

# 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）

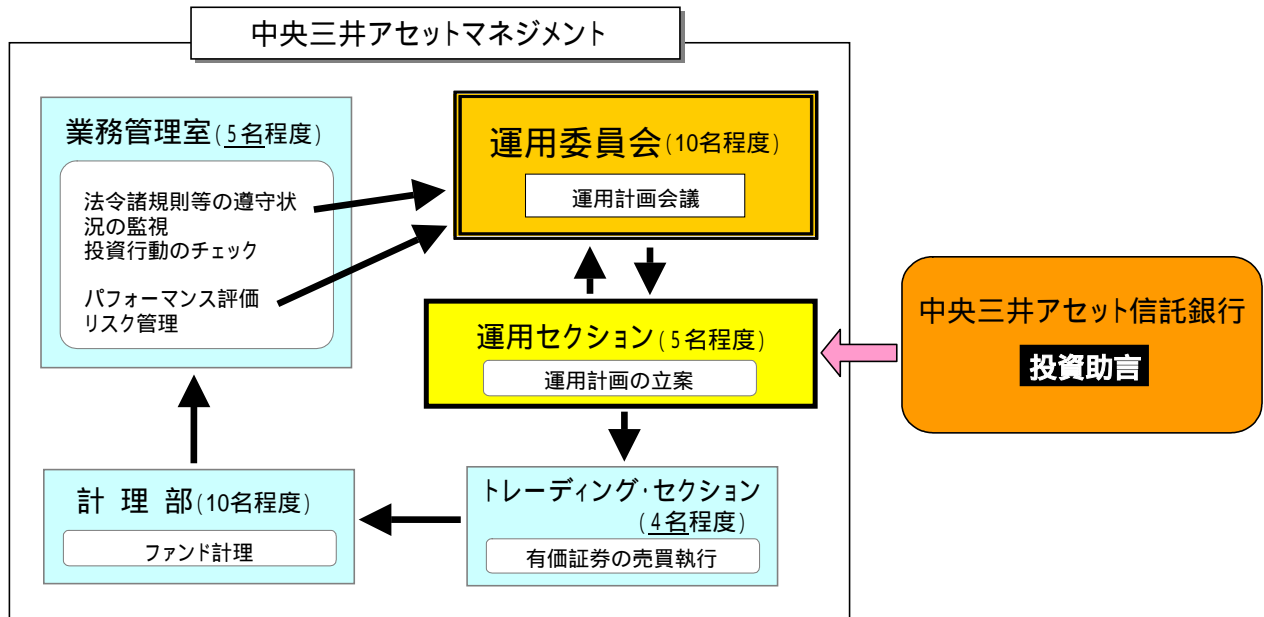
3．大株主の状況（平成20年8月26日現在）

（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。 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% (所得税7%及び地方税3%)	普通分配金に対して7% (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% (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% (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% (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% (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 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 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 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、 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 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 買建 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 (%)	償還日	額面金額 (円)	簿価(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
1	利付国庫債券(2年) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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 買建 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 (枚)	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数 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/ 地域	銘柄名	利率 (%)	償還日	額面金額	簿価(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
						単価	金額	単価	金額	
1	アメリカ	US TREASURY N/B	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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 (枚)	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
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 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 (平成20年6月10日現在) 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 至 平成20年 6 月10日 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 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 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 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 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 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 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。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には、予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。  (2) 派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

「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 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 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。 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 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。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。



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

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

## 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。 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 継続募集額 上限 10兆円
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日までの間、原則として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日までの間、原則として毎営業日お申込みいただけます。 （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。 詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。 （「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は午前11時まで） 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。 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。 （「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は午前11時まで） 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 (本邦金融商品取引所が半日立会いは、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。          1口当たりの元本は1円です。          格付は取得していません。          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。          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。          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。          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。          （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          （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。

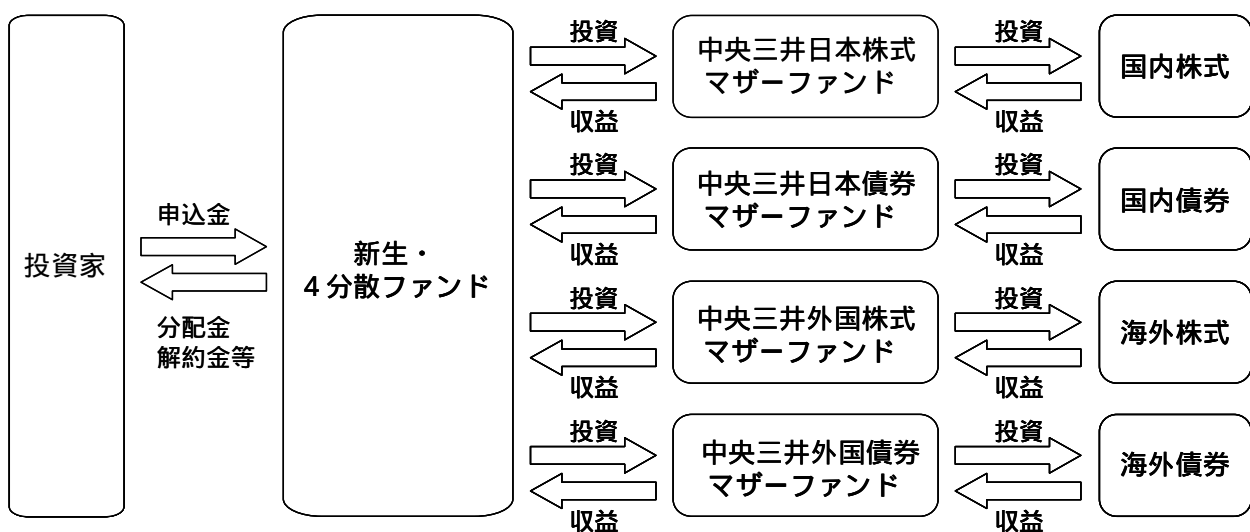
シティグループ世界国債インデックスについて

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。

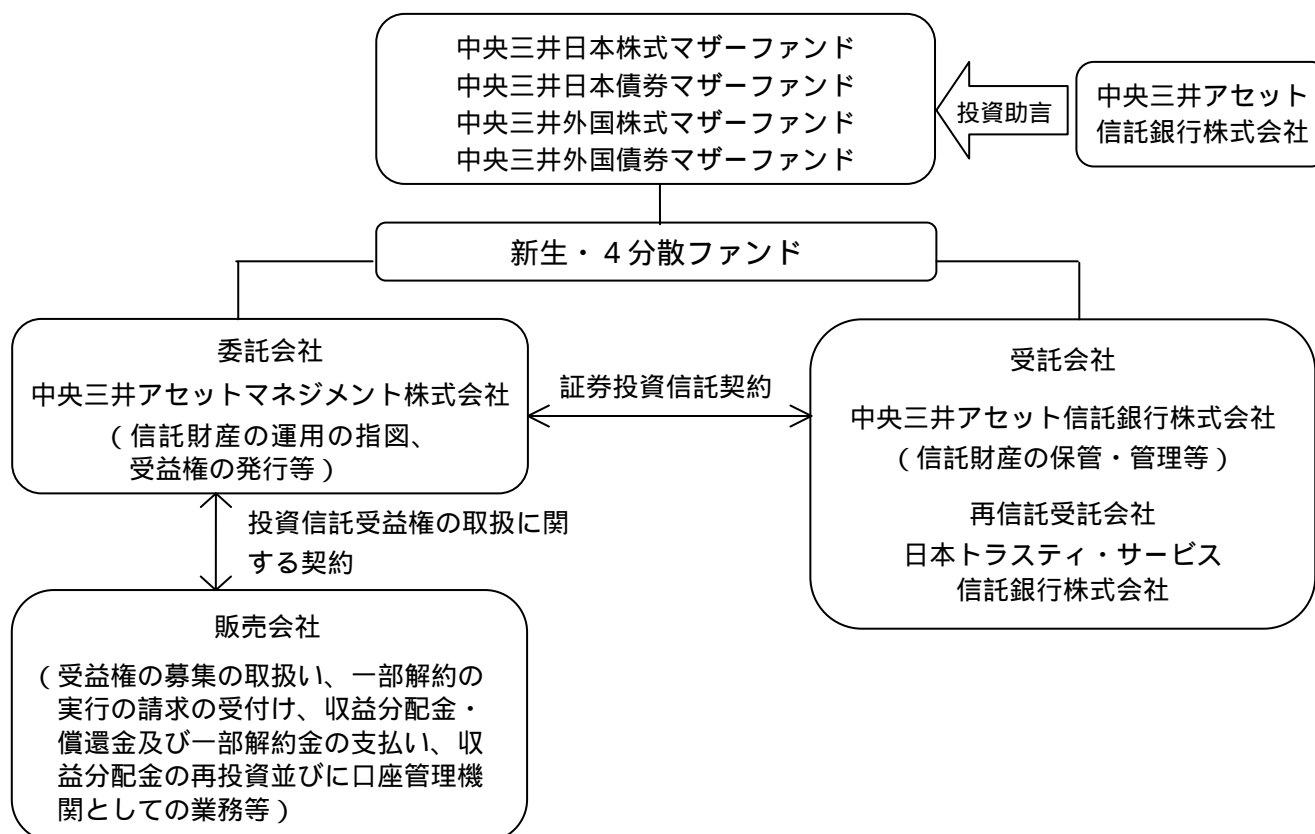
## ファンドの仕組み

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 「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。 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 「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け付け、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資並びに口座管理機関としての業務等に係る事務の内容等が定められています。

< 委託会社の概況 >

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。

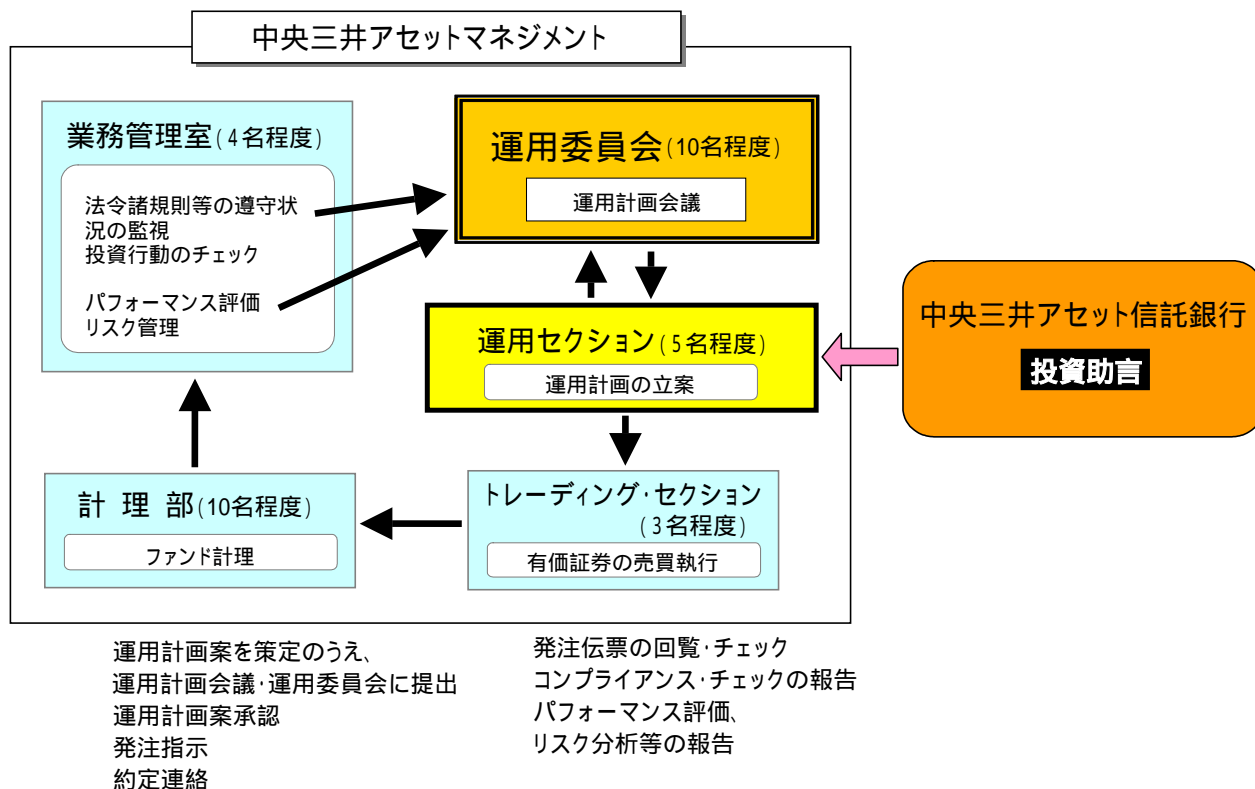
各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の株式・公社債に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。

(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。)

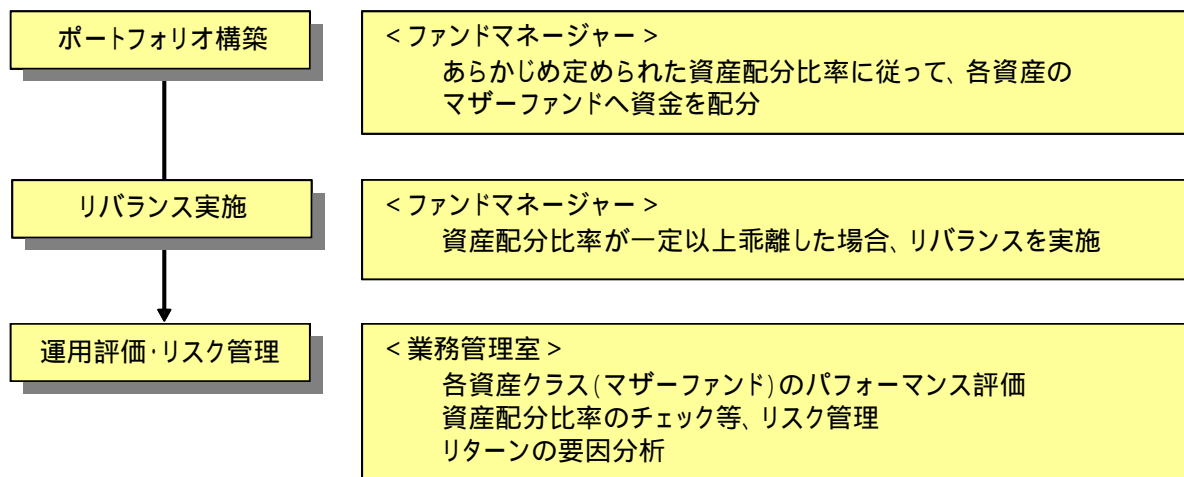


運用体制

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

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 (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 (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。 イ. その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。ロ.において同じ。)の総数 ロ. 当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数</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。 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。

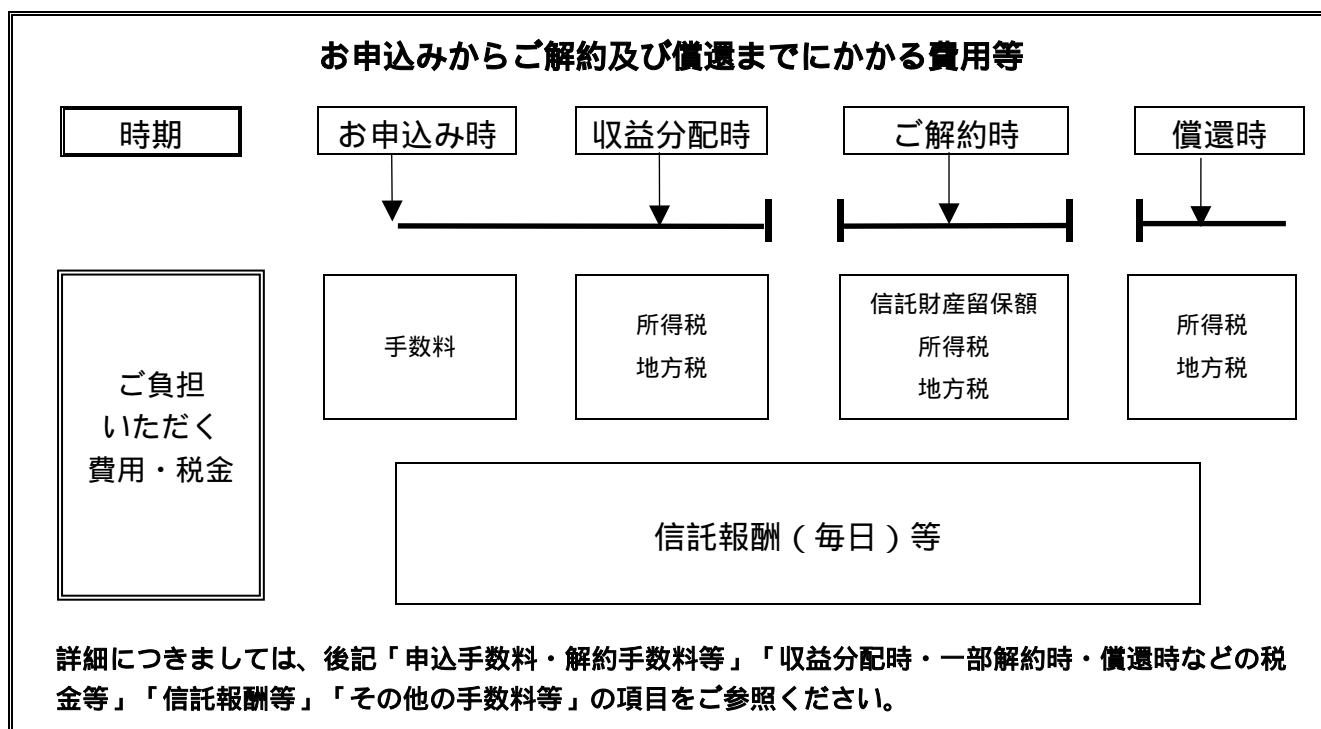
信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資家の皆様に帰属します。

### <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 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） 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。 （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。） 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。 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） 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。 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。 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% （所得税15%及び地方税5%）	普通分配金に対して15% （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% （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% （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% （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% （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 <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)
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

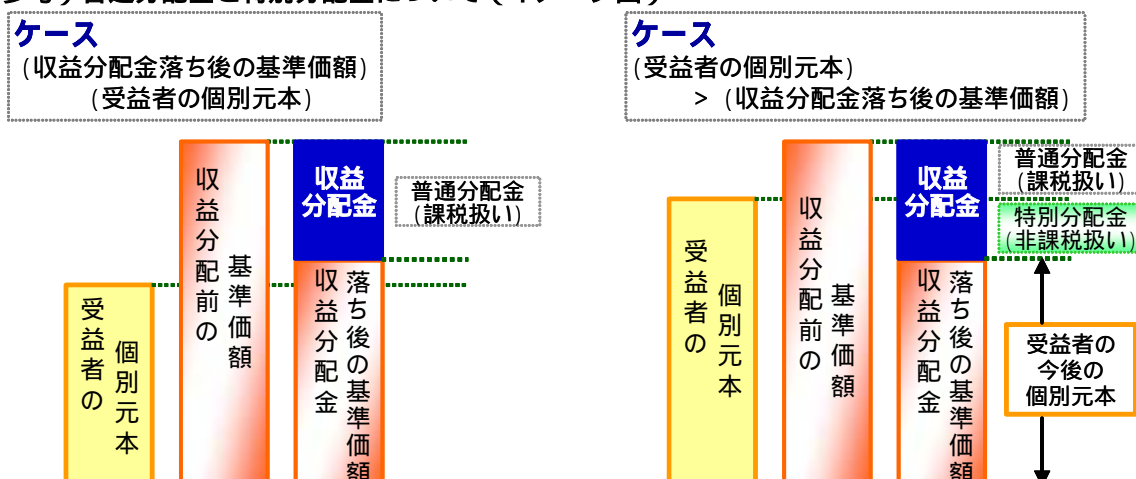
<p>個人の受益者 に対する課税</p>	<p>個人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、20%（所得税15%及び地方税5%）の税率（ ）による源泉徴収（申告不要）が行われます。確定申告を行えば、総合課税を選択することもできます。また、一部解約時及び償還時の損失については、確定申告により、株式等譲渡益との損益通算が可能となります。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金は課税されません。</p> <p>平成21年3月31日までは、上記の20%（所得税15%及び地方税5%）の税率は10%（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 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 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） 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 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 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 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 1482" 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="331 607 1444 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 買建 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 (%)	償還日	額面金額 (円)	簿価(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
					単価	金額	単価	金額	
1	利付国庫債券(5年) 第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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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) 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 (枚)	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
先物取引 買建 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 (枚)	簿価(円)	時価(円)	投資比率 (%)
株価指数 先物取引	アメリカ	S&P 500 FUTU	買建	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/ 地域	銘柄名	利率 (%)	償還日	額面金額	簿価(円)		評価額(円)		投資 比率 (%)
						単価	金額	単価	金額	
1	アメリカ	US TREASURY N/B	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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 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 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	US 5YR NOTE	買建	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> 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> A．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。 B．上記A．の申請のある場合には、上記A．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記A．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。 C．上記A．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。</p> <p><b>受益権の譲渡の対抗要件</b> 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> 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> 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> 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つ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は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、「T O P I X」（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せん。）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. 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、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0.10%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

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。 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。 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 (平成20年6月10日現在) 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 至 平成20年 6 月10日 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 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 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 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。

(貸借対照表に関する注記)

	第 1 期 (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 119,706,781 円
3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9162 円 (9,162 円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	第 1 期 自 平成19年10月31日 至 平成20年6月10日
1. 分配金の計算過程	<p>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)であります。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。</p>
2. 剰余金増加額・減少額	<p>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。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第 1 期 自 平成19年10月31日 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 自 平成19年10月31日 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 自 平成19年10月31日 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 (平成20年 6 月10日現在)	
種類	貸借対照表計上額 (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 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 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 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 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。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3 . 収益及び費用の計上基準	( 1 ) 受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には、予想配当金額を計上し、入金金額との差額については入金時に計上しております。  ( 2 ) 派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

( 貸借対照表に関する注記 )

平成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。 株式 1,355,000,000 円  なお、上記の金額には、約定未受渡株式を含んでおります。
2 . 計算日における受益権総数	247,569,994,601 口
3 . 1 口当たり純資産額 ( 1 万口当たり純資産額 )	1.1641 円 ( 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 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	8,012,189,175		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	
東洋鋼鈹	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	
日本エアータック	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 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	
トーヨー	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	
ユニマットライフ	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	
ユニテッドアローズ	23,400	599	14,016,600	
ハイデイ日高	6,200	887	5,499,400	
京都市もの友禅	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	
NEC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 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 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。 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 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。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3 . 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。

( 貸借対照表に関する注記 )

平成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。 国債証券 49,928,000 円  なお、上記の金額には、約定未受渡債券を含んでおります。
2 . 計算日における受益権総数	234,283,534,118 口
3 . 1 口当たり純資産額 ( 1 万口当たり純資産額 )	1.0828 円 ( 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。 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 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	国債先物取引 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 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 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 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 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 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 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 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JPMorgan Chase and Company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 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 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 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる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。 ( 2 ) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	( 1 ) 受取配当金 原則として、株式、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 ( 2 ) 派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
5. その他	外貨建資産等の会計処理 外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則(平成12年総理府令第133号)」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。



(貸借対照表に関する注記)

	平成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 (1万口当たり純資産額)	1.3731 円 (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。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  
 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 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買 建	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 (円)	評価損益 (円)	
			うち1年超			
市場取引以外の取引	為替予約取引 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 単価	評価額 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		
TRANSCOCEAN 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 単価	評価額 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	
	FREEMPORT-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 単価	評価額 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 単価	評価額 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	
	LEGGETT & 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 単価	評価額 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 単価	評価額 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 VTG 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 単価	評価額 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 単価	評価額 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 単価	評価額 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 単価	評価額 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 単価	評価額 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 単価	評価額 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 ( 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 単価	評価額 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 単価	評価額 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 (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 単価	評価額 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 単価	評価額 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 単価	評価額 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 単価	評価額 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 単価	評価額 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 ( 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 単価	評価額 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 単価	評価額 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 ( 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 単価	評価額 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	
	SYNTHES 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 ( 11,944,829,452 )	
スウェーデン 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 単価	評価額 金額	備考
スウェーデン 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 ( 3,952,978,920 )	
ノルウェー 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 ( 1,899,422,071 )	
デンマーク 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 ( 1,771,344,136 )	
オーストラ 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 単価	評価額 金額	備考
オーストラ 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 単価	評価額 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 ( 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 ( 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		
WHEELLOCK & 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 単価	評価額 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 ( 3,793,655,866 )	
シンガポール 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 ( 1,939,779,751 )	
合計		138,762,896		312,782,031,860 ( 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 受益証券	シンガポール 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 ( 79,414,497 )	
投資信託受益証券 合計			387,600	79,414,497 ( 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 ( 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 ( 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 ( 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 ( 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 (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 (69,614,475)		
投資証券 合計			3,501,320	5,141,958,376 (5,141,958,376)	
合計				5,221,372,873 (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 時価比率 (注1)	組入投資証券 時価比率 (注2)	組入投資信託 受益証券 時価比率 (注3)	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	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 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 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。 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 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる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。 ( 2 ) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。
3 . 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4 . 収益及び費用の計上基準	派生商品取引等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
5 . その他	外貨建資産等の会計処理 外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成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 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	国債先物取引 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 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 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 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 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 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 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 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 (アイルラ 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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 (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 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 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 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 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の場合は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るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容及び買取請求の手続きに関する事項は、上記A.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。



