               | GOODRICH CORP                | 15,300    | 55.75        | 852,975.00    |    |
|                               | GRAINGER (W.W.) INC          | 8,300     | 89.97        | 746,751.00    |    |
|                               | HARSCO CORP                  | 10,400    | 61.85        | 643,240.00    |    |
|                               | HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 86,700    | 54.79        | 4,750,293.00  |    |
|                               | ILLINOIS TOOL WORKS          | 51,676    | 50.46        | 2,607,570.96  |    |
|                               | INGERSOLL-RAND CO            | 38,468    | 39.58        | 1,522,563.44  |    |
|                               | ITT CORPORATION              | 21,200    | 63.27        | 1,341,324.00  |    |
|                               | JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 14,900    | 89.17        | 1,328,633.00  |    |
|                               | JOY GLOBAL INC               | 13,300    | 87.96        | 1,169,868.00  |    |
|                               | KBR INC                      | 20,900    | 37.04        | 774,136.00    |    |
|                               | L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS  | 15,100    | 96.81        | 1,461,831.00  |    |
|                               | LOCKHEED MARTIN CORPORATION  | 43,100    | 102.65       | 4,424,215.00  |    |
|                               | MANITOWOC COMPANY INC        | 16,000    | 42.17        | 674,720.00    |    |
|                               | MASCO CORP                   | 45,300    | 17.21        | 779,613.00    |    |
|                               | MCDERMOTT INTL INC           | 27,700    | 66.32        | 1,837,064.00  |    |
|                               | NORTHROP GRUMMAN CORP        | 39,400    | 71.99        | 2,836,406.00  |    |
|                               | OSHKOSH CORPORATION          | 9,100     | 38.72        | 352,352.00    |    |
|                               | PACCAR INC                   | 42,775    | 49.61        | 2,122,067.75  |    |
|                               | PALL CORP                    | 15,100    | 39.82        | 601,282.00    |    |
|                               | PARKER HANNIFIN CORP         | 20,750    | 77.69        | 1,612,067.50  |    |
|                               | PENTAIR INC                  | 11,600    | 35.85        | 415,860.00    |    |
|                               | PRECISION CASTPARTS CORP     | 17,000    | 104.91       | 1,783,470.00  |    |
|                               | RAYTHEON COMPANY             | 52,300    | 58.01        | 3,033,923.00  |    |
|                               | ROCKWELL AUTOMATION INC      | 17,300    | 53.80        | 930,740.00    |    |
|                               | ROCKWELL COLLONS             | 20,000    | 54.40        | 1,088,000.00  |    |
|                               | ROPER INDUSTRIES INC         | 10,900    | 65.88        | 718,092.00    |    |
|                               | SPX CORP                     | 6,500     | 134.37       | 873,405.00    |    |
|                               | SUNPOWER CORP-CLASS A        | 4,600     | 76.68        | 352,728.00    |    |
|                               | TEREX CORP                   | 12,500    | 66.52        | 831,500.00    |    |
|                               | TEXTRON INC                  | 30,500    | 58.00        | 1,769,000.00  |    |
|                               | TYCO ELECTRONICS LTD         | 61,032    | 38.79        | 2,367,431.28  |    |
|                               | TYCO INTERNATIONAL LTD       | 60,832    | 43.37        | 2,638,283.84  |    |
|                               | UNITED TECHNOLOGIES CORP     | 114,200   | 67.55        | 7,714,210.00  |    |
|                               | APOLLO GROUP INC-CL A        | 17,500    | 46.46        | 813,050.00    |    |
|                               | AVERY DENNISON CORP          | 11,800    | 48.52        | 572,536.00    |    |
|                               | CHOICEPOINT INC              | 8,400     | 48.68        | 408,912.00    |    |
|                               | CINTAS CORP                  | 17,000    | 28.04        | 476,680.00    |    |
|                               | DUN & BRADSTREET CORP        | 7,000     | 91.07        | 637,490.00    |    |
|                               | EQUIFAX INC                  | 15,900    | 36.11        | 574,149.00    |    |
|                               | H&R BLOCK INC                | 39,900    | 22.74        | 907,326.00    |    |
|                               | HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC    | 17,800    | 11.84        | 210,752.00    |    |
|                               | MANPOWER INC                 | 9,800     | 61.73        | 604,954.00    |    |
| MONSTER WORLDWIDE INC         | 14,100                       | 22.75     | 320,775.00   |               |    |
| PITNEY BOWES INC              | 26,606                       | 36.18     | 962,605.08   |               |    |
| REPUBLIC SERVICES INC         | 22,550                       | 34.07     | 768,278.50   |               |    |
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 18,500                       | 24.55     | 454,175.00   |               |    |
| RR DONNELLEY & SONS CO        | 26,400                       | 31.24     | 824,736.00   |               |    |
| WASTE MANAGEMENT INC          | 60,800                       | 38.21     | 2,323,168.00 |               |    |
| WESTERN UNION CO              | 91,948                       | 23.13     | 2,126,757.24 |               |    |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP        | 21,840                       | 20.08     | 438,547.20   |               |    |
| BURLINGTON NORTHERN SANTA FE  | 42,775                       | 114.09    | 4,880,199.75 |               |    |



| 通貨                           | 銘柄                          | 株式数     | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額    | 備考 |
|------------------------------|-----------------------------|---------|--------------|--------------|----|
| 米ドル                          | C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 20,800  | 61.31        | 1,275,248.00 |    |
|                              | CSX CORP                    | 49,500  | 66.89        | 3,311,055.00 |    |
|                              | EXPEDITORS INTL WASH INC    | 26,200  | 46.32        | 1,213,584.00 |    |
|                              | FEDEX CORP                  | 36,095  | 89.13        | 3,217,147.35 |    |
|                              | NORFOLK SOUTHERN CORP       | 46,200  | 65.23        | 3,013,626.00 |    |
|                              | SOUTHWEST AIRLINES          | 22,600  | 14.19        | 320,694.00   |    |
|                              | UNION PACIFIC CORPORATION   | 60,860  | 79.72        | 4,851,759.20 |    |
|                              | UNITED PARCEL SERVICE -CL B | 84,820  | 69.47        | 5,892,445.40 |    |
|                              | BORGWARNER INC              | 14,300  | 47.74        | 682,682.00   |    |
|                              | FORD MOTOR CO               | 222,670 | 6.36         | 1,416,181.20 |    |
|                              | GENERAL MOTORS CORPORATION  | 55,540  | 16.48        | 915,299.20   |    |
|                              | GOODYEAR TIRE & RUBBER CO   | 28,000  | 22.93        | 642,040.00   |    |
|                              | HARLEY-DAVIDSON INC         | 29,300  | 38.99        | 1,142,407.00 |    |
|                              | JOHNSON CONTROLS INC        | 72,842  | 32.66        | 2,379,019.72 |    |
|                              | BLACK & DECKER CORP         | 7,490   | 61.04        | 457,189.60   |    |
|                              | CENTEX CORP                 | 15,082  | 15.62        | 235,580.84   |    |
|                              | COACH INC                   | 43,200  | 34.57        | 1,493,424.00 |    |
|                              | DR HORTON INC               | 34,800  | 11.73        | 408,204.00   |    |
|                              | EASTMAN KODAK CO            | 35,400  | 13.57        | 480,378.00   |    |
|                              | FORTUNE BRANDS INC          | 18,900  | 66.13        | 1,249,857.00 |    |
|                              | GARMIN LTD                  | 14,700  | 49.59        | 728,973.00   |    |
|                              | HASBRO INC                  | 15,800  | 38.44        | 607,352.00   |    |
|                              | LEGETT & PLATT INC          | 20,600  | 18.67        | 384,602.00   |    |
|                              | LENNAR CORP-CL A            | 15,900  | 15.18        | 241,362.00   |    |
|                              | MATTEL INC                  | 44,300  | 20.08        | 889,544.00   |    |
|                              | MOHAWK INDUSTRIES INC       | 7,100   | 71.46        | 507,366.00   |    |
|                              | NEWELL RUBBERMAID INC       | 34,300  | 19.28        | 661,304.00   |    |
|                              | NIKE INC. CLASS B           | 45,700  | 68.58        | 3,134,106.00 |    |
|                              | POLO RALPH LAUREN CORP      | 7,200   | 66.01        | 475,272.00   |    |
|                              | PULTE HOMES INC             | 26,900  | 10.63        | 285,947.00   |    |
|                              | STANLEY WORKS               | 8,700   | 47.69        | 414,903.00   |    |
|                              | TOLL BROTHERS INC           | 16,600  | 19.31        | 320,546.00   |    |
|                              | VF CORP                     | 10,800  | 71.55        | 772,740.00   |    |
|                              | WHIRLPOOL CORP              | 9,300   | 68.42        | 636,306.00   |    |
|                              | CARNIVAL CORP               | 53,600  | 36.95        | 1,980,520.00 |    |
|                              | DARDEN RESTAURANTS INC      | 16,700  | 32.01        | 534,567.00   |    |
|                              | INTL GAME TECHNOLOGY        | 38,400  | 33.31        | 1,279,104.00 |    |
|                              | LAS VEGAS SANDS CORP        | 13,100  | 59.91        | 784,821.00   |    |
|                              | MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A | 34,800  | 29.55        | 1,028,340.00 |    |
|                              | MC DONALD'S CORPORATION     | 141,256 | 59.31        | 8,377,893.36 |    |
|                              | MGM MIRAGE                  | 12,300  | 45.07        | 554,361.00   |    |
|                              | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 17,000  | 27.45        | 466,650.00   |    |
|                              | STARBUCKS CORP              | 88,900  | 17.52        | 1,557,528.00 |    |
|                              | STARWOOD HOTELS & RESORTS   | 23,120  | 45.01        | 1,040,631.20 |    |
| TIM HORTONS INC              | 22,803                      | 30.91   | 704,840.73   |              |    |
| WYNN RESORTS LTD             | 7,700                       | 90.95   | 700,315.00   |              |    |
| YUM BRANDS INC               | 58,300                      | 38.03   | 2,217,149.00 |              |    |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 28,400                      | 26.55   | 754,020.00   |              |    |
| CBS CORP-CL B                | 72,870                      | 21.01   | 1,530,998.70 |              |    |
| CLEAR CHANNEL COMMUNICATIONS | 58,030                      | 35.04   | 2,033,371.20 |              |    |
| COMCAST CORP-CL A            | 239,223                     | 21.96   | 5,253,337.08 |              |    |
| COMCAST CORP-SPECIAL CL A    | 116,250                     | 21.74   | 2,527,275.00 |              |    |
| DIRECTV GROUP INC/THE        | 84,600                      | 27.70   | 2,343,420.00 |              |    |

| 通貨                  | 銘柄                             | 株式数     | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額    | 備考 |
|---------------------|--------------------------------|---------|--------------|--------------|----|
| 米ドル                 | DISCOVERY HOLDING CO-A         | 33,069  | 25.79        | 852,849.51   |    |
|                     | DISH NETWORK CORP-A            | 25,800  | 34.87        | 899,646.00   |    |
|                     | EW SCRIPPS CO-CL A             | 10,800  | 46.54        | 502,632.00   |    |
|                     | GANNETT CO                     | 28,192  | 27.45        | 773,870.40   |    |
|                     | INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES | 57,860  | 9.51         | 550,248.60   |    |
|                     | LAMAR ADVERTISING CO-CL A      | 9,200   | 37.81        | 347,852.00   |    |
|                     | LIBERTY GLOBAL INC-A           | 20,953  | 35.05        | 734,402.65   |    |
|                     | LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C    | 20,400  | 33.24        | 678,096.00   |    |
|                     | LIBERTY MEDIA CORP-ENT SER A   | 60,456  | 26.11        | 1,578,506.16 |    |
|                     | LIBERTY MEDIA- INTERACTIVE A   | 71,047  | 16.91        | 1,201,404.77 |    |
|                     | MCGRAW-HILL INC                | 40,400  | 43.69        | 1,765,076.00 |    |
|                     | NEWS CORP INC CLASS A          | 222,705 | 17.29        | 3,850,569.45 |    |
|                     | NEWS CORP INC CLASS B          | 53,865  | 17.89        | 963,644.85   |    |
|                     | OMNICOM GROUP                  | 39,400  | 45.62        | 1,797,428.00 |    |
|                     | SIRIUS SATELLITE RADIO INC     | 162,100 | 2.57         | 416,597.00   |    |
|                     | THE WALT DISNEY CO.            | 219,358 | 33.18        | 7,278,298.44 |    |
|                     | TIME WARNER INC                | 438,488 | 15.18        | 6,656,247.84 |    |
|                     | VIACOM INC-CLASS B             | 67,970  | 33.92        | 2,305,542.40 |    |
|                     | VIRGIN MEDIA INC               | 34,150  | 16.04        | 547,766.00   |    |
|                     | WASHINGTON POST -CL B          | 800     | 606.00       | 484,800.00   |    |
|                     | XM SATELLITE RADIO HOLD-CL A   | 36,900  | 11.17        | 412,173.00   |    |
|                     | ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A    | 10,600  | 67.64        | 716,984.00   |    |
|                     | ADVANCE AUTO PARTS             | 11,650  | 41.08        | 478,582.00   |    |
|                     | AMAZON.COM INC                 | 38,400  | 79.43        | 3,050,112.00 |    |
|                     | AMERICAN EAGLE OUTFITTERS      | 23,700  | 16.37        | 387,969.00   |    |
|                     | AUTONATION INC                 | 16,555  | 14.10        | 233,425.50   |    |
|                     | AUTOZONE INC                   | 5,500   | 121.45       | 667,975.00   |    |
|                     | BED BATH & BEYOND INC          | 32,200  | 29.78        | 958,916.00   |    |
|                     | BEST BUY CO INC                | 43,750  | 44.18        | 1,932,875.00 |    |
|                     | CARMAX INC                     | 26,800  | 18.45        | 494,460.00   |    |
|                     | EBAY INC                       | 132,772 | 29.07        | 3,859,682.04 |    |
|                     | EXPEDIA INC                    | 23,950  | 22.29        | 533,845.50   |    |
|                     | FAMILY DOLLAR STORES           | 16,400  | 21.37        | 350,468.00   |    |
|                     | GAMESTOP CORP-CLASS A          | 18,800  | 45.83        | 861,604.00   |    |
|                     | GAP INC/THE                    | 64,500  | 16.99        | 1,095,855.00 |    |
|                     | GENUINE PARTS CO               | 20,600  | 42.63        | 878,178.00   |    |
|                     | HOME DEPOT INC                 | 206,904 | 26.54        | 5,491,232.16 |    |
|                     | IAC/INTERACTIVECORP            | 23,250  | 21.15        | 491,737.50   |    |
|                     | J.C. PENNEY CO INC (HLDG CO)   | 25,900  | 38.09        | 986,531.00   |    |
|                     | KOHL'S CORP                    | 36,620  | 43.35        | 1,587,477.00 |    |
|                     | LIMITED BRANDS                 | 39,030  | 17.81        | 695,124.30   |    |
|                     | LOWE'S COS INC                 | 178,796 | 23.23        | 4,153,431.08 |    |
|                     | MACY'S INC                     | 51,452  | 21.56        | 1,109,305.12 |    |
|                     | NORDSTROM INC                  | 20,300  | 33.56        | 681,268.00   |    |
| OFFICE DEPOT INC    | 33,500                         | 12.08   | 404,680.00   |              |    |
| PETSMART INC        | 15,800                         | 22.36   | 353,288.00   |              |    |
| PRICELINE.COM INC   | 4,500                          | 126.55  | 569,475.00   |              |    |
| ROSS STORES INC     | 16,700                         | 36.49   | 609,383.00   |              |    |
| SEARS HOLDING CORP  | 9,285                          | 82.74   | 768,240.90   |              |    |
| SHERWIN-WILLIAMS CO | 12,800                         | 50.05   | 640,640.00   |              |    |
| STAPLES INC         | 86,750                         | 23.21   | 2,013,467.50 |              |    |
| TARGET CORP         | 95,420                         | 52.45   | 5,004,779.00 |              |    |
| TIFFANY & CO        | 16,700                         | 46.21   | 771,707.00   |              |    |

| 通貨                           | 銘柄                             | 株式数     | 評価額<br>単価     | 評価額<br>金額     | 備考 |
|------------------------------|--------------------------------|---------|---------------|---------------|----|
| 米ドル                          | TJX COMPANIES INC              | 53,600  | 31.42         | 1,684,112.00  |    |
|                              | URBAN OUTFITTERS INC           | 14,200  | 30.95         | 439,490.00    |    |
|                              | WILLIAMS-SONOMA INC            | 11,100  | 22.18         | 246,198.00    |    |
|                              | COSTCO WHOLESALE CORP          | 53,300  | 71.33         | 3,801,889.00  |    |
|                              | CVS CAREMARK CORP              | 175,583 | 42.49         | 7,460,521.67  |    |
|                              | KROGER CO                      | 78,700  | 27.38         | 2,154,806.00  |    |
|                              | SAFEWAY INC                    | 54,000  | 31.26         | 1,688,040.00  |    |
|                              | SUPERVALU INC                  | 25,978  | 34.14         | 886,888.92    |    |
|                              | SYSCO CORP                     | 73,990  | 30.49         | 2,255,955.10  |    |
|                              | WAL-MART STORES                | 294,626 | 59.57         | 17,550,870.82 |    |
|                              | WALGREEN CO                    | 121,606 | 35.62         | 4,331,605.72  |    |
|                              | WHOLE FOODS MARKET INC         | 17,200  | 28.60         | 491,920.00    |    |
|                              | ALTRIA GROUP INC               | 258,475 | 21.16         | 5,469,331.00  |    |
|                              | ANHEUSER BUSCH                 | 89,986  | 57.54         | 5,177,794.44  |    |
|                              | ARCHER DANIELS MIDLAND COMPANY | 71,010  | 37.55         | 2,666,425.50  |    |
|                              | BROWN-FORMAN CORP-CLASS B      | 6,900   | 76.96         | 531,024.00    |    |
|                              | BUNGE LIMITED                  | 14,900  | 122.15        | 1,820,035.00  |    |
|                              | CAMPBELL SOUP                  | 28,300  | 33.02         | 934,466.00    |    |
|                              | COCA-COLA CO/THE               | 256,434 | 55.86         | 14,324,403.24 |    |
|                              | COCA-COLA ENTERPRISES          | 35,800  | 19.21         | 687,718.00    |    |
|                              | CONAGRA FOODS INC              | 59,850  | 23.48         | 1,405,278.00  |    |
|                              | CONSTELLATION BRANDS INC-A     | 23,600  | 20.77         | 490,172.00    |    |
|                              | DEAN FOODS CO                  | 18,650  | 20.28         | 378,222.00    |    |
|                              | DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I    | 32,886  | 24.97         | 821,163.42    |    |
|                              | GENERAL MILLS INC              | 41,390  | 62.42         | 2,583,563.80  |    |
|                              | HANSEN NATURAL CORPORATION     | 9,000   | 34.92         | 314,280.00    |    |
|                              | HEINZ (H.J.) CO                | 38,700  | 50.09         | 1,938,483.00  |    |
|                              | HERSHEY CO/THE                 | 19,400  | 37.31         | 723,814.00    |    |
|                              | HORMEL FOODS CORP              | 9,100   | 36.76         | 334,516.00    |    |
|                              | KELLOGG CO                     | 33,400  | 50.32         | 1,680,688.00  |    |
|                              | KRAFT FOODS INC-A              | 188,018 | 31.38         | 5,900,004.84  |    |
|                              | LOEWS CORP - CAROLINA GROUP    | 13,300  | 72.04         | 958,132.00    |    |
|                              | MCCORMICK & CO-NON VTC SHRS    | 14,200  | 37.95         | 538,890.00    |    |
|                              | MOLSON COORS BREWING CO -B     | 15,000  | 58.63         | 879,450.00    |    |
|                              | PEPSI BOTTLING GROUP INC       | 17,600  | 31.28         | 550,528.00    |    |
|                              | PEPSICO INC                    | 196,396 | 65.37         | 12,838,406.52 |    |
|                              | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL    | 258,275 | 49.49         | 12,782,029.75 |    |
|                              | REYNOLDS AMERICAN INC          | 21,700  | 53.18         | 1,154,006.00  |    |
|                              | SARA LEE CORP                  | 87,400  | 13.19         | 1,152,806.00  |    |
|                              | TYSON FOODS INC-CL A           | 33,300  | 15.67         | 521,811.00    |    |
|                              | UST INC                        | 18,300  | 55.96         | 1,024,068.00  |    |
|                              | WRIGLEY WM JR CO               | 25,375  | 77.17         | 1,958,188.75  |    |
|                              | AVON PRODUCTS, INC             | 52,340  | 36.92         | 1,932,392.80  |    |
|                              | CLOROX COMPANY                 | 17,100  | 53.13         | 908,523.00    |    |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 62,500                         | 72.90   | 4,556,250.00  |               |    |
| ENERGIZER HOLDINGS INC       | 6,700                          | 78.52   | 526,084.00    |               |    |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 12,700                         | 46.96   | 596,392.00    |               |    |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 51,547                         | 62.07   | 3,199,522.29  |               |    |
| PROCTER & GAMBLE CO          | 377,315                        | 66.07   | 24,929,202.05 |               |    |
| AETNA INC                    | 61,400                         | 46.11   | 2,831,154.00  |               |    |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 20,000                         | 40.94   | 818,800.00    |               |    |
| APPLIED BIOSYSTEMS GROUP-APP | 20,600                         | 33.13   | 682,478.00    |               |    |
| BARD (C.R.) INC              | 12,300                         | 88.99   | 1,094,577.00  |               |    |

| 通貨                           | 銘柄                           | 株式数     | 評価額<br>単価     | 評価額<br>金額     | 備考 |
|------------------------------|------------------------------|---------|---------------|---------------|----|
| 米ドル                          | BAXTER INTERNATIONAL INC     | 77,810  | 60.87         | 4,736,294.70  |    |
|                              | BECKMAN COULTER INC          | 7,700   | 69.66         | 536,382.00    |    |
|                              | BECTON DICKINSON & CO        | 30,000  | 82.58         | 2,477,400.00  |    |
|                              | BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 164,686 | 13.33         | 2,195,264.38  |    |
|                              | CARDINAL HEALTH INC          | 43,754  | 55.46         | 2,426,596.84  |    |
|                              | CIGNA CORP                   | 34,300  | 40.59         | 1,392,237.00  |    |
|                              | COVENTRY HEALTH CARE INC     | 19,050  | 43.43         | 827,341.50    |    |
|                              | DAVITA INC                   | 13,200  | 49.78         | 657,096.00    |    |
|                              | DENTSPLY INTERNATIONAL INC   | 17,600  | 38.65         | 680,240.00    |    |
|                              | EXPRESS SCRIPTS INC          | 26,400  | 68.84         | 1,817,376.00  |    |
|                              | HEALTH NET INC               | 13,600  | 29.38         | 399,568.00    |    |
|                              | HENRY SCHEIN INC             | 11,000  | 53.96         | 593,560.00    |    |
|                              | HOSPIRA INC                  | 19,315  | 41.81         | 807,560.15    |    |
|                              | HUMANA INC                   | 20,900  | 47.72         | 997,348.00    |    |
|                              | IMS HEALTH INC               | 22,500  | 23.49         | 528,525.00    |    |
|                              | INTUITIVE SURGICAL INC       | 4,800   | 275.09        | 1,320,432.00  |    |
|                              | LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 13,600  | 74.17         | 1,008,712.00  |    |
|                              | MCKESSON CORP                | 35,400  | 56.79         | 2,010,366.00  |    |
|                              | MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC   | 64,310  | 49.19         | 3,163,408.90  |    |
|                              | MEDTRONIC, INCORPORATED      | 138,645 | 50.33         | 6,978,002.85  |    |
|                              | PATTERSON COS INC            | 15,400  | 33.22         | 511,588.00    |    |
|                              | QUEST DIAGNOSTICS INC        | 20,300  | 48.95         | 993,685.00    |    |
|                              | ST JUDE MEDICAL INC          | 42,200  | 40.83         | 1,723,026.00  |    |
|                              | STRYKER CORP                 | 35,300  | 63.59         | 2,244,727.00  |    |
|                              | UNITEDHEALTH GROUP INC       | 153,468 | 32.93         | 5,053,701.24  |    |
|                              | VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC   | 15,500  | 47.43         | 735,165.00    |    |
|                              | WELLPOINT INC                | 66,498  | 55.28         | 3,676,009.44  |    |
|                              | ZIMMER HOLDINGS INC          | 28,800  | 71.02         | 2,045,376.00  |    |
|                              | ABBOTT LABORATORIES          | 189,553 | 54.78         | 10,383,713.34 |    |
|                              | ALLERGAN INC                 | 37,500  | 57.54         | 2,157,750.00  |    |
|                              | AMGEN INC                    | 133,362 | 44.30         | 5,907,936.60  |    |
|                              | AMYLIN PHARMACEUTICALS INC   | 16,600  | 26.84         | 445,544.00    |    |
|                              | BARR PHARMACEUTICALS INC     | 12,600  | 42.42         | 534,492.00    |    |
|                              | BIOGEN IDEC INC              | 36,557  | 61.28         | 2,240,212.96  |    |
|                              | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 242,675 | 20.63         | 5,006,385.25  |    |
|                              | CELGENE CORP                 | 53,400  | 61.47         | 3,282,498.00  |    |
|                              | CEPHALON INC                 | 8,300   | 69.37         | 575,771.00    |    |
|                              | CHARLES RIVER LABORATORIES   | 8,400   | 63.55         | 533,820.00    |    |
|                              | COVANCE INC                  | 7,900   | 80.10         | 632,790.00    |    |
|                              | ELI LILLY & CO               | 125,233 | 48.18         | 6,033,725.94  |    |
|                              | FOREST LABORATORIES INC      | 38,200  | 34.00         | 1,298,800.00  |    |
|                              | GENENTECH INC                | 58,100  | 74.09         | 4,304,629.00  |    |
|                              | GENZYME CORP - GENL DIVISION | 32,700  | 67.05         | 2,192,535.00  |    |
|                              | GILEAD SCIENCES INC          | 113,900 | 54.30         | 6,184,770.00  |    |
| INVITROGEN CORP              | 11,600                       | 44.02   | 510,632.00    |               |    |
| JOHNSON & JOHNSON            | 347,270                      | 65.63   | 22,791,330.10 |               |    |
| MERCK & CO. INC.             | 265,458                      | 36.99   | 9,819,291.42  |               |    |
| MILLIPORE CORP               | 6,700                        | 69.40   | 464,980.00    |               |    |
| PFIZER                       | 837,286                      | 18.02   | 15,087,893.72 |               |    |
| PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVEL | 13,200                       | 43.11   | 569,052.00    |               |    |
| SCHERING-PLOUGH CORP         | 198,600                      | 19.66   | 3,904,476.00  |               |    |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 17,200                       | 33.06   | 568,632.00    |               |    |
| WYETH                        | 164,160                      | 42.88   | 7,039,180.80  |               |    |

| 通貨                      | 銘柄                           | 株式数     | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額     | 備考 |
|-------------------------|------------------------------|---------|--------------|---------------|----|
| 米ドル                     | ASSOCIATED BANC-CORP         | 14,900  | 24.91        | 371,159.00    |    |
|                         | BANK OF AMERICA CORP         | 544,625 | 29.61        | 16,126,346.25 |    |
|                         | BB&T CORPORATION             | 67,000  | 27.06        | 1,813,020.00  |    |
|                         | COMERICA INC                 | 18,500  | 33.89        | 626,965.00    |    |
|                         | COUNTRYWIDE FINANCIAL CORP   | 70,998  | 4.71         | 334,400.58    |    |
|                         | FANNIE MAE                   | 130,427 | 23.68        | 3,088,511.36  |    |
|                         | FIFTH THIRD BANCORP          | 58,843  | 16.78        | 987,385.54    |    |
|                         | FREDDIE MAC                  | 79,243  | 22.55        | 1,786,929.65  |    |
|                         | HUDSON CITY BANCORP INC      | 57,200  | 16.87        | 964,964.00    |    |
|                         | HUNTINGTON BANCSHARES INC    | 42,700  | 7.68         | 327,936.00    |    |
|                         | KEYCORP                      | 47,740  | 16.65        | 794,871.00    |    |
|                         | M & T BANK CORP              | 8,800   | 80.79        | 710,952.00    |    |
|                         | MARSHALL & ILSLEY CORP       | 29,599  | 20.24        | 599,083.76    |    |
|                         | NATIONAL CITY CORP           | 73,900  | 4.47         | 330,333.00    |    |
|                         | NEW YORK COMMUNITY BANCORP   | 35,800  | 19.74        | 706,692.00    |    |
|                         | PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN | 42,300  | 16.40        | 693,720.00    |    |
|                         | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 42,422  | 59.86        | 2,539,380.92  |    |
|                         | REGIONS FINANCIAL CORP       | 85,037  | 14.34        | 1,219,430.58  |    |
|                         | SOVEREIGN BANCORP INC        | 58,690  | 8.49         | 498,278.10    |    |
|                         | SUNTRUST BANKS INC           | 41,208  | 45.23        | 1,863,837.84  |    |
|                         | UNIONBANCAL CORPORATION      | 6,000   | 45.55        | 273,300.00    |    |
|                         | US BANCORP                   | 212,057 | 30.95        | 6,563,164.15  |    |
|                         | WACHOVIA CORP                | 262,065 | 18.89        | 4,950,407.85  |    |
|                         | WASHINGTON MUTUAL INC        | 110,319 | 6.25         | 689,493.75    |    |
|                         | WELLS FARGO & COMPANY        | 390,710 | 25.27        | 9,873,241.70  |    |
|                         | ZIONS BANCORPORATION         | 12,500  | 37.63        | 470,375.00    |    |
|                         | ALLIED CAPITAL CORP          | 21,900  | 18.59        | 407,121.00    |    |
|                         | AMERICAN CAPITAL STRATEGIES  | 23,100  | 30.77        | 710,787.00    |    |
|                         | AMERICAN EXPRESS COMPANY     | 127,601 | 44.11        | 5,628,480.11  |    |
|                         | AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 27,980  | 45.36        | 1,269,172.80  |    |
|                         | BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 139,992 | 41.08        | 5,750,871.36  |    |
|                         | CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 45,784  | 44.44        | 2,034,640.96  |    |
|                         | CITIGROUP INC                | 638,266 | 19.60        | 12,510,013.60 |    |
|                         | CME GROUP INC                | 6,100   | 389.37       | 2,375,157.00  |    |
|                         | DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 52,857  | 15.33        | 810,297.81    |    |
|                         | FRANKLIN RESOURCES INC       | 20,500  | 99.67        | 2,043,235.00  |    |
|                         | GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 43,700  | 165.76       | 7,243,712.00  |    |
|                         | INTERCONTINENTALEXCHANGE INC | 6,900   | 127.05       | 876,645.00    |    |
|                         | INVESCO LTD                  | 51,811  | 26.95        | 1,396,306.45  |    |
|                         | JANUS CAPITAL GROUP INC      | 20,200  | 28.90        | 583,780.00    |    |
|                         | JPMORGAN CHASE & CO          | 418,987 | 37.51        | 15,716,202.37 |    |
|                         | LEGG MASON INC               | 16,300  | 51.87        | 845,481.00    |    |
|                         | LEHMAN BROTHERS HOLDINGS INC | 55,300  | 29.48        | 1,630,244.00  |    |
| LEUCADIA NATIONAL CORP  | 21,700                       | 50.69   | 1,099,973.00 |               |    |
| MERRILL LYNCH & CO INC  | 112,823                      | 37.76   | 4,260,196.48 |               |    |
| MOODY'S CORP            | 27,000                       | 38.11   | 1,028,970.00 |               |    |
| MORGAN STANLEY          | 121,914                      | 39.39   | 4,802,192.46 |               |    |
| NASDAQ STOCK MARKET INC | 17,000                       | 32.13   | 546,210.00   |               |    |
| NORTHERN TRUST CORP     | 24,400                       | 70.04   | 1,708,976.00 |               |    |
| NYMEX HOLDINGS INC      | 10,900                       | 84.12   | 916,908.00   |               |    |
| NYSE GROUP INC          | 16,300                       | 59.14   | 963,982.00   |               |    |
| SCHWAB (CHARLES) CORP   | 120,800                      | 21.49   | 2,595,992.00 |               |    |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 16,700                       | 24.62   | 411,154.00   |               |    |

| 通貨                         | 銘柄                                   | 株式数     | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額    | 備考 |
|----------------------------|--------------------------------------|---------|--------------|--------------|----|
| 米ドル                        | SLM CORP                             | 57,200  | 21.84        | 1,249,248.00 |    |
|                            | STATE STREET CORP                    | 47,573  | 66.95        | 3,185,012.35 |    |
|                            | T ROWE PRICE GROUP INC               | 30,778  | 57.62        | 1,773,428.36 |    |
|                            | TD AMERITRADE HOLDING CORP           | 29,200  | 17.74        | 518,008.00   |    |
|                            | ACE LTD                              | 40,500  | 60.89        | 2,466,045.00 |    |
|                            | AFLAC INC                            | 59,710  | 65.94        | 3,937,277.40 |    |
|                            | ALLSTATE CORP                        | 65,360  | 50.14        | 3,277,150.40 |    |
|                            | AMERICAN INT'L GROUP                 | 277,576 | 33.49        | 9,296,020.24 |    |
|                            | AON CORP                             | 33,800  | 46.82        | 1,582,516.00 |    |
|                            | ASSURANT INC                         | 12,300  | 69.48        | 854,604.00   |    |
|                            | AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD            | 17,700  | 34.05        | 602,685.00   |    |
|                            | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B          | 1,190   | 4,242.00     | 5,047,980.00 |    |
|                            | CHUBB CORP                           | 45,418  | 53.15        | 2,413,966.70 |    |
|                            | CINCINNATI FINANCIAL CORP            | 19,371  | 33.29        | 644,860.59   |    |
|                            | EVEREST RE GROUP LTD                 | 7,800   | 86.62        | 675,636.00   |    |
|                            | FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC CL-A | 25,165  | 14.92        | 375,461.80   |    |
|                            | FIRST AMERICAN CORPORATION           | 9,600   | 30.90        | 296,640.00   |    |
|                            | GENWORTH FINANCIAL INC-CL A          | 53,100  | 20.55        | 1,091,205.00 |    |
|                            | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GR       | 38,500  | 71.08        | 2,736,580.00 |    |
|                            | LINCOLN NATIONAL CORP                | 33,007  | 52.02        | 1,717,024.14 |    |
|                            | LOEWS CORP                           | 51,900  | 49.74        | 2,581,506.00 |    |
|                            | MARSH & MCLENNAN COS                 | 63,839  | 26.04        | 1,662,367.56 |    |
|                            | METLIFE INC                          | 86,940  | 57.05        | 4,959,927.00 |    |
|                            | NATIONWIDE FINANCIAL SERV- A         | 5,800   | 50.83        | 294,814.00   |    |
|                            | OLD REPUBLIC INTL CORP               | 26,850  | 14.49        | 389,056.50   |    |
|                            | PARTNERRE LTD                        | 6,900   | 73.16        | 504,804.00   |    |
|                            | PRINCIPAL FINANCIAL GROUP            | 31,700  | 49.45        | 1,567,565.00 |    |
|                            | PROGRESSIVE CORP                     | 79,000  | 20.03        | 1,582,370.00 |    |
|                            | PRUDENTIAL FINANCIAL INC             | 54,486  | 70.55        | 3,843,987.30 |    |
|                            | RENAISSANCERE HOLDINGS LTD           | 7,700   | 49.95        | 384,615.00   |    |
|                            | SAFECO CORP                          | 11,100  | 67.21        | 746,031.00   |    |
|                            | TORCHMARK CORP                       | 11,300  | 61.11        | 690,543.00   |    |
|                            | TRAVELERS COS INC/THE                | 76,113  | 47.79        | 3,637,440.27 |    |
|                            | UNUM GROUP                           | 42,600  | 23.06        | 982,356.00   |    |
|                            | WHITE MOUNTAINS INSURANCE GP         | 1,000   | 457.00       | 457,000.00   |    |
|                            | WILLIS GROUP HOLDINGS LTD            | 17,600  | 33.72        | 593,472.00   |    |
|                            | WR BERKLEY CORP                      | 20,250  | 26.63        | 539,257.50   |    |
|                            | XL CAPITAL LTD -CLASS A              | 21,871  | 31.93        | 698,341.03   |    |
|                            | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN         | 64,800  | 17.18        | 1,113,264.00 |    |
|                            | CB RICHARD ELLIS GROUP INC-A         | 22,300  | 20.59        | 459,157.00   |    |
|                            | FOREST CITY ENTERPRISES-CL A         | 7,900   | 39.17        | 309,443.00   |    |
|                            | ACCENTURE LTD-CL A                   | 73,400  | 39.20        | 2,877,280.00 |    |
|                            | ACTIVISION INC                       | 36,100  | 34.58        | 1,248,338.00 |    |
|                            | ADOBE SYSTEMS INC                    | 67,600  | 42.47        | 2,870,972.00 |    |
| AFFILIATED COMPUTER SVCS-A | 11,000                               | 53.66   | 590,260.00   |              |    |
| AKAMAI TECHNOLOGIES        | 20,500                               | 36.71   | 752,555.00   |              |    |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 9,800                                | 57.55   | 563,990.00   |              |    |
| AUTODESK INC               | 28,400                               | 40.77   | 1,157,868.00 |              |    |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING  | 64,100                               | 43.00   | 2,756,300.00 |              |    |
| BMC SOFTWARE INC           | 23,600                               | 39.19   | 924,884.00   |              |    |
| CA INC                     | 50,400                               | 24.93   | 1,256,472.00 |              |    |
| CADENCE DESIGN SYS INC     | 34,900                               | 11.42   | 398,558.00   |              |    |
| CITRIX SYSTEMS INC         | 22,800                               | 34.29   | 781,812.00   |              |    |

| 通貨                           | 銘柄                             | 株式数       | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額     | 備考 |
|------------------------------|--------------------------------|-----------|--------------|---------------|----|
| 米ドル                          | COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A     | 35,600    | 35.37        | 1,259,172.00  |    |
|                              | COMPUTER SCIENCES CORP         | 19,500    | 47.78        | 931,710.00    |    |
|                              | DST SYSTEMS INC                | 5,900     | 63.37        | 373,883.00    |    |
|                              | ELECTRONIC ARTS INC            | 38,910    | 46.93        | 1,826,046.30  |    |
|                              | ELECTRONIC DATA SYSTEMS CORP   | 62,400    | 24.43        | 1,524,432.00  |    |
|                              | FIDELITY NATIONAL INFORMATION  | 23,858    | 38.64        | 921,873.12    |    |
|                              | FISERV INC                     | 20,300    | 49.36        | 1,002,008.00  |    |
|                              | GOOGLE INC-CLASS A             | 29,100    | 557.87       | 16,234,017.00 |    |
|                              | HOLOGIC INC                    | 31,344    | 23.19        | 726,867.36    |    |
|                              | INTUIT INC                     | 38,800    | 29.04        | 1,126,752.00  |    |
|                              | IRON MOUNTAIN INC              | 23,400    | 30.47        | 712,998.00    |    |
|                              | MASTERCARD INC-CLASS A         | 9,100     | 291.40       | 2,651,740.00  |    |
|                              | MCAFEE INC                     | 19,900    | 35.99        | 716,201.00    |    |
|                              | MICROSOFT CORP                 | 1,026,891 | 27.71        | 28,455,149.61 |    |
|                              | NAVTEQ CORP                    | 12,100    | 77.20        | 934,120.00    |    |
|                              | ORACLE CORP                    | 503,776   | 22.55        | 11,360,148.80 |    |
|                              | PAYCHEX INC                    | 40,200    | 33.34        | 1,340,268.00  |    |
|                              | SALESFORCE.COM INC             | 12,300    | 69.70        | 857,310.00    |    |
|                              | SYMANTEC CORP                  | 103,800   | 20.46        | 2,123,748.00  |    |
|                              | SYNOPSYS INC                   | 17,700    | 25.13        | 444,801.00    |    |
|                              | TERADATA CORP                  | 22,200    | 25.24        | 560,328.00    |    |
|                              | TOTAL SYSTEM SERVICES INC      | 20,675    | 24.44        | 505,297.00    |    |
|                              | VERISIGN INC                   | 27,400    | 39.51        | 1,082,574.00  |    |
|                              | VISA INC-CLASS A SHARES        | 49,800    | 82.14        | 4,090,572.00  |    |
|                              | VMWARE INC-CLASS A             | 5,100     | 65.84        | 335,784.00    |    |
|                              | YAHOO! INC                     | 147,600   | 26.58        | 3,923,208.00  |    |
|                              | AGILENT TECHNOLOGIES INC       | 45,500    | 36.92        | 1,679,860.00  |    |
|                              | AMPHENOL CORP-CL A             | 21,800    | 47.35        | 1,032,230.00  |    |
|                              | APPLE INC                      | 107,800   | 181.61       | 19,577,558.00 |    |
|                              | ARROW ELECTRONICS INC          | 15,100    | 32.67        | 493,317.00    |    |
|                              | AVNET INC                      | 18,500    | 30.00        | 555,000.00    |    |
|                              | CISCO SYSTEMS INC              | 730,813   | 26.43        | 19,315,387.59 |    |
|                              | CORNING INC                    | 193,100   | 26.81        | 5,177,011.00  |    |
|                              | DELL INC                       | 261,058   | 24.15        | 6,304,550.70  |    |
|                              | EMC CORP/MASS                  | 257,300   | 16.79        | 4,320,067.00  |    |
|                              | FIRST SOLAR INC                | 4,900     | 244.76       | 1,199,324.00  |    |
|                              | FLEXTRONICS INTL LTD           | 102,300   | 10.93        | 1,118,139.00  |    |
|                              | HARRIS CORP                    | 16,700    | 56.49        | 943,383.00    |    |
|                              | HEWLETT-PACKARD CO             | 313,200   | 47.63        | 14,917,716.00 |    |
|                              | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINE | 169,878   | 125.86       | 21,380,845.08 |    |
|                              | JDS UNIPHASE CORP              | 26,311    | 12.12        | 318,889.32    |    |
|                              | JUNIPER NETWORKS INC           | 64,000    | 26.85        | 1,718,400.00  |    |
|                              | LEXMARK INTERNATIONAL INC      | 11,700    | 35.55        | 415,935.00    |    |
|                              | MOTOROLA INC                   | 276,500   | 8.92         | 2,466,380.00  |    |
| NETAPP INC                   | 42,260                         | 23.99     | 1,013,817.40 |               |    |
| QUALCOMM INC                 | 197,738                        | 47.11     | 9,315,437.18 |               |    |
| SANDISK CORP                 | 27,500                         | 26.52     | 729,300.00   |               |    |
| SEAGATE TECHNOLOGY           | 64,700                         | 21.69     | 1,403,343.00 |               |    |
| SUN MICROSYSTEMS INC         | 97,200                         | 12.15     | 1,180,980.00 |               |    |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 51,500                         | 57.59     | 2,965,885.00 |               |    |
| WATERS CORPORATION           | 12,400                         | 60.43     | 749,332.00   |               |    |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 27,300                         | 38.83     | 1,060,059.00 |               |    |
| XEROX CORP                   | 112,500                        | 13.48     | 1,516,500.00 |               |    |

| 通貨                     | 銘柄                              | 株式数     | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額     | 備考 |
|------------------------|---------------------------------|---------|--------------|---------------|----|
| 米ドル                    | AMERICAN TOWER CORP-CL A        | 49,700  | 42.79        | 2,126,663.00  |    |
|                        | AT&T INC                        | 739,952 | 37.56        | 27,792,597.12 |    |
|                        | CROWN CASTLE INTL CORP          | 32,800  | 40.54        | 1,329,712.00  |    |
|                        | EMBARQ CORP                     | 18,776  | 46.97        | 881,908.72    |    |
|                        | LEVEL 3 COMMUNICATIONS          | 188,400 | 4.15         | 781,860.00    |    |
|                        | METROPCS COMMUNICATIONS INC     | 25,600  | 20.18        | 516,608.00    |    |
|                        | NII HOLDINGS INC                | 20,900  | 50.86        | 1,062,974.00  |    |
|                        | QWEST COMMUNICATIONS INTL       | 195,000 | 4.52         | 881,400.00    |    |
|                        | SPRINT NEXTEL CORP              | 339,538 | 8.82         | 2,994,725.16  |    |
|                        | TELEPHONE AND DATA SYSTEMS      | 6,500   | 49.40        | 321,100.00    |    |
|                        | TIME WARNER CABLE-A             | 22,200  | 29.57        | 656,454.00    |    |
|                        | VERIZON COMMUNICATIONS INC      | 352,748 | 37.94        | 13,383,259.12 |    |
|                        | WINDSTREAM CORP                 | 58,500  | 13.51        | 790,335.00    |    |
|                        | AES CORP                        | 82,100  | 19.87        | 1,631,327.00  |    |
|                        | ALLEGHENY ENERGY INC            | 20,500  | 53.19        | 1,090,395.00  |    |
|                        | ALLIANT ENERGY CORP             | 13,600  | 37.36        | 508,096.00    |    |
|                        | AMEREN CORPORATION              | 25,600  | 43.76        | 1,120,256.00  |    |
|                        | AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY | 49,100  | 42.81        | 2,101,971.00  |    |
|                        | AQUA AMERICA INC                | 16,400  | 17.76        | 291,264.00    |    |
|                        | CENTERPOINT ENERGY INC          | 38,200  | 16.91        | 645,962.00    |    |
|                        | CONSOLIDATED EDISON INC         | 33,400  | 40.52        | 1,353,368.00  |    |
|                        | CONSTELLATION ENERGY GROUP      | 21,900  | 88.25        | 1,932,675.00  |    |
|                        | DOMINION RESOURCES INC          | 70,500  | 46.80        | 3,299,400.00  |    |
|                        | DTE ENERGY COMPANY              | 19,900  | 44.36        | 882,764.00    |    |
|                        | DUKE ENERGY CORP                | 154,656 | 18.10        | 2,799,273.60  |    |
|                        | EDISON INTERNATIONAL            | 38,000  | 51.85        | 1,970,300.00  |    |
|                        | ENERGEN CORP                    | 8,300   | 75.07        | 623,081.00    |    |
|                        | ENERGY EAST CORPORATION         | 19,500  | 26.40        | 514,800.00    |    |
|                        | ENTERGY CORP                    | 23,700  | 120.26       | 2,850,162.00  |    |
|                        | EQUITABLE RESOURCES INC         | 15,000  | 73.21        | 1,098,150.00  |    |
|                        | EXELON CORP                     | 81,100  | 88.59        | 7,184,649.00  |    |
|                        | FIRSTENERGY CORP                | 37,400  | 77.90        | 2,913,460.00  |    |
|                        | FPL GROUP INC                   | 47,494  | 64.20        | 3,049,114.80  |    |
|                        | MDU RESOURCES GROUP INC         | 21,200  | 34.29        | 726,948.00    |    |
|                        | MIRANT CORP                     | 26,300  | 40.73        | 1,071,199.00  |    |
|                        | NISOURCE INC                    | 33,700  | 17.43        | 587,391.00    |    |
|                        | NRG ENERGY INC                  | 27,500  | 43.26        | 1,189,650.00  |    |
|                        | ONEOK INC                       | 12,100  | 50.19        | 607,299.00    |    |
|                        | P G & E CORP                    | 44,400  | 39.26        | 1,743,144.00  |    |
|                        | PEPCO HOLDINGS INC              | 23,800  | 26.33        | 626,654.00    |    |
|                        | PINNACLE WEST CAPITAL           | 12,400  | 32.81        | 406,844.00    |    |
|                        | PPL CORPORATION                 | 45,700  | 51.14        | 2,337,098.00  |    |
|                        | PROGRESS ENERGY INC             | 30,200  | 42.89        | 1,295,278.00  |    |
|                        | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP    | 62,400  | 45.54        | 2,841,696.00  |    |
|                        | QUESTAR CORP                    | 21,200  | 68.21        | 1,446,052.00  |    |
|                        | RELIANT ENERGY INC              | 42,400  | 24.94        | 1,057,456.00  |    |
|                        | SCANA CORP                      | 13,600  | 39.73        | 540,328.00    |    |
| SEMPRA ENERGY          | 30,500                          | 56.48   | 1,722,640.00 |               |    |
| SOUTHERN COMPANY       | 93,832                          | 35.25   | 3,307,578.00 |               |    |
| SPECTRA ENERGY CORP    | 77,578                          | 27.25   | 2,114,000.50 |               |    |
| WISCONSIN ENERGY CORP  | 14,400                          | 47.76   | 687,744.00   |               |    |
| XCEL ENERGY INC        | 52,700                          | 20.99   | 1,106,173.00 |               |    |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 74,292                          | 7.68    | 570,562.56   |               |    |



| 通貨                          | 銘柄                             | 株式数        | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額                               | 備考 |
|-----------------------------|--------------------------------|------------|--------------|---|----|
| 米ドル                         | ALTERA CORPORATION             | 37,700     | 22.82        | 860,314.00                              |    |
|                             | ANALOG DEVICES                 | 36,100     | 34.66        | 1,251,226.00                            |    |
|                             | APPLIED MATERIALS INC          | 166,300    | 18.93        | 3,148,059.00                            |    |
|                             | BROADCOM CORP-CL A             | 57,535     | 27.70        | 1,593,719.50                            |    |
|                             | INTEL CORP                     | 709,565    | 22.76        | 16,149,699.40                           |    |
|                             | INTERSIL CORP -CL A            | 15,600     | 26.82        | 418,392.00                              |    |
|                             | KLA-TENCOR CORPORATION         | 22,161     | 42.18        | 934,750.98                              |    |
|                             | LAM RESEARCH CORP              | 15,300     | 38.20        | 584,460.00                              |    |
|                             | LINEAR TECHNOLOGY CORP         | 27,125     | 35.38        | 959,682.50                              |    |
|                             | LSI CORP                       | 86,600     | 7.27         | 629,582.00                              |    |
|                             | MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD   | 61,800     | 16.98        | 1,049,364.00                            |    |
|                             | MEMC ELECTRONIC MATERIALS      | 28,137     | 63.24        | 1,779,383.88                            |    |
|                             | MICROCHIP TECHNOLOGY INC       | 23,200     | 35.21        | 816,872.00                              |    |
|                             | MICRON TECHNOLOGY INC          | 93,300     | 8.02         | 748,266.00                              |    |
|                             | NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP    | 31,300     | 23.48        | 734,924.00                              |    |
|                             | NVIDIA CORP                    | 64,700     | 23.69        | 1,532,743.00                            |    |
|                             | TEXAS INSTRUMENTS INCORPORATED | 162,627    | 31.33        | 5,095,103.91                            |    |
|                             | XILINX INC                     | 35,100     | 27.19        | 954,369.00                              |    |
| 米ドル 小計                      |                                | 38,227,151 |              | 1,544,441,591.72<br>( 164,915,473,163 ) |    |
| カナダドル                       | ADDAX PETROLEUM CORP           | 10,500     | 52.45        | 550,725.00                              |    |
|                             | CANADIAN NATURAL RESOURCES     | 66,320     | 105.51       | 6,997,423.20                            |    |
|                             | ENBRIDGE INC                   | 42,920     | 45.51        | 1,953,289.20                            |    |
|                             | ENCANA CORP                    | 92,040     | 95.75        | 8,812,830.00                            |    |
|                             | ENSIGN ENERGY SERVICES INC     | 16,000     | 22.28        | 356,480.00                              |    |
|                             | HUSKY ENERGY INC               | 31,300     | 51.22        | 1,603,186.00                            |    |
|                             | IMPERIAL OIL LTD               | 38,700     | 60.83        | 2,354,121.00                            |    |
|                             | NEXEN INC                      | 58,400     | 41.22        | 2,407,248.00                            |    |
|                             | NIKO RESOURCES LTD             | 5,600      | 94.91        | 531,496.00                              |    |
|                             | OPTI CANADA INC                | 24,000     | 22.44        | 538,560.00                              |    |
|                             | PETRO CANADA                   | 59,300     | 59.01        | 3,499,293.00                            |    |
|                             | SUNCOR ENERGY INC              | 113,540    | 70.00        | 7,947,800.00                            |    |
|                             | TALISMAN ENERGY INC            | 124,900    | 24.21        | 3,023,829.00                            |    |
|                             | TRANSCANADA CORP               | 70,150     | 39.71        | 2,785,656.50                            |    |
|                             | TRICAN WELL SERVICE LTD        | 15,100     | 24.11        | 364,061.00                              |    |
|                             | URANIUM ONE INC                | 57,300     | 4.60         | 263,580.00                              |    |
|                             | AGNICO-EAGLE MINES             | 17,600     | 72.12        | 1,269,312.00                            |    |
|                             | AGRIUM INC                     | 19,300     | 96.65        | 1,865,345.00                            |    |
|                             | BARRICK GOLD CORP              | 106,800    | 42.92        | 4,583,856.00                            |    |
|                             | CAMECO CORP                    | 42,300     | 41.27        | 1,745,721.00                            |    |
|                             | ELDORADO GOLD CORPORATION      | 42,300     | 8.78         | 371,394.00                              |    |
|                             | FIRST QUANTUM MINERALS LTD     | 8,400      | 78.25        | 657,300.00                              |    |
|                             | GERDAU AMERISTEEL CORP         | 18,900     | 18.39        | 347,571.00                              |    |
|                             | GOLDCORP INC                   | 86,940     | 42.53        | 3,697,558.20                            |    |
|                             | INMET MINING CORPORATION       | 5,500      | 69.95        | 384,725.00                              |    |
|                             | IVANHOE MINES LTD              | 29,900     | 10.86        | 324,714.00                              |    |
|                             | KINROSS GOLD CORP              | 75,223     | 20.62        | 1,551,098.26                            |    |
|                             | LUNDIN MINING CORP             | 40,800     | 7.48         | 305,184.00                              |    |
|                             | METHANEX CORP                  | 12,000     | 30.08        | 360,960.00                              |    |
|                             | NOVA CHEMICALS CORP            | 10,200     | 27.64        | 281,928.00                              |    |
| PAN AMERICAN SILVER CORP    | 9,000                          | 32.72      | 294,480.00   |   |    |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN | 38,800                         | 226.74     | 8,797,512.00 |   |    |
| SHERRITT INTERNATIONAL CORP | 35,400                         | 14.75      | 522,150.00   |   |    |

| 通貨                          | 銘柄                               | 株式数     | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額    | 備考 |
|-----------------------------|----------------------------------|---------|--------------|--------------|----|
| カナダドル                       | SILVER WHEATON CORP              | 27,300  | 14.75        | 402,675.00   |    |
|                             | SINO-FOREST CORPORATION          | 19,100  | 19.18        | 366,338.00   |    |
|                             | TECK COMINCO LTD-CL B            | 53,200  | 48.69        | 2,590,308.00 |    |
|                             | YAMANA GOLD INC                  | 77,800  | 15.34        | 1,193,452.00 |    |
|                             | BOMBARDIER INC CL B              | 175,940 | 8.17         | 1,437,429.80 |    |
|                             | CAE INC                          | 31,200  | 12.75        | 397,800.00   |    |
|                             | FINNING INTERNATIONAL INC        | 21,600  | 27.02        | 583,632.00   |    |
|                             | SNC-LAVALIN GROUP INC            | 18,500  | 55.89        | 1,033,965.00 |    |
|                             | RITCHIE BROS. AUCTIONEERS        | 12,200  | 26.15        | 319,030.00   |    |
|                             | CANADIAN NATL RAILWAY CO         | 59,500  | 53.18        | 3,164,210.00 |    |
|                             | CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD     | 18,810  | 67.75        | 1,274,377.50 |    |
|                             | MAGNA INTERNATIONAL -CL A        | 10,700  | 69.99        | 748,893.00   |    |
|                             | GILDAN ACTIVEWEAR INC            | 14,100  | 29.11        | 410,451.00   |    |
|                             | ASTRAL MEDIA INC                 | 6,500   | 33.14        | 215,410.00   |    |
|                             | ROGERS COMMUNICATIONS-CL B       | 61,400  | 40.85        | 2,508,190.00 |    |
|                             | SHAW COMMUNICATIONS INC-B        | 42,640  | 20.70        | 882,648.00   |    |
|                             | THOMSON REUTERS CORP             | 27,500  | 35.55        | 977,625.00   |    |
|                             | CANADIAN TIRE CORP -CL A         | 9,600   | 59.51        | 571,296.00   |    |
|                             | ALIMENTATION COUCHE-TARD -B      | 16,900  | 13.43        | 226,967.00   |    |
|                             | LOBLAW COMPANIES LTD             | 13,500  | 33.22        | 448,470.00   |    |
|                             | METRO INC -A                     | 12,400  | 27.65        | 342,860.00   |    |
|                             | SHOPPERS DRUG MART CORP          | 25,300  | 55.91        | 1,414,523.00 |    |
|                             | WESTON (GEORGE) LTD              | 6,400   | 49.80        | 318,720.00   |    |
|                             | SAPUTO INC                       | 17,700  | 28.37        | 502,149.00   |    |
|                             | MDS INC                          | 15,000  | 17.08        | 256,200.00   |    |
|                             | BIOVAIL CORP                     | 17,800  | 11.77        | 209,506.00   |    |
|                             | BANK OF MONTREAL                 | 61,300  | 47.85        | 2,933,205.00 |    |
|                             | BANK OF NOVA SCOTIA              | 120,800 | 51.20        | 6,184,960.00 |    |
|                             | CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE      | 46,700  | 65.59        | 3,063,053.00 |    |
|                             | NATIONAL BANK OF CANADA          | 19,400  | 53.44        | 1,036,736.00 |    |
|                             | ROYAL BANK OF CANADA             | 158,600 | 49.40        | 7,834,840.00 |    |
|                             | TORONTO-DOMINION BANK            | 98,150  | 68.79        | 6,751,738.50 |    |
|                             | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT-CL A | 60,825  | 35.44        | 2,155,638.00 |    |
|                             | IGM FINANCIAL INC                | 14,600  | 45.18        | 659,628.00   |    |
|                             | POWER CO OF CANADA               | 42,400  | 33.90        | 1,437,360.00 |    |
|                             | POWER FINANCIAL CORP             | 30,300  | 36.06        | 1,092,618.00 |    |
|                             | TSX GROUP INC                    | 10,000  | 42.37        | 423,700.00   |    |
|                             | FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD      | 2,200   | 260.70       | 573,540.00   |    |
|                             | GREAT-WEST LIFE CO INC           | 32,900  | 31.50        | 1,036,350.00 |    |
|                             | ING CANADA INC                   | 3,800   | 38.49        | 146,262.00   |    |
|                             | MANULIFE FINANCIAL CORP          | 183,900 | 37.96        | 6,980,844.00 |    |
|                             | SUN LIFE FINANCIAL INC           | 69,200  | 45.25        | 3,131,300.00 |    |
|                             | BROOKFIELD PROPERTIES CORP       | 26,525  | 19.90        | 527,847.50   |    |
|                             | CGI GROUP INC                    | 35,500  | 10.63        | 377,365.00   |    |
|                             | NORTEL NETWORKS CORP             | 53,633  | 7.91         | 424,237.03   |    |
|                             | ONEX CORPORATION                 | 12,200  | 32.72        | 399,184.00   |    |
|                             | RESEARCH IN MOTION               | 62,000  | 136.72       | 8,476,640.00 |    |
| BCE INC                     | 32,592                           | 34.45   | 1,122,794.40 |              |    |
| TELUS CORP                  | 7,300                            | 45.75   | 333,975.00   |              |    |
| TELUS CORPORATION -NON VOTE | 18,300                           | 43.82   | 801,906.00   |              |    |
| CANADIAN UTILITIES LTD A    | 6,000                            | 47.00   | 282,000.00   |              |    |
| FORTIS INC                  | 19,200                           | 27.50   | 528,000.00   |              |    |

| 通貨    | 銘柄                          | 株式数       | 評価額<br>単価 | 評価額<br>金額                          | 備考 |
|-------|-----------------------------|-----------|-----------|------------------------------------|----|
| カナダドル | TRANSALTA CORP              | 24,700    | 36.10     | 891,670.00                         |    |
|       | カナダドル 小計                    | 3,491,048 |           | 153,754,903.09<br>(16,044,324,137) |    |
| ユーロ   | CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE | 15,985    | 32.65     | 521,910.25                         |    |
|       | ENI SPA                     | 319,146   | 25.58     | 8,163,754.68                       |    |
|       | FUGRO NV-CVA                | 7,116     | 56.16     | 399,634.56                         |    |
|       | HELLENIC PETROLEUM SA       | 14,986    | 10.14     | 151,958.04                         |    |
|       | NESTE OIL OYJ               | 15,716    | 20.12     | 316,205.92                         |    |
|       | OMV AG                      | 20,227    | 53.60     | 1,084,167.20                       |    |
|       | REPSOL YPF SA               | 89,795    | 26.65     | 2,393,036.75                       |    |
|       | SAIPEM                      | 32,454    | 29.32     | 951,551.28                         |    |
|       | SBM OFFSHORE NV             | 17,570    | 25.11     | 441,182.70                         |    |
|       | TECHNIP S.A.                | 12,487    | 60.97     | 761,332.39                         |    |
|       | TOTAL SA                    | 264,289   | 54.72     | 14,461,894.08                      |    |
|       | ACERINOX SA                 | 17,496    | 16.05     | 280,810.80                         |    |
|       | AIR LIQUIDE                 | 30,607    | 85.46     | 2,615,674.22                       |    |
|       | AKZO NOBEL                  | 33,324    | 50.87     | 1,695,191.88                       |    |
|       | ARCELORMITTAL               | 106,562   | 66.22     | 7,056,535.64                       |    |
|       | BASF SE                     | 59,415    | 95.89     | 5,697,304.35                       |    |
|       | BAYER AG                    | 93,697    | 55.40     | 5,190,813.80                       |    |
|       | CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL | 32,951    | 5.37      | 176,946.87                         |    |
|       | CRH PLC                     | 66,373    | 21.35     | 1,417,063.55                       |    |
|       | ERAMET                      | 635       | 609.44    | 386,994.40                         |    |
|       | HEIDELBERGCEMENT AG         | 3,065     | 98.74     | 302,638.10                         |    |
|       | IMERYS SA                   | 3,483     | 55.95     | 194,873.85                         |    |
|       | ITALCEMENTI SPA             | 8,908     | 12.19     | 108,633.06                         |    |
|       | ITALCEMENTI SPA -RNC        | 12,924    | 8.96      | 115,902.43                         |    |
|       | K+S AG                      | 4,551     | 328.50    | 1,495,003.50                       |    |
|       | KONINKLIJKE DSM NV          | 16,680    | 38.66     | 644,848.80                         |    |
|       | LAFARGE SA                  | 17,981    | 110.31    | 1,983,484.11                       |    |
|       | LINDE AG                    | 16,313    | 95.63     | 1,560,012.19                       |    |
|       | OUTOKUMPU OYJ               | 14,448    | 26.90     | 388,651.20                         |    |
|       | RAUTARUUKKI OYJ             | 10,313    | 33.80     | 348,579.40                         |    |
|       | SALZGITTER AG               | 5,038     | 127.52    | 642,445.76                         |    |
|       | SMURFIT KAPPA GROUP PLC     | 15,074    | 5.98      | 90,142.52                          |    |
|       | SOLVAY SA                   | 7,269     | 96.57     | 701,967.33                         |    |
|       | STORA ENSO OYJ-R SHS        | 71,280    | 7.43      | 529,610.40                         |    |
|       | THYSSENKRUPP AG             | 44,148    | 43.43     | 1,917,347.64                       |    |
|       | UMICORE                     | 15,255    | 35.33     | 538,959.15                         |    |
|       | UPM-KYMMENE OYJ             | 62,833    | 12.12     | 761,535.96                         |    |
|       | VOESTALPINE AG              | 14,111    | 53.61     | 756,490.71                         |    |
|       | WACKER CHEMIE AG            | 1,918     | 148.00    | 283,864.00                         |    |
|       | ZARDOYA OTIS SA             | 14,128    | 17.56     | 248,087.68                         |    |
|       | ACCIONA S.A.                | 3,506     | 168.55    | 590,936.30                         |    |
|       | ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 23,792    | 35.74     | 850,326.08                         |    |
|       | ADP                         | 3,640     | 66.00     | 240,240.00                         |    |
|       | ALSTOM-NEW                  | 12,967    | 160.18    | 2,077,054.06                       |    |
|       | ANDRITZ AG                  | 4,781     | 41.86     | 200,132.66                         |    |
|       | BILFINGER BERGER AG         | 4,560     | 61.69     | 281,306.40                         |    |
|       | CARGOTEC CORP-B SHS         | 4,359     | 24.68     | 107,580.12                         |    |
|       | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN   | 34,405    | 47.62     | 1,638,366.10                       |    |
|       | EIFFAGE                     | 4,569     | 50.30     | 229,820.70                         |    |
|       | EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE | 39,915    | 13.86     | 553,221.90                         |    |

| 通貨                               | 銘柄                           | 株式数     | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額    | 備考 |
|----------------------------------|------------------------------|---------|--------------|--------------|----|
| ユーロ                              | FINMECCANICA SPA             | 36,485  | 18.70        | 682,342.47   |    |
|                                  | FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA | 5,602   | 39.95        | 223,799.90   |    |
|                                  | GAMESA CORP TECNOLOGICA SA   | 22,368  | 33.00        | 738,144.00   |    |
|                                  | GEA GROUP AG                 | 18,450  | 23.19        | 427,855.50   |    |
|                                  | GRUPO FERROVIAL              | 7,738   | 46.18        | 357,340.84   |    |
|                                  | HOCHTIEF AG                  | 5,149   | 68.51        | 352,757.99   |    |
|                                  | KONE OYJ-B                   | 18,737  | 25.48        | 477,418.76   |    |
|                                  | LEGRAND SA                   | 11,626  | 18.60        | 216,243.60   |    |
|                                  | MAN AG                       | 12,961  | 86.70        | 1,123,718.70 |    |
|                                  | METSO OYJ                    | 15,640  | 30.64        | 479,209.60   |    |
|                                  | PIRELLI & CO SPA             | 320,750 | 0.52         | 167,399.42   |    |
|                                  | PRYSMIAN SPA                 | 13,240  | 17.97        | 237,936.04   |    |
|                                  | Q-CELLS AG                   | 7,418   | 73.00        | 541,514.00   |    |
|                                  | RHEINMETALL AG               | 4,414   | 49.94        | 220,435.16   |    |
|                                  | SCHNEIDER ELECTRIC SA        | 27,048  | 78.60        | 2,125,972.80 |    |
|                                  | SIEMENS AG-REG               | 106,464 | 70.44        | 7,499,324.16 |    |
|                                  | SOLARWORLD AG                | 10,272  | 31.72        | 325,827.84   |    |
|                                  | SONAE SGPS SA                | 110,326 | 0.95         | 104,809.70   |    |
|                                  | STRABAG SE-BR                | 6,289   | 47.50        | 298,727.50   |    |
|                                  | THALES SA                    | 10,941  | 39.17        | 428,558.97   |    |
|                                  | TITAN CEMENT CO. S.A.        | 7,076   | 28.00        | 198,128.00   |    |
|                                  | VALLOUREC                    | 6,501   | 206.53       | 1,342,651.53 |    |
|                                  | VINCI S.A.                   | 50,743  | 44.60        | 2,263,137.80 |    |
|                                  | WARTSILA OYJ                 | 10,273  | 42.85        | 440,198.05   |    |
|                                  | WENDEL                       | 3,393   | 83.77        | 284,231.61   |    |
|                                  | WIENERBERGER AG              | 10,367  | 31.18        | 323,243.06   |    |
|                                  | YIT OYJ                      | 15,595  | 18.54        | 289,131.30   |    |
|                                  | ZODIAC SA                    | 5,110   | 33.27        | 170,009.70   |    |
|                                  | BIC                          | 3,437   | 32.35        | 111,186.95   |    |
|                                  | BUREAU VERITAS SA            | 4,975   | 38.05        | 189,298.75   |    |
|                                  | RANDSTAD HOLDING NV          | 9,080   | 26.76        | 242,980.80   |    |
|                                  | ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA   | 32,869  | 18.47        | 607,090.43   |    |
|                                  | AIR FRANCE - KLM             | 16,561  | 16.09        | 266,466.49   |    |
|                                  | ATLANTIA SPA                 | 31,575  | 22.41        | 707,595.75   |    |
|                                  | BRISA                        | 36,776  | 9.10         | 334,661.60   |    |
|                                  | CINTRA CONCESIONES DE INFRAE | 26,550  | 9.32         | 247,446.00   |    |
|                                  | DEUTSCHE POST AG-REG         | 103,657 | 19.31        | 2,001,616.67 |    |
|                                  | FRAPORT AG                   | 4,490   | 41.49        | 186,290.10   |    |
|                                  | HAMBURGER HAFEN UND LOGISTIK | 3,116   | 55.02        | 171,442.32   |    |
|                                  | IBERIA LINEAS AER DE ESPANA  | 58,402  | 1.87         | 109,211.74   |    |
|                                  | LUFTHANSA (REGD)             | 28,068  | 15.59        | 437,580.12   |    |
|                                  | TNT NV                       | 46,487  | 24.93        | 1,158,920.91 |    |
|                                  | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG  | 40,587  | 34.28        | 1,391,322.36 |    |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD     | 6,398                        | 28.10   | 179,783.80   |              |    |
| CONTINENTAL AG                   | 18,833                       | 67.70   | 1,274,994.10 |              |    |
| DAIMLER AG                       | 111,858                      | 44.23   | 4,947,479.34 |              |    |
| FIAT SPA                         | 87,030                       | 12.77   | 1,112,156.37 |              |    |
| MICHELIN CLASS B (BROWN BDS)     | 17,652                       | 51.39   | 907,136.28   |              |    |
| NOKIAN RENKAAT OYJ               | 12,987                       | 31.31   | 406,622.97   |              |    |
| PEUGEOT SA                       | 18,668                       | 37.44   | 698,929.92   |              |    |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-PDF | 10,727                       | 109.68  | 1,176,537.36 |              |    |
| RENAULT SA                       | 22,704                       | 60.16   | 1,365,872.64 |              |    |
| VALEO SA                         | 9,143                        | 22.59   | 206,540.37   |              |    |

| 通貨                          | 銘柄                             | 株式数     | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額    | 備考 |
|-----------------------------|--------------------------------|---------|--------------|--------------|----|
| ユーロ                         | VOLKSWAGEN AG                  | 17,857  | 175.19       | 3,128,367.83 |    |
|                             | VOLKSWAGEN AG (PREF)           | 12,901  | 94.14        | 1,214,500.14 |    |
|                             | ADIDAS-SALOMON AG              | 24,964  | 44.57        | 1,112,645.48 |    |
|                             | BULGARI SPA                    | 18,858  | 6.96         | 131,327.11   |    |
|                             | CHRISTIAN DIOR                 | 6,683   | 73.31        | 489,930.73   |    |
|                             | HERMES INTERNATIONAL           | 8,454   | 97.17        | 821,475.18   |    |
|                             | LUXOTTICA GROUP SPA            | 17,018  | 16.87        | 287,246.82   |    |
|                             | LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA   | 30,030  | 72.12        | 2,165,763.60 |    |
|                             | PHILIPS ELECTRONICS NV         | 133,088 | 23.76        | 3,162,170.88 |    |
|                             | PUMA AG                        | 786     | 241.00       | 189,426.00   |    |
|                             | TOMTOM                         | 7,466   | 21.36        | 159,473.76   |    |
|                             | ACCOR SA                       | 23,957  | 46.85        | 1,122,385.45 |    |
|                             | AUTOGRILL SPA                  | 12,475  | 8.92         | 111,351.85   |    |
|                             | GREEK ORG OF FOOTBALL PROGNO   | 27,373  | 24.64        | 674,470.72   |    |
|                             | LOTTOMATICA SPA                | 7,450   | 18.42        | 137,296.05   |    |
|                             | SODEXO                         | 11,697  | 44.88        | 524,961.36   |    |
|                             | TUI AG                         | 26,179  | 16.00        | 418,864.00   |    |
|                             | EUTELSAT COMMUNICATIONS        | 10,719  | 19.13        | 205,054.47   |    |
|                             | GESTEVISION TELECINCO SA       | 12,094  | 9.16         | 110,781.04   |    |
|                             | JC DECAUX SA                   | 8,150   | 17.32        | 141,158.00   |    |
|                             | LAGARDERE S.C.A.               | 14,799  | 45.20        | 668,914.80   |    |
|                             | M6-METROPOLE TELEVISION        | 7,964   | 15.22        | 121,212.08   |    |
|                             | MEDIASET SPA                   | 94,120  | 4.89         | 461,093.88   |    |
|                             | PAGESJAUNES GROUPE SA          | 15,482  | 11.01        | 170,456.82   |    |
|                             | PROMOTORA DE INFOM SA -PRISA   | 10,729  | 9.56         | 102,569.24   |    |
|                             | PROSIEBEN SAT1 MEDIA AG-PFD    | 10,317  | 9.06         | 93,472.02    |    |
|                             | PUBLICIS GROUPE                | 16,127  | 24.56        | 396,079.12   |    |
|                             | REED ELSEVIER NV               | 76,583  | 11.43        | 875,343.69   |    |
|                             | SANOMAWSOY OYJ                 | 9,965   | 15.50        | 154,457.50   |    |
|                             | SES                            | 37,050  | 16.47        | 610,213.50   |    |
|                             | TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)   | 14,389  | 12.05        | 173,387.45   |    |
|                             | VIVENDI SA                     | 142,779 | 26.17        | 3,736,526.43 |    |
|                             | WOLTERS KLUWER                 | 36,375  | 16.97        | 617,283.75   |    |
|                             | ZON MULTIMEDIA SERVICOS DE TEL | 21,157  | 6.67         | 141,117.19   |    |
|                             | ARCANDOR AG                    | 11,288  | 10.56        | 119,201.28   |    |
|                             | INDITEX                        | 26,744  | 31.30        | 837,087.20   |    |
|                             | PPR                            | 9,421   | 84.07        | 792,023.47   |    |
|                             | CARREFOUR SA                   | 77,885  | 43.94        | 3,422,266.90 |    |
|                             | CASINO GUICHARD PERRACHON      | 5,351   | 80.95        | 433,163.45   |    |
|                             | COLRUYT SA                     | 2,045   | 164.60       | 336,607.00   |    |
|                             | DELHAIZE GROUP                 | 12,268  | 49.16        | 603,094.88   |    |
|                             | KESKO OYJ-B SHS                | 8,095   | 24.55        | 198,732.25   |    |
|                             | KONINKLIJKE AHOLD NV           | 146,107 | 9.53         | 1,392,399.71 |    |
|                             | METRO AG                       | 13,906  | 46.16        | 641,900.96   |    |
| COCA-COLA HELLENIC BOTTLING | 20,065                         | 28.00   | 561,820.00   |              |    |
| GROUPE DANONE               | 53,438                         | 54.28   | 2,900,614.64 |              |    |
| HEINEKEN HOLDING NV         | 13,516                         | 31.11   | 420,482.76   |              |    |
| HEINEKEN NV                 | 30,032                         | 35.26   | 1,058,928.32 |              |    |
| INBEV                       | 22,609                         | 47.25   | 1,068,275.25 |              |    |
| KERRY GROUP PLC-A           | 17,028                         | 19.32   | 328,980.96   |              |    |
| PARMALAT SPA                | 204,018                        | 1.69    | 346,014.52   |              |    |
| PERNOD-RICARD               | 20,155                         | 70.85   | 1,427,981.75 |              |    |
| UNILEVER NV-CVA             | 199,689                        | 20.20   | 4,033,717.80 |              |    |

| 通貨                             | 銘柄                               | 株式数     | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額    | 備考 |
|--------------------------------|----------------------------------|---------|--------------|--------------|----|
| ユーロ                            | BEIERSDORF AG                    | 10,812  | 50.01        | 540,708.12   |    |
|                                | HENKEL AG & CO KGAA              | 15,923  | 28.12        | 447,754.76   |    |
|                                | HENKEL AG & CO KGAA VORZUG       | 21,840  | 29.76        | 649,958.40   |    |
|                                | L'OREAL                          | 29,950  | 74.09        | 2,218,995.50 |    |
|                                | CELESIO AG                       | 10,426  | 26.61        | 277,435.86   |    |
|                                | ESSILOR INTERNATIONAL            | 24,605  | 39.95        | 982,969.75   |    |
|                                | FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co   | 23,329  | 35.70        | 832,845.30   |    |
|                                | FRESENIUS SE                     | 3,320   | 59.30        | 196,876.00   |    |
|                                | FRESENIUS SE-PFD                 | 9,510   | 56.45        | 536,839.50   |    |
|                                | ELAN CORP PLC                    | 57,639  | 15.80        | 910,696.20   |    |
|                                | GRIFOLS SA                       | 15,671  | 18.95        | 296,965.45   |    |
|                                | MERCK KGAA                       | 7,921   | 87.52        | 693,245.92   |    |
|                                | ORION OYJ                        | 10,886  | 13.13        | 142,933.18   |    |
|                                | SANOFI AVENTIS SA                | 125,580 | 43.75        | 5,494,125.00 |    |
|                                | UCB SA                           | 12,363  | 25.05        | 309,693.15   |    |
|                                | ALLIED IRISH BANK PLC            | 107,955 | 11.65        | 1,257,675.75 |    |
|                                | ALPHA BANK A.E.                  | 46,531  | 21.64        | 1,006,930.84 |    |
|                                | ANGLO IRISH BANK CORP PLC        | 93,071  | 7.13         | 663,596.23   |    |
|                                | BANCA CARIGE SPA                 | 86,152  | 2.51         | 216,413.82   |    |
|                                | BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA     | 240,670 | 1.84         | 443,314.14   |    |
|                                | BANCA POPOLARE DI MILANO         | 48,333  | 6.54         | 316,194.48   |    |
|                                | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA     | 436,469 | 13.33        | 5,818,131.77 |    |
|                                | BANCO BPI SA.-RTS                | 28,669  | 0.12         | 3,440.28     |    |
|                                | BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REG    | 287,741 | 1.52         | 438,805.02   |    |
|                                | BANCO DE SABADELL SA             | 112,533 | 5.92         | 666,195.36   |    |
|                                | BANCO ESPIRITO SANTO-REG         | 27,582  | 11.00        | 303,539.91   |    |
|                                | BANCO POPOLARE SPA               | 78,513  | 11.62        | 912,556.59   |    |
|                                | BANCO POPULAR ESPANOL            | 96,846  | 9.50         | 920,037.00   |    |
|                                | BANCO SANTANDER SA               | 766,677 | 12.27        | 9,407,126.79 |    |
|                                | BANK OF IRELAND                  | 122,584 | 6.75         | 827,442.00   |    |
|                                | BANK OF PIRAEUS                  | 39,502  | 20.70        | 817,691.40   |    |
|                                | BANKINTER SA                     | 32,341  | 8.66         | 280,073.06   |    |
|                                | BNP PARIBAS                      | 99,922  | 60.04        | 5,999,316.88 |    |
|                                | BPI-SGPS SA (REGD)               | 33,223  | 3.13         | 103,987.99   |    |
|                                | COMMERZBANK AG                   | 76,531  | 19.40        | 1,484,701.40 |    |
|                                | CREDIT AGRICOLE SA               | 81,875  | 14.01        | 1,147,068.75 |    |
|                                | CREDIT AGRICOLE SA-RTS           | 81,875  | 1.15         | 94,156.25    |    |
|                                | DEUTSCHE POSTBANK AG             | 10,052  | 61.16        | 614,780.32   |    |
|                                | DEXIA                            | 65,014  | 13.71        | 891,341.94   |    |
|                                | EFG EUROBANK ERGASIAS            | 38,610  | 17.48        | 674,902.80   |    |
|                                | ERSTE BANK DER OESTER SPARKASSEN | 23,262  | 44.58        | 1,037,019.96 |    |
|                                | HYPO REAL ESTATE HOLDING         | 24,653  | 21.04        | 518,699.12   |    |
|                                | INTESA SANPAOLO                  | 944,150 | 3.91         | 3,694,458.95 |    |
|                                | INTESA SANPAOLO-RNC              | 108,593 | 3.56         | 387,351.23   |    |
| KBC GROUP                      | 19,583                           | 75.28   | 1,474,208.24 |              |    |
| NATIONAL BANK OF GREECE        | 60,837                           | 32.90   | 2,001,537.30 |              |    |
| NATIXIS                        | 52,431                           | 8.90    | 466,635.90   |              |    |
| POHJOLA BANK PLC               | 13,692                           | 12.39   | 169,643.88   |              |    |
| RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING   | 6,636                            | 88.43   | 586,821.48   |              |    |
| SOCIETE GENERALE               | 57,157                           | 59.29   | 3,388,838.53 |              |    |
| UNICREDIT SPA                  | 1,390,381                        | 4.12    | 5,736,712.00 |              |    |
| UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA | 74,431                           | 15.67   | 1,166,854.78 |              |    |
| CNP -CIE NATL A PORTEFEUILLE   | 4,856                            | 50.72   | 246,296.32   |              |    |

| 通貨                           | 銘柄                                | 株式数     | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額    | 備考 |
|------------------------------|-----------------------------------|---------|--------------|--------------|----|
| ユーロ                          | CRITERIA CAIXACORP SA             | 103,059 | 4.23         | 435,939.57   |    |
|                              | DEUTSCHE BANK AG-REG              | 61,768  | 62.30        | 3,848,146.40 |    |
|                              | DEUTSCHE BOERSE AG                | 24,517  | 84.00        | 2,059,428.00 |    |
|                              | EURAZEO                           | 3,053   | 71.45        | 218,136.85   |    |
|                              | FORTIS                            | 256,387 | 14.37        | 3,684,281.19 |    |
|                              | IFI-ISTITUTO FINANZIARIO IND      | 8,002   | 16.41        | 131,336.82   |    |
|                              | IFIL-INVESTMENTS SPA              | 38,195  | 4.92         | 188,186.76   |    |
|                              | ING GROEP NV-CVA                  | 233,865 | 22.88        | 5,352,000.52 |    |
|                              | KBC ANCORA                        | 3,839   | 60.43        | 231,990.77   |    |
|                              | MARFIN INVESTMENT GROUP SA        | 81,395  | 5.86         | 476,974.70   |    |
|                              | MEDIOBANCA SPA                    | 60,245  | 11.18        | 673,780.08   |    |
|                              | MEDIOLANUM SPA                    | 26,828  | 3.25         | 87,191.00    |    |
|                              | SNS REAAL                         | 16,026  | 13.51        | 216,511.26   |    |
|                              | AEGON NV                          | 170,522 | 9.09         | 1,551,579.67 |    |
|                              | ALLEANZA ASSICURAZIONI            | 51,891  | 7.72         | 401,065.53   |    |
|                              | ALLIANZ SE-REG                    | 55,182  | 114.12       | 6,297,369.84 |    |
|                              | ASSICURAZIONI GENERALI SPA        | 129,602 | 26.06        | 3,377,428.12 |    |
|                              | AXA                               | 189,462 | 20.81        | 3,943,651.53 |    |
|                              | CNP ASSURANCES                    | 4,553   | 77.10        | 351,036.30   |    |
|                              | FONDIARIA-SAI SPA                 | 8,446   | 22.78        | 192,399.88   |    |
|                              | HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG      | 7,392   | 34.86        | 257,685.12   |    |
|                              | IRISH LIFE & PERMANENT PLC        | 33,837  | 9.50         | 321,451.50   |    |
|                              | MAPFRE SA                         | 83,675  | 3.22         | 269,433.50   |    |
|                              | MUENCHENER RUECKVER AG-REG        | 25,375  | 119.20       | 3,024,700.00 |    |
|                              | SAMPO OYJ-A SHS                   | 53,079  | 17.35        | 920,920.65   |    |
|                              | SCOR SE                           | 21,280  | 16.05        | 341,544.00   |    |
|                              | UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SP      | 81,635  | 1.67         | 136,738.62   |    |
|                              | UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SPA-PFD | 111,741 | 1.38         | 154,537.80   |    |
|                              | VIENNA INSURANCE GROUP            | 4,707   | 46.85        | 220,522.95   |    |
|                              | IMMOEAST AG                       | 51,107  | 6.03         | 308,175.21   |    |
|                              | IMMOFINANZ AG                     | 56,267  | 7.08         | 398,370.36   |    |
|                              | IVG IMMOBILIEN AG                 | 11,376  | 16.72        | 190,206.72   |    |
|                              | MEINL EUROPEAN LAND LTD           | 36,776  | 7.25         | 266,626.00   |    |
|                              | SACYR VALLEHERMOSO SA             | 8,723   | 22.27        | 194,261.21   |    |
|                              | ATOS ORIGIN                       | 8,546   | 37.15        | 317,483.90   |    |
|                              | CAP GEMINI SA                     | 16,936  | 41.95        | 710,465.20   |    |
|                              | DASSAULT SYSTEMS SA               | 7,871   | 41.81        | 329,086.51   |    |
|                              | INDRA SISTEMAS SA                 | 12,073  | 17.58        | 212,243.34   |    |
|                              | SAP AG                            | 106,940 | 33.87        | 3,622,057.80 |    |
|                              | UNITED INTERNET AG-REG SHARE      | 15,411  | 13.79        | 212,517.69   |    |
|                              | ALCATEL-LUCENT                    | 284,013 | 4.43         | 1,258,177.59 |    |
|                              | NEOPOST SA                        | 3,888   | 74.28        | 288,800.64   |    |
|                              | NOKIA OYJ                         | 488,229 | 16.84        | 8,221,776.36 |    |
|                              | SAFRAN S.A.                       | 23,005  | 13.08        | 300,905.40   |    |
| BELGACOM SA                  | 20,719                            | 30.16   | 624,988.63   |              |    |
| BOUYGUES                     | 29,819                            | 45.91   | 1,368,990.29 |              |    |
| DEUTSCHE TELEKOM AG (REGD)   | 347,507                           | 10.29   | 3,575,847.03 |              |    |
| ELISA CORPORATION-A SHS      | 17,329                            | 14.46   | 250,577.34   |              |    |
| FRANCE TELECOM SA            | 223,861                           | 17.90   | 4,008,231.20 |              |    |
| HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 33,047                            | 17.66   | 583,610.02   |              |    |
| KONINKLIJKE KPN NV           | 225,982                           | 11.45   | 2,587,493.90 |              |    |
| MOBISTAR SA                  | 3,880                             | 54.27   | 210,567.60   |              |    |
| NEUF CEGETEL                 | 7,738                             | 35.90   | 277,794.20   |              |    |

| 通貨                       | 銘柄                              | 株式数        | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額                          | 備考 |
|--------------------------|---------------------------------|------------|--------------|------------------------------------|----|
| ユーロ                      | PORTUGAL TELECOM SGPS SA (REGD) | 81,736     | 7.77         | 635,497.40                         |    |
|                          | TELECOM ITALIA SPA              | 1,230,202  | 1.39         | 1,711,210.98                       |    |
|                          | TELECOM ITALIA-RNC              | 738,706    | 1.14         | 843,602.25                         |    |
|                          | TELEFONICA S.A.                 | 526,639    | 17.44        | 9,184,584.16                       |    |
|                          | TELEKOM AUSTRIA AG              | 42,292     | 15.24        | 644,530.08                         |    |
|                          | A2A SPA                         | 153,617    | 2.52         | 387,729.30                         |    |
|                          | E.ON AG                         | 77,676     | 135.94       | 10,559,275.44                      |    |
|                          | ELECTRICITE DE FRANCE           | 24,571     | 70.29        | 1,727,095.59                       |    |
|                          | ENAGAS                          | 21,723     | 19.75        | 429,029.25                         |    |
|                          | ENEL SPA                        | 530,765    | 7.04         | 3,741,362.48                       |    |
|                          | ENERGIAS DE PORTUGAL SA         | 224,117    | 3.79         | 849,403.43                         |    |
|                          | FORTUM OYJ                      | 54,363     | 30.43        | 1,654,266.09                       |    |
|                          | GAS NATURAL SDG SA              | 13,723     | 35.75        | 490,597.25                         |    |
|                          | GAZ DE FRANCE                   | 24,122     | 44.73        | 1,078,977.06                       |    |
|                          | GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA     | 9,890      | 83.24        | 823,243.60                         |    |
|                          | IBERDROLA RENOVABLES            | 103,561    | 4.45         | 460,846.45                         |    |
|                          | IBERDROLA SA                    | 428,507    | 8.83         | 3,783,716.81                       |    |
|                          | OEST ELEKTRIZITATSWIRTS-A       | 9,446      | 55.11        | 520,569.06                         |    |
|                          | PUBLIC POWER CORP               | 12,798     | 25.12        | 321,485.76                         |    |
|                          | RED ELECTRICA DE ESPANA         | 13,266     | 43.27        | 574,019.82                         |    |
|                          | RWE AG                          | 54,537     | 82.10        | 4,477,487.70                       |    |
|                          | RWE AG-NON VTG PFD              | 4,781      | 67.69        | 323,625.89                         |    |
|                          | SNAM RETE GAS                   | 95,924     | 4.31         | 414,295.75                         |    |
|                          | SUEZ SA                         | 128,178    | 48.33        | 6,194,842.74                       |    |
|                          | TERNA SPA                       | 147,136    | 2.89         | 425,664.44                         |    |
|                          | UNION FENOSA, S.A.              | 14,940     | 40.70        | 608,058.00                         |    |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT     | 46,162                          | 45.83      | 2,115,604.46 |                                    |    |
| ASML HOLDING NV          | 52,869                          | 17.74      | 937,896.06   |                                    |    |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 91,905                          | 5.87       | 539,482.35   |                                    |    |
| STMICROELECTRONICS NV    | 83,691                          | 7.71       | 645,843.44   |                                    |    |
|                          | ユーロ 小計                          | 20,542,498 |              | 360,384,935.36<br>(59,950,033,997) |    |
| 英ポンド                     | BG GROUP PLC                    | 409,880    | 12.80        | 5,246,464.00                       |    |
|                          | BP PLC                          | 2,314,056  | 5.94         | 13,762,848.06                      |    |
|                          | CAIRN ENERGY PLC                | 16,038     | 33.43        | 536,150.34                         |    |
|                          | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS     | 436,461    | 21.37        | 9,327,171.57                       |    |
|                          | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS     | 338,254    | 20.87        | 7,059,360.98                       |    |
|                          | TULLOW OIL PLC                  | 88,215     | 9.19         | 810,695.85                         |    |
|                          | ANGLO AMERICAN PLC              | 162,072    | 32.98        | 5,345,134.56                       |    |
|                          | ANTOFAGASTA PLC                 | 48,340     | 6.71         | 324,361.40                         |    |
|                          | BHP BILLITON PLC                | 270,544    | 18.77        | 5,078,110.88                       |    |
|                          | EURASIAN NATURAL RESOURCES      | 39,465     | 13.25        | 522,911.25                         |    |
|                          | JOHNSON MATTHEY PLC             | 26,316     | 19.92        | 524,214.72                         |    |
|                          | KAZAKHMYS PLC                   | 25,097     | 16.27        | 408,328.19                         |    |
|                          | LONMIN PLC                      | 19,157     | 32.67        | 625,859.19                         |    |
|                          | MONDI PLC                       | 45,018     | 3.39         | 152,723.56                         |    |
|                          | REXAM PLC                       | 78,772     | 4.22         | 332,417.84                         |    |
|                          | RIO TINTO PLC                   | 122,303    | 58.70        | 7,179,186.10                       |    |
|                          | VEDANTA RESOURCES PLC           | 17,648     | 22.83        | 402,903.84                         |    |
|                          | XSTRATA PLC                     | 77,901     | 42.22        | 3,288,980.22                       |    |
|                          | AMEC PLC                        | 40,640     | 9.01         | 366,369.60                         |    |
|                          | BAE SYSTEMS PLC                 | 430,678    | 4.57         | 1,971,428.54                       |    |
| BALFOUR BEATTY PLC       | 58,402                          | 4.32       | 252,734.65   |                                    |    |



| 通貨                          | 銘柄                            | 株式数        | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額  | 備考 |
|-----------------------------|-------------------------------|------------|--------------|------------|----|
| 英ポンド                        | COBHAM PLC                    | 139,180    | 2.01         | 280,795.65 |    |
|                             | IMI PLC                       | 39,518     | 5.18         | 204,900.83 |    |
|                             | INVENSYS PLC                  | 97,703     | 3.07         | 300,436.72 |    |
|                             | MEGGITT PLC                   | 80,732     | 2.46         | 199,206.21 |    |
|                             | ROLLS-ROYCE GROUP B SHARES    | 20,501,644 | 0.00         | 20,501.64  |    |
|                             | ROLLS-ROYCE GROUP PLC         | 223,305    | 3.83         | 856,374.67 |    |
|                             | SMITHS GROUP PLC              | 47,539     | 10.34        | 491,553.26 |    |
|                             | TOMKINS PLC                   | 108,043    | 1.70         | 184,213.31 |    |
|                             | WOLSELEY PLC                  | 81,105     | 5.06         | 410,796.82 |    |
|                             | BUNZL PLC                     | 40,026     | 7.04         | 281,783.04 |    |
|                             | CAPITA GROUP PLC              | 74,697     | 6.75         | 504,204.75 |    |
|                             | G4S PLC                       | 155,359    | 2.16         | 335,575.44 |    |
|                             | HAYS PLC                      | 171,871    | 0.99         | 171,441.32 |    |
|                             | RENTOKIL INITIAL PLC          | 222,457    | 0.99         | 221,344.71 |    |
|                             | SERCO GROUP PLC               | 59,475     | 4.46         | 265,258.50 |    |
|                             | BRITISH AIRWAYS               | 70,675     | 2.27         | 160,962.31 |    |
|                             | FIRSTGROUP PLC                | 59,021     | 5.10         | 301,302.20 |    |
|                             | NATIONAL EXPRESS GROUP PLC    | 15,922     | 8.85         | 140,989.31 |    |
|                             | STAGECOACH GROUP PLC          | 65,510     | 2.39         | 157,060.22 |    |
|                             | GKN PLC                       | 86,441     | 2.53         | 219,127.93 |    |
|                             | BURBERRY GROUP PLC            | 53,035     | 4.96         | 263,053.60 |    |
|                             | PERSIMMON PLC                 | 37,077     | 4.28         | 158,967.63 |    |
|                             | TAYLOR WIMPEY PLC             | 129,396    | 0.77         | 99,634.92  |    |
|                             | THE BERKELEY GROUP HOLDINGS   | 10,368     | 7.82         | 81,077.76  |    |
|                             | CARNIVAL PLC                  | 19,890     | 18.06        | 359,213.40 |    |
|                             | COMPASS GROUP PLC             | 227,866    | 3.70         | 843,673.86 |    |
|                             | ENTERPRISE INNS PLC           | 62,025     | 4.25         | 263,916.37 |    |
|                             | INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP | 32,518     | 7.55         | 245,673.49 |    |
|                             | LADBROKES PLC                 | 73,738     | 2.89         | 213,287.16 |    |
|                             | MITCHELLS & BUTLERS PLC       | 49,412     | 2.60         | 128,594.73 |    |
|                             | PUNCH TAVERNS PLC             | 32,644     | 4.57         | 149,346.30 |    |
|                             | THOMAS COOK GROUP PLC         | 59,889     | 2.35         | 141,188.31 |    |
|                             | TUI TRABEL PLC                | 68,527     | 2.32         | 158,982.64 |    |
|                             | WHITBREAD PLC                 | 21,540     | 12.51        | 269,465.40 |    |
|                             | WILLIAM HILL PLC              | 42,578     | 3.53         | 150,619.67 |    |
|                             | BRITISH SKY BROADCASTING PLC  | 139,666    | 5.22         | 729,056.52 |    |
|                             | DAILY MAIL&GENERAL TST-A NV   | 34,683     | 3.75         | 130,321.37 |    |
|                             | ITV PLC                       | 405,233    | 0.56         | 228,146.17 |    |
|                             | PEARSON PLC                   | 99,088     | 6.47         | 641,099.36 |    |
|                             | REED ELSEVIER PLC             | 134,929    | 6.06         | 818,344.38 |    |
|                             | THOMSON REUTERS PLC           | 24,810     | 15.48        | 384,058.80 |    |
|                             | UNITED BUSINESS MEDIA PLC     | 28,365     | 6.18         | 175,295.70 |    |
|                             | WPP GROUP PLC                 | 137,282    | 5.65         | 775,643.30 |    |
|                             | CARPHONE WAREHOUSE GROUP      | 50,421     | 2.37         | 119,875.92 |    |
| EXPERIAN GROUP LTD-W/I      | 125,449                       | 3.84       | 481,724.16   |            |    |
| HOME RETAIL PLC             | 107,561                       | 2.31       | 249,272.61   |            |    |
| INCHCAPE PLC                | 53,493                        | 3.95       | 211,431.08   |            |    |
| KINGFISHER PLC              | 287,291                       | 1.31       | 376,351.21   |            |    |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC   | 197,582                       | 3.69       | 730,065.49   |            |    |
| NEXT PLC                    | 24,554                        | 11.38      | 279,424.52   |            |    |
| MORRISON <WM.> SUPERMARKETS | 296,345                       | 2.74       | 813,467.02   |            |    |
| SAINSBURY (J) PLC           | 128,189                       | 3.33       | 427,189.84   |            |    |
| TESCO PLC                   | 963,586                       | 4.01       | 3,872,652.13 |            |    |

| 通貨                         | 銘柄                              | 株式数        | 評価額<br>単価     | 評価額<br>金額                            | 備考 |
|----------------------------|---------------------------------|------------|---------------|--------------------------------------|----|
| 英ポンド                       | ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC    | 43,671     | 8.21          | 358,757.26                           |    |
|                            | BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC    | 185,529    | 18.47         | 3,426,720.63                         |    |
|                            | CADBURY PLC                     | 175,397    | 6.72          | 1,178,667.84                         |    |
|                            | DIAGEO PLC                      | 315,242    | 9.81          | 3,092,524.02                         |    |
|                            | IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC      | 124,573    | 19.66         | 2,449,105.18                         |    |
|                            | SABMILLER PLC                   | 110,727    | 12.63         | 1,398,482.01                         |    |
|                            | TATE & LYLE PLC                 | 56,011     | 4.33          | 242,947.71                           |    |
|                            | UNILEVER PLC                    | 159,188    | 16.03         | 2,551,783.64                         |    |
|                            | RECKITT BENCKISER GROUP PLC     | 74,141     | 29.23         | 2,167,141.43                         |    |
|                            | SMITH & NEPHEW PLC              | 109,229    | 5.81          | 634,620.49                           |    |
|                            | ASTRAZENECA PLC                 | 178,607    | 21.26         | 3,797,184.82                         |    |
|                            | GLAXOSMITHKLINE PLC             | 670,501    | 10.65         | 7,140,835.65                         |    |
|                            | SHIRE LTD                       | 36,322     | 8.00          | 290,576.00                           |    |
|                            | ALLIANCE & LEICESTER PLC        | 46,415     | 3.64          | 169,182.67                           |    |
|                            | BARCLAYS PLC                    | 805,043    | 3.18          | 2,564,061.95                         |    |
|                            | HBOS PLC                        | 458,261    | 3.07          | 1,406,861.27                         |    |
|                            | HSBC HLDGS PLC                  | 1,454,661  | 8.31          | 12,095,506.21                        |    |
|                            | LLOYDS TSB GROUP PLC            | 692,402    | 3.56          | 2,470,144.13                         |    |
|                            | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP    | 1,977,205  | 2.33          | 4,621,716.68                         |    |
|                            | STANDARD CHARTERED PLC          | 172,804    | 16.63         | 2,873,730.52                         |    |
|                            | 3I GROUP PLC                    | 46,917     | 8.38          | 393,399.04                           |    |
|                            | ICAP PLC                        | 63,582     | 5.90          | 375,451.71                           |    |
|                            | INVESTEC PLC                    | 49,051     | 3.15          | 154,755.90                           |    |
|                            | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 18,647     | 8.91          | 166,238.00                           |    |
|                            | MAN GROUP PLC                   | 210,233    | 6.21          | 1,305,546.93                         |    |
|                            | SCHRODERS PLC                   | 14,664     | 9.97          | 146,273.40                           |    |
|                            | AVIVA PLC                       | 321,570    | 5.98          | 1,922,988.60                         |    |
|                            | FRIENDS PROVIDENT PLC           | 284,777    | 1.20          | 341,732.40                           |    |
|                            | LEGAL & GENERAL GROUP PLC       | 753,924    | 1.15          | 869,274.37                           |    |
|                            | OLD MUTUAL PLC                  | 619,744    | 1.12          | 695,352.76                           |    |
|                            | PRUDENTIAL PLC                  | 302,793    | 6.34          | 1,919,707.62                         |    |
|                            | RSA INSURANCE GROUP PLC GRP     | 398,891    | 1.36          | 545,682.88                           |    |
|                            | STANDARD LIFE PLC               | 266,521    | 2.48          | 660,972.08                           |    |
|                            | LOGICA PLC                      | 178,703    | 1.18          | 211,316.29                           |    |
| SAGE GROUP PLC             | 160,011                         | 2.20       | 352,024.20    |                                      |    |
| BT GROUP PLC               | 965,020                         | 2.14       | 2,065,142.80  |                                      |    |
| CABLE & WIRELESS PLC       | 304,747                         | 1.63       | 498,261.34    |                                      |    |
| VODAFONE GROUP PLC         | 6,512,407                       | 1.55       | 10,120,280.47 |                                      |    |
| BRITISH ENERGY GROUP PLC   | 126,626                         | 7.21       | 912,973.46    |                                      |    |
| CENTRICA PLC               | 451,132                         | 2.98       | 1,345,501.19  |                                      |    |
| INTERNATIONAL POWER PLC    | 184,311                         | 4.41       | 812,811.51    |                                      |    |
| NATIONAL GRID PLC          | 309,416                         | 7.08       | 2,192,212.36  |                                      |    |
| SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY | 106,064                         | 15.27      | 1,619,597.28  |                                      |    |
| SEVERN TRENT PLC           | 28,757                          | 14.47      | 416,113.79    |                                      |    |
| UNITED UTILITIES PLC       | 107,974                         | 7.50       | 809,805.00    |                                      |    |
|                            | 英ポンド 小計                         | 52,196,921 |               | 169,980,264.49<br>( 35,818,241,333 ) |    |
| スイスフラン                     | GIVAUDAN-REG                    | 803        | 1,020.00      | 819,060.00                           |    |
|                            | HOLCIM LTD-REG                  | 25,850     | 92.50         | 2,391,125.00                         |    |
|                            | LONZA GROUP AG-REG              | 5,902      | 144.80        | 854,609.60                           |    |
|                            | SYNGENTA AG                     | 12,755     | 330.50        | 4,215,527.50                         |    |
|                            | ABB LTD                         | 268,997    | 32.30         | 8,688,603.10                         |    |
|                            | GEBERIT AG-REG                  | 4,862      | 171.80        | 835,291.60                           |    |

| 通貨                         | 銘柄                           | 株式数       | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額                            | 備考 |
|----------------------------|------------------------------|-----------|--------------|--------------------------------------|----|
| スイスフラン                     | SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 6,244     | 82.20        | 513,256.80                           |    |
|                            | SULZER AG-REG                | 3,345     | 138.60       | 463,617.00                           |    |
|                            | ADECCO SA-REG                | 15,081    | 56.25        | 848,306.25                           |    |
|                            | SGS SA                       | 576       | 1,523.00     | 877,248.00                           |    |
|                            | KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG   | 6,620     | 106.50       | 705,030.00                           |    |
|                            | CIE FINANC RICHEMONT-A       | 63,989    | 63.25        | 4,047,304.25                         |    |
|                            | THE SWATCH GROUP AG-B        | 3,882     | 279.50       | 1,085,019.00                         |    |
|                            | THE SWATCH GROUP AG-REG      | 6,282     | 53.40        | 335,458.80                           |    |
|                            | LINDT & SPRUENGLI AG-PC      | 102       | 3,199.00     | 326,298.00                           |    |
|                            | NESTLE SA-REGISTERD          | 48,185    | 512.50       | 24,694,812.50                        |    |
|                            | NOBEL BIOCARE HOLDING AG-REG | 14,653    | 38.90        | 570,001.70                           |    |
|                            | SONOVA HOLDING AG            | 5,768     | 95.70        | 551,997.60                           |    |
|                            | STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 959       | 280.00       | 268,520.00                           |    |
|                            | SYNTHESES INC                | 7,276     | 145.80       | 1,060,840.80                         |    |
|                            | ACTELION LTD-REG             | 11,987    | 56.85        | 681,460.95                           |    |
|                            | NOVARTIS AG-REG SHS          | 284,349   | 53.15        | 15,113,149.35                        |    |
|                            | ROCHE HLDGS AG GENUSSCHINE   | 86,123    | 180.40       | 15,536,589.20                        |    |
|                            | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 128,250   | 49.74        | 6,379,155.00                         |    |
|                            | EFG INTERNATIONAL AG         | 6,293     | 34.15        | 214,905.95                           |    |
|                            | JULIUS BAER HOLDING AG-REG   | 25,999    | 75.20        | 1,955,124.80                         |    |
|                            | PARGESA HOLDING SA-BR        | 3,313     | 125.60       | 416,112.80                           |    |
|                            | UBS AG REG                   | 360,037   | 23.82        | 8,576,081.34                         |    |
|                            | BALOISE HOLDING-REG          | 6,289     | 116.80       | 734,555.20                           |    |
|                            | REINSURANCE (REGD)           | 43,081    | 75.60        | 3,256,923.60                         |    |
|                            | SWISS LIFE HOLDING-REG       | 4,286     | 283.75       | 1,216,152.50                         |    |
|                            | ZURICH FINANCIAL SERVICES AG | 17,843    | 293.50       | 5,236,920.50                         |    |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG | 21,140                       | 32.44     | 685,781.60   |                                      |    |
| SWISSCOM AG (REG)          | 2,782                        | 356.25    | 991,087.50   |                                      |    |
| OC OERLIKON CORP AG-REG    | 867                          | 342.00    | 296,514.00   |                                      |    |
| スイスフラン 小計                  |                              | 1,504,770 |              | 115,442,441.79<br>( 11,944,829,452 ) |    |
| スウェーデン<br>クローナ             | LUNDIN PETROLEUM AB          | 27,000    | 92.25        | 2,490,750.00                         |    |
|                            | BOLIDEN AB                   | 35,500    | 61.00        | 2,165,500.00                         |    |
|                            | HOLMEN AB-B SHARES           | 6,500     | 196.00       | 1,274,000.00                         |    |
|                            | SSAB SVENSKT STAL AB-SER A   | 22,200    | 211.00       | 4,684,200.00                         |    |
|                            | SSAB SVENSKT STAL AB-SER B   | 10,200    | 190.50       | 1,943,100.00                         |    |
|                            | SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS   | 69,160    | 91.50        | 6,328,140.00                         |    |
|                            | ALFA LAVAL AB                | 46,600    | 99.25        | 4,625,050.00                         |    |
|                            | ASSA ABLOY AB B              | 38,400    | 93.75        | 3,600,000.00                         |    |
|                            | ATLAS COPCO AB-A SHS         | 82,444    | 101.50       | 8,368,066.00                         |    |
|                            | ATLAS COPCO AB-B SHS         | 48,000    | 92.00        | 4,416,000.00                         |    |
|                            | SANDVIK AB                   | 123,450   | 93.75        | 11,573,437.50                        |    |
|                            | SCANIA AB-B SHS              | 44,200    | 109.25       | 4,828,850.00                         |    |
|                            | SKANSKA AB-B SHS             | 46,180    | 96.50        | 4,456,370.00                         |    |
|                            | SKF AB-B SHS                 | 47,400    | 106.75       | 5,059,950.00                         |    |
|                            | VOLVO AB-B SHS               | 133,475   | 89.50        | 11,946,012.50                        |    |
|                            | SECURITAS AB-B SHS           | 38,510    | 75.00        | 2,888,250.00                         |    |
|                            | ELECTROLUX AB-SER B          | 31,200    | 82.75        | 2,581,800.00                         |    |
|                            | HUSQVARNA AB-B SHS           | 33,400    | 60.50        | 2,020,700.00                         |    |
|                            | MODERN TIMES GROUP-B SHS     | 6,375     | 399.50       | 2,546,812.50                         |    |
|                            | HENNES & MAURITZ AB-B SHS    | 62,675    | 333.00       | 20,870,775.00                        |    |
| SWEDISH MATCH AB           | 32,900                       | 123.75    | 4,071,375.00 |                                      |    |
| GETINGE AB-B SHS           | 22,100                       | 154.50    | 3,414,450.00 |                                      |    |

| 通貨               | 銘柄                            | 株式数       | 評価額<br>単価     | 評価額<br>金額                           | 備考 |
|------------------|-------------------------------|-----------|---------------|-------------------------------------|----|
| スウェーデン<br>クローナ   | NORDEA BANK AB                | 254,850   | 90.70         | 23,114,895.00                       |    |
|                  | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK-A | 56,900    | 123.25        | 7,012,925.00                        |    |
|                  | SVENSKA HANDELSBANKEN-A       | 56,710    | 156.50        | 8,875,115.00                        |    |
|                  | SWEDBANK AB - A SHARES        | 44,200    | 133.50        | 5,900,700.00                        |    |
|                  | INVESTOR AB-B SHS             | 55,800    | 140.75        | 7,853,850.00                        |    |
|                  | ERICSSON(L.M.)TEL CLASS B     | 363,453   | 73.80         | 26,822,831.40                       |    |
|                  | MILLICOM INTL CELLULAR-SDR    | 8,600     | 692.00        | 5,951,200.00                        |    |
|                  | TELE2 AB -B SHS               | 37,470    | 125.50        | 4,702,485.00                        |    |
| TELIASONERA AB   | 275,490                       | 56.50     | 15,565,185.00 |                                     |    |
| スウェーデンクローナ 小計    |                               | 2,161,342 |               | 221,952,774.90<br>( 3,952,978,920 ) |    |
| ノルウェー<br>クローネ    | ACERGY S.A                    | 23,950    | 132.25        | 3,167,387.50                        |    |
|                  | AKER SOLUTIONS ASA            | 20,250    | 141.75        | 2,870,437.50                        |    |
|                  | NORSK HYDRO ASA               | 86,750    | 78.90         | 6,844,575.00                        |    |
|                  | PETROLEUM GEO-SERVICES        | 21,000    | 140.00        | 2,940,000.00                        |    |
|                  | SEADRILL LTD                  | 34,200    | 159.00        | 5,437,800.00                        |    |
|                  | STATOILHYDRO ASA              | 157,350   | 196.20        | 30,872,070.00                       |    |
|                  | YARA INTERNATIONAL ASA        | 23,240    | 416.50        | 9,679,460.00                        |    |
|                  | ORKLA ASA                     | 101,650   | 69.20         | 7,034,180.00                        |    |
|                  | DNB NOR ASA                   | 89,890    | 72.10         | 6,481,069.00                        |    |
|                  | STOREBRAND ASA                | 46,900    | 48.05         | 2,253,545.00                        |    |
|                  | TELENOR ASA                   | 103,000   | 103.00        | 10,609,000.00                       |    |
|                  | RENEWABLE ENERGY CORP AS      | 18,200    | 140.75        | 2,561,650.00                        |    |
| ノルウェークローネ 小計     |                               | 726,380   |               | 90,751,174.00<br>( 1,899,422,071 )  |    |
| デンマーク<br>クローネ    | NOVOZYMES A/S-B SHARES        | 5,675     | 477.50        | 2,709,812.50                        |    |
|                  | FLSMIDTH & CO A/S-B SHS       | 6,550     | 559.00        | 3,661,450.00                        |    |
|                  | ROCKWOOL INTL A/S-B SHS       | 955       | 772.00        | 737,260.00                          |    |
|                  | VESTAS WIND SYSTEM AS         | 22,720    | 660.00        | 14,995,200.00                       |    |
|                  | A P MOLLER - MAERSK A/S - A   | 67        | 57,200.00     | 3,832,400.00                        |    |
|                  | A P MOLLER MAERSK A/S         | 135       | 57,100.00     | 7,708,500.00                        |    |
|                  | DSV A/S                       | 23,550    | 117.50        | 2,767,125.00                        |    |
|                  | CARLSBERG AS-B                | 11,650    | 510.00        | 5,941,500.00                        |    |
|                  | DANISCO A/S                   | 6,000     | 357.50        | 2,145,000.00                        |    |
|                  | COLOPLAST-B                   | 3,000     | 425.00        | 1,275,000.00                        |    |
|                  | WILLIAM DEMANT HOLDING        | 3,025     | 322.50        | 975,562.50                          |    |
|                  | NOVO NORDISK AS-B             | 56,215    | 320.00        | 17,988,800.00                       |    |
|                  | DANSKE BANK AS                | 55,780    | 150.00        | 8,367,000.00                        |    |
|                  | JYSKE BANK-REG                | 6,225     | 305.00        | 1,898,625.00                        |    |
|                  | SYDBANK A/S                   | 7,950     | 186.25        | 1,480,687.50                        |    |
| TOPDANMARK A/S   | 2,075                         | 797.00    | 1,653,775.00  |                                     |    |
| TRYGVESTA AS     | 3,350                         | 386.50    | 1,294,775.00  |                                     |    |
| デンマーククローネ 小計     |                               | 214,922   |               | 79,432,472.50<br>( 1,771,344,136 )  |    |
| オーストラ<br>リアドル    | CALTEX AUSTRALIA LIMITED      | 16,549    | 14.58         | 241,284.42                          |    |
|                  | ORIGIN ENERGY LIMITED         | 107,336   | 15.60         | 1,674,441.60                        |    |
|                  | PALADIN ENERGY LTD            | 67,631    | 5.40          | 365,207.40                          |    |
|                  | SANTOS                        | 71,846    | 21.35         | 1,533,912.10                        |    |
|                  | WOODSIDE PETROLEUM LTD        | 59,065    | 60.58         | 3,578,157.70                        |    |
|                  | WORLEYPARSONS LTD             | 18,349    | 37.85         | 694,509.65                          |    |
|                  | ALUMINA LTD                   | 138,394   | 5.52          | 763,934.88                          |    |
|                  | AMCOR LTD                     | 104,427   | 5.95          | 621,340.65                          |    |
| BHP BILLITON LTD | 411,402                       | 44.00     | 18,101,688.00 |                                     |    |

| 通貨                           | 銘柄                             | 株式数     | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額    | 備考 |
|------------------------------|--------------------------------|---------|--------------|--------------|----|
| オーストラ<br>リアドル                | BLUESCOPE STEEL LIMITED        | 91,045  | 12.00        | 1,092,540.00 |    |
|                              | BORAL LIMITED                  | 71,392  | 5.95         | 424,782.40   |    |
|                              | CSR                            | 120,467 | 2.82         | 339,716.94   |    |
|                              | FORTESCUE METALS GROUP LTD     | 154,588 | 10.00        | 1,545,880.00 |    |
|                              | INCITEC PIVOT LTD              | 6,182   | 189.21       | 1,169,696.22 |    |
|                              | JAMES HARDIE INDUSTRIES NV     | 57,356  | 5.32         | 305,133.92   |    |
|                              | NEWCREST MINING LIMITED        | 55,589  | 29.95        | 1,664,890.55 |    |
|                              | ONESTEEL LIMITED               | 102,076 | 7.55         | 770,673.80   |    |
|                              | ORICA LIMITED                  | 38,624  | 30.10        | 1,162,582.40 |    |
|                              | OXIANA LTD                     | 170,538 | 2.97         | 506,497.86   |    |
|                              | RIO TINTO LTD                  | 35,029  | 137.53       | 4,817,538.37 |    |
|                              | SIMS GROUP LTD                 | 18,768  | 38.33        | 719,377.44   |    |
|                              | ZINIFEX LTD                    | 59,688  | 9.37         | 559,276.56   |    |
|                              | BOART LONGYEAR GROUP           | 175,731 | 2.29         | 402,423.99   |    |
|                              | LEIGHTON HOLDINGS LIMITED      | 17,045  | 53.35        | 909,350.75   |    |
|                              | WESFARMERS LTD                 | 77,512  | 38.10        | 2,953,207.20 |    |
|                              | WESFARMERS LTD-PPP             | 17,741  | 38.40        | 681,254.40   |    |
|                              | BRAMBLES LTD                   | 173,416 | 8.16         | 1,415,074.56 |    |
|                              | ASCIANO GROUP                  | 68,415  | 4.45         | 304,446.75   |    |
|                              | QANTAS AIRWAYS LIMITED         | 114,155 | 3.49         | 398,400.95   |    |
|                              | TOLL HOLDINGS LIMITED          | 75,100  | 7.26         | 545,226.00   |    |
|                              | BILLABONG INTERNATIONAL LTD    | 20,342  | 12.30        | 250,206.60   |    |
|                              | ARISTOCRAT LEISURE LTD         | 39,697  | 7.18         | 285,024.46   |    |
|                              | TABCORP HOLDINGS LIMITED       | 64,348  | 11.00        | 707,828.00   |    |
|                              | TATTS GROUP LTD                | 139,809 | 2.56         | 357,911.04   |    |
|                              | CROWN LTD                      | 54,859  | 10.20        | 559,561.80   |    |
|                              | FAIRFAX MEDIA LTD              | 166,983 | 3.40         | 567,742.20   |    |
|                              | HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD     | 66,788  | 3.35         | 223,739.80   |    |
|                              | METCASH LTD                    | 93,751  | 4.25         | 398,441.75   |    |
|                              | WOOLWORTHS LIMITED             | 148,888 | 28.32        | 4,216,508.16 |    |
|                              | COCA-COLA AMATIL LIMITED       | 67,425  | 7.97         | 537,377.25   |    |
|                              | FOSTER'S GROUP LTD             | 235,543 | 5.39         | 1,269,576.77 |    |
|                              | GOODMAN FIELDER LTD            | 162,424 | 1.64         | 266,375.36   |    |
|                              | LION NATHAN LIMITED            | 36,020  | 9.13         | 328,862.60   |    |
|                              | COCHLEAR LIMITED               | 6,819   | 50.50        | 344,359.50   |    |
|                              | SONIC HEALTHCARE LTD           | 38,835  | 14.69        | 570,486.15   |    |
|                              | CSL LIMITED                    | 67,462  | 41.00        | 2,765,942.00 |    |
|                              | AUST AND NZ BANKING GROUP LTD  | 235,473 | 20.74        | 4,883,710.02 |    |
|                              | BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD  | 32,253  | 13.50        | 435,415.50   |    |
|                              | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 161,318 | 43.40        | 7,001,201.20 |    |
|                              | NATIONAL AUSTRALIA BANK        | 199,594 | 29.52        | 5,892,014.88 |    |
|                              | ST GEORGE BANK LIMITED         | 68,354  | 30.80        | 2,105,303.20 |    |
|                              | WESTPAC BANKING CORPORATION    | 230,245 | 22.75        | 5,238,073.75 |    |
|                              | ASX LTD                        | 20,981  | 32.67        | 685,449.27   |    |
|                              | BABCOCK & BROWN LTD            | 28,522  | 11.16        | 318,305.52   |    |
|                              | MACQUARIE GROUP LTD            | 33,658  | 55.99        | 1,884,511.42 |    |
|                              | PERPETUAL LTD                  | 4,625   | 49.93        | 230,926.25   |    |
| SUNCORP-METWAY LIMITED       | 114,136                        | 14.90   | 1,700,626.40 |              |    |
| AMP LIMITED                  | 229,827                        | 7.61    | 1,748,983.47 |              |    |
| AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS    | 103,947                        | 5.30    | 550,919.10   |              |    |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT | 227,147                        | 4.05    | 919,945.35   |              |    |
| QBE INSURANCE GROUP LTD      | 108,638                        | 24.62   | 2,674,667.56 |              |    |
| LEND LEASE                   | 44,255                         | 11.70   | 517,783.50   |              |    |

| 通貨                           | 銘柄                                 | 株式数       | 評価額<br>単価     | 評価額<br>金額                            | 備考 |
|------------------------------|------------------------------------|-----------|---------------|--------------------------------------|----|
| オーストラリアドル                    | COMPUTERSHARE LTD                  | 57,898    | 9.19          | 532,082.62                           |    |
|                              | TELSTRA CORPORATION LTD            | 533,862   | 4.60          | 2,455,765.20                         |    |
|                              | AGL ENERGY LTD                     | 53,147    | 13.78         | 732,365.66                           |    |
| オーストラリアドル 小計                 |                                    | 6,593,329 |               | 104,420,440.77<br>( 10,584,055,876 ) |    |
| ニュージーランドドル                   | FLETCHER BUILDING LTD              | 61,389    | 7.37          | 452,436.93                           |    |
|                              | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD          | 119,862   | 2.09          | 250,511.58                           |    |
|                              | SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP       | 58,388    | 3.57          | 208,445.16                           |    |
|                              | TELECOM CORP OF NEW ZEALAND        | 223,267   | 3.85          | 859,577.95                           |    |
|                              | CONTACT ENERGY LIMITED             | 35,344    | 8.64          | 305,372.16                           |    |
| ニュージーランドドル 小計                |                                    | 498,250   |               | 2,076,343.78<br>( 167,893,158 )      |    |
| 香港ドル                         | MONGOLIA ENERGY CO LTD             | 414,000   | 17.40         | 7,203,600.00                         |    |
|                              | CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE         | 56,000    | 32.25         | 1,806,000.00                         |    |
|                              | LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN       | 55,600    | 15.92         | 885,152.00                           |    |
|                              | HUTCHISON WHAMPOA LTD              | 262,000   | 83.30         | 21,824,600.00                        |    |
|                              | NWS HOLDINGS LTD                   | 100,000   | 23.75         | 2,375,000.00                         |    |
|                              | CATHAY PACIFIC AIRWAYS             | 145,000   | 16.26         | 2,357,700.00                         |    |
|                              | HONG KONG AIRCRAFT ENGINEERG       | 8,400     | 130.10        | 1,092,840.00                         |    |
|                              | HOPEWELL HOLDINGS                  | 78,000    | 32.70         | 2,550,600.00                         |    |
|                              | MTR CORPORATION                    | 172,000   | 27.40         | 4,712,800.00                         |    |
|                              | ORIENT OVERSEAS INTL LTD           | 27,500    | 49.95         | 1,373,625.00                         |    |
|                              | PACIFIC BASIN SHIPPING LTD         | 192,000   | 13.30         | 2,553,600.00                         |    |
|                              | C C LAND HOLDINGS LTD              | 123,000   | 6.74          | 829,020.00                           |    |
|                              | YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG           | 81,500    | 22.20         | 1,809,300.00                         |    |
|                              | SHANGRI-LA ASIA LTD                | 160,000   | 22.90         | 3,664,000.00                         |    |
|                              | TELEVISION BROADCASTS LTD          | 36,000    | 48.85         | 1,758,600.00                         |    |
|                              | ESPRIT HOLDINGS LTD                | 129,500   | 88.90         | 11,512,550.00                        |    |
|                              | LI & FUNG LTD                      | 276,200   | 28.05         | 7,747,410.00                         |    |
|                              | LIFESTYLE INTL HLDGS LTD           | 88,500    | 14.52         | 1,285,020.00                         |    |
|                              | BANK OF EAST ASIA LIMITED          | 172,400   | 47.35         | 8,163,140.00                         |    |
|                              | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD         | 454,000   | 20.95         | 9,511,300.00                         |    |
|                              | CITIC INTERNATIONAL FINANCIA       | 247,000   | 5.70          | 1,407,900.00                         |    |
|                              | HANG SENG BANK LTD                 | 93,800    | 163.40        | 15,326,920.00                        |    |
|                              | WING HANG BANK LIMITED             | 22,500    | 112.50        | 2,531,250.00                         |    |
|                              | WING LUNG BANK                     | 10,000    | 153.30        | 1,533,000.00                         |    |
|                              | HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD | 124,800   | 134.20        | 16,748,160.00                        |    |
|                              | CHEUNG KONG HOLDINGS LTD           | 171,000   | 125.90        | 21,528,900.00                        |    |
|                              | CHINESE ESTATES HOLDINGS LTD       | 113,000   | 12.98         | 1,466,740.00                         |    |
|                              | HANG LUNG GROUP LTD                | 106,000   | 39.10         | 4,144,600.00                         |    |
|                              | HANG LUNG PROPERTIES LTD           | 255,000   | 28.55         | 7,280,250.00                         |    |
|                              | HENDERSON LAND DEVELOPMENT         | 131,585   | 54.75         | 7,204,278.75                         |    |
|                              | HYSAN DEVELOPMENT CO               | 70,000    | 23.05         | 1,613,500.00                         |    |
|                              | KERRY PROPERTIES LTD               | 78,500    | 53.40         | 4,191,900.00                         |    |
|                              | NEW WORLD DEVELOPMENT              | 298,000   | 19.20         | 5,721,600.00                         |    |
|                              | SHUN TAK HOLDINGS LTD              | 130,000   | 9.32          | 1,211,600.00                         |    |
| SINO LAND CO                 | 208,000                            | 19.52     | 4,060,160.00  |                                      |    |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES      | 173,000                            | 126.70    | 21,919,100.00 |                                      |    |
| SWIRE PACIFIC CL A           | 101,500                            | 92.00     | 9,338,000.00  |                                      |    |
| WHARF HOLDINGS LTD           | 169,000                            | 39.75     | 6,717,750.00  |                                      |    |
| WHEELOCK & CO LTD            | 112,000                            | 26.30     | 2,945,600.00  |                                      |    |
| FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS  | 260,000                            | 10.32     | 2,683,200.00  |                                      |    |
| KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS | 67,500                             | 39.10     | 2,639,250.00  |                                      |    |

| 通貨                           | 銘柄                           | 株式数         | 評価額<br>単価    | 評価額<br>金額                              | 備考 |
|------------------------------|------------------------------|-------------|--------------|--|----|
| 香港ドル                         | HUTCHISON TELECOMMUNICATIONS | 205,000     | 10.96        | 2,246,800.00                           |    |
|                              | PCCW LTD                     | 457,600     | 4.84         | 2,214,784.00                           |    |
|                              | CLP HOLDINGS LTD             | 251,000     | 66.15        | 16,603,650.00                          |    |
|                              | HONG KONG & CHINA GAS        | 490,970     | 19.54        | 9,593,553.80                           |    |
|                              | HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS   | 170,500     | 47.65        | 8,124,325.00                           |    |
|                              | ASM PACIFIC TECHNOLOGY       | 24,400      | 61.65        | 1,504,260.00                           |    |
| 香港ドル 小計                      |                              | 7,573,255   |              | 277,516,888.55<br>( 3,793,655,866 )    |    |
| シンガポール<br>ドル                 | KEPPEL CORP LTD              | 156,000     | 11.78        | 1,837,680.00                           |    |
|                              | NOBLE GROUP LTD              | 190,800     | 2.32         | 442,656.00                             |    |
|                              | SEMBCORP INDUSTRIES LIMITED  | 120,000     | 4.60         | 552,000.00                             |    |
|                              | SEMBCORP MARINE LTD          | 104,400     | 4.39         | 458,316.00                             |    |
|                              | SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 165,000     | 3.19         | 526,350.00                             |    |
|                              | COMFORTDELGRO CORP LTD       | 231,000     | 1.60         | 369,600.00                             |    |
|                              | COSCO CORP SINGAPORE LTD     | 110,000     | 3.29         | 361,900.00                             |    |
|                              | NEPTUNE ORIENT LINES LTD     | 63,000      | 3.64         | 229,320.00                             |    |
|                              | SINGAPORE AIRLINES LTD       | 65,600      | 15.40        | 1,010,240.00                           |    |
|                              | GENTING INTERNATIONAL PLC    | 354,000     | 0.60         | 214,170.00                             |    |
|                              | SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 186,250     | 4.27         | 795,287.50                             |    |
|                              | JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 18,000      | 16.80        | 302,400.00                             |    |
|                              | OLAM INTERNATIONAL LTD       | 146,800     | 2.69         | 394,892.00                             |    |
|                              | FRASER & NEAVE LTD           | 119,500     | 4.77         | 570,015.00                             |    |
|                              | GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD    | 611,000     | 0.99         | 607,945.00                             |    |
|                              | WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 102,000     | 5.06         | 516,120.00                             |    |
|                              | PARKWAY HOLDINGS LTD         | 111,000     | 2.75         | 305,250.00                             |    |
|                              | PARKWAY HOLDINGS LTD-RTS     | 36,400      | 0.61         | 22,204.00                              |    |
|                              | DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 140,000     | 19.50        | 2,730,000.00                           |    |
|                              | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 307,000     | 8.32         | 2,554,240.00                           |    |
|                              | UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 150,000     | 19.20        | 2,880,000.00                           |    |
|                              | SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 104,000     | 7.71         | 801,840.00                             |    |
|                              | CAPITALAND LIMITED           | 207,000     | 6.12         | 1,266,840.00                           |    |
|                              | CITY DEVELOPMENTS LTD        | 62,000      | 10.82        | 670,840.00                             |    |
|                              | KEPPEL LAND LTD              | 45,000      | 5.25         | 236,250.00                             |    |
|                              | UOL GROUP LTD                | 65,400      | 3.79         | 247,866.00                             |    |
| YANLORD LAND GROUP LTD       | 59,000                       | 2.23        | 131,570.00   |  |    |
| VENTURE CORP LTD             | 27,000                       | 10.06       | 271,620.00   |  |    |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 975,880                      | 3.63        | 3,542,444.40 |  |    |
| シンガポールドル 小計                  |                              | 5,033,030   |              | 24,849,855.90<br>( 1,939,779,751 )     |    |
| 合計                           |                              | 138,762,896 |              | 312,782,031,860<br>( 312,782,031,860 ) |    |

#### B . 株式以外の有価証券

| 種類           | 通貨           | 銘柄                           | 口数      | 評価額                            | 備考 |
|--------------|--------------|------------------------------|---------|--------------------------------|----|
| 投資信託<br>受益証券 | シンガポール<br>ドル | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 122,000 | 292,800.00                     |    |
|              |              | CAPITACOMMERCIAL TRUST       | 122,000 | 254,980.00                     |    |
|              |              | CAPITAMALL TRUST             | 143,600 | 469,572.00                     |    |
|              | シンガポールドル 小計  |                              | 387,600 | 1,017,352.00<br>( 79,414,497 ) |    |
| 投資信託受益証券 合計  |              |                              | 387,600 | 79,414,497<br>( 79,414,497 )   |    |
| 投資証券         | 米ドル          | AMB PROPERTY CORP            | 12,200  | 668,926.00                     |    |
|              |              | APARTMENT INVT & MGMT CO -A  | 11,770  | 431,135.10                     |    |

| 種類        | 通貨                        | 銘柄                          | 口数         | 評価額                             | 備考                                 |  |
|-----------|---------------------------|-----------------------------|------------|---------------------------------|------------------------------------|--|
| 投資証券      | 米ドル                       | AVALONBAY COMMUNITIES INC   | 9,500      | 917,890.00                      |                                    |  |
|           |                           | BOSTON PROPERTIES INC       | 14,700     | 1,390,914.00                    |                                    |  |
|           |                           | CAMDEN PROPERTY TRUST       | 6,500      | 305,370.00                      |                                    |  |
|           |                           | DEVELOPERS DIVERSIFIED RLTY | 14,700     | 563,157.00                      |                                    |  |
|           |                           | DUKE REALTY CORP            | 18,000     | 428,040.00                      |                                    |  |
|           |                           | EQUITY RESIDENTIAL          | 33,100     | 1,368,685.00                    |                                    |  |
|           |                           | FED REALTY INVS TRUST       | 7,400      | 575,868.00                      |                                    |  |
|           |                           | GENERAL GROWTH PROPERTIES   | 27,000     | 1,040,040.00                    |                                    |  |
|           |                           | HCP INC                     | 28,700     | 947,387.00                      |                                    |  |
|           |                           | HOST HOTELS & RESORTS INC   | 61,066     | 961,789.50                      |                                    |  |
|           |                           | KIMCO REALTY CORP           | 27,900     | 1,037,601.00                    |                                    |  |
|           |                           | LIBERTY PROPERTY TRUST      | 11,300     | 386,347.00                      |                                    |  |
|           |                           | MACERICH CO                 | 8,900      | 599,059.00                      |                                    |  |
|           |                           | PLUM CREEK TIMBER CO        | 21,200     | 968,628.00                      |                                    |  |
|           |                           | PROLOGIS                    | 31,700     | 1,821,165.00                    |                                    |  |
|           |                           | PUBLIC STORAGE INC          | 15,700     | 1,342,193.00                    |                                    |  |
|           |                           | REGENCY CENTERS CORP        | 8,600      | 550,142.00                      |                                    |  |
|           |                           | SIMON PROPERTY GROUP INC    | 27,400     | 2,628,208.00                    |                                    |  |
|           |                           | SL GRENN REALTY CORP        | 7,241      | 672,833.72                      |                                    |  |
|           |                           | UDR INC                     | 16,500     | 400,290.00                      |                                    |  |
|           |                           | VENTAS INC                  | 17,000     | 782,850.00                      |                                    |  |
|           |                           | VORNADO REALTY TRUST        | 17,000     | 1,558,390.00                    |                                    |  |
|           | 米ドル 小計                    |                             |            | 455,077                         | 22,346,908.32<br>( 2,386,202,870 ) |  |
|           | カナダドル                     | AEROPLAN INCOME FUND        | 12,300     | 207,132.00                      |                                    |  |
|           |                           | ARC ENERGY TRUST UNITS      | 12,700     | 396,748.00                      |                                    |  |
|           |                           | CANADIAN OIL SANDS TRUST    | 28,800     | 1,461,600.00                    |                                    |  |
|           |                           | CI FINANCIAL INCOME FUND    | 7,900      | 184,860.00                      |                                    |  |
|           |                           | ENERPLUS RESOURCES FUND     | 19,600     | 942,172.00                      |                                    |  |
|           |                           | FORDING CANADIAN COAL TRUST | 18,300     | 1,520,364.00                    |                                    |  |
|           |                           | HARVEST ENERGY TRUST-UNITS  | 17,500     | 444,325.00                      |                                    |  |
|           |                           | PENN WEST ENERGY TRUST      | 45,878     | 1,559,852.00                    |                                    |  |
|           |                           | PRECISION DRILLING TRUST    | 7,700      | 216,755.00                      |                                    |  |
|           |                           | PROVIDENT ENERGY TRUST-UTS  | 31,800     | 380,964.00                      |                                    |  |
|           |                           | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 12,700     | 274,447.00                      |                                    |  |
|           | YELLOW PAGES INCOME FUND  | 31,400                      | 303,010.00 |                                 |                                    |  |
|           | カナダドル 小計                  |                             |            | 246,578                         | 7,892,229.00<br>( 823,554,096 )    |  |
|           | ユーロ                       | CORIO NV                    | 5,359      | 296,459.88                      |                                    |  |
|           |                           | GECINA SA                   | 1,913      | 172,342.17                      |                                    |  |
|           |                           | ICADE                       | 2,413      | 212,681.82                      |                                    |  |
|           |                           | KLEPIERRE                   | 8,489      | 313,074.32                      |                                    |  |
|           |                           | UNIBAIL                     | 10,024     | 1,632,207.92                    |                                    |  |
|           | ユーロ 小計                    |                             |            | 28,198                          | 2,626,766.11<br>( 436,962,542 )    |  |
|           | 英ポンド                      | BRITISH LAND CO PLC         | 62,626     | 469,068.74                      |                                    |  |
|           |                           | HAMMERSON PLC               | 35,444     | 314,388.28                      |                                    |  |
|           |                           | LAND SECURITIES GROUP PLC   | 56,997     | 787,698.54                      |                                    |  |
|           |                           | LIBERTY INTERNATIONAL PLC   | 31,069     | 267,504.09                      |                                    |  |
|           |                           | SEGR0 PLC                   | 53,457     | 213,026.14                      |                                    |  |
| 英ポンド 小計   |                           |                             | 239,593    | 2,051,685.79<br>( 432,331,229 ) |                                    |  |
| オーストラリアドル | CFS RETAIL PROPERTY TRUST | 180,207                     | 380,236.77 |                                 |                                    |  |
|           | DEXUS PROPERTY GROUP      | 359,425                     | 576,877.12 |                                 |                                    |  |
|           | GOODMAN GROUP             | 189,431                     | 748,252.45 |                                 |                                    |  |



| 種類      | 通貨           | 銘柄                             | 口数                           | 評価額                              | 備考 |
|---------|--------------|--------------------------------|------------------------------|----------------------------------|----|
| 投資証券    | オーストラリアドル    | GPT GROUP                      | 257,379                      | 764,415.63                       |    |
|         |              | MACQUARIE AIRPORTS             | 84,272                       | 235,118.88                       |    |
|         |              | MACQUARIE INFRASTRUCTURE GROUP | 293,590                      | 871,962.30                       |    |
|         |              | MACQUARIE OFFICE TRUST         | 255,164                      | 252,612.36                       |    |
|         |              | MIRVAC GROUP                   | 127,126                      | 420,787.06                       |    |
|         |              | STOCKLAND                      | 179,661                      | 1,108,508.37                     |    |
|         |              | TRANSURBAN GROUP               | 128,131                      | 689,344.78                       |    |
|         |              | WESTFIELD GROUP                | 214,988                      | 3,751,540.60                     |    |
|         | オーストラリアドル 小計 |                                | 2,269,374                    | 9,799,656.32<br>(993,293,164)    |    |
|         | 香港ドル         | LINK REIT                      | 262,500                      | 5,092,500.00                     |    |
| 香港ドル 小計 |              | 262,500                        | 5,092,500.00<br>(69,614,475) |                                  |    |
| 投資証券 合計 |              |                                | 3,501,320                    | 5,141,958,376<br>(5,141,958,376) |    |
| 合計      |              |                                |                              | 5,221,372,873<br>(5,221,372,873) |    |

(注) 有価証券明細表注記

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

| 通貨         | 銘柄数   | 組入株式<br>時価比率<br>(注1) | 組入投資証券<br>時価比率<br>(注2) | 組入投資信託<br>受益証券<br>時価比率<br>(注3) | 有価証券の<br>合計金額に<br>対する比率 |
|------------|-------|----------------------|------------------------|--------------------------------|-------------------------|
| 米ドル        | 623   | 98.6%                | 1.4%                   | -                              | 52.6%                   |
| カナダドル      | 98    | 95.1%                | 4.9%                   | -                              | 5.3%                    |
| ユーロ        | 297   | 99.3%                | 0.7%                   | -                              | 19.0%                   |
| 英ポンド       | 124   | 98.8%                | 1.2%                   | -                              | 11.4%                   |
| スイスフラン     | 35    | 100.0%               | -                      | -                              | 3.8%                    |
| スウェーデンクローナ | 31    | 100.0%               | -                      | -                              | 1.2%                    |
| ノルウェークローネ  | 12    | 100.0%               | -                      | -                              | 0.6%                    |
| デンマーククローネ  | 17    | 100.0%               | -                      | -                              | 0.6%                    |
| オーストラリアドル  | 76    | 91.4%                | 8.6%                   | -                              | 3.6%                    |
| ニュージーランドドル | 5     | 100.0%               | -                      | -                              | 0.1%                    |
| 香港ドル       | 48    | 98.2%                | 1.8%                   | -                              | 1.2%                    |
| シンガポールドル   | 32    | 96.1%                | -                      | 3.9%                           | 0.6%                    |
| 合計         | 1,398 | 98.4%                | 1.6%                   | 0.0%                           | 100.0%                  |

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

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

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

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。

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。

「中央三井外国債券マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 項目       | 平成20年6月10日現在<br>金額(円) |
|----------|-----------------------|
| 資産の部     |                       |
| 流動資産     |                       |
| 預金       | 837,045,184           |
| コール・ローン  | 3,545,931,979         |
| 国債証券     | 500,944,803,218       |
| 特殊債券     | 2,433,899,033         |
| 派生商品評価勘定 | 226,225,350           |
| 未収利息     | 8,096,043,931         |
| 前払費用     | 712,023,325           |
| 差入委託証拠金  | 238,593,439           |
| 流動資産合計   | 517,034,565,459       |
| 資産合計     | 517,034,565,459       |
| 負債の部     |                       |
| 流動負債     |                       |
| 派生商品評価勘定 | 107,456,937           |
| 未払解約金    | 188,439,885           |
| 流動負債合計   | 295,896,822           |
| 負債合計     | 295,896,822           |
| 純資産の部    |                       |
| 元本等      |                       |
| 元本       | 283,562,076,317       |
| 剰余金      |                       |
| 剰余金      | 233,176,592,320       |
| 純資産合計    | 516,738,668,637       |
| 負債・純資産合計 | 517,034,565,459       |

( 2 ) 注記表

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

|                         | 平成20年 6月10日現在  |
|-------------------------|--|
| 1 . 有価証券の評価基準及び評価方法     | 国債証券及び特殊債券<br>移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価しております。<br>ただし、買付後の最初の利払いまでは個別法によっております。  |
| 2 . デリバティブの評価基準及び評価方法   | ( 1 ) 国債先物取引<br>個別法に基づき、時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。<br>( 2 ) 為替予約取引<br>個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。<br><br>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。 |
| 3 . 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。   |
| 4 . 収益及び費用の計上基準         | 派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準<br>約定日基準で計上しております。  |
| 5 . その他                 | 外貨建資産等の会計処理<br>外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。  |

(貸借対照表に関する注記)

| 平成20年 6月10日現在   |                   |
|-----------------|-------------------|
| 1. 計算日における受益権総数 | 283,562,076,317 口 |
| 2. 1口当たり純資産額    | 1.8223 円          |
| (1万口当たり純資産額)    | (18,223 円)        |

(関連当事者との取引に関する注記)

| 平成20年 6月10日現在 |  |
|---------------|--|
| 該当事項はありません。   |  |

(重要な後発事象に関する注記)

| 平成20年 6月10日現在 |  |
|---------------|--|
| 該当事項はありません。   |  |

(その他の注記)

1. 本書における開示対象ファンドの当該計算期間における「中央三井外国債券マザーファンド」の元本額の変動

| 平成20年6月10日現在  |                          |
|---|--------------------------|
| 「新生・4分散ファンド」の第1期計算期間(平成19年10月31日から平成20年6月10日まで)における「中央三井外国債券マザーファンド」の元本額の変動及び計算日の元本額の内訳 |                          |
| 同計算期間の期首元本額   | 282,585,883,425 円        |
| 同計算期間中の追加設定元本額  | 25,341,018,224 円         |
| 同計算期間中の一部解約元本額  | <u>24,364,825,332 円</u>  |
| 計算日の元本額   | <u>283,562,076,317 円</u> |
| 計算日の元本額の内訳  |                          |
| 中央三井外国債券インデックスファンド  | 4,615,313,906 円          |
| 中央三井DC外国債券インデックスファンド  | 1,552,289,419 円          |
| 中央三井DC外国債券インデックスファンドL   | 5,352,672,636 円          |
| 物価連動債組入世界債券ファンド   | 316,261,306 円            |
| 中央三井DCバランスファンド30  | 19,668,207 円             |
| 中央三井DCバランスファンド50  | 36,962,352 円             |
| 中央三井DCバランスファンド70  | 10,772,557 円             |
| ベスタ・世界6資産ファンド(毎月決算型)  | 285,163,305 円            |
| ベスタ・世界6資産ファンド(1年決算型)  | 159,392,997 円            |
| 新生・4分散ファンド  | 178,732,222 円            |
| ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド   | 97,380,207 円             |
| 4資産インデックスバランスオープン(分配型)  | 47,281,517 円             |
| 4資産インデックスバランスオープン(成長型)  | 81,871,045 円             |
| 中央三井外国債券インデックスファンドF(一般投資家私募)  | 1,020,506,664 円          |
| 中央三井外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)   | 27,150,866,749 円         |
| 中央三井バランスVA30(適格機関投資家専用)   | 9,456,735,146 円          |
| 中央三井バランスVA50(適格機関投資家専用)   | 33,360,870,691 円         |
| 中央三井VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)  | 120,976,073,026 円        |
| 中央三井VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)  | 6,340,539,106 円          |
| 中央三井VAバランス株式30(適格機関投資家専用)   | 117,754,394 円            |
| 中央三井VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)  | 11,533,706,649 円         |
| 中央三井バランスVA25(適格機関投資家専用)   | 5,927,835,881 円          |
| 中央三井バランスVA37.5(適格機関投資家専用)   | 1,458,739,268 円          |
| 中央三井バランスVA50L(適格機関投資家専用)  | 19,278,066,759 円         |
| 中央三井バランスVA75(適格機関投資家専用)   | 588,000,174 円            |
| 中央三井VL株式30(適格機関投資家専用)   | 3,660,092 円              |
| 中央三井VL株式50(適格機関投資家専用)   | 4,099,985 円              |
| 中央三井VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)  | 29,920,746,372 円         |
| 中央三井VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)  | 1,713,874,219 円          |
| 中央三井VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)  | 181,813,990 円            |
| 中央三井バランスVA40(適格機関投資家専用)   | 1,037,372,260 円          |
| 中央三井VAバランス株式40(適格機関投資家専用)   | 737,053,216 円            |

2. 有価証券関係  
 売買目的有価証券

| 平成20年6月10日現在 |                 |   |
|--------------|-----------------|---|
| 種類           | 貸借対照表計上額(円)     | 「新生・4分散ファンド」の第1期計算期間において、「中央三井外国債券マザーファンド」の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券         | 500,944,803,218 | 19,546,612,309  |
| 特殊債券         | 2,433,899,033   | 29,713,380  |
| 合計           | 503,378,702,251 | 19,576,325,689  |

(注) 評価差額は、「中央三井外国債券マザーファンド」の期首(平成20年2月8日)から計算日までの期間に対応するものです。

3. デリバティブ取引関係  
 . 取引の状況に関する事項

| 平成20年6月10日現在             |   |
|--------------------------|---|
| 1. 取引の内容                 | 当ファンドが利用している取引は、債券関連では国債先物取引であり、また、通貨関連では為替予約取引であります。   |
| 2. 取引に対する取組方針            | 国債先物取引は、ファンド運用の効率化を図ること及び将来の価格変動リスクの回避を目的としており、為替予約取引は、運用の効率化を図るため、将来の為替変動リスクの回避目的に限定せず利用する場合があります。ただし、いずれのデリバティブ取引においても、投機目的の取引は行わない方針であります。     |
| 3. 取引の利用目的               | 国債先物取引は、ファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、キャッシュ運用の効率化、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用し、為替予約取引は、原則としてファンド運用の効率化を図るために利用しております。 |
| 4. 取引に係るリスクの内容           | 国債先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。また、為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。                                  |
| 5. 取引に係るリスク管理体制          | 組織的な管理体制により、日々のポジション、評価金額及び評価損益の管理を行っております。また、リスク管理は、デリバティブ取引に限定することなく、デリバティブ取引と現物資産等を総合的に勘案し、各ファンド全体でのリスク管理を、リスクの種類ごとに実施しております。                  |
| 6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 | 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、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。   |

・取引の時価等に関する事項  
 デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益  
 債券関連

| 区分   | 種類            | 平成20年6月10日現在  |       |               |             |
|------|---------------|---------------|-------|---------------|-------------|
|      |               | 契約額等(円)       |       | 時価<br>(円)     | 評価損益<br>(円) |
|      |               |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引 | 国債先物取引<br>買 建 | 2,949,063,787 |       | 2,937,845,350 | 11,218,437  |
|      | 合計            | 2,949,063,787 |       | 2,937,845,350 | 11,218,437  |

(注) 1. 時価の算定方法

国債先物取引の時価については、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 国債先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

通貨関連

| 区分            | 種類            | 平成20年6月10日現在   |               |                |             |
|---------------|---------------|----------------|---------------|----------------|-------------|
|               |               | 契約額等(円)        |               | 時価<br>(円)      | 評価損益<br>(円) |
|               |               |                | うち1年超         |                |             |
| 市場取引<br>以外の取引 | 為替予約取引<br>売 建 |                |               |                |             |
|               | 米ドル           | 1,630,571,050  |               | 1,654,470,000  | 23,898,950  |
|               | カナダドル         | 179,234,700    |               | 177,310,000    | 1,924,700   |
|               | ユーロ           | 3,646,799,050  |               | 3,707,375,000  | 60,575,950  |
|               | 英ポンド          | 518,375,175    |               | 526,375,000    | 7,999,825   |
|               | 計             | 5,974,979,975  |               | 6,065,530,000  | 90,550,025  |
|               | 買 建           |                |               |                |             |
|               | 米ドル           | 2,480,563,600  |               | 2,540,412,000  | 59,848,400  |
|               | カナダドル         | 271,472,050    |               | 271,180,000    | 292,050     |
|               | ユーロ           | 5,680,006,350  |               | 5,818,750,000  | 138,743,650 |
| 英ポンド          | 756,798,125   |                | 779,035,000   | 22,236,875     |             |
| 計             | 9,188,840,125 |                | 9,409,377,000 | 220,536,875    |             |
|               | 合計            | 15,163,820,100 |               | 15,474,907,000 | 129,986,850 |

(注) 時価の算定方法

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

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

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



## ( 3 ) 附属明細表 ( 平成20年 6 月10日現在 )

## 有価証券明細表

## A . 株式

該当事項はありません。

## B . 株式以外の有価証券

| 通貨                                | 種類         | 銘柄                                 | 券面総額       | 評価額           | 備考 |
|-----------------------------------|------------|------------------------------------|------------|---------------|----|
| 米ドル                               | 国債証券       | US TREASURY N/B 6.000% 2009/08/15  | 48,120,000 | 50,071,115.86 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 3.375% 2009/09/15  | 15,900,000 | 16,080,117.26 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 3.500% 2009/11/15  | 60,000,000 | 60,829,687.80 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 3.500% 2009/12/15  | 11,000,000 | 11,155,546.93 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 3.625% 2010/01/15  | 5,000,000  | 5,082,421.90  |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 3.500% 2010/02/15  | 6,500,000  | 6,593,945.34  |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 6.500% 2010/02/15  | 40,000,000 | 42,525,000.00 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.000% 2010/03/15  | 66,390,000 | 67,956,389.06 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.000% 2010/04/15  | 6,500,000  | 6,656,406.25  |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 3.625% 2010/06/15  | 33,680,000 | 34,272,031.40 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 3.875% 2010/07/15  | 14,000,000 | 14,323,750.00 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.125% 2010/08/15  | 12,000,000 | 12,328,125.00 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 5.750% 2010/08/15  | 7,200,000  | 7,646,062.53  |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 3.875% 2010/09/15  | 4,200,000  | 4,296,796.89  |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.250% 2010/10/15  | 15,000,000 | 15,492,187.50 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.375% 2010/12/15  | 25,300,000 | 26,225,031.25 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 5.000% 2011/02/15  | 25,960,000 | 27,369,547.00 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.875% 2011/04/30  | 18,000,000 | 18,935,156.34 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 5.125% 2011/06/30  | 9,010,000  | 9,552,007.81  |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.875% 2011/07/31  | 9,960,000  | 10,503,909.42 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 5.000% 2011/08/15  | 7,050,000  | 7,475,753.94  |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.625% 2011/08/31  | 31,700,000 | 33,208,226.72 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.625% 2011/10/31  | 12,300,000 | 12,903,468.75 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.750% 2012/01/31  | 22,670,000 | 23,911,536.83 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.875% 2012/02/15  | 2,830,000  | 2,999,800.00  |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.500% 2012/04/30  | 25,370,000 | 26,567,146.87 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.750% 2012/05/31  | 18,670,000 | 19,726,021.87 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.625% 2012/07/31  | 7,910,000  | 8,329,600.82  |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.375% 2012/08/15  | 21,500,000 | 22,494,375.00 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.000% 2012/11/15  | 17,000,000 | 17,523,281.25 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 2.875% 2013/01/31  | 26,390,000 | 25,876,632.16 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 3.875% 2013/02/15  | 16,200,000 | 16,567,031.25 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 3.625% 2013/05/15  | 10,000,000 | 10,121,875.00 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.250% 2013/08/15  | 6,930,000  | 7,212,614.06  |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.250% 2013/11/15  | 11,250,000 | 11,707,031.25 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.000% 2014/02/15  | 10,000,000 | 10,281,250.00 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.750% 2014/05/15  | 29,400,000 | 31,439,625.00 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.250% 2014/08/15  | 12,550,000 | 13,063,765.62 |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.250% 2014/11/15  | 9,230,000  | 9,625,159.37  |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 11.250% 2015/02/15 | 1,050,000  | 1,520,367.18  |    |
| US TREASURY N/B 4.000% 2015/02/15 | 24,000,000 | 24,633,750.00                      |            |               |    |
| US TREASURY N/B 4.125% 2015/05/15 | 23,000,000 | 23,711,562.50                      |            |               |    |
| US TREASURY N/B 4.250% 2015/08/15 | 6,000,000  | 6,216,562.50                       |            |               |    |
| US TREASURY N/B 4.500% 2015/11/15 | 4,210,000  | 4,420,500.00                       |            |               |    |
| US TREASURY N/B 4.500% 2016/02/15 | 18,200,000 | 19,090,093.75                      |            |               |    |
| US TREASURY N/B 5.125% 2016/05/15 | 27,000,000 | 29,375,156.25                      |            |               |    |
| US TREASURY N/B 7.250% 2016/05/15 | 5,670,000  | 6,960,810.93                       |            |               |    |
| US TREASURY N/B 4.875% 2016/08/15 | 12,000,000 | 12,838,125.00                      |            |               |    |
| US TREASURY N/B 4.625% 2016/11/15 | 9,450,000  | 9,946,125.00                       |            |               |    |

| 通貨                                | 種類         | 銘柄                                | 券面総額          | 評価額               | 備考 |
|-----------------------------------|------------|-----------------------------------|---------------|-------------------|----|
| 米ドル                               | 国債証券       | US TREASURY N/B 7.500% 2016/11/15 | 8,250,000     | 10,312,500.00     |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.625% 2017/02/15 | 23,500,000    | 24,671,328.12     |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.500% 2017/05/15 | 25,530,000    | 26,527,265.62     |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 8.750% 2017/05/15 | 5,200,000     | 7,008,625.00      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 8.875% 2017/08/15 | 6,750,000     | 9,195,820.31      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.250% 2017/11/15 | 12,950,000    | 13,196,859.37     |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 9.125% 2018/05/15 | 7,500,000     | 10,524,609.37     |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 9.000% 2018/11/15 | 3,100,000     | 4,342,421.87      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 8.875% 2019/02/15 | 800,000       | 1,114,625.00      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 8.125% 2019/08/15 | 15,000,000    | 20,010,937.50     |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 8.500% 2020/02/15 | 8,100,000     | 11,141,296.87     |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 8.750% 2020/08/15 | 6,800,000     | 9,550,812.50      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 7.875% 2021/02/15 | 6,650,000     | 8,825,796.87      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 8.125% 2021/05/15 | 1,000,000     | 1,355,468.75      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 8.125% 2021/08/15 | 4,750,000     | 6,454,804.68      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 8.000% 2021/11/15 | 14,000,000    | 18,882,500.00     |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 7.250% 2022/08/15 | 12,000,000    | 15,348,750.00     |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 7.125% 2023/02/15 | 6,550,000     | 8,317,476.56      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 6.250% 2023/08/15 | 4,660,000     | 5,492,975.00      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 7.500% 2024/11/15 | 4,690,000     | 6,248,692.18      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 7.625% 2025/02/15 | 5,000,000     | 6,744,531.25      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 6.875% 2025/08/15 | 6,850,000     | 8,645,984.37      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 6.000% 2026/02/15 | 8,840,000     | 10,240,587.50     |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 6.500% 2026/11/15 | 5,150,000     | 6,306,335.93      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 6.625% 2027/02/15 | 2,500,000     | 3,103,125.00      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 6.125% 2027/11/15 | 25,100,000    | 29,743,500.00     |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 5.500% 2028/08/15 | 9,660,000     | 10,678,828.12     |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 5.250% 2028/11/15 | 4,140,000     | 4,445,971.87      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 5.250% 2029/02/15 | 4,650,000     | 4,995,843.75      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 6.125% 2029/08/15 | 6,200,000     | 7,409,968.74      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 6.250% 2030/05/15 | 5,320,000     | 6,488,737.50      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 5.375% 2031/02/15 | 7,390,000     | 8,130,154.68      |    |
|                                   |            | US TREASURY N/B 4.500% 2036/02/15 | 17,000,000    | 16,657,343.75     |    |
| US TREASURY N/B 4.750% 2037/02/15 | 11,150,000 | 11,367,773.43                     |               |                   |    |
| US TREASURY N/B 5.000% 2037/05/15 | 1,000,000  | 1,061,093.75                      |               |                   |    |
| US TREASURY N/B 4.375% 2038/02/15 | 6,100,000  | 5,856,000.00                      |               |                   |    |
| 米ドル小計                             |            |                                   | 1,167,080,000 | 1,258,041,829.62  |    |
|                                   |            |                                   |               | (134,333,706,566) |    |
| 英ポンド                              | 国債証券       | TREASURY 5.750% 2009/12/07        | 9,200,000     | 9,250,600.00      |    |
|                                   |            | TREASURY 4.750% 2010/06/07        | 11,990,000    | 11,857,150.80     |    |
|                                   |            | TREASURY 6.250% 2010/11/25        | 4,100,000     | 4,186,592.00      |    |
|                                   |            | TREASURY 4.250% 2011/03/07        | 1,920,000     | 1,867,046.40      |    |
|                                   |            | TREASURY 9.000% 2011/07/12        | 5,350,000     | 5,893,025.00      |    |
|                                   |            | TREASURY 5.000% 2012/03/07        | 8,230,000     | 8,151,815.00      |    |
|                                   |            | TREASURY 5.250% 2012/06/07        | 4,310,000     | 4,299,742.20      |    |
|                                   |            | TREASURY 8.000% 2013/09/27        | 3,540,000     | 3,977,190.00      |    |
|                                   |            | TREASURY 5.000% 2014/09/07        | 9,100,000     | 9,019,556.00      |    |
|                                   |            | TREASURY 4.750% 2015/09/07        | 6,300,000     | 6,164,550.00      |    |
|                                   |            | TREASURY 8.000% 2015/12/07        | 5,430,000     | 6,334,095.00      |    |
|                                   |            | TREASURY 4.000% 2016/09/07        | 7,350,000     | 6,816,390.00      |    |
|                                   |            | TREASURY 8.750% 2017/08/25        | 4,970,000     | 6,197,590.00      |    |
|                                   |            | TREASURY 5.000% 2018/03/07        | 7,850,000     | 7,775,425.00      |    |
|                                   |            | TREASURY 4.750% 2020/03/07        | 8,730,000     | 8,402,625.00      |    |
|                                   |            | TREASURY 8.000% 2021/06/07        | 9,390,000     | 11,775,060.00     |    |

| 通貨             | 種類   | 銘柄               |        |            | 券面総額        | 評価額              | 備考          |
|----------------|------|------------------|--------|------------|-------------|------------------|-------------|
| 英ポンド           | 国債証券 | TREASURY         | 5.000% | 2025/03/07 | 14,380,000  | 14,259,208.00    |             |
|                |      | TREASURY         | 4.250% | 2027/12/07 | 3,410,000   | 3,082,605.90     |             |
|                |      | TREASURY         | 6.000% | 2028/12/07 | 9,910,000   | 11,134,776.90    |             |
|                |      | TREASURY         | 4.750% | 2030/12/07 | 1,060,000   | 1,029,816.50     |             |
|                |      | TREASURY         | 4.250% | 2032/06/07 | 10,670,000  | 9,741,710.00     |             |
|                |      | TREASURY         | 4.250% | 2036/03/07 | 9,640,000   | 8,941,398.84     |             |
|                |      | TREASURY         | 4.750% | 2038/12/07 | 12,030,000  | 12,178,690.80    |             |
|                |      | TREASURY         | 4.500% | 2042/12/07 | 4,190,000   | 4,108,881.60     |             |
|                |      | TREASURY         | 4.250% | 2046/12/07 | 5,100,000   | 4,873,050.00     |             |
|                |      | TREASURY         | 4.250% | 2055/12/07 | 10,340,000  | 10,051,514.00    |             |
|                |      | 英ポンド小計           |        |            |             |                  | 188,490,000 |
|                |      |                  |        |            |             | (40,325,508,512) |             |
| カナダドル          | 国債証券 | CANADA-GOV'T     | 5.500% | 2009/06/01 | 1,590,000   | 1,629,829.50     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 4.250% | 2009/09/01 | 4,550,000   | 4,619,251.00     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 4.250% | 2009/12/01 | 4,610,000   | 4,688,323.90     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 5.500% | 2010/06/01 | 9,230,000   | 9,656,887.50     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 4.000% | 2010/09/01 | 3,640,000   | 3,710,215.60     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 2.750% | 2010/12/01 | 1,090,000   | 1,079,241.70     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 6.000% | 2011/06/01 | 6,600,000   | 7,125,954.00     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 3.750% | 2011/09/01 | 6,200,000   | 6,302,486.00     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 5.250% | 2012/06/01 | 8,030,000   | 8,614,423.40     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 5.250% | 2013/06/01 | 8,850,000   | 9,616,233.00     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 5.000% | 2014/06/01 | 2,300,000   | 2,493,108.00     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 4.500% | 2015/06/01 | 10,490,000  | 11,134,820.30    |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 4.000% | 2016/06/01 | 5,470,000   | 5,614,517.40     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 4.000% | 2017/06/01 | 4,400,000   | 4,496,800.00     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 4.250% | 2018/06/01 | 2,150,000   | 2,228,518.00     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 8.000% | 2023/06/01 | 6,700,000   | 9,672,522.00     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 8.000% | 2027/06/01 | 5,630,000   | 8,460,369.90     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 5.750% | 2029/06/01 | 6,960,000   | 8,513,472.00     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 5.750% | 2033/06/01 | 7,840,000   | 9,791,140.80     |             |
|                |      | CANADA-GOV'T     | 5.000% | 2037/06/01 | 7,060,000   | 8,104,880.00     |             |
| カナダドル小計        |      |                  |        |            | 113,390,000 | 127,552,994.00   |             |
|                |      |                  |        |            |             | (13,310,154,923) |             |
| デンマーク<br>クローネ  | 国債証券 | DENMARK - BULLET | 6.000% | 2009/11/15 | 34,700,000  | 35,119,870.00    |             |
|                |      | DENMARK - BULLET | 4.000% | 2010/11/15 | 23,640,000  | 23,122,284.00    |             |
|                |      | DENMARK - BULLET | 6.000% | 2011/11/15 | 30,490,000  | 31,755,335.00    |             |
|                |      | DENMARK - BULLET | 5.000% | 2013/11/15 | 39,660,000  | 39,941,586.00    |             |
|                |      | DENMARK - BULLET | 4.000% | 2015/11/15 | 34,990,000  | 33,397,955.00    |             |
|                |      | DENMARK - BULLET | 4.000% | 2017/11/15 | 28,640,000  | 27,293,920.00    |             |
|                |      | DENMARK - BULLET | 7.000% | 2024/11/10 | 13,860,000  | 17,091,874.80    |             |
|                |      | デンマーククローネ小計      |        |            |             |                  | 205,980,000 |
|                |      |                  |        |            |             | (4,632,218,993)  |             |
| スウェーデン<br>クローナ | 国債証券 | SWEDEN GOVT      | 4.000% | 2009/12/01 | 29,060,000  | 28,754,870.00    |             |
|                |      | SWEDEN GOVT      | 5.250% | 2011/03/15 | 30,110,000  | 30,528,529.00    |             |
|                |      | SWEDEN GOVT      | 5.500% | 2012/10/08 | 31,100,000  | 32,151,180.00    |             |
|                |      | SWEDEN GOVT      | 6.750% | 2014/05/05 | 32,080,000  | 35,740,328.00    |             |
|                |      | SWEDEN GOVT      | 4.500% | 2015/08/12 | 21,940,000  | 21,970,716.00    |             |
|                |      | SWEDEN GOVT      | 3.000% | 2016/07/12 | 20,580,000  | 18,626,958.00    |             |
|                |      | SWEDEN GOVT      | 3.750% | 2017/08/12 | 25,700,000  | 24,543,500.00    |             |
|                |      | SWEDEN GOVT      | 4.250% | 2019/03/12 | 17,880,000  | 17,742,324.00    |             |
|                |      | SWEDEN GOVT      | 5.000% | 2020/12/01 | 30,110,000  | 32,190,601.00    |             |
|                |      | スウェーデンクローナ小計     |        |            |             |                  | 238,560,000 |
|                |      |                  |        |            |             | (4,314,454,796)  |             |

| 通貨            | 種類                   | 銘柄               |            |            | 券面総額          | 評価額             | 備考            |
|---------------|----------------------|------------------|------------|------------|---------------|-----------------|---------------|
| ノルウェー<br>クローネ | 国債証券                 | NORWEGIAN GOV'T  | 6.000%     | 2011/05/16 | 23,790,000    | 24,134,955.00   |               |
|               |                      | NORWEGIAN GOV'T  | 6.500%     | 2013/05/15 | 27,600,000    | 29,222,880.00   |               |
|               |                      | NORWEGIAN GOV'T  | 5.000%     | 2015/05/15 | 17,250,000    | 17,310,375.00   |               |
|               |                      | NORWEGIAN GOV'T  | 4.250%     | 2017/05/19 | 14,710,000    | 14,070,115.00   |               |
|               | ノルウェークローネ小計          |                  |            |            |               | 83,350,000      | 84,738,325.00 |
|               |                      |                  |            |            |               | (1,773,573,142) |               |
| シンガポ<br>ールドル  | 国債証券                 | SPR GOV'T        | 2.375%     | 2009/10/01 | 2,480,000     | 2,524,044.80    |               |
|               |                      | SPR GOV'T        | 2.625%     | 2010/04/01 | 1,800,000     | 1,846,962.00    |               |
|               |                      | SPR GOV'T        | 4.625%     | 2010/07/01 | 2,150,000     | 2,292,308.50    |               |
|               |                      | SPR GOV'T        | 3.125%     | 2011/02/01 | 650,000       | 675,135.50      |               |
|               |                      | SPR GOV'T        | 3.625%     | 2011/07/01 | 2,700,000     | 2,845,152.00    |               |
|               |                      | SPR GOV'T        | 2.625%     | 2012/04/01 | 200,000       | 203,626.00      |               |
|               |                      | SPR GOV'T        | 3.500%     | 2012/07/01 | 2,100,000     | 2,193,576.00    |               |
|               |                      | SPR GOV'T        | 2.500%     | 2012/10/01 | 2,360,000     | 2,359,079.60    |               |
|               |                      | SPR GOV'T        | 1.625%     | 2013/04/01 | 1,260,000     | 1,202,594.40    |               |
|               |                      | SPR GOV'T        | 2.250%     | 2013/07/01 | 900,000       | 885,276.00      |               |
|               |                      | SPR GOV'T        | 3.625%     | 2014/07/01 | 2,960,000     | 3,063,836.80    |               |
|               |                      | SPR GOV'T        | 3.750%     | 2016/09/01 | 2,870,000     | 2,945,308.80    |               |
|               |                      | SPR GOV'T        | 4.000%     | 2018/09/01 | 1,450,000     | 1,500,895.00    |               |
|               |                      | SPR GOV'T        | 3.250%     | 2020/09/01 | 1,330,000     | 1,268,673.70    |               |
|               |                      | SPR GOV'T        | 3.125%     | 2022/09/01 | 1,220,000     | 1,124,230.00    |               |
|               | SPR GOV'T            | 3.500%           | 2027/03/01 | 1,940,000  | 1,813,667.20  |                 |               |
| シンガポール小計      |                      |                  |            |            | 28,370,000    | 28,744,366.30   |               |
|               |                      |                  |            |            |               | (2,243,785,233) |               |
| ポーランド<br>ズロチ  | 国債証券                 | POLAND GOVT BOND | 5.750%     | 2010/03/24 | 17,020,000    | 16,704,108.80   |               |
|               |                      | POLAND GOVT BOND | 6.000%     | 2010/11/24 | 20,860,000    | 20,465,746.00   |               |
|               |                      | POLAND GOVT BOND | 4.250%     | 2011/05/24 | 16,940,000    | 15,802,987.20   |               |
|               |                      | POLAND GOVT BOND | 4.750%     | 2012/04/25 | 17,000,000    | 15,851,820.00   |               |
|               |                      | POLAND GOVT BOND | 5.250%     | 2013/04/25 | 5,890,000     | 5,530,592.20    |               |
|               |                      | POLAND GOVT BOND | 5.000%     | 2013/10/24 | 13,530,000    | 12,537,439.20   |               |
|               |                      | POLAND GOVT BOND | 6.250%     | 2015/10/24 | 15,590,000    | 15,323,878.70   |               |
|               |                      | POLAND GOVT BOND | 5.250%     | 2017/10/25 | 10,480,000    | 9,633,006.40    |               |
|               | POLAND GOVT BOND     | 5.750%           | 2022/09/23 | 11,600,000 | 10,928,708.00 |                 |               |
| ポーランドズロチ小計    |                      |                  |            |            | 128,910,000   | 122,778,286.50  |               |
|               |                      |                  |            |            |               | (6,104,536,404) |               |
| ユーロ           | 国債証券<br>(アイルラ<br>ンド) | IRISH GOVT       | 5.000%     | 2013/04/18 | 3,510,000     | 3,547,416.60    |               |
|               |                      | IRISH GOVT       | 4.600%     | 2016/04/18 | 2,970,000     | 2,947,160.70    |               |
|               |                      | IRISH GOVT       | 4.500%     | 2018/10/18 | 3,500,000     | 3,407,810.00    |               |
|               |                      | IRISH GOVT       | 4.400%     | 2019/06/18 | 4,280,000     | 4,108,586.00    |               |
|               |                      | IRISH GOVT       | 4.500%     | 2020/04/18 | 3,740,000     | 3,609,100.00    |               |
|               | 国債証券<br>(イタリア)       | BTPS             | 4.250%     | 2009/11/01 | 25,210,000    | 25,014,874.60   |               |
|               |                      | BTPS             | 3.000%     | 2010/01/15 | 1,460,000     | 1,418,550.60    |               |
|               |                      | BTPS             | 4.000%     | 2010/03/01 | 5,210,000     | 5,137,581.00    |               |
|               |                      | BTPS             | 2.750%     | 2010/06/15 | 23,110,000    | 22,153,246.00   |               |
|               |                      | BTPS             | 5.500%     | 2010/11/01 | 15,010,000    | 15,196,124.00   |               |
|               |                      | BTPS             | 3.750%     | 2011/02/01 | 7,940,000     | 7,702,594.00    |               |
|               |                      | BTPS             | 3.500%     | 2011/03/15 | 10,760,000    | 10,383,400.00   |               |
|               |                      | BTPS             | 5.250%     | 2011/08/01 | 20,670,000    | 20,835,360.00   |               |
|               |                      | BTPS             | 3.750%     | 2011/09/15 | 4,500,000     | 4,340,250.00    |               |
|               |                      | BTPS             | 5.000%     | 2012/02/01 | 14,510,000    | 14,544,824.00   |               |
|               |                      | BTPS             | 4.000%     | 2012/04/15 | 10,730,000    | 10,382,348.00   |               |
|               |                      | BTPS             | 4.250%     | 2012/10/15 | 8,050,000     | 7,831,040.00    |               |
|               |                      | BTPS             | 4.750%     | 2013/02/01 | 10,240,000    | 10,169,344.00   |               |
|               |                      | BTPS             | 4.250%     | 2013/08/01 | 15,880,000    | 15,430,596.00   |               |

| 通貨                                 | 種類                                 | 銘柄                               | 券面総額                               | 評価額           | 備考           |  |
|------------------------------------|------------------------------------|----------------------------------|------------------------------------|---------------|--------------|--|
| ユーロ                                | 国債証券<br>(イタリア)                     | BTPS 4.250% 2014/08/01           | 10,600,000                         | 10,280,940.00 |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 4.250% 2015/02/01           | 10,550,000                         | 10,209,235.00 |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 3.750% 2015/08/01           | 17,160,000                         | 15,965,664.00 |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 3.750% 2016/08/01           | 8,840,000                          | 8,192,912.00  |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 4.000% 2017/02/01           | 15,370,000                         | 14,404,764.00 |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 5.250% 2017/08/01           | 15,580,000                         | 15,992,870.00 |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 4.500% 2018/02/01           | 6,610,000                          | 6,377,328.00  |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 4.500% 2018/08/01           | 6,030,000                          | 5,782,770.00  |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 4.250% 2019/02/01           | 16,850,000                         | 15,865,960.00 |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 4.500% 2020/02/01           | 9,820,000                          | 9,378,100.00  |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 3.750% 2021/08/01           | 9,270,000                          | 8,129,790.00  |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 9.000% 2023/11/01           | 6,790,000                          | 9,539,950.00  |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 7.250% 2026/11/01           | 6,020,000                          | 7,544,866.00  |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 6.500% 2027/11/01           | 14,850,000                         | 17,263,125.00 |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 5.250% 2029/11/01           | 14,970,000                         | 15,107,724.00 |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 6.000% 2031/05/01           | 12,330,000                         | 13,617,252.00 |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 5.750% 2033/02/01           | 11,900,000                         | 12,799,283.00 |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 5.000% 2034/08/01           | 10,450,000                         | 10,198,155.00 |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 4.000% 2037/02/01           | 14,410,000                         | 11,873,840.00 |              |  |
|                                    |                                    | BTPS 5.000% 2039/08/01           | 3,600,000                          | 3,489,480.00  |              |  |
|                                    | 国債証券<br>(オーストリア)                   | REP OF AUSTRIA 4.000% 2009/07/15 | 4,480,000                          | 4,446,400.00  |              |  |
|                                    |                                    | REP OF AUSTRIA 5.500% 2010/01/15 | 5,340,000                          | 5,397,138.00  |              |  |
|                                    |                                    | REP OF AUSTRIA 5.250% 2011/01/04 | 4,890,000                          | 4,954,059.00  |              |  |
|                                    |                                    | REP OF AUSTRIA 5.000% 2012/07/15 | 5,940,000                          | 6,002,370.00  |              |  |
|                                    |                                    | REP OF AUSTRIA 3.800% 2013/10/20 | 6,800,000                          | 6,538,200.00  |              |  |
|                                    |                                    | REP OF AUSTRIA 4.300% 2014/07/15 | 5,660,000                          | 5,563,214.00  |              |  |
|                                    |                                    | REP OF AUSTRIA 3.500% 2015/07/15 | 3,830,000                          | 3,571,858.00  |              |  |
|                                    |                                    | REP OF AUSTRIA 4.000% 2016/09/15 | 8,350,000                          | 7,961,725.00  |              |  |
|                                    |                                    | REP OF AUSTRIA 4.300% 2017/09/15 | 2,200,000                          | 2,134,880.00  |              |  |
|                                    |                                    | REP OF AUSTRIA 4.650% 2018/01/15 | 5,440,000                          | 5,437,824.00  |              |  |
|                                    |                                    | REP OF AUSTRIA 4.350% 2019/03/15 | 2,260,000                          | 2,187,002.00  |              |  |
|                                    |                                    | REP OF AUSTRIA 3.900% 2020/07/15 | 4,010,000                          | 3,689,601.00  |              |  |
|                                    |                                    | REP OF AUSTRIA 3.500% 2021/09/15 | 6,110,000                          | 5,357,248.00  |              |  |
|                                    |                                    | REP OF AUSTRIA 6.250% 2027/07/15 | 3,730,000                          | 4,373,052.00  |              |  |
|                                    |                                    | REP OF AUSTRIA 4.150% 2037/03/15 | 3,240,000                          | 2,898,180.00  |              |  |
|                                    |                                    | 国債証券<br>(オランダ)                   | NETHERLANDS GOVT 3.750% 2009/07/15 | 6,630,000     | 6,560,385.00 |  |
|                                    |                                    |                                  | NETHERLANDS GOVT 3.000% 2010/01/15 | 6,670,000     | 6,490,577.00 |  |
|                                    | NETHERLANDS GOVT 5.500% 2010/07/15 |                                  | 7,100,000                          | 7,206,500.00  |              |  |
|                                    | NETHERLANDS GOVT 4.000% 2011/01/15 |                                  | 1,800,000                          | 1,768,680.00  |              |  |
|                                    | NETHERLANDS GOVT 5.000% 2011/07/15 |                                  | 7,170,000                          | 7,227,360.00  |              |  |
|                                    | NETHERLANDS GOVT 5.000% 2012/07/15 |                                  | 6,600,000                          | 6,665,340.00  |              |  |
|                                    | NETHERLANDS GOVT 4.250% 2013/07/15 |                                  | 11,190,000                         | 10,975,152.00 |              |  |
|                                    | NETHERLANDS GOVT 3.750% 2014/07/15 |                                  | 1,840,000                          | 1,754,808.00  |              |  |
|                                    | NETHERLANDS GOVT 3.250% 2015/07/15 |                                  | 6,280,000                          | 5,766,924.00  |              |  |
|                                    | NETHERLANDS GOVT 4.000% 2016/07/15 |                                  | 8,210,000                          | 7,840,550.00  |              |  |
|                                    | NETHERLANDS GOVT 4.500% 2017/07/15 |                                  | 4,540,000                          | 4,476,440.00  |              |  |
|                                    | NETHERLANDS GOVT 4.000% 2018/07/15 |                                  | 4,100,000                          | 3,866,300.00  |              |  |
| NETHERLANDS GOVT 3.750% 2023/01/15 | 1,320,000                          |                                  | 1,171,896.00                       |               |              |  |
| NETHERLANDS GOVT 7.500% 2023/01/15 | 4,700,000                          |                                  | 6,016,000.00                       |               |              |  |
| NETHERLANDS GOVT 5.500% 2028/01/15 | 5,050,000                          |                                  | 5,491,875.00                       |               |              |  |
| NETHERLANDS GOVT 4.000% 2037/01/15 | 7,510,000                          |                                  | 6,627,575.00                       |               |              |  |
| 国債証券<br>(ギリシャ)                     | HELLENIC REPUBLI 3.400% 2009/06/21 |                                  | 1,500,000                          | 1,478,550.00  |              |  |
|                                    | HELLENIC REPUBLI 3.100% 2010/04/20 | 7,250,000                        | 7,014,375.00                       |               |              |  |
|                                    | HELLENIC REPUBLI 6.000% 2010/05/19 | 6,210,000                        | 6,322,401.00                       |               |              |  |

| 通貨                                | 種類                                 | 銘柄                                 | 券面総額          | 評価額           | 備考 |
|-----------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|---------------|---------------|----|
| ユーロ                               | 国債証券<br>(ギリシャ)                     | HELLENIC REPUBLI 3.800% 2011/03/20 | 1,060,000     | 1,027,246.00  |    |
|                                   |                                    | HELLENIC REPUBLI 5.350% 2011/05/18 | 2,450,000     | 2,468,130.00  |    |
|                                   |                                    | HELLENIC REPUBLI 3.900% 2011/08/20 | 8,890,000     | 8,599,297.00  |    |
|                                   |                                    | HELLENIC REPUBLI 5.250% 2012/05/18 | 5,450,000     | 5,503,410.00  |    |
|                                   |                                    | HELLENIC REPUBLI 4.600% 2013/05/20 | 4,780,000     | 4,684,878.00  |    |
|                                   |                                    | HELLENIC REPUBLI 6.500% 2014/01/11 | 3,780,000     | 4,047,624.00  |    |
|                                   |                                    | HELLENIC REPUBLI 4.500% 2014/05/20 | 2,700,000     | 2,635,200.00  |    |
|                                   |                                    | HELLENIC REPUBLI 3.700% 2015/07/20 | 12,760,000    | 11,842,556.00 |    |
|                                   |                                    | HELLENIC REPUBLI 3.600% 2016/07/20 | 1,220,000     | 1,111,298.00  |    |
|                                   |                                    | HELLENIC REPUBLI 4.300% 2017/07/20 | 2,110,000     | 2,014,417.00  |    |
|                                   |                                    | HELLENIC REPUBLI 6.500% 2019/10/22 | 7,170,000     | 8,049,759.00  |    |
|                                   |                                    | HELLENIC REPUBLI 5.900% 2022/10/22 | 4,420,000     | 4,734,704.00  |    |
|                                   |                                    | HELLENIC REPUBLI 4.700% 2024/03/20 | 6,560,000     | 6,176,896.00  |    |
|                                   |                                    | HELLENIC REPUBLI 4.500% 2037/09/20 | 5,280,000     | 4,621,584.00  |    |
|                                   | HELLENIC REPUBLI 4.600% 2040/09/20 | 5,050,000                          | 4,461,675.00  |               |    |
|                                   | 国債証券<br>(スペイン)                     | SPANISH GOV'T 5.150% 2009/07/30    | 12,000,000    | 12,046,800.00 |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 4.000% 2010/01/31    | 6,980,000     | 6,895,542.00  |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 3.250% 2010/07/30    | 3,000,000     | 2,910,900.00  |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 4.100% 2011/04/30    | 4,100,000     | 4,024,314.00  |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 5.400% 2011/07/30    | 6,900,000     | 7,022,820.00  |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 5.350% 2011/10/31    | 8,350,000     | 8,501,135.00  |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 5.000% 2012/07/30    | 8,530,000     | 8,611,035.00  |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 3.900% 2012/10/31    | 4,640,000     | 4,484,606.40  |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 6.150% 2013/01/31    | 6,980,000     | 7,385,538.00  |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 4.200% 2013/07/30    | 700,000       | 684,670.00    |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 4.750% 2014/07/30    | 9,560,000     | 9,617,360.00  |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 4.400% 2015/01/31    | 13,270,000    | 13,074,931.00 |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 3.150% 2016/01/31    | 1,790,000     | 1,615,117.00  |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 3.800% 2017/01/31    | 8,890,000     | 8,303,615.60  |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 5.500% 2017/07/30    | 7,760,000     | 8,179,816.00  |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 4.100% 2018/07/30    | 4,120,000     | 3,902,052.00  |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 6.000% 2029/01/31    | 6,980,000     | 7,898,568.00  |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 5.750% 2032/07/30    | 7,680,000     | 8,527,872.00  |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 4.200% 2037/01/31    | 6,920,000     | 6,128,352.00  |    |
|                                   |                                    | SPANISH GOV'T 4.900% 2040/07/30    | 3,350,000     | 3,321,525.00  |    |
|                                   | 国債証券<br>(ドイツ)                      | DEUTSCHLAND REP 4.500% 2009/07/04  | 23,700,000    | 23,643,120.00 |    |
|                                   |                                    | BUNDESUBL-145 3.500% 2009/10/09    | 17,060,000    | 16,795,570.00 |    |
|                                   |                                    | DEUTSCHLAND REP 5.375% 2010/01/04  | 10,460,000    | 10,561,462.00 |    |
|                                   |                                    | BUNDESUBL-146 3.250% 2010/04/09    | 15,700,000    | 15,312,210.00 |    |
|                                   |                                    | DEUTSCHLAND REP 5.250% 2010/07/04  | 10,400,000    | 10,538,320.00 |    |
|                                   |                                    | BUNDESUBL-147 2.500% 2010/10/08    | 18,410,000    | 17,598,119.00 |    |
|                                   |                                    | DEUTSCHLAND REP 5.250% 2011/01/04  | 15,690,000    | 15,958,299.00 |    |
|                                   |                                    | BUNDESUBL-148 3.500% 2011/04/08    | 15,640,000    | 15,209,900.00 |    |
|                                   |                                    | DEUTSCHLAND REP 5.000% 2011/07/04  | 23,200,000    | 23,466,800.00 |    |
| BUNDESUBL-149 3.500% 2011/10/14   |                                    | 6,410,000                          | 6,197,829.00  |               |    |
| DEUTSCHLAND REP 5.000% 2012/01/04 |                                    | 18,700,000                         | 18,954,320.00 |               |    |
| BUNDESUBL-150 4.000% 2012/04/13   |                                    | 6,190,000                          | 6,061,248.00  |               |    |
| DEUTSCHLAND REP 5.000% 2012/07/04 |                                    | 17,500,000                         | 17,745,000.00 |               |    |
| BUNDESUBL-151 4.250% 2012/10/12   |                                    | 470,000                            | 463,467.00    |               |    |
| DEUTSCHLAND REP 4.500% 2013/01/04 |                                    | 9,220,000                          | 9,192,340.00  |               |    |
| BUNDESUBL-152 3.500% 2013/04/12   |                                    | 5,000,000                          | 4,779,000.00  |               |    |
| DEUTSCHLAND REP 3.750% 2013/07/04 |                                    | 7,750,000                          | 7,485,725.00  |               |    |
| DEUTSCHLAND REP 4.250% 2014/01/04 |                                    | 13,950,000                         | 13,779,810.00 |               |    |
| DEUTSCHLAND REP 4.250% 2014/07/04 | 8,350,000                          | 8,253,975.00                       |               |               |    |

| 通貨                              | 種類                                | 銘柄                                | 券面総額          | 評価額           | 備考 |
|---------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|---------------|---------------|----|
| ユーロ                             | 国債証券<br>(ドイツ)                     | DEUTSCHLAND REP 3.750% 2015/01/04 | 30,230,000    | 29,141,720.00 |    |
|                                 |                                   | DEUTSCHLAND REP 3.250% 2015/07/04 | 7,710,000     | 7,134,063.00  |    |
|                                 |                                   | DEUTSCHLAND REP 3.500% 2016/01/04 | 12,600,000    | 11,932,200.00 |    |
|                                 |                                   | DEUTSCHLAND REP 6.000% 2016/06/20 | 16,050,000    | 17,754,510.00 |    |
|                                 |                                   | DEUTSCHLAND REP 4.000% 2016/07/04 | 7,300,000     | 7,108,010.00  |    |
|                                 |                                   | DEUTSCHLAND REP 3.750% 2017/01/04 | 8,860,000     | 8,453,326.00  |    |
|                                 |                                   | DEUTSCHLAND REP 4.250% 2017/07/04 | 10,010,000    | 9,850,841.00  |    |
|                                 |                                   | DEUTSCHLAND REP 4.000% 2018/01/04 | 7,650,000     | 7,374,753.00  |    |
|                                 |                                   | DEUTSCHLAND REP 6.250% 2024/01/04 | 7,370,000     | 8,584,281.20  |    |
|                                 |                                   | DEUTSCHLAND REP 6.500% 2027/07/04 | 8,200,000     | 9,984,402.00  |    |
|                                 |                                   | DEUTSCHLAND REP 5.625% 2028/01/04 | 970,000       | 1,075,594.20  |    |
|                                 |                                   | DEUTSCHLAND REP 4.750% 2028/07/04 | 13,600,000    | 13,659,840.00 |    |
|                                 |                                   | DEUTSCHLAND REP 6.250% 2030/01/04 | 2,190,000     | 2,615,976.90  |    |
|                                 |                                   | DEUTSCHLAND REP 5.500% 2031/01/04 | 10,460,000    | 11,487,799.60 |    |
|                                 |                                   | DEUTSCHLAND REP 4.750% 2034/07/04 | 10,120,000    | 10,114,940.00 |    |
|                                 |                                   | DEUTSCHLAND REP 4.000% 2037/01/04 | 13,450,000    | 11,962,430.00 |    |
|                                 | DEUTSCHLAND REP 4.250% 2039/07/04 | 7,960,000                         | 7,357,348.40  |               |    |
|                                 | 国債証券<br>(フィンランド)                  | FINNISH GOV'T 2.750% 2010/09/15   | 2,240,000     | 2,150,400.00  |    |
|                                 |                                   | FINNISH GOV'T 5.750% 2011/02/23   | 4,050,000     | 4,158,135.00  |    |
|                                 |                                   | FINNISH GOV'T 4.250% 2012/09/15   | 2,070,000     | 2,035,638.00  |    |
|                                 |                                   | FINNISH GOV'T 5.375% 2013/07/04   | 3,390,000     | 3,498,141.00  |    |
|                                 |                                   | FINNISH GOV'T 4.250% 2015/07/04   | 3,600,000     | 3,537,720.00  |    |
|                                 |                                   | FINNISH GOV'T 3.875% 2017/09/15   | 2,990,000     | 2,814,786.00  |    |
|                                 | FINNISH GOV'T 4.375% 2019/07/04   | 2,240,000                         | 2,172,800.00  |               |    |
|                                 | 国債証券<br>(フランス)                    | BTAN-5YR ISSUE 3.500% 2009/07/12  | 2,000,000     | 1,974,200.00  |    |
|                                 |                                   | FRANCE O.A.T. 4.000% 2009/10/25   | 33,670,000    | 33,319,832.00 |    |
|                                 |                                   | BTAN-5YR ISSUE 3.000% 2010/01/12  | 3,570,000     | 3,473,967.00  |    |
|                                 |                                   | FRANCE O.A.T. 5.500% 2010/04/25   | 3,300,000     | 3,341,580.00  |    |
|                                 |                                   | BTAN-5YR ISSUE 2.500% 2010/07/12  | 1,330,000     | 1,272,411.00  |    |
|                                 |                                   | FRANCE O.A.T. 5.500% 2010/10/25   | 26,650,000    | 27,113,710.00 |    |
|                                 |                                   | BTAN-5YR ISSUE 3.000% 2011/01/12  | 8,840,000     | 8,483,748.00  |    |
|                                 |                                   | FRANCE O.A.T. 6.500% 2011/04/25   | 9,720,000     | 10,177,812.00 |    |
|                                 |                                   | BTAN-5YR ISSUE 3.500% 2011/07/12  | 17,640,000    | 17,056,116.00 |    |
|                                 |                                   | BTAN-5YR ISSUE 3.750% 2012/01/12  | 10,680,000    | 10,359,600.00 |    |
|                                 |                                   | FRANCE O.A.T. 5.000% 2012/04/25   | 9,700,000     | 9,789,240.00  |    |
|                                 |                                   | BTAN-5YR ISSUE 4.500% 2012/07/12  | 9,120,000     | 9,041,568.00  |    |
|                                 |                                   | FRANCE O.A.T. 4.750% 2012/10/25   | 7,750,000     | 7,757,750.00  |    |
|                                 |                                   | FRANCE O.A.T. 8.500% 2012/12/26   | 6,170,000     | 7,108,703.80  |    |
|                                 |                                   | BTAN-5YR ISSUE 3.750% 2013/01/12  | 2,570,000     | 2,469,513.00  |    |
|                                 |                                   | FRANCE O.A.T. 4.000% 2013/04/25   | 12,720,000    | 12,348,576.00 |    |
|                                 |                                   | FRANCE O.A.T. 4.000% 2013/10/25   | 10,700,000    | 10,359,740.00 |    |
|                                 |                                   | FRANCE O.A.T. 4.000% 2014/04/25   | 10,820,000    | 10,495,400.00 |    |
|                                 |                                   | FRANCE O.A.T. 4.000% 2014/10/25   | 2,170,000     | 2,101,428.00  |    |
| FRANCE O.A.T. 3.500% 2015/04/25 |                                   | 20,240,000                        | 18,944,640.00 |               |    |
| FRANCE O.A.T. 3.000% 2015/10/25 |                                   | 2,100,000                         | 1,888,530.00  |               |    |
| FRANCE O.A.T. 3.250% 2016/04/25 |                                   | 10,990,000                        | 9,999,801.00  |               |    |
| FRANCE O.A.T. 5.000% 2016/10/25 |                                   | 8,750,000                         | 8,960,875.00  |               |    |
| FRANCE O.A.T. 3.750% 2017/04/25 |                                   | 21,240,000                        | 19,850,904.00 |               |    |
| FRANCE O.A.T. 4.250% 2017/10/25 |                                   | 9,380,000                         | 9,097,662.00  |               |    |
| FRANCE O.A.T. 4.000% 2018/04/25 |                                   | 6,000,000                         | 5,668,200.00  |               |    |
| FRANCE O.A.T. 4.250% 2019/04/25 | 11,300,000                        | 10,896,590.00                     |               |               |    |
| FRANCE O.A.T. 8.500% 2019/10/25 | 7,880,000                         | 10,441,709.20                     |               |               |    |
| FRANCE O.A.T. 3.750% 2021/04/25 | 8,350,000                         | 7,623,550.00                      |               |               |    |
| FRANCE O.A.T. 8.500% 2023/04/25 | 4,640,000                         | 6,425,193.60                      |               |               |    |

| 通貨              | 種類              | 銘柄              |            |            | 券面総額          | 評価額               | 備考            |
|-----------------|-----------------|-----------------|------------|------------|---------------|-------------------|---------------|
| ユーロ             | 国債証券<br>(フランス)  | FRANCE O.A.T.   | 6.000%     | 2025/10/25 | 9,450,000     | 10,659,600.00     |               |
|                 |                 | FRANCE O.A.T.   | 5.500%     | 2029/04/25 | 9,090,000     | 9,878,921.10      |               |
|                 |                 | FRANCE O.A.T.   | 5.750%     | 2032/10/25 | 9,760,000     | 10,994,542.40     |               |
|                 |                 | FRANCE O.A.T.   | 4.750%     | 2035/04/25 | 10,670,000    | 10,539,612.60     |               |
|                 |                 | FRANCE O.A.T.   | 4.000%     | 2038/10/25 | 2,600,000     | 2,255,240.00      |               |
|                 |                 | FRANCE O.A.T.   | 4.000%     | 2055/04/25 | 10,850,000    | 9,238,775.00      |               |
|                 | 国債証券<br>(ベルギー)  | BELGIAN 0305    | 3.000%     | 2010/03/28 | 7,080,000     | 6,869,016.00      |               |
|                 |                 | BELGIAN 0295    | 5.750%     | 2010/09/28 | 6,670,000     | 6,802,733.00      |               |
|                 |                 | BELGIAN 0313    | 3.500%     | 2011/03/28 | 2,520,000     | 2,434,320.00      |               |
|                 |                 | BELGIAN 0296    | 5.000%     | 2011/09/28 | 4,060,000     | 4,081,924.00      |               |
|                 |                 | BELGIAN 0298    | 5.000%     | 2012/09/28 | 8,900,000     | 8,978,320.00      |               |
|                 |                 | BELGIAN 0262    | 8.000%     | 2012/12/24 | 2,340,000     | 2,640,924.00      |               |
|                 |                 | BELGIAN 0310    | 4.000%     | 2013/03/28 | 7,880,000     | 7,619,172.00      |               |
|                 |                 | BELGIAN 0301    | 4.250%     | 2013/09/28 | 13,160,000    | 12,859,952.00     |               |
|                 |                 | BELGIAN 0314    | 4.000%     | 2014/03/28 | 3,360,000     | 3,236,688.00      |               |
|                 |                 | BELGIAN 0303    | 4.250%     | 2014/09/28 | 690,000       | 673,785.00        |               |
|                 |                 | BELGIAN 0282    | 8.000%     | 2015/03/28 | 3,870,000     | 4,600,269.00      |               |
|                 |                 | BELGIAN 0306    | 3.750%     | 2015/09/28 | 8,680,000     | 8,186,108.00      |               |
|                 |                 | BELGIAN 0307    | 3.250%     | 2016/09/28 | 6,220,000     | 5,606,086.00      |               |
|                 |                 | BELGIAN 0309    | 4.000%     | 2017/03/28 | 860,000       | 814,162.00        |               |
|                 |                 | BELGIAN 0300    | 5.500%     | 2017/09/28 | 7,200,000     | 7,612,560.00      |               |
|                 |                 | BELGIAN 0312    | 4.000%     | 2018/03/28 | 4,120,000     | 3,869,092.00      |               |
|                 |                 | BELGIAN 0308    | 4.000%     | 2022/03/28 | 4,170,000     | 3,800,955.00      |               |
|                 |                 | BELGIAN 0291    | 5.500%     | 2028/03/28 | 7,040,000     | 7,546,880.00      |               |
|                 | BELGIAN 0304    | 5.000%          | 2035/03/28 | 8,230,000  | 8,273,701.30  |                   |               |
|                 | 国債証券<br>(ポルトガル) | PORTUGUESE OT'S | 3.950%     | 2009/07/15 | 3,340,000     | 3,308,370.20      |               |
|                 |                 | PORTUGUESE OT'S | 5.850%     | 2010/05/20 | 3,380,000     | 3,440,873.80      |               |
|                 |                 | PORTUGUESE OT'S | 3.200%     | 2011/04/15 | 3,260,000     | 3,118,548.60      |               |
|                 |                 | PORTUGUESE OT'S | 5.150%     | 2011/06/15 | 3,280,000     | 3,308,011.20      |               |
|                 |                 | PORTUGUESE OT'S | 5.000%     | 2012/06/15 | 3,160,000     | 3,176,526.80      |               |
|                 |                 | PORTUGUESE OT'S | 5.450%     | 2013/09/23 | 4,210,000     | 4,336,510.50      |               |
|                 |                 | PORTUGUESE OT'S | 4.375%     | 2014/06/16 | 2,430,000     | 2,383,173.90      |               |
|                 |                 | PORTUGUESE OT'S | 3.350%     | 2015/10/15 | 3,430,000     | 3,143,286.30      |               |
|                 |                 | PORTUGUESE OT'S | 4.200%     | 2016/10/15 | 2,810,000     | 2,697,628.10      |               |
| PORTUGUESE OT'S |                 | 4.350%          | 2017/10/16 | 2,900,000  | 2,793,889.00  |                   |               |
| PORTUGUESE OT'S |                 | 4.450%          | 2018/06/15 | 2,240,000  | 2,158,867.20  |                   |               |
| PORTUGUESE OT'S |                 | 3.850%          | 2021/04/15 | 3,930,000  | 3,531,576.60  |                   |               |
| PORTUGUESE OT'S |                 | 4.100%          | 2037/04/15 | 3,460,000  | 2,973,143.40  |                   |               |
| ユーロ小計           |                 |                 |            |            | 1,737,810,000 | 1,726,766,358.40  |               |
|                 |                 |                 |            |            |               | (287,247,583,719) |               |
| スイス<br>フラン      | 国債証券            | SWISS (GOVT)    | 3.500%     | 2010/08/07 | 5,490,000     | 5,558,625.00      |               |
|                 |                 | SWISS (GOVT)    | 4.000%     | 2011/06/10 | 6,960,000     | 7,161,840.00      |               |
|                 |                 | SWISS (GOVT)    | 2.750%     | 2012/06/10 | 860,000       | 853,034.00        |               |
|                 |                 | SWISS (GOVT)    | 4.000%     | 2013/02/11 | 5,610,000     | 5,834,400.00      |               |
|                 |                 | SWISS (GOVT)    | 4.250%     | 2014/01/06 | 440,000       | 465,256.00        |               |
|                 |                 | SWISS (GOVT)    | 2.500%     | 2016/03/12 | 1,270,000     | 1,215,390.00      |               |
|                 |                 | SWISS (GOVT)    | 4.250%     | 2017/06/05 | 7,530,000     | 8,063,877.00      |               |
|                 |                 | SWISS (GOVT)    | 3.000%     | 2018/01/08 | 1,550,000     | 1,512,800.00      |               |
|                 |                 | SWISS (GOVT)    | 3.000%     | 2019/05/12 | 2,610,000     | 2,528,046.00      |               |
|                 |                 | SWISS (GOVT)    | 4.000%     | 2023/02/11 | 2,570,000     | 2,725,485.00      |               |
|                 |                 | SWISS (GOVT)    | 4.000%     | 2028/04/08 | 3,150,000     | 3,365,775.00      |               |
|                 | スイスフラン小計        |                 |            |            |               | 38,040,000        | 39,284,528.00 |
|                 |                 |                 |            |            |               | (4,064,770,112)   |               |



| 通貨             | 種類   | 銘柄                                 | 券面総額       | 評価額               | 備考 |
|----------------|------|------------------------------------|------------|-------------------|----|
| マレーシア<br>リンギット | 国債証券 | MALAYSIAN GOV'T 3.869% 2010/04/13  | 19,020,000 | 19,025,135.40     |    |
|                |      | MALAYSIAN GOV'T 3.756% 2011/04/28  | 18,000,000 | 17,867,160.00     |    |
|                |      | MALAYSIAN GOV'T 3.718% 2012/06/15  | 5,770,000  | 5,702,202.50      |    |
|                |      | MALAYSIAN GOV'T 3.702% 2013/02/25  | 10,040,000 | 9,884,580.80      |    |
|                |      | MALAYSIAN GOV'T 4.262% 2016/09/15  | 10,410,000 | 10,319,224.80     |    |
|                |      | MALAYSIAN GOV'T 3.814% 2017/02/15  | 5,930,000  | 5,670,147.40      |    |
|                |      | MALAYSIAN GOV'T 4.240% 2018/02/07  | 7,750,000  | 7,657,775.00      |    |
|                |      | MALAYSIAN GOV'T 3.502% 2027/05/31  | 3,810,000  | 3,265,170.00      |    |
| マレーシアリンギット小計   |      |                                    | 80,730,000 | 79,391,395.90     |    |
|                |      |                                    |            | (2,594,510,818)   |    |
| 国債証券合計         |      |                                    |            | 500,944,803,218   |    |
|                |      |                                    |            | (500,944,803,218) |    |
| オーストラ<br>リアドル  | 特殊債券 | QUEENSLAND TREAS 6.000% 2009/07/14 | 1,700,000  | 1,674,840.00      |    |
|                |      | QUEENSLAND TREAS 6.000% 2011/06/14 | 6,100,000  | 5,890,831.00      |    |
|                |      | QUEENSLAND TREAS 6.000% 2013/08/14 | 6,290,000  | 5,978,896.60      |    |
|                |      | QUEENSLAND TREAS 6.000% 2015/10/14 | 11,170,000 | 10,467,853.80     |    |
| オーストラリアドル小計    |      |                                    | 25,260,000 | 24,012,421.40     |    |
|                |      |                                    |            | (2,433,899,033)   |    |
| 特殊債券合計         |      |                                    |            | 2,433,899,033     |    |
|                |      |                                    |            | (2,433,899,033)   |    |
| 合計             |      |                                    |            | 503,378,702,251   |    |
|                |      |                                    |            | (503,378,702,251) |    |

(注) 有価証券明細表注記

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

| 通貨         | 銘柄数 | 組入債券時価比率(注) | 有価証券の合計金額<br>に対する比率 |
|------------|-----|-------------|---------------------|
| 米ドル        | 85  | 100.0%      | 26.7%               |
| カナダドル      | 20  | 100.0%      | 2.6%                |
| ユーロ        | 219 | 100.0%      | 57.1%               |
| 英ポンド       | 26  | 100.0%      | 8.0%                |
| スイスフラン     | 11  | 100.0%      | 0.8%                |
| スウェーデンクローナ | 9   | 100.0%      | 0.9%                |
| ノルウェークローネ  | 4   | 100.0%      | 0.4%                |
| デンマーククローネ  | 7   | 100.0%      | 0.9%                |
| ポーランドズロチ   | 9   | 100.0%      | 1.2%                |
| オーストラリアドル  | 4   | 100.0%      | 0.5%                |
| シンガポールドル   | 16  | 100.0%      | 0.4%                |
| マレーシアリンギット | 8   | 100.0%      | 0.5%                |
| 合計         | 418 | 100.0%      | 100.0%              |

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

信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

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

不動産等明細表

該当事項はありません。

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20年6月30日

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 1,255,261,706 円 |
| 負債総額           | 963,592 円       |
| 純資産総額（ - ）     | 1,254,298,114 円 |
| 発行済口数（口）       | 1,399,588,363 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 0.8962 円        |
| 1万口当たり純資産額     | 8,962 円         |

<参考>

マザーファンドの現況（平成20年6月30日）

純資産額計算書

（中央三井日本株式マザーファンド）

|                |                   |
|----------------|-------------------|
| 資産総額           | 283,552,415,159 円 |
| 負債総額           | 5,343,800,606 円   |
| 純資産総額（ - ）     | 278,208,614,553 円 |
| 発行済口数（口）       | 250,169,872,094 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.1121 円          |
| 1万口当たり純資産額     | 11,121 円          |

（中央三井日本債券マザーファンド）

|                |                   |
|----------------|-------------------|
| 資産総額           | 265,026,010,876 円 |
| 負債総額           | 5,413,654,638 円   |
| 純資産総額（ - ）     | 259,612,356,238 円 |
| 発行済口数（口）       | 236,703,941,291 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0968 円          |
| 1万口当たり純資産額     | 10,968 円          |

(中央三井外国株式マザーファンド)

|                 |                   |
|-----------------|-------------------|
| 資産総額            | 323,003,639,423 円 |
| 負債総額            | 7,925,311,707 円   |
| 純資産総額 ( - )     | 315,078,327,716 円 |
| 発行済口数 (口)       | 244,331,254,928 口 |
| 1口当たり純資産額 ( / ) | 1.2896 円          |
| 1万口当たり純資産額      | 12,896 円          |

(中央三井外国債券マザーファンド)

|                 |                   |
|-----------------|-------------------|
| 資産総額            | 518,366,724,780 円 |
| 負債総額            | 177,626,915 円     |
| 純資産総額 ( - )     | 518,189,097,865 円 |
| 発行済口数 (口)       | 282,049,031,042 口 |
| 1口当たり純資産額 ( / ) | 1.8372 円          |
| 1万口当たり純資産額      | 18,372 円          |

第5【設定及び解約の実績】(原請求目論見書10頁)

|         | 設定口数          | 解約口数       | 発行済み口数        |
|---------|---------------|------------|---------------|
| 第1期計算期間 | 1,515,565,240 | 86,709,615 | 1,428,855,625 |

(注1) 設定及び解約の実績は、全て本邦内における実績です。

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

# 新生・4分散ファンド

追加型株式投資信託 / バランス型

投資信託説明書  
(請求目論見書)  
2007年10月

中央三井アセットマネジメント株式会社

本情報は金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

新生・4分散ファンドは、実質的に国内外の株式や公社債を主要投資対象としています。組入れた有価証券の値動き、為替相場の変動等の影響や組入れた有価証券の発行体の経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化等により、ファンドの基準価額も変動し、これにより投資元本を割り込むことがあります。

従って、当ファンドは元本保証のある商品ではありません。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資家の皆様に帰属します。

ご投資家の皆様におかれましては、投資信託説明書（交付目論見書）も併せてよくお読みいただき、商品の内容・リスクを十分ご理解のうえ、お申込みいただきますようお願い申し上げます。

#### 委託会社のお客さま相談窓口

お電話によるお問合せ先

電話番号 03 - 5440 - 0190

受付時間 営業日の午前9時から午後5時まで

（本邦金融商品取引所が半日立会いの場合、午前9時から正午まで）

委託会社のホームページ アドレス <http://www.cmam.co.jp/>

本書「投資信託説明書（請求目論見書）」は、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する投資家から交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書です。

新生・4分散ファンドの募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条の規定により有価証券届出書を平成19年10月5日に関東財務局長に提出しており、平成19年10月21日に届出の効力が生じております。

本書は、当ファンドの有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報」の内容を記載した目論見書で、投資家の請求に基づき販売会社を通じてお渡しするものです。

なお、販売会社に「投資信託説明書（請求目論見書）」の交付をご請求された場合は、その旨をご自身でも記録しておくようにしてください。

|                     |                    |
|---------------------|--------------------|
| 発 行 者 名             | 中央三井アセットマネジメント株式会社 |
| 本店の所在の場所            | 東京都港区芝三丁目23番1号     |
| 有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所 | 該当事項はありません。        |

# 投資信託説明書（請求目論見書） 目次

## ファンドの詳細情報

|    |             |    |
|----|-------------|----|
| 第1 | ファンドの沿革     | 1  |
| 第2 | 手続等         | 1  |
|    | 1 申込（販売）手続等 | 1  |
|    | 2 換金（解約）手続等 | 3  |
| 第3 | 管理及び運営      | 4  |
|    | 1 資産管理等の概要  | 4  |
|    | （1）資産の評価    | 4  |
|    | （2）保管       | 4  |
|    | （3）信託期間     | 4  |
|    | （4）計算期間     | 4  |
|    | （5）その他      | 4  |
|    | 2 受益者の権利等   | 7  |
| 第4 | ファンドの経理状況   | 9  |
| 第5 | 設定及び解約の実績   | 10 |

## 【ファンドの詳細情報】

### 第1【ファンドの沿革】

平成19年10月5日 有価証券届出書を関東財務局長に提出

平成19年10月31日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始（予定）

なお、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」及び「中央三井日本債券マザーファンド」は平成13年1月23日に、また、「中央三井外国株式マザーファンド」及び「中央三井外国債券マザーファンド」は平成13年2月22日に、それぞれ設定され、運用が開始されています。

### 第2【手続等】

#### 1【申込（販売）手続等】

##### （1）募集の取扱いの期間と受付時間

当初申込期間

平成19年10月22日から平成19年10月30日まで、毎営業日お申込みいただけます。

継続申込期間

平成19年10月31日から平成20年9月10日まで、毎営業日お申込みいただけます。

募集期間（継続申込期間）は、募集期間満了前に委託会社が「有価証券届出書」を関東財務局長に提出することにより更新されます。

（注）お申込みの取扱いは、営業日の午後3時（年末年始など本邦金融商品取引所が半日立会いの場合には午前11時）までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

ただし、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、分配金再投資に関する契約（下記（5））をご参照ください。）に基づく収益分配金の再投資をする場合を除き、販売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

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（注）。

申込単位は、「分配金受取りコース」、「分配金再投資コース」とも、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分配金を再投資する場合は1口単位とします。）。

詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。

販売会社の詳細につきましては、委託会社ホームページ（アドレス：<http://www.cmam.co.jp/>）をご参照いただくか、委託会社のお客さま相談窓口（ ）又は販売会社までお問い合わせください。

電話：03-5440-0190

受付時間：営業日の9：00～17：00（本邦金融商品取引所が半日立会いの場合には9：00～12：00）

（注）平成19年10月22日現在で、「分配金受取りコース」を取扱う販売会社はありません。

##### （3）販売価額

当初申込期間

1口当たり1円に、下記（4）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。

継続申込期間

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、下記（4）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「第3 管理及び運営 1 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) 申込の際に負担するコストの有無

申込手数料及び当該手数料に係る消費税等相当額をご負担いただきます。

申込手数料は、「分配金受取りコース」、「分配金再投資コース」とも、お申込価額(1)、お申込金額(2)、お申込口数等に応じて、3.15%(税抜(3) 3.0%)の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を「お申込受付日の翌営業日の基準価額(当初申込期間中は1口当たり1円)×取得口数」に乗じて得た額とします(注)。

詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。

(注) 平成19年10月22日現在で、「分配金受取りコース」を取扱う販売会社はありません。

(1) お申込受付日の翌営業日の基準価額(当初申込期間中は1口当たり1円)に取得口数を乗じて得た額をいいます(以下同じ。)

(2) お申込価額に申込手数料及び申込手数料に係る消費税及び地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額を加えた総額をいいます(以下同じ。)

(3) 「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます(以下同じ。)

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

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。(「償還乗換え優遇制度」( )) 詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。

「償還乗換え優遇制度」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等のことをいいます。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。

#### (5) 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ます。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、信託契約締結により生じた受益権については信託設定時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。



## 2【換金（解約）手続等】

- (1) 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し1口単位の整数倍をもって一部解約の実行を請求することができます。
- (注) 一部解約の実行の請求の受付けは、営業日の午後3時（年末年始など本邦金融商品取引所が半日立会いの場合は午前11時）までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎての受付けは翌営業日の取扱いとさせていただきます。
- (2) 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- (3) 委託会社は、一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。
- なお、一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載又は記録が行われます。
- (4) 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.15%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。
- 解約価額は委託会社の営業日において日々算出され、日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせいただければ、いつでもお知らせいたします。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<http://www.cmam.co.jp/>）に掲載する予定です。
- 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。
- (5) 委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、上記(1)による一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。
- (6) 上記(5)により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして上記(4)の規定に準じて計算された価額とします。
- (7) 一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。
- (8) 解約に係る手数料については、徴収しません。

## 第3【管理及び運営】

### 1【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。また、基準価額は、原則として、委託会社ホームページ（<http://www.cmam.co.jp/>）でご覧いただけるほか、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に（[中央三井AM]の「4分散」の略号にて）掲載される予定です。

当ファンドの主たる投資対象として想定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（中央三井日本株式マザーファンド、中央三井日本債券マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンド及び中央三井外国債券マザーファンド）

移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、基準価額で評価します。

B．株式、投資信託受益証券及び投資証券

移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価します。

C．国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

移動平均法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価で評価します。

ただし、買付後の最初の利払いまでは個別法によります。

#### (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、平成19年10月31日から無期限とします。ただし、委託会社は、下記(5)の事項に該当することとなった場合は、この信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

#### (4)【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年6月11日から翌年6月10日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成19年10月31日から平成20年6月10日までとし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

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

#### (5)【その他】

##### 信託の終了

この信託契約を解約し信託を終了させる場合は下記のとおりです。

A．委託会社の所定の手続きを経て信託を終了させる場合

イ．受益権の口数が10億口を下回った場合

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

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。

#### 八．所定の手続き

- a．委託会社は、上記イ．及びロ．の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b．委託会社は、上記イ．及びロ．の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c．上記b．の書面決議において、受益者（委託会社及びこの信託の信託財産にこの信託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、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っ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すべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b．からd．までの手続きを行うことが困難な場合には適用しません。

#### B．監督官庁の命令

- イ．委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。
- ロ．委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款の変更をしようとするときは、下記 の規定に従います。

#### C．委託会社の登録取消等に伴う取扱い

- イ．委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ロ．上記イ．の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、下記 D．に該当する場合には、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

#### D．受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い

- イ．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、下記 の規定に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- ロ．委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 委託会社の事業の譲渡及び承継に伴う取扱い

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

#### 信託約款の変更等

- A．委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、又はやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更すること又はこの信託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.の変更事項にあつては、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っ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(委託会社及びこの信託の信託財産にこの信託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、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っ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つて、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、この信託のすべ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すべ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、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### 反対者の買取請求権

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

#### 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 信託財産の管理

##### A. 信託業務の委託等

イ. 受託会社は、委託会社と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準の全てに適合するもの(受託会社の利害関係人(金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下、下記ハ.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あつては、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. 委託会社のみ指図により信託財産の処分及びその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
4. 受託会社が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

## B．混蔵寄託

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

## C．信託財産の登記等及び記載等の留保等

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

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

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

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

### 運用報告書

委託会社は、計算期間の終了毎に、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況等を記載した運用報告書を作成のうえ、販売会社を通じて、あらかじめ受益者からお申し出いただいた住所にお届けいたします。また、販売会社でもお受取りいただけます。

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「投資信託受益権の取扱に関する契約」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。

## 2【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、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

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

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

#### （2）償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

#### （3）一部解約請求権

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

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

一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

#### （4）投資信託約款等重要事項変更時の反対者の買取請求権

前記「1 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

この信託の受益者は、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4【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドは、平成19年10月31日から運用を開始する予定であり、有価証券届出書提出日現在、何ら資産を有していません。

当ファンドの会計監査は、監査法人トーマツが行います。

(2) 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）」に基づいて作成され、監査証明を受けた当ファンドの財務諸表は有価証券報告書に記載されます。

(3) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和52年大蔵省令第38号）」並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」に基づいて作成され、監査証明を受けた当ファンドの中間財務諸表は半期報告書に記載されます。

(4) 法令の定めるところにより、当ファンドの有価証券報告書の提出は、計算期間の終了毎に行われ、半期報告書の提出は、計算期間開始6ヶ月経過毎に行われます。

<参考>

マザーファンドの現況（平成19年8月31日現在）

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           | 294,117,212,217 円 |
| 負債総額           | 9,496,796,674 円   |
| 純資産総額（ - ）     | 284,620,415,543 円 |
| 発行済口数          | 213,739,129,657 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.3316 円          |
| 1万口当たり純資産額     | 13,316 円          |

（中央三井日本債券マザーファンド）

|                |                   |
|----------------|-------------------|
| 資産総額           | 241,314,816,231 円 |
| 負債総額           | 10,104,775,896 円  |
| 純資産総額（ - ）     | 231,210,040,335 円 |
| 発行済口数          | 213,676,387,745 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0821 円          |
| 1万口当たり純資産額     | 10,821 円          |

（中央三井外国株式マザーファンド）

|                |                   |
|----------------|-------------------|
| 資産総額           | 370,868,029,340 円 |
| 負債総額           | 11,348,802,838 円  |
| 純資産総額（ - ）     | 359,519,226,502 円 |
| 発行済口数          | 236,507,914,924 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.5201 円          |
| 1万口当たり純資産額     | 15,201 円          |

(中央三井外国債券マザーファンド)

|                 |                   |
|-----------------|-------------------|
| 資産総額            | 496,709,490,400 円 |
| 負債総額            | 501,497,189 円     |
| 純資産総額 ( - )     | 496,207,993,211 円 |
| 発行済口数           | 278,749,426,006 口 |
| 1口当たり純資産額 ( / ) | 1.7801 円          |
| 1万口当たり純資産額      | 17,801 円          |

## 第5【設定及び解約の実績】

当ファンドは平成19年10月31日から運用を開始するため、該当事項はありません。



