

投資信託説明書
(請求目論見書)

使用開始日 2024.4.5

三菱UFJ 6資産バランスファンド (2カ月分配型)

追加型投信／内外／資産複合

この目論見書により行う「三菱UFJ 6資産バランスファンド(2カ月分配型)」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2024年4月4日に関東財務局長に提出しており、2024年4月5日に効力が生じております。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づき作成され、投資者の請求により交付される目論見書(請求目論見書)です。

発行者名	: 三菱UFJアセットマネジメント株式会社
代表者の役職氏名	: 取締役社長 横川 直
本店の所在の場所	: 東京都港区東新橋一丁目9番1号
縦覧に供する場所	: 該当事項はありません。

目次

第一部【証券情報】	1
(1)【ファンドの名称】	1
(2)【内国投資信託受益証券の形態等】	1
(3)【発行(売出)価額の総額】	1
(4)【発行(売出)価格】	1
(5)【申込手数料】	1
(6)【申込単位】	1
(7)【申込期間】	1
(8)【申込取扱場所】	2
(9)【払込期日】	2
(10)【払込取扱場所】	2
(11)【振替機関に関する事項】	2
(12)【その他】	2
第二部【ファンド情報】	3
第1【ファンドの状況】	3
第2【管理及び運営】	53
第3【ファンドの経理状況】	58
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	268
第三部【委託会社等の情報】	269
第1【委託会社等の概況】	269
約款	313

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）（「ファンド」といいます。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関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、「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（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。）。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

（注）基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。

なお、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。

(5)【申込手数料】

申込価額（発行価格）×2.2%（税抜 2%）を上限として販売会社が定める手数料率

申込手数料は販売会社にご確認ください。

申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

(6)【申込単位】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

(7)【申込期間】

2024年4月5日から2025年4月4日まで

※申込期間は、前記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：営業日の9:00～17:00)

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額および申込手数料（税込）を販売会社が定める日までに支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に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ファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

(11) 【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。
 信託金の限度額は、5,000億円です。

*委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。

当ファンドは、一般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、以下の商品分類および属性区分に該当します。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
	海外	債券	MR F	
追加型		不動産投信		特殊型 ()
	内外	その他資産 ()	E T F	
		資産複合		

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリー ファンド	あり ()	日経225	ブル・ベア型
一般	年2回					
大型株	年4回	日本			TOPIX	条件付運用型
中小型株	年6回 (隔月)	北米	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	その他 ()	ロング・ ショート型/ 絶対収益 追求型
債券	年12回 (毎月)	欧州				
一般	日々	アジア				
公債	その他 ()	オセアニア				
社債		中南米				
その他債券		アフリカ				
クレジット		中近東 (中東)				その他 ()
属性 ()		エマージング				
不動産投信						
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信)))						
資産複合						

()					
-----	--	--	--	--	--

※当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でご覧いただけます。

※ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われのないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MR F 及びMMF の運営に関する規則」に規定するMMF をいいます。
	MR F（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MR F 及びMMF の運営に関する規則」に規定するMR F をいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成 12 年政令 480 号）第 12 条第 1 号および第 2 号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和 32 年法律第 26 号）第 9 条の 4 の 2 に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

※上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載がある

		ものをいいます。
	中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
	公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
	クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（B B B格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（B B格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	TOPIX	信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型 ／絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

※上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

ファンドの目的

世界各国の株式・公社債・不動産投資信託証券を実質的な主要投資対象とし、分散投資を行うことにより、着実な値上がり益の獲得と安定した収益の確保をめざします。

ファンドの特色

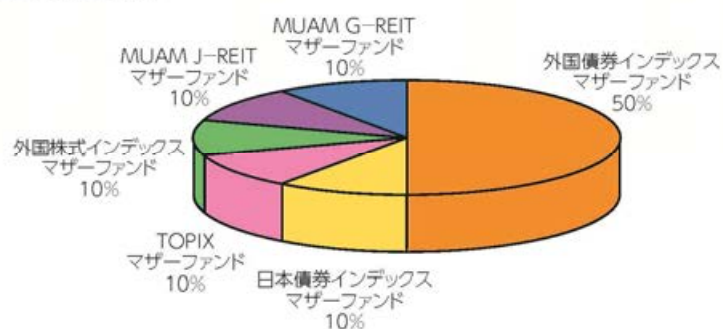
特色 1

世界各国の株式・公社債・不動産投資信託証券に分散投資を行い、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

特色 2

各マザーファンドへの資産配分は、信託財産の純資産総額に対して以下の比率を基本投資割合とします。

<ファンドの基本投資割合>



<各マザーファンドの主要投資対象と運用目標>

	主要投資対象	運用目標
TOPIXマザーファンド	国内株式	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
外国株式インデックスマザーファンド	外国株式	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
日本債券インデックスマザーファンド	国内公社債	NOMURA-BPI総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。
外国債券インデックスマザーファンド	外国公社債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
MUAM J-REITマザーファンド	国内不動産投資信託証券	東証REIT指数 (配当込み)をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果をめざします。
MUAM G-REITマザーファンド	外国不動産投資信託証券	S&P先進国REITインデックス (除く日本、配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

❑ ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。

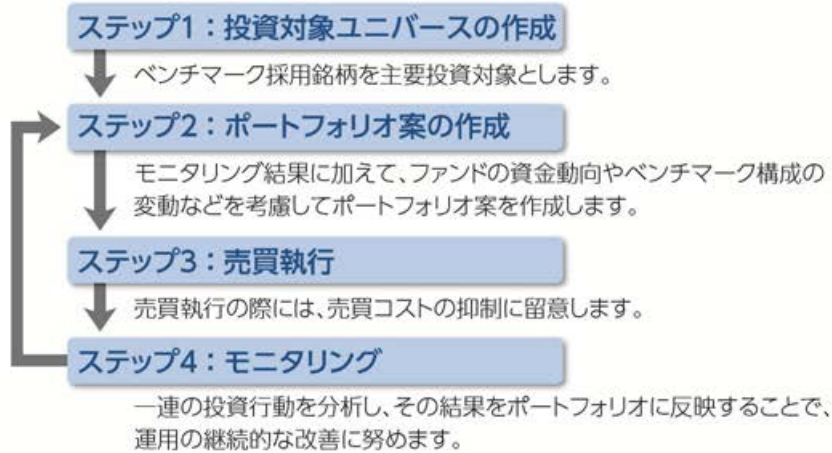
❗ ファンドはベンチマークを設けません。上記各指数はご参考である点にご留意ください。

- 実質的な組入外貨建資産については原則として為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

<各マザーファンドの運用プロセス>

TOPIXマザーファンド／外国株式インデックスマザーファンド／日本債券インデックスマザーファンド／外国債券インデックスマザーファンド／MUAM G-REITマザーファンド

<運用プロセスのイメージ>



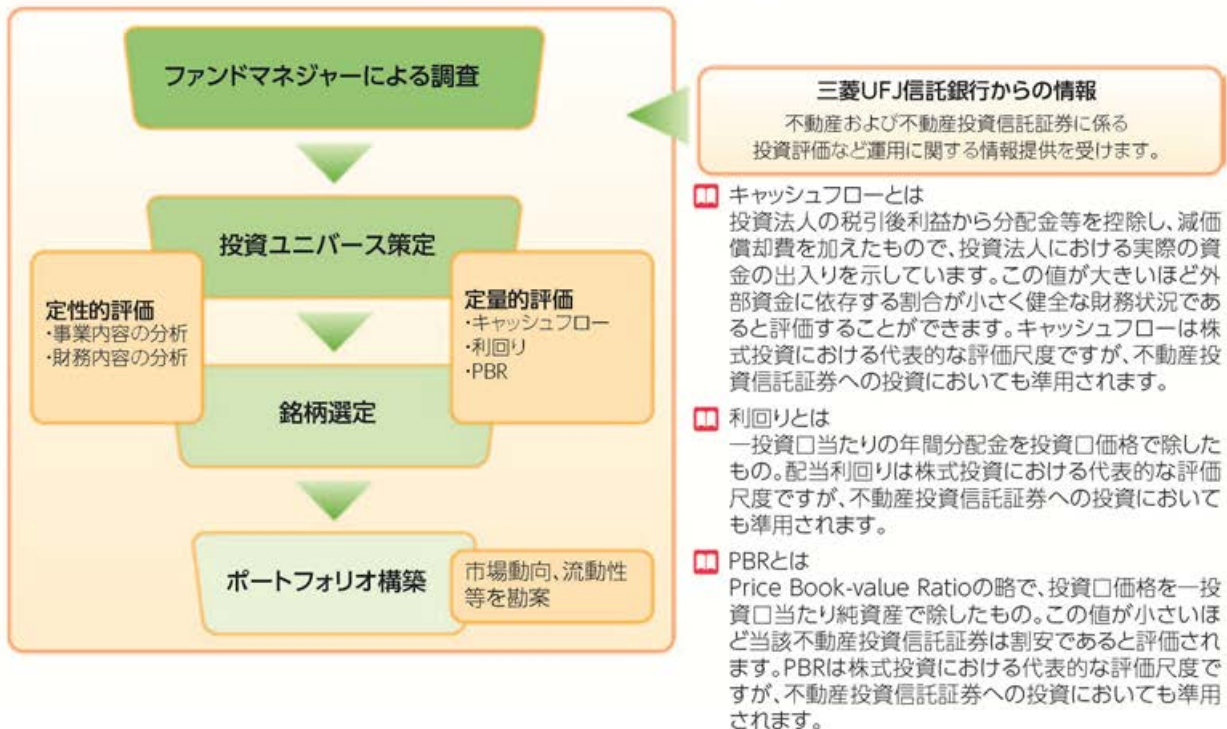
❗ 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

📄 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページをご覧ください。

(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)

MUAM J-REITマザーファンド

<ポートフォリオ構築のプロセス>



❗ 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄が常に上記の条件を満たすわけではありません。

📄 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページをご覧ください。

(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)



毎年1・3・5・7・9・11月の各5日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とし、分配を行います。

- 分配対象額は、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- 分配金額は、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。
- 原則として、配当等収益や分配対象額的水準等を考慮し、安定した分配を継続することをめざします。
- 分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、基準価額水準、運用状況等によっては安定した分配とならないことがあります。



- ❗ 上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

収益分配金に関する留意事項

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



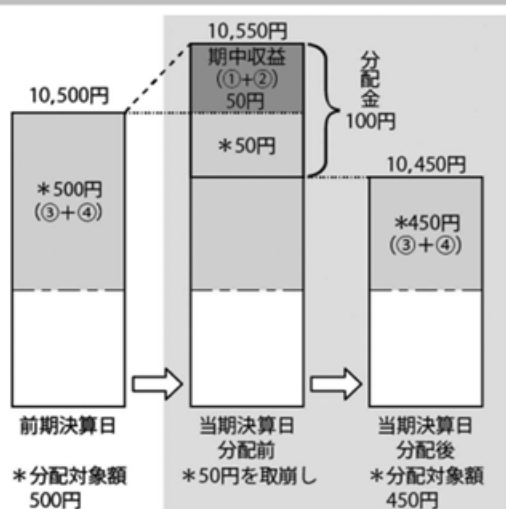
- ◆分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。

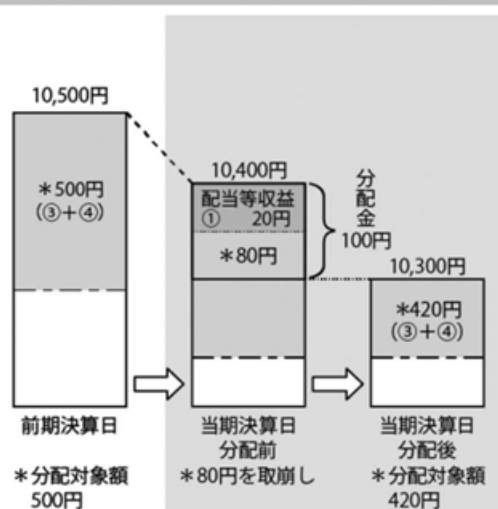
分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算日から基準価額が上昇した場合



前期決算日から基準価額が下落した場合



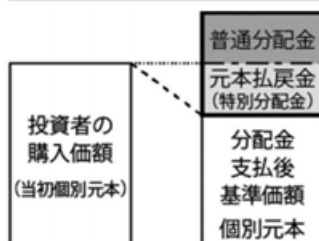
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

分配準備積立金：当期の①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益のうち、当期分配金として支払わなかった残りの金額をいいます。信託財産に留保され、次期以降の分配金の支払いに充当できる分配対象額となります。

収益調整金：追加型投資信託で追加設定が行われることによって、既存の受益者への収益分配可能額が薄まらないようにするために設けられた勘定です。

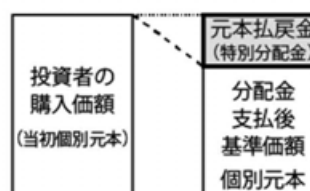
- ◆投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金(特別分配金)：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

(注) 普通分配金に対する課税については、「4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」をご参照ください。

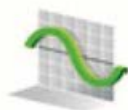
■ファンドの仕組み

運用は主に各マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の株式・公社債・不動産投資信託証券へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



■主な投資制限

株式	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。



指数について

- ・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、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・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- ・MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
- ・NOMURA-BPI総合とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- ・FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率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。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE世界国債インデックス(除く日本)・データに基づき委託会社が計算したものです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- ・東証REIT指数(配当込み)とは、東京証券取引所に上場している不動産投資信託全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証REIT指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- ・S&P先進国REITインデックスとは、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS&Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託(REIT)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。なお、S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)は、S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み)をもとに、委託会社が計算したものです。S&P先進国REITインデックスはS&P Dow Jones Indices LLC(「SPDJ」)の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱UFJアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S&P先進国REITインデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

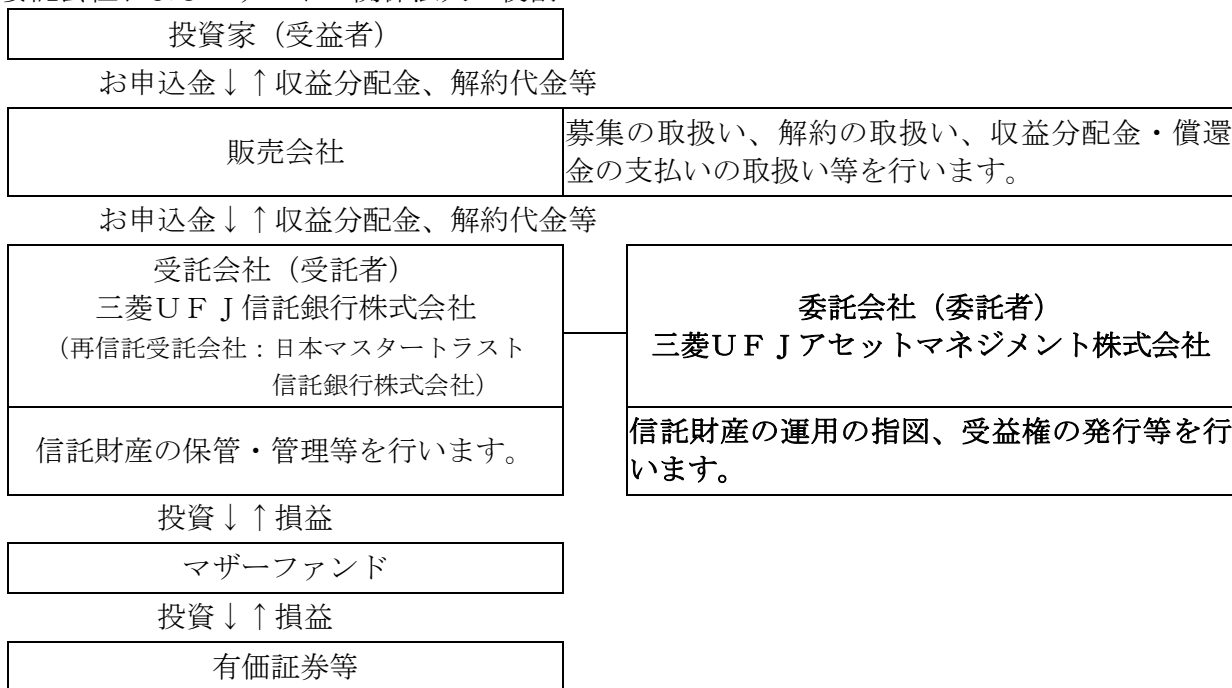
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2006年3月17日	設定日、信託契約締結、運用開始
2015年10月6日	信託期間を2016年7月5日までから2021年7月5日までに変更
2020年4月4日	信託期間を2021年7月5日までから2026年7月3日までに変更
2021年4月3日	ファンドの投資対象に「TOPIXマザーファンド」、「外国株式インデックスマザーファンド」、「日本債券インデックスマザーファンド」、「外国債券インデックスマザーファンド」を追加
2021年12月28日	ファンドの投資対象から「三菱UFJ トピックスインデックスマザーファンド」、「三菱UFJ 外国株式マザーファンド」、「三菱UFJ 国内債券マザーファンド」、「三菱UFJ 外国債券マザーファンド」を削除

(3) 【ファンドの仕組み】

①委託会社およびファンドの関係法人の役割



②委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社およ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、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で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

③委託会社の概況（2024年4月1日現在）

- 金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- 設立年月日
1985年8月1日
- 資本金
2,000百万円
- 沿革
1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
2015年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
2023年10月 エム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱UFJ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更
- 大株主の状況

株主名	住所	所有株式数	所有比率
-----	----	-------	------

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	211,581株	100.0%
-----------------------	-------------------	----------	--------

2【投資方針】

(1)【投資方針】

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、MUAM J-REITマザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券への投資を通して、世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券への分散投資を行います。各マザーファンド受益証券への資金配分は、信託財産の純資産総額に対して以下の比率を基本投資割合とします。

TOPIXマザーファンド受益証券	・・・	10%
外国株式インデックスマザーファンド受益証券	・・・	10%
日本債券インデックスマザーファンド受益証券	・・・	10%
外国債券インデックスマザーファンド受益証券	・・・	50%
MUAM J-REITマザーファンド受益証券	・・・	10%
MUAM G-REITマザーファンド受益証券	・・・	10%

実質組入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。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2)【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

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. 約束手形
- ハ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

- イ. 為替手形

②有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（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。）は、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社として締結されたTOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、MUAM J-REITマザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の各受益証券のほか、次に掲げるものとします。

1. コマーシャル・ペーパー
2. 外国の者の発行する証券または証書で、1. の証券または証書の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（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を除きます。）
4. 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。）

なお、3. の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができます。

③金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品（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。)は、次に掲げるものとします。

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号で定め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
- ④その他の投資対象
信託約款に定める次に掲げるもの。
・外国為替予約取引

<マザーファンドの概要>

TOPIXマザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

東京証券取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

②投資態度

主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

対象インデックスからカイ離するリスクと運用コストの極小化を目的として、定量的なリスク管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。

株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

①株式への投資割合に制限を設けません。

②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑤外貨建資産への投資は行いません。

⑥有価証券先物取引等を行うことができます。

⑦スワップ取引を行うことができます。

⑧デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国株式インデックスマザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。

②投資態度

主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

- ・株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を 100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。
 - ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。
- 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
- なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

- ①株式への投資割合に制限を設けません。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の 20%以下とします。
- ③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ④同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ⑤外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
- ⑥有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑦スワップ取引を行うことができます。
- ⑧外国為替予約取引を行うことができます。
- ⑨デリバティブ取引（法人税法第 61 条の 5 に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- ⑩外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

日本債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、NOMURA-BPI 総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

NOMURA-BPI 総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。

②投資態度

主として対象インデックスに採用されている公社債に投資を行い、信託財産の 1 口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

- ・公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を 100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。
 - ・銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。
- なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

- ①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ⑤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割合は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。
- ⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ⑦外貨建資産への投資は行いません。
- ⑧有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑨スワップ取引を行うことができます。
- ⑩デリバティブ取引（法人税法第 61 条の 5 に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクおよび金

利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

外国債券インデックスマザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、F T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

F T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。

②投資態度

主として対象インデックスに採用されている国債に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

投資成果を対象インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

- ・ 公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。
- ・ 銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

①株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑤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割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

⑦外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

⑧有価証券先物取引等を行うことができます。

⑨スワップ取引を行うことができます。

⑩外国為替予約取引を行うことができます。

⑪デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

⑫外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

MUAM J-REITマザーファンド

(基本方針)

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を目標として、運用を行います。

(運用方法)

①投資対象

わが国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券（不動産投資法人の投資証券もしくは新投資口予約権証券または不動産投資信託の受益証券をいいます。）を主要投資対象とします。

②投資態度

わが国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券への分散投資を行います。

東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。

銘柄選定およびポートフォリオの構築は、定性的評価・定量的評価を経て行います。定性的評価については、事業内容および財務内容等の分析を行います。定量的評価においては、キャッシュフロー、配当利回り、PBR（株価純資産倍率）等の分析を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は高位（通常の状態では90%以上）を基本とします。

市況動向、資金動向等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

- ① 投資信託証券への投資に制限を設けません。
- ② 同一銘柄の投資信託証券への投資は信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- ③ 株式への投資は行いません。
- ④ 外貨建資産への投資は行いません。

MUAM G-REITマザーファンド

（基本方針）

この投資信託は、信託財産の成長を目指して運用を行います。

（運用方法）

① 投資対象

S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

② 投資態度

主として対象インデックスに採用されている不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。

銘柄選定にあたっては、時価総額および流動性等を勘案します。

原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。

対象インデックスとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引を利用し不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。

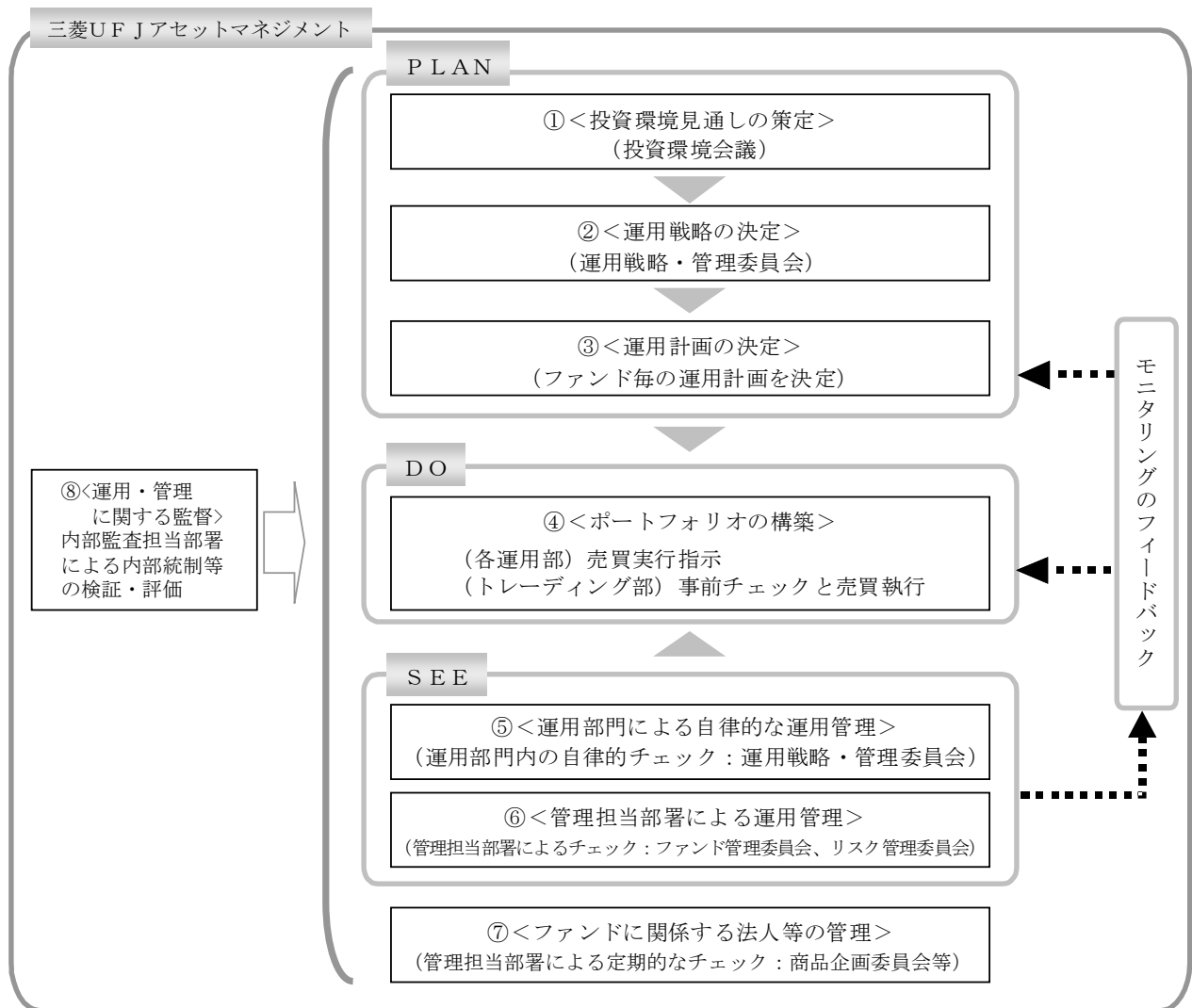
組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

市場動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（投資制限）

- ① 株式への直接投資は行いません。
- ② 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。
- ③ 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
- ④ 不動産投信指数先物取引を行うことができます。
- ⑤ デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- ⑥ 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

（3）【運用体制】



①投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

②運用戦略の決定

運用戦略・管理委員会において、①で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

③運用計画の決定

②で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

④ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

⑤運用部門による自律的な運用管理

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

⑥管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、(a) 運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、(b) リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、(a) についてはファンド管理委員会を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、(b) についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

⑦ファンドに関係する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部

署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、商品企画委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

⑧運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（10名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

なお、委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。

「運用担当者に係る事項」 <https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>

(4)【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。

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ②収益分配金額は、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、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- ③収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行います。

(5)【投資制限】

<信託約款に定められた投資制限>

①株式

- a. 委託会社は、親投資信託の信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する親投資信託の受益証券の時価総額に親投資信託の信託財産の純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

②投資信託証券

投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への投資は行いません。

③信用取引

信用取引の指図は行いません。

④外国為替予約取引

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産と親投資信託の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属する親投資信託の受益証券の時価総額に親投資信託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。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

⑤公社債の借入れ

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

⑥資金の借入れ

- a. 委託会社は、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。

- b. 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り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、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 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。

⑦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。

⑧デリバティブ取引等

デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、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、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

⑨信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

<その他法令等に定められた投資制限>

・同一の法人の発行する株式への投資制限

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべ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の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た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。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が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。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。)

①価格変動リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動し、また、公社債の価格は市場金利の変動等を受けて変動し、不動産投資信託証券の価格は保有不動産等の価値やそこから得られる収益の増減等により変動するため、当ファンドはその影響を受け株式や公社債、不動産投資信託証券の価格が下落した場合には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。

保有不動産等の価値は、不動産市況、社会情勢等のマクロ的な要因の他、不動産の質や収益増減等の個別の要因によって変動しますが、災害等による保有不動産の滅失、劣化または毀損があった場合には、その影響を大きく受けることがあります。なお、保有不動産等から得られる収益は、賃料水準、稼働率、借入金利等の要因により変動します。

また、不動産投資信託証券は、株式と同様に上場市場で取引が行われ市場の需給を受けて価格が決定しますが、利回りに着目して取引される傾向もあるため、公社債と同様に、金利の影響を受けることがあります。よって、金利の上昇局面では、不動産投資信託証券に対する投資価値が相対的に

低下し、不動産投資信託証券の市場価格が下落する場合があります。この場合、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。

②為替変動リスク

実質的な主要投資対象である海外の株式や公社債、不動産投資信託証券は外貨建資産であり、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。そのため、為替相場が円高方向に進んだ場合には、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。

③信用リスク

信用リスクとは、有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、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。

④流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている株式や公社債、不動産投資信託証券の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、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。

また、不動産投資信託証券は、株式と比べ市場規模が小さく、また、一般的に取引量も少ないため、流動性リスクも高い傾向にあります。

※留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・有価証券の貸付等においては、取引先の倒産等による決済不履行リスクを伴い、当ファンドが損失を被る可能性があります。
- ・当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・不動産投資信託証券および不動産投資信託証券が保有する不動産に係る法律、税制、会計などの制度変更が、不動産投資信託証券の価格や配当率に影響を及ぼすことがあります。不動産投資信託証券の投資口数が増加する場合、1口当たりの不動産投資信託証券の収益性が低下することがあります。

(2) 投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行い、ファンド管理委員会およびリスク管理委員会においてそれらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を検討しています。

また、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策を策定し流動性リスクの評価と管理プロセスの検証などを行います。リスク管理委員会は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

①コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守のための管理態勢の状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

②リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

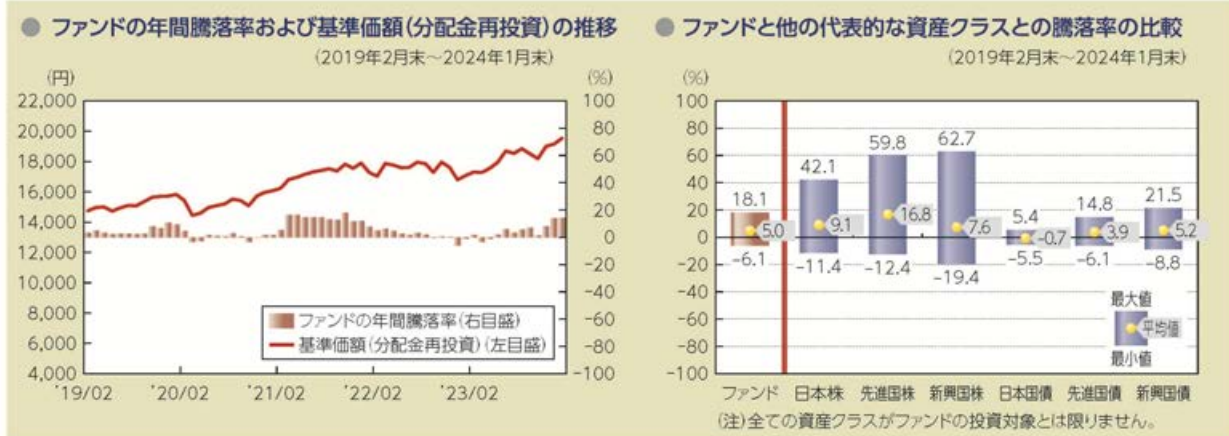
③内部監査担当部署

委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

*組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、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・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPI(国債)とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表しているわが国の代表的な国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(総合)のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当該指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

申込価額（発行価格）×2.2%（税抜 2%）を上限として販売会社が定める手数料率

申込手数料は販売会社にご確認ください。

申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

※申込手数料の対価として提供する役務の内容は、ファンドおよび投資環境の説明・情報提供、購入に関する事務手続等です。

(2) 【換金（解約）手数料】

かかりません。

※換金（解約）手数料の対価として提供する役務の内容は、商品の換金に関する事務手続等です。

(3) 【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年 1.1%（税抜 1%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

1 万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額×信託報酬率×（保有日数／365）

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

- ・信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.42%	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等
販売会社	0.52%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等
受託会社	0.06%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

ファンドは実質的に上場投資信託（リート）を投資対象としており、上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託の費用は表示していません。

(4) 【その他の手数料等】

- ・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外国株式インデックスマザーファンド、外国債券インデックスマザーファンド、MUAM J-REIT マザーファンドおよび MUAM G-REIT マザーファンドの解約に伴う信託財産留保額、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産

の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

※売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。

(注) 手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。なお、ファンドが負担する費用(手数料等)の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

(5)【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

①個人の受益者に対する課税

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ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

1. 収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金(特別分配金)は課税されません。原則として、20.315%(所得税 15%、復興特別所得税 0.315%、地方税 5%)の税率で源泉徴収(申告不要)されます。なお、確定申告を行い、総合課税(配当控除は適用されません)・申告分離課税を選択することもできます。

2. 解約時および償還時の課税

解約価額および償還価額から取得費(申込手数料(税込)を含みます。)を控除した利益(譲渡益)が譲渡所得とみなされて課税されます。

20.315%(所得税 15%、復興特別所得税 0.315%、地方税 5%)の税率による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)を利用する場合、20.315%(所得税 15%、復興特別所得税 0.315%、地方税 5%)の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

解約時および償還時の損失(譲渡損)については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得(申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。)との損益通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

※公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に「NISA(少額投資非課税制度)」の適用対象となります。ファンドは、NISAの対象ではありません。

②法人の受益者に対する課税

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ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として 15.315%(所得税 15%、復興特別所得税 0.315%)の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

※分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

◇個別元本について

①受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料(税込)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。

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。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、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等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

③受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

◇収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、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また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、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元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※上記は2024年1月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

(参考情報) ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間(以下「当期間」といいます。)(2023年7月6日～2024年1月5日)における当ファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
1.12%	1.10%	0.02%

(比率は年率、表示桁数未満四捨五入)

※当期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。消費税等のかかるものは消費税等を含む。)を当期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除しています。

詳細につきましては、当期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5 【運用状況】

【三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)】

(1) 【投資状況】

2024年1月31日現在

(単位:円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,768,026,794	99.81
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	5,379,319	0.19
純資産総額		2,773,406,113	100.00

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

(2) 【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

2024年1月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	536,694,954	2.5527	1,370,027,738	2.5795	1,384,404,633	49.92

日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	45,733,485	5.9355	271,451,101	6.2795	287,183,419	10.35
日本	親投資信託受益証券	TOPIXマザーファンド	92,213,872	2.9051	267,890,520	3.0966	285,549,476	10.30
日本	親投資信託受益証券	MUAM G-REITマザーファンド	107,110,058	2.5604	274,247,441	2.5554	273,709,042	9.87
日本	親投資信託受益証券	MUAM J-REITマザーファンド	72,420,804	3.7873	274,283,860	3.7522	271,737,340	9.80
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	208,435,716	1.2850	267,856,250	1.2735	265,442,884	9.57

(注) 投資比率は、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です。

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.81
合計	99.81

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

下記計算期間末日および2024年1月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第47計算期間末日 (2014年3月5日)	4,343,530,938	4,362,007,361	9,403	9,443
第48計算期間末日 (2014年5月7日)	4,166,701,836	4,184,393,724	9,421	9,461
第49計算期間末日 (2014年7月7日)	4,037,163,442	4,053,905,015	9,646	9,686
第50計算期間末日 (2014年9月5日)	4,011,612,468	4,027,927,547	9,835	9,875
第51計算期間末日 (2014年11月5日)	4,125,074,898	4,140,987,120	10,370	10,410
第52計算期間末日 (2015年1月5日)	4,057,108,973	4,071,987,583	10,907	10,947
第53計算期間末日 (2015年3月5日)	3,945,663,320	3,960,249,219	10,820	10,860
第54計算期間末日 (2015年5月7日)	3,850,221,172	3,864,573,812	10,730	10,770
第55計算期間末日 (2015年7月6日)	3,790,086,171	3,804,256,294	10,699	10,739
第56計算期間末日 (2015年9月7日)	3,579,189,123	3,593,270,222	10,167	10,207
第57計算期間末日 (2015年11月5日)	3,675,466,665	3,689,333,938	10,602	10,642
第58計算期間末日 (2016年1月5日)	3,512,932,178	3,526,576,805	10,298	10,338

第 59 計算期間末日	(2016 年 3 月 7 日)	3, 403, 422, 619	3, 416, 942, 199	10, 070	10, 110
第 60 計算期間末日	(2016 年 5 月 6 日)	3, 314, 255, 278	3, 327, 724, 834	9, 842	9, 882
第 61 計算期間末日	(2016 年 7 月 5 日)	3, 187, 783, 343	3, 201, 188, 324	9, 512	9, 552
第 62 計算期間末日	(2016 年 9 月 5 日)	3, 238, 768, 392	3, 252, 194, 203	9, 649	9, 689
第 63 計算期間末日	(2016 年 11 月 7 日)	3, 093, 777, 509	3, 107, 034, 644	9, 335	9, 375
第 64 計算期間末日	(2017 年 1 月 5 日)	3, 279, 863, 037	3, 292, 813, 996	10, 130	10, 170
第 65 計算期間末日	(2017 年 3 月 6 日)	3, 169, 265, 132	3, 182, 003, 843	9, 952	9, 992
第 66 計算期間末日	(2017 年 5 月 8 日)	3, 164, 844, 325	3, 177, 511, 946	9, 993	10, 033
第 67 計算期間末日	(2017 年 7 月 5 日)	3, 150, 844, 791	3, 163, 349, 842	10, 079	10, 119
第 68 計算期間末日	(2017 年 9 月 5 日)	3, 079, 347, 911	3, 091, 670, 564	9, 996	10, 036
第 69 計算期間末日	(2017 年 11 月 6 日)	3, 143, 639, 899	3, 155, 813, 142	10, 330	10, 370
第 70 計算期間末日	(2018 年 1 月 5 日)	3, 130, 576, 528	3, 142, 575, 505	10, 436	10, 476
第 71 計算期間末日	(2018 年 3 月 5 日)	2, 884, 115, 349	2, 895, 984, 870	9, 719	9, 759
第 72 計算期間末日	(2018 年 5 月 7 日)	2, 944, 361, 612	2, 956, 159, 261	9, 983	10, 023
第 73 計算期間末日	(2018 年 7 月 5 日)	2, 874, 461, 634	2, 885, 957, 526	10, 002	10, 042
第 74 計算期間末日	(2018 年 9 月 5 日)	2, 861, 305, 362	2, 872, 715, 665	10, 031	10, 071
第 75 計算期間末日	(2018 年 11 月 5 日)	2, 774, 219, 627	2, 785, 454, 045	9, 878	9, 918
第 76 計算期間末日	(2019 年 1 月 7 日)	2, 650, 940, 831	2, 662, 069, 977	9, 528	9, 568
第 77 計算期間末日	(2019 年 3 月 5 日)	2, 738, 054, 496	2, 748, 985, 225	10, 020	10, 060
第 78 計算期間末日	(2019 年 5 月 7 日)	2, 718, 462, 572	2, 729, 286, 711	10, 046	10, 086
第 79 計算期間末日	(2019 年 7 月 5 日)	2, 722, 710, 438	2, 733, 446, 214	10, 144	10, 184
第 80 計算期間末日	(2019 年 9 月 5 日)	2, 700, 621, 147	2, 711, 302, 207	10, 114	10, 154
第 81 計算期間末日	(2019 年 11 月 5 日)	2, 756, 997, 405	2, 767, 593, 068	10, 408	10, 448
第 82 計算期間末日	(2020 年 1 月 6 日)	2, 708, 525, 109	2, 719, 030, 080	10, 313	10, 353
第 83 計算期間末日	(2020 年 3 月 5 日)	2, 681, 098, 553	2, 691, 568, 969	10, 243	10, 283
第 84 計算期間末日	(2020 年 5 月 7 日)	2, 403, 687, 331	2, 413, 940, 823	9, 377	9, 417
第 85 計算期間末日	(2020 年 7 月 6 日)	2, 570, 398, 548	2, 580, 736, 779	9, 945	9, 985
第 86 計算期間末日	(2020 年 9 月 7 日)	2, 602, 772, 673	2, 613, 063, 735	10, 117	10, 157
第 87 計算期間末日	(2020 年 11 月 5 日)	2, 542, 331, 833	2, 552, 540, 761	9, 961	10, 001
第 88 計算期間末日	(2021 年 1 月 5 日)	2, 576, 659, 798	2, 586, 697, 867	10, 268	10, 308
第 89 計算期間末日	(2021 年 3 月 5 日)	2, 595, 979, 218	2, 605, 857, 016	10, 512	10, 552
第 90 計算期間末日	(2021 年 5 月 6 日)	2, 664, 537, 743	2, 674, 332, 476	10, 882	10, 922
第 91 計算期間末日	(2021 年 7 月 5 日)	2, 720, 761, 827	2, 730, 519, 782	11, 153	11, 193
第 92 計算期間末日	(2021 年 9 月 6 日)	2, 730, 364, 362	2, 740, 084, 100	11, 236	11, 276
第 93 計算期間末日	(2021 年 11 月 5 日)	2, 740, 464, 460	2, 750, 136, 640	11, 333	11, 373
第 94 計算期間末日	(2022 年 1 月 5 日)	2, 754, 885, 070	2, 764, 569, 607	11, 378	11, 418
第 95 計算期間末日	(2022 年 3 月 7 日)	2, 567, 884, 240	2, 577, 532, 439	10, 646	10, 686
第 96 計算期間末日	(2022 年 5 月 6 日)	2, 661, 459, 702	2, 671, 055, 287	11, 095	11, 135
第 97 計算期間末日	(2022 年 7 月 5 日)	2, 658, 166, 449	2, 667, 781, 657	11, 058	11, 098
第 98 計算期間末日	(2022 年 9 月 5 日)	2, 632, 944, 046	2, 642, 431, 283	11, 101	11, 141
第 99 計算期間末日	(2022 年 11 月 7 日)	2, 608, 885, 265	2, 618, 412, 042	10, 954	10, 994

第100 計算期間末日	(2023 年 1 月 5 日)	2,483,434,726	2,492,982,276	10,404	10,444
第101 計算期間末日	(2023 年 3 月 6 日)	2,524,282,413	2,533,746,393	10,669	10,709
第102 計算期間末日	(2023 年 5 月 8 日)	2,571,879,648	2,581,304,625	10,915	10,955
第103 計算期間末日	(2023 年 7 月 5 日)	2,726,571,456	2,736,076,765	11,474	11,514
第104 計算期間末日	(2023 年 9 月 5 日)	2,732,935,205	2,742,442,761	11,498	11,538
第105 計算期間末日	(2023 年 11 月 6 日)	2,699,936,579	2,709,416,494	11,392	11,432
第106 計算期間末日	(2024 年 1 月 5 日)	2,735,794,875	2,745,179,891	11,660	11,700
	2023 年 1 月末日	2,499,508,167	—	10,566	—
	2 月末日	2,533,595,532	—	10,707	—
	3 月末日	2,514,295,144	—	10,650	—
	4 月末日	2,550,274,063	—	10,823	—
	5 月末日	2,607,673,758	—	11,025	—
	6 月末日	2,728,922,104	—	11,484	—
	7 月末日	2,687,880,557	—	11,345	—
	8 月末日	2,742,214,723	—	11,537	—
	9 月末日	2,677,681,602	—	11,289	—
	10 月末日	2,631,727,869	—	11,096	—
	11 月末日	2,733,399,286	—	11,546	—
	12 月末日	2,732,435,666	—	11,640	—
	2024 年 1 月末日	2,773,406,113	—	11,833	—

②【分配の推移】

	1 万口当たりの分配金
第 47 計算期間	40 円
第 48 計算期間	40 円
第 49 計算期間	40 円
第 50 計算期間	40 円
第 51 計算期間	40 円
第 52 計算期間	40 円
第 53 計算期間	40 円
第 54 計算期間	40 円
第 55 計算期間	40 円
第 56 計算期間	40 円
第 57 計算期間	40 円
第 58 計算期間	40 円
第 59 計算期間	40 円
第 60 計算期間	40 円
第 61 計算期間	40 円

第 62 計算期間	40 円
第 63 計算期間	40 円
第 64 計算期間	40 円
第 65 計算期間	40 円
第 66 計算期間	40 円
第 67 計算期間	40 円
第 68 計算期間	40 円
第 69 計算期間	40 円
第 70 計算期間	40 円
第 71 計算期間	40 円
第 72 計算期間	40 円
第 73 計算期間	40 円
第 74 計算期間	40 円
第 75 計算期間	40 円
第 76 計算期間	40 円
第 77 計算期間	40 円
第 78 計算期間	40 円
第 79 計算期間	40 円
第 80 計算期間	40 円
第 81 計算期間	40 円
第 82 計算期間	40 円
第 83 計算期間	40 円
第 84 計算期間	40 円
第 85 計算期間	40 円
第 86 計算期間	40 円
第 87 計算期間	40 円
第 88 計算期間	40 円
第 89 計算期間	40 円
第 90 計算期間	40 円
第 91 計算期間	40 円
第 92 計算期間	40 円
第 93 計算期間	40 円
第 94 計算期間	40 円
第 95 計算期間	40 円
第 96 計算期間	40 円
第 97 計算期間	40 円
第 98 計算期間	40 円
第 99 計算期間	40 円
第 100 計算期間	40 円
第 101 計算期間	40 円
第 102 計算期間	40 円

第 103 計算期間	40 円
第 104 計算期間	40 円
第 105 計算期間	40 円
第 106 計算期間	40 円

③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第 47 計算期間	0.00
第 48 計算期間	0.61
第 49 計算期間	2.81
第 50 計算期間	2.37
第 51 計算期間	5.84
第 52 計算期間	5.56
第 53 計算期間	△0.43
第 54 計算期間	△0.46
第 55 計算期間	0.08
第 56 計算期間	△4.59
第 57 計算期間	4.67
第 58 計算期間	△2.49
第 59 計算期間	△1.82
第 60 計算期間	△1.86
第 61 計算期間	△2.94
第 62 計算期間	1.86
第 63 計算期間	△2.83
第 64 計算期間	8.94
第 65 計算期間	△1.36
第 66 計算期間	0.81
第 67 計算期間	1.26
第 68 計算期間	△0.42
第 69 計算期間	3.74
第 70 計算期間	1.41
第 71 計算期間	△6.48
第 72 計算期間	3.12
第 73 計算期間	0.59
第 74 計算期間	0.68
第 75 計算期間	△1.12
第 76 計算期間	△3.13
第 77 計算期間	5.58
第 78 計算期間	0.65
第 79 計算期間	1.37

第 80 計算期間	0.09
第 81 計算期間	3.30
第 82 計算期間	△0.52
第 83 計算期間	△0.29
第 84 計算期間	△8.06
第 85 計算期間	6.48
第 86 計算期間	2.13
第 87 計算期間	△1.14
第 88 計算期間	3.48
第 89 計算期間	2.76
第 90 計算期間	3.90
第 91 計算期間	2.85
第 92 計算期間	1.10
第 93 計算期間	1.21
第 94 計算期間	0.75
第 95 計算期間	△6.08
第 96 計算期間	4.59
第 97 計算期間	0.02
第 98 計算期間	0.75
第 99 計算期間	△0.96
第 100 計算期間	△4.65
第 101 計算期間	2.93
第 102 計算期間	2.68
第 103 計算期間	5.48
第 104 計算期間	0.55
第 105 計算期間	△0.57
第 106 計算期間	2.70

(注)「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額）を控除した額を当該基準価額（分配落の額）で除して得た数に 100 を乗じて得た数をいう。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第 47 計算期間	25,640,091	83,617,705	4,619,105,769
第 48 計算期間	20,192,372	216,326,128	4,422,972,013
第 49 計算期間	9,516,850	247,095,541	4,185,393,322
第 50 計算期間	4,294,026	110,917,411	4,078,769,937
第 51 計算期間	7,199,481	107,913,761	3,978,055,657
第 52 計算期間	9,962,337	268,365,463	3,719,652,531
第 53 計算期間	25,286,911	98,464,526	3,646,474,916
第 54 計算期間	31,381,918	89,696,712	3,588,160,122
第 55 計算期間	34,133,627	79,762,910	3,542,530,839

第 56 計算期間	20, 113, 555	42, 369, 455	3, 520, 274, 939
第 57 計算期間	9, 419, 189	62, 875, 682	3, 466, 818, 446
第 58 計算期間	11, 183, 103	66, 844, 797	3, 411, 156, 752
第 59 計算期間	8, 752, 722	40, 014, 447	3, 379, 895, 027
第 60 計算期間	17, 262, 692	29, 768, 555	3, 367, 389, 164
第 61 計算期間	15, 769, 805	31, 913, 534	3, 351, 245, 435
第 62 計算期間	21, 289, 446	16, 082, 033	3, 356, 452, 848
第 63 計算期間	3, 491, 064	45, 660, 056	3, 314, 283, 856
第 64 計算期間	1, 228, 572	77, 772, 613	3, 237, 739, 815
第 65 計算期間	880, 672	53, 942, 531	3, 184, 677, 956
第 66 計算期間	11, 373, 498	29, 146, 061	3, 166, 905, 393
第 67 計算期間	6, 363, 440	47, 005, 834	3, 126, 262, 999
第 68 計算期間	2, 871, 884	48, 471, 619	3, 080, 663, 264
第 69 計算期間	15, 294, 938	52, 647, 418	3, 043, 310, 784
第 70 計算期間	1, 932, 002	45, 498, 409	2, 999, 744, 377
第 71 計算期間	903, 484	33, 267, 532	2, 967, 380, 329
第 72 計算期間	1, 028, 317	18, 996, 297	2, 949, 412, 349
第 73 計算期間	3, 133, 333	78, 572, 555	2, 873, 973, 127
第 74 計算期間	757, 571	22, 154, 831	2, 852, 575, 867
第 75 計算期間	1, 415, 963	45, 387, 161	2, 808, 604, 669
第 76 計算期間	1, 844, 248	28, 162, 366	2, 782, 286, 551
第 77 計算期間	741, 012	50, 345, 157	2, 732, 682, 406
第 78 計算期間	717, 791	27, 365, 330	2, 706, 034, 867
第 79 計算期間	13, 787, 205	35, 877, 855	2, 683, 944, 217
第 80 計算期間	13, 380, 895	27, 059, 903	2, 670, 265, 209
第 81 計算期間	4, 220, 182	25, 569, 448	2, 648, 915, 943
第 82 計算期間	1, 679, 081	24, 352, 041	2, 626, 242, 983
第 83 計算期間	10, 749, 761	19, 388, 632	2, 617, 604, 112
第 84 計算期間	1, 940, 193	56, 171, 292	2, 563, 373, 013
第 85 計算期間	45, 606, 674	24, 421, 824	2, 584, 557, 863
第 86 計算期間	665, 032	12, 457, 159	2, 572, 765, 736
第 87 計算期間	1, 655, 806	22, 189, 371	2, 552, 232, 171
第 88 計算期間	935, 221	43, 650, 035	2, 509, 517, 357
第 89 計算期間	3, 484, 521	43, 552, 150	2, 469, 449, 728
第 90 計算期間	12, 707, 759	33, 474, 033	2, 448, 683, 454
第 91 計算期間	6, 621, 606	15, 816, 114	2, 439, 488, 946
第 92 計算期間	3, 735, 297	13, 289, 721	2, 429, 934, 522
第 93 計算期間	2, 887, 581	14, 776, 872	2, 418, 045, 231
第 94 計算期間	10, 640, 138	7, 550, 873	2, 421, 134, 496
第 95 計算期間	8, 981, 162	18, 065, 848	2, 412, 049, 810
第 96 計算期間	1, 279, 685	14, 433, 084	2, 398, 896, 411

第 97 計算期間	18,452,672	13,547,055	2,403,802,028
第 98 計算期間	10,524,242	42,516,820	2,371,809,450
第 99 計算期間	22,156,968	12,272,115	2,381,694,303
第 100 計算期間	15,691,277	10,497,889	2,386,887,691
第 101 計算期間	4,822,752	25,715,374	2,365,995,069
第 102 計算期間	3,899,602	13,650,313	2,356,244,358
第 103 計算期間	48,031,098	27,948,067	2,376,327,389
第 104 計算期間	11,332,139	10,770,415	2,376,889,113
第 105 計算期間	9,949,375	16,859,713	2,369,978,775
第 106 計算期間	7,479,545	31,204,251	2,346,254,069

(参考)

TOPIXマザーファンド

投資状況

2024年1月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
株式	日本	1,281,891,613,710	98.55
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	18,818,345,435	1.45
純資産総額		1,300,709,959,145	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。

その他の資産の投資状況

2024年1月31日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	11,158,795,000	0.86

(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

a 評価額上位30銘柄

2024年1月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	19,449,700	1,927.39	37,487,327,549	3,000.00	58,349,100,000	4.49
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2,505,600	11,786.44	29,532,127,308	14,695.00	36,819,792,000	2.83
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル	銀行業	21,245,200	890.20	18,912,496,815	1,395.00	29,637,054,000	2.28

		ル・グループ							
日本	株式	キーエンス	電気機器	354,400	62,270.91	22,068,813,040	66,580.00	23,595,952,000	1.81
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	749,700	17,243.80	12,927,680,652	27,865.00	20,890,390,500	1.61
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,719,400	7,480.52	12,862,021,380	11,675.00	20,073,995,000	1.54
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	105,672,300	161.70	17,088,161,815	186.30	19,686,749,490	1.51
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2,480,400	5,450.22	13,518,741,884	7,700.00	19,099,080,000	1.47
日本	株式	三菱商事	卸売業	7,426,000	1,740.09	12,921,948,430	2,565.00	19,047,690,000	1.46
日本	株式	信越化学工業	化学	3,217,400	4,331.73	13,936,928,352	5,875.00	18,902,225,000	1.45
日本	株式	任天堂	その他製品	2,236,300	5,380.24	12,031,841,428	8,310.00	18,583,653,000	1.43
日本	株式	三井物産	卸売業	2,823,700	4,177.27	11,795,374,629	6,031.00	17,029,734,700	1.31
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	2,519,200	4,541.67	11,441,377,346	6,752.00	17,009,638,400	1.31
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	2,695,800	3,952.37	10,654,814,596	5,927.00	15,978,006,600	1.23
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	8,637,900	1,207.04	10,426,294,258	1,675.50	14,472,801,450	1.11
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	3,144,000	4,317.99	13,575,777,769	4,362.00	13,714,128,000	1.05
日本	株式	第一三共	医薬品	3,094,800	4,615.13	14,282,924,558	4,423.00	13,688,300,400	1.05
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	3,448,300	2,691.25	9,280,248,384	3,930.00	13,551,819,000	1.04
日本	株式	KDDI	情報・通信業	2,745,100	4,166.11	11,436,391,595	4,897.00	13,442,754,700	1.03
日本	株式	HOYA	精密機器	697,300	14,441.84	10,070,300,131	18,945.00	13,210,348,500	1.02
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	4,708,900	1,951.24	9,188,230,347	2,702.00	12,723,447,800	0.98
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,752,400	5,232.74	9,169,863,130	6,460.00	11,320,504,000	0.87
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	5,716,500	1,573.74	8,996,286,072	1,963.50	11,224,347,750	0.86
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	1,927,000	4,551.24	8,770,256,828	5,502.00	10,602,354,000	0.82
日本	株式	ダイキン工業	機械	427,100	23,497.37	10,035,730,590	23,885.00	10,201,283,500	0.78
日本	株式	村田製作所	電気機器	3,222,700	2,632.98	8,485,333,043	3,015.00	9,716,440,500	0.75
日本	株式	SMC	機械	107,100	69,704.41	7,465,342,930	82,910.00	8,879,661,000	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	3,981,800	1,632.02	6,498,399,940	2,203.00	8,771,905,400	0.67
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	2,119,400	2,863.57	6,069,051,541	3,895.00	8,255,063,000	0.63
日本	株式	丸紅	卸売業	3,124,600	1,874.98	5,858,564,937	2,541.50	7,941,170,900	0.61

(注) 投資比率は、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です。

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年1月31日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.34
	建設業	2.08
	食料品	3.26
	繊維製品	0.38
	パルプ・紙	0.16
	化学	5.81

	医薬品	4.50
	石油・石炭製品	0.45
	ゴム製品	0.70
	ガラス・土石製品	0.66
	鉄鋼	0.96
	非鉄金属	0.65
	金属製品	0.51
	機械	5.31
	電気機器	17.21
	輸送用機器	8.48
	精密機器	2.32
	その他製品	2.39
	電気・ガス業	1.36
	陸運業	2.67
	海運業	0.89
	空運業	0.43
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.51
	卸売業	7.16
	小売業	4.13
	銀行業	7.04
	証券、商品先物取引業	0.85
	保険業	2.41
	その他金融業	1.14
	不動産業	1.91
	サービス業	4.65
	小計	98.55
合計		98.55

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

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

2024年1月31日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 24年03月限	買建	437	円	11,042,633,350	11,158,795,000	0.86

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

外国株式インデックスマザーファンド

投資状況

2024年1月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
株式	アメリカ	3,030,581,166,522	72.36
	イギリス	168,867,182,743	4.03
	カナダ	136,947,629,486	3.27
	フランス	126,522,824,775	3.02
	スイス	116,567,091,397	2.78
	ドイツ	97,415,475,089	2.33
	オーストラリア	80,308,433,701	1.92
	オランダ	72,666,477,910	1.74
	デンマーク	39,501,777,812	0.94
	スウェーデン	35,208,507,031	0.84
	スペイン	28,745,713,710	0.69
	イタリア	22,305,484,246	0.53
	香港	21,031,883,282	0.50
	フィンランド	12,418,527,571	0.30
	シンガポール	12,068,234,572	0.29
	ベルギー	8,641,337,031	0.21
	ノルウェー	7,221,222,438	0.17
	イスラエル	4,257,237,438	0.10
	アイルランド	3,730,585,321	0.09
	オーストリア	2,243,878,494	0.05
	ニュージーランド	2,242,909,403	0.05
	ルクセンブルグ	2,183,741,521	0.05
	ポルトガル	1,944,139,399	0.05
バミューダ	615,355,679	0.01	
	小計	4,034,236,816,571	96.32
投資証券	アメリカ	68,998,696,855	1.65
	オーストラリア	4,941,647,986	0.12
	シンガポール	1,653,918,627	0.04
	フランス	1,638,000,139	0.04
	イギリス	1,383,377,179	0.03
	香港	849,051,876	0.02
	カナダ	305,974,834	0.01
	ベルギー	305,833,205	0.01
	小計	80,076,500,701	1.91
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	73,948,618,681	1.77
純資産総額		4,188,261,935,953	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。

その他の資産の投資状況

2024年1月31日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	54,204,587,710	1.29
	買建	カナダ	2,288,266,264	0.05
	買建	ドイツ	8,403,550,438	0.20
	買建	オーストラリア	2,481,332,805	0.06
	買建	イギリス	2,868,771,620	0.07
	買建	スイス	1,867,697,491	0.04

(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

a 評価額上位30銘柄

2024年1月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7,544,617	26,090.41	196,842,180,450	27,745.30	209,327,677,139	5.00
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3,406,582	47,721.26	162,566,407,371	60,287.45	205,374,157,326	4.90
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,192,335	50,528.74	60,247,194,173	92,623.03	110,437,688,821	2.64
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	4,482,789	17,797.28	79,781,467,249	23,460.44	105,168,247,195	2.51
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	3,579,102	18,504.15	66,228,251,728	22,347.92	79,985,495,905	1.91
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1,073,464	38,832.33	41,685,111,032	59,028.85	63,365,348,657	1.51
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1,809,297	17,989.52	32,548,389,930	22,582.52	40,858,499,258	0.98
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1,380,503	28,329.82	39,109,413,759	28,269.10	39,025,583,570	0.93
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	214,340	109,417.12	23,452,466,806	178,264.00	38,209,107,475	0.91
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエ	389,914	69,760.13	27,200,451,795	95,166.79	37,106,867,265	0.89

			ンス						
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1,401,964	20,921.75	29,331,544,183	26,008.63	36,463,174,866	0.87
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	631,073	49,081.14	30,973,786,349	57,123.98	36,049,403,008	0.86
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	447,429	73,129.65	32,720,326,585	74,307.65	33,247,399,993	0.79
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	775,108	34,874.11	27,031,205,251	40,893.48	31,696,865,434	0.76
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	1,936,136	15,562.85	30,131,802,585	15,470.61	29,953,219,484	0.72
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,161,777	23,751.31	27,593,734,368	23,426.51	27,216,384,574	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	405,850	57,650.35	23,397,396,424	65,687.78	26,659,387,339	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	1,138,090	22,673.35	25,804,320,021	23,237.64	26,446,536,519	0.63
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	483,670	44,199.15	21,377,804,974	52,690.10	25,484,623,085	0.61
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,579,484	12,942.77	20,442,910,818	16,056.37	25,360,782,672	0.61
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	194,807	97,072.92	18,910,484,402	128,183.96	24,971,132,891	0.60
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	214,012	78,379.18	16,774,086,761	103,394.18	22,127,596,748	0.53
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,225,883	17,108.48	20,972,995,326	17,950.93	22,005,743,599	0.53
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	1,290,449	19,075.53	24,616,010,583	16,950.96	21,874,355,962	0.52
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	853,782	21,885.47	18,685,425,461	24,333.94	20,775,885,084	0.50
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	220,235	59,257.90	13,050,663,976	92,655.49	20,405,983,602	0.49
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	471,290	31,516.97	14,853,635,884	42,454.56	20,008,410,289	0.48
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	782,018	15,687.36	12,267,799,709	25,387.45	19,853,445,220	0.47
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	877,103	22,934.77	20,116,162,513	22,150.20	19,428,012,133	0.46
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア	214,420	55,427.12	11,884,685,051	83,048.51	17,807,263,122	0.43

			ア・娯楽					
--	--	--	------	--	--	--	--	--

(注) 投資比率は、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です。

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年1月31日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式	エネルギー	4.53
	素材	3.73
	資本財	6.64
	商業・専門サービス	1.58
	運輸	1.76
	自動車・自動車部品	1.68
	耐久消費財・アパレル	1.51
	消費者サービス	2.07
	メディア・娯楽	6.25
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.60
	生活必需品流通・小売り	1.69
	食品・飲料・タバコ	3.40
	家庭用品・パーソナル用品	1.62
	ヘルスケア機器・サービス	4.24
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.95
	銀行	5.35
	金融サービス	6.65
	保険	3.03
	ソフトウェア・サービス	10.51
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.44
	電気通信サービス	1.18
公益事業	2.50	
半導体・半導体製造装置	7.08	
不動産管理・開発	0.32	
	小計	96.32
投資証券	—	1.91
合計		98.23

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

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

2024年1月31日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額(円)	評価金額	評価金額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2403	買建	1,484	アメリカドル	362,630,524.22	53,506,133,849	367,364,200	54,204,587,710	1.29
	カナダ	モントリオール取引所	SP/TSE602403	買建	81	カナダドル	20,550,402.75	2,261,777,326	20,791,080	2,288,266,264	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO ST 2403	買建	1,122	ユーロ	50,893,376.9	8,141,413,502	52,532,040	8,403,550,438	0.20
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 2403	買建	135	オーストラリアドル	25,297,871.25	2,457,941,171	25,538,625	2,481,332,805	0.06
	イギリス	インターコンチネンタル取引所	FTSE100 2403	買建	200	イギリスポンド	15,018,190	2,813,357,533	15,314,000	2,868,771,620	0.07
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS IX2403	買建	96	スイスフラン	10,711,327.6	1,833,457,945	10,911,360	1,867,697,491	0.04

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

日本債券インデックスマザーファンド

投資状況

2024年1月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率(%)
国債証券	日本	661,164,299,360	85.12
地方債証券	日本	41,470,009,834	5.34
特殊債券	日本	35,795,408,228	4.61
社債券	日本	45,774,965,000	5.89
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	△7,420,328,567	△0.96
純資産総額		776,784,353,855	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。

その他の資産の投資状況

2024年1月31日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国/地域	時価合計	投資比率(%)
債券先物取引	買建	日本	731,250,000	0.09

(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

a 評価額上位30銘柄

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第163回利付国債(5年)	11,950,000,000	100.73	12,038,291,000	100.57	12,018,234,500	0.400000	2028/9/20	1.55
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	8,550,000,000	99.36	8,495,788,000	98.31	8,406,018,000	0.100000	2030/6/20	1.08
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	7,980,000,000	98.12	7,829,976,000	96.67	7,714,505,400	0.100000	2031/12/20	0.99
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	7,920,000,000	98.45	7,797,404,400	97.25	7,702,675,200	0.100000	2031/6/20	0.99
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	7,740,000,000	99.65	7,713,526,400	98.78	7,645,726,800	0.100000	2029/9/20	0.98
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	7,480,000,000	97.99	7,330,224,000	96.59	7,225,455,600	0.200000	2032/9/20	0.93
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	7,220,000,000	98.38	7,103,699,600	96.95	6,999,934,400	0.100000	2031/9/20	0.90
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	7,010,000,000	98.68	6,917,482,500	97.85	6,859,915,900	0.100000	2030/12/20	0.88
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	6,790,000,000	99.55	6,760,056,100	98.49	6,688,082,100	0.100000	2030/3/20	0.86
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	6,620,000,000	100.97	6,684,393,700	100.94	6,682,691,400	0.800000	2033/9/20	0.86
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	6,530,000,000	100.02	6,531,567,200	99.54	6,500,549,700	0.100000	2028/3/20	0.84
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	6,410,000,000	100.38	6,434,942,800	100.13	6,418,333,000	0.100000	2025/9/20	0.83
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	6,380,000,000	100.34	6,402,074,800	100.14	6,389,187,200	0.100000	2025/6/20	0.82
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	6,340,000,000	100.43	6,367,388,800	100.04	6,342,726,200	0.100000	2026/12/20	0.82
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	6,370,000,000	100.86	6,424,931,800	98.66	6,284,896,800	0.500000	2033/3/20	0.81
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	6,340,000,000	98.87	6,268,383,400	98.09	6,219,096,200	0.100000	2030/9/20	0.80
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	6,220,000,000	99.79	6,206,938,000	98.96	6,155,560,800	0.100000	2029/3/20	0.79
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	6,130,000,000	100.40	6,154,703,900	99.98	6,129,019,200	0.100000	2027/3/20	0.79
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	6,090,000,000	100.16	6,099,744,000	99.67	6,070,024,800	0.100000	2027/12/20	0.78
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	6,150,000,000	99.44	6,116,034,000	98.67	6,068,328,000	0.100000	2029/12/20	0.78
日本	国債証券	第149回利付国債(5年)	6,050,000,000	100.01	6,051,015,000	99.82	6,039,654,500	0.005000	2026/9/20	0.78
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	6,070,000,000	100.80	6,118,828,500	98.90	6,003,594,200	0.500000	2032/12/20	0.77
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	6,140,000,000	98.74	6,062,636,000	97.58	5,991,534,800	0.100000	2031/3/20	0.77
日本	国債証券	第154回利付国債(5年)	5,930,000,000	100.18	5,940,683,000	99.78	5,917,131,900	0.100000	2027/9/20	0.76
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	5,700,000,000	100.34	5,719,836,000	99.89	5,694,243,000	0.100000	2027/6/20	0.73
日本	国債証券	第153回利付国債(5年)	5,620,000,000	99.95	5,617,190,000	99.57	5,596,339,800	0.005000	2027/6/20	0.72
日本	国債証券	第143回利付国債(5年)	5,380,000,000	100.32	5,397,377,400	100.15	5,388,177,600	0.100000	2025/3/20	0.69
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	5,540,000,000	98.32	5,447,106,800	96.88	5,367,429,000	0.200000	2032/6/20	0.69

日本	国債証券	第158回利付国債(5年)	5,330,000,000	100.07	5,333,791,800	99.54	5,305,961,700	0.100000	2028/3/20	0.68
日本	国債証券	第146回利付国債(5年)	5,150,000,000	100.37	5,169,555,600	100.09	5,154,841,000	0.100000	2025/12/20	0.66

(注) 投資比率は、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です。

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	85.12
地方債証券	5.34
特殊債券	4.61
社債券	5.89
合計	100.96

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

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

2024年1月31日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	大阪取引所	長期国債先物24年03月限	買建	5	円	731,134,675	731,250,000	0.09

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

外国債券インデックスマザーファンド

投資状況

2024年1月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	248,673,917,479	46.46
	フランス	43,815,389,518	8.19
	中国	42,207,073,001	7.89
	イタリア	38,879,631,891	7.26
	ドイツ	33,975,688,923	6.35
	イギリス	27,739,482,334	5.18
	スペイン	25,767,839,636	4.81
	カナダ	10,700,349,806	2.00
	ベルギー	9,179,826,878	1.72
	オランダ	7,749,241,817	1.45
	オーストラリア	7,231,182,220	1.35

	オーストリア	6,224,709,013	1.16
	メキシコ	4,475,872,564	0.84
	アイルランド	3,028,032,334	0.57
	マレーシア	2,692,119,254	0.50
	ポーランド	2,679,745,368	0.50
	フィンランド	2,646,708,838	0.49
	シンガポール	2,193,769,660	0.41
	イスラエル	1,552,266,811	0.29
	デンマーク	1,413,961,865	0.26
	ニュージーランド	1,213,185,644	0.23
	スウェーデン	1,023,417,380	0.19
	ノルウェー	856,644,106	0.16
	小計	525,920,056,340	98.26
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	9,291,900,535	1.74
純資産総額		535,211,956,875	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

a 評価額上位30銘柄

2024年1月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	3.875 T-NOTE 330815	16,640,000	14,023.11	2,333,446,723	14,556.72	2,422,239,818	3.875000	2033/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	4.125 T-NOTE 321115	16,070,000	15,562.25	2,500,853,934	14,840.30	2,384,836,585	4.125000	2032/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	3.375 T-NOTE 330515	16,100,000	14,203.25	2,286,723,478	13,994.19	2,253,065,446	3.375000	2033/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	1.375 T-NOTE 311115	18,100,000	12,591.82	2,279,119,614	12,160.19	2,200,995,266	1.375000	2031/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 310815	17,720,000	12,551.54	2,224,134,341	12,123.30	2,148,250,061	1.250000	2031/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	3.5 T-NOTE 330215	15,100,000	14,885.25	2,247,674,093	14,148.08	2,136,360,892	3.500000	2033/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	1.875 T-NOTE 320215	16,860,000	13,011.05	2,193,664,508	12,582.96	2,121,487,101	1.875000	2032/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	0.875 T-NOTE 301115	17,430,000	12,383.46	2,158,438,568	12,041.75	2,098,877,275	0.875000	2030/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 320515	15,480,000	14,161.41	2,192,187,552	13,547.51	2,097,154,656	2.875000	2032/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	1.625 T-NOTE 310515	16,640,000	12,982.06	2,160,215,690	12,555.87	2,089,296,930	1.625000	2031/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	2.75 T-NOTE 320815	15,460,000	13,901.65	2,149,195,991	13,378.63	2,068,336,995	2.750000	2032/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 310215	16,920,000	12,456.33	2,107,611,136	12,216.39	2,067,013,311	1.125000	2031/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE	16,160,000	12,155.39	1,964,311,715	11,892.18	1,921,776,956	0.625000	2030/8/15	0.36

		300815									
アメリカ	国債証券	4.5 T-NOTE 331115	12,400,000	15,202.78	1,885,145,529	15,291.02	1,896,086,651	4.500000	2033/11/15	0.35	
フランス	国債証券	2.75 O.A.T 271025	10,320,000	16,150.18	1,666,699,145	16,147.25	1,666,397,214	2.750000	2027/10/25	0.31	
アメリカ	国債証券	2 T-NOTE 250815	11,490,000	14,185.54	1,629,919,605	14,210.90	1,632,833,487	2.000000	2025/8/15	0.31	
アメリカ	国債証券	1.5 T-NOTE 270131	11,540,000	13,745.20	1,586,196,621	13,672.00	1,577,749,494	1.500000	2027/1/31	0.29	
アメリカ	国債証券	1.25 T-NOTE 261130	11,360,000	13,608.15	1,545,886,842	13,619.55	1,547,181,642	1.250000	2026/11/30	0.29	
フランス	国債証券	2.5 O.A.T 300525	9,590,000	15,928.08	1,527,503,344	15,980.62	1,532,541,521	2.500000	2030/5/25	0.29	
アメリカ	国債証券	4.375 T-NOTE 261215	10,000,000	14,909.76	1,490,976,621	14,841.45	1,484,145,515	4.375000	2026/12/15	0.28	
アメリカ	国債証券	2.25 T-NOTE 251115	10,290,000	14,239.15	1,465,208,671	14,208.02	1,462,006,038	2.250000	2025/11/15	0.27	
フランス	国債証券	0.75 O.A.T 280525	9,750,000	14,639.02	1,427,304,650	14,885.68	1,451,354,620	0.750000	2028/5/25	0.27	
アメリカ	国債証券	0.625 T-NOTE 300515	12,090,000	12,263.36	1,482,640,780	11,991.31	1,449,750,502	0.625000	2030/5/15	0.27	
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280815	10,310,000	14,317.28	1,476,112,117	14,056.15	1,449,189,558	2.875000	2028/8/15	0.27	
アメリカ	国債証券	4.125 T-BOND 530815	10,020,000	13,623.84	1,365,109,122	14,380.36	1,440,912,209	4.125000	2053/8/15	0.27	
フランス	国債証券	1.5 O.A.T 310525	9,560,000	14,707.55	1,406,041,847	14,878.60	1,422,394,326	1.500000	2031/5/25	0.27	
アメリカ	国債証券	2.875 T-NOTE 280515	10,090,000	14,381.47	1,451,091,140	14,087.27	1,421,406,405	2.875000	2028/5/15	0.27	
アメリカ	国債証券	1.125 T-NOTE 261031	10,450,000	13,580.16	1,419,126,887	13,599.09	1,421,105,494	1.125000	2026/10/31	0.27	
アメリカ	国債証券	5 T-NOTE 251031	9,500,000	14,786.02	1,404,672,312	14,892.17	1,414,756,670	5.000000	2025/10/31	0.26	
アメリカ	国債証券	0.25 T-NOTE 251031	10,300,000	13,559.90	1,396,669,977	13,726.18	1,413,797,014	0.250000	2025/10/31	0.26	

(注) 投資比率は、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です。

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.26
合計	98.26

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

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。

MUAM J-REITマザーファンド

投資状況

2024年1月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
-------	------	------	----------

投資証券	日本	15,872,825,000	97.93
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	335,046,649	2.07
純資産総額		16,207,871,649	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

a 評価額上位30銘柄

2024年1月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	2,000	566,826.56	1,133,653,125	597,000	1,194,000,000	7.37
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	3,200	290,751.79	930,405,734	262,600	840,320,000	5.18
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,400	553,615.06	775,061,086	566,000	792,400,000	4.89
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	12,500	56,194.99	702,437,375	60,700	758,750,000	4.68
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	4,400	155,904.14	685,978,216	160,200	704,880,000	4.35
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	6,900	102,000	703,800,000	100,200	691,380,000	4.27
日本	投資証券	GLP投資法人	5,200	145,700	757,640,000	131,700	684,840,000	4.23
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4,000	149,400	597,600,000	161,400	645,600,000	3.98
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	7,800	73,340.71	572,057,538	78,500	612,300,000	3.78
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	4,000	151,770.44	607,081,796	149,400	597,600,000	3.69
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	1,400	398,735.84	558,230,188	369,500	517,300,000	3.19
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,800	276,500	497,700,000	260,700	469,260,000	2.90
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	2,700	177,865.84	480,237,768	170,600	460,620,000	2.84
日本	投資証券	いちごオフィスリート投資法人	5,400	84,686.04	457,304,639	82,800	447,120,000	2.76
日本	投資証券	スターアジア不動産投資法人	7,500	57,021.61	427,662,098	57,800	433,500,000	2.67
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	670	604,849.47	405,249,150	614,000	411,380,000	2.54
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	2,700	147,300	397,710,000	149,400	403,380,000	2.49
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,200	323,007.89	387,609,468	325,000	390,000,000	2.41
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	3,000	124,061.9	372,185,727	122,000	366,000,000	2.26
日本	投資証券	サンケイリアルエステート投資法人	3,300	88,877.72	293,296,476	93,800	309,540,000	1.91
日本	投資証券	スターツプロシード投資法人	1,500	230,860.84	346,291,269	203,400	305,100,000	1.88
日本	投資証券	アドバンス・ロジスティクス投資法人	2,200	133,717.44	294,178,377	128,200	282,040,000	1.74
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	700	385,857.15	270,100,005	402,000	281,400,000	1.74
日本	投資証券	Oneリート投資法人	950	247,993.02	235,593,369	271,200	257,640,000	1.59
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	700	353,500	247,450,000	353,500	247,450,000	1.53
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,800	76,500	214,200,000	75,900	212,520,000	1.31
日本	投資証券	ザイマックス・リート投資法人	1,700	114,107.9	193,983,446	120,600	205,020,000	1.26
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	700	296,604.83	207,623,381	272,800	190,960,000	1.18
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	1,400	145,478.8	203,670,320	133,600	187,040,000	1.15
日本	投資証券	いちごホテルリート投資法人	1,600	108,579.44	173,727,104	115,200	184,320,000	1.14

(注) 投資比率は、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です。

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資証券	97.93
合計	97.93

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

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。

MUAM G-REITマザーファンド

投資状況

2024年1月31日現在

(単位：円)

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	88,845,010,907	76.13
	オーストラリア	7,793,458,427	6.68
	イギリス	5,678,739,448	4.87
	シンガポール	3,795,958,084	3.25
	フランス	2,079,838,291	1.78
	カナダ	1,795,425,186	1.54
	ベルギー	1,287,629,822	1.10
	香港	1,286,886,636	1.10
	スペイン	481,136,780	0.41
	ニュージーランド	330,497,917	0.28
	韓国	202,253,052	0.17
	オランダ	196,643,351	0.17
	イスラエル	139,266,758	0.12
	ガンジー	128,096,777	0.11
	ドイツ	45,188,529	0.04
	アイルランド	42,385,067	0.04
イタリア	7,882,872	0.01	
	小計	114,136,297,904	97.80
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)	—	2,563,482,398	2.20

純資産総額	116,699,780,302	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。

その他の資産の投資状況

2024年1月31日現在

(単位：円)

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	買建	アメリカ	2,604,080,440	2.23

(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

a 評価額上位30銘柄

2024年1月31日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	537,478	19,224.28	10,332,632,672	18,669.50	10,034,446,327	8.60
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	54,575	117,284.54	6,400,803,989	124,175.12	6,776,857,665	5.81
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	322,009	13,087.68	4,214,352,359	12,826.52	4,130,255,362	3.54
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	482,968	8,510.68	4,110,389,151	8,141.80	3,932,233,209	3.37
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	189,649	20,695.36	3,924,854,897	20,544.86	3,896,312,533	3.34
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	92,010	44,291.55	4,075,266,343	42,016.33	3,865,923,259	3.31
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	176,078	19,444.13	3,423,685,107	21,279.66	3,746,880,150	3.21
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	601,464	4,709.79	2,832,772,741	4,461.91	2,683,679,439	2.30
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	122,744	23,157.97	2,842,502,176	21,477.37	2,636,219,285	2.26
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1,004,916	2,332.81	2,344,279,702	2,456.20	2,468,279,503	2.12
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	82,502	27,088.70	2,234,872,299	26,328.82	2,172,180,473	1.86
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	200,612	8,963.66	1,798,218,262	8,749.71	1,755,297,826	1.50
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	169,544	9,820.92	1,665,079,417	10,071.76	1,707,606,986	1.46
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	333,726	5,013.74	1,673,218,399	4,880.95	1,628,901,255	1.40
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	233,648	7,268.31	1,698,226,796	6,934.85	1,620,313,833	1.39
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	90,567	18,542.60	1,679,348,424	17,883.05	1,619,615,095	1.39
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	72,217	19,556.27	1,412,295,657	18,337.51	1,324,280,249	1.13
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	67,585	19,500.20	1,317,921,558	19,177.07	1,296,082,513	1.11
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	37,274	35,972.68	1,340,846,047	34,596.04	1,289,533,112	1.11
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	408,175	2,906.73	1,186,456,558	2,903.78	1,185,252,034	1.02
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	126,967	9,539.10	1,211,151,862	9,199.74	1,168,063,706	1.00
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	711,005	1,618.90	1,151,050,161	1,642.13	1,167,566,039	1.00
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	384,072	3,071.99	1,179,865,727	3,020.34	1,160,031,289	0.99
香港	投資証券	LINK REIT	1,487,500	809.52	1,204,165,462	743.47	1,105,923,525	0.95
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	108,343	10,263.57	1,111,986,831	10,017.16	1,085,290,195	0.93
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	155,102	7,157.65	1,110,165,908	6,763.69	1,049,062,157	0.90
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	122,123	8,146.23	994,842,718	7,849.65	958,624,028	0.82

アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	184,085	5,277.86	971,575,502	5,207.03	958,537,866	0.82
アメリカ	投資証券	UDR INC	174,913	5,586.24	977,106,522	5,382.62	941,490,912	0.81
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	95,124	9,676.32	920,451,120	9,322.20	886,765,809	0.76

(注) 投資比率は、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です。

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年1月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資証券	97.80
合計	97.80

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

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

2024年1月31日現在

資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額 (円)	評価金額	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産 投信指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ商品 取引所	DJREIT2403	買建	520	アメリカ ドル	17,999,721.1	2,655,858,848	17,648,800	2,604,080,440	2.23

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

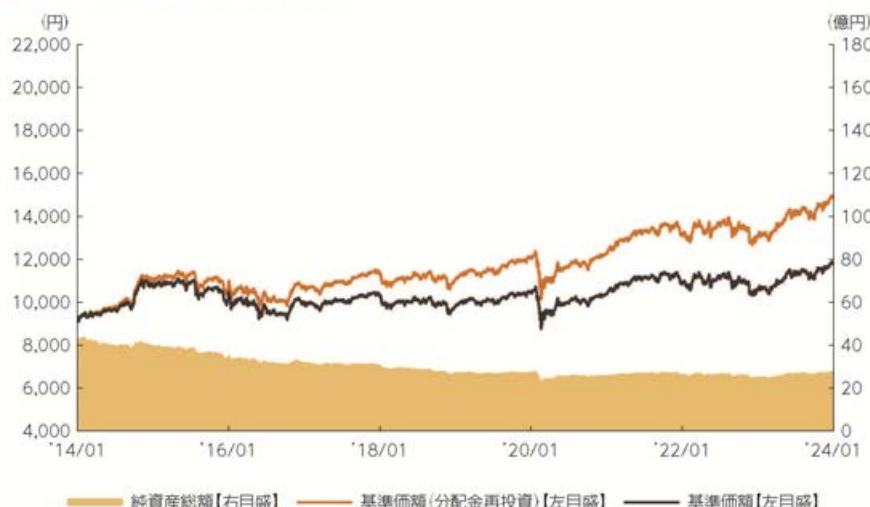
《参考情報》



運用実績

2024年1月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2014年1月31日～2024年1月31日



- 基準価額(分配金再投資)はグラフの起点における基準価額に合わせて指数化
- 基準価額、基準価額(分配金再投資)は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	11,833円
純資産総額	27.7億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年 1月	40円
2023年 11月	40円
2023年 9月	40円
2023年 7月	40円
2023年 5月	40円
2023年 3月	40円
直近1年間累計	240円
設定来累計	4,680円

●分配金は1万口当たり、税引前

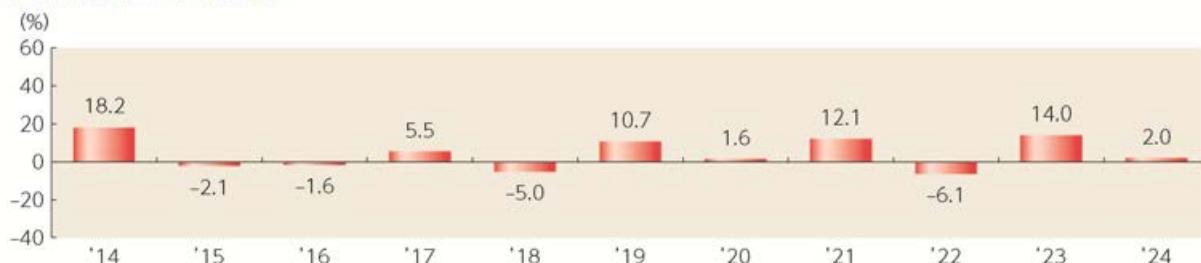
■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位通貨	比率	組入上位銘柄	種類	業種/種別	国・地域	比率
国内株式	10.1%	1 アメリカドル	39.2%	APPLE INC	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	0.5%
国内債券	9.7%	2 円	29.7%	MICROSOFT CORP	株式	ソフトウェア・サービス	アメリカ	0.5%
国内リート	9.6%	3 ユーロ	17.5%	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	日本	0.5%
外国株式	10.0%	4 中国元	4.0%	ソニーグループ	株式	電気機器	日本	0.3%
外国債券	49.1%	5 イギリスポンド	3.5%	3.875 T-NOTE 330815	債券	国債	アメリカ	0.2%
外国リート	9.9%	6 オーストラリアドル	1.6%	4.125 T-NOTE 321115	債券	国債	アメリカ	0.2%
コールローン他 (負債控除後)	1.6%	7 カナダドル	1.5%	3.375 T-NOTE 330515	債券	国債	アメリカ	0.2%
合計	100.0%	8 シンガポールドル	0.6%	PROLOGIS INC	リート	-	アメリカ	0.9%
		9 メキシコペソ	0.4%	日本ビルファンド投資法人	リート	-	日本	0.7%
		10 スイスフラン	0.3%	EQUINIX INC	リート	-	アメリカ	0.6%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引 (買建)	0.3%
債券先物取引 (買建)	0.0%
不動産投信指数先物取引 (買建)	0.2%

- 各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)
- コールローン他には未収・未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。
- 国内株式の業種は、東京証券取引所の33業種分類によるもの
- 外国株式の業種は、GICS(世界産業分類基準)によるもの。Global Industry Classification Standard ("GICS")は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。
- 「国・地域」は原則、発行通貨ベースで分類しています。(ただし、発行通貨がユーロの場合は発行地)

■年間収益率の推移



- 収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- 2024年は年初から1月31日までの収益率を表示
- ファンドにベンチマークはありません。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②申込単位

販売会社が定める単位

③申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑥申込手数料

申込価額（発行価格）×2.2%（税抜2%）を上限として販売会社が定める手数料率

申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）の場合、再投資される収益分配金については、申込手数料はかかりません。

⑦申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額および申込手数料（税込）を販売会社が定める日までに支払うものとします。

なお、申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があります。申込みコースの取扱いは販売会社により異なる場合があります。

⑧申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

⑨取得申込みの受付の中止および取消し

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、取得申込みの受付を中止することがあります。

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2 【換金（解約）手続等】

①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されません。

②解約単位

販売会社が定める単位

③解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

④信託財産留保額

ありません。

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑦支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

⑧解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。

解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

⑨解約請求受付の中止および取消し

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、解約請求の受付を中止することがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、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解約請求を受け付けたものとしません。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、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。

「信託財産の純資産総額」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借入有価

証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により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をいいます。

(資産の評価方法)

- ・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券
原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。
- ・転換社債／転換社債型新株予約権付社債
原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額）で評価します。
- ・公社債等
原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。
残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法による評価を適用することができます。
- ・マザーファンド
計算日における基準価額で評価します。
- ・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）
原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。
- ・外貨建資産
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り円換算します。
- ・外国為替予約取引
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り評価します。
- ・市場デリバティブ取引
原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

③基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

(受付時間：営業日の9:00～17:00)

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2026年7月3日まで（2006年3月17日設定）

ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

毎年1月6日から3月5日、3月6日から5月5日、5月6日から7月5日、7月6日から9月5日、9月6日から11月5日および11月6日から翌年1月5日まで

ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合、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。

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

①ファンドの償還条件等

委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還）

- ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
- ・信託期間中において、ファンドを償還させ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

このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。

委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

②信託約款の変更

委託会社は、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、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。委託会社は、信託約款を変更しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。

③ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還または信託約款の変更のうち重大な内容の変更を行おうとする場合、あらかじめその旨およびその内容を公告し、かつ、原則としてこれらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託約款に係るすべ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。）。この公告および書面には、原則として、受益者で異議のあるものは一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。

④異議申立ておよび反対者の買取請求権

受益者は、委託会社がファンドの任意償還または信託約款について重大な内容の変更を行おうとする場合、原則として、一定の期間（1ヵ月以上）内に委託会社に対して異議を述べることができます。異議を述べた受益者は、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い取るべき旨を請求することができます。なお、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2分の1を超えるときは、ファンドの償還または信託約款の変更を行いません。その場合、償還しない旨または信託約款を変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、原則として、これらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託契約に係るすべ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。）。

⑤関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結された「投資信託受益権の取扱いに関する契約」の契約期間は、契約締結日から1年とします。ただし双方から契約満了日の3ヵ月前までに別段の意思表示のないときは、さらに1年間延長するものとし、その後も同様とします。

⑥運用報告書

委託会社は、毎年1月および7月に終了する計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更、

ファンドの任意償還等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。

⑦委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社は、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。また、委託会社は、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。

⑧受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

⑨信託事務の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託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。

⑩公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.am.mufg.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

①分配金受取コース（一般コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、毎計算期間の終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

②分配金再投資コース（累積投資コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、「累積投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額再投資されます。

(2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、償還金について支払開始日から10年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(3) 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

くわしくは「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」を参照してください。

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）ならびに同規則第 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 隔月決算ファンドの計算期間は 6 ヶ月未満であるため、財務諸表は 6 ヶ月毎に作成しております。
- 3 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、当期（2023 年 7 月 6 日から 2024 年 1 月 5 日まで）の財務諸表について、PwC Japan 有限責任監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年3月13日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwC Japan 有限責任監査法人

東京事務所
指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

監査意見

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」に掲げられている三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）の2023年7月6日から2024年1月5日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）の2024年1月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱UFJアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の

意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三菱UFJ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

-
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

【三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 [2023年 7月 5日現在]	当期 [2024年 1月 5日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,678,268	9,645,754
親投資信託受益証券	2,721,228,675	2,730,924,867
未収入金	9,831,610	10,946,425
流動資産合計	2,740,738,553	2,751,517,046
資産合計	2,740,738,553	2,751,517,046
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	9,505,309	9,385,016
未払解約金	51,601	1,409,219
未払受託者報酬	275,540	294,532
未払委託者報酬	4,316,748	4,614,274
未払利息	12	2
その他未払費用	17,887	19,128
流動負債合計	14,167,097	15,722,171
負債合計	14,167,097	15,722,171
純資産の部		
元本等		
元本	2,376,327,389	2,346,254,069
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	350,244,067	389,540,806
（分配準備積立金）	261,326,036	299,019,431
元本等合計	2,726,571,456	2,735,794,875
純資産合計	2,726,571,456	2,735,794,875
負債純資産合計	2,740,738,553	2,751,517,046

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 自 2023年 1月 6日 至 2023年 7月 5日	当期 自 2023年 7月 6日 至 2024年 1月 5日
営業収益		
受取利息	22	39
有価証券売買等損益	295,264,219	87,202,466
その他収益	1,683	22,047
営業収益合計	295,265,924	87,224,552
営業費用		

支払利息	1,469	1,432
受託者報酬	834,228	895,562
委託者報酬	13,069,456	14,030,296
その他費用	54,161	58,155
営業費用合計	13,959,314	14,985,445
営業利益又は営業損失(△)	281,306,610	72,239,107
経常利益又は経常損失(△)	281,306,610	72,239,107
当期純利益又は当期純損失(△)	281,306,610	72,239,107
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△)	493,449	△37,309
期首剰余金又は期首欠損金(△)	96,547,035	350,244,067
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,790,397	3,849,742
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,790,397	3,849,742
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,512,260	8,456,932
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,512,260	8,456,932
分配金	28,394,266	28,372,487
期末剰余金又は期末欠損金(△)	350,244,067	389,540,806

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
--------------------	---

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	前期 [2023年7月5日現在]	当期 [2024年1月5日現在]
1. 期首元本額	2,386,887,691円	2,376,327,389円
期中追加設定元本額	56,753,452円	28,761,059円
期中一部解約元本額	67,313,754円	58,834,379円
2. 受益権の総数	2,376,327,389口	2,346,254,069口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自2023年1月6日 至2023年7月5日			当期 自2023年7月6日 至2024年1月5日
1. 分配金の計算過程 第101期 2023年1月6日 2023年3月6日			1. 分配金の計算過程 第104期 2023年7月6日 2023年9月5日
	項目		項目
	費用控除後の配当等収益額	A 8,732,896円	費用控除後の配当等収益額
	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B ー円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額
	収益調整金額	C 134,025,135円	収益調整金額
	分配準備積立金額	D 219,162,534円	分配準備積立金額
	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D 361,920,565円	当ファンドの分配対象収益額
			費用控除後の配当等収益額
			費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額
			収益調整金額
			分配準備積立金額
			当ファンドの分配対象収益額
			E=A+B+C+D 416,242,262円

当ファンドの期末残存口数	F	2,365,995,069 口
1 万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	1,529 円
1 万口当たり分配金額	H	40 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	9,463,980 円

第 102 期

2023 年 3 月 7 日

2023 年 5 月 8 日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	11,571,862 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	—円
収益調整金額	C	133,833,362 円
分配準備積立金額	D	217,172,741 円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	362,577,965 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,356,244,358 口
1 万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	1,538 円
1 万口当たり分配金額	H	40 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	9,424,977 円

第 103 期

2023 年 5 月 9 日

2023 年 7 月 5 日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	10,233,312 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	43,856,989 円
収益調整金額	C	139,464,093 円
分配準備積立金額	D	216,741,044 円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	410,295,438 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,376,327,389 口
1 万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	1,726 円
1 万口当たり分配金額	H	40 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	9,505,309 円

当ファンドの期末残存口数	F	2,376,889,113 口
1 万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	1,751 円
1 万口当たり分配金額	H	40 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	9,507,556 円

第 105 期

2023 年 9 月 6 日

2023 年 11 月 6 日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	7,194,154 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	—円
収益調整金額	C	141,469,126 円
分配準備積立金額	D	264,093,384 円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	412,756,664 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,369,978,775 口
1 万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	1,741 円
1 万口当たり分配金額	H	40 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	9,479,915 円

第 106 期

2023 年 11 月 7 日

2024 年 1 月 5 日

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	10,643,863 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	39,392,307 円
収益調整金額	C	140,879,274 円
分配準備積立金額	D	258,368,277 円
当ファンドの分配対象収益額	$E=A+B+C+D$	449,283,721 円
当ファンドの期末残存口数	F	2,346,254,069 口
1 万口当たり収益分配対象額	$G=E/F*10,000$	1,914 円
1 万口当たり分配金額	H	40 円
収益分配金金額	$I=F*H/10,000$	9,385,016 円

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	前期 自 2023 年 1 月 6 日 至 2023 年 7 月 5 日	当期 自 2023 年 7 月 6 日 至 2024 年 1 月 5 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号) 第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。	同左

	また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。
--	--

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	前期 [2023年7月5日現在]	当期 [2024年1月5日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期 [2023年7月5日現在]	当期 [2024年1月5日現在]
	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	最終計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	143,367,351	75,353,249
合計	143,367,351	75,353,249

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前期 [2023年7月5日現在]	当期 [2024年1月5日現在]
1口当たり純資産額	1,147円	1,166円
(1万口当たり純資産額)	(11,474円)	(11,660円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	MUAM G-REITマザーファンド	106,730,421	273,272,569	
	MUAM J-REITマザーファンド	71,857,681	272,168,152	
	TOPIXマザーファンド	95,094,682	276,259,560	
	外国株式インデックスマザーファンド	46,173,647	274,063,681	
	日本債券インデックスマザーファンド	206,252,058	265,075,144	
	外国債券インデックスマザーファンド	536,720,242	1,370,085,761	
合計		1,062,828,731	2,730,924,867	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

TOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年1月5日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	15,758,694,465
株式	1,192,412,168,850
派生商品評価勘定	54,272,100
未収配当金	1,682,603,198
未収利息	507,423
その他未収収益	14,041,444
差入委託証拠金	190,855,208
流動資産合計	1,210,113,142,688
資産合計	1,210,113,142,688

負債の部

流動負債	
派生商品評価勘定	25,550
前受金	23,940,500
未払金	3,588,164,880
未払解約金	1,411,741,702
未払利息	3,596
受入担保金	11,733,017,083
流動負債合計	16,756,893,311
負債合計	16,756,893,311
純資産の部	
元本等	
元本	410,781,255,894
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	782,574,993,483
元本等合計	1,193,356,249,377
純資産合計	1,193,356,249,377
負債純資産合計	1,210,113,142,688

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年1月5日現在]
1. 期首	2023年7月6日
期首元本額	398,813,580,332円
期中追加設定元本額	71,841,317,007円
期中一部解約元本額	59,873,641,445円
元本の内訳※	
三菱UFJ トピックスインデックスオープン	6,775,143,228円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	842,665,213円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	3,744,177,268円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	3,576,957,430円
三菱UFJ トピックスオープン(確定拠出年金)	3,549,157,957円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	6,415,056,178円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	35,742,592,445円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	42,291,709,590円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	95,094,682円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	250,787,828円
ファンド・マネジャー(国内株式)	553,436,052円
eMAXIS TOPIXインデックス	7,157,315,820円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,095,900,358円

eMAXIS バランス (波乗り型)	101, 123, 831 円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	2, 859, 413, 258 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	895, 483, 681 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	1, 130, 458, 280 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	1, 087, 721, 530 円
eMAXIS Slim 国内株式 (TOPIX)	36, 671, 523, 696 円
国内株式セレクション (ラップ向け)	4, 720, 464, 682 円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	10, 260, 432, 398 円
つみたて日本株式 (TOPIX)	8, 468, 226, 717 円
つみたて8資産均等バランス	5, 030, 092, 540 円
つみたて4資産均等バランス	1, 788, 439, 647 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2, 783, 385 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	4, 725, 839 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	7, 753, 170 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	739, 390, 824 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	933, 376, 735 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	666, 289, 071 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	563, 361, 919 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	1, 768, 274, 522 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	3, 997, 360, 944 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	1, 147, 559, 287 円
三菱UFJ DC年金インデックス (国内株式)	3, 952, 051, 621 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	586, 181, 677 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	166, 149, 690 円
国内株式インデックス・オープン (ラップ向け)	19, 276, 357, 956 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	265, 327, 461 円
ラップ向けインデックスf 国内株式	3, 953, 377, 402 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	160, 349, 292 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	2, 710, 125, 103 円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	1, 461, 518, 957 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	42, 536, 386 円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	3, 846, 127, 133 円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	76, 310, 403 円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	21, 882, 456 円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	29, 576, 323 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	1, 641, 654 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	1, 056, 568, 013 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	2, 387, 465, 042 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	234, 304, 959 円
三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	1, 285, 924, 652 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	363, 642, 359 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	16, 852, 005 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	111, 275, 031 円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	714, 101, 900 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	134, 739, 090 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	165, 011, 268 円

eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	609,639,066 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	506,399,683 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	1,003,618,907 円
三菱UFJ トピックスオープン	998,402,484 円
三菱UFJ DCトピックスオープン	7,944,475,330 円
三菱UFJ トピックスオープンVA (適格機関投資家限定)	53,690,745 円
三菱UFJ トピックスインデックスファンドVA (適格機関投資家限定)	4,409,415,921 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定)	604 円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	7,842,865 円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	4,045,218,577 円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	74,027,347 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,330,083,671 円
MUAM 日本株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)	42,038,961,860 円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	207,209,164 円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	225,897 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	134,400 円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	213,774,873 円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	373,202,972 円
MUAM インデックスファンドTOPIXi (適格機関投資家限定)	4,073,378,153 円
MUKAM バランス・イノベーション (株式抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	3,287,200,901 円
MUKAM バランス・イノベーション (リスク抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	990,035,652 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	522,372,720 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	86,097,443 円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド (適格機関投資家限定)	2,897,422,869 円
MUKAM バランス・イノベーション (債券重視型) (適格機関投資家転売制限付)	180,311,996 円
MUKAM 日本株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	3,179,655,707 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	327,721,170 円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド (適格機関投資家限定)	16,468,253,190 円
MUKAM バランス・イノベーション (リスク抑制型) 2 (適格機関投資家転売制限付)	88,085,272 円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	310,244 円
日米コアバランス (FOFs用) (適格機関投資家限定)	124,061,530 円
日本株式インデックスファンドS	2,318,473,058 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	35,980,732 円
MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	94,510,806 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	35,434,968 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	35,501,352 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	35,160,631 円

MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	35,822,253円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	35,950,680円
MUKAM 日米コアバランス 2021-07 (適格機関投資家限定)	333,834,268円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	34,885,307円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	34,844,004円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	35,768,349円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	35,818,860円
MUKAM 日米コアバランス (除く米国株) 2022-03 (適格機関投資家限定)	694,816,377円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	40,180,532円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	39,815,667円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	40,598,807円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	40,095,797円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	34,367,095円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	39,980,785円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	34,332,624円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	35,329,633円
三菱UFJ TOPIX・ファンド	5,550,318,916円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	2,852,812円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	7,168,688円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	1,544,969円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	6,218,678円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA1	473,607,407円
三菱UFJ TOPIX・ファンドVA	74,360,932円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	3,143,007円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	26,049,259円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	1,493,941円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	15,088,550円
三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド	1,569,155,976円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	346,957,394円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	1,482,692,003円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	1,406,182,482円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)	1,321,516,727円
三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド	59,396,522,517円
合計	410,781,255,894円
2. 貸付有価証券 貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。 株式	11,303,800,170円

3. 受益権の総数	410,781,255,894 口
-----------	-------------------

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023 年 7 月 6 日 至 2024 年 1 月 5 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号)第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ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または計算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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024 年 1 月 5 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024 年 1 月 5 日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	181,838,350,243
合計	181,838,350,243

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[2024 年 1 月 5 日現在]

区分	種類	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	4,465,584,500	—	4,519,935,000	54,350,500
合計		4,465,584,500	—	4,519,935,000	54,350,500

(注) 時価の算定方法

- 先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
 - 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
 - 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- ※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024年1月5日現在]
1口当たり純資産額	2.9051円
(1万口当たり純資産額)	(29,051円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1301	極洋	18,700	3,850.00	71,995,000	
1332	ニッスイ	492,400	768.70	378,507,880	
1333	マルハニチロ	73,100	2,822.50	206,324,750	貸付有価証券 2,800株
1375	雪国まいたけ	41,900	935.00	39,176,500	
1376	カネコ種苗	15,100	1,411.00	21,306,100	
1377	サカタのタネ	56,000	3,910.00	218,960,000	
1379	ホクト	39,400	1,755.00	69,147,000	
1384	ホクリヨウ	3,100	1,043.00	3,233,300	貸付有価証券 200株
1514	住石ホールディングス	51,000	1,143.00	58,293,000	貸付有価証券 20,900株
1515	日鉄鉱業	19,700	5,180.00	102,046,000	貸付有価証券 2,800株
1518	三井松島ホールディングス	29,200	2,775.00	81,030,000	貸付有価証券 4,100株

1605	I N P E X	1,821,000	1,981.50	3,608,311,500	
1662	石油資源開発	57,000	5,550.00	316,350,000	
1663	K&Oエナジーグループ	22,300	2,252.00	50,219,600	
1414	ショーボンドホールディングス	67,100	6,444.00	432,392,400	貸付有価証券 100株
1417	ミライト・ワン	162,800	1,898.00	308,994,400	
1419	タマホーム	30,900	4,060.00	125,454,000	
1420	サンヨーホームズ	2,600	755.00	1,963,000	
1429	日本アクア	8,800	922.00	8,113,600	貸付有価証券 2,400株
1430	ファーストコーポレーション	5,400	741.00	4,001,400	
1433	ベステラ	4,800	1,086.00	5,212,800	
1446	キャンディル	3,500	588.00	2,058,000	貸付有価証券 400株
1712	ダイセキ環境ソリューション	4,300	1,113.00	4,785,900	
1716	第一カッター興業	12,600	1,350.00	17,010,000	
1719	安藤・間	285,300	1,164.00	332,089,200	
1720	東急建設	154,200	825.00	127,215,000	
1721	コムシスホールディングス	157,200	3,153.00	495,651,600	貸付有価証券 6,200株
1726	ビーアールホールディングス	72,200	365.00	26,353,000	
1762	高松コンストラクシヨングループ	36,600	2,778.00	101,674,800	貸付有価証券 1,700株
1766	東建コーポレーション	14,200	9,090.00	129,078,000	
1768	ソネック	2,200	956.00	2,103,200	
1780	ヤマウラ	24,900	1,527.00	38,022,300	
1786	オリエンタル白石	182,300	350.00	63,805,000	
1801	大成建設	322,300	5,016.00	1,616,656,800	
1802	大林組	1,231,800	1,268.00	1,561,922,400	
1803	清水建設	976,600	962.10	939,586,860	
1805	飛島建設	35,500	1,409.00	50,019,500	
1808	長谷工コーポレーション	316,000	1,913.50	604,666,000	
1810	松井建設	32,100	863.00	27,702,300	貸付有価証券 2,400株
1811	銭高組	1,900	4,045.00	7,685,500	貸付有価証券 600株
1812	鹿島建設	763,700	2,450.00	1,871,065,000	
1813	不動テトラ	23,800	2,378.00	56,596,400	
1814	大末建設	5,700	1,398.00	7,968,600	
1815	鉄建建設	24,700	2,052.00	50,684,400	

1820	西松建設	65,700	3,994.00	262,405,800	貸付有価証券 2,300株
1821	三井住友建設	256,400	407.00	104,354,800	
1822	大豊建設	11,900	3,705.00	44,089,500	
1826	佐田建設	9,400	660.00	6,204,000	
1827	ナカノフドー建設	10,500	488.00	5,124,000	
1833	奥村組	55,900	4,770.00	266,643,000	
1835	東鉄工業	42,700	3,090.00	131,943,000	
1847	イチケン	3,600	2,319.00	8,348,400	
1848	富士ピー・エス	6,700	465.00	3,115,500	
1852	浅沼組	25,500	4,070.00	103,785,000	
1860	戸田建設	466,100	933.40	435,057,740	
1861	熊谷組	56,800	3,660.00	207,888,000	
1866	北野建設	2,800	3,240.00	9,072,000	
1867	植木組	4,200	1,623.00	6,816,600	
1870	矢作建設工業	46,900	1,393.00	65,331,700	貸付有価証券 6,200株
1871	ピーエス三菱	13,100	893.00	11,698,300	
1873	日本ハウスホールディングス	73,500	301.00	22,123,500	貸付有価証券 4,200株
1879	新日本建設	48,300	1,150.00	55,545,000	
1882	東亜道路工業	13,700	7,020.00	96,174,000	貸付有価証券 800株
1884	日本道路	40,400	2,082.00	84,112,800	
1885	東亜建設工業	26,600	3,745.00	99,617,000	貸付有価証券 100株
1887	日本国土開発	98,000	611.00	59,878,000	
1888	若築建設	11,900	3,100.00	36,890,000	
1890	東洋建設	86,800	1,243.00	107,892,400	貸付有価証券 600株
1893	五洋建設	488,300	814.30	397,622,690	
1898	世紀東急工業	44,200	1,745.00	77,129,000	
1899	福田組	13,000	5,550.00	72,150,000	
1911	住友林業	297,700	4,164.00	1,239,622,800	
1914	日本基礎技術	9,000	462.00	4,158,000	貸付有価証券 200株
1921	巴コーポレーション	18,700	585.00	10,939,500	
1925	大和ハウス工業	952,500	4,461.00	4,249,102,500	貸付有価証券 14,100株
1926	ライト工業	70,800	1,992.00	141,033,600	

1928	積水ハウス	1,044,600	3,227.00	3,370,924,200	
1929	日特建設	32,900	1,126.00	37,045,400	貸付有価証券 500株
1930	北陸電気工事	23,600	1,262.00	29,783,200	
1934	ユアテック	75,900	1,156.00	87,740,400	
1938	日本リーテック	26,900	1,223.00	32,898,700	
1939	四電工	14,400	3,255.00	46,872,000	
1941	中電工	53,400	2,654.00	141,723,600	
1942	関電工	215,700	1,370.00	295,509,000	
1944	きんでん	242,500	2,392.50	580,181,250	
1945	東京エネシス	34,300	1,033.00	35,431,900	
1946	トーエネック	11,400	4,710.00	53,694,000	
1949	住友電設	32,800	2,778.00	91,118,400	
1950	日本電設工業	64,700	1,984.00	128,364,800	貸付有価証券 600株
1951	エクシオグループ	168,300	3,117.00	524,591,100	貸付有価証券 6,200株
1952	新日本空調	22,300	2,387.00	53,230,100	貸付有価証券 800株
1959	九電工	74,500	5,120.00	381,440,000	
1961	三機工業	74,400	1,780.00	132,432,000	
1963	日揮ホールディングス	340,800	1,686.50	574,759,200	
1964	中外炉工業	11,300	2,403.00	27,153,900	
1967	ヤマト	12,400	956.00	11,854,400	
1968	太平電業	21,400	4,380.00	93,732,000	
1969	高砂熱学工業	92,200	3,215.00	296,423,000	
1972	三晃金属工業	1,900	4,715.00	8,958,500	
1975	朝日工業社	16,100	3,060.00	49,266,000	
1976	明星工業	66,600	1,088.00	72,460,800	貸付有価証券 9,000株
1979	大気社	39,700	4,145.00	164,556,500	
1980	ダイダン	45,300	1,455.00	65,911,500	
1982	日比谷総合設備	25,000	2,516.00	62,900,000	
3267	フィル・カンパニー	5,300	615.00	3,259,500	
5074	テスホールディングス	74,200	433.00	32,128,600	
5076	インフロニア・ホールディングス	397,000	1,446.00	574,062,000	
6330	東洋エンジニアリング	50,600	817.00	41,340,200	
6379	レイズネクスト	49,800	1,543.00	76,841,400	

2001	ニッポン	103,500	2,223.00	230,080,500	
2002	日清製粉グループ本社	319,800	1,945.00	622,011,000	
2003	日東富士製粉	6,200	4,955.00	30,721,000	
2004	昭和産業	33,500	3,225.00	108,037,500	
2009	鳥越製粉	12,400	650.00	8,060,000	貸付有価証券 2,100株
2053	中部飼料	47,900	1,091.00	52,258,900	
2060	フィード・ワン	50,500	827.00	41,763,500	
2107	東洋精糖	2,800	2,069.00	5,793,200	貸付有価証券 800株
2108	日本甜菜製糖	20,100	1,997.00	40,139,700	
2109	DM三井製糖ホールディングス	34,300	3,125.00	107,187,500	
2112	塩水港精糖	19,600	240.00	4,704,000	
2117	ウェルネオシュガー	17,300	2,166.00	37,471,800	
2201	森永製菓	148,000	2,613.50	386,798,000	
2204	中村屋	8,600	3,070.00	26,402,000	
2206	江崎グリコ	98,900	4,251.00	420,423,900	
2207	名糖産業	13,600	1,701.00	23,133,600	
2209	井村屋グループ	20,600	2,368.00	48,780,800	
2211	不二家	23,700	2,449.00	58,041,300	
2212	山崎製パン	231,400	3,226.00	746,496,400	貸付有価証券 9,000株
2215	第一屋製パン	2,700	648.00	1,749,600	
2217	モロゾフ	11,200	3,850.00	43,120,000	
2220	亀田製菓	19,800	4,065.00	80,487,000	
2222	寿スピリッツ	163,500	2,091.50	341,960,250	
2229	カルビー	158,300	2,817.50	446,010,250	
2264	森永乳業	120,800	2,816.00	340,172,800	
2266	六甲バター	25,400	1,348.00	34,239,200	
2267	ヤクルト本社	494,200	3,199.00	1,580,945,800	
2269	明治ホールディングス	423,900	3,431.00	1,454,400,900	
2270	雪印メグミルク	83,600	2,148.00	179,572,800	
2281	プリマハム	46,400	2,306.00	106,998,400	
2282	日本ハム	148,700	4,812.00	715,544,400	
2286	林兼産業	5,000	566.00	2,830,000	
2288	丸大食品	34,800	1,625.00	56,550,000	
2292	S F o o d s	38,100	3,335.00	127,063,500	

2294	柿安本店	13,500	2,510.00	33,885,000	貸付有価証券 600株
2296	伊藤ハム米久ホールディングス	52,800	3,925.00	207,240,000	
2501	サッポロホールディングス	113,800	6,419.00	730,482,200	
2502	アサヒグループホールディングス	799,000	5,366.00	4,287,434,000	
2503	キリンホールディングス	1,440,400	2,088.50	3,008,275,400	
2531	宝ホールディングス	236,000	1,226.50	289,454,000	
2533	オエノンホールディングス	103,400	348.00	35,983,200	
2540	養命酒製造	11,400	1,887.00	21,511,800	
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	270,900	2,016.50	546,269,850	
2585	ライフドリンク カンパニー	5,100	4,755.00	24,250,500	
2587	サントリー食品インターナショナル	243,500	4,717.00	1,148,589,500	
2590	ダイドーグループホールディングス	19,600	5,890.00	115,444,000	
2593	伊藤園	117,200	4,417.00	517,672,400	
2594	キーコーヒー	38,700	2,085.00	80,689,500	
2597	ユニカフェ	5,000	923.00	4,615,000	
2599	ジャパンフーズ	2,300	1,364.00	3,137,200	
2602	日清オイリオグループ	48,700	4,445.00	216,471,500	
2607	不二製油グループ本社	80,500	2,480.50	199,680,250	
2612	かどや製油	1,500	3,675.00	5,512,500	
2613	J-オイルミルズ	39,600	1,955.00	77,418,000	
2801	キッコーマン	229,200	8,698.00	1,993,581,600	
2802	味の素	821,700	5,516.00	4,532,497,200	貸付有価証券 32,500株
2804	ブルドックソース	18,300	2,183.00	39,948,900	
2809	キューピー	185,800	2,560.50	475,740,900	貸付有価証券 7,300株
2810	ハウス食品グループ本社	119,100	3,159.00	376,236,900	
2811	カゴメ	148,700	3,127.00	464,984,900	
2812	焼津水産化学工業	8,000	1,217.00	9,736,000	
2815	アリアケジャパン	34,500	4,505.00	155,422,500	
2818	ピエトロ	2,000	1,818.00	3,636,000	
2819	エバラ食品工業	8,200	2,869.00	23,525,800	
2820	やまみ	1,300	3,350.00	4,355,000	貸付有価証券 100株
2871	ニチレイ	158,500	3,503.00	555,225,500	
2875	東洋水産	174,700	7,600.00	1,327,720,000	

2882	イトアンドホールディングス	16,400	2,112.00	34,636,800	
2883	大冷	2,000	1,939.00	3,878,000	
2884	ヨシムラ・フード・ホールディングス	15,700	1,066.00	16,736,200	貸付有価証券 2,400株
2897	日清食品ホールディングス	364,700	4,938.00	1,800,888,600	
2899	永谷園ホールディングス	17,000	2,175.00	36,975,000	
2904	一正蒲鉾	6,400	750.00	4,800,000	
2908	フジッコ	35,500	1,975.00	70,112,500	
2910	ロック・フィールド	38,700	1,623.00	62,810,100	
2914	日本たばこ産業	2,101,200	3,757.00	7,894,208,400	
2915	ケンコーマヨネーズ	23,800	1,724.00	41,031,200	
2918	わらべや日洋ホールディングス	23,100	3,420.00	79,002,000	
2922	なとり	21,700	2,105.00	45,678,500	
2924	イフジ産業	2,800	1,350.00	3,780,000	貸付有価証券 200株
2929	ファーマフーズ	49,600	1,009.00	50,046,400	貸付有価証券 1,300株
2931	ユーグレナ	215,200	690.00	148,488,000	貸付有価証券 19,600株
2933	紀文食品	30,000	1,225.00	36,750,000	貸付有価証券 1,000株
2935	ビックルスホールディングス	20,300	1,215.00	24,664,500	
4404	ミヨシ油脂	5,500	1,271.00	6,990,500	
4526	理研ビタミン	29,900	2,278.00	68,112,200	
3001	片倉工業	32,400	1,685.00	54,594,000	
3002	グンゼ	25,000	5,080.00	127,000,000	
3101	東洋紡	152,000	1,079.00	164,008,000	
3103	ユニチカ	113,800	171.00	19,459,800	
3104	富士紡ホールディングス	15,400	3,885.00	59,829,000	
3106	倉敷紡績	26,300	2,950.00	77,585,000	
3109	シキボウ	16,300	1,160.00	18,908,000	貸付有価証券 600株
3201	日本毛織	92,800	1,359.00	126,115,200	
3202	ダイトウボウ	24,600	91.00	2,238,600	貸付有価証券 7,000株
3204	トーア紡コーポレーション	6,000	430.00	2,580,000	
3205	ダイドーリミテッド	21,800	443.00	9,657,400	貸付有価証券 5,700株
3302	帝国繊維	39,600	2,089.00	82,724,400	
3401	帝人	338,000	1,365.50	461,539,000	

3402	東レ	2,356,800	746.80	1,760,058,240	
3501	住江織物	2,800	2,266.00	6,344,800	
3512	日本フェルト	10,800	430.00	4,644,000	
3513	イチカワ	1,900	1,620.00	3,078,000	
3524	日東製網	1,600	1,560.00	2,496,000	
3529	アツギ	10,300	502.00	5,170,600	貸付有価証券 5,200株
3551	ダイニック	4,500	725.00	3,262,500	貸付有価証券 1,600株
3569	セーレン	67,900	2,469.00	167,645,100	
3571	ソトー	4,800	701.00	3,364,800	貸付有価証券 1,700株
3577	東海染工	1,400	870.00	1,218,000	
3580	小松マテーレ	51,000	779.00	39,729,000	
3591	ワコールホールディングス	72,100	3,441.00	248,096,100	貸付有価証券 800株
3593	ホギメディカル	46,400	3,490.00	161,936,000	
3607	クラウディアホールディングス	3,500	371.00	1,298,500	貸付有価証券 1,500株
3608	T S Iホールディングス	114,400	755.00	86,372,000	貸付有価証券 7,900株
3611	マツオカコーポレーション	4,500	1,445.00	6,502,500	貸付有価証券 1,200株
3612	ワールド	49,700	1,695.00	84,241,500	
8011	三陽商会	11,600	2,366.00	27,445,600	
8013	ナイガイ	5,100	269.00	1,371,900	
8016	オンワードホールディングス	207,400	490.00	101,626,000	貸付有価証券 800株
8029	ルックホールディングス	8,600	2,348.00	20,192,800	
8107	キムラタン	96,300	19.00	1,829,700	貸付有価証券 23,300株
8111	ゴールドウイン	62,300	9,485.00	590,915,500	
8114	デサント	60,600	3,645.00	220,887,000	
8118	キング	5,700	698.00	3,978,600	貸付有価証券 2,100株
8127	ヤマトインターナショナル	11,900	314.00	3,736,600	
3708	特種東海製紙	19,200	3,995.00	76,704,000	
3861	王子ホールディングス	1,465,400	561.50	822,822,100	貸付有価証券 75,000株
3863	日本製紙	198,500	1,300.00	258,050,000	
3864	三菱製紙	20,300	570.00	11,571,000	貸付有価証券 5,000株

3865	北越コーポレーション	172,900	1,391.00	240,503,900	貸付有価証券 48,500株
3877	中越パルプ工業	6,000	1,909.00	11,454,000	貸付有価証券 1,900株
3880	大王製紙	155,400	1,126.00	174,980,400	
3896	阿波製紙	3,700	382.00	1,413,400	
3941	レンゴー	320,400	962.30	308,320,920	
3946	トーマク	20,300	2,218.00	45,025,400	
3950	ザ・バック	26,100	3,290.00	85,869,000	貸付有価証券 1,800株
2930	北の達人コーポレーション	148,200	211.00	31,270,200	貸付有価証券 5,700株
3405	クラレ	512,600	1,447.00	741,732,200	
3407	旭化成	2,379,800	1,076.50	2,561,854,700	貸付有価証券 85,400株
3553	共和レザー	8,700	746.00	6,490,200	貸付有価証券 500株
3878	巴川コーポレーション	4,300	1,089.00	4,682,700	
4004	レゾナック・ホールディングス	340,000	2,978.00	1,012,520,000	貸付有価証券 30,900株
4005	住友化学	2,610,400	358.10	934,784,240	貸付有価証券 355,000株
4008	住友精化	16,500	5,150.00	84,975,000	
4021	日産化学	165,200	5,577.00	921,320,400	貸付有価証券 5,200株
4022	ラサ工業	13,600	2,141.00	29,117,600	
4023	クレハ	76,900	2,928.00	225,163,200	貸付有価証券 11,100株
4025	多木化学	13,700	3,150.00	43,155,000	
4027	テイカ	30,400	1,386.00	42,134,400	
4028	石原産業	58,300	1,412.00	82,319,600	
4031	片倉コープアグリ	3,500	1,101.00	3,853,500	貸付有価証券 1,100株
4041	日本曹達	41,500	5,580.00	231,570,000	
4042	東ソー	469,600	1,900.00	892,240,000	
4043	トクヤマ	113,600	2,468.00	280,364,800	
4044	セントラル硝子	37,600	2,706.00	101,745,600	
4045	東亜合成	176,400	1,342.50	236,817,000	
4046	大阪ソーダ	24,600	8,880.00	218,448,000	
4047	関東電化工業	68,000	863.00	58,684,000	貸付有価証券 10,300株
4061	デンカ	127,900	2,583.50	330,429,650	

4063	信越化学工業	3,189,800	5,637.00	17,980,902,600	
4064	日本カーバイド工業	5,900	1,470.00	8,673,000	
4078	堺化学工業	26,800	1,926.00	51,616,800	
4082	第一稀元素化学工業	38,500	993.00	38,230,500	貸付有価証券 4,700株
4088	エア・ウォーター	331,900	1,928.00	639,903,200	
4091	日本酸素ホールディングス	341,300	3,792.00	1,294,209,600	
4092	日本化学工業	12,900	1,908.00	24,613,200	
4093	東邦アセチレン	20,000	380.00	7,600,000	
4095	日本パーカライジング	156,700	1,146.00	179,578,200	
4097	高圧ガス工業	51,100	885.00	45,223,500	貸付有価証券 6,900株
4098	チタン工業	2,000	1,143.00	2,286,000	貸付有価証券 500株
4099	四国化成ホールディングス	45,000	1,819.00	81,855,000	貸付有価証券 200株
4100	戸田工業	8,000	1,556.00	12,448,000	貸付有価証券 1,000株
4109	ステラ ケミファ	19,100	3,285.00	62,743,500	
4112	保土谷化学工業	11,000	3,630.00	39,930,000	貸付有価証券 300株
4114	日本触媒	51,200	5,539.00	283,596,800	
4116	大日精化工業	24,400	2,618.00	63,879,200	
4118	カネカ	89,300	3,602.00	321,658,600	
4182	三菱瓦斯化学	262,700	2,320.00	609,464,000	
4183	三井化学	290,100	4,358.00	1,264,255,800	貸付有価証券 11,300株
4185	J S R	383,200	4,025.00	1,542,380,000	
4186	東京応化工業	167,800	2,996.50	502,812,700	
4187	大阪有機化学工業	29,400	2,592.00	76,204,800	
4188	三菱ケミカルグループ	2,571,600	895.50	2,302,867,800	
4189	KHネオケム	53,700	2,308.00	123,939,600	
4202	ダイセル	452,200	1,423.00	643,480,600	
4203	住友ベークライト	49,300	7,393.00	364,474,900	
4204	積水化学工業	706,800	2,091.00	1,477,918,800	
4205	日本ゼオン	241,100	1,308.50	315,479,350	
4206	アイカ工業	88,800	3,420.00	303,696,000	
4208	UBE	167,400	2,369.00	396,570,600	
4212	積水樹脂	52,500	2,523.00	132,457,500	
4215	タキロンシーアイ	89,700	650.00	58,305,000	

4216	旭有機材	23,400	3,780.00	88,452,000	貸付有価証券 2,500株
4218	ニチバン	19,100	1,755.00	33,520,500	
4220	リケンテクノス	75,800	864.00	65,491,200	
4221	大倉工業	16,300	2,542.00	41,434,600	貸付有価証券 700株
4228	積水化成工業	49,400	500.00	24,700,000	
4229	群栄化学工業	8,300	3,185.00	26,435,500	
4231	タイガースポリマー	6,800	896.00	6,092,800	貸付有価証券 2,200株
4238	ミライアル	5,200	1,449.00	7,534,800	
4245	ダイキアクシス	5,900	722.00	4,259,800	貸付有価証券 1,500株
4246	ダイキョーニシカワ	77,600	707.00	54,863,200	
4248	竹本容器	5,300	772.00	4,091,600	
4249	森六ホールディングス	18,300	2,860.00	52,338,000	
4251	恵和	25,300	1,250.00	31,625,000	貸付有価証券 2,400株
4272	日本化薬	268,700	1,347.50	362,073,250	
4275	カーリットホールディングス	37,900	923.00	34,981,700	
4362	日本精化	23,300	3,110.00	72,463,000	貸付有価証券 500株
4368	扶桑化学工業	37,300	4,110.00	153,303,000	貸付有価証券 3,000株
4369	トリケミカル研究所	42,700	3,675.00	156,922,500	貸付有価証券 4,000株
4401	ADEKA	122,600	2,867.00	351,494,200	
4403	日油	106,200	6,853.00	727,788,600	
4406	新日本理化	20,800	197.00	4,097,600	
4410	ハリマ化成グループ	11,100	823.00	9,135,300	貸付有価証券 3,600株
4452	花王	795,400	5,845.00	4,649,113,000	
4461	第一工業製薬	14,000	1,935.00	27,090,000	
4462	石原ケミカル	15,700	1,906.00	29,924,200	
4463	日華化学	6,000	943.00	5,658,000	
4465	ニイタカ	2,800	1,867.00	5,227,600	
4471	三洋化成工業	21,600	4,360.00	94,176,000	
4531	有機合成薬品工業	11,700	286.00	3,346,200	貸付有価証券 3,300株
4611	大日本塗料	39,000	1,080.00	42,120,000	
4612	日本ペイントホールディングス	1,867,800	1,143.50	2,135,829,300	

4613	関西ペイント	344,700	2,400.00	827,280,000	
4615	神東塗料	12,500	131.00	1,637,500	貸付有価証券 3,400株
4617	中国塗料	72,200	1,691.00	122,090,200	
4619	日本特殊塗料	10,700	1,220.00	13,054,000	
4620	藤倉化成	40,500	439.00	17,779,500	
4626	太陽ホールディングス	61,200	3,040.00	186,048,000	
4631	D I C	137,500	2,724.50	374,618,750	
4633	サカタインクス	78,300	1,355.00	106,096,500	
4634	a r t i e n c e	76,500	2,621.00	200,506,500	
4636	T & K TOKA	33,700	1,455.00	49,033,500	貸付有価証券 1,400株
4901	富士フイルムホールディングス	653,400	8,509.00	5,559,780,600	
4911	資生堂	735,400	4,212.00	3,097,504,800	
4912	ライオン	461,000	1,308.50	603,218,500	
4914	高砂香料工業	26,500	3,530.00	93,545,000	貸付有価証券 700株
4917	マンダム	76,100	1,280.00	97,408,000	
4919	ミルボン	47,800	3,625.00	173,275,000	
4921	ファンケル	154,100	2,318.00	357,203,800	
4922	コーセー	71,600	10,260.00	734,616,000	
4923	コタ	32,400	1,584.00	51,321,600	
4926	シーボン	2,000	1,492.00	2,984,000	
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	180,500	1,551.00	279,955,500	
4928	ノエビアホールディングス	31,400	5,180.00	162,652,000	
4929	アジュバンホールディングス	3,600	936.00	3,369,600	
4931	新日本製薬	20,100	1,753.00	35,235,300	
4933	I - n e	7,000	2,402.00	16,814,000	
4936	アクシージア	17,900	880.00	15,752,000	貸付有価証券 800株
4951	エステー	27,200	1,536.00	41,779,200	
4955	アグロ カネショウ	14,100	1,513.00	21,333,300	
4956	コニシ	101,700	1,395.00	141,871,500	
4958	長谷川香料	67,300	3,060.00	205,938,000	貸付有価証券 3,200株
4967	小林製薬	102,500	6,564.00	672,810,000	
4968	荒川化学工業	29,800	1,045.00	31,141,000	
4971	メック	29,000	4,215.00	122,235,000	

4973	日本高純度化学	8,000	2,497.00	19,976,000	
4974	タカラバイオ	94,900	1,236.00	117,296,400	
4975	J C U	39,400	3,760.00	148,144,000	
4977	新田ゼラチン	9,900	769.00	7,613,100	貸付有価証券 2,800株
4979	O A Tアグリオ	6,500	1,757.00	11,420,500	
4980	デクセリアルズ	88,300	4,223.00	372,890,900	
4985	アース製薬	32,000	4,530.00	144,960,000	貸付有価証券 3,300株
4992	北興化学工業	35,400	1,071.00	37,913,400	
4994	大成ラミック	10,200	2,928.00	29,865,600	
4996	クミアイ化学工業	139,900	845.00	118,215,500	
4997	日本農薬	64,600	650.00	41,990,000	
5142	アキレス	22,200	1,592.00	35,342,400	
5208	有沢製作所	61,700	1,061.00	65,463,700	貸付有価証券 7,000株
6988	日東電工	226,200	10,700.00	2,420,340,000	
7874	レック	45,100	1,034.00	46,633,400	
7888	三光合成	44,300	502.00	22,238,600	貸付有価証券 5,100株
7908	きもと	25,100	207.00	5,195,700	
7917	藤森工業	27,800	3,835.00	106,613,000	
7925	前澤化成工業	22,700	1,523.00	34,572,100	貸付有価証券 2,200株
7931	未来工業	12,600	3,575.00	45,045,000	
7940	ウェーブブロックホールディングス	5,200	637.00	3,312,400	
7942	J S P	24,800	1,865.00	46,252,000	
7947	エフピコ	66,600	2,888.00	192,340,800	
7958	天馬	25,500	2,269.00	57,859,500	
7970	信越ポリマー	76,000	1,644.00	124,944,000	
7971	東リ	43,200	326.00	14,083,200	
7988	ニフコ	105,300	3,839.00	404,246,700	
7995	バルカー	29,500	4,170.00	123,015,000	
8113	ユニ・チャーム	733,800	5,125.00	3,760,725,000	
9385	ショーエイコーポレーション	4,500	599.00	2,695,500	貸付有価証券 500株
4151	協和キリン	425,500	2,414.50	1,027,369,750	
4502	武田薬品工業	3,117,100	4,288.00	13,366,124,800	
4503	アステラス製薬	3,089,500	1,766.00	5,456,057,000	

4506	住友ファーマ	261,300	486.00	126,991,800	
4507	塩野義製薬	444,000	6,883.00	3,056,052,000	
4512	わかもと製薬	15,900	213.00	3,386,700	貸付有価証券 5,200株
4516	日本新薬	92,300	5,192.00	479,221,600	
4519	中外製薬	1,102,500	5,388.00	5,940,270,000	
4521	科研製薬	60,300	3,394.00	204,658,200	
4523	エーザイ	428,400	7,260.00	3,110,184,000	
4527	ロート製薬	341,200	2,920.50	996,474,600	
4528	小野薬品工業	747,500	2,639.50	1,973,026,250	
4530	久光製薬	78,300	4,353.00	340,839,900	
4534	持田製薬	40,400	3,310.00	133,724,000	
4536	参天製薬	641,900	1,421.50	912,460,850	
4538	扶桑薬品工業	12,400	1,920.00	23,808,000	
4539	日本ケミファ	1,700	1,600.00	2,720,000	貸付有価証券 600株
4540	ツムラ	110,900	2,670.50	296,158,450	
4547	キッセイ薬品工業	58,300	3,165.00	184,519,500	
4548	生化学工業	59,700	771.00	46,028,700	貸付有価証券 8,600株
4549	栄研化学	64,700	1,710.00	110,637,000	
4551	鳥居薬品	18,900	3,650.00	68,985,000	
4552	JCRファーマ	119,200	1,142.00	136,126,400	
4553	東和薬品	54,100	2,410.00	130,381,000	
4554	富士製薬工業	26,000	1,843.00	47,918,000	
4559	ゼリア新薬工業	48,800	2,033.00	99,210,400	
4565	そーせいグループ	115,600	1,510.00	174,556,000	
4568	第一三共	3,068,300	4,031.00	12,368,317,300	
4569	杏林製薬	76,400	1,793.00	136,985,200	
4574	大幸薬品	72,700	293.00	21,301,100	貸付有価証券 6,100株
4577	ダイト	27,100	1,921.00	52,059,100	貸付有価証券 100株
4578	大塚ホールディングス	732,600	5,587.00	4,093,036,200	
4581	大正製薬ホールディングス	78,300	8,671.00	678,939,300	
4587	ペプチドリーム	170,700	1,406.00	240,004,200	貸付有価証券 22,400株
4880	セルソース	9,800	1,275.00	12,495,000	貸付有価証券 100株
4886	あすか製薬ホールディングス	36,100	1,825.00	65,882,500	

4887	サワイグループホールディングス	80,500	5,238.00	421,659,000	貸付有価証券 3,200株
3315	日本コークス工業	357,400	125.00	44,675,000	貸付有価証券 37,400株
5011	ニチレキ	45,800	2,459.00	112,622,200	貸付有価証券 200株
5013	ユシロ化学工業	18,300	1,716.00	31,402,800	
5015	ビービー・カストロール	5,900	872.00	5,144,800	
5017	富士石油	102,700	377.00	38,717,900	
5018	MORESCO	5,400	1,325.00	7,155,000	
5019	出光興産	1,955,900	807.50	1,579,389,250	
5020	ENEOSホールディングス	5,576,100	597.30	3,330,604,530	
5021	コスモエネルギーホールディングス	104,400	5,924.00	618,465,600	
5101	横浜ゴム	178,100	3,294.00	586,661,400	
5105	TOYO TIRE	202,400	2,356.50	476,955,600	
5108	ブリヂストン	1,031,000	5,913.00	6,096,303,000	
5110	住友ゴム工業	345,400	1,584.00	547,113,600	
5121	藤倉コンポジット	23,700	1,404.00	33,274,800	
5122	オカモト	16,600	4,940.00	82,004,000	
5185	フコク	18,500	1,379.00	25,511,500	貸付有価証券 800株
5186	ニッタ	35,800	3,730.00	133,534,000	
5191	住友理工	54,700	1,098.00	60,060,600	
5192	三ツ星ベルト	42,800	4,520.00	193,456,000	
5195	バンドー化学	52,300	1,656.00	86,608,800	貸付有価証券 2,500株
3110	日東紡績	44,600	4,775.00	212,965,000	貸付有価証券 1,600株
5201	AGC	314,100	5,334.00	1,675,409,400	
5202	日本板硝子	168,000	603.00	101,304,000	
5204	石塚硝子	2,600	3,355.00	8,723,000	
5210	日本山村硝子	5,700	1,406.00	8,014,200	貸付有価証券 1,900株
5214	日本電気硝子	143,800	3,108.00	446,930,400	
5218	オハラ	16,700	1,171.00	19,555,700	貸付有価証券 1,700株
5232	住友大阪セメント	58,600	3,819.00	223,793,400	
5233	太平洋セメント	208,300	2,995.50	623,962,650	貸付有価証券 5,100株
5262	日本ヒューム	30,800	910.00	28,028,000	
5269	日本コンクリート工業	68,300	347.00	23,700,100	貸付有価証券

					2,700株
5273	三谷セキサン	14,800	5,140.00	76,072,000	貸付有価証券 100株
5288	アジアパイルホールディングス	50,000	717.00	35,850,000	
5301	東海カーボン	324,900	1,041.00	338,220,900	
5302	日本カーボン	18,600	4,410.00	82,026,000	
5310	東洋炭素	24,800	4,915.00	121,892,000	貸付有価証券 2,600株
5331	ノリタケカンパニーリミテド	19,500	7,040.00	137,280,000	
5332	TOTO	232,400	3,824.00	888,697,600	貸付有価証券 9,100株
5333	日本碍子	409,700	1,737.00	711,648,900	
5334	日本特殊陶業	294,900	3,515.00	1,036,573,500	
5337	ダントーホールディングス	10,000	1,076.00	10,760,000	貸付有価証券 4,800株
5344	MARUWA	13,000	27,660.00	359,580,000	貸付有価証券 600株
5351	品川リフラクトリーズ	43,300	1,854.00	80,278,200	
5352	黒崎播磨	7,200	11,470.00	82,584,000	貸付有価証券 900株
5357	ヨータイ	21,700	1,503.00	32,615,100	
5363	東京窯業	16,200	449.00	7,273,800	貸付有価証券 5,600株
5367	ニッカトー	6,700	571.00	3,825,700	貸付有価証券 2,000株
5384	フジミインコーポレーテッド	94,700	2,934.00	277,849,800	
5388	クニミネ工業	4,300	1,022.00	4,394,600	
5391	エーアンドエーマテリアル	2,800	1,338.00	3,746,400	
5393	ニチアス	89,100	3,390.00	302,049,000	
7943	ニチハ	44,100	2,918.00	128,683,800	
5401	日本製鉄	1,622,400	3,384.00	5,490,201,600	
5406	神戸製鋼所	728,700	1,948.00	1,419,507,600	貸付有価証券 44,900株
5408	中山製鋼所	82,800	845.00	69,966,000	貸付有価証券 7,400株
5410	合同製鐵	20,300	4,860.00	98,658,000	貸付有価証券 2,400株
5411	J F Eホールディングス	1,007,700	2,310.00	2,327,787,000	
5423	東京製鐵	101,800	1,802.00	183,443,600	貸付有価証券 10,300株
5440	共英製鋼	41,300	2,090.00	86,317,000	貸付有価証券 4,900株
5444	大和工業	68,300	7,752.00	529,461,600	

5445	東京鐵鋼	16,000	4,505.00	72,080,000	
5449	大阪製鐵	16,700	2,579.00	43,069,300	貸付有価証券 1,000株
5451	淀川製鋼所	41,200	3,915.00	161,298,000	
5461	中部鋼板	23,800	2,369.00	56,382,200	貸付有価証券 3,700株
5463	丸一鋼管	110,300	3,706.00	408,771,800	
5464	モリ工業	6,400	4,380.00	28,032,000	
5471	大同特殊鋼	228,200	1,504.50	343,326,900	
5476	日本高周波鋼業	5,900	575.00	3,392,500	貸付有価証券 1,600株
5480	日本冶金工業	26,500	4,355.00	115,407,500	貸付有価証券 3,600株
5481	山陽特殊製鋼	35,800	2,668.00	95,514,400	
5482	愛知製鋼	20,900	3,260.00	68,134,000	貸付有価証券 2,400株
5491	日本金属	4,000	875.00	3,500,000	貸付有価証券 1,000株
5541	大平洋金属	30,900	1,209.00	37,358,100	貸付有価証券 2,800株
5563	新日本電工	180,200	280.00	50,456,000	
5602	栗本鐵工所	16,800	3,270.00	54,936,000	
5603	虹技	1,900	1,143.00	2,171,700	貸付有価証券 600株
5612	日本鑄鉄管	1,700	1,081.00	1,837,700	
5632	三菱製鋼	26,800	1,509.00	40,441,200	貸付有価証券 500株
5658	日亜鋼業	15,700	325.00	5,102,500	
5659	日本精線	5,700	4,985.00	28,414,500	
5698	エンビプロ・ホールディングス	11,300	593.00	6,700,900	
6319	シンニッタン	19,600	265.00	5,194,000	貸付有価証券 4,000株
7305	新家工業	3,400	2,905.00	9,877,000	貸付有価証券 1,000株
5702	大紀アルミニウム工業所	45,800	1,221.00	55,921,800	
5703	日本軽金属ホールディングス	105,800	1,770.00	187,266,000	
5706	三井金属鉱業	105,500	4,420.00	466,310,000	
5707	東邦亜鉛	23,200	1,153.00	26,749,600	貸付有価証券 900株
5711	三菱マテリアル	259,000	2,529.50	655,140,500	
5713	住友金属鉱山	420,100	4,262.00	1,790,466,200	
5714	DOWAホールディングス	89,500	5,112.00	457,524,000	

5715	古河機械金属	47,800	1,977.00	94,500,600	
5721	エス・サイエンス	75,500	20.00	1,510,000	貸付有価証券 19,300株
5726	大阪チタニウムテクノロジーズ	62,800	2,759.00	173,265,200	貸付有価証券 4,600株
5727	東邦チタニウム	74,900	1,842.00	137,965,800	貸付有価証券 14,900株
5741	UACJ	50,800	3,855.00	195,834,000	
5757	CKサンエツ	8,700	3,865.00	33,625,500	
5801	古河電気工業	120,600	2,238.00	269,902,800	
5802	住友電気工業	1,355,400	1,838.50	2,491,902,900	
5803	フジクラ	427,400	1,112.00	475,268,800	
5805	SWCC	40,500	2,929.00	118,624,500	
5809	タツタ電線	64,500	694.00	44,763,000	貸付有価証券 8,700株
5819	カナレ電気	2,500	1,539.00	3,847,500	
5821	平河ヒューテック	23,100	1,351.00	31,208,100	
5851	リョービ	38,600	2,718.00	104,914,800	貸付有価証券 4,600株
5852	アーレスティ	17,100	731.00	12,500,100	貸付有価証券 5,700株
5857	AREホールディングス	136,100	1,966.00	267,572,600	貸付有価証券 2,600株
3421	稲葉製作所	17,900	1,510.00	27,029,000	
3431	宮地エンジニアリンググループ	18,200	3,300.00	60,060,000	
3433	トーカロ	104,500	1,482.00	154,869,000	
3434	アルファC o	5,700	1,404.00	8,002,800	
3436	SUMCO	643,800	2,058.50	1,325,262,300	
3443	川田テクノロジーズ	8,500	6,770.00	57,545,000	
3445	RS Technologies	24,200	2,952.00	71,438,400	
3446	ジェイテックコーポレーション	2,000	2,068.00	4,136,000	貸付有価証券 500株
3447	信和	9,900	762.00	7,543,800	
5901	東洋製罐グループホールディングス	216,100	2,364.00	510,860,400	
5902	ホッカンホールディングス	17,700	1,709.00	30,249,300	
5909	コロナ	20,200	964.00	19,472,800	
5911	横河ブリッジホールディングス	56,700	2,665.00	151,105,500	
5915	駒井ハルテック	2,700	2,055.00	5,548,500	貸付有価証券 800株
5923	高田機工	1,200	3,400.00	4,080,000	貸付有価証券 100株

5929	三和ホールディングス	364,000	2,154.50	784,238,000	
5930	文化シヤッター	94,800	1,427.00	135,279,600	
5932	三協立山	41,400	801.00	33,161,400	
5933	アルインコ	27,600	1,023.00	28,234,800	貸付有価証券 3,200株
5936	東洋シヤッター	3,500	685.00	2,397,500	
5938	L I X I L	565,800	1,844.50	1,043,618,100	貸付有価証券 20,600株
5942	日本ファイルコン	10,100	476.00	4,807,600	
5943	ノーリツ	60,000	1,526.00	91,560,000	
5946	長府製作所	36,000	2,050.00	73,800,000	
5947	リンナイ	177,400	3,280.00	581,872,000	
5951	ダイニチ工業	7,700	718.00	5,528,600	
5957	日東精工	52,500	536.00	28,140,000	
5958	三洋工業	1,800	2,734.00	4,921,200	
5959	岡部	64,700	756.00	48,913,200	
5970	ジーテクト	46,200	1,753.00	80,988,600	貸付有価証券 1,600株
5975	東プレ	63,800	1,918.00	122,368,400	
5976	高周波熱錬	55,900	988.00	55,229,200	貸付有価証券 200株
5981	東京製綱	23,500	1,385.00	32,547,500	貸付有価証券 6,800株
5985	サンコール	14,500	451.00	6,539,500	
5986	モリテック スチール	13,100	290.00	3,799,000	貸付有価証券 3,400株
5988	パイオラックス	45,000	2,403.00	108,135,000	
5989	エイチワン	37,300	809.00	30,175,700	
5991	日本発條	320,500	1,201.50	385,080,750	
5992	中央発條	26,800	698.00	18,706,400	貸付有価証券 1,000株
5998	アドバネクス	2,000	932.00	1,864,000	貸付有価証券 600株
7989	立川ブラインド工業	16,400	1,427.00	23,402,800	
8155	三益半導体工業	28,000	3,095.00	86,660,000	
1909	日本ドライケミカル	3,500	2,674.00	9,359,000	
5631	日本製鋼所	97,700	2,459.00	240,244,300	
6005	三浦工業	148,100	2,755.50	408,089,550	
6013	タクマ	119,900	1,754.00	210,304,600	
6101	ツガミ	78,800	1,206.00	95,032,800	貸付有価証券 9,100株

6103	オークマ	31,000	6,096.00	188,976,000	
6104	芝浦機械	35,400	3,475.00	123,015,000	
6113	アマダ	565,900	1,497.00	847,152,300	
6118	アイダエンジニアリング	82,100	844.00	69,292,400	貸付有価証券 2,900株
6121	TAKISAWA	1,300	2,596.00	3,374,800	
6134	FUJ I	167,000	2,398.00	400,466,000	
6135	牧野フライス製作所	39,200	5,870.00	230,104,000	
6136	オーエスジー	156,300	1,965.00	307,129,500	
6138	ダイジェット工業	1,500	839.00	1,258,500	
6140	旭ダイヤモンド工業	81,800	850.00	69,530,000	
6141	DMG森精機	215,000	2,652.50	570,287,500	貸付有価証券 8,400株
6143	ソディック	86,300	727.00	62,740,100	
6146	ディスコ	170,800	32,920.00	5,622,736,000	
6151	日東工器	17,200	1,880.00	32,336,000	
6157	日進工具	32,900	1,015.00	33,393,500	貸付有価証券 2,600株
6165	パンチ工業	14,600	410.00	5,986,000	
6167	富士ダイス	18,400	673.00	12,383,200	貸付有価証券 2,100株
6203	豊和工業	8,300	769.00	6,382,700	貸付有価証券 3,400株
6208	石川製作所	3,900	1,166.00	4,547,400	貸付有価証券 1,000株
6209	リケンNPR	38,500	2,358.00	90,783,000	貸付有価証券 5,600株
6210	東洋機械金属	11,000	709.00	7,799,000	貸付有価証券 3,100株
6217	津田駒工業	2,700	360.00	972,000	貸付有価証券 800株
6218	エンシュウ	3,600	688.00	2,476,800	貸付有価証券 1,000株
6222	島精機製作所	56,400	1,522.00	85,840,800	
6235	オプトラン	58,300	1,614.00	94,096,200	貸付有価証券 2,300株
6236	NCホールディングス	3,600	1,965.00	7,074,000	貸付有価証券 1,300株
6237	イワキポンプ	23,600	2,069.00	48,828,400	
6238	フリーー	33,400	1,328.00	44,355,200	
6240	ヤマシンフィルタ	85,100	326.00	27,742,600	貸付有価証券 9,400株
6247	日阪製作所	38,700	932.00	36,068,400	

6250	やまびこ	57,900	1,535.00	88,876,500	
6254	野村マイクロ・サイエンス	12,000	14,780.00	177,360,000	貸付有価証券 1,000株
6258	平田機工	17,000	6,110.00	103,870,000	貸付有価証券 1,200株
6262	P E G A S U S	39,100	448.00	17,516,800	
6264	マルマエ	15,400	1,893.00	29,152,200	貸付有価証券 2,500株
6266	タツモ	21,400	2,759.00	59,042,600	
6268	ナブテスコ	222,600	2,812.50	626,062,500	
6269	三井海洋開発	44,900	2,330.00	104,617,000	貸付有価証券 4,700株
6272	レオン自動機	41,000	1,512.00	61,992,000	
6273	SMC	106,200	75,000.00	7,965,000,000	
6277	ホソカワミクロン	22,700	4,045.00	91,821,500	
6278	ユニオンツール	15,600	3,370.00	52,572,000	
6279	瑞光	25,500	1,877.00	47,863,500	貸付有価証券 900株
6282	オイレス工業	48,100	2,043.00	98,268,300	
6284	日精エー・エス・ビー機械	14,100	4,350.00	61,335,000	
6287	サトーホールディングス	50,400	2,122.00	106,948,800	
6289	技研製作所	33,300	1,886.00	62,803,800	
6291	日本エアータック	16,600	1,220.00	20,252,000	
6292	カワタ	4,700	1,085.00	5,099,500	貸付有価証券 1,300株
6293	日精樹脂工業	26,300	1,154.00	30,350,200	
6294	オカダアイヨン	5,100	2,615.00	13,336,500	
6298	ワイエイシイホールディングス	11,700	2,312.00	27,050,400	貸付有価証券 2,800株
6301	小松製作所	1,662,500	3,804.00	6,324,150,000	
6302	住友重機械工業	209,800	3,586.00	752,342,800	
6305	日立建機	141,300	3,880.00	548,244,000	貸付有価証券 5,500株
6306	日工	52,500	712.00	37,380,000	
6309	巴工業	13,800	3,700.00	51,060,000	貸付有価証券 1,000株
6310	井関農機	33,200	1,091.00	36,221,200	
6315	T O W A	39,500	6,480.00	255,960,000	
6316	丸山製作所	2,600	2,640.00	6,864,000	
6317	北川鉄工所	13,900	1,372.00	19,070,800	
6323	ローツェ	18,500	14,350.00	265,475,000	

6325	タカキタ	5,000	512.00	2,560,000	貸付有価証券 1,600株
6326	クボタ	1,861,300	2,141.00	3,985,043,300	
6328	荏原実業	18,700	2,925.00	54,697,500	
6331	三菱化工機	12,500	3,205.00	40,062,500	
6332	月島ホールディングス	47,900	1,375.00	65,862,500	貸付有価証券 500株
6333	帝国電機製作所	24,900	3,030.00	75,447,000	
6335	東京機械製作所	4,000	488.00	1,952,000	貸付有価証券 1,000株
6339	新東工業	71,700	1,094.00	78,439,800	
6340	澁谷工業	33,300	2,433.00	81,018,900	
6345	アイチ コーポレーション	49,400	1,051.00	51,919,400	
6349	小森コーポレーション	87,400	1,239.00	108,288,600	
6351	鶴見製作所	27,100	3,775.00	102,302,500	
6356	日本ギア工業	5,800	520.00	3,016,000	貸付有価証券 1,300株
6358	酒井重工業	4,900	6,460.00	31,654,000	
6361	荏原製作所	145,500	8,176.00	1,189,608,000	
6362	石井鐵工所	1,700	2,719.00	4,622,300	
6363	西島製作所	30,500	2,280.00	69,540,000	
6364	北越工業	35,700	2,618.00	93,462,600	
6367	ダイキン工業	423,400	22,750.00	9,632,350,000	貸付有価証券 16,500株
6368	オルガノ	42,600	5,540.00	236,004,000	
6369	トーヨーカネツ	12,000	3,990.00	47,880,000	
6370	栗田工業	198,400	5,383.00	1,067,987,200	
6371	椿本チエイン	50,300	4,055.00	203,966,500	
6373	大同工業	6,700	734.00	4,917,800	
6378	木村化工機	27,100	742.00	20,108,200	
6381	アネスト岩田	54,800	1,136.00	62,252,800	貸付有価証券 2,400株
6383	ダイフク	598,600	2,754.50	1,648,843,700	貸付有価証券 21,400株
6387	サムコ	9,500	4,075.00	38,712,500	貸付有価証券 1,200株
6390	加藤製作所	7,700	1,340.00	10,318,000	貸付有価証券 2,400株
6393	油研工業	2,500	2,227.00	5,567,500	
6395	タダノ	204,100	1,185.00	241,858,500	貸付有価証券 300株

6406	フジテック	82,900	3,540.00	293,466,000	
6407	CKD	98,100	2,340.00	229,554,000	
6412	平和	104,900	2,129.00	223,332,100	
6413	理想科学工業	28,400	2,810.00	79,804,000	
6417	SANKYO	81,600	8,355.00	681,768,000	
6418	日本金銭機械	42,900	1,381.00	59,244,900	貸付有価証券 4,900株
6419	マースグループホールディングス	17,900	2,590.00	46,361,000	貸付有価証券 2,800株
6420	フクシマガリレイ	23,200	4,930.00	114,376,000	
6428	オーイズミ	5,700	429.00	2,445,300	
6430	ダイコク電機	17,500	3,575.00	62,562,500	貸付有価証券 3,000株
6432	竹内製作所	64,300	4,465.00	287,099,500	
6436	アマノ	100,700	3,336.00	335,935,200	
6440	JUKI	54,900	460.00	25,254,000	
6444	サンデン	22,700	207.00	4,698,900	貸付有価証券 7,600株
6445	ジャノメ	35,900	684.00	24,555,600	
6454	マックス	49,900	3,190.00	159,181,000	
6457	グローリー	85,100	2,800.50	238,322,550	
6458	新晃工業	35,700	2,755.00	98,353,500	
6459	大和冷機工業	54,300	1,523.00	82,698,900	
6460	セガサミーホールディングス	316,800	2,039.50	646,113,600	
6463	TPR	45,000	1,770.00	79,650,000	
6464	ツバキ・ナカシマ	71,000	734.00	52,114,000	貸付有価証券 9,000株
6465	ホシザキ	209,300	5,085.00	1,064,290,500	
6470	大豊工業	30,600	821.00	25,122,600	
6471	日本精工	656,600	780.40	512,410,640	
6472	NTN	769,200	264.80	203,684,160	
6473	ジェイテクト	315,600	1,237.50	390,555,000	
6474	不二越	26,200	3,715.00	97,333,000	貸付有価証券 2,400株
6480	日本トムソン	96,500	576.00	55,584,000	
6481	THK	204,600	2,734.50	559,478,700	
6482	ユーシン精機	28,100	665.00	18,686,500	
6485	前澤給装工業	27,200	1,331.00	36,203,200	貸付有価証券 1,000株
6486	イーグル工業	39,200	1,659.00	65,032,800	

6489	前澤工業	8,700	1,009.00	8,778,300	
6490	日本ビラー工業	32,900	4,285.00	140,976,500	
6498	キッツ	118,700	1,220.00	144,814,000	
6586	マキタ	404,500	3,825.00	1,547,212,500	
7003	三井E&S	176,000	768.00	135,168,000	貸付有価証券 16,000株
7004	日立造船	312,900	956.00	299,132,400	貸付有価証券 11,300株
7011	三菱重工業	620,300	8,641.00	5,360,012,300	貸付有価証券 15,300株
7013	I H I	264,100	2,827.00	746,610,700	
7022	サノヤスホールディングス	19,500	141.00	2,749,500	
7718	スター精密	66,100	1,718.00	113,559,800	
3105	日清紡ホールディングス	266,600	1,159.00	308,989,400	
4062	イビデン	185,000	7,501.00	1,387,685,000	
4902	コニカミノルタ	792,200	419.30	332,169,460	貸付有価証券 127,500株
6448	ブラザー工業	473,900	2,262.00	1,071,961,800	
6479	ミネベアミツミ	617,000	2,859.50	1,764,311,500	
6501	日立製作所	1,704,600	10,245.00	17,463,627,000	
6503	三菱電機	3,947,700	2,029.50	8,011,857,150	
6504	富士電機	215,700	6,086.00	1,312,750,200	
6505	東洋電機製造	5,000	996.00	4,980,000	貸付有価証券 1,700株
6506	安川電機	385,300	5,650.00	2,176,945,000	
6507	シンフォニアテクノロジー	39,100	2,137.00	83,556,700	
6508	明電舎	65,800	2,418.00	159,104,400	
6513	オリジン	3,400	1,241.00	4,219,400	
6516	山洋電気	15,300	6,170.00	94,401,000	
6517	デンヨー	27,000	2,327.00	62,829,000	貸付有価証券 1,100株
6523	PHCホールディングス	66,300	1,479.00	98,057,700	貸付有価証券 6,000株
6525	KOKUSAI ELECTRIC	136,900	2,956.00	404,676,400	貸付有価証券 1,700株
6526	ソシオネクスト	257,300	2,659.50	684,289,350	貸付有価証券 9,500株
6588	東芝テック	45,400	2,830.00	128,482,000	
6590	芝浦メカトロニクス	20,200	6,060.00	122,412,000	貸付有価証券 2,400株
6592	マブチモーター	174,400	2,379.00	414,897,600	

6594	ニデック	783,100	5,696.00	4,460,537,600	
6615	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	22,300	364.00	8,117,200	貸付有価証券 2,500株
6616	トレックス・セミコンダクター	18,200	1,740.00	31,668,000	貸付有価証券 2,500株
6617	東光高岳	21,400	2,157.00	46,159,800	
6619	ダブル・スコープ	101,500	893.00	90,639,500	貸付有価証券 6,000株
6622	ダイヘン	35,600	6,200.00	220,720,000	
6630	ヤーマン	61,300	1,012.00	62,035,600	貸付有価証券 6,400株
6632	JVCケンウッド	280,000	753.00	210,840,000	
6638	ミマキエンジニアリング	33,700	890.00	29,993,000	
6640	IPEX	24,600	1,547.00	38,056,200	貸付有価証券 1,000株
6644	大崎電気工業	77,600	649.00	50,362,400	
6645	オムロン	270,900	6,286.00	1,702,877,400	
6651	日東工業	47,800	3,745.00	179,011,000	
6652	IDEC	52,400	2,885.00	151,174,000	貸付有価証券 1,600株
6653	正興電機製作所	5,200	1,091.00	5,673,200	貸付有価証券 1,100株
6654	不二電機工業	3,000	1,197.00	3,591,000	貸付有価証券 700株
6674	ジーエス・ユアサコーポレーション	138,400	2,000.00	276,800,000	貸付有価証券 4,600株
6675	サクサホールディングス	3,500	2,604.00	9,114,000	
6676	メルコホールディングス	11,100	3,420.00	37,962,000	
6678	テクノメディア	8,600	2,149.00	18,481,400	
6699	ダイヤモンドエレクトリックホールディング	13,200	679.00	8,962,800	貸付有価証券 1,100株
6701	日本電気	465,800	8,348.00	3,888,498,400	
6702	富士通	326,400	21,235.00	6,931,104,000	
6703	沖電気工業	160,400	943.00	151,257,200	
6704	岩崎通信機	6,900	761.00	5,250,900	
6706	電気興業	15,900	2,286.00	36,347,400	
6707	サンケン電気	33,000	6,921.00	228,393,000	
6715	ナカヨ	2,400	1,197.00	2,872,800	貸付有価証券 800株
6718	アイホン	19,100	2,703.00	51,627,300	
6723	ルネサスエレクトロニクス	2,314,800	2,388.50	5,528,899,800	
6724	セイコーエプソン	455,100	2,151.00	978,920,100	貸付有価証券

					17,700株
6727	ワコム	269,700	651.00	175,574,700	
6728	アルバック	84,300	6,443.00	543,144,900	
6730	アクセル	12,400	2,179.00	27,019,600	
6737	E I Z O	26,000	4,950.00	128,700,000	
6740	ジャパンディスプレイ	1,528,800	20.00	30,576,000	貸付有価証券 126,800株
6741	日本信号	80,800	977.00	78,941,600	
6742	京三製作所	74,300	463.00	34,400,900	
6744	能美防災	47,900	2,206.00	105,667,400	
6745	ホーチキ	26,500	1,794.00	47,541,000	
6748	星和電機	6,300	484.00	3,049,200	貸付有価証券 1,400株
6750	エレコム	84,800	1,699.00	144,075,200	
6752	パナソニック ホールディングス	4,190,000	1,424.50	5,968,655,000	
6753	シャープ	597,900	1,026.50	613,744,350	貸付有価証券 50,900株
6754	アンリツ	249,800	1,328.50	331,859,300	
6755	富士通ゼネラル	100,500	2,279.50	229,089,750	
6758	ソニーグループ	2,484,100	13,170.00	32,715,597,000	
6762	T D K	561,600	6,488.00	3,643,660,800	貸付有価証券 21,900株
6763	帝国通信工業	15,500	1,970.00	30,535,000	
6768	タムラ製作所	141,300	543.00	76,725,900	貸付有価証券 14,900株
6770	アルプスアルパイン	316,800	1,246.00	394,732,800	貸付有価証券 12,400株
6771	池上通信機	4,800	890.00	4,272,000	
6779	日本電波工業	42,500	1,225.00	52,062,500	
6785	鈴木	18,900	1,102.00	20,827,800	
6787	メイコー	35,200	3,995.00	140,624,000	
6788	日本トリム	8,000	3,005.00	24,040,000	
6789	ローランド ディー. ジー.	19,400	3,620.00	70,228,000	
6794	フォスター電機	26,300	1,047.00	27,536,100	
6798	SMK	9,500	2,577.00	24,481,500	
6800	ヨコオ	31,300	1,404.00	43,945,200	
6803	ティアック	25,000	97.00	2,425,000	
6804	ホシデン	80,600	1,721.00	138,712,600	
6806	ヒロセ電機	52,400	16,035.00	840,234,000	貸付有価証券 2,300株

6807	日本航空電子工業	84,900	3,125.00	265,312,500	
6809	TOA	40,300	1,075.00	43,322,500	貸付有価証券 4,800株
6810	マクセル	78,300	1,586.00	124,183,800	
6814	古野電気	46,100	1,900.00	87,590,000	
6817	スミダコーポレーション	47,500	1,167.00	55,432,500	貸付有価証券 3,700株
6820	アイコム	13,700	3,540.00	48,498,000	
6823	リオン	14,600	2,326.00	33,959,600	
6841	横河電機	388,000	2,735.00	1,061,180,000	
6844	新電元工業	13,600	3,075.00	41,820,000	
6845	アズビル	241,600	4,730.00	1,142,768,000	
6848	東亜ディーケーケー	7,000	915.00	6,405,000	
6849	日本光電工業	150,600	4,486.00	675,591,600	
6850	チノー	14,600	2,141.00	31,258,600	
6853	共和電業	14,000	396.00	5,544,000	
6855	日本電子材料	21,600	1,736.00	37,497,600	
6856	堀場製作所	67,000	10,435.00	699,145,000	
6857	アドバンテスト	1,006,100	4,663.00	4,691,444,300	貸付有価証券 43,200株
6858	小野測器	5,900	443.00	2,613,700	
6859	エスペック	28,100	2,363.00	66,400,300	
6861	キーエンス	351,300	60,130.00	21,123,669,000	
6866	日置電機	16,600	6,250.00	103,750,000	貸付有価証券 100株
6869	シスメックス	303,000	7,793.00	2,361,279,000	
6871	日本マイクロニクス	63,100	3,475.00	219,272,500	
6875	メガチップス	27,800	4,570.00	127,046,000	貸付有価証券 4,100株
6877	OBARA GROUP	19,200	3,790.00	72,768,000	
6901	澤藤電機	1,800	1,248.00	2,246,400	貸付有価証券 500株
6904	原田工業	6,700	756.00	5,065,200	貸付有価証券 2,100株
6905	コーセル	42,200	1,303.00	54,986,600	
6908	イリソ電子工業	32,300	3,595.00	116,118,500	
6914	オプテックスグループ	64,400	1,701.00	109,544,400	
6915	千代田インテグレ	13,700	2,795.00	38,291,500	
6920	レーザーテック	161,000	34,010.00	5,475,610,000	貸付有価証券 6,300株

6923	スタンレー電気	224,800	2,688.00	604,262,400	
6925	ウシオ電機	178,400	2,042.00	364,292,800	
6926	岡谷電機産業	11,500	285.00	3,277,500	
6927	ヘリオス テクノ ホールディング	14,700	517.00	7,599,900	貸付有価証券 6,500株
6928	エノモト	4,200	1,583.00	6,648,600	
6929	日本セラミック	28,600	2,711.00	77,534,600	
6932	遠藤照明	6,800	1,324.00	9,003,200	
6937	古河電池	25,800	871.00	22,471,800	貸付有価証券 1,000株
6938	双信電機	6,000	303.00	1,818,000	貸付有価証券 2,200株
6941	山一電機	31,500	1,834.00	57,771,000	
6947	函研	30,600	3,990.00	122,094,000	
6951	日本電子	88,000	5,961.00	524,568,000	
6952	カシオ計算機	253,700	1,226.00	311,036,200	
6954	ファナック	1,712,500	4,090.00	7,004,125,000	貸付有価証券 40,700株
6958	日本シイエムケイ	74,600	777.00	57,964,200	
6961	エンプラス	10,200	11,350.00	115,770,000	貸付有価証券 1,500株
6962	大真空	52,300	856.00	44,768,800	
6963	ローム	649,300	2,606.50	1,692,400,450	
6965	浜松ホトニクス	281,800	5,694.00	1,604,569,200	
6966	三井ハイテック	31,100	7,039.00	218,912,900	貸付有価証券 4,900株
6967	新光電気工業	124,300	5,495.00	683,028,500	
6971	京セラ	2,182,000	2,055.00	4,484,010,000	
6976	太陽誘電	171,000	3,683.00	629,793,000	貸付有価証券 6,700株
6981	村田製作所	3,195,100	2,907.50	9,289,753,250	
6986	双葉電子工業	66,900	530.00	35,457,000	
6989	北陸電気工業	5,600	1,380.00	7,728,000	
6996	ニチコン	92,200	1,309.00	120,689,800	貸付有価証券 2,800株
6997	日本ケミコン	37,400	1,307.00	48,881,800	
6999	KOA	53,200	1,522.00	80,970,400	貸付有価証券 2,100株
7244	市光工業	63,300	544.00	34,435,200	
7276	小糸製作所	363,800	2,225.50	809,636,900	
7280	ミツバ	65,800	952.00	62,641,600	

7735	SCREENホールディングス	120,100	11,860.00	1,424,386,000	貸付有価証券 4,800株
7739	キヤノン電子	38,800	2,049.00	79,501,200	
7751	キヤノン	1,751,600	3,695.00	6,472,162,000	貸付有価証券 238,300株
7752	リコー	880,500	1,120.00	986,160,000	
7965	象印マホービン	95,300	1,494.00	142,378,200	
7999	MUTOHホールディングス	1,900	2,008.00	3,815,200	
8035	東京エレクトロン	743,200	24,120.00	17,925,984,000	貸付有価証券 28,900株
9880	イノテック	23,400	1,792.00	41,932,800	
3116	トヨタ紡織	147,900	2,362.50	349,413,750	
3526	芦森工業	3,000	2,092.00	6,276,000	貸付有価証券 900株
5949	ユニプレス	63,000	981.00	61,803,000	貸付有価証券 8,600株
6201	豊田自動織機	299,500	11,660.00	3,492,170,000	
6455	モリタホールディングス	61,600	1,559.00	96,034,400	
6584	三櫻工業	53,600	826.00	44,273,600	貸付有価証券 5,600株
6902	デンソー	2,897,400	2,165.00	6,272,871,000	
6995	東海理化電機製作所	99,000	2,246.00	222,354,000	
7012	川崎重工業	286,700	3,255.00	933,208,500	
7014	名村造船所	76,500	1,375.00	105,187,500	貸付有価証券 21,000株
7102	日本車輛製造	11,600	2,119.00	24,580,400	
7105	三菱ロジスネクスト	56,100	1,360.00	76,296,000	
7122	近畿車輛	2,000	1,809.00	3,618,000	
7201	日産自動車	4,988,600	567.30	2,830,032,780	
7202	いすゞ自動車	1,021,000	1,917.00	1,957,257,000	
7203	トヨタ自動車	19,283,100	2,701.50	52,093,294,650	貸付有価証券 749,200株
7205	日野自動車	528,200	487.20	257,339,040	
7211	三菱自動車工業	1,370,000	454.80	623,076,000	貸付有価証券 139,300株
7212	エフテック	10,500	646.00	6,783,000	貸付有価証券 3,100株
7213	レシップホールディングス	6,500	629.00	4,088,500	
7214	GMB	2,900	1,208.00	3,503,200	貸付有価証券 1,000株
7215	ファルテック	2,700	546.00	1,474,200	貸付有価証券 700株

7220	武蔵精密工業	85,800	1,540.00	132,132,000	
7222	日産車体	41,300	980.00	40,474,000	貸付有価証券 11,800株
7224	新明和工業	101,100	1,196.00	120,915,600	
7226	極東開発工業	58,000	1,937.00	112,346,000	
7231	トピー工業	28,500	2,658.00	75,753,000	貸付有価証券 3,600株
7236	ティラド	7,800	3,150.00	24,570,000	
7238	曙ブレーキ工業	214,300	116.00	24,858,800	貸付有価証券 24,300株
7239	タチエス	64,800	1,842.00	119,361,600	貸付有価証券 7,300株
7240	NOK	136,400	1,966.00	268,162,400	
7241	フタバ産業	94,100	843.00	79,326,300	貸付有価証券 3,100株
7242	カヤバ	33,800	5,040.00	170,352,000	
7245	大同メタル工業	68,600	550.00	37,730,000	
7246	プレス工業	140,300	584.00	81,935,200	
7247	ミクニ	19,000	460.00	8,740,000	
7250	太平洋工業	80,500	1,348.00	108,514,000	貸付有価証券 9,200株
7256	河西工業	21,100	194.00	4,093,400	
7259	アイシン	270,900	5,154.00	1,396,218,600	
7261	マツダ	1,161,600	1,611.00	1,871,337,600	
7266	今仙電機製作所	9,500	652.00	6,194,000	貸付有価証券 4,100株
7267	本田技研工業	8,563,900	1,530.00	13,102,767,000	
7269	スズキ	645,000	6,055.00	3,905,475,000	貸付有価証券 25,100株
7270	SUBARU	1,089,100	2,765.50	3,011,906,050	
7271	安永	6,600	650.00	4,290,000	貸付有価証券 2,100株
7272	ヤマハ発動機	1,517,700	1,309.50	1,987,428,150	貸付有価証券 173,100株
7277	TBK	16,300	384.00	6,259,200	貸付有価証券 5,200株
7278	エクセディ	57,400	2,677.00	153,659,800	
7282	豊田合成	102,500	2,729.00	279,722,500	
7283	愛三工業	58,100	1,242.00	72,160,200	
7284	盟和産業	2,100	999.00	2,097,900	
7291	日本プラスト	12,300	542.00	6,666,600	
7294	ヨロズ	32,900	853.00	28,063,700	

7296	エフ・シー・シー	62,200	1,806.00	112,333,200	
7309	シマノ	142,600	21,840.00	3,114,384,000	
7313	テイ・エス テック	125,000	1,750.50	218,812,500	
7408	ジャムコ	14,800	1,574.00	23,295,200	貸付有価証券 2,200株
4543	テルモ	981,900	4,672.00	4,587,436,800	貸付有価証券 42,000株
5187	クリエートメディック	4,900	896.00	4,390,400	貸付有価証券 300株
6376	日機装	81,800	1,038.00	84,908,400	
7600	日本エム・ディ・エム	27,800	759.00	21,100,200	
7701	島津製作所	466,600	3,957.00	1,846,336,200	
7702	JMS	32,500	510.00	16,575,000	
7709	クボテック	3,600	259.00	932,400	貸付有価証券 1,600株
7715	長野計器	25,500	2,031.00	51,790,500	貸付有価証券 1,900株
7717	ブイ・テクノロジー	18,500	2,738.00	50,653,000	貸付有価証券 2,700株
7721	東京計器	26,900	1,774.00	47,720,600	
7723	愛知時計電機	15,200	2,328.00	35,385,600	
7725	インターアクション	16,600	1,061.00	17,612,600	貸付有価証券 2,400株
7727	オーバル	13,200	498.00	6,573,600	
7729	東京精密	71,800	8,159.00	585,816,200	
7730	マニー	140,500	2,133.50	299,756,750	
7731	ニコン	507,700	1,430.50	726,264,850	
7732	トプコン	170,700	1,555.50	265,523,850	
7733	オリンパス	2,161,700	2,030.50	4,389,331,850	
7734	理研計器	24,900	6,620.00	164,838,000	
7740	タムロン	21,500	5,590.00	120,185,000	
7741	HOYA	691,300	16,865.00	11,658,774,500	
7743	シード	7,500	843.00	6,322,500	
7744	ノーリツ鋼機	33,300	3,080.00	102,564,000	
7745	A&Dホロンホールディングス	51,200	1,813.00	92,825,600	
7747	朝日インテック	392,400	2,853.00	1,119,517,200	
7762	シチズン時計	323,100	881.00	284,651,100	
7769	リズム	3,400	3,005.00	10,217,000	貸付有価証券 1,400株
7775	大研医器	13,000	508.00	6,604,000	貸付有価証券 3,100株

7780	メニコン	120,800	2,276.00	274,940,800	
7782	シンシア	1,400	532.00	744,800	
7979	松風	15,900	2,733.00	43,454,700	貸付有価証券 700株
8050	セイコーグループ	48,900	2,699.00	131,981,100	
8086	ニプロ	292,700	1,111.50	325,336,050	
7795	KYORITSU	22,500	185.00	4,162,500	
7811	中本パックス	4,800	1,682.00	8,073,600	
7816	スノーピーク	50,100	909.00	45,540,900	貸付有価証券 6,100株
7817	パラマウントベッドホールディングス	73,000	2,706.00	197,538,000	
7818	トランザクション	23,100	2,127.00	49,133,700	
7819	粧美堂	4,100	685.00	2,808,500	
7820	ニホンフラッシュ	32,900	919.00	30,235,100	
7821	前田工織	29,700	3,245.00	96,376,500	貸付有価証券 1,200株
7822	永大産業	17,900	228.00	4,081,200	
7823	アートネイチャー	31,600	807.00	25,501,200	
7826	フルヤ金属	6,300	9,290.00	58,527,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	962,100	2,839.00	2,731,401,900	
7833	アイフィスジャパン	4,200	615.00	2,583,000	
7839	SHOEI	79,400	1,891.00	150,145,400	貸付有価証券 5,600株
7840	フランスベッドホールディングス	45,400	1,385.00	62,879,000	
7846	パイロットコーポレーション	49,400	4,186.00	206,788,400	
7856	萩原工業	23,500	1,502.00	35,297,000	貸付有価証券 2,500株
7864	フジシールインターナショナル	71,100	1,734.00	123,287,400	
7867	タカラトミー	159,800	2,260.50	361,227,900	
7868	広済堂ホールディングス	79,100	772.00	61,065,200	貸付有価証券 3,500株
7872	エステールホールディングス	3,600	637.00	2,293,200	
7885	タカノ	5,600	983.00	5,504,800	
7893	プロネクサス	36,400	1,297.00	47,210,800	
7897	ホクシン	11,600	117.00	1,357,200	貸付有価証券 4,600株
7898	ウッドワン	5,100	1,024.00	5,222,400	貸付有価証券 1,700株
7911	TOPPANホールディングス	431,700	3,921.00	1,692,695,700	
7912	大日本印刷	383,800	4,176.00	1,602,748,800	

7914	共同印刷	9,900	3,305.00	32,719,500	
7915	N I S S H A	60,100	1,503.00	90,330,300	
7916	光村印刷	1,100	1,484.00	1,632,400	貸付有価証券 400株
7921	TAKARA & COMPANY	22,500	2,672.00	60,120,000	
7936	アシックス	299,200	4,210.00	1,259,632,000	
7937	ツツミ	8,200	2,315.00	18,983,000	貸付有価証券 1,400株
7944	ローランド	25,900	4,425.00	114,607,500	貸付有価証券 3,300株
7949	小松ウオール工業	14,300	3,005.00	42,971,500	
7951	ヤマハ	221,400	3,255.00	720,657,000	
7952	河合楽器製作所	10,700	3,625.00	38,787,500	
7955	クリナップ	34,400	702.00	24,148,800	
7956	ビジョン	223,700	1,619.00	362,170,300	
7962	キングジム	31,000	874.00	27,094,000	
7966	リンテック	70,500	2,700.00	190,350,000	
7972	イトーキ	72,000	1,428.00	102,816,000	貸付有価証券 300株
7974	任天堂	2,217,200	7,223.00	16,014,835,600	
7976	三菱鉛筆	49,900	2,033.00	101,446,700	
7981	タカラスタンダード	73,900	1,692.00	125,038,800	
7984	コクヨ	143,700	2,342.00	336,545,400	
7987	ナカバヤシ	37,800	556.00	21,016,800	
7990	グローブライド	31,500	1,992.00	62,748,000	
7994	オカムラ	105,700	2,211.00	233,702,700	
8022	美津濃	34,900	4,000.00	139,600,000	
9501	東京電力ホールディングス	3,165,600	758.00	2,399,524,800	貸付有価証券 353,400株
9502	中部電力	1,294,100	1,903.00	2,462,672,300	
9503	関西電力	1,356,100	1,956.50	2,653,209,650	
9504	中国電力	610,100	1,048.00	639,384,800	貸付有価証券 47,500株
9505	北陸電力	359,100	757.10	271,874,610	
9506	東北電力	924,600	1,008.00	931,996,800	
9507	四国電力	327,000	1,059.50	346,456,500	
9508	九州電力	809,500	1,068.00	864,546,000	
9509	北海道電力	339,300	657.60	223,123,680	
9511	沖縄電力	89,700	1,178.00	105,666,600	

9513	電源開発	288,500	2,393.00	690,380,500	
9514	エフオン	22,700	457.00	10,373,900	
9517	イーレックス	62,500	819.00	51,187,500	貸付有価証券 8,800株
9519	レノバ	93,600	1,200.00	112,320,000	貸付有価証券 7,300株
9531	東京瓦斯	742,400	3,339.00	2,478,873,600	
9532	大阪瓦斯	711,400	3,089.00	2,197,514,600	
9533	東邦瓦斯	152,100	3,071.00	467,099,100	貸付有価証券 300株
9534	北海道瓦斯	21,000	2,278.00	47,838,000	
9535	広島ガス	74,200	391.00	29,012,200	
9536	西部ガスホールディングス	36,600	1,984.00	72,614,400	
9543	静岡ガス	70,000	1,088.00	76,160,000	
9551	メタウォーター	42,100	2,071.00	87,189,100	貸付有価証券 600株
2384	SBSホールディングス	31,300	2,503.00	78,343,900	
9001	東武鉄道	385,800	3,873.00	1,494,203,400	
9003	相鉄ホールディングス	125,700	2,751.00	345,800,700	
9005	東急	984,700	1,768.50	1,741,441,950	
9006	京浜急行電鉄	434,600	1,311.00	569,760,600	
9007	小田急電鉄	580,700	2,217.50	1,287,702,250	
9008	京王電鉄	168,800	4,492.00	758,249,600	貸付有価証券 7,300株
9009	京成電鉄	226,400	6,741.00	1,526,162,400	
9010	富士急行	43,200	4,290.00	185,328,000	
9020	東日本旅客鉄道	645,200	8,316.00	5,365,483,200	貸付有価証券 23,200株
9021	西日本旅客鉄道	416,600	6,048.00	2,519,596,800	
9022	東海旅客鉄道	1,352,700	3,679.00	4,976,583,300	貸付有価証券 53,000株
9024	西武ホールディングス	424,800	1,992.00	846,201,600	貸付有価証券 14,900株
9025	鴻池運輸	59,800	1,930.00	115,414,000	貸付有価証券 300株
9031	西日本鉄道	93,800	2,424.00	227,371,200	貸付有価証券 800株
9037	ハマキョウレックス	30,000	4,160.00	124,800,000	貸付有価証券 600株
9039	サカイ引越センター	38,900	2,726.00	106,041,400	貸付有価証券 500株
9041	近鉄グループホールディングス	350,500	4,568.00	1,601,084,000	

9042	阪急阪神ホールディングス	467,500	4,543.00	2,123,852,500	
9044	南海電気鉄道	156,400	2,905.00	454,342,000	
9045	京阪ホールディングス	193,200	3,695.00	713,874,000	
9046	神戸電鉄	9,500	2,942.00	27,949,000	
9048	名古屋鉄道	361,600	2,319.00	838,550,400	
9052	山陽電気鉄道	26,400	2,172.00	57,340,800	
9055	アルプス物流	28,000	1,764.00	49,392,000	
9064	ヤマトホールディングス	448,900	2,632.50	1,181,729,250	貸付有価証券 600株
9065	山九	89,200	5,233.00	466,783,600	
9067	丸運	7,700	274.00	2,109,800	貸付有価証券 2,400株
9068	丸全昭和運輸	21,700	4,050.00	87,885,000	
9069	センコーグループホールディングス	185,600	1,176.00	218,265,600	貸付有価証券 7,300株
9070	トナミホールディングス	7,700	4,655.00	35,843,500	
9072	ニッコンホールディングス	112,200	3,114.00	349,390,800	貸付有価証券 700株
9074	日本石油輸送	1,500	2,914.00	4,371,000	
9075	福山通運	40,000	4,155.00	166,200,000	
9076	セイノーホールディングス	197,200	2,162.50	426,445,000	貸付有価証券 7,700株
9078	エスライングループ本社	4,300	905.00	3,891,500	
9081	神奈川中央交通	9,900	3,025.00	29,947,500	
9090	AZ-COM丸和ホールディングス	89,600	1,593.00	142,732,800	
9099	C&Fロジホールディングス	33,700	1,493.00	50,314,100	
9142	九州旅客鉄道	247,900	3,171.00	786,090,900	
9143	SGホールディングス	588,700	2,067.00	1,216,842,900	
9147	NIPPON EXPRESSホールディング	119,000	8,252.00	981,988,000	
9101	日本郵船	1,005,000	4,758.00	4,781,790,000	
9104	商船三井	760,900	4,908.00	3,734,497,200	
9107	川崎汽船	296,300	6,607.00	1,957,654,100	貸付有価証券 10,300株
9110	NSユニテッド海運	18,900	5,030.00	95,067,000	貸付有価証券 2,300株
9115	明海グループ	16,300	823.00	13,414,900	
9119	飯野海運	128,700	1,230.00	158,301,000	貸付有価証券 6,700株
9130	共栄タンカー	2,800	870.00	2,436,000	貸付有価証券 1,600株

9308	乾汽船	41,100	1,129.00	46,401,900	貸付有価証券 4,300株
9201	日本航空	861,100	2,786.50	2,399,455,150	
9202	A N Aホールディングス	954,000	3,137.00	2,992,698,000	
9232	パスコ	2,800	1,828.00	5,118,400	
9058	トランコム	10,200	7,260.00	74,052,000	
9066	日新	26,600	2,547.00	67,750,200	
9301	三菱倉庫	86,100	4,367.00	375,998,700	貸付有価証券 900株
9302	三井倉庫ホールディングス	32,800	4,880.00	160,064,000	
9303	住友倉庫	94,600	2,534.00	239,716,400	
9304	澁澤倉庫	16,000	3,020.00	48,320,000	
9306	東陽倉庫	4,000	1,574.00	6,296,000	
9310	日本トランスシティ	70,500	635.00	44,767,500	
9312	ケイヒン	2,700	1,777.00	4,797,900	
9319	中央倉庫	18,800	1,174.00	22,071,200	
9322	川西倉庫	2,700	1,224.00	3,304,800	貸付有価証券 200株
9324	安田倉庫	23,900	1,248.00	29,827,200	
9325	ファイブホールディングス	2,100	1,221.00	2,564,100	貸付有価証券 900株
9351	東洋埠頭	4,400	1,404.00	6,177,600	貸付有価証券 1,300株
9364	上組	161,900	3,474.00	562,440,600	
9366	サンリツ	3,600	779.00	2,804,400	
9368	キムラユニティー	7,100	1,400.00	9,940,000	
9369	キューソー流通システム	9,100	937.00	8,526,700	
9380	東海運	8,800	292.00	2,569,600	
9381	エーアイテイー	22,000	1,816.00	39,952,000	
9384	内外トランスライン	14,000	2,390.00	33,460,000	貸付有価証券 900株
9386	日本コンセプト	12,700	1,763.00	22,390,100	
1973	N E C ネットエスアイ	137,300	2,288.00	314,142,400	
2307	クロスキャット	22,300	1,095.00	24,418,500	貸付有価証券 2,200株
2317	システナ	532,900	309.00	164,666,100	
2326	デジタルアーツ	22,300	4,990.00	111,277,000	
2327	日鉄ソリューションズ	60,100	4,650.00	279,465,000	
2335	キューブシステム	18,600	1,112.00	20,683,200	
2359	コア	15,600	1,790.00	27,924,000	

2477	手間いらず	6,000	2,971.00	17,826,000	貸付有価証券 700株
3031	ラクーンホールディングス	29,200	651.00	19,009,200	貸付有価証券 2,100株
3040	ソリトンシステムズ	18,100	1,344.00	24,326,400	
3371	ソフトクリエイティブホールディングス	28,900	1,728.00	49,939,200	
3626	T I S	385,200	3,092.00	1,191,038,400	
3627	テクミラホールディングス	6,900	473.00	3,263,700	貸付有価証券 700株
3632	グリー	94,400	590.00	55,696,000	貸付有価証券 2,300株
3633	GMOペパボ	4,300	1,183.00	5,086,900	貸付有価証券 500株
3635	コーエーテクモホールディングス	220,700	1,623.50	358,306,450	
3636	三菱総合研究所	17,300	4,645.00	80,358,500	
3639	ボルテージ	4,400	245.00	1,078,000	貸付有価証券 500株
3640	電算	1,800	1,516.00	2,728,800	貸付有価証券 500株
3648	A G S	6,200	840.00	5,208,000	
3649	ファインデックス	28,000	1,000.00	28,000,000	
3655	ブレインパッド	26,400	1,078.00	28,459,200	
3656	K L a b	64,800	288.00	18,662,400	貸付有価証券 10,900株
3657	ポールトゥウィンホールディングス	60,100	471.00	28,307,100	
3659	ネクソン	788,000	2,694.50	2,123,266,000	
3660	アイスタイル	104,500	412.00	43,054,000	貸付有価証券 11,100株
3661	エムアップホールディングス	43,100	1,044.00	44,996,400	貸付有価証券 100株
3662	エイチーム	20,800	565.00	11,752,000	貸付有価証券 3,000株
3665	エニグモ	44,800	348.00	15,590,400	貸付有価証券 3,900株
3666	テクノスジャパン	13,100	625.00	8,187,500	貸付有価証券 3,400株
3667	e n i s h	11,900	167.00	1,987,300	貸付有価証券 1,900株
3668	コロブラ	136,600	607.00	82,916,200	貸付有価証券 5,400株
3672	オルトプラス	12,100	142.00	1,718,200	貸付有価証券 2,400株
3673	ブロードリーフ	167,100	574.00	95,915,400	
3675	クロス・マーケティンググループ	6,400	555.00	3,552,000	
3676	デジタルハーツホールディングス	22,000	986.00	21,692,000	貸付有価証券

					100株
3677	システム情報	9,300	927.00	8,621,100	
3678	メディアドゥ	15,900	1,395.00	22,180,500	貸付有価証券 2,000株
3679	じげん	102,700	529.00	54,328,300	
3681	ブイキューブ	42,200	310.00	13,082,000	貸付有価証券 2,700株
3682	エンカレッジ・テクノロジー	3,600	574.00	2,066,400	貸付有価証券 700株
3683	サイバーリンクス	5,100	761.00	3,881,100	
3686	ディー・エル・イー	10,700	199.00	2,129,300	貸付有価証券 3,100株
3687	フィックスターズ	39,800	1,252.00	49,829,600	
3688	CARTA HOLDINGS	16,500	1,363.00	22,489,500	
3694	オプティム	36,200	834.00	30,190,800	貸付有価証券 1,100株
3696	セレス	14,200	1,146.00	16,273,200	貸付有価証券 1,400株
3697	SHIFT	23,400	33,760.00	789,984,000	貸付有価証券 900株
3738	ティーガイア	36,800	1,945.00	71,576,000	
3741	セック	2,400	5,100.00	12,240,000	
3762	テクマトリックス	64,300	1,689.00	108,602,700	
3763	プロシップ	16,900	1,390.00	23,491,000	貸付有価証券 1,200株
3765	ガンホー・オンライン・エンターテイメント	91,700	2,328.50	213,523,450	
3769	GMOペイメントゲートウェイ	70,400	9,224.00	649,369,600	貸付有価証券 8,400株
3770	ザッパラス	4,200	472.00	1,982,400	貸付有価証券 2,200株
3771	システムリサーチ	12,100	3,095.00	37,449,500	
3774	インターネットイニシアティブ	168,400	2,843.00	478,761,200	
3778	さくらインターネット	39,500	2,121.00	83,779,500	貸付有価証券 4,700株
3784	ヴィンクス	4,500	2,018.00	9,081,000	
3788	GMOグローバルサイン・ホールディングス	10,700	2,657.00	28,429,900	
3817	SRAホールディングス	18,000	3,710.00	66,780,000	
3826	システムインテグレータ	4,400	410.00	1,804,000	貸付有価証券 1,300株
3834	朝日ネット	37,800	623.00	23,549,400	
3835	eBASE	49,600	754.00	37,398,400	貸付有価証券 5,200株

3836	アバントグループ	44,500	1,423.00	63,323,500	
3837	アドソル日進	14,800	1,577.00	23,339,600	
3839	ODKソリューションズ	2,800	611.00	1,710,800	
3843	フリービット	18,400	1,411.00	25,962,400	
3844	コムチュア	50,800	1,845.00	93,726,000	
3852	サイバーコム	3,100	1,905.00	5,905,500	
3853	アステリア	27,600	642.00	17,719,200	貸付有価証券 2,600株
3854	アイル	16,400	3,070.00	50,348,000	
3901	マークライNZ	19,100	2,956.00	56,459,600	
3902	メディカル・データ・ビジョン	42,100	667.00	28,080,700	
3903	g u m i	52,000	431.00	22,412,000	貸付有価証券 5,500株
3909	ショーケース	3,500	305.00	1,067,500	
3912	モバイルファクトリー	3,200	645.00	2,064,000	貸付有価証券 1,000株
3915	テラスカイ	15,200	1,801.00	27,375,200	
3916	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	20,400	1,639.00	33,435,600	
3918	P C Iホールディングス	5,800	1,008.00	5,846,400	
3920	アイビーシー	2,300	460.00	1,058,000	
3921	ネオジャパン	11,800	1,011.00	11,929,800	貸付有価証券 800株
3922	P R T I M E S	7,100	1,818.00	12,907,800	
3923	ラクス	166,600	2,435.00	405,671,000	
3924	ランドコンピュータ	7,300	892.00	6,511,600	
3925	ダブルスタンダード	10,700	1,577.00	16,873,900	
3926	オープンドア	20,500	781.00	16,010,500	貸付有価証券 3,100株
3928	マイネット	4,900	289.00	1,416,100	
3932	アカツキ	16,800	2,479.00	41,647,200	貸付有価証券 1,500株
3934	ベネフィットジャパン	900	1,259.00	1,133,100	貸付有価証券 300株
3937	U b i c o mホールディングス	10,900	1,662.00	18,115,800	貸付有価証券 1,000株
3939	カナミックネットワーク	37,900	417.00	15,804,300	
3940	ノムラシステムコーポレーション	14,700	115.00	1,690,500	
3962	チェンジホールディングス	76,700	1,419.00	108,837,300	貸付有価証券 5,400株
3963	シンクロ・フード	8,500	642.00	5,457,000	

3964	オークネット	13,000	1,885.00	24,505,000	
3965	キャピタル・アセット・プランニング	2,800	736.00	2,060,800	貸付有価証券 300株
3968	セグエグループ	4,300	925.00	3,977,500	
3969	エイトレッド	2,200	1,421.00	3,126,200	貸付有価証券 500株
3978	マクロミル	69,100	796.00	55,003,600	
3981	ビーグリー	2,700	1,203.00	3,248,100	貸付有価証券 800株
3983	オロ	12,700	2,637.00	33,489,900	
3984	ユーザーローカル	12,700	1,807.00	22,948,900	貸付有価証券 1,400株
3985	テモナ	3,000	216.00	648,000	貸付有価証券 600株
3992	ニーズウェル	8,300	764.00	6,341,200	貸付有価証券 1,000株
3994	マネーフォワード	78,300	4,000.00	313,200,000	貸付有価証券 5,900株
3996	サインポスト	5,400	378.00	2,041,200	貸付有価証券 700株
4053	Sun Asterisk	25,000	961.00	24,025,000	貸付有価証券 1,200株
4071	プラスアルファ・コンサルティング	20,800	2,633.00	54,766,400	
4072	電算システムホールディングス	15,600	2,814.00	43,898,400	
4180	Appier Group	120,400	1,798.00	216,479,200	貸付有価証券 1,500株
4194	ビジョナル	21,000	8,540.00	179,340,000	
4284	ソルクシーズ	12,300	401.00	4,932,300	貸付有価証券 3,800株
4295	フェイス	4,300	478.00	2,055,400	貸付有価証券 1,500株
4298	プロトコーポレーション	38,500	1,296.00	49,896,000	
4299	ハイマックス	11,000	1,448.00	15,928,000	
4307	野村総合研究所	780,300	4,172.00	3,255,411,600	
4312	サイバネットシステム	25,300	1,093.00	27,652,900	
4320	CEホールディングス	7,700	633.00	4,874,100	
4323	日本システム技術	11,400	2,903.00	33,094,200	貸付有価証券 1,000株
4326	インタージホールディングス	39,800	1,644.00	65,431,200	貸付有価証券 200株
4333	東邦システムサイエンス	6,600	1,264.00	8,342,400	
4344	ソースネクスト	161,200	159.00	25,630,800	貸付有価証券 20,400株
4348	インフォコム	45,400	2,428.00	110,231,200	

4373	シンプレクス・ホールディングス	53,000	2,656.00	140,768,000	
4382	HEROZ	11,800	1,610.00	18,998,000	貸付有価証券 600株
4384	ラクスル	84,800	1,171.00	99,300,800	貸付有価証券 9,600株
4385	メルカリ	213,600	2,456.00	524,601,600	貸付有価証券 8,300株
4390	I P S	10,100	2,077.00	20,977,700	貸付有価証券 1,100株
4392	F I G	17,500	311.00	5,442,500	貸付有価証券 5,600株
4396	システムサポート	13,600	1,899.00	25,826,400	
4420	イーソル	25,400	581.00	14,757,400	貸付有価証券 2,400株
4430	東海ソフト	2,200	1,183.00	2,602,600	
4432	ウイングアーク1st	36,600	2,900.00	106,140,000	
4433	ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	9,400	1,270.00	11,938,000	
4434	サーバーワークス	7,200	3,145.00	22,644,000	貸付有価証券 500株
4439	東名	1,200	1,807.00	2,168,400	貸付有価証券 500株
4440	ヴィッツ	1,400	880.00	1,232,000	貸付有価証券 400株
4441	トビラシステムズ	3,900	896.00	3,494,400	貸付有価証券 900株
4443	S a n s a n	115,500	1,470.00	169,785,000	
4446	L i n k - U	3,000	730.00	2,190,000	貸付有価証券 300株
4449	ギフトィ	30,700	1,652.00	50,716,400	貸付有価証券 4,000株
4480	メドレー	47,300	4,130.00	195,349,000	貸付有価証券 2,300株
4481	ベース	12,200	3,485.00	42,517,000	貸付有価証券 1,600株
4483	J M D C	60,000	4,042.00	242,520,000	貸付有価証券 9,300株
4662	フォーカスシステムズ	23,500	1,009.00	23,711,500	
4674	クレスコ	28,900	1,947.00	56,268,300	貸付有価証券 100株
4676	フジ・メディア・ホールディングス	338,300	1,610.50	544,832,150	
4684	オービック	117,700	23,815.00	2,803,025,500	
4686	ジャストシステム	50,600	3,120.00	157,872,000	貸付有価証券 200株
4687	T D C ソフト	33,000	2,117.00	69,861,000	
4689	L I N E ヤフー	5,013,900	483.30	2,423,217,870	

4704	トレンドマイクロ	166,500	7,469.00	1,243,588,500	
4709	IDホールディングス	23,700	1,730.00	41,001,000	
4716	日本オラクル	67,400	10,935.00	737,019,000	
4719	アルファシステムズ	9,200	2,995.00	27,554,000	
4722	フューチャー	75,100	1,767.00	132,701,700	
4725	CAC Holdings	18,900	1,753.00	33,131,700	
4726	SBテクノロジー	14,900	2,400.00	35,760,000	
4728	トーセ	4,200	713.00	2,994,600	貸付有価証券 700株
4733	オービックビジネスコンサルタント	49,500	6,342.00	313,929,000	
4743	アイティフォー	45,100	1,177.00	53,082,700	
4746	東計電算	9,800	3,430.00	33,614,000	
4762	エックスネット	2,000	1,109.00	2,218,000	貸付有価証券 100株
4768	大塚商会	174,700	5,677.00	991,771,900	
4776	サイボウズ	48,500	2,143.00	103,935,500	貸付有価証券 3,500株
4812	電通総研	42,800	5,720.00	244,816,000	
4813	ACCESS	36,600	809.00	29,609,400	貸付有価証券 4,100株
4819	デジタルガレージ	56,300	3,555.00	200,146,500	
4820	EMシステムズ	58,700	715.00	41,970,500	貸付有価証券 800株
4825	ウェザーニューズ	10,900	5,470.00	59,623,000	
4826	C I J	58,500	663.00	38,785,500	貸付有価証券 2,300株
4828	ビジネスエンジニアリング	5,800	4,020.00	23,316,000	
4829	日本エンタープライズ	15,600	124.00	1,934,400	貸付有価証券 4,400株
4839	WOWOW	26,500	1,084.00	28,726,000	
4845	スカラ	32,600	747.00	24,352,200	
4847	インテリジェント ウェイブ	8,000	1,050.00	8,400,000	
5032	ANYCOLOR	12,400	3,130.00	38,812,000	貸付有価証券 100株
6879	IMAGICA GROUP	35,300	623.00	21,991,900	
7518	ネットワンシステムズ	142,200	2,344.00	333,316,800	
7527	システムソフト	122,500	62.00	7,595,000	貸付有価証券 10,300株
7595	アルゴグラフィックス	32,300	3,770.00	121,771,000	
7844	マーベラス	57,200	719.00	41,126,800	
7860	エイバックス	60,000	1,382.00	82,920,000	

8056	B I P R O G Y	115,200	4,340.00	499,968,000	
8157	都築電気	18,500	2,280.00	42,180,000	貸付有価証券 1,300株
9401	T B Sホールディングス	177,100	2,964.00	524,924,400	
9404	日本テレビホールディングス	311,800	1,555.50	485,004,900	
9405	朝日放送グループホールディングス	33,000	669.00	22,077,000	
9409	テレビ朝日ホールディングス	85,500	1,633.00	139,621,500	貸付有価証券 3,400株
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	273,600	708.00	193,708,800	貸付有価証券 3,500株
9413	テレビ東京ホールディングス	25,400	3,090.00	78,486,000	
9414	日本BS放送	5,400	917.00	4,951,800	
9416	ビジョン	53,100	1,188.00	63,082,800	
9417	スマートバリュー	3,600	409.00	1,472,400	貸付有価証券 1,400株
9418	USEN-NEXT HOLDING S	39,500	3,995.00	157,802,500	
9419	ワイヤレスゲート	6,600	230.00	1,518,000	貸付有価証券 2,400株
9424	日本通信	346,700	228.00	79,047,600	
9428	クロップス	2,000	1,189.00	2,378,000	
9432	日本電信電話	104,767,300	173.90	18,219,033,470	
9433	K D D I	2,721,600	4,594.00	12,503,030,400	
9434	ソフトバンク	5,667,600	1,811.00	10,264,023,600	
9435	光通信	35,500	24,080.00	854,840,000	
9438	エムティーアイ	24,100	655.00	15,785,500	貸付有価証券 1,000株
9449	GMOインターネットグループ	130,100	2,497.50	324,924,750	貸付有価証券 1,900株
9450	ファイバーゲート	18,900	908.00	17,161,200	貸付有価証券 700株
9466	アイドママーケティングコミュニケー ション	3,500	235.00	822,500	貸付有価証券 1,300株
9468	K A D O K A W A	186,200	2,891.00	538,304,200	
9470	学研ホールディングス	58,600	998.00	58,482,800	
9474	ゼンリン	60,200	887.00	53,397,400	
9475	昭文社ホールディングス	6,500	365.00	2,372,500	貸付有価証券 2,000株
9479	インプレスホールディングス	13,900	180.00	2,502,000	貸付有価証券 3,600株
9600	アイネット	21,300	1,867.00	39,767,100	
9601	松竹	18,300	9,645.00	176,503,500	

9602	東宝	195,900	4,854.00	950,898,600	
9605	東映	11,600	20,370.00	236,292,000	貸付有価証券 300株
9613	N T Tデータグループ	920,900	1,980.00	1,823,382,000	貸付有価証券 43,000株
9629	ピー・シー・エー	20,200	1,135.00	22,927,000	
9658	ビジネスブレイン太田昭和	13,800	2,163.00	29,849,400	貸付有価証券 900株
9682	D T S	74,200	3,570.00	264,894,000	
9684	スクウェア・エニックス・ホールディングス	160,900	5,203.00	837,162,700	
9692	シーイーシー	44,400	1,571.00	69,752,400	
9697	カプコン	315,000	4,803.00	1,512,945,000	
9702	アイ・エス・ビー	18,000	1,457.00	26,226,000	
9717	ジャステック	21,600	1,440.00	31,104,000	
9719	S C S K	246,500	2,867.50	706,838,750	
9739	N S W	15,700	2,895.00	45,451,500	
9742	アイネス	27,400	1,616.00	44,278,400	
9746	T K C	55,900	3,690.00	206,271,000	
9749	富士ソフト	70,800	6,020.00	426,216,000	
9759	N S D	125,700	2,720.00	341,904,000	
9766	コナミグループ	131,900	7,874.00	1,038,580,600	貸付有価証券 5,900株
9790	福井コンピュータホールディングス	21,700	2,545.00	55,226,500	
9889	J B C Cホールディングス	23,300	3,930.00	91,569,000	
9928	ミロク情報サービス	32,000	1,742.00	55,744,000	
9984	ソフトバンクグループ	1,737,400	6,080.00	10,563,392,000	
2676	高千穂交易	10,300	3,765.00	38,779,500	貸付有価証券 900株
2689	オルバヘルスケアホールディングス	2,400	1,811.00	4,346,400	貸付有価証券 500株
2692	伊藤忠食品	8,400	7,760.00	65,184,000	
2715	エレマテック	33,300	1,778.00	59,207,400	
2733	あらた	56,800	3,195.00	181,476,000	
2737	トーマンデバイス	5,400	5,290.00	28,566,000	貸付有価証券 500株
2760	東京エレクトロン デバイス	37,000	5,040.00	186,480,000	
2767	円谷フィールズホールディングス	63,800	1,395.00	89,001,000	貸付有価証券 6,800株
2768	双日	413,700	3,309.00	1,368,933,300	
2784	アルフレッサ ホールディングス	372,900	2,408.50	898,129,650	

2874	横浜冷凍	101,200	1,056.00	106,867,200	貸付有価証券 12,200株
3004	神栄	2,300	1,870.00	4,301,000	貸付有価証券 600株
3023	ラサ商事	13,200	1,554.00	20,512,800	
3036	アルコニックス	48,900	1,361.00	66,552,900	
3038	神戸物産	287,400	3,941.00	1,132,643,400	
3054	ハイパー	3,100	308.00	954,800	
3076	あい ホールディングス	59,500	2,328.00	138,516,000	
3079	ディーブイエックス	4,300	1,086.00	4,669,800	
3107	ダイワボウホールディングス	164,500	3,050.00	501,725,000	
3132	マクニカホールディングス	87,900	7,122.00	626,023,800	
3139	ラクト・ジャパン	14,400	1,918.00	27,619,200	貸付有価証券 1,600株
3150	グリムス	15,600	2,080.00	32,448,000	
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	56,200	1,048.00	58,897,600	
3153	八洲電機	30,000	1,348.00	40,440,000	
3154	メディアスホールディングス	23,800	777.00	18,492,600	
3156	レスターホールディングス	31,600	2,838.00	89,680,800	
3157	ジオリーブグループ	3,300	1,336.00	4,408,800	貸付有価証券 400株
3160	大光	6,800	622.00	4,229,600	貸付有価証券 2,300株
3166	OCHIホールディングス	3,500	1,506.00	5,271,000	
3167	TOKAIホールディングス	201,800	983.00	198,369,400	貸付有価証券 4,000株
3168	黒谷	4,300	599.00	2,575,700	貸付有価証券 1,400株
3173	Cominix	2,900	815.00	2,363,500	
3176	三洋貿易	41,900	1,230.00	51,537,000	貸付有価証券 4,400株
3180	ビューティガレージ	11,700	2,124.00	24,850,800	
3183	ウイン・パートナーズ	24,000	1,212.00	29,088,000	
3321	ミタチ産業	4,000	1,128.00	4,512,000	貸付有価証券 1,300株
3360	シップヘルスケアホールディングス	133,500	2,302.50	307,383,750	
3388	明治電機工業	13,800	1,426.00	19,678,800	貸付有価証券 900株
3392	デリカフーズホールディングス	6,600	586.00	3,867,600	
3393	スターティアホールディングス	3,600	1,324.00	4,766,400	貸付有価証券 1,000株

3543	コメダホールディングス	91,100	2,778.00	253,075,800	
3559	ピーバンドットコム	1,900	369.00	701,100	貸付有価証券 200株
3565	アセンテック	14,200	504.00	7,156,800	貸付有価証券 600株
5009	富士興産	4,200	1,944.00	8,164,800	貸付有価証券 1,400株
6973	協栄産業	1,600	2,447.00	3,915,200	貸付有価証券 500株
7128	フルサト・マルカホールディングス	33,100	2,602.00	86,126,200	
7130	ヤマエグループホールディングス	21,000	4,000.00	84,000,000	貸付有価証券 3,300株
7414	小野建	36,500	1,793.00	65,444,500	
7417	南陽	3,200	2,197.00	7,030,400	
7420	佐鳥電機	18,100	2,027.00	36,688,700	
7427	エコートレーディング	3,000	1,465.00	4,395,000	
7433	伯東	21,300	5,600.00	119,280,000	貸付有価証券 2,700株
7438	コンドーテック	28,500	1,169.00	33,316,500	
7442	中山福	8,400	373.00	3,133,200	貸付有価証券 2,500株
7447	ナガイレーベン	46,900	2,432.00	114,060,800	
7451	三菱食品	34,300	4,865.00	166,869,500	
7456	松田産業	28,300	2,438.00	68,995,400	
7458	第一興商	143,800	2,089.00	300,398,200	
7459	メディパルホールディングス	384,900	2,320.00	892,968,000	貸付有価証券 13,900株
7466	S P K	16,500	1,889.00	31,168,500	
7467	萩原電気ホールディングス	15,900	4,815.00	76,558,500	
7476	アズワン	58,200	5,421.00	315,502,200	
7480	スズデン	13,000	2,368.00	30,784,000	
7481	尾家産業	3,700	1,763.00	6,523,100	
7482	シモジマ	24,800	1,302.00	32,289,600	
7483	ドウシシャ	34,400	2,100.00	72,240,000	
7487	小津産業	3,600	1,612.00	5,803,200	貸付有価証券 1,000株
7504	高速	22,100	2,114.00	46,719,400	
7510	たけびし	14,200	1,945.00	27,619,000	
7525	リックス	6,600	3,455.00	22,803,000	
7537	丸文	33,200	1,613.00	53,551,600	
7552	ハピネット	31,600	2,779.00	87,816,400	

7570	橋本総業ホールディングス	14,700	1,315.00	19,330,500	
7575	日本ライフライン	108,900	1,237.00	134,709,300	
7590	タカショー	32,300	555.00	17,926,500	貸付有価証券 2,600株
7599	I DOM	98,300	965.00	94,859,500	
7607	進和	22,700	2,426.00	55,070,200	
7608	エスケイジャパン	3,800	816.00	3,100,800	
7609	ダイトロン	14,700	2,767.00	40,674,900	
7613	シークス	53,000	1,456.00	77,168,000	
7619	田中商事	4,400	792.00	3,484,800	
7628	オーハシテクニカ	19,500	1,866.00	36,387,000	
7637	白銅	10,400	2,368.00	24,627,200	
7673	ダイコー通産	1,600	1,205.00	1,928,000	貸付有価証券 500株
8001	伊藤忠商事	2,497,600	5,878.00	14,680,892,800	
8002	丸紅	3,097,800	2,291.00	7,097,059,800	
8007	高島	9,600	1,211.00	11,625,600	貸付有価証券 2,800株
8012	長瀬産業	170,300	2,319.50	395,010,850	
8014	蝶理	23,300	2,875.00	66,987,500	
8015	豊田通商	325,500	8,798.00	2,863,749,000	
8018	三共生興	51,500	718.00	36,977,000	
8020	兼松	155,400	2,147.00	333,643,800	
8025	ツカモトコーポレーション	2,200	1,205.00	2,651,000	
8031	三井物産	2,799,500	5,443.00	15,237,678,500	
8032	日本紙パルプ商事	17,800	5,020.00	89,356,000	
8037	カメイ	39,500	1,774.00	70,073,000	
8038	東都水産	800	7,130.00	5,704,000	貸付有価証券 100株
8041	OUGホールディングス	2,300	2,445.00	5,623,500	
8043	スターゼン	25,600	2,700.00	69,120,000	
8051	山善	112,600	1,211.00	136,358,600	
8052	椿本興業	7,700	6,150.00	47,355,000	貸付有価証券 200株
8053	住友商事	2,248,700	3,147.00	7,076,658,900	
8057	内田洋行	15,100	6,870.00	103,737,000	
8058	三菱商事	7,362,400	2,353.00	17,323,727,200	
8059	第一実業	34,900	2,060.00	71,894,000	

8060	キャノンマーケティングジャパン	86,100	4,195.00	361,189,500	
8061	西華産業	14,600	2,995.00	43,727,000	
8065	佐藤商事	25,800	1,519.00	39,190,200	貸付有価証券 3,600株
8068	菱洋エレクトロ	35,200	3,640.00	128,128,000	
8070	東京産業	33,900	849.00	28,781,100	
8074	ユアサ商事	29,000	4,730.00	137,170,000	
8075	神鋼商事	9,300	5,840.00	54,312,000	
8077	トルク	8,500	276.00	2,346,000	貸付有価証券 3,100株
8078	阪和興業	66,700	5,050.00	336,835,000	
8079	正栄食品工業	24,700	4,785.00	118,189,500	
8081	カナデン	27,900	1,589.00	44,333,100	
8084	RYODEN	30,000	2,715.00	81,450,000	
8088	岩谷産業	84,600	6,593.00	557,767,800	
8089	ナイス	5,000	1,708.00	8,540,000	
8091	ニチモウ	4,000	2,079.00	8,316,000	貸付有価証券 1,400株
8093	極東貿易	22,200	2,037.00	45,221,400	貸付有価証券 900株
8095	アステナホールディングス	69,800	482.00	33,643,600	
8097	三愛オブリ	89,300	1,657.00	147,970,100	貸付有価証券 1,800株
8098	稲畑産業	73,400	3,255.00	238,917,000	
8101	G S I クレオス	19,900	2,244.00	44,655,600	
8103	明和産業	43,900	672.00	29,500,800	
8104	クワザワホールディングス	5,700	700.00	3,990,000	貸付有価証券 1,600株
8125	ワキタ	61,500	1,608.00	98,892,000	
8129	東邦ホールディングス	102,800	3,198.00	328,754,400	
8130	サンゲツ	85,500	3,125.00	267,187,500	
8131	ミツウロコグループホールディングス	47,400	1,602.00	75,934,800	
8132	シナネンホールディングス	10,300	4,235.00	43,620,500	貸付有価証券 500株
8133	伊藤忠エネクス	92,100	1,653.00	152,241,300	
8136	サンリオ	105,300	6,001.00	631,905,300	
8137	サンワテクノス	19,000	2,246.00	42,674,000	
8140	リョーサン	26,300	4,790.00	125,977,000	貸付有価証券 900株
8141	新光商事	49,900	1,192.00	59,480,800	

8142	トーヨー	14,500	2,782.00	40,339,000	貸付有価証券 1,400株
8150	三信電気	15,000	2,236.00	33,540,000	
8151	東陽テクニカ	37,700	1,443.00	54,401,100	
8153	モスフードサービス	54,600	3,325.00	181,545,000	
8154	加賀電子	33,900	6,240.00	211,536,000	
8158	ソーダニッカ	27,400	1,122.00	30,742,800	
8159	立花エレテック	24,600	2,800.00	68,880,000	
8275	フォーバル	14,600	1,447.00	21,126,200	
8283	PAL TAC	50,100	4,589.00	229,908,900	
8285	三谷産業	64,900	355.00	23,039,500	貸付有価証券 2,000株
8835	太平洋興発	6,000	832.00	4,992,000	
9260	西本Wismettacホールディングス	9,400	5,800.00	54,520,000	
9265	ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	2,203.00	2,643,600	貸付有価証券 300株
9273	コア商事ホールディングス	20,800	728.00	15,142,400	
9274	KPPグループホールディングス	96,200	698.00	67,147,600	貸付有価証券 10,300株
9305	ヤマタネ	16,400	2,543.00	41,705,200	
9763	丸紅建材リース	1,100	2,751.00	3,026,100	
9824	泉州電業	18,600	3,235.00	60,171,000	
9830	トラスコ中山	78,000	2,468.00	192,504,000	
9832	オートバックスセブン	129,300	1,579.50	204,229,350	
9837	モリト	26,600	1,311.00	34,872,600	
9869	加藤産業	46,000	4,625.00	212,750,000	
9872	北恵	3,700	900.00	3,330,000	貸付有価証券 800株
9882	イエローハット	59,000	1,782.00	105,138,000	
9896	JKホールディングス	28,500	1,074.00	30,609,000	
9902	日伝	25,100	2,898.00	72,739,800	
9930	北沢産業	8,900	278.00	2,474,200	貸付有価証券 3,300株
9932	杉本商事	18,000	2,269.00	40,842,000	
9934	因幡電機産業	96,300	3,405.00	327,901,500	
9960	東テク	12,400	4,910.00	60,884,000	
9962	ミスミグループ本社	561,000	2,413.50	1,353,973,500	貸付有価証券 1,200株
9972	アルテック	8,400	240.00	2,016,000	貸付有価証券 3,000株

9982	タキヒヨー	3,700	1,008.00	3,729,600	貸付有価証券 1,300株
9986	蔵王産業	2,700	2,490.00	6,723,000	
9987	スズケン	141,400	4,677.00	661,327,800	
9991	ジェコス	22,200	1,098.00	24,375,600	
9995	グローセル	18,300	687.00	12,572,100	
2651	ローソン	79,000	7,237.00	571,723,000	
2659	サンエー	28,400	4,615.00	131,066,000	
2664	カワチ薬品	29,100	2,691.00	78,308,100	
2670	エービーシー・マート	162,600	2,410.00	391,866,000	
2674	ハードオフコーポレーション	7,500	1,647.00	12,352,500	
2678	アスクル	76,900	2,167.00	166,642,300	
2681	ゲオホールディングス	41,700	2,153.00	89,780,100	
2685	アダストリア	44,900	3,200.00	143,680,000	
2686	ジーフット	10,100	292.00	2,949,200	貸付有価証券 3,900株
2687	シー・ヴィ・エス・バイエリア	2,000	699.00	1,398,000	
2695	くら寿司	43,500	3,410.00	148,335,000	
2698	キャンドウ	13,200	2,725.00	35,970,000	貸付有価証券 500株
2722	I Kホールディングス	5,100	328.00	1,672,800	貸付有価証券 1,300株
2726	パルグループホールディングス	72,900	2,247.00	163,806,300	
2730	エディオン	147,100	1,569.00	230,799,900	貸付有価証券 18,400株
2734	サーラコーポレーション	78,100	734.00	57,325,400	
2735	ワッツ	7,700	595.00	4,581,500	貸付有価証券 1,900株
2742	ハローズ	16,900	4,340.00	73,346,000	
2752	フジオフードグループ本社	41,700	1,414.00	58,963,800	貸付有価証券 1,600株
2753	あみやき亭	9,000	4,410.00	39,690,000	
2764	ひらまつ	35,800	268.00	9,594,400	貸付有価証券 8,600株
2791	大黒天物産	11,400	7,170.00	81,738,000	
2792	ハニーズホールディングス	29,300	1,637.00	47,964,100	
2796	ファーマライズホールディングス	3,500	651.00	2,278,500	
3028	アルペン	30,600	1,950.00	59,670,000	貸付有価証券 1,900株
3030	ハブ	5,100	756.00	3,855,600	
3034	クオールホールディングス	51,100	1,726.00	88,198,600	

3046	ジズホールディングス	22,000	4,620.00	101,640,000	貸付有価証券 1,200株
3048	ビクカメラ	197,700	1,374.00	271,639,800	
3050	DCMホールディングス	196,300	1,317.00	258,527,100	
3053	ペッパーフードサービス	86,200	99.00	8,533,800	貸付有価証券 7,000株
3064	Monotaro	526,700	1,557.50	820,335,250	貸付有価証券 57,300株
3067	東京一番フーズ	3,600	517.00	1,861,200	
3073	DDグループ	8,900	1,288.00	11,463,200	
3082	きちりホールディングス	3,700	1,017.00	3,762,900	貸付有価証券 1,200株
3086	J.フロントリテイリング	426,400	1,305.00	556,452,000	
3087	ドトール・日レスホールディングス	65,900	2,220.00	146,298,000	
3088	マツキヨココカラ&カンパニー	675,900	2,562.50	1,731,993,750	
3091	ブロンコビリー	21,800	3,175.00	69,215,000	貸付有価証券 800株
3092	ZOZO	236,800	3,242.00	767,705,600	
3093	トレジャー・ファクトリー	17,900	1,239.00	22,178,100	
3097	物語コーポレーション	62,100	4,450.00	276,345,000	
3099	三越伊勢丹ホールディングス	625,700	1,599.50	1,000,807,150	貸付有価証券 800株
3134	Hamee	12,800	990.00	12,672,000	貸付有価証券 1,300株
3135	マーケットエンタープライズ	1,600	1,047.00	1,675,200	貸付有価証券 100株
3141	ウエルシアホールディングス	192,700	2,514.50	484,544,150	
3148	クリエイトSDホールディングス	61,400	3,085.00	189,419,000	
3159	丸善CHIホールディングス	18,700	333.00	6,227,100	貸付有価証券 5,500株
3169	ミサワ	3,300	680.00	2,244,000	
3172	ティーライフ	2,100	1,425.00	2,992,500	
3175	エー・ピーホールディングス	3,300	934.00	3,082,200	貸付有価証券 300株
3178	チムニー	4,900	1,442.00	7,065,800	貸付有価証券 1,300株
3179	シュッピン	33,500	1,154.00	38,659,000	
3182	オイシックス・ラ・大地	49,900	1,370.00	68,363,000	貸付有価証券 4,400株
3186	ネクステージ	84,900	2,568.00	218,023,200	貸付有価証券 9,900株
3191	ジョイフル本田	108,100	1,870.00	202,147,000	
3193	鳥貴族ホールディングス	13,700	3,350.00	45,895,000	貸付有価証券

					1,800株
3196	ホットランド	28,400	1,852.00	52,596,800	貸付有価証券 2,200株
3197	すかいらくホールディングス	507,900	2,163.50	1,098,841,650	貸付有価証券 19,700株
3198	SFPホールディングス	20,300	2,130.00	43,239,000	貸付有価証券 1,900株
3199	綿半ホールディングス	28,800	1,432.00	41,241,600	
3221	ヨシックスホールディングス	3,300	2,749.00	9,071,700	
3222	ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	103,800	1,022.00	106,083,600	
3319	ゴルフダイジェスト・オンライン	16,800	667.00	11,205,600	
3328	B E E N O S	15,200	1,396.00	21,219,200	貸付有価証券 1,500株
3333	あさひ	34,500	1,272.00	43,884,000	
3341	日本調剤	25,300	1,428.00	36,128,400	
3349	コスモス薬品	36,800	15,965.00	587,512,000	
3361	トーエル	7,000	753.00	5,271,000	貸付有価証券 300株
3382	セブン&アイ・ホールディングス	1,280,500	5,645.00	7,228,422,500	
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディング	251,500	1,134.00	285,201,000	
3391	ツルハホールディングス	78,000	12,980.00	1,012,440,000	貸付有価証券 3,200株
3395	サンマルクホールディングス	29,900	2,148.00	64,225,200	
3396	フェリシモ	3,500	952.00	3,332,000	
3397	トリドールホールディングス	104,100	4,213.00	438,573,300	
3415	TOKYO BASE	44,600	303.00	13,513,800	貸付有価証券 3,900株
3538	ウイルプラスホールディングス	2,600	1,007.00	2,618,200	
3539	JMホールディングス	28,000	2,175.00	60,900,000	貸付有価証券 1,100株
3544	サツドラホールディングス	7,200	794.00	5,716,800	
3546	アレンザホールディングス	27,800	1,057.00	29,384,600	
3547	串カツ田中ホールディングス	9,900	1,583.00	15,671,700	貸付有価証券 1,200株
3548	パロックジャパンリミテッド	28,900	828.00	23,929,200	貸付有価証券 800株
3549	クスリのアオキホールディングス	99,400	3,341.00	332,095,400	
3561	力の源ホールディングス	16,600	1,394.00	23,140,400	貸付有価証券 1,900株
3563	FOOD & LIFE COMPANIE	198,200	2,835.50	561,996,100	
4350	メディカルシステムネットワーク	40,200	664.00	26,692,800	

7127	一家ホールディングス	3,500	671.00	2,348,500	貸付有価証券 1,300株
7135	ジャパンクラブホールディングス	9,200	165.00	1,518,000	貸付有価証券 1,700株
7416	はるやまホールディングス	7,600	625.00	4,750,000	
7419	ノジマ	107,800	1,758.00	189,512,400	
7421	カップ・クリエイト	58,400	1,718.00	100,331,200	
7445	ライトオン	12,000	448.00	5,376,000	貸付有価証券 5,800株
7453	良品計画	405,600	2,260.50	916,858,800	
7455	パリミキホールディングス	19,900	538.00	10,706,200	貸付有価証券 4,700株
7463	アドヴァングループ	35,300	1,075.00	37,947,500	
7475	アルビス	12,200	2,648.00	32,305,600	
7494	コナカ	17,300	405.00	7,006,500	
7506	ハウス オブ ローゼ	2,000	1,617.00	3,234,000	
7508	G-7ホールディングス	40,500	1,207.00	48,883,500	
7512	イオン北海道	109,900	934.00	102,646,600	貸付有価証券 5,200株
7513	コジマ	61,400	782.00	48,014,800	
7514	ヒマラヤ	5,100	936.00	4,773,600	貸付有価証券 100株
7516	コーナン商事	45,500	3,930.00	178,815,000	
7520	エコス	13,800	2,469.00	34,072,200	
7522	ワタミ	39,200	1,047.00	41,042,400	
7524	マルシェ	5,500	238.00	1,309,000	貸付有価証券 400株
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	750,300	3,292.00	2,469,987,600	
7545	西松屋チェーン	73,100	2,040.00	149,124,000	貸付有価証券 6,600株
7550	ゼンショーホールディングス	189,200	7,328.00	1,386,457,600	
7554	幸楽苑ホールディングス	27,500	1,238.00	34,045,000	貸付有価証券 2,700株
7561	ハークスレイ	5,600	864.00	4,838,400	
7581	サイゼリヤ	54,900	5,150.00	282,735,000	
7593	V Tホールディングス	141,100	519.00	73,230,900	
7596	魚力	13,000	2,348.00	30,524,000	
7601	ポプラ	3,600	198.00	712,800	
7605	フジ・コーポレーション	17,700	1,680.00	29,736,000	
7606	ユナイテッドアローズ	43,600	1,845.00	80,442,000	

7611	ハイデイ日高	55,100	2,912.00	160,451,200	
7615	YU-WA Creation Holdi	8,900	155.00	1,379,500	貸付有価証券 400株
7616	コロワイド	159,800	2,279.50	364,264,100	貸付有価証券 5,200株
7630	壱番屋	29,300	5,210.00	152,653,000	
7640	トップカルチャー	5,200	157.00	816,400	貸付有価証券 1,900株
7646	PLANT	3,600	1,526.00	5,493,600	貸付有価証券 1,100株
7649	スギホールディングス	74,900	6,500.00	486,850,000	
7679	薬王堂ホールディングス	18,100	2,714.00	49,123,400	
7918	ヴィア・ホールディングス	22,200	176.00	3,907,200	貸付有価証券 6,400株
8005	スクロール	55,300	977.00	54,028,100	貸付有価証券 2,200株
8008	ヨンドシーホールディングス	35,100	2,044.00	71,744,400	
8160	木曾路	56,200	2,603.00	146,288,600	
8163	SRSホールディングス	61,300	1,113.00	68,226,900	
8165	千趣会	68,400	351.00	24,008,400	貸付有価証券 7,800株
8166	タカキュー	11,200	83.00	929,600	
8167	リテールパートナーズ	55,100	1,701.00	93,725,100	
8173	上新電機	36,800	2,455.00	90,344,000	
8174	日本瓦斯	196,900	2,383.50	469,311,150	
8179	ロイヤルホールディングス	65,500	2,567.00	168,138,500	貸付有価証券 2,500株
8181	東天紅	1,200	824.00	988,800	
8182	いなげや	36,100	1,315.00	47,471,500	
8185	チヨダ	35,500	861.00	30,565,500	
8194	ライフコーポレーション	39,000	3,330.00	129,870,000	
8200	リンガーハット	47,900	2,358.00	112,948,200	
8203	MrMaxHD	46,800	635.00	29,718,000	
8207	テンアライド	17,000	311.00	5,287,000	貸付有価証券 7,600株
8214	AOKIホールディングス	79,700	1,137.00	90,618,900	貸付有価証券 6,100株
8217	オークワ	53,500	843.00	45,100,500	
8218	コメリ	57,200	3,200.00	183,040,000	
8219	青山商事	79,400	1,487.00	118,067,800	
8227	しまむら	43,600	15,605.00	680,378,000	

8230	はせがわ	7,500	372.00	2,790,000	
8233	高島屋	256,800	1,959.50	503,199,600	貸付有価証券 10,900株
8237	松屋	63,000	948.00	59,724,000	貸付有価証券 4,200株
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	164,400	1,555.00	255,642,000	
8244	近鉄百貨店	15,900	2,657.00	42,246,300	
8252	丸井グループ	246,600	2,437.00	600,964,200	
8255	アクシアル リテイリング	25,300	4,120.00	104,236,000	
8260	井筒屋	7,500	385.00	2,887,500	貸付有価証券 2,300株
8267	イオン	1,259,600	3,252.00	4,096,219,200	貸付有価証券 9,200株
8273	イズミ	65,900	3,657.00	240,996,300	
8276	平和堂	62,100	2,141.00	132,956,100	
8278	フジ	57,000	1,966.00	112,062,000	貸付有価証券 7,500株
8279	ヤオコー	42,000	8,072.00	339,024,000	貸付有価証券 2,600株
8281	ゼビオホールディングス	50,300	972.00	48,891,600	
8282	ケーズホールディングス	262,700	1,334.50	350,573,150	
8289	O l y m p i cグループ	6,900	549.00	3,788,100	貸付有価証券 2,200株
8291	日産東京販売ホールディングス	23,600	462.00	10,903,200	貸付有価証券 6,400株
9262	シルバーライフ	7,100	857.00	6,084,700	貸付有価証券 1,000株
9267	Genky Drug Stores	16,300	5,400.00	88,020,000	
9275	ナルミヤ・インターナショナル	2,600	1,215.00	3,159,000	
9278	ブックオフグループホールディングス	18,900	1,163.00	21,980,700	
9279	ギフトホールディングス	15,700	2,402.00	37,711,400	貸付有価証券 200株
9627	アインホールディングス	51,200	4,519.00	231,372,800	
9828	元気寿司	21,000	3,390.00	71,190,000	
9831	ヤマダホールディングス	1,142,800	446.30	510,031,640	
9842	アークランズ	110,500	1,711.00	189,065,500	貸付有価証券 8,600株
9843	ニトリホールディングス	135,300	17,500.00	2,367,750,000	
9850	グルメ杵屋	30,100	1,069.00	32,176,900	
9854	愛眼	11,700	188.00	2,199,600	貸付有価証券 400株
9856	ケーユーホールディングス	17,400	1,125.00	19,575,000	

9861	吉野家ホールディングス	136,900	3,262.00	446,567,800	
9887	松屋フーズホールディングス	17,500	5,780.00	101,150,000	
9900	サガミホールディングス	55,700	1,453.00	80,932,100	貸付有価証券 1,800株
9919	関西フードマーケット	25,200	1,460.00	36,792,000	
9936	王将フードサービス	27,500	8,090.00	222,475,000	
9946	ミニストップ	27,000	1,533.00	41,391,000	
9948	アークス	68,100	2,812.00	191,497,200	
9956	バローホールディングス	70,900	2,463.00	174,626,700	
9974	ベルク	18,500	6,250.00	115,625,000	
9979	大庄	9,100	1,244.00	11,320,400	
9983	ファーストリテイリング	167,200	34,500.00	5,768,400,000	貸付有価証券 6,500株
9989	サンドラッグ	125,400	4,517.00	566,431,800	
9990	サックスパー ホールディングス	31,400	812.00	25,496,800	
9993	ヤマザワ	3,400	1,263.00	4,294,200	
9994	やまや	3,300	3,085.00	10,180,500	
9997	ペルーナ	89,400	628.00	56,143,200	
5830	いよぎんホールディングス	411,600	971.90	400,034,040	
5831	しずおかフィナンシャルグループ	768,400	1,246.50	957,810,600	貸付有価証券 82,600株
5832	ちゅうぎんフィナンシャルグループ	291,200	1,018.00	296,441,600	
5838	楽天銀行	120,300	2,257.00	271,517,100	
5844	京都フィナンシャルグループ	438,200	2,225.00	974,995,000	
7150	島根銀行	4,300	518.00	2,227,400	
7161	じもとホールディングス	11,200	550.00	6,160,000	貸付有価証券 600株
7167	めぶきフィナンシャルグループ	1,716,200	438.00	751,695,600	
7173	東京きらぼしフィナンシャルグループ	44,300	4,050.00	179,415,000	
7180	九州フィナンシャルグループ	669,400	831.20	556,405,280	
7182	ゆうちょ銀行	3,800,700	1,455.00	5,530,018,500	
7184	富山第一銀行	109,800	780.00	85,644,000	
7186	コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,855,800	671.00	1,245,241,800	
7189	西日本フィナンシャルホールディングス	195,100	1,656.00	323,085,600	
7322	三十三フィナンシャルグループ	30,900	1,859.00	57,443,100	
7327	第四北越フィナンシャルグループ	54,300	3,920.00	212,856,000	
7337	ひろぎんホールディングス	492,300	938.00	461,777,400	

7350	おきなわフィナンシャルグループ	29,500	2,367.00	69,826,500	
7380	十六フィナンシャルグループ	44,800	3,800.00	170,240,000	
7381	北國フィナンシャルホールディングス	36,400	4,755.00	173,082,000	
7384	プロクレアホールディングス	39,500	1,882.00	74,339,000	貸付有価証券 4,600株
7389	あいちフィナンシャルグループ	53,200	2,446.00	130,127,200	
8304	あおぞら銀行	248,600	3,160.00	785,576,000	貸付有価証券 9,700株
8306	三菱UFJフィナンシャル・グループ	21,063,300	1,258.00	26,497,631,400	
8308	りそなホールディングス	4,033,000	746.70	3,011,441,100	
8309	三井住友トラスト・ホールディングス	1,243,000	2,848.00	3,540,064,000	
8316	三井住友フィナンシャルグループ	2,459,100	7,161.00	17,609,615,100	
8331	千葉銀行	963,900	1,044.50	1,006,793,550	
8334	群馬銀行	671,200	704.80	473,061,760	
8336	武蔵野銀行	48,300	2,696.00	130,216,800	貸付有価証券 4,700株
8337	千葉興業銀行	57,200	777.00	44,444,400	
8338	筑波銀行	151,800	247.00	37,494,600	
8341	七十七銀行	100,700	3,515.00	353,960,500	
8343	秋田銀行	23,200	1,932.00	44,822,400	
8344	山形銀行	38,400	1,077.00	41,356,800	
8345	岩手銀行	21,900	2,526.00	55,319,400	
8346	東邦銀行	273,600	289.00	79,070,400	貸付有価証券 39,100株
8349	東北銀行	7,200	1,197.00	8,618,400	
8354	ふくおかフィナンシャルグループ	301,200	3,447.00	1,038,236,400	
8358	スルガ銀行	304,900	806.00	245,749,400	
8359	八十二銀行	742,200	774.40	574,759,680	
8360	山梨中央銀行	38,700	1,696.00	65,635,200	
8361	大垣共立銀行	65,900	1,887.00	124,353,300	
8362	福井銀行	30,900	1,664.00	51,417,600	
8364	清水銀行	13,800	1,553.00	21,431,400	
8365	富山銀行	2,500	1,717.00	4,292,500	貸付有価証券 800株
8366	滋賀銀行	57,500	3,500.00	201,250,000	
8367	南都銀行	52,000	2,491.00	129,532,000	
8368	百五銀行	325,400	545.00	177,343,000	
8370	紀陽銀行	123,700	1,589.00	196,559,300	

8377	ほくほくフィナンシャルグループ	214,000	1,534.50	328,383,000	貸付有価証券 500株
8381	山陰合同銀行	216,500	1,012.00	219,098,000	
8383	鳥取銀行	5,200	1,380.00	7,176,000	
8386	百十四銀行	34,000	2,424.00	82,416,000	貸付有価証券 4,600株
8387	四国銀行	50,700	980.00	49,686,000	
8388	阿波銀行	48,500	2,407.00	116,739,500	
8392	大分銀行	20,800	2,564.00	53,331,200	
8393	宮崎銀行	20,800	2,667.00	55,473,600	
8395	佐賀銀行	20,300	1,879.00	38,143,700	
8399	琉球銀行	73,600	1,123.00	82,652,800	
8410	セブン銀行	1,084,100	300.30	325,555,230	貸付有価証券 48,200株
8411	みずほフィナンシャルグループ	4,668,500	2,548.00	11,895,338,000	
8416	高知銀行	5,100	928.00	4,732,800	貸付有価証券 1,600株
8418	山口フィナンシャルグループ	339,100	1,317.50	446,764,250	
8522	名古屋銀行	22,400	5,420.00	121,408,000	貸付有価証券 1,100株
8524	北洋銀行	524,100	354.00	185,531,400	
8537	大光銀行	4,800	1,296.00	6,220,800	
8541	愛媛銀行	46,600	1,027.00	47,858,200	
8542	トマト銀行	5,200	1,180.00	6,136,000	
8544	京葉銀行	145,100	684.00	99,248,400	
8550	栃木銀行	172,700	307.00	53,018,900	貸付有価証券 21,200株
8551	北日本銀行	11,300	2,144.00	24,227,200	
8558	東和銀行	63,500	614.00	38,989,000	
8562	福島銀行	15,500	237.00	3,673,500	
8563	大東銀行	6,500	762.00	4,953,000	貸付有価証券 2,200株
8600	トモニホールディングス	327,300	390.00	127,647,000	貸付有価証券 33,800株
8713	フィデアホールディングス	35,700	1,531.00	54,656,700	
8714	池田泉州ホールディングス	479,700	331.00	158,780,700	
7148	F P G	117,000	1,725.00	201,825,000	
7172	ジャパンインベストメントアドバイザー	28,300	1,489.00	42,138,700	
7347	マーキュリアホールディングス	7,500	710.00	5,325,000	
8473	S B Iホールディングス	506,500	3,360.00	1,701,840,000	貸付有価証券

					19,400株
8518	日本アジア投資	10,800	242.00	2,613,600	貸付有価証券 3,700株
8595	ジャフコ グループ	103,100	1,669.50	172,125,450	
8601	大和証券グループ本社	2,679,300	1,005.00	2,692,696,500	
8604	野村ホールディングス	5,816,400	669.20	3,892,334,880	
8609	岡三証券グループ	303,600	708.00	214,948,800	
8613	丸三証券	115,100	860.00	98,986,000	貸付有価証券 17,500株
8614	東洋証券	91,800	296.00	27,172,800	
8616	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	410,700	556.00	228,349,200	
8617	光世証券	3,400	497.00	1,689,800	貸付有価証券 200株
8622	水戸証券	102,100	443.00	45,230,300	
8624	いちよし証券	64,800	724.00	46,915,200	
8628	松井証券	170,200	756.00	128,671,200	
8698	マネックスグループ	338,700	697.00	236,073,900	
8706	極東証券	47,400	1,000.00	47,400,000	
8707	岩井コスモホールディングス	39,400	1,872.00	73,756,800	
8708	アイザワ証券グループ	49,900	1,264.00	63,073,600	
8732	マネーパートナーズグループ	15,500	296.00	4,588,000	貸付有価証券 4,600株
8739	スパークス・グループ	38,500	1,643.00	63,255,500	
8742	小林洋行	5,900	244.00	1,439,600	貸付有価証券 100株
7181	かんぽ生命保険	352,300	2,662.00	937,822,600	
7388	F P パートナー	6,900	5,220.00	36,018,000	
8630	SOMPOホールディングス	520,300	7,080.00	3,683,724,000	
8715	アニコム ホールディングス	117,500	540.00	63,450,000	貸付有価証券 8,300株
8725	MS&ADインシュアランスグループ ホール	774,400	5,700.00	4,414,080,000	
8750	第一生命ホールディングス	1,690,000	3,107.00	5,250,830,000	
8766	東京海上ホールディングス	3,418,700	3,555.00	12,153,478,500	
8795	T&Dホールディングス	928,700	2,324.00	2,158,298,800	
8798	アドバンスクリエイト	20,000	1,015.00	20,300,000	
7164	全国保証	90,400	5,347.00	483,368,800	貸付有価証券 3,600株
7183	あんしん保証	6,400	247.00	1,580,800	貸付有価証券 1,600株

7187	ジェイリース	9,000	2,127.00	19,143,000	
7191	イントラスト	5,700	799.00	4,554,300	
7192	日本モーゲージサービス	8,300	526.00	4,365,800	貸付有価証券 1,800株
7196	C a s a	5,800	900.00	5,220,000	貸付有価証券 600株
7198	S B Iアルヒ	33,200	858.00	28,485,600	
7199	プレミアグループ	58,300	1,823.00	106,280,900	貸付有価証券 10,000株
7383	ネットプロテクションズホールディングス	114,600	207.00	23,722,200	貸付有価証券 13,900株
8253	クレディセゾン	219,200	2,628.00	576,057,600	
8424	芙蓉総合リース	31,800	12,735.00	404,973,000	
8425	みずほリース	57,900	4,965.00	287,473,500	
8439	東京センチュリー	258,500	1,584.00	409,464,000	
8511	日本証券金融	127,100	1,536.00	195,225,600	
8515	アイフル	509,100	388.00	197,530,800	
8566	リコーリース	32,800	4,890.00	160,392,000	
8570	イオンフィナンシャルサービス	198,600	1,308.50	259,868,100	
8572	アコム	614,000	355.50	218,277,000	
8584	ジャックス	36,900	5,300.00	195,570,000	
8585	オリエントコーポレーション	112,900	1,094.00	123,512,600	貸付有価証券 11,800株
8591	オリックス	2,108,200	2,759.00	5,816,523,800	
8593	三菱HCキャピタル	1,541,100	984.90	1,517,829,390	
8596	九州リースサービス	6,000	1,123.00	6,738,000	
8697	日本取引所グループ	902,400	3,005.00	2,711,712,000	
8771	イー・ギャランティ	56,200	2,018.00	113,411,600	
8772	アサックス	6,800	725.00	4,930,000	貸付有価証券 2,200株
8793	NECキャピタルソリューション	17,000	3,495.00	59,415,000	
1435	R o b o t H o m e	95,700	175.00	16,747,500	
1878	大東建託	126,700	16,430.00	2,081,681,000	
2337	いちご	398,200	343.00	136,582,600	
2353	日本駐車場開発	366,000	196.00	71,736,000	
2975	スター・マイカ・ホールディングス	40,200	635.00	25,527,000	
2980	S R Eホールディングス	14,900	2,686.00	40,021,400	貸付有価証券 1,300株
2982	ADワークスグループ	37,400	238.00	8,901,200	貸付有価証券 8,000株

3003	ヒューリック	806,800	1,499.50	1,209,796,600	
3231	野村不動産ホールディングス	192,500	3,823.00	735,927,500	
3232	三重交通グループホールディングス	74,000	606.00	44,844,000	
3244	サムティ	55,100	2,477.00	136,482,700	
3245	ディア・ライフ	59,000	953.00	56,227,000	
3246	コーセーアールイー	4,700	1,096.00	5,151,200	貸付有価証券 1,800株
3252	地主	26,400	2,232.00	58,924,800	貸付有価証券 600株
3254	プレサンスコーポレーション	54,900	1,640.00	90,036,000	貸付有価証券 2,100株
3271	THEグローバル社	8,600	404.00	3,474,400	貸付有価証券 2,400株
3275	ハウスコム	2,400	920.00	2,208,000	
3276	JPMC	20,000	1,117.00	22,340,000	
3277	サンセイランディック	4,400	1,010.00	4,444,000	
3280	エストラスト	1,500	661.00	991,500	
3284	フージャースホールディングス	53,300	1,089.00	58,043,700	
3288	オープンハウスグループ	126,700	4,287.00	543,162,900	貸付有価証券 400株
3289	東急不動産ホールディングス	1,039,900	953.30	991,336,670	
3291	飯田グループホールディングス	331,400	2,201.50	729,577,100	
3294	イーランド	2,200	1,542.00	3,392,400	
3299	ムゲンエステート	9,900	1,117.00	11,058,300	
3452	ビーロッド	10,100	970.00	9,797,000	
3454	ファーストブラザーズ	2,900	1,023.00	2,966,700	貸付有価証券 200株
3457	And Doホールディングス	20,900	1,058.00	22,112,200	貸付有価証券 300株
3458	シーアールイー	19,200	1,464.00	28,108,800	貸付有価証券 700株
3465	ケイアイスター不動産	16,700	3,235.00	54,024,500	貸付有価証券 600株
3467	アグレ都市デザイン	2,700	1,563.00	4,220,100	
3475	グッドコムアセット	32,100	742.00	23,818,200	貸付有価証券 4,000株
3480	ジェイ・エス・ビー	17,200	2,521.00	43,361,200	
3482	ロードスターキャピタル	22,500	2,000.00	45,000,000	
3484	テンポイノベーション	4,400	1,034.00	4,549,600	
3486	グローバル・リンク・マネジメント	2,700	2,260.00	6,102,000	
3489	フェイスネットワーク	4,000	1,484.00	5,936,000	貸付有価証券 800株

3498	霞ヶ関キャピタル	9,400	8,510.00	79,994,000	貸付有価証券 100株
4666	パーク24	224,600	1,873.50	420,788,100	貸付有価証券 8,800株
4809	パラカ	12,200	1,947.00	23,753,400	
5535	ミガロホールディングス	2,900	1,420.00	4,118,000	
6620	宮越ホールディングス	15,800	1,107.00	17,490,600	貸付有価証券 1,600株
8801	三井不動産	1,599,500	3,551.00	5,679,824,500	
8802	三菱地所	2,260,900	1,996.50	4,513,886,850	
8803	平和不動産	56,100	3,825.00	214,582,500	貸付有価証券 2,700株
8804	東京建物	302,200	2,138.00	646,103,600	
8818	京阪神ビルディング	64,600	1,405.00	90,763,000	貸付有価証券 2,300株
8830	住友不動産	500,200	4,289.00	2,145,357,800	
8841	テーオーシー	61,600	728.00	44,844,800	
8842	東京楽天地	5,700	6,740.00	38,418,000	貸付有価証券 400株
8848	レオパレス21	346,100	423.00	146,400,300	
8850	スターツコーポレーション	49,600	2,954.00	146,518,400	
8860	フジ住宅	43,600	719.00	31,348,400	
8864	空港施設	48,700	596.00	29,025,200	
8869	明和地所	7,900	1,262.00	9,969,800	
8871	ゴールドクレスト	28,200	2,284.00	64,408,800	
8877	エスリード	16,200	3,600.00	58,320,000	
8881	日神グループホールディングス	55,500	516.00	28,638,000	
8892	日本エスコン	64,700	959.00	62,047,300	貸付有価証券 7,900株
8897	MIRARTHホールディングス	158,900	481.00	76,430,900	
8904	AVANTIA	7,900	894.00	7,062,600	
8905	イオンモール	179,300	1,808.00	324,174,400	
8908	毎日コムネット	5,400	747.00	4,033,800	
8917	ファースト住建	5,900	1,071.00	6,318,900	貸付有価証券 800株
8918	ランド	1,892,400	8.00	15,139,200	
8919	カチタス	93,000	2,144.00	199,392,000	貸付有価証券 6,600株
8923	トーセイ	57,500	2,003.00	115,172,500	
8928	穴吹興産	2,800	2,032.00	5,689,600	
8934	サンフロンティア不動産	51,200	1,706.00	87,347,200	

8935	F J ネクストホールディングス	36,400	1,157.00	42,114,800	
8940	インテリックス	3,500	499.00	1,746,500	
8944	ランドビジネス	5,400	268.00	1,447,200	
8945	サンネクスタグループ	4,300	968.00	4,162,400	
8999	グランディハウス	11,600	626.00	7,261,600	
9706	日本空港ビルデング	122,300	6,167.00	754,224,100	
1717	明豊ファシリティワークス	7,500	818.00	6,135,000	
2120	L I F U L L	123,400	185.00	22,829,000	
2121	M I X I	77,500	2,426.00	188,015,000	
2124	ジェイエイシーリクルートメント	130,500	645.00	84,172,500	
2127	日本M&Aセンターホールディングス	575,200	777.20	447,045,440	
2130	メンバーズ	12,300	968.00	11,906,400	
2139	中広	2,500	422.00	1,055,000	
2146	U T グループ	46,500	2,310.00	107,415,000	
2148	アイティメディア	13,700	992.00	13,590,400	貸付有価証券 1,200株
2150	ケアネット	55,400	934.00	51,743,600	
2153	E・Jホールディングス	21,100	1,639.00	34,582,900	
2154	オープンアップグループ	108,200	2,252.00	243,666,400	貸付有価証券 200株
2157	コシダカホールディングス	108,100	1,085.00	117,288,500	
2163	アルトナー	3,900	2,263.00	8,825,700	
2168	パソナグループ	43,800	2,582.00	113,091,600	
2169	C D S	3,800	1,704.00	6,475,200	貸付有価証券 1,100株
2170	リンクアンドモチベーション	103,900	558.00	57,976,200	
2175	エス・エム・エス	126,500	2,785.50	352,365,750	
2180	サニーサイドアップグループ	4,600	564.00	2,594,400	
2181	パーソルホールディングス	3,675,000	249.70	917,647,500	
2183	リニカル	9,100	537.00	4,886,700	貸付有価証券 2,100株
2193	クックパッド	98,800	116.00	11,460,800	
2196	エスクリ	6,300	293.00	1,845,900	貸付有価証券 1,300株
2198	アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,500	685.00	5,137,500	
2301	学情	18,400	1,765.00	32,476,000	
2305	スタジオアリス	18,100	2,106.00	38,118,600	貸付有価証券 2,100株
2309	シミックホールディングス	17,400	2,645.00	46,023,000	

2311	エプロ	3,500	916.00	3,206,000	
2325	N J S	7,900	2,751.00	21,732,900	
2331	総合警備保障	603,000	819.00	493,857,000	
2371	カカクコム	238,500	1,721.50	410,577,750	貸付有価証券 10,300株
2372	アイロムグループ	14,600	2,040.00	29,784,000	
2374	セントケア・ホールディング	26,300	1,007.00	26,484,100	
2376	サイネックス	2,700	824.00	2,224,800	
2378	ルネサンス	28,100	891.00	25,037,100	
2379	ディップ	55,300	3,175.00	175,577,500	
2389	デジタルホールディングス	18,800	1,263.00	23,744,400	
2395	新日本科学	32,800	1,789.00	58,679,200	貸付有価証券 4,600株
2410	キャリアデザインセンター	3,200	2,105.00	6,736,000	
2412	ベネフィット・ワン	125,400	2,110.00	264,594,000	
2413	エムスリー	713,400	2,278.00	1,625,125,200	貸付有価証券 7,100株
2418	ツカダ・グローバルホールディング	10,000	379.00	3,790,000	貸付有価証券 2,700株
2424	プラス	1,800	691.00	1,243,800	貸付有価証券 500株
2427	アウトソーシング	231,700	1,731.00	401,072,700	
2428	ウェルネット	11,800	569.00	6,714,200	
2429	ワールドホールディングス	16,300	2,741.00	44,678,300	
2432	ディー・エヌ・エー	128,300	1,385.00	177,695,500	
2433	博報堂D Yホールディングス	460,400	1,098.50	505,749,400	貸付有価証券 17,800株
2440	ぐるなび	67,300	271.00	18,238,300	貸付有価証券 7,300株
2445	タカミヤ	48,900	496.00	24,254,400	
2453	ジャパンベストレスキューシステム	17,900	997.00	17,846,300	
2461	ファンコミュニケーションズ	50,500	400.00	20,200,000	貸付有価証券 2,000株
2462	ライク	13,400	1,463.00	19,604,200	貸付有価証券 2,600株
2464	A o b a - B B T	5,800	410.00	2,378,000	
2471	エスプール	103,800	432.00	44,841,600	貸付有価証券 9,900株
2475	WDBホールディングス	18,400	2,255.00	41,492,000	
2485	ティア	9,200	470.00	4,324,000	
2487	CDG	1,700	1,201.00	2,041,700	

2489	アドウェイズ	49,600	491.00	24,353,600	貸付有価証券 7,400株
2491	バリューコマース	31,700	1,422.00	45,077,400	貸付有価証券 100株
2492	インフォマート	374,800	474.00	177,655,200	
2749	J Pホールディングス	92,300	457.00	42,181,100	
3521	エコナックホールディングス	13,400	132.00	1,768,800	貸付有価証券 3,800株
4286	C Lホールディングス	8,500	855.00	7,267,500	
4290	プレステージ・インターナショナル	169,000	601.00	101,569,000	貸付有価証券 13,600株
4301	アミューズ	22,000	1,503.00	33,066,000	
4310	ドリームインキュベータ	12,400	3,115.00	38,626,000	
4318	クイック	25,100	2,522.00	63,302,200	
4319	T A C	7,600	200.00	1,520,000	
4324	電通グループ	354,800	3,720.00	1,319,856,000	
4331	テイクアンドギヴ・ニーズ	12,100	1,220.00	14,762,000	
4337	びあ	12,300	3,400.00	41,820,000	貸付有価証券 1,200株
4343	イオンファンタジー	13,000	2,546.00	33,098,000	
4345	シーティーエス	45,600	680.00	31,008,000	貸付有価証券 1,600株
4346	N E X Y Z . G r o u p	4,800	704.00	3,379,200	貸付有価証券 1,500株
4544	H. U. グループホールディングス	105,700	2,669.00	282,113,300	
4641	アルプス技研	34,300	2,652.00	90,963,600	貸付有価証券 100株
4651	サニックス	57,800	315.00	18,207,000	
4658	日本空調サービス	38,800	820.00	31,816,000	
4661	オリエンタルランド	1,910,500	5,274.00	10,075,977,000	
4665	ダスキン	80,400	3,369.00	270,867,600	貸付有価証券 100株
4668	明光ネットワークジャパン	43,800	778.00	34,076,400	
4671	ファルコホールディングス	16,300	2,123.00	34,604,900	
4678	秀英予備校	3,500	310.00	1,085,000	
4679	田谷	2,600	406.00	1,055,600	貸付有価証券 200株
4680	ラウンドワン	339,700	565.00	191,930,500	
4681	リゾートトラスト	156,800	2,470.00	387,296,000	
4694	ビー・エム・エル	44,400	2,920.00	129,648,000	
4714	リソー教育	184,600	230.00	42,458,000	貸付有価証券 19,400株

4718	早稲田アカデミー	20,000	1,815.00	36,300,000	
4732	ユー・エス・エス	405,000	2,830.00	1,146,150,000	
4745	東京個別指導学院	42,800	449.00	19,217,200	
4751	サイバーエージェント	797,700	888.60	708,836,220	貸付有価証券 31,000株
4755	楽天グループ	3,093,800	648.20	2,005,401,160	貸付有価証券 303,600株
4763	クリーク・アンド・リバー社	18,100	2,210.00	40,001,000	
4765	SBIグローバルアセットマネジメン ト	70,700	642.00	45,389,400	貸付有価証券 2,500株
4767	テー・オー・ダブリュー	70,700	324.00	22,906,800	
4792	山田コンサルティンググループ	15,700	1,756.00	27,569,200	
4801	セントラルスポーツ	13,600	2,480.00	33,728,000	
4848	フルキャストホールディングス	34,500	1,815.00	62,617,500	
4849	エン・ジャパン	58,800	2,670.00	156,996,000	
5261	リソルホールディングス	1,300	5,940.00	7,722,000	貸付有価証券 300株
6028	テクノプロ・ホールディングス	211,400	3,668.00	775,415,200	
6029	アトラグループ	3,600	190.00	684,000	貸付有価証券 300株
6035	アイ・アールジャパンホールディング ス	18,700	1,515.00	28,330,500	
6036	Ke e P e r 技研	22,300	6,720.00	149,856,000	
6037	ファーストロジック	3,500	556.00	1,946,000	
6044	三機サービス	2,300	1,218.00	2,801,400	
6047	G u n o s y	28,600	744.00	21,278,400	貸付有価証券 1,800株
6048	デザインワン・ジャパン	3,800	130.00	494,000	貸付有価証券 800株
6050	イー・ガーディアン	13,700	1,603.00	21,961,100	
6054	リブセンス	7,100	256.00	1,817,600	貸付有価証券 2,700株
6055	ジャパンマテリアル	110,500	2,362.00	261,001,000	
6058	ベクトル	44,300	1,095.00	48,508,500	
6059	ウチヤマホールディングス	6,600	396.00	2,613,600	貸付有価証券 2,100株
6062	チャーム・ケア・コーポレーション	30,100	1,255.00	37,775,500	貸付有価証券 3,300株
6070	キャリアリンク	13,200	2,416.00	31,891,200	
6071	I B J	27,600	685.00	18,906,000	
6073	アサンテ	17,800	1,668.00	29,690,400	
6078	バリューHR	31,500	1,491.00	46,966,500	貸付有価証券

					1,600株
6080	M&Aキャピタルパートナーズ	29,200	2,377.00	69,408,400	貸付有価証券 3,000株
6082	ライドオンエクスプレスホールディングス	14,300	1,021.00	14,600,300	貸付有価証券 900株
6083	E R Iホールディングス	3,900	1,958.00	7,636,200	貸付有価証券 1,200株
6087	アビスト	2,400	3,125.00	7,500,000	貸付有価証券 600株
6088	シグマクシス・ホールディングス	48,700	1,365.00	66,475,500	
6089	ウィルグループ	30,100	1,192.00	35,879,200	貸付有価証券 2,800株
6093	エスクロー・エージェンツ・ジャパン	17,100	143.00	2,445,300	
6095	メドピア	31,700	707.00	22,411,900	
6096	レアジョブ	2,900	870.00	2,523,000	貸付有価証券 1,000株
6098	リクルートホールディングス	2,672,700	5,818.00	15,549,768,600	
6099	エラン	47,700	1,064.00	50,752,800	貸付有価証券 1,800株
6171	土木管理総合試験所	6,700	336.00	2,251,200	
6178	日本郵政	4,242,200	1,317.50	5,589,098,500	
6183	バルシステム24ホールディングス	38,700	1,716.00	66,409,200	
6184	鎌倉新書	30,800	520.00	16,016,000	貸付有価証券 5,200株
6185	SMN	2,900	290.00	841,000	
6186	一蔵	2,000	588.00	1,176,000	
6189	グローバルキッズCOMPANY	2,500	653.00	1,632,500	
6191	エアトリ	26,400	1,725.00	45,540,000	貸付有価証券 1,900株
6194	アトラエ	21,300	700.00	14,910,000	貸付有価証券 2,200株
6196	ストライク	15,300	4,465.00	68,314,500	貸付有価証券 300株
6197	ソラスト	99,500	618.00	61,491,000	
6199	セラク	11,000	1,262.00	13,882,000	
6200	インソース	78,400	850.00	66,640,000	
6532	バイカレント・コンサルティング	265,300	4,742.00	1,258,052,600	
6533	Orchestra Holdings	7,700	1,050.00	8,085,000	
6535	アイモバイル	48,200	454.00	21,882,800	
6538	キャリアインデックス	5,200	209.00	1,086,800	
6539	MS-Japan	6,000	1,127.00	6,762,000	貸付有価証券 1,400株

6540	船場	2,700	890.00	2,403,000	貸付有価証券 700株
6544	ジャパンエレベーターサービスホール ディン	117,000	2,328.00	272,376,000	
6546	フルテック	2,100	1,172.00	2,461,200	貸付有価証券 300株
6547	グリーンズ	5,600	1,795.00	10,052,000	
6551	ツナググループ・ホールディングス	4,300	889.00	3,822,700	
6552	Game With	4,600	304.00	1,398,400	貸付有価証券 900株
6555	MS&Consulting	2,000	702.00	1,404,000	貸付有価証券 300株
6556	ウェルビー	18,100	837.00	15,149,700	
6560	エル・ティー・エス	4,200	2,855.00	11,991,000	
6564	ミダックホールディングス	21,900	2,071.00	45,354,900	貸付有価証券 1,000株
6571	キュービーネットホールディングス	17,200	1,483.00	25,507,600	
6572	RPAホールディングス	48,900	268.00	13,105,200	
7030	スプリックス	4,400	839.00	3,691,600	貸付有価証券 600株
7033	マネジメントソリューションズ	15,500	3,140.00	48,670,000	貸付有価証券 2,100株
7034	プロレド・パートナーズ	8,800	345.00	3,036,000	
7035	and factory	4,500	332.00	1,494,000	
7037	テノ.ホールディングス	2,000	504.00	1,008,000	貸付有価証券 500株
7038	フロンティア・マネジメント	9,100	1,472.00	13,395,200	貸付有価証券 1,700株
7044	ピアラ	2,700	296.00	799,200	
7059	コプロ・ホールディングス	5,100	1,600.00	8,160,000	貸付有価証券 1,400株
7060	ギークス	2,000	493.00	986,000	
7071	アンビスホールディングス	38,600	2,915.00	112,519,000	貸付有価証券 400株
7085	カーブスホールディングス	98,600	651.00	64,188,600	
7088	フォーラムエンジニアリング	49,100	849.00	41,685,900	貸付有価証券 4,400株
7092	Fast Fitness Japan	12,300	1,073.00	13,197,900	
7354	ダイレクトマーケティングミックス	37,200	442.00	16,442,400	
7358	ポピンズ	5,300	1,149.00	6,089,700	
7366	LITALICO	28,100	1,950.00	54,795,000	
7374	コンフィデンス・インターワークス	1,700	1,550.00	2,635,000	
8769	アドバンテッジリスクマネジメント	7,900	489.00	3,863,100	貸付有価証券

					2,100株
8876	リログループ	180,900	1,646.00	297,761,400	
8920	東祥	25,200	844.00	21,268,800	
9161	I D&Eホールディングス	21,800	3,445.00	75,101,000	
9216	ビーウィズ	9,200	2,115.00	19,458,000	貸付有価証券 400株
9247	T R Eホールディングス	69,100	1,184.00	81,814,400	
9248	人・夢・技術グループ	13,600	1,810.00	24,616,000	
9332	N I S S Oホールディングス	31,300	803.00	25,133,900	貸付有価証券 2,000株
9336	大栄環境	65,600	2,483.00	162,884,800	
9347	日本管財ホールディングス	37,900	2,584.00	97,933,600	
9552	M&A総研ホールディングス	17,300	4,270.00	73,871,000	貸付有価証券 200株
9603	エイチ・アイ・エス	104,900	1,843.00	193,330,700	貸付有価証券 6,600株
9612	ラックランド	16,400	2,403.00	39,409,200	貸付有価証券 800株
9616	共立メンテナンス	56,700	5,879.00	333,339,300	貸付有価証券 9,500株
9619	イチネンホールディングス	38,200	1,593.00	60,852,600	
9621	建設技術研究所	18,600	5,200.00	96,720,000	貸付有価証券 2,600株
9622	スペース	23,600	945.00	22,302,000	
9628	燦ホールディングス	33,800	1,116.00	37,720,800	
9632	スバル興業	1,100	15,000.00	16,500,000	
9633	東京テアトル	5,700	1,116.00	6,361,200	
9644	タナベコンサルティンググループ	6,300	1,012.00	6,375,600	
9663	ナガワ	11,300	7,930.00	89,609,000	貸付有価証券 1,300株
9672	東京都競馬	30,200	4,425.00	133,635,000	
9675	常磐興産	5,700	1,239.00	7,062,300	
9678	カナモト	56,000	2,930.00	164,080,000	
9699	ニシオホールディングス	33,600	4,080.00	137,088,000	貸付有価証券 5,700株
9704	アゴーラ ホスピタリティー グループ	90,100	23.00	2,072,300	貸付有価証券 27,100株
9715	トランス・コスモス	44,900	3,080.00	138,292,000	
9716	乃村工藝社	157,500	873.00	137,497,500	
9722	藤田観光	14,400	5,910.00	85,104,000	貸付有価証券 1,800株
9726	K N T - C Tホールディングス	21,500	1,321.00	28,401,500	

9729	トーカイ	31,900	2,098.00	66,926,200	
9731	白洋舎	1,500	2,345.00	3,517,500	貸付有価証券 500株
9735	セコム	367,700	10,375.00	3,814,887,500	
9740	セントラル警備保障	19,500	2,504.00	48,828,000	
9743	丹青社	70,000	885.00	61,950,000	
9744	メイテックグループホールディングス	130,000	2,849.00	370,370,000	
9755	応用地質	33,700	2,085.00	70,264,500	
9757	船井総研ホールディングス	75,100	2,538.00	190,603,800	
9760	進学会ホールディングス	4,100	246.00	1,008,600	
9765	オオバ	9,600	950.00	9,120,000	
9768	いであ	3,500	1,762.00	6,167,000	
9769	学究社	14,400	2,051.00	29,534,400	
9783	ベネッセホールディングス	121,300	2,635.00	319,625,500	
9787	イオンディライト	38,700	3,580.00	138,546,000	
9788	ナック	15,300	990.00	15,147,000	
9793	ダイセキ	73,700	3,935.00	290,009,500	貸付有価証券 200株
9795	ステップ	13,100	1,956.00	25,623,600	
合 計		542,721,300		1,192,412,168,850	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年1月5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	60,177,276,362
コール・ローン	9,403,760,794
株式	3,365,542,899,931
投資証券	70,915,946,258
派生商品評価勘定	1,327,099,929

未収入金	21,571,213
未収配当金	3,017,367,298
差入委託証拠金	137,222,154,290
流動資産合計	3,647,628,076,075
資産合計	3,647,628,076,075
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,281,291,063
未払解約金	2,600,937,167
未払利息	2,146
流動負債合計	3,882,230,376
負債合計	3,882,230,376
純資産の部	
元本等	
元本	613,889,357,394
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	3,029,856,488,305
元本等合計	3,643,745,845,699
純資産合計	3,643,745,845,699
負債純資産合計	3,647,628,076,075

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。 為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年1月5日現在]
1. 期首	2023年7月6日
期首元本額	521,049,010,350円
期中追加設定元本額	132,580,429,816円
期中一部解約元本額	39,740,082,772円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	192,461,943円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	936,148,925円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	868,047,902円
MAXIS 海外株式(MSCIコクサイ)上場投信	2,983,061,455円
MAXIS 全世界株式(オール・カントリー)上場投信	4,836,706,460円

三菱UFJ プライムバランス (安定型) (確定拠出年金)	1,465,165,186 円
三菱UFJ プライムバランス (安定成長型) (確定拠出年金)	8,936,573,199 円
三菱UFJ プライムバランス (成長型) (確定拠出年金)	10,263,145,368 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	46,173,647 円
三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)	121,701,787 円
ファンド・マネジャー (海外株式)	778,535 円
eMAXIS 先進国株式インデックス	13,827,443,505 円
eMAXIS バランス (8資産均等型)	1,013,783,552 円
eMAXIS バランス (波乗り型)	189,618,526 円
三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	1,734,757,577 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	216,609,650 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	283,141,732 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	256,003,113 円
eMAXIS Slim 先進国株式インデックス	98,158,319,152 円
海外株式セレクション (ラップ向け)	2,629,117,013 円
eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)	4,981,810,645 円
つみたて先進国株式	30,196,003,980 円
つみたて8資産均等バランス	2,431,794,575 円
つみたて4資産均等バランス	864,852,589 円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	2,022,224 円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,559,470 円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	5,710,362 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	178,590,478 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	225,319,773 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	157,231,071 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式15)	68,354,369 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式40)	514,935,944 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式65)	1,378,521,741 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (除く日本)	53,865,480,660 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (3地域均等型)	555,643,704 円
三菱UFJ DC年金インデックス (先進国株式)	4,379,207,841 円
eMAXIS Slim 全世界株式 (オール・カントリー)	260,231,738,589 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	145,172,277 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式25)	45,364,819 円
つみたて全世界株式	614,756,306 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	65,823,380 円
ラップ向けインデックスf 先進国株式	2,628,737,924 円
三菱UFJ DC年金バランス (株式80)	45,423,032 円
ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)	3,212,468,918 円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	64,984,696 円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	410,717 円
三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド	32,438,005,925 円
eMAXIS 全世界株式インデックス	5,452,175,115 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式抑制型)	597,171,787 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (株式重視型)	1,234,023,333 円
三菱UFJ バランス・イノベーション (新興国投資型)	187,225,286 円

三菱UFJ DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)	727,020,996円
三菱UFJ バランス・イノベーション (債券重視型)	170,348,026円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	344,559,647円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	81,748,344円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	113,393,109円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	474,187,389円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	380,702,700円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	740,234,225円
三菱UFJ 外国株式ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,275,648,933円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定)	151円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	4,792,906円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,292,967,233円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	36,344,848円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	652,183,799円
MUAM 外国株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)	8,720,252,380円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	65,848円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	525,943,899円
MUAM 全世界株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)	4,901,614,312円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	9,840,322円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	62,127,885円
MUKAM バランス・イノベーション (株式抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	1,863,070,952円
MUKAM バランス・イノベーション (リスク抑制型) (適格機関投資家転売制限付)	560,001,558円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	176,899,287円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	52,233,997円
MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド (適格機関投資家限定)	1,765,377,303円
MUKAM バランス・イノベーション (債券重視型) (適格機関投資家転売制限付)	88,203,913円
MUKAM 外国株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	2,294,745,373円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	115,839,520円
MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド (適格機関投資家限定)	8,835,067,515円
MUKAM バランス・イノベーション (リスク抑制型) 2 (適格機関投資家転売制限付)	50,066,781円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	225,828円
外国株式インデックスファンドV (適格機関投資家限定)	2,866,967,527円
海外株式インデックスファンドS	5,790,330,687円
外国株式インデックスオープンV (適格機関投資家限定)	84,622,185円
全世界株式インデックスファンドV (適格機関投資家限定)	43,970,794円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンド	2,860,331,846円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	697,601円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	1,751,463円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	427,882円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	1,885,124円
三菱UFJ 外国株式インデックスファンドVA	21,245,596円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	776,608円

三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	6,305,370円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	740,929円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	7,284,468円
三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド	6,920,535,275円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	84,189,478円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	359,505,374円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	389,946,786円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)	400,853,665円
合計	613,889,357,394円
2. 受益権の総数	613,889,357,394円

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023 年 7 月 6 日 至 2024 年 1 月 5 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用してしております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ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または計算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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024 年 1 月 5 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項につ	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024年1月5日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	298,520,972,052	
投資証券	4,058,946,100	
合計	302,579,918,152	

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

[2024年1月5日現在]

区分	種類	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	289,237,012,832	—	289,208,201,764	△28,811,068
合計		289,237,012,832	—	289,208,201,764	△28,811,068

(注) 時価の算定方法

1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

通貨関連

[2024年1月5日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	68,668,359,428	—	68,721,952,254	53,592,826
	カナダドル	3,028,644,577	—	3,030,223,774	1,579,197
	オーストラリアドル	1,988,704,281	—	1,989,297,677	593,396
	イギリスポンド	3,933,655,668	—	3,937,398,437	3,742,769
	スイスフラン	2,683,223,521	—	2,685,331,665	2,108,144
	香港ドル	530,070,707	—	530,779,577	708,870
シンガポールドル	337,678,943	—	338,071,695	392,752	

ニュージーランドドル	58,301,550	58,296,583	△4,967
スウェーデンクローネ	801,036,622	802,127,623	1,091,001
ノルウェークローネ	177,549,664	177,765,272	215,608
デンマーククローネ	913,427,370	914,482,153	1,054,783
イスラエルシェケル	107,018,527	106,966,629	△51,898
ユーロ	8,772,335,777	8,781,933,230	9,597,453
合計	92,000,006,635	92,074,626,569	74,619,934

(注) 時価の算定方法

1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

②当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

(イ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、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対顧客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。

(ロ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024年1月5日現在]
1口当たり純資産額	5.9355円
(1万口当たり純資産額)	(59,355円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	APA CORP	129,903	34.05	4,423,197.15	
	BAKER HUGHES CO	437,848	33.25	14,558,446.00	
	CHENIERE ENERGY INC	103,979	168.86	17,557,893.94	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	44,592	76.96	3,431,800.32	
	CHEVRON CORP	774,876	150.66	116,742,818.16	
	CONOCOPHILLIPS	512,641	116.48	59,712,423.68	

COTERRA ENERGY INC	322,936	25.39	8,199,345.04
DEVON ENERGY CORP	272,351	45.63	12,427,376.13
DIAMONDBACK ENERGY INC	69,696	155.82	10,860,030.72
EOG RESOURCES INC	250,502	121.02	30,315,752.04
EQT CORP	170,428	38.20	6,510,349.60
EXXON MOBIL CORP	1,709,675	102.32	174,933,946.00
HALLIBURTON CO	380,204	35.78	13,603,699.12
HESS CORP	120,001	145.75	17,490,145.75
HF SINCLAIR CORP	59,686	54.40	3,246,918.40
KINDER MORGAN INC	851,526	17.95	15,284,891.70
MARATHON OIL CORP	273,045	24.18	6,602,228.10
MARATHON PETROLEUM CORP	172,619	153.40	26,479,754.60
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	280,263	59.12	16,569,148.56
ONEOK INC	245,260	70.87	17,381,576.20
OVINTIV INC	113,361	43.16	4,892,660.76
PHILLIPS 66	187,417	135.28	25,353,771.76
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	98,078	229.62	22,520,670.36
SCHLUMBERGER LTD	595,649	51.69	30,789,096.81
TARGA RESOURCES CORP	94,068	86.25	8,113,365.00
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2,458	1,550.50	3,811,129.00
VALERO ENERGY CORP	147,973	130.31	19,282,361.63
WILLIAMS COS INC	512,425	35.82	18,355,063.50
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	93,071	270.25	25,152,437.75
ALBEMARLE CORP	48,547	135.93	6,598,993.71
AMCOR PLC	582,763	9.64	5,617,835.32
AVERY DENNISON CORP	35,066	195.68	6,861,714.88
BALL CORP	131,267	56.65	7,436,275.55
CELANESE CORP	46,361	149.75	6,942,559.75
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	85,246	81.14	6,916,860.44
CLEVELAND-CLIFFS INC	204,021	19.10	3,896,801.10
CORTEVA INC	309,081	47.60	14,712,255.60
CROWN HOLDINGS INC	50,366	90.34	4,550,064.44
DOW INC	304,036	54.19	16,475,710.84
DUPONT DE NEMOURS INC	197,782	76.56	15,142,189.92
EASTMAN CHEMICAL CO	46,681	88.31	4,122,399.11
ECOLAB INC	110,213	195.49	21,545,539.37

FMC CORP	49,253	60.27	2,968,478.31
FREEMPORT-MCMORAN INC	621,759	41.55	25,834,086.45
INTERNATIONAL PAPER CO	128,893	36.47	4,700,727.71
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	109,273	79.55	8,692,667.15
LINDE PLC	207,982	408.59	84,979,365.38
LYONDELLBASELL INDU-CL A	111,623	96.09	10,725,854.07
MARTIN MARIETTA MATERIALS	25,903	486.07	12,590,671.21
MOSAIC CO/THE	145,017	35.72	5,180,007.24
NEWMONT CORP	481,646	40.12	19,323,637.52
NUCOR CORP	105,886	172.07	18,219,804.02
PACKAGING CORP OF AMERICA	39,261	165.67	6,504,369.87
PPG INDUSTRIES INC	97,684	144.91	14,155,388.44
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	26,220	275.61	7,226,494.20
RPM INTERNATIONAL INC	57,533	103.91	5,978,254.03
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	104,875	295.77	31,018,878.75
STEEL DYNAMICS INC	66,871	116.46	7,787,796.66
VULCAN MATERIALS CO	55,514	220.68	12,250,829.52
WESTLAKE CORP	17,817	136.79	2,437,187.43
WESTROCK CO	100,519	42.16	4,237,881.04
3M CO	232,157	108.17	25,112,422.69
AECOM	58,145	88.79	5,162,694.55
AERCAP HOLDINGS NV	88,868	72.46	6,439,375.28
ALLEGION PLC	36,193	122.27	4,425,318.11
AMETEK INC	97,581	160.48	15,659,798.88
AXON ENTERPRISE INC	31,200	244.93	7,641,816.00
BOEING CO/THE	245,314	244.94	60,087,211.16
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	51,717	157.29	8,134,566.93
CARLISLE COS INC	21,691	301.66	6,543,307.06
CARRIER GLOBAL CORP	360,602	55.48	20,006,198.96
CATERPILLAR INC	218,190	286.10	62,424,159.00
CNH INDUSTRIAL NV	438,944	11.90	5,223,433.60
CUMMINS INC	60,036	235.88	14,161,291.68
DEERE & CO	116,315	392.39	45,640,842.85
DOVER CORP	57,480	148.10	8,512,788.00
EATON CORP PLC	171,132	234.48	40,127,031.36
EMERSON ELECTRIC CO	238,677	95.10	22,698,182.70

FASTENAL CO	241,457	62.19	15,016,210.83
FERGUSON PLC	86,294	186.47	16,091,242.18
FORTIVE CORP	150,774	71.52	10,783,356.48
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	59,589	74.02	4,410,777.78
GENERAL DYNAMICS CORP	99,736	256.18	25,550,368.48
GENERAL ELECTRIC CO	465,453	124.66	58,023,370.98
GRACO INC	73,387	83.37	6,118,274.19
HEICO CORP	18,379	173.96	3,197,210.84
HEICO CORP-CLASS A	34,856	138.41	4,824,418.96
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	283,748	204.90	58,139,965.20
HOWMET AEROSPACE INC	160,482	52.60	8,441,353.20
HUBBELL INC	22,290	319.94	7,131,462.60
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	15,641	256.32	4,009,101.12
IDEX CORP	34,302	211.18	7,243,896.36
ILLINOIS TOOL WORKS	126,933	259.38	32,923,881.54
INGERSOLL-RAND INC	170,719	74.94	12,793,681.86
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	62,100	40.49	2,514,429.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	288,556	56.72	16,366,896.32
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	80,321	207.53	16,669,017.13
LENNOX INTERNATIONAL INC	13,139	430.61	5,657,784.79
LOCKHEED MARTIN CORP	94,938	457.87	43,469,262.06
MASCO CORP	97,005	64.23	6,230,631.15
NORDSON CORP	23,401	251.15	5,877,161.15
NORTHROP GRUMMAN CORP	60,382	471.73	28,484,000.86
OTIS WORLDWIDE CORP	174,349	87.68	15,286,920.32
OWENS CORNING	40,184	145.24	5,836,324.16
PACCAR INC	220,468	93.78	20,675,489.04
PARKER HANNIFIN CORP	54,069	452.06	24,442,432.14
PENTAIR PLC	73,174	68.93	5,043,883.82
QUANTA SERVICES INC	63,222	200.07	12,648,825.54
ROCKWELL AUTOMATION INC	48,586	304.67	14,802,696.62
RTX CORP	625,752	85.41	53,445,478.32
SMITH (A. O.) CORP	48,340	79.38	3,837,229.20
SNAP-ON INC	23,090	282.07	6,512,996.30
STANLEY BLACK & DECKER INC	60,855	94.32	5,739,843.60
TEXTRON INC	87,158	78.65	6,854,976.70

TORO CO	40,158	91.35	3,668,433.30
TRANE TECHNOLOGIES PLC	95,589	239.69	22,911,727.41
TRANSDIGM GROUP INC	23,808	975.53	23,225,418.24
UNITED RENTALS INC	29,588	548.86	16,239,669.68
VERTIV HOLDINGS CO-A	150,485	45.80	6,892,213.00
WABTEC CORP	76,768	123.99	9,518,464.32
WATSCO INC	15,087	412.70	6,226,404.90
WW GRAINGER INC	19,439	815.98	15,861,835.22
XYLEM INC	104,849	112.33	11,777,688.17
AUTOMATIC DATA PROCESSING	176,502	233.66	41,241,457.32
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	56,266	125.38	7,054,631.08
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	50,320	197.09	9,917,568.80
CERIDIAN HCM HOLDING INC	63,385	63.78	4,042,695.30
CINTAS CORP	39,396	582.38	22,943,442.48
COPART INC	364,325	46.64	16,992,118.00
EQUIFAX INC	51,586	234.09	12,075,766.74
JACOBS SOLUTIONS INC	51,774	126.43	6,545,786.82
LEIDOS HOLDINGS INC	57,281	107.82	6,176,037.42
PAYCHEX INC	136,188	117.85	16,049,755.80
PAYCOM SOFTWARE INC	22,892	196.50	4,498,278.00
PAYLOCITY HOLDING CORP	19,837	160.13	3,176,498.81
REPUBLIC SERVICES INC	95,896	164.16	15,742,287.36
ROBERT HALF INC	46,823	83.10	3,890,991.30
ROLLINS INC	124,555	42.79	5,329,708.45
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	91,481	59.37	5,431,226.97
TRANSUNION	77,035	63.51	4,892,492.85
VERALTO CORP	104,122	76.61	7,976,786.42
VERISK ANALYTICS INC	62,870	237.95	14,959,916.50
WASTE CONNECTIONS INC	108,579	147.48	16,013,230.92
WASTE MANAGEMENT INC	173,973	178.79	31,104,632.67
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	45,375	88.21	4,002,528.75
CSX CORP	859,495	34.72	29,841,666.40
DELTA AIR LINES INC	63,959	39.20	2,507,192.80
EXPEDITORS INTL WASH INC	63,824	127.25	8,121,604.00
FEDEX CORP	100,090	245.29	24,551,076.10
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	833,326	3.25	2,708,309.50

HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	34,927	189.04	6,602,600.08
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	70,638	55.52	3,921,821.76
NORFOLK SOUTHERN CORP	97,880	231.02	22,612,237.60
OLD DOMINION FREIGHT LINE	42,397	389.26	16,503,456.22
SOUTHWEST AIRLINES CO	70,510	27.93	1,969,344.30
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	36,932	64.55	2,383,960.60
UBER TECHNOLOGIES INC	787,002	57.80	45,488,715.60
UNION PACIFIC CORP	260,242	241.06	62,733,936.52
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	309,805	156.99	48,636,286.95
APTIV PLC	118,613	83.59	9,914,860.67
BORGWARNER INC	91,258	34.31	3,131,061.98
FORD MOTOR CO	1,697,671	11.68	19,828,797.28
GENERAL MOTORS CO	575,434	35.49	20,422,152.66
LEAR CORP	23,906	134.15	3,206,989.90
LUCID GROUP INC	324,874	3.89	1,263,759.86
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	276,586	19.50	5,393,427.00
TESLA INC	1,219,019	237.93	290,041,190.67
DECKERS OUTDOOR CORP	11,616	672.22	7,808,507.52
DR HORTON INC	127,212	147.69	18,787,940.28
GARMIN LTD	65,772	123.81	8,143,231.32
HASBRO INC	51,810	48.36	2,505,531.60
LENNAR CORP-A	108,891	145.07	15,796,817.37
LULULEMON ATHLETICA INC	49,590	496.00	24,596,640.00
NIKE INC -CL B	524,242	102.30	53,629,956.60
NVR INC	1,373	6,912.71	9,491,150.83
PULTEGROUP INC	92,320	100.31	9,260,619.20
VF CORP	121,637	16.94	2,060,530.78
AIRBNB INC-CLASS A	182,985	133.72	24,468,754.20
BOOKING HOLDINGS INC	15,445	3,419.94	52,820,973.30
CAESARS ENTERTAINMENT INC	96,290	44.91	4,324,383.90
CARNIVAL CORP	410,554	16.85	6,917,834.90
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	11,821	2,220.47	26,248,175.87
DARDEN RESTAURANTS INC	49,854	161.00	8,026,494.00
DOMINO'S PIZZA INC	13,758	401.27	5,520,672.66
DOORDASH INC - A	111,603	93.90	10,479,521.70
DRAFTKINGS INC-CL A	180,722	32.88	5,942,139.36

EXPEDIA GROUP INC	57,523	144.82	8,330,480.86
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	111,532	178.75	19,936,345.00
HYATT HOTELS CORP - CL A	24,388	126.53	3,085,813.64
LAS VEGAS SANDS CORP	139,342	50.25	7,001,935.50
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	108,859	220.02	23,951,157.18
MCDONALD'S CORP	310,671	291.74	90,635,157.54
MGM RESORTS INTERNATIONAL	118,154	44.35	5,240,129.90
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	105,371	119.00	12,539,149.00
STARBUCKS CORP	489,282	93.55	45,772,331.10
VAIL RESORTS INC	15,472	209.78	3,245,716.16
WYNN RESORTS LTD	45,962	94.21	4,330,080.02
YUM! BRANDS INC	117,881	128.69	15,170,105.89
ALPHABET INC-CL A	3,162,102	136.39	431,279,091.78
ALPHABET INC-CL C	1,599,297	138.04	220,766,957.88
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	41,130	375.75	15,454,597.50
COMCAST CORP-CLASS A	1,758,750	42.63	74,975,512.50
ELECTRONIC ARTS INC	110,929	135.97	15,083,016.13
FOX CORP - CLASS A	120,205	30.06	3,613,362.30
FOX CORP - CLASS B	50,847	27.99	1,423,207.53
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	162,362	32.19	5,226,432.78
LIBERTY BROADBAND-C	48,406	77.36	3,744,688.16
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	81,790	61.90	5,062,801.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	66,027	29.91	1,974,867.57
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	70,934	89.04	6,315,963.36
MATCH GROUP INC	107,263	36.36	3,900,618.99
META PLATFORMS INC-CLASS A	948,299	347.12	329,173,548.88
NETFLIX INC	189,241	474.67	89,827,025.47
NEWS CORP - CLASS A	155,926	24.24	3,779,646.24
OMNICOM GROUP	85,179	85.09	7,247,881.11
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	226,588	14.49	3,283,260.12
PINTEREST INC- CLASS A	245,160	35.78	8,771,824.80
ROBLOX CORP -CLASS A	182,046	42.66	7,766,082.36
ROKU INC	48,057	87.91	4,224,690.87
SEA LTD-ADR	157,094	37.82	5,941,295.08
SIRIUS XM HOLDINGS INC	334,269	5.43	1,815,080.67
SNAP INC - A	457,200	16.20	7,406,640.00

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	73,815	158.86	11,726,250.90
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	187,631	68.40	12,833,960.40
WALT DISNEY CO/THE	782,112	90.56	70,828,062.72
WARNER BROS DISCOVERY INC	1,015,736	11.35	11,528,603.60
AMAZON.COM INC	3,960,792	144.57	572,611,699.44
AUTOZONE INC	7,643	2,557.41	19,546,284.63
BATH & BODY WORKS INC	83,543	43.44	3,629,107.92
BEST BUY CO INC	85,732	75.30	6,455,619.60
BURLINGTON STORES INC	24,572	188.15	4,623,221.80
CARMAX INC	67,362	71.83	4,838,612.46
DICK'S SPORTING GOODS INC	25,400	138.52	3,518,408.00
EBAY INC	222,003	42.53	9,441,787.59
ETSY INC	47,624	76.29	3,633,234.96
GENUINE PARTS CO	60,439	136.16	8,229,374.24
GLOBAL-E ONLINE LTD	34,400	37.05	1,274,520.00
HOME DEPOT INC	427,629	338.59	144,790,903.11
LKQ CORP	112,105	46.55	5,218,487.75
LOWE'S COS INC	244,871	211.22	51,721,652.62
MERCADOLIBRE INC	18,992	1,519.38	28,856,064.96
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	25,985	935.80	24,316,763.00
POOL CORP	16,466	372.87	6,139,677.42
ROSS STORES INC	143,792	135.27	19,450,743.84
TJX COMPANIES INC	490,480	92.78	45,506,734.40
TRACTOR SUPPLY COMPANY	48,484	215.04	10,425,999.36
ULTA BEAUTY INC	21,546	468.92	10,103,350.32
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	129,336	22.54	2,915,233.44
COSTCO WHOLESALE CORP	188,957	648.35	122,510,270.95
DOLLAR GENERAL CORP	92,571	134.76	12,474,867.96
DOLLAR TREE INC	85,729	136.18	11,674,575.22
KROGER CO	296,985	45.90	13,631,611.50
SYSCO CORP	214,157	75.12	16,087,473.84
TARGET CORP	193,994	140.25	27,207,658.50
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	302,157	24.26	7,330,328.82
WALMART INC	631,923	157.76	99,692,172.48
ALTRIA GROUP INC	757,910	41.52	31,468,423.20
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	228,935	71.75	16,426,086.25

BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	134,070	55.84	7,486,468.80
BUNGE GLOBAL SA	62,756	98.95	6,209,706.20
CAMPBELL SOUP CO	79,341	43.47	3,448,953.27
CELSIUS HOLDINGS INC	66,588	56.55	3,765,551.40
COCA-COLA CO/THE	1,751,098	59.76	104,645,616.48
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	85,359	65.45	5,586,746.55
CONAGRA BRANDS INC	200,246	28.72	5,751,065.12
CONSTELLATION BRANDS INC-A	69,309	242.33	16,795,649.97
DARLING INGREDIENTS INC	61,326	48.50	2,974,311.00
GENERAL MILLS INC	246,665	65.74	16,215,757.10
HERSHEY CO/THE	65,401	190.50	12,458,890.50
HORMEL FOODS CORP	119,470	32.32	3,861,270.40
JM SMUCKER CO/THE	47,902	128.64	6,162,113.28
KELLANOVA	114,197	56.84	6,490,957.48
KEURIG DR PEPPER INC	453,632	32.37	14,684,067.84
KRAFT HEINZ CO/THE	371,775	37.78	14,045,659.50
LAMB WESTON HOLDINGS INC	57,997	105.26	6,104,764.22
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	105,426	68.05	7,174,239.30
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	81,614	61.31	5,003,754.34
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	580,947	73.28	42,571,796.16
MONSTER BEVERAGE CORP	330,390	57.71	19,066,806.90
PEPSICO INC	586,232	171.47	100,521,201.04
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	661,945	95.66	63,321,658.70
TYSON FOODS INC-CL A	122,328	54.16	6,625,284.48
CHURCH & DWIGHT CO INC	101,442	94.52	9,588,297.84
CLOROX COMPANY	53,540	142.45	7,626,773.00
COLGATE-PALMOLIVE CO	337,690	80.34	27,130,014.60
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	102,410	138.72	14,206,315.20
KENVUE INC	753,128	20.90	15,740,375.20
KIMBERLY-CLARK CORP	141,348	122.53	17,319,370.44
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,004,805	148.65	149,364,263.25
ABBOTT LABORATORIES	741,682	110.98	82,311,868.36
ALIGN TECHNOLOGY INC	31,117	261.36	8,132,739.12
BAXTER INTERNATIONAL INC	219,606	38.63	8,483,379.78
BECTON DICKINSON AND CO	124,420	242.91	30,222,862.20
BOSTON SCIENTIFIC CORP	627,412	58.17	36,496,556.04

CARDINAL HEALTH INC	103,411	105.56	10,916,065.16
CENCORA INC	71,716	210.67	15,108,409.72
CENTENE CORP	232,843	77.21	17,977,808.03
COOPER COS INC/THE	20,491	365.98	7,499,296.18
CVS HEALTH CORP	550,172	80.51	44,294,347.72
DAVITA INC	22,235	106.18	2,360,912.30
DEXCOM INC	164,538	121.83	20,045,664.54
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	264,369	73.52	19,436,408.88
ELEVANCE HEALTH INC	100,756	484.84	48,850,539.04
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	177,212	76.57	13,569,122.84
HCA HEALTHCARE INC	87,436	273.10	23,878,771.60
HENRY SCHEIN INC	55,674	74.80	4,164,415.20
HOLOGIC INC	108,472	72.87	7,904,354.64
HUMANA INC	52,419	466.54	24,455,560.26
IDEXX LABORATORIES INC	35,095	538.50	18,898,657.50
INSULET CORP	27,547	199.81	5,504,166.07
INTUITIVE SURGICAL INC	150,465	323.27	48,640,820.55
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	38,741	225.22	8,725,248.02
MCKESSON CORP	57,806	474.55	27,431,837.30
MEDTRONIC PLC	569,590	83.93	47,805,688.70
MOLINA HEALTHCARE INC	25,469	378.74	9,646,129.06
QUEST DIAGNOSTICS INC	46,957	140.56	6,600,275.92
RESMED INC	60,756	167.58	10,181,490.48
STERIS PLC	42,132	216.00	9,100,512.00
STRYKER CORP	146,192	298.05	43,572,525.60
TELEFLEX INC	21,664	241.06	5,222,323.84
THE CIGNA GROUP	126,648	306.22	38,782,150.56
UNITEDHEALTH GROUP INC	395,096	545.42	215,493,260.32
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	24,352	152.18	3,705,887.36
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	66,068	186.11	12,295,915.48
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	87,861	120.20	10,560,892.20
ABBVIE INC	753,713	161.46	121,694,500.98
AGILENT TECHNOLOGIES INC	123,646	131.00	16,197,626.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	52,167	192.31	10,032,235.77
AMGEN INC	228,652	303.17	69,320,426.84
AVANTOR INC	283,614	21.88	6,205,474.32

BIO-RAD LABORATORIES-A	9,607	316.48	3,040,423.36
BIO-TECHNE CORP	73,060	72.42	5,291,005.20
BIOGEN INC	61,337	260.28	15,964,794.36
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	76,181	97.73	7,445,169.13
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	897,166	52.04	46,688,518.64
CATALENT INC	70,521	43.45	3,064,137.45
CHARLES RIVER LABORATORIES	20,426	223.35	4,562,147.10
DANAHER CORP	300,095	232.62	69,808,098.90
ELI LILLY & CO	344,420	614.50	211,646,090.00
EXACT SCIENCES CORP	73,011	71.23	5,200,573.53
GILEAD SCIENCES INC	533,101	84.48	45,036,372.48
ILLUMINA INC	64,334	131.43	8,455,417.62
INCYTE CORP	74,888	66.59	4,986,791.92
IQVIA HOLDINGS INC	78,468	220.08	17,269,237.44
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	24,964	124.35	3,104,273.40
JOHNSON & JOHNSON	1,027,864	160.63	165,105,794.32
MERCK & CO. INC.	1,083,709	117.01	126,804,790.09
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	9,017	1,149.32	10,363,418.44
MODERNA INC	141,774	108.66	15,405,162.84
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	37,628	133.58	5,026,348.24
PFIZER INC	2,418,565	29.09	70,356,055.85
REGENERON PHARMACEUTICALS	45,114	912.17	41,151,637.38
REPLIGEN CORP	20,929	171.57	3,590,788.53
REVVITY INC	53,131	107.72	5,723,271.32
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	163,958	27.80	4,558,032.40
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	437,021	10.88	4,754,788.48
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	165,142	537.36	88,740,705.12
UNITED THERAPEUTICS CORP	20,488	230.11	4,714,493.68
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	110,624	416.15	46,036,177.60
VIATRIS INC	485,676	11.55	5,609,557.80
WATERS CORP	24,237	307.37	7,449,726.69
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	30,191	340.32	10,274,601.12
ZOETIS INC	197,467	194.04	38,316,496.68
BANK OF AMERICA CORP	3,054,263	33.80	103,234,089.40
CITIGROUP INC	813,416	53.77	43,737,378.32
CITIZENS FINANCIAL GROUP	215,044	32.32	6,950,222.08

FIFTH THIRD BANCORP	295,069	34.42	10,156,274.98
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	4,692	1,388.35	6,514,138.20
HUNTINGTON BANCSHARES INC	629,375	12.73	8,011,943.75
JPMORGAN CHASE & CO	1,238,730	171.41	212,330,709.30
KEYCORP	425,764	14.33	6,101,198.12
M & T BANK CORP	69,833	136.29	9,517,539.57
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	171,998	152.53	26,234,854.94
REGIONS FINANCIAL CORP	383,556	18.97	7,276,057.32
TRUIST FINANCIAL CORP	562,019	36.97	20,777,842.43
US BANCORP	660,371	43.21	28,534,630.91
WELLS FARGO & CO	1,561,181	49.28	76,934,999.68
ALLY FINANCIAL INC	112,650	34.27	3,860,515.50
AMERICAN EXPRESS CO	263,541	187.14	49,319,062.74
AMERIPRISE FINANCIAL INC	42,207	379.04	15,998,141.28
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	221,134	18.69	4,132,994.46
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	172,265	94.80	16,330,722.00
ARES MANAGEMENT CORP - A	68,942	116.48	8,030,364.16
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	329,110	52.01	17,117,011.10
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	557,283	363.68	202,672,681.44
BLACKROCK INC	63,828	785.95	50,165,616.60
BLACKSTONE INC	304,415	122.90	37,412,603.50
BLOCK INC	239,595	68.15	16,328,399.25
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	159,120	129.77	20,649,002.40
CARLYLE GROUP INC/THE	100,944	38.94	3,930,759.36
CBOE GLOBAL MARKETS INC	43,452	173.55	7,541,094.60
CME GROUP INC	154,064	202.74	31,234,935.36
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	72,310	155.60	11,251,436.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	109,691	110.33	12,102,208.03
EQUITABLE HOLDINGS INC	161,103	32.57	5,247,124.71
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	16,770	458.16	7,683,343.20
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	251,411	60.57	15,227,964.27
FISERV INC	258,284	133.00	34,351,772.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	28,726	280.88	8,068,558.88
FRANKLIN RESOURCES INC	117,877	28.47	3,355,958.19
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	20,000	52.37	1,047,400.00
GLOBAL PAYMENTS INC	110,499	125.83	13,904,089.17

GOLDMAN SACHS GROUP INC	140,900	382.95	53,957,655.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	239,108	125.62	30,036,746.96
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	32,205	166.67	5,367,607.35
KKR & CO INC	255,830	79.96	20,456,166.80
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	32,152	232.68	7,481,127.36
MARKETAXESS HOLDINGS INC	14,393	275.39	3,963,688.27
MASTERCARD INC - A	358,808	419.77	150,616,834.16
MOODY'S CORP	70,874	374.49	26,541,604.26
MORGAN STANLEY	532,336	92.15	49,054,762.40
MSCI INC	32,950	559.72	18,442,774.00
NASDAQ INC	139,552	56.03	7,819,098.56
NORTHERN TRUST CORP	91,424	82.36	7,529,680.64
PAYPAL HOLDINGS INC	444,604	58.45	25,987,103.80
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	82,716	110.17	9,112,821.72
ROBINHOOD MARKETS INC - A	164,032	11.98	1,965,103.36
S&P GLOBAL INC	139,463	429.67	59,923,067.21
SCHWAB (CHARLES) CORP	645,158	66.89	43,154,618.62
SEI INVESTMENTS COMPANY	49,468	62.78	3,105,601.04
STATE STREET CORP	141,914	77.38	10,981,305.32
SYNCHRONY FINANCIAL	169,784	37.44	6,356,712.96
T ROWE PRICE GROUP INC	94,838	106.06	10,058,518.28
TOAST INC-CLASS A	133,334	17.52	2,336,011.68
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	44,347	95.10	4,217,399.70
VISA INC-CLASS A SHARES	685,153	259.61	177,872,570.33
AFLAC INC	240,259	82.30	19,773,315.70
ALLSTATE CORP	113,476	148.50	16,851,186.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	28,005	120.55	3,376,002.75
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	306,244	68.63	21,017,525.72
AON PLC-CLASS A	85,162	290.74	24,759,999.88
ARCH CAPITAL GROUP LTD	162,463	77.47	12,586,008.61
ARTHUR J GALLAGHER & CO	92,550	225.90	20,907,045.00
ASSURANT INC	21,769	169.08	3,680,702.52
BROWN & BROWN INC	99,807	70.48	7,034,397.36
CHUBB LTD	172,961	227.30	39,314,035.30
CINCINNATI FINANCIAL CORP	69,403	106.60	7,398,359.80
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	9,638	334.01	3,219,188.38

EVEREST GROUP LTD	17,990	367.69	6,614,743.10
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	100,838	48.05	4,845,265.90
GLOBE LIFE INC	42,612	122.22	5,208,038.64
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	130,847	82.00	10,729,454.00
LOEWS CORP	77,085	70.70	5,449,909.50
MARKEL GROUP INC	5,490	1,435.13	7,878,863.70
MARSH & MCLENNAN COS	210,729	191.49	40,352,496.21
METLIFE INC	274,896	67.49	18,552,731.04
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	100,359	79.39	7,967,501.01
PROGRESSIVE CORP	250,932	163.00	40,901,916.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	155,243	102.88	15,971,399.84
TRAVELERS COS INC/THE	97,355	192.54	18,744,731.70
WILLIS TOWERS WATSON PLC	42,969	239.49	10,290,645.81
WR BERKLEY CORP	90,046	73.17	6,588,665.82
ACCENTURE PLC-CL A	267,849	337.09	90,289,219.41
ADOBE INC	194,382	567.05	110,224,313.10
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	67,049	114.63	7,685,826.87
ANSYS INC	38,016	344.16	13,083,586.56
ASPEN TECHNOLOGY INC	10,737	208.38	2,237,376.06
ATLASSIAN CORP-CL A	64,104	222.82	14,283,653.28
AUTODESK INC	92,129	228.92	21,090,170.68
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	87,832	46.95	4,123,712.40
BILL HOLDINGS INC	41,762	74.08	3,093,728.96
CADENCE DESIGN SYS INC	114,354	255.92	29,265,475.68
CHECK POINT SOFTWARE TECH	37,125	152.14	5,648,197.50
CLOUDFLARE INC - CLASS A	113,575	76.83	8,725,967.25
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	213,799	73.59	15,733,468.41
CONFLUENT INC-CLASS A	64,138	21.71	1,392,435.98
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	94,693	245.65	23,261,335.45
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	18,427	211.68	3,900,627.36
DATADOG INC - CLASS A	110,874	113.02	12,530,979.48
DOCUSIGN INC	79,128	54.97	4,349,666.16
DROPBOX INC-CLASS A	105,126	28.60	3,006,603.60
DYNATRACE INC	97,064	51.66	5,014,326.24
EPAM SYSTEMS INC	25,272	290.23	7,334,692.56
FAIR ISAAC CORP	10,585	1,117.46	11,828,314.10

FORTINET INC	276,678	58.39	16,155,228.42
GARTNER INC	34,099	426.54	14,544,587.46
GEN DIGITAL INC	243,028	22.33	5,426,815.24
GODADDY INC - CLASS A	58,848	100.94	5,940,117.12
HUBSPOT INC	20,889	530.25	11,076,392.25
INTL BUSINESS MACHINES CORP	388,793	160.86	62,541,241.98
INTUIT INC	119,811	586.82	70,307,491.02
MANHATTAN ASSOCIATES INC	27,717	200.57	5,559,198.69
MICROSOFT CORP	3,010,119	367.94	1,107,543,184.86
MONDAY.COM LTD	10,500	172.10	1,807,050.00
MONGODB INC	30,242	362.41	10,960,003.22
OKTA INC	67,338	83.37	5,613,969.06
ORACLE CORP	701,937	102.59	72,011,716.83
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	797,763	16.25	12,963,648.75
PALO ALTO NETWORKS INC	132,335	283.30	37,490,505.50
PTC INC	51,963	167.72	8,715,234.36
ROPER TECHNOLOGIES INC	45,714	524.17	23,961,907.38
SALESFORCE INC	415,796	251.24	104,464,587.04
SERVICENOW INC	87,439	671.87	58,747,640.93
SNOWFLAKE INC-CLASS A	121,292	183.72	22,283,766.24
SPLUNK INC	69,583	152.16	10,587,749.28
SYNOPSYS INC	65,154	490.18	31,937,187.72
TWILIO INC - A	67,301	68.49	4,609,445.49
TYLER TECHNOLOGIES INC	18,292	401.39	7,342,225.88
UIPATH INC - CLASS A	163,403	22.57	3,688,005.71
UNITY SOFTWARE INC	98,085	37.05	3,634,049.25
VERISIGN INC	38,564	198.48	7,654,182.72
WIX.COM LTD	21,919	116.90	2,562,331.10
WORKDAY INC-CLASS A	89,326	267.08	23,857,188.08
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	102,103	66.90	6,830,690.70
ZSCALER INC	36,376	210.33	7,650,964.08
AMPHENOL CORP-CL A	255,814	94.63	24,207,678.82
APPLE INC	6,666,960	181.91	1,212,786,693.60
ARISTA NETWORKS INC	110,193	230.56	25,406,098.08
CDW CORP/DE	57,574	215.08	12,383,015.92
CISCO SYSTEMS INC	1,731,880	50.08	86,732,550.40

CORNING INC	354,949	30.28	10,747,855.72
DELL TECHNOLOGIES -C	105,383	75.97	8,005,946.51
F5 INC	23,495	171.78	4,035,971.10
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	540,248	17.00	9,184,216.00
HP INC	361,373	29.68	10,725,550.64
JABIL INC	56,474	125.03	7,060,944.22
JUNIPER NETWORKS INC	146,230	29.77	4,353,267.10
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	73,573	149.61	11,007,256.53
MOTOROLA SOLUTIONS INC	71,736	311.75	22,363,698.00
NETAPP INC	87,598	86.06	7,538,683.88
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	81,210	80.77	6,559,331.70
SUPER MICRO COMPUTER INC	20,822	288.80	6,013,393.60
TE CONNECTIVITY LTD	133,999	132.46	17,749,507.54
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	19,344	438.19	8,476,347.36
TRIMBLE INC	104,717	51.02	5,342,661.34
WESTERN DIGITAL CORP	132,049	50.02	6,605,090.98
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	23,205	252.97	5,870,168.85
AT&T INC	3,057,248	17.15	52,431,803.20
LIBERTY GLOBAL LTD-C	110,741	18.66	2,066,427.06
T-MOBILE US INC	225,440	162.30	36,588,912.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,796,679	39.37	70,735,252.23
AES CORP	301,072	18.87	5,681,228.64
ALLIANT ENERGY CORP	111,263	51.94	5,779,000.22
AMEREN CORPORATION	108,665	73.91	8,031,430.15
AMERICAN ELECTRIC POWER	223,780	83.39	18,661,014.20
AMERICAN WATER WORKS CO INC	85,857	131.76	11,312,518.32
ATMOS ENERGY CORP	59,425	117.60	6,988,380.00
CENTERPOINT ENERGY INC	257,054	29.08	7,475,130.32
CMS ENERGY CORP	125,406	59.38	7,446,608.28
CONSOLIDATED EDISON INC	146,375	93.25	13,649,468.75
CONSTELLATION ENERGY	138,080	115.36	15,928,908.80
DOMINION ENERGY INC	355,533	48.20	17,136,690.60
DTE ENERGY COMPANY	87,468	110.53	9,667,838.04
DUKE ENERGY CORP	329,427	98.49	32,445,265.23
EDISON INTERNATIONAL	157,003	72.29	11,349,746.87
ENTERGY CORP	92,973	103.04	9,579,937.92

ESSENTIAL UTILITIES INC	117,465	37.26	4,376,745.90
EVERGY INC	90,715	53.61	4,863,231.15
EVERSOURCE ENERGY	150,953	62.89	9,493,434.17
EXELON CORP	426,577	36.02	15,365,303.54
FIRSTENERGY CORP	230,793	37.79	8,721,667.47
NEXTERA ENERGY INC	877,699	61.80	54,241,798.20
NISOURCE INC	183,411	26.86	4,926,419.46
NRG ENERGY INC	90,959	51.29	4,665,287.11
P G & E CORP	872,004	17.71	15,443,190.84
PPL CORP	320,518	27.62	8,852,707.16
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	214,723	61.79	13,267,734.17
SEMPRA	263,726	75.96	20,032,626.96
SOUTHERN CO/THE	465,129	71.71	33,354,400.59
VISTRA CORP	138,089	38.40	5,302,617.60
WEC ENERGY GROUP INC	131,711	85.92	11,316,609.12
XCEL ENERGY INC	233,294	63.73	14,867,826.62
ADVANCED MICRO DEVICES	690,632	136.01	93,932,858.32
ANALOG DEVICES INC	209,392	186.07	38,961,569.44
APPLIED MATERIALS INC	357,260	149.31	53,342,490.60
BROADCOM INC	188,923	1,049.01	198,182,116.23
ENPHASE ENERGY INC	58,680	118.07	6,928,347.60
ENTEGRIS INC	65,028	109.04	7,090,653.12
FIRST SOLAR INC	41,690	166.31	6,933,463.90
INTEL CORP	1,788,849	46.87	83,843,352.63
KLA CORP	57,587	546.44	31,467,840.28
LAM RESEARCH CORP	56,534	731.08	41,330,876.72
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	53,600	64.86	3,476,496.00
MARVELL TECHNOLOGY INC	372,053	58.07	21,605,117.71
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	234,747	83.40	19,577,899.80
MICRON TECHNOLOGY INC	469,881	82.71	38,863,857.51
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	19,210	571.06	10,970,062.60
NVIDIA CORP	1,053,576	479.98	505,695,408.48
NXP SEMICONDUCTORS NV	109,157	207.76	22,678,458.32
ON SEMICONDUCTOR	181,696	76.20	13,845,235.20
QORVO INC	38,881	102.99	4,004,354.19
QUALCOMM INC	476,566	136.17	64,893,992.22

	SKYWORKS SOLUTIONS INC	65,806	103.22	6,792,495.32	
	TERADYNE INC	64,271	101.58	6,528,648.18	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	387,947	164.46	63,803,703.35	
	CBRE GROUP INC - A	134,884	87.42	11,791,559.28	
	COSTAR GROUP INC	172,471	81.42	14,042,588.82	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	487,100	3.42	1,665,882.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	61,585	54.16	3,335,443.60	
	アメリカドル 小計	144,744,542		17,234,495,418.42	(2,499,346,525,579)
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	242,100	20.23	4,897,683.00	
	CAMECO CORP	177,400	56.95	10,102,930.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	469,300	88.98	41,758,314.00	
	CENOVUS ENERGY INC	596,900	21.90	13,072,110.00	
	ENBRIDGE INC	915,200	48.79	44,652,608.00	
	IMPERIAL OIL LTD	86,400	78.77	6,805,728.00	
	KEYERA CORP	96,900	31.90	3,091,110.00	
	MEG ENERGY CORP	137,000	24.05	3,294,850.00	
	PARKLAND CORP	59,200	42.72	2,529,024.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	238,732	45.99	10,979,284.68	
	SUNCOR ENERGY INC	554,700	45.00	24,961,500.00	
	TC ENERGY CORP	446,600	53.08	23,705,528.00	
	TOURMALINE OIL CORP	134,500	62.06	8,347,070.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	220,940	70.25	15,521,035.00	
	BARRICK GOLD CORP	739,300	23.20	17,151,760.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	62,000	58.74	3,641,880.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	254,400	13.05	3,319,920.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	84,800	148.62	12,602,976.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	247,000	13.14	3,245,580.00	
	KINROSS GOLD CORP	502,500	7.70	3,869,250.00	
	LUNDIN MINING CORP	278,300	10.85	3,019,555.00	
	NUTRIEN LTD	206,759	74.53	15,409,748.27	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	166,900	20.69	3,453,161.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	203,400	53.75	10,932,750.00	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	26,600	111.69	2,970,954.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	197,300	64.05	12,637,065.00	
	CAE INC	122,100	28.56	3,487,176.00	

STANTEC INC	52,200	105.02	5,482,044.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	34,700	115.42	4,005,074.00
WSP GLOBAL INC	54,000	184.78	9,978,120.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	158,500	21.85	3,463,225.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	89,900	43.45	3,906,155.00
RB GLOBAL INC	77,500	87.40	6,773,500.00
THOMSON REUTERS CORP	65,532	192.50	12,614,910.00
AIR CANADA	62,200	18.12	1,127,064.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	236,000	168.05	39,659,800.00
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	390,900	105.99	41,431,491.00
TFI INTERNATIONAL INC	36,700	176.42	6,474,614.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	113,500	74.52	8,458,020.00
BRP INC/CA- SUB VOTING	15,700	92.69	1,455,233.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	74,300	42.91	3,188,213.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	125,910	101.92	12,832,747.20
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	25,300	139.75	3,535,675.00
DOLLARAMA INC	122,600	94.57	11,594,282.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	320,900	79.31	25,450,579.00
EMPIRE CO LTD 'A'	55,300	35.16	1,944,348.00
LOBLAW COMPANIES LTD	70,200	126.59	8,886,618.00
METRO INC/CN	96,200	67.98	6,539,676.00
WESTON (GEORGE) LTD	25,711	163.59	4,206,062.49
SAPUTO INC	95,600	26.59	2,542,004.00
BANK OF MONTREAL	309,000	129.59	40,043,310.00
BANK OF NOVA SCOTIA	517,800	63.09	32,668,002.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	400,900	63.38	25,409,042.00
NATIONAL BANK OF CANADA	138,500	100.29	13,890,165.00
ROYAL BANK OF CANADA	595,100	133.77	79,606,527.00
TORONTO-DOMINION BANK	766,300	85.64	65,625,932.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	157,388	51.37	8,085,021.56
BROOKFIELD CORP	595,550	51.46	30,647,003.00
IGM FINANCIAL INC	39,400	34.64	1,364,816.00
ONEX CORPORATION	24,300	90.97	2,210,571.00
TMX GROUP LTD	127,600	31.68	4,042,368.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	9,200	1,240.95	11,416,740.00
GREAT-WEST LIFECO INC	104,600	43.63	4,563,698.00

	IA FINANCIAL CORP INC	41,300	88.56	3,657,528.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	73,300	201.59	14,776,547.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	778,800	28.89	22,499,532.00	
	POWER CORP OF CANADA	259,900	37.98	9,871,002.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	254,300	68.50	17,419,550.00	
	CGI INC	88,300	136.93	12,090,919.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	8,500	3,325.20	28,264,200.00	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	35,400	106.94	3,785,676.00	
	OPEN TEXT CORP	122,700	53.12	6,517,824.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	517,100	98.11	50,732,681.00	
	BCE INC	22,600	54.30	1,227,180.00	
	QUEBECOR INC -CL B	55,600	31.98	1,778,088.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	150,000	62.17	9,325,500.00	
	TELUS CORP	231,200	23.87	5,518,744.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	241,500	8.52	2,057,580.00	
	ALTAGAS LTD	126,100	27.97	3,527,017.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	54,950	38.96	2,140,852.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	58,500	32.33	1,891,305.00	
	EMERA INC	124,600	50.89	6,340,894.00	
	FORTIS INC	211,600	55.29	11,699,364.00	
	HYDRO ONE LTD	127,300	39.53	5,032,169.00	
	NORTHLAND POWER INC	103,200	23.86	2,462,352.00	
	FIRSTSERVICE CORP	18,100	212.25	3,841,725.00	
	カナダドル 小計	17,357,072		1,081,041,429.20 (117,433,530,453)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	111,261	36.69	4,082,166.09	
	SANTOS LTD	1,408,749	7.66	10,791,017.34	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	797,066	31.57	25,163,373.62	
	BHP GROUP LTD	2,171,796	49.58	107,677,645.68	
	BLUESCOPE STEEL LTD	195,782	22.81	4,465,787.42	
	FORTESCUE LTD	707,190	28.93	20,459,006.70	
	IGO LTD	302,734	8.69	2,630,758.46	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	196,297	54.54	10,706,038.38	
	MINERAL RESOURCES LTD	76,336	68.87	5,257,260.32	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	452,727	12.80	5,794,905.60	
	ORICA LTD	225,412	15.79	3,559,255.48	

PILBARA MINERALS LTD	1,080,576	3.86	4,171,023.36
RIO TINTO LTD	154,543	134.50	20,786,033.50
SOUTH32 LTD	2,068,849	3.28	6,785,824.72
REECE LTD	81,800	21.96	1,796,328.00
BRAMBLES LTD	588,870	13.72	8,079,296.40
COMPUTERSHARE LTD	216,679	24.35	5,276,133.65
AURIZON HOLDINGS LTD	799,349	3.81	3,045,519.69
QANTAS AIRWAYS LTD	318,258	5.28	1,680,402.24
TRANSURBAN GROUP	1,321,940	13.62	18,004,822.80
ARISTOCRAT LEISURE LTD	242,487	40.31	9,774,650.97
IDP EDUCATION LTD	98,033	19.99	1,959,679.67
LOTTERY CORP LTD/THE	820,014	4.72	3,870,466.08
CAR GROUP LTD	174,947	30.69	5,369,123.43
REA GROUP LTD	22,035	179.50	3,955,282.50
SEEK LTD	146,470	25.92	3,796,502.40
WESFARMERS LTD	480,438	56.78	27,279,269.64
COLES GROUP LTD	583,356	16.10	9,392,031.60
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	584,671	5.28	3,087,062.88
WOOLWORTHS GROUP LTD	516,828	37.07	19,158,813.96
TREASURY WINE ESTATES LTD	311,138	10.34	3,217,166.92
COCHLEAR LTD	27,104	297.07	8,051,785.28
RAMSAY HEALTH CARE LTD	89,028	51.10	4,549,330.80
SONIC HEALTHCARE LTD	195,410	31.51	6,157,369.10
CSL LTD	208,116	286.73	59,673,100.68
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	1,261,685	25.54	32,223,434.90
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	716,358	111.49	79,866,753.42
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,318,034	30.46	40,147,315.64
WESTPAC BANKING CORP	1,509,880	22.64	34,183,683.20
ASX LTD	89,482	62.46	5,589,045.72
MACQUARIE GROUP LTD	159,906	180.00	28,783,080.00
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	89,647	32.65	2,926,974.55
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	948,895	5.63	5,342,278.85
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,155,175	3.66	4,227,940.50
QBE INSURANCE GROUP LTD	609,225	14.74	8,979,976.50
SUNCORP GROUP LTD	581,731	13.80	8,027,887.80
WISETECH GLOBAL LTD	64,916	73.54	4,773,922.64

	XERO LTD	63,997	108.76	6,960,313.72
	TELSTRA GROUP LTD	1,847,864	3.91	7,225,148.24
	APA GROUP	500,694	8.53	4,270,919.82
	ORIGIN ENERGY LTD	666,776	8.45	5,634,257.20
	オーストラリアドル 小計	29,360,554		718,667,168.06 (69,933,502,123)
イギリスポンド	BP PLC	7,241,437	4.73	34,284,583.47
	SHELL PLC	2,827,039	25.94	73,347,526.85
	ANGLO AMERICAN PLC	539,596	18.73	10,107,712.27
	ANTOFAGASTA PLC	155,265	16.04	2,491,226.92
	CRH PLC	301,961	52.50	15,852,952.50
	CRODA INTERNATIONAL PLC	61,968	46.67	2,892,046.56
	ENDEAVOUR MINING PLC	64,300	16.94	1,089,242.00
	GLENORE PLC	4,515,023	4.59	20,735,243.12
	MONDI PLC	194,179	15.37	2,985,502.12
	RIO TINTO PLC	485,029	57.54	27,908,568.66
	ASHTAD GROUP PLC	190,574	52.46	9,997,512.04
	BAE SYSTEMS PLC	1,281,839	11.55	14,811,649.64
	BUNZL PLC	143,172	31.84	4,558,596.48
	DCC PLC	39,599	57.16	2,263,478.84
	MELROSE INDUSTRIES PLC	529,501	5.56	2,945,084.56
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	3,677,660	2.97	10,952,071.48
	SMITHS GROUP PLC	140,644	17.20	2,419,076.80
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	35,331	98.56	3,482,223.36
	EXPERIAN PLC	384,481	30.51	11,730,515.31
	INTERTEK GROUP PLC	65,231	42.76	2,789,277.56
	RELX PLC	811,783	31.07	25,222,097.81
	RENTOKIL INITIAL PLC	1,038,754	4.14	4,300,441.56
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	378,223	5.50	2,083,252.28
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	43,223	47.75	2,063,898.25
	BURBERRY GROUP PLC	144,568	13.59	1,965,401.96
	PERSIMMON PLC	151,061	13.87	2,095,216.07
	TAYLOR WIMPEY PLC	1,572,933	1.44	2,268,169.38
	COMPASS GROUP PLC	731,174	21.33	15,595,941.42
	ENTAIN PLC	240,784	9.69	2,333,196.96
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	75,690	71.28	5,395,183.20

PEARSON PLC	248,798	9.83	2,446,181.93
WHITBREAD PLC	78,523	35.81	2,811,908.63
AUTO TRADER GROUP PLC	416,016	6.95	2,892,975.26
INFORMA PLC	633,403	7.75	4,908,873.25
WPP PLC	481,002	7.42	3,569,996.84
JD SPORTS FASHION PLC	969,434	1.19	1,160,412.49
KINGFISHER PLC	726,268	2.33	1,692,204.44
NEXT PLC	54,333	85.50	4,645,471.50
OCADO GROUP PLC	232,705	7.34	1,708,520.11
SAINSBURY (J) PLC	620,861	3.08	1,913,493.60
TESCO PLC	3,087,728	3.02	9,337,289.47
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	138,980	23.74	3,299,385.20
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	909,582	23.66	21,525,258.03
COCA-COLA HBC AG-DI	102,274	23.09	2,361,506.66
DIAGEO PLC	966,774	28.08	27,151,847.79
IMPERIAL BRANDS PLC	374,002	18.60	6,956,437.20
HALEON PLC	2,302,884	3.29	7,591,457.10
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	300,924	55.18	16,604,986.32
UNILEVER PLC	1,069,344	38.42	41,089,543.20
SMITH & NEPHEW PLC	356,638	10.51	3,748,265.38
ASTRAZENECA PLC	663,409	108.64	72,072,753.76
GSK PLC	1,759,677	15.39	27,095,506.44
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	72,292	18.50	1,337,763.46
BARCLAYS PLC	6,308,670	1.55	9,815,028.78
HSBC HOLDINGS PLC	8,252,620	6.32	52,197,821.50
LLOYDS BANKING GROUP PLC	26,964,602	0.47	12,825,712.94
NATWEST GROUP PLC	2,410,804	2.20	5,306,179.60
STANDARD CHARTERED PLC	1,015,012	6.51	6,611,788.16
3I GROUP PLC	416,277	23.37	9,728,393.49
ABRDN PLC	805,516	1.73	1,396,764.74
HARGREAVES LANSDOWN PLC	123,322	7.27	896,550.94
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	175,165	90.10	15,782,366.50
M&G PLC	928,249	2.24	2,084,847.25
SCHRODERS PLC	321,906	4.31	1,389,668.20
ST JAMES' S PLACE PLC	312,234	6.54	2,043,259.29
WISE PLC - A	218,500	8.40	1,835,400.00

	ADMIRAL GROUP PLC	117,270	27.00	3,166,290.00	
	AVIVA PLC	1,237,039	4.33	5,356,378.87	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,482,685	2.46	6,112,370.47	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	293,906	5.24	1,540,067.44	
	PRUDENTIAL PLC	1,173,289	8.35	9,804,002.88	
	SAGE GROUP PLC/THE	461,867	11.48	5,302,233.16	
	HALMA PLC	162,680	21.45	3,489,486.00	
	BT GROUP PLC	2,832,338	1.21	3,444,123.00	
	VODAFONE GROUP PLC	9,316,470	0.70	6,563,453.11	
	CENTRICA PLC	2,355,857	1.47	3,471,355.28	
	NATIONAL GRID PLC	1,590,634	10.78	17,154,987.69	
	SEVERN TRENT PLC	124,470	25.81	3,212,570.70	
	SSE PLC	470,042	18.46	8,676,975.32	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	275,510	10.63	2,930,048.85	
	イギリスポンド 小計	115,774,807		791,027,051.65 (145,596,439,126)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	99,007	12.21	1,208,875.47	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	3,236	667.50	2,160,030.00	
	GIVAUDAN-REG	4,004	3,366.00	13,477,464.00	
	HOLCIM LTD	221,148	64.98	14,370,197.04	
	SIG GROUP AG	122,800	19.01	2,334,428.00	
	SIKA AG-REG	66,174	257.50	17,039,805.00	
	ABB LTD-REG	691,408	36.47	25,215,649.76	
	GEBERIT AG-REG	14,442	519.00	7,495,398.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	9,410	198.30	1,866,003.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	18,836	209.80	3,951,792.80	
	VAT GROUP AG	11,903	389.50	4,636,218.50	
	ADECCO GROUP AG-REG	67,953	40.78	2,771,123.34	
	SGS SA-REG	63,124	75.38	4,758,287.12	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	21,579	301.30	6,501,752.70	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	219,946	112.50	24,743,925.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	15,105	223.20	3,371,436.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	14,795	42.55	629,527.25	
	AVOLTA AG	36,100	32.16	1,160,976.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	1,816	1,406.00	2,553,296.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	401	10,150.00	4,070,150.00	

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	49	102,800.00	5,037,200.00	
	NESTLE SA-REG	1,139,094	98.77	112,508,314.38	
	ALCON INC	211,019	64.38	13,585,403.22	
	SONOVA HOLDING AG-REG	22,022	267.40	5,888,682.80	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	49,846	129.15	6,437,610.90	
	BACHEM HOLDING AG	12,632	61.50	776,868.00	
	LONZA GROUP AG-REG	31,860	350.60	11,170,116.00	
	NOVARTIS AG-REG	876,217	89.84	78,719,335.28	
	ROCHE HOLDING AG-BR	13,335	273.80	3,651,123.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	300,822	254.35	76,514,075.70	
	SANDOZ GROUP AG	163,810	28.70	4,701,347.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	14,828	108.90	1,614,769.20	
	JULIUS BAER GROUP LTD	81,875	48.23	3,948,831.25	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	9,357	1,167.50	10,924,297.50	
	UBS GROUP AG-REG	1,407,250	25.38	35,716,005.00	
	BALOISE HOLDING AG - REG	19,933	132.30	2,637,135.90	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	13,700	117.70	1,612,490.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	12,670	583.00	7,386,610.00	
	SWISS RE AG	131,030	95.94	12,571,018.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	62,854	438.50	27,561,479.00	
	TEMENOS AG - REG	22,921	75.22	1,724,117.62	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	65,741	79.28	5,211,946.48	
	SWISSCOM AG-REG	10,809	517.80	5,596,900.20	
	BKW AG	9,300	149.30	1,388,490.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	28,756	89.10	2,562,159.60	
	スイスフラン 小計	6,414,917		583,762,661.21 (99,607,422,882)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,104,868	41.00	45,299,588.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	580,500	87.65	50,880,825.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	656,000	8.53	5,595,680.00	
	MTR CORP	706,500	28.25	19,958,625.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	622,000	14.00	8,708,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,031,000	44.10	45,467,100.00	
	SANDS CHINA LTD	943,600	23.10	21,797,160.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	894,300	13.68	12,234,024.00	
	WH GROUP LTD	3,953,000	5.03	19,883,590.00	

	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,548,000	20.40	31,579,200.00	
	HANG SENG BANK LTD	287,300	87.35	25,095,655.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	530,000	257.80	136,634,000.00	
	AIA GROUP LTD	4,868,400	64.25	312,794,700.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,589,000	9.32	14,809,480.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	253,000	43.35	10,967,550.00	
	CLP HOLDINGS LTD	706,000	63.95	45,148,700.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	4,338,348	5.86	25,422,719.28	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	514,500	45.15	23,229,675.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	750,868	38.20	28,683,157.60	
	ESR GROUP LTD	1,052,000	10.68	11,235,360.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	724,000	10.34	7,486,160.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	559,641	22.80	12,759,814.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	552,250	11.24	6,207,290.00	
	SINO LAND CO	1,247,400	8.26	10,303,524.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	663,500	80.90	53,677,150.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	221,500	65.40	14,486,100.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	500,800	15.50	7,762,400.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	527,000	22.75	11,989,250.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	639,000	24.05	15,367,950.00	
	香港ドル 小計	32,564,275		1,035,464,427.68 (19,228,574,422)	
シンガポールドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	30,200	29.08	878,216.00	
	KEPPEL LTD	584,800	6.99	4,087,752.00	
	SEATRIM LTD	15,794,803	0.11	1,784,812.73	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	754,200	3.80	2,865,960.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	563,640	6.36	3,584,750.40	
	GENTING SINGAPORE LTD	2,772,500	0.99	2,758,637.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	897,000	3.52	3,157,440.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	758,900	32.74	24,846,386.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,473,500	12.74	18,772,390.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	537,100	28.08	15,081,768.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	409,000	9.66	3,950,940.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,586,960	2.38	8,536,964.80	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	348,700	5.25	1,830,675.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	1,026,100	3.00	3,078,300.00	

	CITY DEVELOPMENTS LTD	224,100	6.42	1,438,722.00	
	UOL GROUP LTD	194,000	6.12	1,187,280.00	
	シンガポールドル 小計	29,955,503		97,840,994.43 (10,676,409,312)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	512,197	8.40	4,302,454.80	
	EBOS GROUP LTD	54,700	36.15	1,977,405.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	253,197	24.00	6,076,728.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	788,533	5.14	4,053,059.62	
	MERCURY NZ LTD	216,705	6.71	1,454,090.55	
	MERIDIAN ENERGY LTD	765,945	5.59	4,281,632.55	
	ニュージーランドドル 小計	2,591,277		22,145,370.52 (2,003,048,763)	
スウェーデンクローネ	BOLIDEN AB	107,054	303.85	32,528,357.90	
	HOLMEN AB-B SHARES	33,017	433.70	14,319,472.90	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	239,955	152.95	36,701,117.25	
	ALFA LAVAL AB	125,173	386.20	48,341,812.60	
	ASSA ABLOY AB-B	435,313	281.10	122,366,484.30	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	1,188,133	166.20	197,467,704.60	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	635,290	143.60	91,227,644.00	
	BEIJER REF AB	158,800	131.00	20,802,800.00	
	EPIROC AB-A	268,599	194.50	52,242,505.50	
	EPIROC AB-B	163,208	169.50	27,663,756.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	159,232	80.14	12,760,852.48	
	INDUTRADE AB	117,500	255.40	30,009,500.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	58,459	255.20	14,918,736.80	
	LIFCO AB-B SHS	96,300	243.10	23,410,530.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	609,996	68.12	41,552,927.52	
	SAAB AB-B	28,000	630.40	17,651,200.00	
	SANDVIK AB	436,679	212.60	92,837,955.40	
	SKANSKA AB-B SHS	145,633	178.60	26,010,053.80	
	SKF AB-B SHARES	141,090	199.40	28,133,346.00	
	VOLVO AB-A SHS	93,930	257.40	24,177,582.00	
	VOLVO AB-B SHS	635,456	250.15	158,959,318.40	
	SECURITAS AB-B SHS	235,929	96.72	22,819,052.88	
VOLVO CAR AB-B	207,500	30.91	6,413,825.00		
EVOLUTION AB	80,450	1,182.40	95,124,080.00		

	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	296,852	169.04	50,179,862.08	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	262,793	255.00	67,012,215.00	
	GETINGE AB-B SHS	85,916	222.00	19,073,352.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	93,763	269.00	25,222,247.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	692,614	142.00	98,351,188.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	574,426	110.90	63,703,843.40	
	SWEDBANK AB - A SHARES	360,592	207.20	74,714,662.40	
	EQT AB	143,445	265.30	38,055,958.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	44,871	329.00	14,762,559.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	89,196	329.10	29,354,403.60	
	INVESTOR AB-B SHS	717,801	232.20	166,673,392.20	
	LUNDBERGS AB-B SHS	43,685	543.60	23,747,166.00	
	ERICSSON LM-B SHS	1,206,411	63.19	76,233,111.09	
	HEXAGON AB-B SHS	926,291	116.85	108,237,103.35	
	TELE2 AB-B SHS	198,238	89.10	17,663,005.80	
	TELIA CO AB	910,648	26.91	24,505,537.68	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	296,348	68.66	20,347,253.68	
	SAGAX AB-B	105,140	267.80	28,156,492.00	
	スウェーデンクローネ 小計	13,449,726		2,184,433,968.11 (31,040,806,686)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	124,846	304.80	38,053,060.80	
	EQUINOR ASA	398,055	334.95	133,328,522.25	
	NORSK HYDRO ASA	519,804	65.82	34,213,499.28	
	YARA INTERNATIONAL ASA	83,488	367.50	30,681,840.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	32,500	482.80	15,691,000.00	
	ADEVINTA ASA	106,857	112.10	11,978,669.70	
	MOWI ASA	204,936	188.80	38,691,916.80	
	ORKLA ASA	312,992	80.88	25,314,792.96	
	SALMAR ASA	25,891	588.60	15,239,442.60	
	DNB BANK ASA	383,872	216.70	83,185,062.40	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	69,251	183.40	12,700,633.40	
	TELENOR ASA	333,379	120.65	40,222,176.35	
	ノルウェークローネ 小計	2,595,871		479,300,616.54 (6,758,138,693)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	40,357	555.00	22,398,135.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	83,163	363.90	30,263,015.70	

	ROCKWOOL A/S-B SHS	3,501	1,942.00	6,798,942.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	446,489	203.55	90,882,835.95	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1,339	13,840.00	18,531,760.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,814	14,120.00	25,613,680.00	
	DSV A/S	80,348	1,229.00	98,747,692.00	
	PANDORA A/S	36,319	929.60	33,762,142.40	
	CARLSBERG AS-B	43,500	855.40	37,209,900.00	
	COLOPLAST-B	59,282	770.20	45,658,996.40	
	DEMANT A/S	34,228	295.80	10,124,642.40	
	GENMAB A/S	27,981	2,158.00	60,382,998.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	1,395,214	728.90	1,016,971,484.60	
	DANSKE BANK A/S	284,870	188.15	53,598,290.50	
	TRYG A/S	137,570	148.00	20,360,360.00	
	ORSTED A/S	75,074	365.70	27,454,561.80	
	デンマーククローネ 小計	2,751,049		1,598,759,436.75 (34,037,588,408)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	299,785	18.75	5,620,968.75	
	ELBIT SYSTEMS LTD	10,169	762.50	7,753,862.50	
	BANK HAPOALIM BM	615,641	33.27	20,482,376.07	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	662,777	29.30	19,419,366.10	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	501,841	18.51	9,289,076.91	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	63,104	143.60	9,061,734.40	
	NICE LTD	28,581	709.70	20,283,935.70	
	AZRIELI GROUP LTD	14,806	243.90	3,611,183.40	
	イスラエルシェケル 小計	2,196,704		95,522,503.83 (3,782,929,957)	
ユーロ	ENI SPA	992,890	15.52	15,409,652.80	
	GALP ENERGIA SGPS SA	199,355	14.14	2,819,876.47	
	NESTE OYJ	176,099	32.27	5,682,714.73	
	OMV AG	55,701	40.08	2,232,496.08	
	REPSOL SA	515,996	13.71	7,076,885.14	
	TENARIS SA	206,256	15.61	3,219,656.16	
	TOTALENERGIES SE	979,516	62.48	61,200,159.68	
	AIR LIQUIDE SA	224,195	172.06	38,574,991.70	
	AKZO NOBEL N.V.	78,085	71.08	5,550,281.80	
	ARCELORMITTAL	211,797	25.51	5,402,941.47	

ARKEMA	23,464	101.05	2,371,037.20
BASF SE	374,769	47.69	17,874,607.45
COVESTRO AG	86,995	52.78	4,591,596.10
DSM-FIRMENICH AG	76,438	88.06	6,731,130.28
EVONIK INDUSTRIES AG	123,314	18.37	2,265,894.75
HEIDELBERG MATERIALS AG	64,181	80.44	5,162,719.64
OCI NV	34,955	26.64	931,201.20
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	112,656	35.84	4,037,591.04
STORA ENSO OYJ-R SHS	225,908	12.70	2,870,161.14
SYENSQO SA	29,153	91.10	2,655,838.30
SYMRISE AG	58,459	97.56	5,703,260.04
UMICORE	77,865	24.17	1,881,997.05
UPM-KYMMENE OYJ	236,305	34.47	8,145,433.35
VOESTALPINE AG	62,408	27.68	1,727,453.44
WACKER CHEMIE AG	6,600	104.75	691,350.00
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	99,597	39.94	3,977,904.18
AIRBUS SE	254,905	139.38	35,528,658.90
ALSTOM	108,862	11.23	1,222,520.26
BOUYGUES SA	83,366	34.92	2,911,140.72
BRENTAG SE	58,066	82.40	4,784,638.40
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	188,511	64.61	12,179,695.71
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	234,394	33.32	7,810,008.08
DASSAULT AVIATION SA	9,266	185.70	1,720,696.20
EIFFAGE	27,982	97.76	2,735,520.32
FERROVIAL SE	222,426	33.86	7,531,344.36
GEA GROUP AG	66,562	36.55	2,432,841.10
IMCD NV	22,965	151.90	3,488,383.50
KINGSPAN GROUP PLC	69,503	76.24	5,298,908.72
KNORR-BREMSE AG	25,881	57.80	1,495,921.80
KONE OYJ-B	136,554	45.32	6,188,627.28
LEGRAND SA	115,398	92.32	10,653,543.36
LEONARDO SPA	188,516	16.33	3,078,466.28
METSO CORP	279,500	9.04	2,526,680.00
MTU AERO ENGINES AG	22,956	196.80	4,517,740.80
PRYSMIAN SPA	111,578	40.31	4,497,709.18
RATIONAL AG	2,060	652.50	1,344,150.00

RHEINMETALL AG	18,567	305.10	5,664,791.70
SAFRAN SA	143,756	160.34	23,049,837.04
SCHNEIDER ELECTRIC SE	233,769	175.10	40,932,951.90
SIEMENS AG-REG	325,426	162.42	52,855,690.92
SIEMENS ENERGY AG	208,154	11.40	2,372,955.60
THALES SA	44,828	137.10	6,145,918.80
VINCI SA	220,115	114.52	25,207,569.80
WARTSILA OYJ ABP	210,609	12.96	2,730,545.68
BUREAU VERITAS SA	117,885	23.56	2,777,370.60
RANDSTAD NV	52,875	55.64	2,941,965.00
TELEPERFORMANCE	22,891	130.25	2,981,552.75
WOLTERS KLUWER	104,610	128.30	13,421,463.00
ADP	17,115	116.60	1,995,609.00
AENA SME SA	33,377	162.05	5,408,742.85
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	227,150	7.69	1,747,010.65
DHL GROUP	420,123	44.17	18,558,933.52
GETLINK SE	172,576	16.51	2,849,229.76
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	137,876	101.00	13,925,476.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	27,087	90.75	2,458,145.25
CONTINENTAL AG	51,684	74.42	3,846,323.28
DR ING HC F PORSCHE AG	48,570	77.72	3,774,860.40
FERRARI NV	53,245	306.80	16,335,566.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	347,380	62.32	21,648,721.60
MICHELIN (CGDE)	292,072	31.89	9,314,176.08
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	65,951	46.09	3,039,681.59
RENAULT SA	87,484	36.02	3,151,173.68
STELLANTIS NV	932,915	20.42	19,054,788.87
VOLKSWAGEN AG	12,382	117.15	1,450,551.30
VOLKSWAGEN AG-PREF	90,976	112.32	10,218,424.32
ADIDAS AG	67,673	173.76	11,758,860.48
HERMES INTERNATIONAL	13,359	1,850.60	24,722,165.40
KERING	31,767	379.45	12,053,988.15
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	118,239	697.80	82,507,174.20
MONCLER SPA	87,908	52.30	4,597,588.40
PUMA SE	43,656	46.66	2,036,988.96
SEB SA	9,694	111.50	1,080,881.00

ACCOR SA	72,993	34.52	2,519,718.36
AMADEUS IT GROUP SA	196,322	64.00	12,564,608.00
DELIVERY HERO SE	67,819	24.10	1,634,437.90
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	75,662	154.95	11,723,826.90
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	37,870	33.24	1,258,798.80
SODEXO SA	38,147	102.25	3,900,530.75
BOLLORE SE	260,906	5.71	1,491,077.79
PUBLICIS GROUPE	98,599	84.20	8,302,035.80
SCOUT24 SE	27,257	64.04	1,745,538.28
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	337,237	25.14	8,478,138.18
VIVENDI SE	296,979	9.69	2,877,726.51
D'ETEREN GROUP	8,226	172.10	1,415,694.60
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	452,970	38.01	17,217,389.70
PROSUS NV	631,338	27.58	17,415,458.73
ZALANDO SE	89,391	19.37	1,731,950.62
CARREFOUR SA	266,829	16.79	4,480,058.91
HELLOFRESH SE	67,988	13.37	909,339.50
JERONIMO MARTINS	116,013	22.26	2,582,449.38
KESKO OYJ-B SHS	133,348	18.24	2,432,267.52
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	422,654	27.06	11,439,130.51
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	374,651	58.81	22,033,225.31
DANONE	271,996	60.57	16,474,797.72
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	210,240	10.05	2,112,912.00
HEINEKEN HOLDING NV	52,148	75.70	3,947,603.60
HEINEKEN NV	118,376	90.22	10,679,882.72
JDE PEET'S NV	53,600	24.62	1,319,632.00
KERRY GROUP PLC-A	67,171	77.98	5,237,994.58
LOTUS BAKERIES	163	8,180.00	1,333,340.00
PERNOD RICARD SA	86,835	152.45	13,237,995.75
REMY COINTREAU	9,646	108.95	1,050,931.70
BEIERSDORF AG	42,526	135.05	5,743,136.30
HENKEL AG & CO KGAA	41,570	65.54	2,724,497.80
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	74,805	73.52	5,499,663.60
L'OREAL	103,218	437.35	45,142,392.30
AMPLIFON SPA	42,891	30.50	1,308,175.50
BIOMERIEUX	13,869	99.50	1,379,965.50

CARL ZEISS MEDITEC AG – BR	15,246	93.50	1,425,501.00
DIASORIN SPA	9,103	88.72	807,618.16
ESSILORLUXOTTICA	126,577	178.78	22,629,436.06
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	78,156	38.23	2,987,903.88
FRESENIUS SE & CO KGAA	164,066	29.06	4,767,757.96
KONINKLIJKE PHILIPS NV	348,313	21.28	7,412,100.64
SIEMENS HEALTHINEERS AG	118,182	51.78	6,119,463.96
ARGENX SE	25,812	355.90	9,186,490.80
BAYER AG–REG	413,972	35.23	14,586,303.42
EUROFINS SCIENTIFIC	52,717	57.90	3,052,314.30
GRIFOLS SA	126,564	14.94	1,890,866.16
IPSEN	13,860	109.60	1,519,056.00
MERCK KGAA	55,398	143.25	7,935,763.50
ORION OYJ–CLASS B	50,154	40.74	2,043,273.96
QIAGEN N. V.	109,292	39.59	4,326,870.28
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	42,431	48.52	2,058,752.12
SANOFI	489,778	92.83	45,466,091.74
SARTORIUS AG–VORZUG	9,986	320.80	3,203,508.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	10,076	238.80	2,406,148.80
UCB SA	56,484	81.68	4,613,613.12
ABN AMRO BANK NV–CVA	220,601	13.67	3,016,718.67
AIB GROUP PLC	598,464	4.08	2,441,733.12
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,555,898	8.46	21,622,897.08
BANCO BPM SPA	558,757	5.06	2,830,662.96
BANCO SANTANDER SA	6,930,410	3.88	26,889,990.80
BANK OF IRELAND GROUP PLC	407,946	8.71	3,556,473.22
BNP PARIBAS	450,912	62.91	28,366,873.92
CAIXABANK SA	1,742,858	3.95	6,893,003.39
COMMERZBANK AG	473,485	11.46	5,426,138.10
CREDIT AGRICOLE SA	530,480	13.14	6,970,507.20
ERSTE GROUP BANK AG	148,524	37.50	5,569,650.00
FINECOBANK SPA	253,566	13.64	3,458,640.24
ING GROEP NV	1,558,608	13.29	20,713,900.32
INTESA SANPAOLO	6,602,415	2.75	18,186,352.11
KBC GROUP NV	105,061	61.14	6,423,429.54
MEDIOBANCA SPA	227,881	11.23	2,560,243.03

NORDEA BANK ABP	1, 371, 262	11. 58	15, 887, 441. 53
SOCIETE GENERALE SA	301, 573	24. 35	7, 343, 302. 55
UNICREDIT SPA	690, 216	25. 61	17, 679, 882. 84
ADYEN NV	9, 317	1, 123. 00	10, 462, 991. 00
AMUNDI SA	21, 837	61. 30	1, 338, 608. 10
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	835, 056	12. 52	10, 454, 901. 12
DEUTSCHE BOERSE AG	78, 922	185. 10	14, 608, 462. 20
EDENRED	102, 855	54. 46	5, 601, 483. 30
EURAZEO SE	19, 619	71. 80	1, 408, 644. 20
EURONEXT NV	35, 304	77. 30	2, 728, 999. 20
EXOR NV	41, 814	89. 72	3, 751, 552. 08
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	40, 261	71. 00	2, 858, 531. 00
NEXI SPA	224, 714	7. 06	1, 586, 930. 26
SOFINA	5, 291	220. 20	1, 165, 078. 20
WORLDLINE SA	93, 323	14. 39	1, 342, 917. 97
AEGON LTD	703, 492	5. 27	3, 708, 809. 82
AGEAS	64, 112	39. 83	2, 553, 580. 96
ALLIANZ SE-REG	172, 748	245. 50	42, 409, 634. 00
ASR NEDERLAND NV	61, 663	43. 10	2, 657, 675. 30
ASSICURAZIONI GENERALI	440, 374	19. 76	8, 701, 790. 24
AXA SA	759, 011	29. 91	22, 705, 814. 06
HANNOVER RUECK SE	25, 577	222. 40	5, 688, 324. 80
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	58, 716	384. 00	22, 546, 944. 00
NN GROUP NV	107, 855	36. 78	3, 966, 906. 90
POSTE ITALIANE SPA	269, 406	10. 27	2, 768, 146. 65
SAMPO OYJ-A SHS	194, 261	39. 88	7, 748, 099. 98
TALANX AG	23, 200	64. 70	1, 501, 040. 00
BECHTLE AG	39, 938	43. 92	1, 754, 076. 96
CAPGEMINI SE	70, 311	187. 85	13, 207, 921. 35
DASSAULT SYSTEMES SE	289, 497	42. 27	12, 237, 038. 19
NEMETSCHEK SE	20, 683	74. 06	1, 531, 782. 98
SAP SE	446, 787	136. 44	60, 959, 618. 28
NOKIA OYJ	2, 388, 442	3. 16	7, 565, 390. 03
CELLNEX TELECOM SA	240, 171	35. 20	8, 454, 019. 20
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1, 351, 048	22. 46	30, 351, 293. 32
ELISA OYJ	64, 406	42. 50	2, 737, 255. 00

INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	180,053	11.55	2,080,512.41	
KONINKLIJKE KPN NV	1,430,285	3.13	4,489,664.61	
ORANGE	760,595	10.65	8,103,379.13	
TELECOM ITALIA SPA	3,630,827	0.29	1,061,290.73	
TELEFONICA SA	2,100,226	3.69	7,766,635.74	
ACCIONA SA	13,178	128.05	1,687,442.90	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	19,200	25.96	498,432.00	
E.ON SE	978,468	12.42	12,157,464.90	
EDP RENOVAVEIS SA	131,444	17.65	2,320,643.82	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,417,284	4.49	6,372,108.86	
ELIA GROUP SA/NV	10,658	112.60	1,200,090.80	
ENAGAS SA	120,868	15.79	1,909,110.06	
ENDESA SA	138,773	19.10	2,651,258.16	
ENEL SPA	3,480,707	6.72	23,404,273.86	
ENGIE	787,266	16.18	12,739,538.41	
FORTUM OYJ	180,538	13.67	2,467,954.46	
IBERDROLA SA	2,542,981	12.03	30,592,061.43	
NATURGY ENERGY GROUP SA	45,200	27.10	1,224,920.00	
REDEIA CORP SA	164,909	15.01	2,476,108.63	
RWE AG	271,030	40.78	11,052,603.40	
SNAM SPA	805,364	4.70	3,792,459.07	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	620,192	7.68	4,766,795.71	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	277,850	28.84	8,013,194.00	
VERBUND AG	28,497	84.15	2,398,022.55	
ASM INTERNATIONAL NV	20,427	436.30	8,912,300.10	
ASML HOLDING NV	172,178	646.40	111,295,859.20	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	29,712	127.30	3,782,337.60	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	564,351	34.91	19,704,315.16	
STMICROELECTRONICS NV	289,824	41.34	11,981,324.16	
LEG IMMOBILIEN SE	30,299	75.02	2,273,030.98	
VONOVIA SE	297,789	27.43	8,168,352.27	
ユーロ 小計	76,804,273		2,053,384,443.85 (326,097,983,527)	
合 計	476,560,570		3,365,542,899,931 (3,365,542,899,931)	

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
アメリカ ドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	68,439	8,600,729.13	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	145,112	5,190,656.24	
		AMERICAN TOWER CORP	199,702	43,027,792.92	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	57,854	10,621,415.86	
		BOSTON PROPERTIES INC	58,898	4,078,097.52	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	43,724	4,276,644.44	
		CROWN CASTLE INC	187,669	21,394,266.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	130,444	17,189,910.32	
		EQUINIX INC	40,029	31,818,251.52	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	76,761	5,339,495.16	
		EQUITY RESIDENTIAL	151,609	9,210,246.75	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	26,770	6,526,526.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	91,850	14,415,857.50	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	109,823	5,327,513.73	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	255,134	5,015,934.44	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	308,081	6,069,195.70	
		INVITATION HOMES INC	259,803	8,828,105.94	
		IRON MOUNTAIN INC	126,593	8,426,030.08	
		KIMCO REALTY CORP	282,414	5,879,859.48	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	47,987	6,341,961.92	
		PROLOGIS INC	395,217	51,492,822.93	
		PUBLIC STORAGE	66,150	19,856,907.00	
		REALTY INCOME CORP	309,444	17,851,824.36	
		REGENCY CENTERS CORP	73,940	4,848,985.20	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	46,023	11,500,687.47	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	136,593	19,158,534.18	
		SUN COMMUNITIES INC	54,882	7,274,060.28	
		UDR INC	127,075	4,811,059.50	
VENTAS INC	167,085	8,230,607.10			
VICI PROPERTIES INC	437,300	13,958,616.00			
WELLTOWER INC	222,586	19,743,378.20			

		WEYERHAEUSER CO	308,243	10,353,882.37	
		WP CAREY INC	84,740	5,478,441.00	
アメリカドル合計			5,097,974	422,138,296.24 (61,218,495,720)	
カナダドル	投資証券	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	36,100	1,719,443.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	58,600	1,102,266.00	
カナダドル合計			94,700	2,821,709.00 (306,522,248)	
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS/AU	413,611	3,102,082.50	
		GOODMAN GROUP	745,213	17,892,564.13	
		GPT GROUP	891,183	3,983,588.01	
		MIRVAC GROUP	1,521,680	3,089,010.40	
		SCENTRE GROUP	2,111,199	6,206,925.06	
		STOCKLAND	1,030,265	4,450,744.80	
		VICINITY CENTRES	1,843,215	3,667,997.85	
オーストラリアドル合計			8,556,366	42,392,912.75 (4,125,254,339)	
イギリスポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	352,124	2,452,191.53	
		SEGRO PLC	470,753	4,068,247.42	
イギリスポンド合計			822,877	6,520,438.95 (1,200,151,993)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	1,142,000	48,991,800.00	
香港ドル合計			1,142,000	48,991,800.00 (909,777,726)	
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,488,200	4,375,308.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	2,099,771	4,199,542.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,470,700	2,456,069.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	1,782,700	2,709,704.00	
シンガポールドル合計			6,841,371	13,740,623.00 (1,499,376,781)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	26,523	1,276,286.76	
		GECINA SA	16,340	1,785,962.00	
		KLEPIERRE	90,686	2,241,757.92	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	47,386	3,175,809.72	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	70,808	1,950,052.32	
ユーロ合計			251,743	10,429,868.72	

		(1,656,367,451)
合計		70,915,946,258 (70,915,946,258)

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 589 銘柄	97.61%	—	72.73%
	投資証券 33 銘柄	—	2.39%	1.78%
カナダドル	株式 86 銘柄	99.74%	—	3.42%
	投資証券 2 銘柄	—	0.26%	0.01%
オーストラリアドル	株式 51 銘柄	94.43%	—	2.04%
	投資証券 7 銘柄	—	5.57%	0.12%
イギリスポンド	株式 80 銘柄	99.18%	—	4.24%
	投資証券 2 銘柄	—	0.82%	0.03%
スイスフラン	株式 45 銘柄	100.00%	—	2.90%
香港ドル	株式 29 銘柄	95.48%	—	0.56%
	投資証券 1 銘柄	—	4.52%	0.03%
シンガポールドル	株式 16 銘柄	87.69%	—	0.31%
	投資証券 4 銘柄	—	12.31%	0.04%
ニュージーランドドル	株式 6 銘柄	100.00%	—	0.06%
スウェーデンクローネ	株式 42 銘柄	100.00%	—	0.90%
ノルウェークローネ	株式 12 銘柄	100.00%	—	0.20%
デンマーククローネ	株式 16 銘柄	100.00%	—	0.99%
イスラエルシェケル	株式 8 銘柄	100.00%	—	0.11%
ユーロ	株式 221 銘柄	99.49%	—	9.49%
	投資証券 5 銘柄	—	0.51%	0.05%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位: 円)

[2024年1月5日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,068,912,021
国債証券	651,729,798,220
地方債証券	41,739,547,558
特殊債券	35,730,844,935
社債券	47,869,763,000
派生商品評価勘定	2,326,260
未収利息	1,093,061,724
前払費用	56,302,348
差入委託証拠金	7,407,413
流動資産合計	781,297,963,479
資産合計	781,297,963,479
負債の部	
流動負債	
前受金	1,970,000
未払金	1,827,253,300
未払解約金	563,659,396
未払利息	700
流動負債合計	2,392,883,396
負債合計	2,392,883,396
純資産の部	
元本等	
元本	606,041,837,870
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	172,863,242,213
元本等合計	778,905,080,083
純資産合計	778,905,080,083
負債純資産合計	781,297,963,479

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年1月5日現在]
1. 期首	2023年7月6日
期首元本額	578,832,975,172円
期中追加設定元本額	63,224,965,056円
期中一部解約元本額	36,016,102,358円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	7,435,258,851円

三菱UF J	ライフセレクトファンド (安定成長型)	10,668,634,295 円
三菱UF J	ライフセレクトファンド (成長型)	2,722,779,289 円
三菱UF J	プライムバランス (安定型) (確定拠出年金)	56,603,106,017 円
三菱UF J	プライムバランス (安定成長型) (確定拠出年金)	101,844,401,952 円
三菱UF J	プライムバランス (成長型) (確定拠出年金)	32,192,305,467 円
三菱UF J	6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)	206,252,058 円
三菱UF J	6資産バランスファンド (成長型)	183,377,476 円
三菱UF J	国内債券インデックスファンド	1,855,853,625 円
eMAXIS	国内債券インデックス	6,913,655,377 円
eMAXIS	バランス (8資産均等型)	4,291,431,689 円
eMAXIS	バランス (波乗り型)	286,223,482 円
三菱UF J	プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)	16,804,372,972 円
三菱UF J	国内債券インデックスファンド (確定拠出年金)	42,073,049,324 円
三菱UF J	ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)	10,823,968,716 円
三菱UF J	ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)	4,945,554,307 円
三菱UF J	ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)	2,238,237,607 円
eMAXIS	Slim 国内債券インデックス	17,113,997,893 円
	国内債券セレクション (ラップ向け)	10,067,507,654 円
eMAXIS	Slim バランス (8資産均等型)	20,965,910,466 円
	つみたて8資産均等バランス	10,294,124,505 円
	つみたて4資産均等バランス	3,828,142,580 円
eMAXIS	マイマネージャー 1970s	18,065,819 円
eMAXIS	マイマネージャー 1980s	13,763,898 円
eMAXIS	マイマネージャー 1990s	346,215 円
三菱UF J	ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)	6,042,093,885 円
三菱UF J	ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)	2,630,338,774 円
三菱UF J	ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)	1,036,458,730 円
三菱UF J	DC年金バランス (株式15)	7,041,949,216 円
三菱UF J	DC年金バランス (株式40)	6,650,826,103 円
三菱UF J	DC年金バランス (株式65)	4,003,671,423 円
三菱UF J	ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)	756,526,908 円
三菱UF J	DC年金バランス (株式25)	1,325,222,162 円
	国内債券インデックスファンド (ラップ向け)	1,670,604,172 円
三菱UF J	ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)	343,217,335 円
	ラップ向けインデックスf 国内債券	6,118,073,767 円
MUFG	ウェルス・インサイト・ファンド (保守型)	2,204,333,840 円
MUFG	ウェルス・インサイト・ファンド (標準型)	2,284,828,803 円
三菱UF J	DC年金バランス (株式80)	7,618,709 円
三菱UF J	ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)	2,122,413 円
三菱UF J	アドバンスト・バランス (安定型)	129,703,024 円
三菱UF J	アドバンスト・バランス (安定成長型)	177,956,270 円
eMAXIS	債券バランス (2資産均等型)	79,462,395 円
eMAXIS	バランス (4資産均等型)	1,523,299,067 円
eMAXIS	最適化バランス (マイゴールキーパー)	1,847,613,370 円
eMAXIS	最適化バランス (マイディフェンダー)	1,076,025,950 円
eMAXIS	最適化バランス (マイミッドフィルダー)	2,182,794,742 円

eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	113, 104, 381 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	44, 900, 097 円
三菱UFJ 日本債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	5, 942, 730, 717 円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定)	1, 723 円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	26, 414, 657 円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	8, 992, 209, 469 円
三菱UFJ バランスファンドVA 20型 (適格機関投資家限定)	663, 171, 082 円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	4, 461, 028, 957 円
MUAM 日本債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)	118, 057, 715, 815 円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	454, 712, 623 円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1, 515, 465 円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	293, 333 円
三菱UFJ バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4, 310, 442, 492 円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	2, 490, 890, 163 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	3, 019, 129, 541 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	505, 983, 303 円
MUKAM 日本債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	13, 047, 415, 984 円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	1, 859, 395, 378 円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	2, 054, 382 円
日本債券インデックスファンドS	4, 325, 813, 168 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	429, 832, 474 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	424, 280, 144 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	424, 729, 389 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	421, 626, 267 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	419, 477, 595 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	420, 955, 442 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	413, 671, 752 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	416, 234, 104 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	418, 690, 273 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	416, 840, 490 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	462, 440, 331 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	469, 323, 041 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	477, 586, 919 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	478, 244, 702 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	476, 937, 873 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01 (適格機関投資家限定)	490, 248, 647 円

格機関投資家限定)	
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)	476,919,903 円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	477,769,455 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	18,184,996 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	22,512,710 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	3,131,730 円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	9,395,378 円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	17,602,509 円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	43,409,557 円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	8,935,685 円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	27,906,095 円
三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド	4,306,640,964 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	2,213,677,587 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	4,635,660,171 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	2,877,989,452 円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)	1,996,996,913 円
合計	606,041,837,870 円
2. 受益権の総数	606,041,837,870 円

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023 年 7 月 6 日 至 2024 年 1 月 5 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、債券先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 また、デリバティブ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または計算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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024 年 1 月 5 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(3) 上記以外の金融商品
	上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024年1月5日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△15,479,947,780
地方債証券	△233,724,052
特殊債券	△327,702,483
社債券	△38,503,000
合計	△16,079,877,315

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

債券関連

[2024年1月5日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引				
	買建	585,430,000	—	587,760,000	2,330,000
合計		585,430,000	—	587,760,000	2,330,000

(注) 時価の算定方法

- 先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024年1月5日現在]
1口当たり純資産額	1.2852円
(1万口当たり純資産額)	(12,852円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第445回利付国債(2年)	2,890,000,000	2,891,676,200	
	第446回利付国債(2年)	5,100,000,000	5,103,162,000	
	第447回利付国債(2年)	1,020,000,000	1,020,622,200	
	第448回利付国債(2年)	1,800,000,000	1,800,936,000	
	第449回利付国債(2年)	2,220,000,000	2,220,910,200	
	第450回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,300,377,000	
	第451回利付国債(2年)	2,700,000,000	2,701,026,000	
	第452回利付国債(2年)	3,100,000,000	3,100,496,000	
	第453回利付国債(2年)	1,300,000,000	1,300,000,000	
	第454回利付国債(2年)	1,800,000,000	1,803,582,000	
	第455回利付国債(2年)	900,000,000	899,910,000	
	第143回利付国債(5年)	5,380,000,000	5,388,930,800	
	第144回利付国債(5年)	6,380,000,000	6,390,590,800	
	第145回利付国債(5年)	6,410,000,000	6,421,409,800	
	第146回利付国債(5年)	5,150,000,000	5,159,476,000	
	第147回利付国債(5年)	4,530,000,000	4,529,003,400	
	第148回利付国債(5年)	5,100,000,000	5,098,113,000	
	第149回利付国債(5年)	6,050,000,000	6,045,886,000	
	第150回利付国債(5年)	930,000,000	929,042,100	
	第151回利付国債(5年)	750,000,000	748,920,000	
	第152回利付国債(5年)	3,930,000,000	3,936,248,700	
	第153回利付国債(5年)	5,620,000,000	5,607,411,200	
	第154回利付国債(5年)	5,730,000,000	5,732,062,800	
	第155回利付国債(5年)	2,850,000,000	2,871,261,000	
	第156回利付国債(5年)	4,650,000,000	4,666,414,500	
	第157回利付国債(5年)	2,020,000,000	2,025,050,000	
	第158回利付国債(5年)	5,330,000,000	5,321,098,900	
	第159回利付国債(5年)	1,980,000,000	1,974,753,000	
	第160回利付国債(5年)	2,850,000,000	2,855,016,000	
	第161回利付国債(5年)	120,000,000	120,714,000	
第162回利付国債(5年)	190,000,000	190,927,200		

第163回利付国債（5年）	11,850,000,000	11,962,930,500	
第1回利付国債（40年）	1,105,000,000	1,301,159,600	
第2回利付国債（40年）	1,335,000,000	1,512,768,600	
第3回利付国債（40年）	1,168,000,000	1,321,732,160	
第4回利付国債（40年）	1,218,000,000	1,377,350,940	
第5回利付国債（40年）	775,000,000	841,766,250	
第6回利付国債（40年）	1,230,000,000	1,306,014,000	
第7回利付国債（40年）	1,540,000,000	1,560,220,200	
第8回利付国債（40年）	1,510,000,000	1,417,663,500	
第9回利付国債（40年）	2,880,000,000	1,977,580,800	
第10回利付国債（40年）	2,720,000,000	2,190,851,200	
第11回利付国債（40年）	2,100,000,000	1,622,880,000	
第12回利付国債（40年）	2,490,000,000	1,709,708,700	
第13回利付国債（40年）	2,800,000,000	1,902,236,000	
第14回利付国債（40年）	3,070,000,000	2,223,539,600	
第15回利付国債（40年）	3,500,000,000	2,790,480,000	
第16回利付国債（40年）	2,230,000,000	1,944,716,100	
第338回利付国債（10年）	3,330,000,000	3,347,449,200	
第339回利付国債（10年）	4,020,000,000	4,044,079,800	
第340回利付国債（10年）	3,470,000,000	3,493,804,200	
第341回利付国債（10年）	3,320,000,000	3,339,023,600	
第342回利付国債（10年）	2,570,000,000	2,574,780,200	
第343回利付国債（10年）	4,870,000,000	4,879,496,500	
第344回利付国債（10年）	4,620,000,000	4,628,685,600	
第345回利付国債（10年）	6,340,000,000	6,351,158,400	
第346回利付国債（10年）	6,130,000,000	6,139,746,700	
第347回利付国債（10年）	5,700,000,000	5,705,871,000	
第348回利付国債（10年）	4,970,000,000	4,971,789,200	
第349回利付国債（10年）	6,090,000,000	6,087,564,000	
第350回利付国債（10年）	6,530,000,000	6,519,094,900	
第351回利付国債（10年）	4,870,000,000	4,857,094,500	
第352回利付国債（10年）	4,110,000,000	4,091,792,700	
第353回利付国債（10年）	4,630,000,000	4,605,044,300	
第354回利付国債（10年）	6,220,000,000	6,181,684,800	
第355回利付国債（10年）	2,740,000,000	2,721,559,800	
第356回利付国債（10年）	7,740,000,000	7,681,253,400	

第357回利付国債（10年）	5,750,000,000	5,699,457,500	
第358回利付国債（10年）	6,790,000,000	6,721,692,600	
第359回利付国債（10年）	8,550,000,000	8,449,879,500	
第360回利付国債（10年）	6,340,000,000	6,252,634,800	
第361回利付国債（10年）	6,210,000,000	6,108,839,100	
第362回利付国債（10年）	6,140,000,000	6,023,831,200	
第363回利付国債（10年）	7,920,000,000	7,748,215,200	
第364回利付国債（10年）	7,220,000,000	7,042,460,200	
第365回利付国債（10年）	8,080,000,000	7,856,992,000	
第366回利付国債（10年）	4,440,000,000	4,342,009,200	
第367回利付国債（10年）	5,540,000,000	5,403,106,600	
第368回利付国債（10年）	6,880,000,000	6,691,212,800	
第369回利付国債（10年）	6,070,000,000	6,046,691,200	
第370回利付国債（10年）	6,370,000,000	6,333,818,400	
第371回利付国債（10年）	5,010,000,000	4,924,830,000	
第372回利付国債（10年）	6,920,000,000	7,046,774,400	
第1回利付国債（30年）	196,000,000	224,445,480	
第2回利付国債（30年）	268,000,000	302,794,440	
第3回利付国債（30年）	307,000,000	346,065,750	
第4回利付国債（30年）	252,000,000	295,958,880	
第5回利付国債（30年）	238,000,000	269,392,200	
第6回利付国債（30年）	339,000,000	390,385,620	
第7回利付国債（30年）	339,000,000	389,205,900	
第8回利付国債（30年）	302,000,000	335,053,900	
第9回利付国債（30年）	206,000,000	221,398,500	
第10回利付国債（30年）	398,000,000	417,151,760	
第11回利付国債（30年）	237,000,000	261,233,250	
第12回利付国債（30年）	325,000,000	370,685,250	
第13回利付国債（30年）	595,000,000	673,492,400	
第14回利付国債（30年）	683,000,000	800,305,250	
第15回利付国債（30年）	686,000,000	811,702,640	
第16回利付国債（30年）	547,000,000	648,200,470	
第17回利付国債（30年）	577,000,000	678,442,370	
第18回利付国債（30年）	687,000,000	801,495,420	
第19回利付国債（30年）	593,000,000	692,054,720	
第20回利付国債（30年）	655,000,000	779,928,150	

第2 1 回利付国債（3 0年）	529,000,000	618,549,120	
第2 2 回利付国債（3 0年）	975,000,000	1,162,989,750	
第2 3 回利付国債（3 0年）	194,000,000	231,585,560	
第2 4 回利付国債（3 0年）	981,000,000	1,172,530,440	
第2 5 回利付国債（3 0年）	1,287,000,000	1,508,145,210	
第2 6 回利付国債（3 0年）	1,014,000,000	1,200,423,900	
第2 7 回利付国債（3 0年）	760,000,000	909,925,200	
第2 8 回利付国債（3 0年）	1,426,000,000	1,707,749,080	
第2 9 回利付国債（3 0年）	830,000,000	983,292,700	
第3 0 回利付国債（3 0年）	1,721,000,000	2,014,723,070	
第3 1 回利付国債（3 0年）	2,223,000,000	2,567,476,080	
第3 2 回利付国債（3 0年）	1,989,000,000	2,325,021,660	
第3 3 回利付国債（3 0年）	1,227,000,000	1,375,970,070	
第3 4 回利付国債（3 0年）	2,231,000,000	2,563,552,860	
第3 5 回利付国債（3 0年）	2,379,000,000	2,656,795,830	
第3 6 回利付国債（3 0年）	1,929,000,000	2,151,394,410	
第3 7 回利付国債（3 0年）	2,717,000,000	2,980,114,280	
第3 8 回利付国債（3 0年）	1,590,000,000	1,713,415,800	
第3 9 回利付国債（3 0年）	1,360,000,000	1,487,799,200	
第4 0 回利付国債（3 0年）	1,720,000,000	1,847,606,800	
第4 1 回利付国債（3 0年）	1,210,000,000	1,277,542,200	
第4 2 回利付国債（3 0年）	1,920,000,000	2,025,004,800	
第4 3 回利付国債（3 0年）	1,690,000,000	1,780,482,600	
第4 4 回利付国債（3 0年）	1,630,000,000	1,715,346,800	
第4 5 回利付国債（3 0年）	1,580,000,000	1,604,284,600	
第4 6 回利付国債（3 0年）	2,380,000,000	2,412,963,000	
第4 7 回利付国債（3 0年）	1,900,000,000	1,957,817,000	
第4 8 回利付国債（3 0年）	2,100,000,000	2,082,654,000	
第4 9 回利付国債（3 0年）	2,160,000,000	2,138,443,200	
第5 0 回利付国債（3 0年）	1,910,000,000	1,670,696,100	
第5 1 回利付国債（3 0年）	2,460,000,000	1,911,370,800	
第5 2 回利付国債（3 0年）	2,020,000,000	1,640,462,200	
第5 3 回利付国債（3 0年）	1,950,000,000	1,615,926,000	
第5 4 回利付国債（3 0年）	1,870,000,000	1,616,932,900	
第5 5 回利付国債（3 0年）	1,940,000,000	1,672,532,200	
第5 6 回利付国債（3 0年）	1,840,000,000	1,581,645,600	

第57回利付国債（30年）	2,040,000,000	1,748,361,600	
第58回利付国債（30年）	2,280,000,000	1,948,282,800	
第59回利付国債（30年）	1,960,000,000	1,629,975,200	
第60回利付国債（30年）	1,730,000,000	1,503,646,800	
第61回利付国債（30年）	1,820,000,000	1,501,190,600	
第62回利付国債（30年）	1,190,000,000	928,295,200	
第63回利付国債（30年）	1,960,000,000	1,481,132,800	
第64回利付国債（30年）	1,870,000,000	1,407,549,000	
第65回利付国債（30年）	1,510,000,000	1,133,104,000	
第66回利付国債（30年）	1,900,000,000	1,418,939,000	
第67回利付国債（30年）	2,840,000,000	2,235,420,800	
第68回利付国債（30年）	2,060,000,000	1,615,719,800	
第69回利付国債（30年）	1,890,000,000	1,519,654,500	
第70回利付国債（30年）	1,990,000,000	1,594,726,300	
第71回利付国債（30年）	1,960,000,000	1,565,373,600	
第72回利付国債（30年）	1,910,000,000	1,521,677,900	
第73回利付国債（30年）	2,030,000,000	1,613,322,200	
第74回利付国債（30年）	3,040,000,000	2,614,491,200	
第75回利付国債（30年）	2,370,000,000	2,194,548,900	
第76回利付国債（30年）	2,070,000,000	1,961,573,400	
第77回利付国債（30年）	2,110,000,000	2,095,483,200	
第78回利付国債（30年）	2,360,000,000	2,232,748,800	
第79回利付国債（30年）	2,030,000,000	1,825,457,200	
第80回利付国債（30年）	2,120,000,000	2,200,920,400	
第75回利付国債（20年）	705,000,000	722,984,550	
第76回利付国債（20年）	410,000,000	419,483,300	
第77回利付国債（20年）	370,000,000	378,998,400	
第78回利付国債（20年）	310,000,000	318,571,500	
第79回利付国債（20年）	150,000,000	154,363,500	
第80回利付国債（20年）	585,000,000	602,865,900	
第81回利付国債（20年）	250,000,000	258,500,000	
第82回利付国債（20年）	1,082,000,000	1,120,627,400	
第83回利付国債（20年）	395,000,000	411,092,300	
第84回利付国債（20年）	880,000,000	914,144,000	
第85回利付国債（20年）	520,000,000	543,753,600	
第86回利付国債（20年）	1,047,000,000	1,099,412,820	

第87回利付国債（20年）	420,000,000	440,105,400	
第88回利付国債（20年）	1,264,000,000	1,334,392,160	
第89回利付国債（20年）	340,000,000	358,101,600	
第90回利付国債（20年）	1,270,000,000	1,344,231,500	
第91回利付国債（20年）	548,000,000	581,504,720	
第92回利付国債（20年）	1,282,000,000	1,359,676,380	
第93回利付国債（20年）	190,000,000	201,806,600	
第94回利付国債（20年）	875,000,000	932,155,000	
第95回利付国債（20年）	1,107,000,000	1,192,006,530	
第96回利付国債（20年）	340,000,000	363,772,800	
第97回利付国債（20年）	573,000,000	617,648,160	
第98回利付国債（20年）	610,000,000	655,280,300	
第99回利付国債（20年）	1,480,000,000	1,596,002,400	
第100回利付国債（20年）	1,030,000,000	1,118,652,100	
第101回利付国債（20年）	723,000,000	791,251,200	
第102回利付国債（20年）	520,000,000	571,521,600	
第103回利付国債（20年）	760,000,000	831,941,600	
第104回利付国債（20年）	610,000,000	662,362,400	
第105回利付国債（20年）	920,000,000	1,001,778,800	
第106回利付国債（20年）	571,000,000	624,417,050	
第107回利付国債（20年）	607,000,000	663,469,210	
第108回利付国債（20年）	1,000,000,000	1,083,240,000	
第109回利付国債（20年）	560,000,000	608,602,400	
第110回利付国債（20年）	876,000,000	961,024,560	
第111回利付国債（20年）	861,000,000	952,963,410	
第112回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,156,491,000	
第113回利付国債（20年）	922,000,000	1,019,215,680	
第114回利付国債（20年）	1,600,000,000	1,774,960,000	
第115回利付国債（20年）	944,000,000	1,052,758,240	
第116回利付国債（20年）	461,000,000	515,808,290	
第117回利付国債（20年）	1,320,000,000	1,468,896,000	
第118回利付国債（20年）	520,000,000	576,976,400	
第119回利付国債（20年）	400,000,000	438,760,000	
第120回利付国債（20年）	780,000,000	845,699,400	
第121回利付国債（20年）	1,299,000,000	1,435,888,620	
第122回利付国債（20年）	100,000,000	109,882,000	

第123回利付国債（20年）	1,318,000,000	1,477,385,740	
第124回利付国債（20年）	1,240,000,000	1,381,533,600	
第125回利付国債（20年）	1,844,000,000	2,084,033,480	
第126回利付国債（20年）	200,000,000	223,150,000	
第127回利付国債（20年）	440,000,000	487,841,200	
第128回利付国債（20年）	1,974,000,000	2,191,988,820	
第129回利付国債（20年）	280,000,000	308,893,200	
第130回利付国債（20年）	1,862,000,000	2,055,852,820	
第131回利付国債（20年）	420,000,000	460,588,800	
第132回利付国債（20年）	187,000,000	205,165,180	
第133回利付国債（20年）	2,320,000,000	2,563,182,400	
第134回利付国債（20年）	4,545,000,000	5,027,769,900	
第135回利付国債（20年）	50,000,000	54,916,000	
第136回利付国債（20年）	190,000,000	207,179,800	
第137回利付国債（20年）	4,342,000,000	4,773,768,480	
第138回利付国債（20年）	160,000,000	173,243,200	
第139回利付国債（20年）	310,000,000	338,172,800	
第140回利付国債（20年）	2,817,000,000	3,098,700,000	
第141回利付国債（20年）	1,120,000,000	1,232,963,200	
第142回利付国債（20年）	3,090,000,000	3,428,046,000	
第143回利付国債（20年）	1,740,000,000	1,901,506,800	
第144回利付国債（20年）	1,520,000,000	1,647,771,200	
第145回利付国債（20年）	3,100,000,000	3,416,975,000	
第146回利付国債（20年）	3,420,000,000	3,771,610,200	
第147回利付国債（20年）	3,450,000,000	3,771,988,500	
第148回利付国債（20年）	3,360,000,000	3,639,921,600	
第149回利付国債（20年）	3,440,000,000	3,724,109,600	
第150回利付国債（20年）	3,750,000,000	4,019,175,000	
第151回利付国債（20年）	3,780,000,000	3,968,092,800	
第152回利付国債（20年）	3,110,000,000	3,261,208,200	
第153回利付国債（20年）	3,620,000,000	3,829,815,200	
第154回利付国債（20年）	3,360,000,000	3,513,115,200	
第155回利付国債（20年）	3,600,000,000	3,676,464,000	
第156回利付国債（20年）	3,100,000,000	2,944,256,000	
第157回利付国債（20年）	3,630,000,000	3,349,364,700	
第158回利付国債（20年）	2,960,000,000	2,826,681,600	

第159回利付国債(20年)	2,850,000,000	2,747,656,500	
第160回利付国債(20年)	3,630,000,000	3,531,881,100	
第161回利付国債(20年)	3,120,000,000	2,986,245,600	
第162回利付国債(20年)	3,740,000,000	3,568,371,400	
第163回利付国債(20年)	3,330,000,000	3,165,031,800	
第164回利付国債(20年)	3,890,000,000	3,632,443,100	
第165回利付国債(20年)	3,160,000,000	2,940,158,800	
第166回利付国債(20年)	3,720,000,000	3,547,429,200	
第167回利付国債(20年)	2,910,000,000	2,684,154,900	
第168回利付国債(20年)	2,660,000,000	2,406,661,600	
第169回利付国債(20年)	2,720,000,000	2,410,464,000	
第170回利付国債(20年)	2,150,000,000	1,896,923,500	
第171回利付国債(20年)	2,720,000,000	2,387,534,400	
第172回利付国債(20年)	2,180,000,000	1,936,973,600	
第173回利付国債(20年)	3,150,000,000	2,784,757,500	
第174回利付国債(20年)	4,670,000,000	4,107,498,500	
第175回利付国債(20年)	2,920,000,000	2,601,019,200	
第176回利付国債(20年)	2,930,000,000	2,596,976,200	
第177回利付国債(20年)	3,140,000,000	2,722,662,600	
第178回利付国債(20年)	3,420,000,000	3,006,898,200	
第179回利付国債(20年)	3,240,000,000	2,838,045,600	
第180回利付国債(20年)	3,780,000,000	3,481,417,800	
第181回利付国債(20年)	2,730,000,000	2,550,447,900	
第182回利付国債(20年)	2,680,000,000	2,585,771,200	
第183回利付国債(20年)	2,870,000,000	2,904,784,400	
第184回利付国債(20年)	2,740,000,000	2,629,550,600	
第185回利付国債(20年)	3,880,000,000	3,713,431,600	
第186回利付国債(20年)	2,760,000,000	2,822,210,400	
第1回大韓民国	100,000,000	100,524,000	
第2回大韓民国	100,000,000	101,207,000	
国債証券 合計	660,189,000,000	651,729,798,220	
地方債証券	第5回東京都公募公債(20年)	100,000,000	102,451,000
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,484,000
	第7回東京都公募公債(30年)	80,000,000	94,425,600
	第10回東京都公募公債(30年)	100,000,000	115,098,000
	第12回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,725,000

第20回東京都公募公債（20年）	80,000,000	87,762,400	
第21回東京都公募公債（20年）	80,000,000	88,529,600	
第28回東京都公募公債（20年）	100,000,000	108,016,000	
第33回東京都公募公債（20年）	100,000,000	90,716,000	
第747回東京都公募公債	500,000,000	503,095,000	
第750回東京都公募公債	200,000,000	201,282,000	
第751回東京都公募公債	500,000,000	502,480,000	
第757回東京都公募公債	150,000,000	149,632,500	
第758回東京都公募公債	150,000,000	149,632,500	
第782回東京都公募公債	100,000,000	99,802,000	
第783回東京都公募公債	400,000,000	399,032,000	
第807回東京都公募公債	200,000,000	196,102,000	
第809回東京都公募公債	100,000,000	97,844,000	
平成27年度第1回北海道公募公債	300,000,000	301,329,000	
平成27年度第5回北海道公募公債	100,000,000	100,698,000	
平成30年度第14回北海道公募公債	100,000,000	99,314,000	
令和3年度第14回北海道公募公債（5年）	400,000,000	398,000,000	
第36回2号宮城県公募公債	342,000,000	334,869,300	
第2回神奈川県公募公債（30年）	180,000,000	219,646,800	
第3回神奈川県公募公債（20年）	500,000,000	514,590,000	
第4回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	119,515,000	
第20回神奈川県公募公債（20年）	500,000,000	543,980,000	
第27回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	105,743,000	
第226回神奈川県公募公債	100,000,000	100,095,000	
第234回神奈川県公募公債	100,000,000	99,907,000	
第243回神奈川県公募公債	100,000,000	98,275,000	
第256回神奈川県公募公債	350,000,000	340,791,500	
第7回大阪府公募公債（20年）	220,000,000	241,003,400	
第11回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	108,932,000	
第179回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	99,734,000	
第184回大阪府公募公債（5年）	120,000,000	119,587,200	
第186回大阪府公募公債（5年）	300,000,000	298,860,000	
第191回大阪府公募公債（5年）	160,000,000	159,200,000	
第393回大阪府公募公債	110,000,000	110,492,800	
第400回大阪府公募公債	136,000,000	136,962,880	
第407回大阪府公募公債	200,000,000	199,792,000	

第410回大阪府公募公債	200,000,000	199,264,000	
第415回大阪府公募公債	100,000,000	99,946,000	
第417回大阪府公募公債	300,000,000	300,729,000	
第420回大阪府公募公債	100,000,000	99,932,000	
第426回大阪府公募公債	100,000,000	99,776,000	
第435回大阪府公募公債	130,000,000	129,344,800	
第439回大阪府公募公債	100,000,000	99,305,000	
第455回大阪府公募公債	148,000,000	145,327,120	
第460回大阪府公募公債	194,000,000	189,747,520	
第464回大阪府公募公債	800,000,000	777,184,000	
第465回大阪府公募公債	500,000,000	486,910,000	
第467回大阪府公募公債	200,000,000	194,988,000	
第471回大阪府公募公債	97,000,000	93,604,030	
第483回大阪府公募公債	200,000,000	202,024,000	
平成26年度第2回京都府公募公債（15年）	200,000,000	207,512,000	
平成26年度第5回京都府公募公債（20年）	100,000,000	106,398,000	
第1回兵庫県公募公債（15年）	400,000,000	415,460,000	
第2回兵庫県公募公債（20年）	300,000,000	323,658,000	
第2回兵庫県公募公債（30年）	90,000,000	103,923,900	
第4回兵庫県公募公債（12年）	300,000,000	304,515,000	
第5回兵庫県公募公債（12年）	400,000,000	406,840,000	
第5回兵庫県公募公債（15年）	200,000,000	208,924,000	
第6回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	104,705,000	
第9回兵庫県公募公債（15年）	800,000,000	828,336,000	
第9回兵庫県公募公債（20年）	200,000,000	221,656,000	
第27回兵庫県公募公債（20年）	200,000,000	186,312,000	
平成28年度第29回兵庫県公募公債	100,000,000	100,211,000	
令和5年度第4回兵庫県公募公債（グリーン）	100,000,000	99,515,000	
令和5年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	100,811,000	
第1回静岡県公募公債（15年）	100,000,000	104,293,000	
第6回静岡県公募公債（15年）	300,000,000	311,460,000	
第11回静岡県公募公債（20年）	550,000,000	600,913,500	
第14回静岡県公募公債（20年）	100,000,000	109,081,000	
平成27年度第10回静岡県公募公債	400,000,000	402,380,000	
令和2年度第15回静岡県公募公債（5年）	120,000,000	119,696,400	
令和2年度第13回静岡県公募公債（5年）	120,000,000	119,696,400	

平成20年度第8回愛知県公募公債(20年)	200,000,000	216,780,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	700,000,000	772,709,000	
平成23年度第13回愛知県公募公債	500,000,000	519,595,000	
平成24年度第14回愛知県公募公債(15年)	300,000,000	312,744,000	
平成27年度第7回愛知県公募公債	100,000,000	100,687,000	
平成27年度第16回愛知県公募公債	100,000,000	100,666,000	
平成29年度第5回愛知県公募公債	600,000,000	600,312,000	
平成30年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	99,646,000	
平成30年度第8回愛知県公募公債	200,000,000	199,586,000	
令和3年度第18回愛知県公募公債	100,000,000	97,361,000	
令和5年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	100,466,000	
平成23年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	109,582,000	
平成26年度第7回広島県公募公債	260,000,000	261,229,800	
平成28年度第1回広島県公募公債	100,000,000	99,893,000	
平成28年度第4回広島県公募公債	100,000,000	99,755,000	
平成28年度第1回広島県公募公債(20年)	100,000,000	93,026,000	
平成30年度第4回広島県公募公債	200,000,000	199,428,000	
令和3年度第7回広島県公募公債	100,000,000	97,131,000	
第2回埼玉県公募公債(サステナビリティ)	100,000,000	100,588,000	
第3回埼玉県公募公債	200,000,000	202,734,000	
第9回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	221,910,000	
第10回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	109,972,000	
第14回埼玉県公募公債(20年)	200,000,000	214,758,000	
第16回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	103,298,000	
平成30年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	99,691,000	
令和2年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	98,384,000	
令和3年度第2回埼玉県公募公債(5年)	110,000,000	109,712,900	
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	70,000,000	83,640,900	
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	80,000,000	91,980,000	
平成22年度第2回福岡県公募公債(20年)	800,000,000	890,808,000	
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	103,862,000	
平成27年度第7回福岡県公募公債	100,000,000	100,685,000	
令和2年度第4回福岡県公募公債	200,000,000	196,144,000	
令和5年度第1回福岡県公募公債(グリーン)	100,000,000	99,828,000	
令和5年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	99,560,000	
第9回千葉県公募公債(20年)	80,000,000	87,408,800	

第13回千葉県公募公債（20年）	300,000,000	326,688,000	
第14回千葉県公募公債（20年）	100,000,000	103,939,000	
平成27年度第3回千葉県公募公債	200,000,000	201,240,000	
平成27年度第6回千葉県公募公債	500,000,000	503,475,000	
平成28年度第3回千葉県公募公債	400,000,000	399,184,000	
平成30年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	99,080,000	
令和元年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	98,547,000	
令和5年度第7回千葉県公募公債（サステナビリティ）	100,000,000	100,194,000	
令和5年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	101,324,000	
平成27年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	100,202,000	
令和4年度第1回長野県公募公債	300,000,000	292,500,000	
令和5年度第2回長野県公募公債	100,000,000	100,376,000	
第2回群馬県公募公債（20年）	100,000,000	110,899,000	
第7回群馬県公募公債（20年）	100,000,000	92,297,000	
平成27年度第1回岐阜県公募公債	300,000,000	302,097,000	
令和2年度第2回岐阜県公募公債（5年）	100,000,000	99,829,000	
平成27年度第1回大分県公募公債	203,400,000	204,746,508	
第144回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,970,000	
第145回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,420,000	
第148回共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,495,000	
第150回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,370,000	
第151回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,276,000	
第152回共同発行市場公募地方債	700,000,000	705,082,000	
第153回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,390,000	
第158回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,786,000	
第172回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,123,000	
第173回共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,216,000	
第185回共同発行市場公募地方債	300,000,000	299,247,000	
第193回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,725,000	
第198回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,263,000	
第232回共同発行市場公募地方債	450,000,000	440,086,500	
令和元年度第3回堺市公募公債	100,000,000	98,423,000	
平成27年度第1回長崎県公募公債	300,000,000	302,097,000	
平成27年度第1回佐賀県公募公債	500,000,000	503,455,000	
平成29年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	99,884,000	

平成30年度第1回福島県公募公債	100,000,000	99,735,000	
第2回滋賀県公募公債（サステナビリティ）	100,000,000	100,631,000	
令和元年度第2回栃木県公募公債	100,000,000	98,380,000	
令和2年度第2回栃木県公募公債	100,000,000	97,828,000	
令和3年度第1回熊本県公募公債（5年）	200,000,000	199,334,000	
令和5年度第2回奈良県公募公債	200,000,000	200,908,000	
第5回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	110,049,000	
第15回大阪市公募公債（20年）	100,000,000	111,336,000	
令和2年度第3回大阪市公募公債（5年）	500,000,000	499,235,000	
第1回名古屋市公募公債（30年）	100,000,000	117,539,000	
第9回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	108,536,000	
第9回名古屋市公募公債（30年）	90,000,000	99,699,300	
第28回名古屋市公募公債（5年）	500,000,000	498,975,000	
第491回名古屋市公募公債	400,000,000	402,816,000	
第511回名古屋市公募公債	100,000,000	98,087,000	
第1回京都市公募公債（15年）	100,000,000	102,129,000	
第3回京都市公募公債（20年）	100,000,000	103,849,000	
第5回京都市公募公債（20年）	50,000,000	53,245,500	
平成18年度第3回神戸市公募公債（20年）	110,000,000	116,477,900	
平成20年度第24回神戸市公募公債（20年）	200,000,000	217,170,000	
平成22年度第4回神戸市公募公債	100,000,000	109,586,000	
平成23年度第4回神戸市公募公債（20年）	150,000,000	165,243,000	
第5回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	103,005,000	
第7回横浜市公募公債（20年）	450,000,000	467,055,000	
第19回横浜市公募公債（20年）	200,000,000	220,502,000	
平成27年度第2回横浜市公募公債	200,000,000	201,360,000	
平成27年度第3回横浜市公募公債	400,000,000	402,696,000	
平成27年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	302,010,000	
第27回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	108,088,000	
第33回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	92,576,000	
第35回横浜市公募公債（20年）	500,000,000	466,270,000	
第54回横浜市公募公債（5年）	300,000,000	299,487,000	
平成22年度第8回札幌市公募公債（30年）	80,000,000	91,448,000	
平成23年度第3回札幌市公募公債	100,000,000	110,355,000	
平成23年度第9回札幌市公募公債	600,000,000	624,696,000	
令和2年度第7回札幌市公募公債	200,000,000	195,286,000	

	令和3年度第2回札幌市公募公債（5年）	100,000,000	99,706,000	
	令和3年度第9回札幌市公募公債（5年）	100,000,000	99,694,000	
	第7回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	109,411,000	
	第12回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	110,983,000	
	第62回川崎市公募公債（5年）	490,000,000	488,368,300	
	第3回北九州市公募公債（サステナビリティ）	100,000,000	100,149,000	
	第17回北九州市公募公債（20年）	100,000,000	107,034,000	
	令和3年度第4回千葉市公募公債	100,000,000	96,532,000	
	令和5年度第4回千葉市公募公債（サステナビリティ）	100,000,000	100,720,000	
	平成26年度第4回福井県公募公債	100,000,000	100,444,000	
	令和2年度第2回徳島県公募公債	100,000,000	97,828,000	
	平成28年度第1回山梨県公募公債	200,000,000	199,522,000	
	平成30年度第1回山梨県公募公債	100,000,000	99,866,000	
	令和2年度第1回山梨県公募公債	700,000,000	685,398,000	
	第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	108,976,000	
地方債証券 合計		40,880,400,000	41,739,547,558	
特殊債券	第4回政府保証新関西国際空港債券	904,000,000	909,424,000	
	第21回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券	600,000,000	599,376,000	
	第6回神奈川県住宅供給公社債券	100,000,000	98,428,000	
	第36回日本政策投資銀行債券（財投機関債）	30,000,000	32,007,900	
	第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	123,942,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	140,000,000	147,011,200	
	第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	317,412,000	
	第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	30,000,000	36,611,100	
	第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	239,532,000	
	第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	213,376,000	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	110,000,000	130,033,200	
	第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	322,503,000	
	第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	200,000,000	215,524,000	
	第28回道路債券（財投機関債）	100,000,000	118,768,000	

第33回道路債券（財投機関債）	300,000,000	359,661,000	
第42回道路債券（財投機関債）	200,000,000	205,066,000	
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	150,000,000	164,454,000	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	108,743,000	
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,082,000	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,433,000	
第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,327,000	
第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,828,000	
第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,042,000	
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,525,000	
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	300,000,000	305,421,000	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	103,281,000	
第158回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,601,000	
第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	100,000,000	103,243,000	
第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,168,000	
第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,730,000	
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,793,000	
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,008,000	
第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,250,000,000	1,257,837,500	
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	101,617,110	
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,752,000	
第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,554,000	
第263回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,156,000	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,474,000	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	200,234,000	
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	299,478,000	

構債券			
第276回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	299,460,000	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,586,000	
第443回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	298,737,000	
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	50,000,000	55,028,500	
第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)	100,000,000	120,406,000	
第11回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	100,000,000	108,928,000	
第12回公営企業債券(20年)(財投機関債)	300,000,000	306,960,000	
第13回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	100,000,000	110,942,000	
第14回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	80,000,000	89,169,600	
第16回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	80,000,000	87,343,200	
第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)	150,000,000	157,324,500	
第22回公営企業債券(20年)(財投機関債)	1,000,000,000	1,070,960,000	
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	100,000,000	108,122,000	
第24回公営企業債券(20年)(財投機関債)	300,000,000	325,137,000	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	200,000,000	216,644,000	
第27回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	50,000,000	54,550,500	
第27回地方公共団体金融機構債券(5年)(財投機関債)	100,000,000	99,847,000	
第44回地方公共団体金融機構債券(20年)(財投機関債)	100,000,000	103,503,000	
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	302,000,000	303,812,000	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	400,000,000	402,312,000	
第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,541,000	
第77回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	300,000,000	301,869,000	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	150,000,000	150,840,000	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,116,000	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	674,000,000	672,894,640	
第83回政府保証地方公共団体金融機構債券	102,000,000	101,825,580	
F90回地方公共団体金融機構債券(財投機関債)	100,000,000	105,316,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	299,691,000	
第94回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,047,000	

第100回政府保証地方公共団体金融機構債券	325,000,000	323,982,750	
第101回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,962,000	
第102回政府保証地方公共団体金融機構債券	131,000,000	130,874,240	
F104回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	101,421,000	
第108回政府保証地方公共団体金融機構債券	223,000,000	222,132,530	
第115回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,688,000	
F131回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	70,000,000	74,869,900	
F151回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	104,108,000	
F203回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	200,000,000	206,292,000	
F234回地方公共団体金融機構債券（財投機関債）	100,000,000	106,853,000	
第27回首都高速道路	100,000,000	99,737,000	
第24回阪神高速道路	200,000,000	199,784,000	
第10回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	88,309,600	
第15回日本政策金融公庫（財投機関債）	80,000,000	87,346,400	
第48回福祉医療機構債券（財投機関債）	400,000,000	399,704,000	
第54回福祉医療機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,517,000	
第4回中部国際空港（財投機関債）	200,000,000	200,154,000	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	31,793,000	31,594,929	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	33,053,000	32,910,872	
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	38,270,000	37,954,272	
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	54,909,000	54,427,997	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	10,179,000	10,226,026	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,596,000	19,522,824	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,696,000	19,578,077	
第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,938,000	19,788,316	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,199,000	19,015,407	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,102,000	36,554,169	
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,334,000	37,792,446	
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,783,000	20,546,030	
第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,356,000	39,461,803	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,695,000	23,598,941	
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,484,000	90,341,186	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,688,000	55,787,200	

第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,641,000	16,217,683	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,234,000	34,529,128	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,870,000	35,118,109	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,154,000	36,393,530	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,938,000	38,249,299	
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,752,000	41,075,344	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,812,000	43,202,249	
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,522,000	24,305,517	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,663,000	24,469,908	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,248,000	51,998,137	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,022,000	52,608,784	
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,466,000	52,912,709	
第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,916,000	29,657,984	
第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,663,000	29,278,681	
第65回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,816,000	203,295,324	
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,115,000	97,150,461	
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,725,000	30,552,841	
第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,618,000	34,645,029	
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,340,000	29,085,625	
第77回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	30,000,000	31,146,600	
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,612,000	30,217,269	
第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,296,000	33,918,968	
第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,100,000	36,677,961	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,024,000	143,135,129	
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,502,000	74,587,624	
第88回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	109,234,000	
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,411,000	39,798,804	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	120,912,000	121,543,160	
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,783,000	42,631,548	
第93回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	207,990,000	
第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,940,000	53,821,871	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,473,000	51,158,499	
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,722,000	52,812,681	
第100回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	200,000,000	219,232,000	

第102回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	103,879,000	
第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,996,000	55,833,611	
第106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,362,000	114,564,089	
第107回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	120,866,000	117,375,389	
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	257,248,000	248,406,386	
第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	326,270,000	312,772,210	
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	529,072,000	505,062,712	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	137,012,000	132,496,084	
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	476,497,000	461,430,164	
第121回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	130,000,000	145,694,900	
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	212,163,000	204,616,362	
第123回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	108,973,000	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,480,000	67,810,922	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,609,000	69,660,348	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,161,000	68,422,013	
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,924,000	140,507,301	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,918,000	140,250,544	
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,837,000	69,832,473	
第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,218,000	69,264,283	
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	220,017,000	211,231,721	
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,968,000	70,796,991	
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,982,000	71,982,720	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	150,890,000	145,127,510	
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,522,000	144,166,121	
第143回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	103,835,000	
第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,334,000	148,799,126	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	240,978,000	225,215,629	
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	245,436,000	230,270,509	
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,726,000	156,173,553	
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,461,000	78,157,360	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,562,000	156,911,385	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,701,000	81,176,844	
第161回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	101,617,000	

第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,494,000	164,040,311	
第164回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	100,595,000	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,356,000	82,586,362	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	262,806,000	249,037,593	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	177,992,000	168,416,030	
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	178,010,000	168,379,659	
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,630,000	170,005,343	
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,740,000	84,446,237	
第174回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	180,000,000	182,268,000	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,729,000	86,635,288	
第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,276,000	172,325,259	
第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,662,000	173,850,775	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,829,000	87,580,072	
第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	184,300,000	175,258,242	
第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,366,000	88,238,163	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,966,000	88,727,680	
第182回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,760,000	179,053,568	
第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,336,000	179,945,631	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	189,224,000	180,322,903	
第186回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,437,000	92,924,143	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,212,000	191,552,712	
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,613,000	96,820,717	
第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,114,000	96,828,484	
第192回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	388,900,000	390,622,827	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,649,000	97,394,136	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,256,000	97,828,586	
第194回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	99,694,000	
第195回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,728,000	196,616,768	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	297,258,000	298,066,541	
第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,538,000	200,032,991	
第198回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,664,000	202,900,553	
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	400,000,000	404,096,000	
第200回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,926,000	
第203回一般担保住宅金融支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	100,047,000	

第6回沖縄振興開発金融公庫債券（財投機関債）	50,000,000	51,382,000	
い第843号商工債券	200,000,000	199,652,000	
い第848号商工債券	100,000,000	99,672,000	
い第850号商工債券	300,000,000	298,839,000	
い第852号商工債券	100,000,000	99,525,000	
い第854号商工債券	500,000,000	497,270,000	
い第857号商工債券	100,000,000	99,373,000	
い第871号商工債券	200,000,000	199,492,000	
い第872号商工債券	400,000,000	400,400,000	
第376回信金中金債	100,000,000	99,679,000	
第280号商工債券（3年）	200,000,000	199,690,000	
第2回信金中金債（10年）	100,000,000	100,582,000	
第7回国際協力機構債券（財投機関債）	70,000,000	77,039,200	
第83回東日本高速道路	400,000,000	398,436,000	
第29回西日本高速道路	200,000,000	200,460,000	
第56回西日本高速道路	900,000,000	898,299,000	
第61回西日本高速道路	700,000,000	697,095,000	
第72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券（財投機関債）	100,000,000	102,725,000	
特殊債券 合計	35,303,420,000	35,730,844,935	
社債券			
第19回フランス相互信用連合銀行	100,000,000	100,619,000	
第29回フランス相互信用連合銀行	200,000,000	199,632,000	
第35回フランス相互信用連合銀行	500,000,000	492,810,000	
第38回フランス相互信用連合銀行	300,000,000	300,813,000	
第6回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	200,054,000	
第21回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	300,000,000	300,006,000	
第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	100,000,000	98,364,000	
第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	199,446,000	
第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	200,000,000	198,456,000	
第36回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	400,000,000	400,672,000	
第1回サンタンドール銀行（2019）	500,000,000	498,885,000	
第12回新関西国際空港	100,000,000	103,203,000	
第27回新関西国際空港	100,000,000	99,660,000	
第32回成田国際空港	100,000,000	98,714,000	
第17回ナショナル・オーストラリア銀行	300,000,000	300,006,000	
第1回国際石油開発帝石	100,000,000	99,465,000	

第48回鹿島建設（サステナビリティ）	100,000,000	100,393,000	
第10回明治ホールディングス（サステナビリティ）	200,000,000	198,992,000	
第16回アサヒグループホールディングス	100,000,000	99,586,000	
第19回アサヒグループホールディングス	400,000,000	400,124,000	
第21回麒麟ホールディングス（ソーシャル）	300,000,000	298,806,000	
第22回麒麟ホールディングス（ソーシャル）	100,000,000	100,584,000	
第9回サントリーホールディングス	500,000,000	499,185,000	
第22回味の素	100,000,000	100,160,000	
第3回 キューピー	100,000,000	99,926,000	
第13回日本たばこ産業	400,000,000	397,080,000	
第16回日本たばこ産業	300,000,000	299,103,000	
第6回ヒューリック	400,000,000	396,308,000	
第24回森ヒルズリート投資法人（グリーン）	300,000,000	300,921,000	
第27回東急不動産ホールディングス（グリーン）	300,000,000	299,964,000	
第9回クラレ	100,000,000	99,729,000	
第22回旭化成	100,000,000	100,216,000	
第42回王子ホールディングス	300,000,000	298,413,000	
第4回野村総合研究所	100,000,000	99,122,000	
第12回野村総合研究所	200,000,000	200,630,000	
第6回花王	200,000,000	199,498,000	
第1回アステラス製薬	400,000,000	399,840,000	
第17回Zホールディングス	100,000,000	99,807,000	
第22回Zホールディングス	200,000,000	199,120,000	
第7回住友三井オートサービス（サステナビリティ）	100,000,000	99,166,000	
第8回住友三井オートサービス（サステナビリティ）	100,000,000	99,988,000	
第11回ブリヂストン	500,000,000	498,330,000	
第12回日本電気硝子	100,000,000	98,953,000	
第4回新日本製鐵	200,000,000	199,614,000	
第36回ジェイ エフ イー ホールディングス	400,000,000	398,408,000	
第1回住友生命2023基金	400,000,000	398,436,000	
第14回LIXIL	200,000,000	199,478,000	
第1回日本郵政（グリーン）	100,000,000	99,484,000	
第4回日本郵政	500,000,000	503,160,000	
第30回ダイキン工業	200,000,000	198,076,000	

第55回日本精工	100,000,000	99,945,000	
第19回日立製作所	100,000,000	99,293,000	
第17回パナソニック	500,000,000	500,975,000	
第22回パナソニック	100,000,000	98,940,000	
第24回パナソニックホールディングス	300,000,000	300,351,000	
第25回パナソニックホールディングス	400,000,000	402,564,000	
第18回デンソー	300,000,000	298,518,000	
第40回三菱重工業	300,000,000	298,374,000	
第26回トヨタ自動車（サステナビリティ）	800,000,000	796,240,000	
第27回トヨタ自動車（サステナビリティ）	100,000,000	96,905,000	
第31回トヨタ自動車（サステナビリティ）	200,000,000	197,302,000	
第4回ヤマハ発動機	100,000,000	99,941,000	
第1回明治安田生命2019基金	200,000,000	199,840,000	
第7回アシックス	100,000,000	100,760,000	
第63回三井物産	400,000,000	425,904,000	
第51回住友商事	100,000,000	102,981,000	
第61回住友商事	100,000,000	100,531,000	
第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ	300,000,000	299,940,000	
第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ	500,000,000	490,240,000	
第23回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	220,800,000	
第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	204,288,000	
第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付	200,000,000	205,544,000	
第30回三菱東京UFJ銀行（劣後特約付）	100,000,000	108,251,000	
第88回三菱東京UFJ銀行	100,000,000	106,328,000	
第15回みずほフィナンシャルグループ劣後特約付	100,000,000	97,786,000	
第18回みずほ銀行（劣後特約付）	100,000,000	103,255,000	
第38回芙蓉総合リース（サステナビリティ）	400,000,000	402,980,000	
第7回みずほリース	200,000,000	198,314,000	
第21回みずほリース	300,000,000	299,805,000	
第22回みずほリース（サステナビリティ）	300,000,000	300,528,000	
第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	1,200,000,000	1,196,952,000	
第17回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス	300,000,000	298,212,000	
第25回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）	300,000,000	299,334,000	
第26回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）	200,000,000	196,092,000	
第28回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス（グリーン）	300,000,000	301,389,000	

ン)			
第29回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス (グリーン)	300,000,000	302,991,000	
第30回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス (グリーン)	200,000,000	202,236,000	
第53回日産フィナンシャルサービス	300,000,000	297,492,000	
第56回日産フィナンシャルサービス	500,000,000	497,515,000	
第57回日産フィナンシャルサービス	400,000,000	396,020,000	
第30回東京センチュリー	100,000,000	98,935,000	
第34回東京センチュリー	300,000,000	294,855,000	
第96回トヨタファイナンス	800,000,000	796,112,000	
第22回ポケットカード	100,000,000	99,593,000	
第24回ポケットカード	300,000,000	301,617,000	
第79回アコム	300,000,000	299,856,000	
第80回アコム	200,000,000	199,298,000	
第81回アコム	100,000,000	99,090,000	
第84回アコム	300,000,000	300,195,000	
第189回オリックス	200,000,000	200,168,000	
第220回オリックス	400,000,000	401,704,000	
第34回三井住友ファイナンス&リース	300,000,000	300,462,000	
第3回野村ホールディングス	200,000,000	198,132,000	
第24回野村ホールディングス	100,000,000	102,550,000	
第27回野村ホールディングス	100,000,000	102,575,000	
第83回三井不動産 (グリーン)	200,000,000	196,214,000	
第137回三菱地所	300,000,000	299,454,000	
第142回三菱地所 (サステナビリティ)	200,000,000	199,802,000	
第143回三菱地所	100,000,000	99,185,000	
第111回住友不動産 (グリーン)	100,000,000	100,091,000	
第13回森トラスト総合リート投資法人	200,000,000	199,992,000	
第20回森トラストリート投資法人	200,000,000	200,218,000	
第76回東京急行電鉄	200,000,000	208,244,000	
第36回京王電鉄	200,000,000	199,720,000	
第53回東日本旅客鉄道	300,000,000	324,396,000	
第71回東日本旅客鉄道	400,000,000	432,876,000	
第100回東日本旅客鉄道	200,000,000	207,344,000	
第163回東日本旅客鉄道	600,000,000	597,084,000	
第73回西日本旅客鉄道	400,000,000	398,040,000	

第42回東海旅客鉄道	100,000,000	109,211,000	
第53回東海旅客鉄道	100,000,000	107,467,000	
第28回東京地下鉄	300,000,000	297,423,000	
第50回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	198,642,000	
第58回阪急阪神ホールディングス	200,000,000	199,294,000	
第68回名古屋鉄道（サステナビリティ）	200,000,000	198,778,000	
第1回横浜高速鉄道	300,000,000	301,236,000	
第31回KDDI（サステナビリティ）	200,000,000	199,714,000	
第9回ソフトバンク	600,000,000	591,528,000	
第13回ソフトバンク	500,000,000	471,280,000	
第16回ソフトバンク	500,000,000	468,385,000	
第21回ソフトバンク	700,000,000	696,269,000	
第22回ソフトバンク	300,000,000	296,844,000	
第548回東京電力	100,000,000	103,171,000	
第567回東京電力	100,000,000	100,691,000	
第508回関西電力	200,000,000	200,032,000	
第510回関西電力	500,000,000	500,000,000	
第511回関西電力	100,000,000	99,655,000	
第518回関西電力	200,000,000	198,742,000	
第524回関西電力	200,000,000	198,762,000	
第393回中国電力	100,000,000	99,671,000	
第400回中国電力	200,000,000	199,014,000	
第409回中国電力	200,000,000	198,072,000	
第433回中国電力	700,000,000	696,745,000	
第448回中国電力	200,000,000	196,432,000	
第322回北陸電力	100,000,000	99,744,000	
第485回東北電力	100,000,000	99,747,000	
第492回東北電力	300,000,000	299,853,000	
第494回東北電力	200,000,000	199,794,000	
第529回東北電力	500,000,000	496,975,000	
第552回東北電力	400,000,000	404,512,000	
第449回九州電力	300,000,000	300,000,000	
第468回九州電力	100,000,000	99,212,000	
第471回九州電力	300,000,000	297,321,000	
第484回九州電力	400,000,000	391,540,000	
第503回九州電力	600,000,000	598,632,000	

第511回九州電力	600,000,000	601,860,000	
第49回電源開発	500,000,000	499,450,000	
第50回電源開発	200,000,000	199,630,000	
第57回電源開発	100,000,000	98,991,000	
第59回電源開発	300,000,000	297,198,000	
第64回電源開発	600,000,000	592,086,000	
第67回電源開発	200,000,000	195,076,000	
第86回電源開発	100,000,000	98,260,000	
第6回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,666,000	
第13回東京電力パワーグリッド	300,000,000	300,147,000	
第15回東京電力パワーグリッド	100,000,000	98,996,000	
第25回東京電力パワーグリッド	100,000,000	100,794,000	
第28回東京電力パワーグリッド	400,000,000	402,768,000	
第31回東京電力パワーグリッド	300,000,000	301,092,000	
第33回東京電力パワーグリッド	200,000,000	200,524,000	
第35回東京電力パワーグリッド	100,000,000	101,102,000	
第39回東京電力パワーグリッド	400,000,000	400,760,000	
第47回東京電力パワーグリッド	200,000,000	192,180,000	
第49回東京電力パワーグリッド	400,000,000	399,768,000	
第16回JERA	200,000,000	200,350,000	
第17回JERA	200,000,000	200,492,000	
第20回JERA	600,000,000	600,126,000	
第21回JERA	200,000,000	200,338,000	
第3回東京電力リニューアブルパワー（グリーン）	400,000,000	401,896,000	
第51回大阪ガス	100,000,000	98,487,000	
第13回広島ガス	200,000,000	197,878,000	
第7回ファーストリテイリング	100,000,000	99,597,000	
社債券 合計	47,900,000,000	47,869,763,000	
合計	784,272,820,000	777,069,953,713	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

外国債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年1月5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	3,227,777,041
コール・ローン	2,549,869,343
国債証券	511,444,049,889
派生商品評価勘定	44,224,965
未収入金	8,139,356,292
未収利息	3,616,755,056
前払費用	370,690,268
流動資産合計	529,392,722,854
資産合計	529,392,722,854
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	41,051,539
未払金	8,252,070,436
未払解約金	339,608,298
未払利息	581
流動負債合計	8,632,730,854
負債合計	8,632,730,854
純資産の部	
元本等	
元本	204,001,587,526
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	316,758,404,474
元本等合計	520,759,992,000
純資産合計	520,759,992,000
負債純資産合計	529,392,722,854

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	公社債は時価で評価しております。時価評価にあたっては、価格情報会社等の提供する理論価格で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年1月5日現在]
1. 期首 期首元本額	2023年7月6日 189,747,983,220円

期中追加設定元本額	24,236,450,237円
期中一部解約元本額	9,982,845,931円
元本の内訳※	
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定型)	280,883,757円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(安定成長型)	642,931,961円
三菱UFJ ライフセレクトファンド(成長型)	405,386,234円
三菱UFJ 外国債券オープン	838,672,763円
三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)	2,138,309,206円
三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)	6,137,521,776円
三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)	4,793,010,875円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	536,720,242円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	94,583,374円
ファンド・マネジャー(海外債券)	924,903,413円
eMAXIS 先進国債券インデックス	6,027,244,702円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,361,037,474円
eMAXIS バランス(波乗り型)	212,848,405円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	1,012,694,511円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030(確定拠出年金)	420,928,485円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040(確定拠出年金)	236,225,968円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050(確定拠出年金)	157,264,859円
eMAXIS Slim 先進国債券インデックス	36,671,093,561円
海外債券セレクション(ラップ向け)	5,794,847,787円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	11,568,269,271円
つみたて8資産均等バランス	5,668,641,619円
つみたて4資産均等バランス	2,018,639,157円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	4,450,644円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	2,325,182円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	525,287円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035(確定拠出年金)	231,753,656円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045(確定拠出年金)	154,861,583円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055(確定拠出年金)	87,428,009円
三菱UFJ DC年金バランス(株式15)	798,075,113円
三菱UFJ DC年金バランス(株式40)	1,202,410,900円
三菱UFJ DC年金バランス(株式65)	1,788,283,594円
三菱UFJ DC年金インデックス(先進国債券)	2,031,022,292円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060(確定拠出年金)	73,608,763円
三菱UFJ DC年金バランス(株式25)	176,539,705円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065(確定拠出年金)	33,411,988円
ラップ向けインデックスf 先進国債券	2,759,565,875円
三菱UFJ DC年金バランス(株式80)	28,925,419円
ダイナミックアロケーションファンド(ラップ向け)	4,021,839,748円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	76,839,332円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	40,233,091円
アクティブアロケーションファンド(ラップ向け)	54,433,336円
三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070(確定拠出年金)	201,354円
三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)	3,097,001,108円

三菱UFJ 外国債券オープン (毎月分配型)	16,897,163,187円
ワールド・インカムオープン	997,117,253円
三菱UFJ DC海外債券インデックスファンド	15,579,342,363円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (毎月分配型)	408,979,315円
三菱UFJ 世界国債インデックスファンド (年1回決算型)	2,082,335,829円
eMAXIS バランス (4資産均等型)	804,653,372円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	515,360,345円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	280,220,121円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	322,397,420円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	171,858,270円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	68,203,525円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA (適格機関投資家限定)	1,015,077,741円
三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型) VA (適格機関投資家限定)	103円
三菱UFJ 外国債券ファンドVA2 (適格機関投資家限定)	10,768,443円
MUAM 世界債券オープン (適格機関投資家限定)	1,104,363,036円
三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)	11,128,596円
三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,531,462,765円
三菱UFJ バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定)	1,137,711,042円
MUAM 外国債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)	41,610,136,623円
三菱UFJ バランスファンドVA 50型 (適格機関投資家限定)	469,398,237円
三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	384,288円
三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)	102,333円
三菱UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)	1,274,012,888円
アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)	62,425,371円
アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)	108,652,517円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)	1,031,658,432円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	30,492,456円
MUKAM 外国債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)	2,493,195,812円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)	655,362,166円
外国債券インデックスファンドV (適格機関投資家限定)	757,069,799円
海外債券インデックスファンドS	3,782,585,237円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA	1,616,152円
インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA	2,692,686円
インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA	495,798円
インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA	880,706円
三菱UFJ 外国債券インデックスファンドVA	4,605,940円
三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)	3,552,428円
三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)	7,338,404円
三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)	3,383,459円
三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)	8,511,826円
三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド	1,751,149,518円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)	196,594,915円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)	558,480,567円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)	455,065,651円
三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド	187,205,212円

(積極型) 合計	204,001,587,526 円
2. 受益権の総数	204,001,587,526 口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023 年 7 月 6 日 至 2024 年 1 月 5 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号)第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、公社債等に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ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または計算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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024 年 1 月 5 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024 年 1 月 5 日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	△824,106,089
合計	△824,106,089

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)
取引の時価等に関する事項
通貨関連

[2024年1月5日現在]

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	3,407,849,200	—	3,439,912,000	32,062,800
	カナダドル	212,883,960	—	214,958,314	2,074,354
	オーストラリアドル	18,478,260	—	18,476,949	△1,311
	イギリスポンド	360,439,053	—	364,205,526	3,766,473
	シンガポールドル	6,543,780	—	6,543,234	△546
	マレーシアリンギット	26,332,400	—	26,515,370	182,970
	ニュージーランドドル	8,944,500	—	9,039,580	95,080
	メキシコペソ	9,874,036	—	9,869,396	△4,640
	イスラエルシェケル	92,003,910	—	93,010,885	1,006,975
	ポーランドズロチ	75,231,298	—	76,239,457	1,008,159
	中国元	2,479,348,000	—	2,483,361,598	4,013,598
	ユーロ	414,261,810	—	414,245,628	△16,182
	売建				
	アメリカドル	1,040,575,800	—	1,052,180,184	△11,604,384
	オーストラリアドル	55,926,616	—	56,410,626	△484,010
	シンガポールドル	21,574,000	—	21,813,420	△239,420
	オフショア元	665,899,180	—	666,061,370	△162,190
	ユーロ	1,995,332,925	—	2,023,857,225	△28,524,300
合計		10,891,498,728	—	10,976,700,762	3,173,426

(注) 時価の算定方法

- 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 - ①為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。
 - ②当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - (イ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、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対顧客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。
 - (ロ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024年1月5日現在]
1口当たり純資産額	2,5527円
(1万口当たり純資産額)	(25,527円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
アメリカドル	国債証券	0.25 T-NOTE 250531	5,000,000.00	4,704,785.15	
		0.25 T-NOTE 250630	6,650,000.00	6,241,258.81	
		0.25 T-NOTE 250731	5,800,000.00	5,426,398.45	
		0.25 T-NOTE 250831	6,700,000.00	6,249,320.34	
		0.25 T-NOTE 250930	7,600,000.00	7,068,742.21	
		0.25 T-NOTE 251031	10,300,000.00	9,552,445.36	
		0.375 T-NOTE 250430	4,670,000.00	4,415,703.92	
		0.375 T-NOTE 251130	10,150,000.00	9,409,565.41	
		0.375 T-NOTE 251231	8,500,000.00	7,861,835.98	
		0.375 T-NOTE 260131	7,700,000.00	7,099,339.86	
		0.375 T-NOTE 270731	7,150,000.00	6,281,386.68	
		0.375 T-NOTE 270930	7,300,000.00	6,377,947.29	
		0.5 T-NOTE 250331	6,500,000.00	6,175,761.73	
		0.5 T-NOTE 260228	9,900,000.00	9,129,462.90	
		0.5 T-NOTE 270430	5,280,000.00	4,697,137.52	
		0.5 T-NOTE 270531	4,280,000.00	3,797,162.50	
		0.5 T-NOTE 270630	5,900,000.00	5,220,232.44	
		0.5 T-NOTE 270831	4,950,000.00	4,357,063.45	
		0.5 T-NOTE 271031	7,900,000.00	6,916,357.41	
		0.625 T-NOTE 260731	7,930,000.00	7,242,939.88	
0.625 T-NOTE 270331	3,800,000.00	3,403,300.78			

0.625 T-NOTE 271130	7,550,000.00	6,625,862.33	
0.625 T-NOTE 271231	8,630,000.00	7,554,452.50	
0.625 T-NOTE 300515	12,090,000.00	9,819,582.99	
0.625 T-NOTE 300815	16,160,000.00	13,021,740.60	
0.75 T-NOTE 260331	8,100,000.00	7,499,460.97	
0.75 T-NOTE 260430	9,200,000.00	8,492,570.32	
0.75 T-NOTE 260531	8,200,000.00	7,549,925.81	
0.75 T-NOTE 260831	10,100,000.00	9,234,398.48	
0.75 T-NOTE 280131	8,850,000.00	7,767,603.49	
0.875 T-NOTE 260630	8,300,000.00	7,655,453.12	
0.875 T-NOTE 260930	10,000,000.00	9,159,375.00	
0.875 T-NOTE 301115	16,730,000.00	13,656,189.23	
1 T-NOTE 280731	9,150,000.00	8,011,253.95	
1.125 T-BOND 400515	6,020,000.00	3,824,816.39	
1.125 T-BOND 400815	8,350,000.00	5,251,367.18	
1.125 T-NOTE 250228	4,150,000.00	3,983,675.80	
1.125 T-NOTE 261031	10,450,000.00	9,611,959.00	
1.125 T-NOTE 270228	2,950,000.00	2,692,739.26	
1.125 T-NOTE 280229	9,760,000.00	8,685,637.54	
1.125 T-NOTE 280831	9,970,000.00	8,760,163.82	
1.125 T-NOTE 310215	16,360,000.00	13,558,350.00	
1.25 T-BOND 500515	9,420,000.00	4,981,008.97	
1.25 T-NOTE 261130	11,360,000.00	10,469,171.85	
1.25 T-NOTE 261231	8,200,000.00	7,546,242.20	
1.25 T-NOTE 280331	9,950,000.00	8,883,678.69	
1.25 T-NOTE 280430	9,740,000.00	8,678,111.69	
1.25 T-NOTE 280531	9,750,000.00	8,670,073.23	
1.25 T-NOTE 280630	9,680,000.00	8,592,134.39	
1.25 T-NOTE 280930	10,700,000.00	9,437,107.46	
1.25 T-NOTE 310815	17,720,000.00	14,561,202.32	
1.375 T-BOND 401115	8,400,000.00	5,491,007.84	
1.375 T-BOND 500815	10,430,000.00	5,697,387.50	
1.375 T-NOTE 260831	3,800,000.00	3,532,367.17	
1.375 T-NOTE 281031	8,250,000.00	7,306,728.49	
1.375 T-NOTE 281231	8,700,000.00	7,677,919.91	
1.375 T-NOTE 311115	18,100,000.00	14,919,773.52	

1. 5 T-NOTE 250215	6,300,000.00	6,077,039.09	
1. 5 T-NOTE 260815	9,740,000.00	9,089,398.38	
1. 5 T-NOTE 270131	11,540,000.00	10,674,274.62	
1. 5 T-NOTE 281130	9,700,000.00	8,629,021.44	
1. 5 T-NOTE 300215	8,740,000.00	7,567,781.67	
1. 625 T-BOND 501115	10,140,000.00	5,925,760.53	
1. 625 T-NOTE 260215	9,760,000.00	9,227,775.00	
1. 625 T-NOTE 260515	7,670,000.00	7,218,488.65	
1. 625 T-NOTE 260930	2,100,000.00	1,963,171.87	
1. 625 T-NOTE 261031	3,350,000.00	3,125,641.58	
1. 625 T-NOTE 261130	3,400,000.00	3,167,312.50	
1. 625 T-NOTE 290815	7,050,000.00	6,237,873.06	
1. 625 T-NOTE 310515	16,640,000.00	14,173,249.95	
1. 75 T-BOND 410815	11,370,000.00	7,795,334.19	
1. 75 T-NOTE 250315	9,030,000.00	8,720,651.97	
1. 75 T-NOTE 261231	4,700,000.00	4,388,992.16	
1. 75 T-NOTE 290131	8,600,000.00	7,719,507.83	
1. 75 T-NOTE 291115	5,150,000.00	4,569,619.15	
1. 875 T-BOND 410215	10,700,000.00	7,586,550.80	
1. 875 T-BOND 510215	11,810,000.00	7,358,414.29	
1. 875 T-BOND 511115	10,450,000.00	6,484,918.98	
1. 875 T-NOTE 260630	3,500,000.00	3,309,892.56	
1. 875 T-NOTE 260731	5,500,000.00	5,188,691.42	
1. 875 T-NOTE 270228	7,700,000.00	7,192,882.77	
1. 875 T-NOTE 290228	7,800,000.00	7,035,691.41	
1. 875 T-NOTE 320215	16,860,000.00	14,390,273.35	
2 T-BOND 411115	9,720,000.00	6,937,839.82	
2 T-BOND 500215	7,790,000.00	5,033,831.07	
2 T-BOND 510815	11,990,000.00	7,690,695.09	
2 T-NOTE 250215	8,110,000.00	7,865,749.58	
2 T-NOTE 250815	11,490,000.00	11,041,171.87	
2 T-NOTE 261115	7,550,000.00	7,113,810.52	
2. 125 T-NOTE 250515	6,970,000.00	6,741,296.87	
2. 125 T-NOTE 260531	5,000,000.00	4,761,328.10	
2. 25 T-BOND 410515	9,190,000.00	6,905,064.47	
2. 25 T-BOND 460815	5,040,000.00	3,529,575.00	

2.25 T-BOND 490815	6,580,000.00	4,518,095.27	
2.25 T-BOND 520215	9,580,000.00	6,521,510.18	
2.25 T-NOTE 251115	10,290,000.00	9,892,066.35	
2.25 T-NOTE 260331	4,500,000.00	4,306,816.39	
2.25 T-NOTE 270215	6,810,000.00	6,441,435.37	
2.25 T-NOTE 270815	6,190,000.00	5,813,884.95	
2.25 T-NOTE 271115	7,500,000.00	7,022,021.46	
2.375 T-BOND 420215	7,850,000.00	5,945,148.43	
2.375 T-BOND 491115	6,910,000.00	4,874,924.00	
2.375 T-BOND 510515	11,570,000.00	8,113,914.42	
2.375 T-NOTE 260430	2,000,000.00	1,917,070.32	
2.375 T-NOTE 270515	9,070,000.00	8,585,499.01	
2.375 T-NOTE 290331	7,500,000.00	6,927,246.07	
2.375 T-NOTE 290515	7,480,000.00	6,897,085.91	
2.5 T-BOND 450215	5,050,000.00	3,771,324.24	
2.5 T-BOND 460215	4,030,000.00	2,979,523.83	
2.5 T-BOND 460515	4,210,000.00	3,105,039.44	
2.5 T-NOTE 250131	3,350,000.00	3,270,083.84	
2.5 T-NOTE 260228	3,450,000.00	3,321,568.36	
2.5 T-NOTE 270331	7,700,000.00	7,332,144.51	
2.625 T-NOTE 250331	1,960,000.00	1,912,225.00	
2.625 T-NOTE 250415	9,000,000.00	8,771,835.96	
2.625 T-NOTE 251231	3,200,000.00	3,095,624.99	
2.625 T-NOTE 260131	3,900,000.00	3,769,136.70	
2.625 T-NOTE 270531	7,900,000.00	7,534,933.57	
2.625 T-NOTE 290215	9,640,000.00	9,029,215.57	
2.625 T-NOTE 290731	5,600,000.00	5,217,406.26	
2.75 T-BOND 420815	2,120,000.00	1,697,200.78	
2.75 T-BOND 421115	3,700,000.00	2,953,062.50	
2.75 T-BOND 470815	4,860,000.00	3,727,961.70	
2.75 T-BOND 471115	5,110,000.00	3,917,932.81	
2.75 T-NOTE 250228	3,440,000.00	3,363,607.81	
2.75 T-NOTE 250515	6,400,000.00	6,240,750.01	
2.75 T-NOTE 250630	2,370,000.00	2,309,083.60	
2.75 T-NOTE 250831	4,050,000.00	3,936,647.46	
2.75 T-NOTE 270430	6,400,000.00	6,133,374.97	

2.75 T-NOTE 270731	7,650,000.00	7,313,818.37	
2.75 T-NOTE 280215	9,990,000.00	9,503,963.12	
2.75 T-NOTE 290531	6,300,000.00	5,918,677.75	
2.75 T-NOTE 320815	15,460,000.00	14,050,482.73	
2.875 T-BOND 430515	4,680,000.00	3,794,090.60	
2.875 T-BOND 450815	3,500,000.00	2,783,593.75	
2.875 T-BOND 461115	2,340,000.00	1,846,589.05	
2.875 T-BOND 490515	7,170,000.00	5,608,284.37	
2.875 T-BOND 520515	9,820,000.00	7,686,451.59	
2.875 T-NOTE 250430	6,000,000.00	5,862,070.32	
2.875 T-NOTE 250531	4,230,000.00	4,129,207.05	
2.875 T-NOTE 250615	7,800,000.00	7,612,312.50	
2.875 T-NOTE 250731	6,100,000.00	5,945,951.14	
2.875 T-NOTE 251130	3,800,000.00	3,694,460.92	
2.875 T-NOTE 280515	10,090,000.00	9,628,658.36	
2.875 T-NOTE 280815	10,310,000.00	9,817,657.17	
2.875 T-NOTE 290430	7,000,000.00	6,623,476.58	
2.875 T-NOTE 320515	15,480,000.00	14,240,390.70	
3 T-BOND 420515	1,920,000.00	1,603,762.50	
3 T-BOND 441115	3,560,000.00	2,908,839.83	
3 T-BOND 450515	2,790,000.00	2,271,234.37	
3 T-BOND 451115	2,000,000.00	1,622,773.44	
3 T-BOND 470215	5,030,000.00	4,052,490.21	
3 T-BOND 470515	3,390,000.00	2,727,956.83	
3 T-BOND 480215	5,970,000.00	4,791,974.39	
3 T-BOND 480815	7,070,000.00	5,668,703.93	
3 T-BOND 490215	7,800,000.00	6,250,359.33	
3 T-BOND 520815	8,670,000.00	6,968,173.84	
3 T-NOTE 250715	6,700,000.00	6,548,595.67	
3 T-NOTE 250930	5,400,000.00	5,266,687.50	
3 T-NOTE 251031	3,300,000.00	3,217,500.00	
3.125 T-BOND 411115	1,990,000.00	1,708,679.29	
3.125 T-BOND 420215	2,200,000.00	1,882,332.03	
3.125 T-BOND 430215	2,850,000.00	2,405,522.46	
3.125 T-BOND 440815	4,130,000.00	3,453,067.18	
3.125 T-BOND 480515	6,010,000.00	4,933,599.62	

3. 125 T-NOTE 250815	5,000,000.00	4,893,066.40	
3. 125 T-NOTE 270831	7,300,000.00	7,066,171.87	
3. 125 T-NOTE 281115	8,280,000.00	7,956,885.91	
3. 125 T-NOTE 290831	5,900,000.00	5,637,380.85	
3. 25 T-BOND 420515	6,950,000.00	6,021,251.97	
3. 25 T-NOTE 270630	6,300,000.00	6,133,148.40	
3. 25 T-NOTE 290630	6,170,000.00	5,941,637.68	
3. 375 T-BOND 420815	6,300,000.00	5,549,783.20	
3. 375 T-BOND 440515	3,380,000.00	2,943,636.72	
3. 375 T-BOND 481115	6,920,000.00	5,938,360.14	
3. 375 T-NOTE 330515	16,100,000.00	15,322,671.87	
3. 5 T-BOND 390215	1,360,000.00	1,271,520.31	
3. 5 T-NOTE 250915	5,100,000.00	5,016,328.12	
3. 5 T-NOTE 280131	6,100,000.00	5,977,523.46	
3. 5 T-NOTE 280430	6,900,000.00	6,758,900.38	
3. 5 T-NOTE 300131	5,100,000.00	4,959,152.33	
3. 5 T-NOTE 300430	5,600,000.00	5,441,187.47	
3. 5 T-NOTE 330215	15,100,000.00	14,526,966.77	
3. 625 T-BOND 430815	3,400,000.00	3,089,152.34	
3. 625 T-BOND 440215	3,870,000.00	3,504,995.49	
3. 625 T-BOND 530215	8,690,000.00	7,891,266.81	
3. 625 T-BOND 530515	8,600,000.00	7,817,937.50	
3. 625 T-NOTE 260515	7,000,000.00	6,901,289.08	
3. 625 T-NOTE 280331	6,000,000.00	5,906,953.14	
3. 625 T-NOTE 280531	6,600,000.00	6,499,066.39	
3. 625 T-NOTE 300331	5,500,000.00	5,382,695.34	
3. 75 T-BOND 410815	2,060,000.00	1,935,273.42	
3. 75 T-BOND 431115	2,790,000.00	2,576,772.07	
3. 75 T-NOTE 260415	7,000,000.00	6,917,968.75	
3. 75 T-NOTE 300531	5,600,000.00	5,518,078.10	
3. 75 T-NOTE 300630	5,400,000.00	5,320,687.50	
3. 875 T-BOND 400815	1,870,000.00	1,799,692.37	
3. 875 T-BOND 430215	6,040,000.00	5,691,402.36	
3. 875 T-BOND 430515	6,200,000.00	5,842,046.84	
3. 875 T-NOTE 250331	5,000,000.00	4,951,269.55	
3. 875 T-NOTE 250430	4,000,000.00	3,959,062.48	

3. 875 T-NOTE 260115	6,700,000.00	6,636,271.47	
3. 875 T-NOTE 271130	6,900,000.00	6,855,123.02	
3. 875 T-NOTE 271231	7,000,000.00	6,957,890.66	
3. 875 T-NOTE 290930	5,100,000.00	5,063,841.81	
3. 875 T-NOTE 291130	5,100,000.00	5,062,746.08	
3. 875 T-NOTE 291231	5,700,000.00	5,658,363.26	
3. 875 T-NOTE 330815	16,640,000.00	16,481,399.97	
4 T-BOND 421115	5,870,000.00	5,639,442.01	
4 T-BOND 521115	9,230,000.00	8,957,426.55	
4 T-NOTE 251215	5,700,000.00	5,658,251.94	
4 T-NOTE 260215	8,000,000.00	7,945,156.24	
4 T-NOTE 280229	8,020,000.00	8,009,035.13	
4 T-NOTE 280630	6,000,000.00	5,998,710.96	
4 T-NOTE 291031	5,500,000.00	5,496,132.84	
4 T-NOTE 300228	6,270,000.00	6,264,611.68	
4 T-NOTE 300731	5,400,000.00	5,396,625.00	
4. 125 T-BOND 530815	10,020,000.00	9,964,420.23	
4. 125 T-NOTE 260615	7,000,000.00	6,979,492.17	
4. 125 T-NOTE 270930	7,440,000.00	7,455,839.08	
4. 125 T-NOTE 271031	6,500,000.00	6,513,203.12	
4. 125 T-NOTE 280731	6,500,000.00	6,534,277.35	
4. 125 T-NOTE 300831	6,500,000.00	6,542,529.30	
4. 125 T-NOTE 321115	15,100,000.00	15,232,714.80	
4. 25 T-BOND 390515	1,770,000.00	1,799,937.88	
4. 25 T-BOND 401115	1,980,000.00	1,992,684.37	
4. 25 T-NOTE 250531	9,000,000.00	8,953,593.75	
4. 25 T-NOTE 251015	6,000,000.00	5,977,500.00	
4. 375 T-BOND 380215	1,000,000.00	1,038,144.53	
4. 375 T-BOND 391115	1,930,000.00	1,984,771.29	
4. 375 T-BOND 400515	2,080,000.00	2,132,487.51	
4. 375 T-BOND 410515	1,960,000.00	1,995,716.41	
4. 375 T-BOND 430815	6,360,000.00	6,416,146.83	
4. 375 T-NOTE 260815	5,500,000.00	5,520,302.75	
4. 375 T-NOTE 261215	10,000,000.00	10,061,718.80	
4. 375 T-NOTE 280831	7,000,000.00	7,113,339.86	
4. 375 T-NOTE 281130	4,500,000.00	4,580,683.60	

		4. 375 T-NOTE 301130	5,500,000.00	5,621,171.87	
		4. 5 T-BOND 360215	1,160,000.00	1,225,068.75	
		4. 5 T-BOND 380515	1,330,000.00	1,396,629.88	
		4. 5 T-BOND 390815	1,880,000.00	1,963,902.35	
		4. 5 T-NOTE 251115	4,700,000.00	4,706,058.58	
		4. 5 T-NOTE 260715	6,500,000.00	6,541,513.68	
		4. 5 T-NOTE 331115	10,700,000.00	11,138,867.12	
		4. 625 T-BOND 400215	2,100,000.00	2,220,216.78	
		4. 625 T-NOTE 250228	3,000,000.00	2,995,722.66	
		4. 625 T-NOTE 250630	5,000,000.00	5,004,394.55	
		4. 625 T-NOTE 260315	6,000,000.00	6,037,851.54	
		4. 625 T-NOTE 260915	7,500,000.00	7,580,273.40	
		4. 625 T-NOTE 261015	6,800,000.00	6,878,359.39	
		4. 625 T-NOTE 261115	7,000,000.00	7,085,585.92	
		4. 625 T-NOTE 280930	7,050,000.00	7,239,055.68	
		4. 625 T-NOTE 300930	5,700,000.00	5,905,623.05	
		4. 75 T-BOND 410215	2,010,000.00	2,146,028.31	
		4. 75 T-BOND 431115	2,980,000.00	3,158,567.19	
		4. 75 T-BOND 531115	5,550,000.00	6,124,078.12	
		4. 75 T-NOTE 250731	7,500,000.00	7,523,583.97	
		4. 875 T-NOTE 251130	6,000,000.00	6,048,515.64	
		4. 875 T-NOTE 281031	8,500,000.00	8,825,722.63	
		4. 875 T-NOTE 301031	5,500,000.00	5,781,875.00	
		5 T-BOND 370515	1,020,000.00	1,128,534.37	
		5 T-NOTE 250831	5,500,000.00	5,540,927.75	
		5 T-NOTE 250930	7,600,000.00	7,662,937.49	
		5 T-NOTE 251031	9,500,000.00	9,589,062.50	
		5. 25 T-BOND 281115	2,690,000.00	2,838,895.69	
		5. 375 T-BOND 310215	1,300,000.00	1,416,187.50	
		6 T-BOND 260215	1,200,000.00	1,239,890.62	
		6. 125 T-BOND 271115	1,160,000.00	1,246,184.38	
		6. 25 T-BOND 300515	1,150,000.00	1,292,312.50	
			1,832,980,000.00	1,657,271,317.71	
		アメリカドル合計		(240,337,486,494)	
カナダドル	国債証券	0. 25 CAN GOVT 260301	2,200,000.00	2,041,209.01	
		0. 5 CAN GOVT 250901	2,900,000.00	2,736,309.87	

0.5 CAN GOVT 301201	4,500,000.00	3,744,522.40	
1 CAN GOVT 260901	2,500,000.00	2,335,398.70	
1 CAN GOVT 270601	1,930,000.00	1,781,636.26	
1.25 CAN GOVT 250301	2,100,000.00	2,025,321.31	
1.25 CAN GOVT 270301	2,500,000.00	2,330,781.17	
1.25 CAN GOVT 300601	4,410,000.00	3,904,338.28	
1.5 CAN GOVT 250401	1,000,000.00	964,965.18	
1.5 CAN GOVT 260601	4,070,000.00	3,865,089.50	
1.5 CAN GOVT 310601	5,900,000.00	5,229,928.26	
1.5 CAN GOVT 311201	4,270,000.00	3,756,542.83	
1.75 CAN GOVT 531201	4,900,000.00	3,581,648.67	
2 CAN GOVT 280601	2,670,000.00	2,530,352.43	
2 CAN GOVT 320601	3,750,000.00	3,412,246.31	
2 CAN GOVT 511201	6,060,000.00	4,757,417.78	
2.25 CAN GOVT 250601	4,360,000.00	4,243,163.99	
2.25 CAN GOVT 290601	2,210,000.00	2,104,489.34	
2.25 CAN GOVT 291201	1,000,000.00	949,073.28	
2.5 CAN GOVT 321201	3,500,000.00	3,303,367.62	
2.75 CAN GOVT 270901	2,000,000.00	1,950,836.00	
2.75 CAN GOVT 330601	3,000,000.00	2,885,226.09	
2.75 CAN GOVT 481201	1,680,000.00	1,560,137.96	
2.75 CAN GOVT 551201	1,750,000.00	1,607,582.06	
2.75 CANADA GOVER 641201	1,250,000.00	1,151,330.32	
3 CAN GOVT 251001	3,000,000.00	2,945,988.69	
3 CAN GOVT 340601	1,200,000.00	1,174,927.65	
3.25 CAN GOVT 280901	1,600,000.00	1,594,459.77	
3.25 CAN GOVT 331201	2,750,000.00	2,755,205.75	
3.5 CAN GOVT 280301	2,000,000.00	2,008,600.14	
3.5 CAN GOVT 451201	1,650,000.00	1,729,608.39	
3.75 CAN GOVT 250201	3,000,000.00	2,973,464.67	
3.75 CAN GOVT 250501	3,500,000.00	3,472,727.05	
4 CAN GOVT 290301	1,080,000.00	1,115,660.77	
4 CAN GOVT 410601	1,200,000.00	1,325,551.56	
4.5 CAN GOVT 251101	2,540,000.00	2,559,980.37	
4.5 CAN GOVT 260201	700,000.00	708,350.12	
5 CAN GOVT 370601	830,000.00	986,437.42	

		5.75 CAN GOVT 290601	950,000.00	1,066,800.98
		5.75 CAN GOVT 330601	1,430,000.00	1,719,000.34
カナダドル合計			103,840,000.00	96,889,678.29 (10,525,125,752)
オーストラリアドル	国債証券	0.25 AUST GOVT 251121	5,450,000.00	5,103,138.83
		0.5 AUST GOVT 260921	4,100,000.00	3,764,849.14
		1 AUST GOVT 301221	3,010,000.00	2,483,875.11
		1 AUST GOVT 311121	4,250,000.00	3,406,123.14
		1.25 AUST GOVT 320521	4,530,000.00	3,653,172.29
		1.5 AUST GOVT 310621	3,740,000.00	3,157,390.31
		1.75 AUST GOVT 321121	3,980,000.00	3,310,497.09
		1.75 AUST GOVT 510621	3,070,000.00	1,779,940.53
		2.25 AUST GOVT 280521	2,900,000.00	2,730,511.00
		2.5 AUST GOVT 300521	3,940,000.00	3,642,459.47
		2.75 AUST GOVT 271121	2,490,000.00	2,405,436.03
		2.75 AUST GOVT 281121	1,940,000.00	1,855,877.11
		2.75 AUST GOVT 291121	2,980,000.00	2,815,172.62
		2.75 AUST GOVT 350621	1,520,000.00	1,334,052.53
		2.75 AUST GOVT 410521	2,170,000.00	1,751,689.92
		3 AUST GOVT 331121	4,100,000.00	3,752,600.11
		3 AUST GOVT 470321	2,020,000.00	1,607,592.35
		3.25 AUST GOVT 250421	1,100,000.00	1,090,454.88
		3.25 AUST GOVT 290421	2,660,000.00	2,594,462.68
		3.25 AUST GOVT 390621	2,130,000.00	1,886,992.94
		3.5 AUST GOVT 341221	2,300,000.00	2,183,251.08
3.75 AUST GOVT 340521	2,300,000.00	2,240,103.90		
3.75 AUST GOVT 370421	3,150,000.00	3,014,460.63		
4.25 AUST GOVT 260421	2,490,000.00	2,517,179.84		
4.5 AUST GOVT 330421	3,900,000.00	4,039,454.64		
4.75 AUST GOVT 270421	3,050,000.00	3,148,450.64		
4.75 AUST GOVT 540621	1,570,000.00	1,666,726.44		
オーストラリアドル合計			80,840,000.00	72,935,915.25 (7,097,393,912)
イギリス ポンド	国債証券	0.125 GILT 260130	2,600,000.00	2,409,820.40
		0.125 GILT 280131	2,300,000.00	2,002,748.00
		0.25 GILT 250131	5,100,000.00	4,873,815.30

0.25 GILT 310731	4,460,000.00	3,482,020.12	
0.375 GILT 261022	3,750,000.00	3,419,512.50	
0.375 GILT 301022	2,390,000.00	1,936,856.00	
0.5 GILT 290131	4,900,000.00	4,208,561.00	
0.5 GILT 611022	3,700,000.00	1,172,456.00	
0.625 GILT 250607	2,880,000.00	2,738,160.00	
0.625 GILT 350731	4,030,000.00	2,814,809.92	
0.625 GILT 501022	2,890,000.00	1,218,424.00	
0.875 GILT 291022	2,320,000.00	1,999,773.18	
0.875 GILT 330731	5,140,000.00	3,966,399.22	
0.875 GILT 460131	2,980,000.00	1,536,190.00	
1 GILT 320131	5,100,000.00	4,170,015.00	
1.125 GILT 390131	3,600,000.00	2,392,946.38	
1.125 GILT 731022	1,500,000.00	587,779.20	
1.25 GILT 270722	2,100,000.00	1,936,107.60	
1.25 GILT 411022	3,750,000.00	2,368,650.00	
1.25 GILT 510731	4,180,000.00	2,134,684.20	
1.5 GILT 260722	2,490,000.00	2,357,148.54	
1.5 GILT 470722	3,160,000.00	1,849,036.08	
1.5 GILT 530731	2,950,000.00	1,576,304.18	
1.625 GILT 281022	3,470,000.00	3,181,688.11	
1.625 GILT 541022	2,060,000.00	1,126,408.00	
1.625 GILT 711022	2,530,000.00	1,239,005.76	
1.75 GILT 370907	3,340,000.00	2,545,848.20	
1.75 GILT 490122	1,780,000.00	1,084,732.00	
1.75 GILT 570722	3,230,000.00	1,797,818.00	
2 GILT 250907	2,100,000.00	2,030,280.00	
2.5 GILT 650722	2,480,000.00	1,654,408.00	
3.25 GILT 330131	5,100,000.00	4,925,126.10	
3.25 GILT 440122	3,440,000.00	2,952,896.00	
3.5 GILT 251022	4,400,000.00	4,350,869.60	
3.5 GILT 450122	3,190,000.00	2,828,648.28	
3.5 GILT 680722	2,250,000.00	1,934,243.10	
3.75 GILT 380129	3,350,000.00	3,232,756.70	
3.75 GILT 520722	1,810,000.00	1,642,575.00	
3.75 GILT 531022	4,180,000.00	3,770,422.70	

		4 GILT 600122	1,980,000.00	1,883,772.00	
		4 GILT 631022	1,630,000.00	1,548,500.00	
		4.125 GILT 270129	4,900,000.00	4,950,103.48	
		4.25 GILT 271207	2,450,000.00	2,507,178.10	
		4.25 GILT 320607	3,370,000.00	3,524,177.50	
		4.25 GILT 360307	2,410,000.00	2,489,337.20	
		4.25 GILT 390907	2,320,000.00	2,344,128.00	
		4.25 GILT 401207	2,120,000.00	2,131,448.00	
		4.25 GILT 461207	2,680,000.00	2,647,818.56	
		4.25 GILT 491207	1,990,000.00	1,961,544.99	
		4.25 GILT 551207	2,770,000.00	2,734,267.00	
		4.5 GILT 280607	2,500,000.00	2,585,541.50	
		4.5 GILT 340907	1,990,000.00	2,107,831.88	
		4.5 GILT 421207	3,190,000.00	3,286,657.00	
		4.625 GILT 340131	1,100,000.00	1,176,560.00	
		4.75 GILT 301207	3,650,000.00	3,911,707.92	
		4.75 GILT 381207	2,310,000.00	2,477,165.46	
		4.75 GILT 431022	1,250,000.00	1,323,875.00	
		5 GILT 250307	2,490,000.00	2,506,292.56	
		6 GILT 281207	1,890,000.00	2,094,814.76	
		イギリスポンド合計	175,970,000.00	147,642,663.28 (27,175,108,603)	
シンガポ ールドル	国債証券	1.25 SINGAPORGOVT 261101	700,000.00	668,500.00	
		1.625 SINGAPORGOV 310701	1,050,000.00	971,040.00	
		1.875 SINGAPORGOV 500301	700,000.00	583,800.00	
		1.875 SINGAPORGOV 511001	950,000.00	791,055.50	
		2.125 SINGAPORGOV 260601	1,530,000.00	1,496,034.00	
		2.25 SINGAPORGOVT 360801	1,300,000.00	1,230,450.00	
		2.375 SINGAPORGOV 250601	1,560,000.00	1,537,068.00	
		2.375 SINGAPORGOV 390701	780,000.00	738,094.50	
		2.625 SINGAPORGOV 280501	800,000.00	798,240.00	
		2.625 SINGAPORGOV 320801	700,000.00	693,700.00	
		2.75 SINGAPORGOVT 420401	980,000.00	971,630.80	
		2.75 SINGAPORGOVT 460301	1,140,000.00	1,127,460.00	
		2.875 SINGAPORGOV 270901	1,000,000.00	1,005,500.00	
		2.875 SINGAPORGOV 280801	1,000,000.00	1,008,135.00	

		2. 875 SINGAPORGOV 290701	1,760,000.00	1,774,080.00	
		2. 875SINGAPORGOVT 300901	1,340,000.00	1,350,720.00	
		3 SINGAPORGOVT 720801	910,000.00	967,785.00	
		3. 375 SINGAPORGOV 330901	1,280,000.00	1,345,177.60	
		3. 5 SINGAPORGOVT 270301	1,000,000.00	1,019,000.00	
シンガポールドル合計			20,480,000.00	20,077,470.40 (2,190,853,570)	
マレーシア リング ット	国債証券	2. 632 MALAYSIAGOV 310415	2,800,000.00	2,585,294.48	
		3. 502MALAYSIAGOVT 270531	3,000,000.00	2,990,933.52	
		3. 582 MALAYSIAGOV 320715	2,100,000.00	2,055,895.69	
		3. 733 MALAYSIAGO 280615	2,800,000.00	2,804,213.44	
		3. 757 MALAYSIAGOV 400522	3,630,000.00	3,465,749.86	
		3. 828 MALAYSIAGOV 340705	3,410,000.00	3,374,709.25	
		3. 844 MALAYSIAGOV 330415	2,400,000.00	2,396,953.99	
		3. 882 MALAYSIAGOV 250314	2,410,000.00	2,425,420.38	
		3. 885 MALAYSIAGOV 290815	3,600,000.00	3,625,631.28	
		3. 892 MALAYSIAGOV 270315	5,100,000.00	5,151,176.46	
		3. 899 MALAYSIAGOV 271116	5,640,000.00	5,701,137.03	
		3. 9 MALAYSIAGOVT 261130	1,800,000.00	1,819,159.56	
		3. 906 MALAYSIAGOV 260715	2,730,000.00	2,757,874.93	
		3. 955 MALAYSIAGOV 250915	4,270,000.00	4,303,558.78	
		4. 065 MALAYSIAGOV 500615	5,250,000.00	5,111,189.21	
		4. 232MALAYSIAGOVT 310630	2,550,000.00	2,613,153.30	
		4. 254 MALAYSIAGOV 350531	2,150,000.00	2,195,924.64	
		4. 392 MALAYSIAGOV 260415	1,350,000.00	1,375,690.23	
		4. 457 MALAYSIAGOV 530331	1,600,000.00	1,646,881.92	
		4. 498 MALAYSIAGOV 300415	3,640,000.00	3,784,603.00	
		4. 504 MALAYSIAGOV 290430	1,500,000.00	1,556,917.35	
		4. 642 MALAYSIAGOV 331107	2,200,000.00	2,343,314.82	
		4. 696 MALAYSIAGOV 421015	3,900,000.00	4,183,513.23	
4. 736 MALAYSIAGOV 460315	1,650,000.00	1,762,749.61			
4. 762 MALAYSIAGOV 370407	4,440,000.00	4,774,435.00			
4. 893 MALAYSIAGOV 380608	3,360,000.00	3,678,589.48			
4. 921 MALAYSIAGOV 480706	2,020,000.00	2,223,169.37			
4. 935 MALAYSIAGOV 430930	1,190,000.00	1,295,099.25			
マレーシアリングット合計			82,490,000.00	84,002,939.06	

				(2,621,689,726)	
ニュージーランドドル	国債証券	0.25 NZ GOVT 280515	2,000,000.00	1,681,152.18	
		1.75 NZ GOVT 410515	600,000.00	386,128.85	
		2 NZ GOVT 320515	2,300,000.00	1,911,120.92	
		2.75 NZ GOVT 250415	1,400,000.00	1,360,924.61	
		2.75 NZ GOVT 370415	1,450,000.00	1,172,240.76	
		2.75 NZ GOVT 510515	1,180,000.00	818,704.79	
		3 NZ GOVT 290420	1,700,000.00	1,598,258.23	
		3.5 NZ GOVT 330414	1,900,000.00	1,759,662.65	
		4.5 NZ GOVT 270415	1,800,000.00	1,806,087.60	
		4.5 NZ GOVT 300515	1,000,000.00	1,008,622.60	
ニュージーランドドル合計			15,330,000.00	13,502,903.19	(1,221,337,593)
スウェーデンクローネ	国債証券	0.125 SWD GOVT 310512	9,450,000.00	8,219,458.80	
		0.75 SWD GOVT 280512	8,000,000.00	7,550,596.32	
		0.75 SWD GOVT 291112	12,200,000.00	11,342,439.79	
		1 SWD GOVT 261112	11,960,000.00	11,523,873.45	
		1.75 SWD GOVT 331111	8,000,000.00	7,749,589.84	
		2.25 SWD GOVT 320601	6,750,000.00	6,837,555.60	
		2.5 SWD GOVT 250512	8,840,000.00	8,786,891.66	
		3.5 SWD GOVT 390330	6,470,000.00	7,489,025.00	
スウェーデンクローネ合計			71,670,000.00	69,499,430.46	(987,586,906)
ノルウェークローネ	国債証券	1.25 NORWE GOVT 310917	4,700,000.00	4,041,130.50	
		1.375 NORWE GOVT 300819	8,770,000.00	7,761,783.26	
		1.5 NORWE GOVT 260219	6,040,000.00	5,790,946.64	
		1.75 NORWE GOVT 250313	10,200,000.00	9,957,064.56	
		1.75 NORWE GOVT 270217	5,120,000.00	4,876,825.60	
		1.75 NORWE GOVT 290906	4,600,000.00	4,234,405.80	
		2 NORWE GOVT 280426	6,900,000.00	6,572,250.00	
		2.125 NORWE GOVT 320518	10,500,000.00	9,572,115.00	
		3 NORWE GOVT 330815	4,500,000.00	4,373,084.70	
		3.5 NORWE GOVT 421006	4,000,000.00	4,141,500.00	
ノルウェークローネ合計			65,330,000.00	61,321,106.06	(864,627,595)
デンマーク	国債証券	0 DMK GOVT 311115	14,550,000.00	12,244,712.55	

ククロ ネ		0.25 DMK GOVT 521115	8,900,000.00	4,944,840.00	
		0.5 DMK GOVT 271115	8,100,000.00	7,601,613.48	
		0.5 DMK GOVT 291115	10,550,000.00	9,594,625.76	
		1.75 DMK GOVT 251115	7,490,000.00	7,382,046.63	
		2.25 DMK GOVT 331115	3,500,000.00	3,476,854.50	
		4.5 DMK GOVT 391115	15,650,000.00	19,808,877.95	
デンマーククローネ合計			68,740,000.00	65,053,570.87	(1,384,990,523)
メキシコ ペソ	国債証券	10 MEXICAN BONOS 361120	12,350,000.00	13,219,069.50	
		5 MEXICAN BONOS 250306	34,000,000.00	32,205,480.00	
		5.5 MEXICAN BONOS 270304	52,000,000.00	46,570,160.00	
		5.75 MEXICAN BONO 260305	65,500,000.00	60,319,147.15	
		7 MEXICAN BONOS 260903	20,000,000.00	18,755,000.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 270603	48,750,000.00	46,092,150.00	
		7.5 MEXICAN BONOS 330526	34,000,000.00	30,602,040.00	
		7.75 MEXICAN BONO 310529	68,050,000.00	63,148,358.50	
		7.75 MEXICAN BONO 341123	13,400,000.00	12,162,242.00	
		7.75 MEXICAN BONO 421113	49,690,000.00	43,300,362.90	
		8 MEXICAN BONOS 350524	5,000,000.00	4,619,311.45	
		8 MEXICAN BONOS 471107	39,100,000.00	34,583,559.00	
		8 MEXICAN BONOS 530731	26,500,000.00	23,226,985.00	
		8.5 MEXICAN BONOS 290301	13,420,000.00	13,016,326.40	
		8.5 MEXICAN BONOS 290531	39,150,000.00	38,199,829.50	
8.5 MEXICAN BONOS 381118	39,700,000.00	37,662,993.00			
メキシコペソ合計			560,610,000.00	517,683,014.40	(4,413,299,466)
イスラエ ルシエケ ル	国債証券	0.5 ISRAEL FIXED 250430	6,500,000.00	6,256,575.00	
		0.5 ISRAEL FIXED 260227	5,800,000.00	5,446,490.00	
		1 ISRAEL FIXED BO 300331	3,370,000.00	2,869,386.50	
		1.3 ISRAEL FIXED 320430	4,800,000.00	3,934,800.00	
		1.5 ISRAEL FIXED 370531	4,900,000.00	3,537,065.00	
		2.25 ISRAEL FIXED 280928	3,080,000.00	2,908,290.00	
		2.8 ISRAEL FIXED 521129	800,000.00	566,880.00	
		3.75 ISRAEL FIXED 470331	4,680,000.00	4,261,842.00	
		5.5 ISRAEL FIXED 420131	3,130,000.00	3,696,060.50	
		6.25 ISRAEL FIXED 261030	5,000,000.00	5,399,750.00	

イスラエルシェケル合計			42,060,000.00	38,877,139.00 (1,539,631,897)
ポーランド ドズロチ	国債証券	0.25 POLAND 261025	3,000,000.00	2,638,413.00
		0.75 POLAND 250425	3,500,000.00	3,316,974.50
		1.25 POLAND 301025	9,190,000.00	7,230,186.55
		1.75 POLAND 320425	7,600,000.00	5,876,783.60
		2.5 POLAND 260725	7,840,000.00	7,385,005.60
		2.5 POLAND 270725	6,110,000.00	5,638,149.14
		2.75 POLAND 280425	5,760,000.00	5,276,355.84
		2.75 POLAND 291025	7,900,000.00	7,013,983.40
		3.25 POLAND 250725	8,700,000.00	8,474,904.90
		3.75 POLAND 270525	4,000,000.00	3,850,208.00
		5.75 POLAND 290425	5,600,000.00	5,763,430.40
		6 POLAND 331025	2,000,000.00	2,107,180.80
		7.5 POLAND 280725	6,000,000.00	6,585,309.00
ポーランドドズロチ合計			77,200,000.00	71,156,884.73 (2,597,880,935)
中国元	国債証券	1.99 CHINA GOVT 250409	35,000,000.00	34,907,569.20
		2 CHINA GOVT 250615	42,000,000.00	41,831,716.92
		2.18 CHINA GOVT 250825	34,000,000.00	33,989,401.52
		2.18 CHINA GOVT 260815	32,000,000.00	31,894,080.32
		2.22 CHINA GOVT 250925	50,000,000.00	49,939,746.00
		2.24 CHINA GOVT 250525	18,000,000.00	18,012,474.00
		2.26 CHINA GOVT 250224	14,000,000.00	14,017,596.60
		2.28 CHINA GOVT 251125	34,000,000.00	34,019,587.40
		2.3 CHINA GOVT 260515	30,000,000.00	29,999,332.80
		2.33 CHINA GOVT 251215	30,000,000.00	30,050,271.00
		2.35 CHINA GOVT 250315	22,000,000.00	22,048,417.60
		2.37 CHINA GOVT 270120	28,000,000.00	27,991,951.68
		2.39 CHINA GOVT 261115	22,000,000.00	22,048,901.60
		2.4 CHINA GOVT 280715	28,000,000.00	28,002,769.20
		2.44 CHINA GOVT 271015	23,000,000.00	23,040,868.70
		2.46 CHINA GOVT 260215	29,000,000.00	29,128,171.30
		2.48 CHINA GOVT 270415	23,000,000.00	23,087,692.10
		2.48 CHINA GOVT 280925	12,000,000.00	12,040,995.60
2.5 CHINA GOVT 270725	25,000,000.00	25,110,842.50		

2.52 CHINA GOVT 330825	37,000,000.00	36,890,688.31	
2.55 CHINA GOVT 281015	50,000,000.00	50,360,040.00	
2.6 CHINA GOVT 300915	39,000,000.00	39,180,390.60	
2.6 CHINA GOVT 320901	23,000,000.00	23,040,583.50	
2.62 CHINA GOVT 280415	33,000,000.00	33,368,233.80	
2.62 CHINA GOVT 290925	21,000,000.00	21,161,977.20	
2.62 CHINA GOVT 300625	26,000,000.00	26,147,019.60	
2.64 CHINA GOVT 280115	41,000,000.00	41,428,007.20	
2.67 CHINA GOVT 330525	28,000,000.00	28,164,449.60	
2.67 CHINA GOVT 331125	31,000,000.00	31,381,123.30	
2.68 CHINA GOVT 300521	45,000,000.00	45,399,924.00	
2.69 CHINA GOVT 260812	34,000,000.00	34,323,663.00	
2.69 CHINA GOVT 320815	25,000,000.00	25,211,465.00	
2.74 CHINA GOVT 260804	15,000,000.00	15,156,450.00	
2.75 CHINA GOVT 290615	30,000,000.00	30,444,630.00	
2.75 CHINA GOVT 320217	24,000,000.00	24,320,068.80	
2.76 CHINA GOVT 320515	25,000,000.00	25,344,395.00	
2.79 CHINA GOVT 291215	31,000,000.00	31,507,535.10	
2.8 CHINA GOVT 290324	27,000,000.00	27,454,782.60	
2.8 CHINA GOVT 300325	35,000,000.00	35,549,087.00	
2.8 CHINA GOVT 321115	29,000,000.00	29,516,719.10	
2.85 CHINA GOVT 270604	32,000,000.00	32,543,657.60	
2.88 CHINA GOVT 330225	25,000,000.00	25,659,332.50	
2.89 CHINA GOVT 311118	18,000,000.00	18,426,304.80	
2.9 CHINA GOVT 260505	17,000,000.00	17,268,880.50	
2.91 CHINA GOVT 281014	32,000,000.00	32,724,752.00	
2.99 CHINA GOVT 251015	9,000,000.00	9,124,191.90	
3 CHINA GOVT 531015	8,000,000.00	8,316,610.40	
3.01 CHINA GOVT 280513	39,000,000.00	40,064,208.60	
3.02 CHINA GOVT 251022	36,000,000.00	36,558,608.40	
3.02 CHINA GOVT 310527	38,000,000.00	39,224,747.60	
3.03 CHINA GOVT 260311	28,000,000.00	28,525,574.00	
3.12 CHINA GOVT 261205	37,000,000.00	37,918,636.00	
3.12 CHINA GOVT 521025	15,000,000.00	15,715,762.50	
3.13 CHINA GOVT 291121	30,000,000.00	31,116,279.00	
3.19 CHINA GOVT 530415	17,000,000.00	18,174,402.50	

		3. 22 CHINA GOVT 251206	18,000,000.00	18,369,703.80	
		3. 25 CHINA GOVT 260606	28,000,000.00	28,728,165.20	
		3. 25 CHINA GOVT 281122	17,000,000.00	17,732,815.60	
		3. 27 CHINA GOVT 301119	35,000,000.00	36,755,355.00	
		3. 28 CHINA GOVT 271203	24,000,000.00	24,928,488.00	
		3. 29 CHINA GOVT 290523	25,000,000.00	26,162,860.00	
		3. 32 CHINA GOVT 520415	16,000,000.00	17,324,945.60	
		3. 39 CHINA GOVT 500316	30,000,000.00	32,796,039.00	
		3. 52 CHINA GOVT 270504	19,000,000.00	19,802,265.50	
		3. 53 CHINA GOVT 511018	16,000,000.00	17,992,316.80	
		3. 54 CHINA GOVT 280816	13,000,000.00	13,757,257.80	
		3. 59 CHINA GOVT 270803	7,000,000.00	7,348,123.30	
		3. 6 CHINA GOVT 250906	8,000,000.00	8,221,283.20	
		3. 61 CHINA GOVT 250607	10,000,000.00	10,239,974.00	
		3. 69 CHINA GOVT 280517	15,000,000.00	15,945,705.00	
		3. 72 CHINA GOVT 510412	21,000,000.00	24,327,546.60	
		3. 77 CHINA GOVT 250308	11,000,000.00	11,246,593.60	
		3. 81 CHINA GOVT 500914	31,000,000.00	36,351,204.50	
		3. 86 CHINA GOVT 490722	25,000,000.00	29,334,652.50	
		4. 08 CHINA GOVT 481022	25,000,000.00	30,227,100.00	
		中国元合計	1,955,000,000.00	2,005,467,962.05 (40,589,869,364)	
ユーロ	国債証券	0 AUSTRIA GOVT 250420	800,000.00	771,675.60	
		0 AUSTRIA GOVT 281020	1,790,000.00	1,596,418.66	
		0 AUSTRIA GOVT 300220	2,150,000.00	1,852,293.80	
		0 AUSTRIA GOVT 310220	2,130,000.00	1,780,692.78	
		0 AUSTRIA GOVT 401020	810,000.00	499,282.38	
		0 BEL GOVT 271022	1,800,000.00	1,648,081.80	
		0 BEL GOVT 311022	2,300,000.00	1,889,705.30	
		0 BUND 260815	5,930,000.00	5,600,286.07	
		0 BUND 271115	3,100,000.00	2,864,998.30	
		0 BUND 281115	4,400,000.00	3,997,664.00	
		0 BUND 290815	4,550,000.00	4,075,462.30	
		0 BUND 300215	4,820,000.00	4,276,848.66	
		0 BUND 300815	4,960,000.00	4,356,680.48	
		0 BUND 300815	1,550,000.00	1,363,293.20	

0 BUND 310215	3,700,000.00	3,216,865.10	
0 BUND 310815	5,400,000.00	4,644,210.60	
0 BUND 310815	1,900,000.00	1,634,889.97	
0 BUND 320215	4,690,000.00	3,986,889.27	
0 BUND 350515	3,630,000.00	2,835,741.48	
0 BUND 360515	3,800,000.00	2,886,988.36	
0 BUND 500815	6,050,000.00	3,304,492.69	
0 BUND 500815	1,560,000.00	856,404.12	
0 BUND 520815	4,540,000.00	2,367,682.64	
0 FINNISH GOVT 300915	750,000.00	636,395.40	
0 IRISH GOVT 311018	1,350,000.00	1,125,199.35	
0 ITALY GOVT 260401	3,300,000.00	3,092,189.10	
0 ITALY GOVT 260801	5,000,000.00	4,643,601.40	
0 NETH GOVT 260115	2,200,000.00	2,092,474.09	
0 NETH GOVT 270115	1,950,000.00	1,821,593.47	
0 NETH GOVT 290115	1,300,000.00	1,163,297.46	
0 NETH GOVT 300715	2,650,000.00	2,291,325.15	
0 NETH GOVT 310715	2,220,000.00	1,873,015.30	
0 NETH GOVT 380115	1,540,000.00	1,077,445.60	
0 NETH GOVT 520115	2,830,000.00	1,425,269.22	
0 O. A. T 250225	5,400,000.00	5,219,502.30	
0 O. A. T 250325	7,380,000.00	7,121,670.48	
0 O. A. T 260225	6,600,000.00	6,259,908.60	
0 O. A. T 270225	6,130,000.00	5,693,286.54	
0 O. A. T 291125	7,180,000.00	6,255,682.70	
0 O. A. T 301125	8,840,000.00	7,499,352.12	
0 O. A. T 311125	8,400,000.00	6,922,305.60	
0 O. A. T 320525	5,430,000.00	4,409,067.69	
0 OBL 250411	2,800,000.00	2,701,636.00	
0 OBL 251010	4,000,000.00	3,827,672.00	
0 OBL 251010	1,000,000.00	959,139.33	
0 OBL 260410	2,910,000.00	2,763,248.70	
0 OBL 261009	2,900,000.00	2,729,842.50	
0 OBL 270416	3,050,000.00	2,847,836.85	
0 SPAIN GOVT 250131	3,630,000.00	3,510,496.77	
0 SPAIN GOVT 250531	2,500,000.00	2,397,431.47	

0 SPAIN GOVT 260131	6,500,000.00	6,142,753.50	
0 SPAIN GOVT 270131	3,800,000.00	3,505,678.60	
0 SPAIN GOVT 280131	3,800,000.00	3,418,160.80	
0.1 BEL GOVT 300622	1,650,000.00	1,421,198.62	
0.1 SPAIN GOVT 310430	4,360,000.00	3,580,070.12	
0.125 FINNISH GOV 310915	1,070,000.00	890,366.36	
0.125 FINNISH GOV 360415	510,000.00	369,260.91	
0.125 FINNISH GOV 520415	750,000.00	359,872.65	
0.2 IRISH GOVT 270515	500,000.00	466,668.75	
0.2 IRISH GOVT 301018	1,220,000.00	1,058,277.28	
0.25 AUSTRIA GOVT 361020	1,050,000.00	759,568.88	
0.25 BUND 270215	4,490,000.00	4,239,202.07	
0.25 BUND 280815	4,170,000.00	3,853,213.44	
0.25 BUND 290215	4,850,000.00	4,446,058.05	
0.25 FINNISH GOVT 400915	540,000.00	353,498.58	
0.25 ITALY GOVT 280315	2,700,000.00	2,407,590.24	
0.25 NETH GOVT 250715	1,930,000.00	1,861,075.06	
0.25 NETH GOVT 290715	2,950,000.00	2,650,049.90	
0.25 O. A. T 261125	5,680,000.00	5,341,358.40	
0.35 BEL GOVT 320622	2,450,000.00	2,033,718.05	
0.35 IRISH GOVT 321018	800,000.00	669,744.80	
0.35 ITALY GOVT 250201	3,060,000.00	2,966,122.26	
0.4 BEL GOVT 400622	1,300,000.00	855,741.90	
0.4 IRISH GOVT 350515	700,000.00	551,292.00	
0.45 ITALY GOVT 290215	2,300,000.00	2,009,569.80	
0.5 AUSTRIA GOVT 270420	2,100,000.00	1,974,972.30	
0.5 AUSTRIA GOVT 290220	2,050,000.00	1,862,888.30	
0.5 BUND 250215	7,110,000.00	6,919,089.39	
0.5 BUND 260215	3,160,000.00	3,038,488.52	
0.5 BUND 270815	5,120,000.00	4,844,088.32	
0.5 BUND 280215	4,280,000.00	4,025,712.36	
0.5 FINNISH GOVT 260415	1,670,000.00	1,596,304.15	
0.5 FINNISH GOVT 270915	700,000.00	653,872.97	
0.5 FINNISH GOVT 280915	1,480,000.00	1,355,275.96	
0.5 FINNISH GOVT 290915	1,350,000.00	1,213,563.93	
0.5 FINNISH GOVT 430415	780,000.00	502,745.88	

0. 5 ITALY GOVT 260201	2, 450, 000. 00	2, 330, 153. 35	
0. 5 ITALY GOVT 280715	2, 400, 000. 00	2, 142, 379. 20	
0. 5 NETH GOVT 260715	3, 970, 000. 00	3, 792, 610. 47	
0. 5 NETH GOVT 320715	2, 300, 000. 00	1, 974, 662. 99	
0. 5 NETH GOVT 400115	2, 630, 000. 00	1, 925, 660. 22	
0. 5 O. A. T 250525	6, 490, 000. 00	6, 284, 818. 65	
0. 5 O. A. T 260525	7, 530, 000. 00	7, 190, 171. 10	
0. 5 O. A. T 290525	9, 030, 000. 00	8, 189, 740. 44	
0. 5 O. A. T 400525	3, 990, 000. 00	2, 717, 365. 56	
0. 5 O. A. T 440625	3, 100, 000. 00	1, 906, 936. 04	
0. 5 O. A. T 720525	2, 100, 000. 00	846, 814. 50	
0. 5 SPAIN GOVT 300430	3, 580, 000. 00	3, 117, 288. 58	
0. 5 SPAIN GOVT 311031	3, 190, 000. 00	2, 663, 787. 17	
0. 55 IRISH GOVT 410422	600, 000. 00	414, 445. 20	
0. 6 ITALY GOVT 310801	3, 100, 000. 00	2, 515, 851. 50	
0. 6 SPAIN GOVT 291031	3, 680, 000. 00	3, 265, 963. 20	
0. 65 BEL GOVT 710622	910, 000. 00	395, 245. 76	
0. 7 AUSTRIA GOVT 710420	680, 000. 00	316, 360. 52	
0. 7 SPAIN GOVT 320430	3, 800, 000. 00	3, 181, 823. 60	
0. 75 AUSTRIA GOVT 261020	2, 480, 000. 00	2, 366, 791. 72	
0. 75 AUSTRIA GOVT 280220	1, 690, 000. 00	1, 580, 809. 10	
0. 75 AUSTRIA GOVT 510320	1, 570, 000. 00	934, 969. 54	
0. 75 FINNISH GOVT 310415	1, 050, 000. 00	928, 584. 30	
0. 75 NETH GOVT 270715	2, 670, 000. 00	2, 536, 736. 02	
0. 75 NETH GOVT 280715	3, 020, 000. 00	2, 830, 289. 64	
0. 75 O. A. T 280225	7, 400, 000. 00	6, 935, 429. 84	
0. 75 O. A. T 280525	9, 750, 000. 00	9, 107, 046. 00	
0. 75 O. A. T 281125	9, 060, 000. 00	8, 397, 863. 49	
0. 75 O. A. T 520525	5, 560, 000. 00	3, 117, 403. 04	
0. 75 O. A. T 530525	4, 990, 000. 00	2, 738, 337. 35	
0. 8 BEL GOVT 250622	2, 970, 000. 00	2, 884, 422. 42	
0. 8 BEL GOVT 270622	2, 880, 000. 00	2, 730, 726. 72	
0. 8 BEL GOVT 280622	2, 250, 000. 00	2, 104, 620. 75	
0. 8 SPAIN GOVT 270730	3, 350, 000. 00	3, 142, 762. 30	
0. 8 SPAIN GOVT 290730	5, 430, 000. 00	4, 897, 805. 70	
0. 85 AUSTRIA GOVT 200630	650, 000. 00	289, 317. 60	

0. 85 ITALY GOVT 270115	3,060,000.00	2,879,282.52	
0. 85 SPAIN GOVT 370730	2,150,000.00	1,563,258.55	
0. 875 FINNISH GOV 250915	630,000.00	611,797.41	
0. 9 AUSTRIA GOVT 320220	2,120,000.00	1,856,356.80	
0. 9 BEL GOVT 290622	3,090,000.00	2,857,199.40	
0. 9 IRISH GOVT 280515	1,640,000.00	1,549,554.00	
0. 9 ITALY GOVT 310401	3,530,000.00	2,963,964.50	
0. 95 ITALY GOVT 270915	4,000,000.00	3,721,404.00	
0. 95 ITALY GOVT 300801	2,500,000.00	2,146,975.00	
0. 95 ITALY GOVT 311201	2,730,000.00	2,254,619.64	
0. 95 ITALY GOVT 320601	3,600,000.00	2,927,775.60	
0. 95 ITALY GOVT 370301	2,560,000.00	1,777,753.60	
1 BEL GOVT 260622	2,760,000.00	2,663,894.59	
1 BEL GOVT 310622	2,850,000.00	2,557,849.35	
1 BUND 250815	5,580,000.00	5,436,387.54	
1 BUND 380515	3,260,000.00	2,743,521.46	
1 IRISH GOVT 260515	1,850,000.00	1,789,923.84	
1 O. A. T 251125	6,580,000.00	6,386,501.94	
1 O. A. T 270525	6,260,000.00	5,981,417.48	
1 SPAIN GOVT 420730	2,070,000.00	1,357,207.92	
1 SPAIN GOVT 501031	3,400,000.00	1,862,877.00	
1. 1 IRISH GOVT 290515	1,610,000.00	1,514,142.21	
1. 1 ITALY GOVT 270401	3,300,000.00	3,115,437.60	
1. 125 FINNISH GOV 340415	730,000.00	628,445.32	
1. 2 AUSTRIA GOVT 251020	2,710,000.00	2,645,157.83	
1. 2 ITALY GOVT 250815	2,100,000.00	2,038,816.50	
1. 2 SPAIN GOVT 401031	3,030,000.00	2,137,825.59	
1. 25 BEL GOVT 330422	1,770,000.00	1,574,340.66	
1. 25 BUND 480815	5,740,000.00	4,591,540.80	
1. 25 ITALY GOVT 261201	2,680,000.00	2,558,721.96	
1. 25 O. A. T 340525	6,790,000.00	5,918,048.57	
1. 25 O. A. T 360525	7,150,000.00	5,988,611.20	
1. 25 O. A. T 380525	2,880,000.00	2,316,807.36	
1. 25 SPAIN GOVT 301031	3,230,000.00	2,921,702.96	
1. 3 IRISH GOVT 330515	860,000.00	776,274.70	
1. 3 OBL 271015	5,750,000.00	5,592,329.25	

1. 3 OBL 271015	800,000.00	780,157.60	
1. 3 SPAIN GOVT 261031	4,750,000.00	4,577,480.00	
1. 35 IRISH GOVT 310318	1,070,000.00	999,904.30	
1. 35 ITALY GOVT 300401	3,610,000.00	3,214,427.03	
1. 375 FINNISH GOV 270415	800,000.00	773,023.20	
1. 375 FINNISH GOV 470415	840,000.00	626,624.88	
1. 4 BEL GOVT 530622	1,720,000.00	1,129,938.52	
1. 4 SPAIN GOVT 280430	3,740,000.00	3,553,145.86	
1. 4 SPAIN GOVT 280730	4,240,000.00	4,016,836.08	
1. 45 BEL GOVT 370622	1,220,000.00	1,019,961.48	
1. 45 ITALY GOVT 250515	2,300,000.00	2,249,204.50	
1. 45 ITALY GOVT 360301	2,140,000.00	1,633,361.42	
1. 45 SPAIN GOVT 271031	4,330,000.00	4,146,884.30	
1. 45 SPAIN GOVT 290430	3,300,000.00	3,101,917.50	
1. 45 SPAIN GOVT 711031	1,300,000.00	633,146.80	
1. 5 AUSTRIA GOVT 470220	1,810,000.00	1,368,074.02	
1. 5 AUSTRIA GOVT 861102	460,000.00	280,370.00	
1. 5 FINNISH GOVT 320915	750,000.00	686,638.12	
1. 5 IRISH GOVT 500515	1,460,000.00	1,081,464.34	
1. 5 ITALY GOVT 250601	3,300,000.00	3,226,334.10	
1. 5 ITALY GOVT 450430	2,010,000.00	1,254,223.92	
1. 5 O. A. T 310525	9,560,000.00	8,960,110.00	
1. 5 O. A. T 500525	5,230,000.00	3,728,979.54	
1. 5 SPAIN GOVT 270430	4,290,000.00	4,136,106.97	
1. 6 BEL GOVT 470622	1,570,000.00	1,162,346.36	
1. 6 ITALY GOVT 260601	4,120,000.00	3,996,573.04	
1. 6 SPAIN GOVT 250430	3,510,000.00	3,444,247.17	
1. 65 ITALY GOVT 301201	3,870,000.00	3,454,536.15	
1. 65 ITALY GOVT 320301	4,450,000.00	3,865,181.00	
1. 7 BEL GOVT 500622	1,840,000.00	1,346,644.48	
1. 7 BUND 320815	4,350,000.00	4,231,614.75	
1. 7 IRISH GOVT 370515	1,190,000.00	1,051,835.05	
1. 7 ITALY GOVT 510901	2,390,000.00	1,441,958.70	
1. 75 O. A. T 390625	5,050,000.00	4,330,713.35	
1. 75 O. A. T 660525	2,590,000.00	1,806,970.48	
1. 8 BUND 530815	4,060,000.00	3,598,204.98	

1. 8 BUND 530815	800,000.00	710,936.00	
1. 8 ITALY GOVT 410301	2,640,000.00	1,883,460.48	
1. 85 AUSTRIA GOVT 490523	870,000.00	697,465.95	
1. 85 ITALY GOVT 250701	2,400,000.00	2,356,068.00	
1. 85 SPAIN GOVT 350730	3,510,000.00	3,051,204.39	
1. 9 BEL GOVT 380622	1,360,000.00	1,187,392.88	
1. 9 SPAIN GOVT 521031	2,920,000.00	1,971,274.48	
1. 95 SPAIN GOVT 260430	3,520,000.00	3,458,252.16	
1. 95 SPAIN GOVT 300730	3,790,000.00	3,604,434.02	
2 AUSTRIA GOVT 260715	1,000,000.00	988,667.00	
2 IRISH GOVT 450218	1,640,000.00	1,399,111.88	
2 ITALY GOVT 251201	3,530,000.00	3,468,196.15	
2 ITALY GOVT 280201	3,880,000.00	3,732,179.76	
2 NETH GOVT 540115	1,310,000.00	1,160,447.78	
2 O. A. T 321125	7,450,000.00	7,123,317.50	
2 O. A. T 480525	4,650,000.00	3,779,496.75	
2. 05 ITALY GOVT 270801	2,650,000.00	2,569,993.85	
2. 1 AUSTRIA GOVT 170920	950,000.00	717,888.40	
2. 1 BUND 291115	3,800,000.00	3,816,233.60	
2. 1 ITALY GOVT 260715	2,350,000.00	2,304,372.40	
2. 15 BEL GOVT 660622	1,460,000.00	1,129,634.12	
2. 15 ITALY GOVT 520901	1,550,000.00	1,017,793.55	
2. 15 ITALY GOVT 720301	850,000.00	512,983.50	
2. 15 SPAIN GOVT 251031	6,000,000.00	5,931,243.96	
2. 2 ITALY GOVT 270601	2,000,000.00	1,953,172.00	
2. 2 OBL 280413	4,250,000.00	4,273,919.00	
2. 25 BEL GOVT 570622	1,020,000.00	820,328.88	
2. 25 ITALY GOVT 360901	2,720,000.00	2,261,650.08	
2. 3 BUND 330215	5,650,000.00	5,754,352.67	
2. 3 BUND 330215	950,000.00	968,008.20	
2. 35 SPAIN GOVT 330730	3,110,000.00	2,931,246.53	
2. 4 AUSTRIA GOVT 340523	1,300,000.00	1,261,897.00	
2. 4 BUND 301115	2,580,000.00	2,640,488.10	
2. 4 IRISH GOVT 300515	1,490,000.00	1,498,034.08	
2. 4 OBL 281019	4,820,000.00	4,896,594.62	
2. 45 ITALY GOVT 330901	2,870,000.00	2,587,689.58	

2.45 ITALY GOVT 500901	2,490,000.00	1,792,384.17	
2.5 BUND 440704	4,730,000.00	4,830,205.05	
2.5 BUND 460815	4,950,000.00	5,074,061.85	
2.5 ITALY GOVT 251115	2,330,000.00	2,311,520.77	
2.5 ITALY GOVT 321201	2,850,000.00	2,613,569.70	
2.5 NETH GOVT 300115	600,000.00	607,668.60	
2.5 NETH GOVT 330115	2,250,000.00	2,273,546.25	
2.5 NETH GOVT 330715	1,650,000.00	1,661,497.86	
2.5 O.A.T 260924	7,300,000.00	7,306,248.80	
2.5 O.A.T 300525	9,590,000.00	9,646,596.34	
2.5 O.A.T 430525	2,110,000.00	1,934,720.96	
2.5 SCHATS 250313	1,000,000.00	994,710.62	
2.55 SPAIN GOVT 321031	4,190,000.00	4,050,271.88	
2.6 BUND 330815	3,780,000.00	3,939,497.10	
2.625 FINNISH GOV 420704	940,000.00	901,991.10	
2.65 ITALY GOVT 271201	2,800,000.00	2,765,590.80	
2.7 ITALY GOVT 470301	3,300,000.00	2,569,360.20	
2.7 SPAIN GOVT 481031	2,910,000.00	2,451,675.32	
2.75 BEL GOVT 390422	950,000.00	918,075.25	
2.75 FINNISH GOVT 280704	1,110,000.00	1,126,587.84	
2.75 FINNISH GOVT 380415	680,000.00	670,045.95	
2.75 NETH GOVT 470115	3,320,000.00	3,428,769.84	
2.75 O.A.T 271025	10,320,000.00	10,459,836.00	
2.75 O.A.T 290225	5,250,000.00	5,341,245.00	
2.8 ITALY GOVT 281201	3,680,000.00	3,631,479.20	
2.8 ITALY GOVT 290615	3,200,000.00	3,134,214.40	
2.8 ITALY GOVT 670301	1,510,000.00	1,088,762.85	
2.8 SPAIN GOVT 260531	7,500,000.00	7,510,020.00	
2.875 FINNISH GOV 290415	600,000.00	612,951.00	
2.9 AUSTRIA GOVT 290523	700,000.00	717,723.79	
2.9 AUSTRIA GOVT 330220	2,180,000.00	2,219,821.62	
2.9 SPAIN GOVT 461031	2,990,000.00	2,648,730.25	
2.95 ITALY GOVT 380901	2,380,000.00	2,091,115.60	
3 BEL GOVT 330622	2,750,000.00	2,821,038.00	
3 BEL GOVT 340622	2,050,000.00	2,094,970.85	
3 FINNISH GOVT 330915	920,000.00	947,030.97	

3 IRISH GOVT 431018	690,000.00	707,992.99	
3 ITALY GOVT 290801	3,400,000.00	3,365,751.80	
3 O. A. T 330525	5,500,000.00	5,680,174.50	
3 O. A. T 540525	3,450,000.00	3,329,550.15	
3. 1 ITALY GOVT 400301	1,890,000.00	1,659,618.45	
3. 15 AUSTRIA GOVT 440620	1,250,000.00	1,282,191.25	
3. 15 AUSTRIA GOVT 531020	500,000.00	512,936.50	
3. 15 SPAIN GOVT 330430	3,500,000.00	3,528,416.50	
3. 25 BUND 420704	3,120,000.00	3,525,784.69	
3. 25 ITALY GOVT 380301	2,220,000.00	2,023,784.19	
3. 25 ITALY GOVT 460901	2,740,000.00	2,348,100.54	
3. 25 NETH GOVT 440115	500,000.00	549,952.00	
3. 25 O. A. T 450525	4,710,000.00	4,843,194.09	
3. 3 BEL GOVT 540622	1,690,000.00	1,694,464.98	
3. 35 ITALY GOVT 350301	3,110,000.00	2,966,613.45	
3. 4 ITALY GOVT 250328	2,300,000.00	2,303,486.34	
3. 4 ITALY GOVT 280401	3,000,000.00	3,040,650.90	
3. 45 AUSTRIA GOVT 301020	700,000.00	739,099.90	
3. 45 BEL GOVT 430622	800,000.00	833,606.40	
3. 45 ITALY GOVT 480301	2,820,000.00	2,488,320.06	
3. 45 SPAIN GOVT 430730	1,800,000.00	1,753,551.00	
3. 45 SPAIN GOVT 660730	2,230,000.00	2,036,488.15	
3. 5 ITALY GOVT 260115	2,500,000.00	2,526,360.00	
3. 5 ITALY GOVT 300301	4,470,000.00	4,523,689.17	
3. 5 O. A. T 260425	6,690,000.00	6,837,802.17	
3. 5 O. A. T 331125	2,620,000.00	2,811,983.12	
3. 5 SPAIN GOVT 290531	1,000,000.00	1,039,000.00	
3. 55 SPAIN GOVT 331031	3,690,000.00	3,829,548.42	
3. 6 ITALY GOVT 250929	2,000,000.00	2,017,596.00	
3. 7 ITALY GOVT 300615	2,350,000.00	2,395,082.40	
3. 75 BEL GOVT 450622	1,620,000.00	1,766,948.58	
3. 75 NETH GOVT 420115	2,940,000.00	3,429,464.13	
3. 8 AUSTRIA GOVT 620126	700,000.00	823,208.40	
3. 8 ITALY GOVT 260415	2,700,000.00	2,751,204.69	
3. 8 ITALY GOVT 280801	3,090,000.00	3,179,946.81	
3. 85 ITALY GOVT 260915	1,450,000.00	1,484,093.85	

3. 85 ITALY GOVT 291215	2, 600, 000. 00	2, 676, 720. 80	
3. 85 ITALY GOVT 490901	2, 180, 000. 00	2, 034, 990. 76	
3. 9 SPAIN GOVT 390730	1, 670, 000. 00	1, 746, 672. 37	
4 BEL GOVT 320328	1, 250, 000. 00	1, 380, 962. 50	
4 BUND 370104	4, 440, 000. 00	5, 297, 923. 44	
4 FINNISH GOVT 250704	240, 000. 00	244, 272. 38	
4 ITALY GOVT 301115	2, 220, 000. 00	2, 298, 750. 06	
4 ITALY GOVT 311030	1, 650, 000. 00	1, 707, 886. 95	
4 ITALY GOVT 350430	2, 150, 000. 00	2, 179, 265. 58	
4 ITALY GOVT 370201	4, 950, 000. 00	4, 971, 028. 09	
4 NETH GOVT 370115	3, 160, 000. 00	3, 654, 593. 72	
4 O. A. T 381025	4, 020, 000. 00	4, 549, 357. 62	
4 O. A. T 550425	3, 090, 000. 00	3, 585, 920. 28	
4 O. A. T 600425	3, 010, 000. 00	3, 536, 743. 98	
4. 1 ITALY GOVT 290201	2, 230, 000. 00	2, 325, 109. 50	
4. 15 AUSTRIA GOVT 370315	2, 540, 000. 00	2, 883, 649. 30	
4. 2 ITALY GOVT 340301	1, 360, 000. 00	1, 410, 477. 76	
4. 2 SPAIN GOVT 370131	3, 460, 000. 00	3, 785, 681. 84	
4. 25 BEL GOVT 410328	2, 380, 000. 00	2, 751, 741. 72	
4. 25 BUND 390704	3, 010, 000. 00	3, 753, 302. 64	
4. 35 ITALY GOVT 331101	2, 800, 000. 00	2, 945, 138. 00	
4. 4 ITALY GOVT 330501	3, 800, 000. 00	4, 023, 436. 20	
4. 45 ITALY GOVT 430901	1, 450, 000. 00	1, 480, 876. 30	
4. 5 BEL GOVT 260328	1, 610, 000. 00	1, 676, 932. 53	
4. 5 ITALY GOVT 260301	3, 740, 000. 00	3, 859, 680. 00	
4. 5 ITALY GOVT 531001	1, 530, 000. 00	1, 558, 820. 61	
4. 5 O. A. T 410425	5, 870, 000. 00	7, 065, 959. 67	
4. 65 SPAIN GOVT 250730	2, 890, 000. 00	2, 963, 391. 55	
4. 7 SPAIN GOVT 410730	3, 300, 000. 00	3, 799, 683. 69	
4. 75 BUND 280704	2, 340, 000. 00	2, 611, 126. 44	
4. 75 BUND 340704	4, 170, 000. 00	5, 180, 945. 61	
4. 75 BUND 400704	3, 230, 000. 00	4, 281, 951. 89	
4. 75 ITALY GOVT 280901	3, 930, 000. 00	4, 207, 902. 09	
4. 75 ITALY GOVT 440901	2, 900, 000. 00	3, 086, 899. 20	
4. 75 O. A. T 350425	4, 900, 000. 00	5, 850, 665. 66	
4. 85 AUSTRIA GOVT 260315	1, 370, 000. 00	1, 435, 717. 53	

	4. 9 SPAIN GOVT 400730	3,000,000.00	3,507,309.00	
	5 BEL GOVT 350328	2,950,000.00	3,563,797.65	
	5 ITALY GOVT 250301	4,280,000.00	4,361,619.60	
	5 ITALY GOVT 340801	3,850,000.00	4,253,660.95	
	5 ITALY GOVT 390801	3,980,000.00	4,360,030.30	
	5 ITALY GOVT 400901	3,600,000.00	3,946,305.60	
	5. 15 SPAIN GOVT 281031	3,250,000.00	3,613,252.50	
	5. 15 SPAIN GOVT 441031	2,640,000.00	3,226,396.80	
	5. 25 ITALY GOVT 291101	4,110,000.00	4,550,452.26	
	5. 4 IRISH GOVT 250313	2,100,000.00	2,156,842.80	
	5. 5 BEL GOVT 280328	3,380,000.00	3,802,669.00	
	5. 5 BUND 310104	4,280,000.00	5,243,539.28	
	5. 5 NETH GOVT 280115	2,180,000.00	2,446,983.72	
	5. 5 O. A. T 290425	5,820,000.00	6,704,541.06	
	5. 625 BUND 280104	2,540,000.00	2,882,530.43	
	5. 75 ITALY GOVT 330201	3,820,000.00	4,435,218.64	
	5. 75 O. A. T 321025	5,490,000.00	6,855,384.96	
	5. 75 SPAIN GOVT 320730	3,980,000.00	4,820,079.69	
	5. 9 SPAIN GOVT 260730	4,650,000.00	5,009,365.95	
	6 ITALY GOVT 310501	5,030,000.00	5,875,970.55	
	6 O. A. T 251025	5,760,000.00	6,092,611.20	
	6 SPAIN GOVT 290131	4,230,000.00	4,891,825.80	
	6. 25 AUSTRIA GOVT 270715	1,630,000.00	1,838,173.82	
	6. 25 BUND 300104	1,700,000.00	2,102,118.00	
	6. 5 BUND 270704	1,750,000.00	2,003,704.50	
	6. 5 ITALY GOVT 271101	3,900,000.00	4,390,261.20	
	7. 25 ITALY GOVT 261101	2,300,000.00	2,567,524.50	
ユーロ合計		1,122,280,000.00	1,057,220,373.74 (167,897,167,553)	
	合計		511,444,049,889 (511,444,049,889)	

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入債券	有価証券の
----	-----	------	-------

		時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 269 銘柄	100.00%	46.99%
カナダドル	国債証券 40 銘柄	100.00%	2.06%
オーストラリアドル	国債証券 27 銘柄	100.00%	1.39%
イギリスポンド	国債証券 59 銘柄	100.00%	5.31%
シンガポールドル	国債証券 19 銘柄	100.00%	0.43%
マレーシアリングgit	国債証券 28 銘柄	100.00%	0.51%
ニュージーランドドル	国債証券 10 銘柄	100.00%	0.24%
スウェーデンクローネ	国債証券 8 銘柄	100.00%	0.19%
ノルウェークローネ	国債証券 10 銘柄	100.00%	0.17%
デンマーククローネ	国債証券 7 銘柄	100.00%	0.27%
メキシコペソ	国債証券 16 銘柄	100.00%	0.86%
イスラエルシェケル	国債証券 10 銘柄	100.00%	0.30%
ポーランドズロチ	国債証券 13 銘柄	100.00%	0.51%
中国元	国債証券 75 銘柄	100.00%	7.94%
ユーロ	国債証券 365 銘柄	100.00%	32.83%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

MUAM J-REITマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年1月5日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	177,312,786
投資証券	16,182,330,000
未収入金	68,721,102
未収配当金	153,566,200
流動資産合計	16,581,930,088
資産合計	16,581,930,088
負債の部	
流動負債	
未払金	30,874,453
未払解約金	38,012,780
未払利息	40
流動負債合計	68,887,273
負債合計	68,887,273

純資産の部

元本等	
元本	4,359,803,569
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	12,153,239,246
元本等合計	16,513,042,815
純資産合計	16,513,042,815
負債純資産合計	16,581,930,088

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
--------------------	---

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年1月5日現在]
1. 期首	2023年7月6日
期首元本額	4,502,325,094円
期中追加設定元本額	177,689,288円
期中一部解約元本額	320,210,813円
元本の内訳※	
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	71,857,681円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	63,944,249円
三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型)	1,644,323円
三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型)	3,158,064円
三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型)	1,288,388円
三菱UFJ <DC>J-REITファンド	4,118,098,178円
MUAM J-REITファンド(適格機関投資家転売制限付)	99,812,686円
合計	4,359,803,569円
2. 受益権の総数	4,359,803,569口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年7月6日 至2024年1月5日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年1月5日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024年1月5日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	108,312,620
合計	108,312,620

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024年1月5日現在]
1口当たり純資産額	3,7876円
(1万口当たり純資産額)	(37,876円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	1,150	136,160,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	3,400	311,440,000	

S O S i L A物流リート投資法人	50	5,995,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	670	407,360,000	
森ヒルズリート投資法人	500	70,850,000	
産業ファンド投資法人	1,500	212,850,000	
アドバンス・レジデンス投資法人	1,250	403,125,000	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,200	471,600,000	
G L P 投資法人	5,200	733,200,000	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	500	157,500,000	
日本プロロジスリート投資法人	3,150	862,785,000	
星野リゾート・リート投資法人	50	28,750,000	
O n e リート投資法人	1,050	282,975,000	
イオンリート投資法人	1,000	141,900,000	
ヒューリックリート投資法人	850	127,755,000	
日本リート投資法人	450	154,350,000	
積水ハウス・リート投資法人	8,000	625,600,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	4,200	695,940,000	
いちごホテルリート投資法人	1,400	158,060,000	
ラサールロジポート投資法人	4,000	610,800,000	
スターアジア不動産投資法人	7,000	410,200,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	400	184,600,000	
大江戸温泉リート投資法人	1,100	78,650,000	
三菱地所物流リート投資法人	1,400	525,000,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	1,000	154,500,000	
ザイマックス・リート投資法人	1,500	179,550,000	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	2,200	279,180,000	
日本ビルファンド投資法人	1,940	1,200,860,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,400	819,000,000	
日本都市ファンド投資法人	7,000	716,800,000	
オリックス不動産投資法人	2,800	472,360,000	
日本プライムリアルティ投資法人	700	249,550,000	
N T T 都市開発リート投資法人	700	87,990,000	
東急リアル・エステート投資法人	300	51,750,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	3,200	466,240,000	
森トラストリート投資法人	600	44,520,000	
インヴィンシブル投資法人	12,500	768,750,000	
フロンティア不動産投資法人	250	108,625,000	

平和不動産リート投資法人	450	61,020,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	700	199,780,000	
KDX不動産投資法人	4,600	755,780,000	
いちごオフィスリート投資法人	4,800	398,400,000	
大和証券オフィス投資法人	230	155,940,000	
スターツプロシード投資法人	1,400	281,960,000	
大和ハウスリート投資法人	1,800	458,280,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	3,000	209,100,000	
大和証券リビング投資法人	1,100	114,950,000	
ジャパンエクセレント投資法人	1,200	150,000,000	
合計	104,840	16,182,330,000	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

MUAM G-REITマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年1月5日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	651,460,728
コール・ローン	261,235,475
投資証券	114,401,255,608
派生商品評価勘定	352,925
未収入金	19,560
未収配当金	474,174,156
差入委託証拠金	961,201,592
流動資産合計	116,749,700,044
資産合計	116,749,700,044
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,306,802
未払金	6,588,270
未払解約金	269,311,013
未払利息	59
流動負債合計	292,206,144
負債合計	292,206,144
純資産の部	

元本等	
元本	45,483,654,763
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	70,973,839,137
元本等合計	116,457,493,900
純資産合計	116,457,493,900
負債純資産合計	116,749,700,044

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年1月5日現在]
1. 期首	2023年7月6日
期首元本額	44,763,019,729円
期中追加設定元本額	4,687,914,403円
期中一部解約元本額	3,967,279,369円
元本の内訳※	
三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)	106,730,421円
三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型)	93,127,745円
三菱UFJ 資産設計ファンド(分配型)	29,997,986円
三菱UFJ 資産設計ファンド(バランス型)	54,285,579円
三菱UFJ 資産設計ファンド(株式重視型)	24,888,416円
eMAXIS 先進国リートインデックス	5,993,296,223円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	2,342,855,681円
eMAXIS バランス(波乗り型)	210,585,598円
三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド	3,277,288,724円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	597,167,019円
オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け)	1,567,691,742円
eMAXIS Slim バランス(8資産均等型)	11,589,964,172円
つみたて8資産均等バランス	5,653,815,055円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	1,591,598円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	3,074,028円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	1,039,197円
eMAXIS Slim 先進国リートインデックス	10,007,487,864円
三菱UFJ 先進国リートインデックスファンド	97,044,067円
ラップ向けインデックスf 先進国リート	872,874,739円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型)	64,670,216円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型)	777,967,410円

MUFG ウェルス・インサイト・ファンド (積極型)	300,321,949 円
ラップ向けインデックス f 先進国リート (為替ヘッジあり)	303,033 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	3,944,730 円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	34,400,995 円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	56,346,040 円
eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)	92,580,986 円
eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)	416,597,800 円
eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)	340,589,407 円
eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)	134,919,872 円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	17,980,892 円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	151,675 円
海外リートインデックスファンドS	718,073,904 円
合計	45,483,654,763 円
2. 受益権の総数	45,483,654,763 口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023 年 7 月 6 日 至 2024 年 1 月 5 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和 26 年法律第 198 号)第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、不動産投信指数先物取引を利用してしております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用してしております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ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または計算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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024 年 1 月 5 日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	[2024年1月5日現在]	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	5,637,204,151	
合計	5,637,204,151	

(注) 当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

投資証券関連

[2024年1月5日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	2,295,422,966	—	2,279,496,870	△15,926,096
合計		2,295,422,966	—	2,279,496,870	△15,926,096

(注) 時価の算定方法

1 先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

通貨関連

[2024年1月5日現在]

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカドル	166,356,909	—	166,351,514	△5,395
	カナダドル	4,125,135	—	4,124,938	△197
	オーストラリアドル	20,617,848	—	20,616,385	△1,463
	イギリスポンド	23,960,381	—	24,095,075	134,694
	イスラエルシェケル	5,945,325	—	5,976,002	30,677
	ユーロ	25,845,627	—	26,030,811	185,184
売建					
アメリカドル	143,331	—	144,928	△1,597	

	オーストラリア ドル	42,716,363	—	43,086,047	△369,684
	合計	289,710,919	—	290,425,700	△27,781

(注) 時価の算定方法

1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。

②当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

(イ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、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対顧客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。

(ロ) 当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	[2024年1月5日現在]
1口当たり純資産額	2.5604円
(1万口当たり純資産額)	(25,604円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
アメリカ ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	54,731	920,028.11	
		AGREE REALTY CORP	58,629	3,691,281.84	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	42,082	778,937.82	
		ALEXANDER'S INC	1,131	244,262.07	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	90,567	11,381,554.89	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	8,816	149,166.72	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	29,861	670,678.06	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	184,085	6,584,720.45	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	153,871	4,536,117.08	
		APARTMENT INCOME REIT CO	83,510	2,875,249.30	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	84,829	656,576.46	

APPLE HOSPITALITY REIT INC	127,458	2,148,941.88	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	38,034	465,916.50	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,953	28,715.40	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	82,502	15,146,542.18	
BOSTON PROPERTIES INC	83,248	5,764,091.52	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	34,741	86,505.09	
BRANDYWINE REALTY TRUST	96,861	513,363.30	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	176,710	4,018,385.40	
BROADSTONE NET LEASE INC	111,165	1,869,795.30	
BRT APARTMENTS CORP	8,081	151,437.94	
CAMDEN PROPERTY TRUST	61,631	6,028,128.11	
CARETRUST REIT INC	71,487	1,569,139.65	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	15,865	389,961.70	
CENTERSPACE	8,971	493,853.55	
CHATHAM LODGING TRUST	29,966	321,834.84	
CITY OFFICE REIT INC	25,899	157,983.90	
CLIPPER REALTY INC	11,551	60,296.22	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	14,982	386,535.60	
COPT DEFENSE PROPERTIES	67,568	1,705,416.32	
COUSINS PROPERTIES INC	90,985	2,171,811.95	
CTO REALTY GROWTH INC	12,027	205,781.97	
CUBESMART	130,093	5,950,453.82	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	126,684	1,178,161.20	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	423,000	281,295.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	176,078	23,203,558.84	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	131,456	440,377.60	
DOUGLAS EMMETT INC	95,343	1,359,591.18	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	202,000	—	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	57,051	771,900.03	
EASTGROUP PROPERTIES INC	27,135	4,887,827.55	
ELME COMMUNITIES	51,661	731,519.76	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	78,964	770,688.64	
EPR PROPERTIES	45,244	2,148,185.12	
EQUINIX INC	54,575	43,380,576.00	
EQUITY COMMONWEALTH	63,262	1,228,548.04	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	108,343	7,536,339.08	

EQUITY RESIDENTIAL	200,612	12,187,179.00	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	92,599	2,362,200.49	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	37,274	9,087,401.20	
EXTRA SPACE STORAGE INC	122,744	19,264,670.80	
FARMLAND PARTNERS INC	29,083	348,996.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	42,267	4,303,203.27	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	77,849	4,041,141.59	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	52,314	1,309,942.56	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	64,997	171,592.08	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	155,102	7,523,998.02	
GETTY REALTY CORP	27,482	795,603.90	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	24,371	321,209.78	
GLADSTONE LAND CORP	18,797	262,218.15	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	36,267	388,782.24	
GLOBAL NET LEASE INC	115,380	1,127,262.60	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	227,647	3,865,446.06	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	316,762	6,227,540.92	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	63,623	1,448,695.71	
HOST HOTELS & RESORTS INC	408,175	8,041,047.50	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	78,151	753,375.64	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	130,032	1,950,480.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	36,445	167,647.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	17,158	1,635,843.72	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	39,857	1,012,766.37	
INVITATION HOMES INC	333,726	11,340,009.48	
IRON MOUNTAIN INC	169,544	11,284,848.64	
JBG SMITH PROPERTIES	51,300	853,119.00	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	477,700	162,418.00	
KILROY REALTY CORP	62,598	2,465,735.22	
KIMCO REALTY CORP	384,072	7,996,379.04	
KITE REALTY GROUP TRUST	125,382	2,789,749.50	
LTC PROPERTIES INC	24,391	783,682.83	
LXP INDUSTRIAL TRUST	174,052	1,676,120.76	
MACERICH CO/THE	121,861	1,821,821.95	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	1,011,020	78,859.56	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	365,098	1,825,490.00	

MID-AMERICA APARTMENT COMM	67,585	8,932,033.60	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	44,841	1,786,465.44	
NATL HEALTH INVESTORS INC	24,630	1,326,571.80	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	8,717	150,019.57	
NETSTREIT CORP	39,142	708,861.62	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	16,184	120,570.80	
NEXPOINT RESIDENTIAL	13,180	445,484.00	
NNN REIT INC	105,455	4,512,419.45	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	30,313	204,915.88	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	141,919	4,329,948.69	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	9,253	203,843.59	
ORION OFFICE REIT INC	36,842	203,736.26	
PARAMOUNT GROUP INC	102,100	511,521.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	123,544	1,944,582.56	
PEAKSTONE REALTY TRUST	21,921	380,110.14	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	74,248	1,165,693.60	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	69,835	2,508,473.20	
PHYSICIANS REALTY TRUST	140,351	1,824,563.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	73,777	516,439.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	20,594	486,636.22	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	11,862	167,610.06	
PRIME US REIT	348,400	76,648.00	
PROLOGIS INC	537,478	70,028,008.62	
PUBLIC STORAGE	92,010	27,619,561.80	
REALTY INCOME CORP	421,066	24,291,297.54	
REGENCY CENTERS CORP	95,124	6,238,231.92	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	72,391	995,376.25	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	122,123	6,742,410.83	
RLJ LODGING TRUST	95,326	1,106,734.86	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	35,313	3,921,508.65	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	131,793	1,847,737.86	
SAFEHOLD INC	27,619	637,998.90	
SAUL CENTERS INC	8,150	320,539.50	
SERVICE PROPERTIES TRUST	100,591	838,928.94	
SIMON PROPERTY GROUP INC	189,649	26,600,168.74	
SITE CENTERS CORP	107,265	1,436,278.35	

		SL GREEN REALTY CORP	36,506	1,620,501.34	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	81,237	3,566,304.30	
		STAG INDUSTRIAL INC	104,417	4,030,496.20	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	61,291	407,585.15	
		SUN COMMUNITIES INC	72,217	9,571,641.18	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	113,652	1,233,124.20	
		TANGER INC	62,667	1,696,395.69	
		TERRENO REALTY CORP	49,857	3,092,629.71	
		UDR INC	174,913	6,622,206.18	
		UMH PROPERTIES INC	35,545	523,222.40	
		UNITI GROUP INC	146,642	872,519.90	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,436	317,517.20	
		URBAN EDGE PROPERTIES	69,540	1,258,674.00	
		VENTAS INC	233,648	11,509,500.48	
		VERIS RESIDENTIAL INC	47,834	718,466.68	
		VICI PROPERTIES INC	601,464	19,198,730.88	
		VORNADO REALTY TRUST	93,353	2,596,146.93	
		WELLTOWER INC	322,009	28,562,198.30	
		WHITESTONE REIT	27,990	330,841.80	
		WP CAREY INC	126,967	8,208,416.55	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	64,037	848,490.25	
		アメリカドル合計	15,558,231	613,636,051.12 (88,989,500,133)	
カナダドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	36,000	727,200.00	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	36,990	250,422.30	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	13,410	925,290.00	
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	13,300	206,815.00	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	52,400	155,104.00	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	48,780	2,323,391.40	
		CHOICE PROPERTIES REIT	92,687	1,299,471.74	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	30,230	418,080.90	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	29,700	435,699.00	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	79,000	1,088,620.00	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	12,310	130,486.00	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	64,500	988,785.00	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	18,200	1,386,840.00	

		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	74,409	737,393.19	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	41,700	536,679.00	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	34,500	615,135.00	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	12,300	195,570.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	10,800	158,976.00	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	14,500	120,495.00	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	66,500	347,130.00	
		PRIMARIS REIT	31,077	431,037.99	
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	13,000	63,050.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	76,170	1,432,757.70	
		SLATE GROCERY REIT-CL U	20,200	243,410.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	41,700	1,051,674.00	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,182	52,752.76	
カナダドル合計			969,545	16,322,265.98 (1,773,087,753)	
オーストラリアドル	投資証券	ABACUS GROUP	258,313	288,018.99	
		ABACUS STORAGE KING	349,661	381,130.49	
		ARENA REIT	193,872	696,000.48	
		BWP TRUST	286,513	979,874.46	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	502,926	829,827.90	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	327,007	1,043,152.33	
		CENTURIA OFFICE REIT	223,021	296,617.93	
		CHARTER HALL GROUP	270,715	3,088,858.15	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	398,836	1,439,797.96	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	320,766	1,119,473.34	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	195,853	571,890.76	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	821,364	340,866.06	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	114,607	316,315.32	
		DEXUS/AU	623,225	4,674,187.50	
		GDI PROPERTY GROUP	148,753	96,689.45	
		GOODMAN GROUP	1,004,916	24,128,033.16	
		GPT GROUP	1,092,975	4,885,598.25	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	156,679	372,896.02	
		HEALTHCO REIT	303,509	418,842.42	
		HMC CAPITAL LTD	151,349	862,689.30	
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	1,044,796	1,258,979.18			

		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	115,529	322,325.91	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	236,027	1,036,158.53	
		MIRVAC GROUP	2,346,665	4,763,729.95	
		NATIONAL STORAGE REIT	744,264	1,659,708.72	
		REGION RE LTD	703,188	1,532,949.84	
		RURAL FUNDS GROUP	228,339	461,244.78	
		SCENTRE GROUP	2,989,451	8,788,985.94	
		STOCKLAND	1,373,704	5,934,401.28	
		VICINITY CENTRES	2,220,258	4,418,313.42	
		WAYPOINT REIT	384,457	915,007.66	
		オーストラリアドル合計	20,131,538	77,922,565.48 (7,582,644,846)	
イギリス ポンド	投資証券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	189,691	100,156.84	
		AEW UK REIT PLC	118,804	116,665.52	
		ASSURA PLC	1,769,948	847,451.10	
		BALANCED COMM PROPERTY TRUST	417,405	300,949.00	
		BIG YELLOW GROUP PLC	112,854	1,313,620.56	
		BRITISH LAND CO PLC	533,482	2,111,521.75	
		CLS HOLDINGS PLC	90,000	90,540.00	
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	291,411	252,944.74	
		DERWENT LONDON PLC	63,419	1,464,978.90	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	372,068	354,580.80	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	155,948	657,476.76	
		HAMMERSON PLC	2,333,062	652,790.74	
		HELICAL PLC	60,734	130,881.77	
		HOME REIT PLC	398,800	151,743.40	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	246,077	222,453.60	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	440,897	3,070,406.70	
		LIFE SCIENCE REIT PLC	209,200	132,632.80	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	623,621	1,156,193.33	
		LXI REIT PLC	989,382	1,024,010.37	
		NEWRIVER REIT PLC	188,335	158,578.07	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	360,527	253,811.00	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	742,515	765,532.96	
		PRS REIT PLC/THE	310,645	269,018.57	
		REGIONAL REIT LTD	125,644	42,090.74	

		SAFESTORE HOLDINGS PLC	121,233	1,034,117.49	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	308,300	136,731.05	
		SEGRO PLC	711,005	6,144,505.21	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	1,105,659	1,515,858.48	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	754,928	649,238.08	
		TARGET HEALTHCARE REIT PLC	371,700	324,494.10	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	175,846	110,958.82	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,083,502	1,783,444.29	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	464,477	294,942.89	
		UNITE GROUP PLC/THE	231,814	2,392,320.48	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	260,093	322,515.32	
		WAREHOUSE REIT PLC	260,780	228,704.06	
		WORKSPACE GROUP PLC	72,738	392,057.82	
イギリスポンド合計			17,066,544	30,970,918.11 (5,700,507,187)	
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	1,129,000	2,619,280.00	
		FORTUNE REIT	855,000	4,146,750.00	
		LINK REIT	1,487,500	63,813,750.00	
		PROSPERITY REIT	760,000	1,056,400.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	635,000	1,365,250.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	1,304,000	1,577,840.00	
香港ドル合計			6,170,500	74,579,270.00 (1,384,937,043)	
シンガポ ールドル	投資証券	AIMS APAC REIT	411,000	542,520.00	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	2,052,000	6,032,880.00	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	1,381,074	1,346,547.15	
		CAPITALAND CHINA TRUST	703,900	647,588.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	2,909,132	5,818,264.00	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	427,700	470,470.00	
		EC WORLD REIT	199,400	55,832.00	
		ESR-LOGOS REIT	3,783,668	1,229,692.10	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	677,200	450,338.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	653,900	1,464,736.00	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERC	1,768,966	2,016,621.24	
		KEPPEL DC REIT	758,200	1,440,580.00	
		KEPPEL REIT	1,267,700	1,172,622.50	

		LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	1,007,000	639,445.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,217,200	3,043,000.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,896,000	3,166,320.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	1,393,200	2,117,664.00	
		PARAGON REIT	719,700	626,139.00	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	234,000	861,120.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	272,500	186,662.50	
		STARHILL GLOBAL REIT	704,300	366,236.00	
		SUNTEC REIT	1,267,600	1,559,148.00	
シンガポールドル合計			25,705,340	35,254,425.49 (3,846,962,909)	
ニュージーランドドル	投資証券	ARGOSY PROPERTY LTD	451,499	510,193.87	
		GOODMAN PROPERTY TRUST	596,091	1,347,165.66	
		KIWI PROPERTY GROUP LTD	876,670	762,702.90	
		PRECINCT PROPERTIES GROUP	831,046	1,055,428.42	
ニュージーランドドル合計			2,755,306	3,675,490.85 (332,448,147)	
韓国ウォン	投資証券	D&D PLATFORM REIT CO LTD	42,272	137,172,640.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	96,143	352,364,095.00	
		JR REIT XXVII	87,237	365,086,845.00	
		KORAMCO LIFE INFRA REIT	18,324	95,468,040.00	
		LOTTE REIT CO LTD	80,098	254,311,150.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	32,547	110,008,860.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	44,672	291,261,440.00	
		SK REITS CO LTD	62,600	248,522,000.00	
韓国ウォン合計			463,893	1,854,195,070.00 (205,073,974)	
イスラエルシェケル	投資証券	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	406,762	730,951.31	
		REIT 1 LTD	109,796	1,944,487.16	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	113,370	981,784.20	
イスラエルシェケル合計			629,928	3,657,222.67 (144,835,160)	
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	28,472	1,790,888.80	
		ALTAREA	2,731	223,668.90	
		CARE PROPERTY INVEST	16,132	221,976.32	
		CARMILA	31,800	503,712.00	

	COFINIMMO	21,277	1,492,581.55	
	COVIVIO	27,358	1,316,466.96	
	CROMWELL REIT EUR	199,500	281,295.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	24,838	557,364.72	
	GECINA SA	30,773	3,363,488.90	
	HAMBORNER REIT AG	43,259	298,054.51	
	ICADE	18,221	643,930.14	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	22,501	52,202.32	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	170,569	1,099,317.20	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	17,880	370,116.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	229,201	247,537.08	
	KLEPIERRE	116,653	2,883,662.16	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	32,964	205,036.08	
	MERCIALYS	54,648	549,758.88	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	194,326	1,919,940.88	
	MONTEA NV	9,378	782,125.20	
	NSI NV	12,706	245,225.80	
	RETAIL ESTATES	6,890	440,271.00	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	19,000	819,565.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	58,209	3,901,167.18	
	VASTNED RETAIL NV	6,082	127,722.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	100,885	2,778,372.90	
	WERELDHAVE NV	24,111	352,502.82	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	16,907	497,911.15	
ユーロ合計		1,537,271	27,965,861.45 (4,441,258,456)	
	合計		114,401,255,608 (114,401,255,608)	

(注1)通貨の種類ごとの小計/合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	投資証券 140 銘柄	100.00%	77.79%
カナダドル	投資証券 26 銘柄	100.00%	1.55%

オーストラリアドル	投資証券	31 銘柄	100.00%	6.63%
イギリスポンド	投資証券	37 銘柄	100.00%	4.98%
香港ドル	投資証券	6 銘柄	100.00%	1.21%
シンガポールドル	投資証券	22 銘柄	100.00%	3.36%
ニュージーランドドル	投資証券	4 銘柄	100.00%	0.29%
韓国ウォン	投資証券	8 銘柄	100.00%	0.18%
イスラエルシェケル	投資証券	3 銘柄	100.00%	0.13%
ユーロ	投資証券	28 銘柄	100.00%	3.88%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

(デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。

2 【ファンドの現況】

【三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）】

【純資産額計算書】

2024年1月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	2,776,758,797
II 負債総額	3,352,684
III 純資産総額 (I - II)	2,773,406,113
IV 発行済口数	2,343,742,280口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.1833
(10,000口当たり)	(11,833)

(参考)

TOPIXマザーファンド

純資産額計算書

2024年1月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	1,371,051,187,098
II 負債総額	70,341,227,953
III 純資産総額 (I - II)	1,300,709,959,145
IV 発行済口数	420,040,808,164口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	3.0966

(10,000口当たり)	(30,966)
--------------	----------

外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年1月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	4,279,954,708,579
II 負債総額	91,692,772,626
III 純資産総額 (I - II)	4,188,261,935,953
IV 発行済口数	666,970,067,669口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	6.2795
(10,000口当たり)	(62,795)

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年1月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	791,952,243,857
II 負債総額	15,167,890,002
III 純資産総額 (I - II)	776,784,353,855
IV 発行済口数	609,948,827,270口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	1.2735
(10,000口当たり)	(12,735)

外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年1月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	538,456,519,143
II 負債総額	3,244,562,268
III 純資産総額 (I - II)	535,211,956,875
IV 発行済口数	207,487,008,054口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	2.5795
(10,000口当たり)	(25,795)

MUAM J-REITマザーファンド

純資産額計算書

2024年1月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	16,362,391,089
II 負債総額	154,519,440
III 純資産総額 (I - II)	16,207,871,649
IV 発行済口数	4,319,566,545口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	3.7522
(10,000口当たり)	(37,522)

MUAM G-REITマザーファンド

純資産額計算書

2024年1月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	117,624,858,829
II 負債総額	925,078,527
III 純資産総額 (I - II)	116,699,780,302
IV 発行済口数	45,668,753,660口
V 1口当たり純資産価額 (III/IV)	2.5554
(10,000口当たり)	(25,554)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等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、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取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、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡

①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。

②上記①の申請のある場合には、上記①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、上記①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。

③上記①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、委託会社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。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載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、解約請求の受付、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

2024年1月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

(2) 委託会社の機構

・ 会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席する株主総会にてその議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

・ 投資運用の意思決定機構

①投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

②運用戦略の決定

運用戦略・管理委員会において、①で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

③運用計画の決定

②で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

④ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示

をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

⑤運用部門による自律的な運用管理

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

⑥管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署は、(a) 運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、(b) リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、(a) についてはファンド管理委員会を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、(b) についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

⑦ファンドに関係する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、商品企画委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

⑧運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

2024年1月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	843	30,533,287
追加型公社債投資信託	16	1,601,492
単位型株式投資信託	97	445,099
単位型公社債投資信託	49	95,799
合計	1,005	32,675,676

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

3【委託会社等の経理状況】

(1) 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJアセットマネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）」（以下「財務諸表等規則」という。）第 2 条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成 19 年内閣府令第 52 号）」に基づき作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和 52 年大蔵省令第 38 号）」（以下「中間財務諸表等規則」という。）第 38 条及び第 57 条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

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

(2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 38 期事業年度（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 39 期事業年度に係る中間会計期間（自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年6月9日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 青木 裕 晃

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊藤 鉄 也

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

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、三菱UFJ国際投信株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行

を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月1日

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山田 信之

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 田嶋 大士

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJアセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJアセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRL データは中間監査の対象には含まれていません。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)		第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	※2	51,593,362	※2	51,733,041
有価証券		293,326		1,579,691
前払費用		645,109		770,747
未収入金		61,092		81,854
未収委託者報酬		15,750,264		16,753,855
未収収益	※2	783,790	※2	688,142
金銭の信託		8,401,300		10,400,000
その他		295,584		745,576
流動資産合計		77,823,830		82,752,908
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	391,042	※1	181,551
器具備品	※1	1,079,023	※1	730,357
土地		628,433		628,433
建設仮勘定		-		1,111,177
有形固定資産合計		2,098,499		2,651,520
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		4,381,293		4,183,644
ソフトウェア仮勘定		1,581,652		1,907,739
無形固定資産合計		5,978,768		6,107,206
投資その他の資産				
投資有価証券		16,803,642		12,022,365
関係会社株式		159,536		159,536
投資不動産	※1	810,684	※1	807,066
長期差入保証金		524,244		689,492
前払年金費用		189,708		118,832
繰延税金資産		982,406		1,675,132
その他		45,230		45,230
貸倒引当金		△23,600		△23,600
投資その他の資産合計		19,491,852		15,494,056
固定資産合計		27,569,120		24,252,782
資産合計		105,392,950		107,005,691

(単位：千円)

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)		第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)	
(負債の部)				
流動負債				
預り金		565,222		507,559
未払金				
未払収益分配金		197,334		114,094
未払償還金		7,418		7,418
未払手数料	※2	6,423,139	※2	6,139,595
その他未払金	※2	4,565,457	※2	955,697
未払費用	※2	4,328,968	※2	5,778,896
未払消費税等		1,112,923		439,657
未払法人税等		769,692		2,375,281
賞与引当金		942,287		849,840
役員賞与引当金		149,028		154,872
その他		5,517		5,517
流動負債合計		19,066,990		17,328,431
固定負債				
長期未払金		10,800		-
退職給付引当金		1,246,300		1,333,882
役員退職慰労引当金		117,938		75,667
時効後支払損引当金		250,214		254,296
固定負債合計		1,625,252		1,663,846
負債合計		20,692,243		18,992,277
(純資産の部)				
株主資本				
資本金		2,000,131		2,000,131
資本剰余金				
資本準備金		3,572,096		3,572,096
その他資本剰余金		41,160,616		41,160,616
資本剰余金合計		44,732,712		44,732,712
利益剰余金				
利益準備金		342,589		342,589
その他利益剰余金				
別途積立金		6,998,000		6,998,000
繰越利益剰余金		29,000,498		33,267,700
利益剰余金合計		36,341,088		40,608,289
株主資本合計		83,073,932		87,341,133

(単位：千円)

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,626,775	672,279
評価・換算差額等合計	1,626,775	672,279
純資産合計	84,700,707	88,013,413
負債純資産合計	105,392,950	107,005,691

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
営業収益		
委託者報酬	79,977,953	84,121,445
投資顧問料	2,711,169	2,750,601
その他営業収益	13,459	10,412
営業収益合計	82,702,582	86,882,459
営業費用		
支払手数料	※2 31,644,834	※2 31,461,274
広告宣伝費	720,785	798,894
公告費	500	375
調査費		
調査費	2,430,158	2,849,042
委託調査費	14,557,009	19,236,505
事務委託費	1,450,062	1,751,807
営業雑経費		
通信費	138,868	113,480
印刷費	379,428	367,379
協会費	49,590	58,128
諸会費	17,729	18,447
事務機器関連費	2,172,978	2,238,382
その他営業雑経費	649	-
営業費用合計	53,562,596	58,893,717
一般管理費		
給料		
役員報酬	414,260	416,461
給料・手当	6,496,233	6,565,766
賞与引当金繰入	942,287	849,840
役員賞与引当金繰入	149,028	154,872
福利厚生費	1,282,310	1,279,885
交際費	4,874	8,942
旅費交通費	21,698	75,274
租税公課	430,233	403,955
不動産賃借料	724,961	719,707
退職給付費用	494,615	388,176
固定資産減価償却費	2,249,287	2,418,341
諸経費	379,054	444,313
一般管理費合計	13,588,846	13,725,534
営業利益	15,551,139	14,263,207

(単位：千円)

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)		第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	
営業外収益				
受取配当金		243,133		47,353
受取利息	※2	7,408	※2	10,279
投資有価証券償還益		1,089,101		609,102
収益分配金等時効完成分		137,485		94,351
受取賃貸料	※2	65,808	※2	65,808
その他		36,211		36,894
営業外収益合計		1,579,148		863,788
営業外費用				
投資有価証券償還損		3,074		32,995
時効後支払損引当金繰入		16,548		31,951
事務過誤費		76,076		2,680
賃貸関連費用		15,780		14,262
その他		7,585		32,394
営業外費用合計		119,066		114,284
経常利益		17,011,221		15,012,711
特別利益				
投資有価証券売却益		605,706		387,113
特別利益合計		605,706		387,113
特別損失				
投資有価証券売却損		28,188		15,828
投資有価証券評価損		36,558		104,554
固定資産除却損	※1	13,094	※1	32,791
減損損失		-	※3	315,350
特別損失合計		77,840		468,524
税引前当期純利益		17,539,087		14,931,300
法人税、住民税及び事業税	※2	5,366,608	※2	4,860,444
法人税等調整額		22,446		△271,471
法人税等合計		5,389,054		4,588,973
当期純利益		12,150,032		10,342,327

(3) 【株主資本等変動計算書】

第37期(自2021年4月1日至2022年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
会計方針の変更による累積的影響額				
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)				
当期変動額合計	—	—	—	—
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	342,589	6,998,000	26,951,289	34,291,879	81,024,723
会計方針の変更による累積的影響額			475,687	475,687	475,687
会計方針の変更を反映した当期首残高	342,589	6,998,000	27,426,976	34,767,566	81,500,410
当期変動額					
剰余金の配当			△10,576,511	△10,576,511	△10,576,511
当期純利益			12,150,032	12,150,032	12,150,032
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)					
当期変動額合計	—	—	1,573,521	1,573,521	1,573,521
当期末残高	342,589	6,998,000	29,000,498	36,341,088	83,073,932

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	2,301,606	2,301,606	83,326,329
会計方針の変更による累積的影響額			475,687
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,301,606	2,301,606	83,802,017
当期変動額			
剰余金の配当			△10,576,511
当期純利益			12,150,032
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△674,831	△674,831	△674,831
当期変動額合計	△674,831	△674,831	898,690
当期末残高	1,626,775	1,626,775	84,700,707

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)				
当期変動額合計	—	—	—	—
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				株主資本合計
	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	342,589	6,998,000	29,000,498	36,341,088	83,073,932
当期変動額					
剰余金の配当			△6,075,125	△6,075,125	△6,075,125
当期純利益			10,342,327	10,342,327	10,342,327
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)					
当期変動額合計	—	—	4,267,201	4,267,201	4,267,201
当期末残高	342,589	6,998,000	33,267,700	40,608,289	87,341,133

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,626,775	1,626,775	84,700,707
当期変動額			
剰余金の配当			△6,075,125
当期純利益			10,342,327
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	△954,495	△954,495	△954,495
当期変動額合計	△954,495	△954,495	3,312,705
当期末残高	672,279	672,279	88,013,413

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5年～50年
器具備品	2年～20年
投資不動産	5年～47年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

① 退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(主として10年)による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

(5) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

(6) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるた

め、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

6. 収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 委託者報酬

投資信託の信託約款に基づき信託財産の運用指図等を行っております。委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年 2 回受領しております。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 投資顧問料

顧客との投資一任及び投資助言契約に基づき運用及び助言を行っております。投資顧問料は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を主に年 4 回受領しております。当該報酬は契約期間にわたり収益として認識しております。

7. その他財務諸表作成のための基礎となる事項

グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第 31 号 2021 年 6 月 17 日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第 27-2 項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。なお、時価算定会計基準適用指針の適用による、財務諸表への影響はありません。

(貸借対照表関係)

※1. 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
建物	805,250千円	1,006,606千円
器具備品	2,054,366千円	1,985,072千円
投資不動産	157,995千円	163,978千円

※2. 関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
預金	43,782,913千円	40,165,058千円
未収収益	13,741千円	15,046千円
未払手数料	836,105千円	790,279千円
その他未払金	3,887,520千円	77,007千円
未払費用	337,847千円	277,358千円

(損益計算書関係)

※1. 固定資産除却損の内訳

	第37期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)	第38期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)
建物	2,599千円	1,047千円
器具備品	10,495千円	29,762千円
ソフトウェア	-	1,981千円
計	13,094千円	32,791千円

※2. 関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第37期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)	第38期 (自2022年4月1日 至2023年3月31日)
支払手数料	5,153,589千円	4,893,312千円
受取利息	7,377千円	10,236千円
受取賃貸料	65,808千円	68,168千円
法人税、住民税及び事業税	4,062,765千円	3,947,200千円

※3. 減損損失

当社は、以下のとおり減損損失を計上しました。

場所	用途	種類	金額
東京都千代田区(本社)	ホームページ	ソフトウェア	315,350千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグルーピングとしております。

翌期において、ホームページのリニューアルを予定しており、現行のホームページについて将来の利用終了が見込まれるため帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、割引率については使用見込期間が短いため考慮していません。

(株主資本等変動計算書関係)

第37期(自2021年4月1日至2022年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度増加 株式数 (株)	当事業年度減少 株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	211,581	—	—	211,581
合計	211,581	—	—	211,581

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

2021年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

- ① 配当金の総額 10,576,511千円
- ② 1株当たり配当額 49,988円
- ③ 基準日 2021年3月31日
- ④ 効力発生日 2021年6月29日

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

2022年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

- ① 配当金の総額 6,075,125千円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 28,713円
- ④ 基準日 2022年3月31日
- ⑤ 効力発生日 2022年6月29日

第38期(自2022年4月1日至2023年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度増加 株式数 (株)	当事業年度減少 株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	211,581	—	—	211,581
合計	211,581	—	—	211,581

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

2022年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

- ① 配当金の総額 6,075,125千円
- ② 1株当たり配当額 28,713円
- ③ 基準日 2022年3月31日
- ④ 効力発生日 2022年6月29日

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

2023年6月28日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

- ① 配当金の総額 5,171,039千円
- ② 配当の原資 利益剰余金
- ③ 1株当たり配当額 24,440円
- ④ 基準日 2023年3月31日
- ⑤ 効力発生日 2023年6月29日

(リース取引関係)

(借主側)

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
1 年内	709,808 千円	962,809 千円
1 年超	414,054 千円	1,532,728 千円
合計	1,123,863 千円	2,495,537 千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、金銭の信託（合同運用指定金銭信託）で運用し、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（(注2)参照）。

第 37 期(2022 年 3 月 31 日現在)

	貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 有価証券	293,326	293,326	—
(2) 金銭の信託	8,401,300	8,401,300	—
(3) 投資有価証券	16,772,282	16,772,282	—
資産計	25,466,909	25,466,909	—

(注 1) 「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注 2) 市場価格のない株式等

非上場株式（前事業年度の貸借対照表計上額 31,360 千円）は、市場価格がないため、「(3) 投資有価証券」には含めておりません。また、関連会社株式（前事業年度の貸借対照表計上額 159,536 千円）は、市場価格がないため、記載しておりません。

(注 3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

(注 4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第 37 期(2022 年 3 月 31 日現在)

(単位：千円)

	1 年以内	1 年超 5 年以内	5 年超 10 年以内	10 年超
現金及び預金	51,593,362	—	—	—
金銭の信託	8,401,300	—	—	—
未収委託者報酬	15,750,264	—	—	—
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	293,326	6,911,464	3,695,585	—
合計	76,038,253	6,911,464	3,695,585	—

第38期(2023年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 有価証券	1,579,691	1,579,691	—
(2) 金銭の信託	10,400,000	10,400,000	—
(3) 投資有価証券	12,022,365	12,022,365	—
資産計	24,002,056	24,002,056	—

(注1) 「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注2) 市場価格のない株式等

関連会社株式(当事業年度の貸借対照表計上額 159,536千円)は、市場価格がないため、記載しておりません。

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

(注4) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第38期(2023年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	51,733,041	—	—	—
金銭の信託	10,400,000	—	—	—
未収委託者報酬	16,753,855	—	—	—
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	1,579,691	4,859,714	1,433,213	—
合計	80,466,587	4,859,714	1,433,213	—

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

- レベル1の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価： 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価： 観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債
第37期(2022年3月31日現在)

区分	時価 (千円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	—	8,401,300	—	8,401,300
資産計	—	8,401,300	—	8,401,300

※財務諸表等規則附則(2021年9月24日内閣府令第9号)に基づく経過措置を適用した投資信託(貸借対照表計上額 有価証券 293,326千円、投資有価証券 16,772,282千円)は、表には含めておりません。

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル2の時価に分類しております。

第38期(2023年3月31日現在)

区分	時価 (千円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	—	1,579,691	—	1,579,691
金銭の信託	—	10,400,000	—	10,400,000
投資有価証券	1,794,704	10,227,661	—	12,022,365
資産計	1,794,704	22,207,352	—	24,002,056

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

ETF(上場投資信託)は相場価格を用いて評価しております。ETFは活発な市場で取引されているため、レベル1の時価に分類しております。

ETF(上場投資信託)以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル2の時価に分類しております。

金銭の信託

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル2の時価に分類しております。

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

第37期(2022年3月31日現在)及び第38期(2023年3月31日現在)

関連会社株式(貸借対照表計上額は159,536千円)は、市場価格がないため、記載しておりません。

2. その他有価証券

第37期(2022年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	19,193,250	16,560,340	2,632,910
	小計	19,193,250	16,560,340	2,632,910
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	6,273,658	6,561,836	△288,177
	小計	6,273,658	6,561,836	△288,177
合計		25,466,909	23,122,176	2,344,732

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」(貸借対照表計上額は8,401,300千円、取得原価は8,400,000千円)を含めております。

非上場株式(貸借対照表計上額は31,360千円)は、市場価格がないため、含めておりません。

第38期(2023年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	8,983,713	7,558,314	1,425,399
	小計	8,983,713	7,558,314	1,425,399
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	15,018,343	15,474,760	△456,417
	小計	15,018,343	15,474,760	△456,417
合計		24,002,056	23,033,074	968,982

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」(貸借対照表計上額は10,400,000千円、取得原価は10,400,000千円)を含めております。

3. 売却したその他有価証券

第37期(自2021年4月1日至2022年3月31日)

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	—	—	—
債券	—	—	—
その他	4,164,921	605,706	28,188
合計	4,164,921	605,706	28,188

第38期(自2022年4月1日至2023年3月31日)

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	17,240	—	14,120
債券	—	—	—
その他	1,551,405	387,113	1,708
合計	1,568,645	387,113	15,828

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について 36,558 千円（その他有価証券のその他 36,558 千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について 104,554 千円（その他有価証券のその他 104,554 千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ 50%以上下落した場合、及び 30%以上 50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
退職給付債務の期首残高	3,729,235 千円	3,723,521 千円
勤務費用	198,457	196,190
利息費用	21,549	25,925
数理計算上の差異の 発生額	△46,069	△186,130
退職給付の支払額	△179,650	△176,727
過去勤務費用の発生額	—	—
退職給付債務の期末残高	3,723,521	3,582,778

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
年金資産の期首残高	2,649,846 千円	2,583,927 千円
期待運用収益	47,588	46,453
数理計算上の差異の 発生額	1,824	△103,934
事業主からの拠出額	—	—
退職給付の支払額	△115,331	△100,694
年金資産の期末残高	2,583,927	2,425,752

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
積立型制度の 退職給付債務	2,675,015 千円	2,468,195 千円
年金資産	△2,583,927	△2,425,752
非積立型制度の退職給付債務	91,087	42,442
未積立退職給付債務	1,048,506	1,114,583
未認識数理計算上の差異	1,139,593	1,157,025
未認識過去勤務費用	205,679	281,343
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	△288,681	△223,319
退職給付引当金	1,056,591	1,215,049
前払年金費用	1,246,300	1,333,882
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	△189,708	△118,832

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
勤務費用	198,457 千円	196,190 千円
利息費用	21,549	25,925
期待運用収益	△47,588	△46,453
数理計算上の差異の 費用処理額	△3,547	△6,532
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	109,013	1,600
確定給付制度に係る 退職給付費用	343,245	236,091

(注)「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額及び退職金です。

(5) 年金資産に関する事項

①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
債券	62.0 %	63.6 %
株式	36.3	34.2
その他	1.7	2.2
合計	100	100

②長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
割引率	0.078～0.72%	0.066～1.13%
長期期待運用収益率	1.5～1.8%	1.5～1.8%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度 151,370 千円、当事業年度 152,084 千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第 37 期 (2022 年 3 月 31 日現在)	第 38 期 (2023 年 3 月 31 日現在)
繰延税金資産		
減損損失	410,082千円	499,742千円
投資有価証券評価損	65,490	47,876
未払事業税	165,702	169,997
賞与引当金	288,528	260,221
役員賞与引当金	25,799	29,828
役員退職慰労引当金	36,112	23,169
退職給付引当金	381,617	408,434
減価償却超過額	145,316	227,100
差入保証金	-	52,869
長期差入保証金	52,869	-
時効後支払損引当金	76,615	77,865
連結納税適用による時価評価	35,311	35,311
その他	76,257	177,003
繰延税金資産 小計	1,759,702	2,009,420
評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	1,759,702	2,009,420
繰延税金負債		
前払年金費用	△58,088	△36,386
連結納税適用による時価評価	△1,149	△1,098
その他有価証券評価差額金	△717,957	△296,702
その他	△101	△101
繰延税金負債 合計	△777,296	△334,288
繰延税金資産の純額	982,406	1,675,132

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
第 37 期（2022 年 3 月 31 日現在）及び第 38 期（2023 年 3 月 31 日現在）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の 100 分の 5 以下であるため注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第 42 号 2021 年 8 月 12 日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（収益認識関係）

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

収益及び契約から生じるキャッシュ・フローの性質、金額、時期及び不確実性に影響を及ぼす主要な要因に基づく区分に当該収益を分解した情報については、重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は、「(重要な会計方針) の 6. 収益および費用の計上基準」に記載のとおりであります。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第 37 期（自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日）及び第 38 期（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第 37 期（自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日）及び第 38 期（自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第 37 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注 5)	科目	期末残高(注 5)
親会社	三菱 UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払 (注 1)	4,062,765 千円	その他未払金	3,887,520 千円
親会社	三菱 UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注 2)	5,153,589 千円	未払手数料	836,105 千円
						投資の助言	投資助言料 (注 3)	499,388 千円	未払費用	272,264 千円
						役員の兼任				

第 38 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注 5)	科目	期末残高(注 5)
親会社	三菱 UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税等	連結納税等 に伴う支払 (注 4)	3,947,200 千円	その他未払金	77,007 千円
親会社	三菱 UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注 2)	4,893,312 千円	未払手数料	790,279 千円
						投資の助言	投資助言料 (注 3)	463,416 千円	未払費用	253,093 千円
						役員の兼任				

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。
2. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
3. 投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。
4. 連結納税制度及びグループ通算制度に基づく法人税の支払予定額であります。
5. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第37期(自2021年4月1日至2022年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注2)	科目	期末残高(注2)
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	4,097,951 千円	未払手数料	838,058 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	7,025,984 千円	未払手数料	1,319,958 千円

第38期(自2022年4月1日至2023年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(注2)	科目	期末残高(注2)
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	4,052,979 千円	未払手数料	868,785 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払(注1)	6,661,991 千円	未払手数料	1,218,051 千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注)1. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

2. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示してまいります。

2. 親会社に関する注記

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
1株当たり純資産額	400,322.84円	415,979.76円
1株当たり当期純利益金額	57,424.97円	48,881.17円

（注）1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
当期純利益金額（千円）	12,150,032	10,342,327
普通株主に帰属しない金額（千円）	—	—
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	12,150,032	10,342,327
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

中間財務諸表
(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間
(2023 年 9 月 30 日現在)

(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金		49,727,641
有価証券		1,621,227
前払費用		710,443
未収入金		93,528
未収委託者報酬		19,282,859
未収収益		770,875
金銭の信託		10,401,000
その他		740,886
流動資産合計		83,348,451
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1	2,546,133
器具備品	※1	1,676,631
土地		628,433
建設仮勘定		10,560
有形固定資産合計		4,861,758
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		4,917,655
ソフトウェア仮勘定		1,357,259
無形固定資産合計		6,290,737
投資その他の資産		
投資有価証券		14,016,994
関係会社株式		159,536
投資不動産	※1	1,580,210
長期差入保証金		689,627
前払年金費用		83,203
繰延税金資産		1,274,071
その他		45,230
貸倒引当金		△23,600
投資その他の資産合計		17,825,273
固定資産合計		28,977,769
資産合計		112,326,220

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間
(2023 年 9 月 30 日現在)

(負債の部)	
流動負債	
預り金	492,861
未払金	
未払収益分配金	105,556
未払償還金	44,768
未払手数料	6,929,093
その他未払金	3,313,588
未払費用	6,935,916
未払消費税等	※2 319,737
未払法人税等	2,205,065
賞与引当金	899,167
役員賞与引当金	78,660
その他	5,517
流動負債合計	21,329,934
固定負債	
退職給付引当金	1,375,952
役員退職慰労引当金	32,510
時効後支払損引当金	252,955
資産除去債務	704,072
固定負債合計	2,365,490
負債合計	23,695,424
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712
利益剰余金	
利益準備金	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	6,998,000
繰越利益剰余金	33,502,194
利益剰余金合計	40,842,784
株主資本合計	87,575,628

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間
(2023 年 9 月 30 日現在)

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,055,167
評価・換算差額等合計	1,055,167
純資産合計	88,630,795
負債純資産合計	112,326,220

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
営業収益	
委託者報酬	47,550,495
投資顧問料	1,407,644
その他営業収益	10,158
営業収益合計	48,968,298
営業費用	
支払手数料	16,737,084
広告宣伝費	208,241
公告費	892
調査費	
調査費	1,594,100
委託調査費	12,907,263
事務委託費	947,553
営業雑経費	
通信費	53,048
印刷費	194,402
協会費	33,149
諸会費	9,640
事務機器関連費	1,212,110
その他営業雑経費	5,384
営業費用合計	33,902,872
一般管理費	
給料	
役員報酬	190,163
給料・手当	2,957,056
賞与引当金繰入	899,167
役員賞与引当金繰入	78,660
福利厚生費	645,394
交際費	4,144
旅費交通費	46,547
租税公課	204,887
不動産賃借料	390,491
退職給付費用	188,933
固定資産減価償却費	※1 1,169,259
諸経費	275,931
一般管理費合計	7,050,636
営業利益	8,014,788

(単位：千円)

第 39 期中間会計期間
(自 2023 年 4 月 1 日
至 2023 年 9 月 30 日)

営業外収益		
受取配当金		27,966
受取利息		6,353
投資有価証券償還益		19,971
収益分配金等時効完成分		15,896
受取賃貸料		36,751
その他		20,823
営業外収益合計		127,762
営業外費用		
投資有価証券償却損		53,716
時効後支払損引当金繰入		1,347
事務過誤費		10,736
賃貸関連費用	※1	16,188
その他		3,902
営業外費用合計		85,890
経常利益		8,056,659
特別利益		
投資有価証券売却益		132,206
固定資産売却益		1,021
特別利益合計		133,228
特別損失		
投資有価証券売却損		30,309
投資有価証券評価損		28,130
固定資産除却損		20,162
固定資産売却損		65,427
その他特別損失		289,389
特別損失合計		433,419
税引前中間純利益		7,756,468
法人税、住民税及び事業税		2,118,856
法人税等調整額		232,077
法人税等合計		2,350,934
中間純利益		5,405,533

(3) 中間株主資本等変動計算書

第 39 期中間会計期間（自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当中間期変動額				
剰余金の配当				
中間純利益				
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)				
当中間期変動額合計	—	—	—	—
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	342,589	6,998,000	33,267,700	40,608,289	87,341,133
当中間期変動額					
剰余金の配当			△5,171,039	△5,171,039	△5,171,039
中間純利益			5,405,533	5,405,533	5,405,533
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)					
当中間期変動額合計	—	—	234,494	234,494	234,494
当中間期末残高	342,589	6,998,000	33,502,194	40,842,784	87,575,628

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	672,279	672,279	88,013,413
当中間期変動額			
剰余金の配当			△5,171,039
中間純利益			5,405,533
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	382,887	382,887	382,887
当中間期変動額合計	382,887	382,887	617,382
当中間期末残高	1,055,167	1,055,167	88,630,795

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法
 - (1) 子会社株式及び関連会社株式
移動平均法による原価法を採用しております。
 - (2) その他有価証券
市場価格のない株式等以外のもの
中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。
市場価格のない株式等
移動平均法による原価法を採用しております。
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法
時価法を採用しております。
3. 固定資産の減価償却の方法
 - (1) 有形固定資産及び投資不動産
定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。
なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5年～50年
器具備品	2年～20年
投資不動産	3年～50年
 - (2) 無形固定資産
定額法を採用しております。
なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。
4. 引当金の計上基準
 - (1) 貸倒引当金
貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。
 - (2) 賞与引当金
従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。
 - (3) 役員賞与引当金
役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。
 - (4) 退職給付引当金
従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。
 - ① 退職給付見込額の期間帰属方法
退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。
 - ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法
過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により費用処理することとしております。
数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(主として10年)による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。
 - (5) 役員退職慰労引当金
役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間期末要支給額を計上しております。
 - (6) 時効後支払損引当金
時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

5. 収益および費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1) 委託者報酬

投資信託の信託約款に基づき信託財産の運用指図等を行っております。委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受領しております。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 投資顧問料

顧客との投資一任及び投資助言契約に基づき運用及び助言を行っております。投資顧問料は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を主に年4回受領しております。当該報酬は契約期間にわたり収益として認識しております。

6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

7. その他中間財務諸表作成のための重要な事項

グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

※1 減価償却累計額

第 39 期中間会計期間 (2023 年 9 月 30 日現在)	
建物	407,329 千円
器具備品	1,336,738 千円
投資不動産	170,993 千円

※2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

※1 減価償却実施額

第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
有形固定資産	225,710 千円
無形固定資産	943,548 千円
投資不動産	7,015 千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数 (株)	当中間会計期間 増加株式数 (株)	当中間会計期間 減少株式数 (株)	当中間会計期間末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	211,581	—	—	211,581
合計	211,581	—	—	211,581

2. 配当に関する事項

2023 年 6 月 28 日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

① 配当金の総額	5,171,039 千円
② 配当の原資	利益剰余金
③ 1 株当たり配当額	24,440 円
④ 基準日	2023 年 3 月 31 日
⑤ 効力発生日	2023 年 6 月 29 日

(リース取引関係)

第 39 期中間会計期間(2023 年 9 月 30 日現在)

〈借主側〉

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

1 年内	740,363 千円
1 年超	1,192,121 千円
合 計	1,932,485 千円

(金融商品関係)

第 39 期中間会計期間(2023 年 9 月 30 日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

2023 年 9 月 30 日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません ((注 2) 参照)。

	中間貸借対照表 計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 有価証券	1,621,227	1,621,227	—
(2) 金銭の信託	10,401,000	10,401,000	—
(3) 投資有価証券	14,016,994	14,016,994	—
資産計	26,039,221	26,039,221	

(注 1) 「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注 2) 市場価格のない株式等

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 159,536 千円）は、市場価格がないため、記載していません。

(注 3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の 3 つのレベルに分類しております。

レベル 1 の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル 2 の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル 1 のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル 3 の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産

区分	時価 (千円)			合計
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	
有価証券	—	1,621,227	—	1,621,227
金銭の信託	—	10,401,000	—	10,401,000
投資有価証券	2,257,164	11,759,829	—	14,016,994
資産計	2,257,164	23,782,057	—	26,039,221

(注) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

ETF（上場投資信託）は相場価格を用いて評価しております。ETF は活発な市場で取引されているため、レベル 1 の時価に分類しております。

ETF（上場投資信託）以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル 2 の時価に分類しております。

金銭の信託

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル 2 の時価に分類しております。

(有価証券関係)

第 39 期中間会計期間（2023 年 9 月 30 日現在）

1. 子会社及び関連会社株式

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 159,536 千円）は、市場価格がないため、記載していません。

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表 計上額が取得原価を 超えるもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	15,250,611	13,190,791	2,059,819
	小計	15,250,611	13,190,791	2,059,819
中間貸借対照表 計上額が取得原価を 超えないもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	10,788,610	11,327,577	△538,966
	小計	10,788,610	11,327,577	△538,966
合計		26,039,221	24,518,369	1,520,852

(注)「その他」には、中間貸借対照表の「金銭の信託」(中間貸借対照表計上額 10,401,000 千円、取得価額 10,400,000 千円)を含めております。

3. 減損処理を行った有価証券

当中間会計期間において、有価証券について 28,130 千円(その他有価証券のその他 28,130 千円)減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、中間期末における時価が取得原価に比べ 50%以上下落した場合、及び 30%以上 50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの
当該資産除去債務の総額の増減

	第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
期首残高	—
有形固定資産の取得に伴う増加	704,072 千円
時の経過による調整額	—
中間期末残高	704,072 千円

(収益認識関係)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

収益及び契約から生じるキャッシュ・フローの性質、金額、時期及び不確実性に影響を及ぼす主要な要因に基づく区分に当該収益を分解した情報については、重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(1 株当たり情報)

1 株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第 39 期中間会計期間 (2023 年 9 月 30 日現在)
1 株当たり純資産額	418,897.70 円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額 (千円)	88,630,795
普通株式に係る中間期末の純資産額 (千円)	88,630,795
1 株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数 (株)	211,581

1 株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第 39 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
1 株当たり中間純利益金額	25,548.29 円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額 (千円)	5,405,533
普通株主に帰属しない金額 (千円)	—
普通株式に係る中間純利益金額 (千円)	5,405,533
普通株式の期中平均株式数 (株)	211,581

(注) 潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

(重要な後発事象)

共通支配下の取引等

当社は 2023 年 7 月 31 日開催の取締役会において、三菱UFJ不動産投資顧問株式会社(旧商号：MU投資顧問株式会社)と吸収分割契約を締結することを決議し、同日、吸収分割の効力発生日を 2023 年 10 月 1 日とする吸収分割契約を締結いたしました。本吸収分割契約に基づき、当社と三菱UFJ不動産投資顧問株式会社は、2023 年 10 月 1 日付で吸収分割を実施いたしました。

なお、2023 年 10 月 1 日付で当社は「三菱UFJアセットマネジメント株式会社」へ商号変更しました。

(1) 取引の概要

①被取得企業の名称及びその事業の内容

被取得企業の名称 三菱UFJ不動産投資顧問株式会社
事業の内容 投資顧問業、私募投資信託の設定・運用等

②企業結合日

2023 年 10 月 1 日

③企業結合の法的形式

当社と兄弟会社である三菱UFJ不動産投資顧問株式会社を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする無対価吸収分割

④結合後企業の名称

分割会社：三菱UFJ不動産投資顧問株式会社
承継会社：三菱UFJアセットマネジメント株式会社

⑤企業結合を行う主な理由

法人投資家の運用ニーズが拡大しており、両社で取り組みを強化している法人投資家ビジネスにかかる運用・営業等の関連機能を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に統合することで、リソースやノウハウの集約を通じた運用機能等の強化を図ってまいります。

(2) 実施する会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準 (企業会計基準第 21 号 2019 年 1 月 16 日)」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針 (企業会計基準適用指針第 10 号 2019 年 1 月 16 日)」に基づき、共通支配下の取引として処理する予定です。

4 【利害関係人との取引制限】

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

- ①自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ②運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ③通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ④委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ⑤上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5 【その他】

①定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

②訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

約款

追加型証券投資信託

三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）

約 款

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）

運用の基本方針

約款第24条の規定に基づき、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、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、MUAM J-REITマザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① TOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、MUAM J-REITマザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券への投資を通して、世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券への分散投資を行います。

② 各マザーファンド受益証券への資金配分は、信託財産の純資産総額に対して以下の比率を基本投資割合とします。

TOPIXマザーファンド受益証券	…	10%
外国株式インデックスマザーファンド受益証券	…	10%
日本債券インデックスマザーファンド受益証券	…	10%
外国債券インデックスマザーファンド受益証券	…	50%
MUAM J-REITマザーファンド受益証券	…	10%
MUAM G-REITマザーファンド受益証券	…	10%

③ 実質組入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。

④ 市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

3. 運用制限

(1) 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

(2) 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。

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。

① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

② 収益分配金額は、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、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

③ 収益の分配にあてなかった利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。

追加型証券投資信託
『三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型)』約款

(信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は、証券投資信託であり、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者とします。

② 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)(以下「信託法」といいます。)の適用を受けます。

(信託事務の委託)

第2条 受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、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。

② 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3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、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

② 追加信託が行われたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 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5条 この信託の期間は、信託契約締結日から2026年7月3日まで、または第46条第1項、第46条第2項、第47条第1項、第48条第1項および第50条第2項の規定による解約の日までとします。

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

第6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7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8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8条 委託者は、第3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9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第9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。

② 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25条に規定する借入有価証券を除きます。)を法令および一般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。

なお、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。

- ③ 第27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10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11条 この信託の受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けることとし、追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資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。）。

- ② 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。

- ③ 委託者は、第8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。

- ④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の2006年12月29日現在のすべての受益権（受益権につき、すでに信託契約の一部解約が行われたもので、当該一部解約に係る一部解約金の支払開始日が2007年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して2007年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預りではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行うものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権に係る受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日に係る収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する第一種金融商品取引業者（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をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第12条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

（受益権の申込単位および価額）

第13条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、第8条第1項の規定により分割される受益権について、その取得申込者に対し、1口単位をもって取得申込みに応じることができます。ただし、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録

金融機関と別に定める累積投資に関する契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に限り、1口の整数倍をもって取得申込みに応じることができます。

- ② 前項の場合の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、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価額は、1口につき1円に、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加算した価額とします。
- ③ 前項の手数料の額は、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関がそれぞれ別に定める手数料率を取得申込日の翌営業日の基準価額（信託契約締結日前の取得申込みについては、1口につき1円とします。）に乗じて得た額とします。
- ④ 第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37条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑤ 第1項の取得申込者は、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に、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、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、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14条 削除

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第15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。

- ② 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。
- ③ 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16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。

第17条 削除

第18条 削除

第19条 削除

第20条 削除

（投資の対象とする資産の種類等）

第21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. 約束手形

ハ. 金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

- ② デリバティブ取引等(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。)については、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、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。
- ③ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(運用の指図範囲等)

第22条 委託者は、信託金を、主として、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託者とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託者として締結されたTOPIXマザーファンド受益証券、外国株式インデックスマザーファンド受益証券、日本債券インデックスマザーファンド受益証券、外国債券インデックスマザーファンド受益証券、MUAM J-REITマザーファンド受益証券およびMUAM G-REITマザーファンド受益証券(以下これらを総称して「親投資信託」といいます。)の各受益証券のほか、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. コマーシャル・ペーパー
2. 外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券(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を除きます。)
4. 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。)

なお、第3号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引(売戻条件付の買入れ)および債券貸借取引(現金担保付債券借入れ)に限り行うことができます。

- ② 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号で定め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
- ③ 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には、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。
- ④ 委託者は、親投資信託の信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑤ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する親投資信託の受益証券の時価総額に親投資信託の信託財産の純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(受託者の自己または利害関係人等との取引)

第23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、受託者および受託者の利害関係人、第28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、第21条第1項ならびに前条第1項および第2項に定める資産への投資等を行うことができます。

② 前項の取扱いは、第25条、第27条および第32条から第34条までにおける委託者の指図による取引についても同様とします。

(運用の基本方針)

第24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。

(公社債の借入れ)

第25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。

② 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。

③ 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。

④ 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26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。

(外国為替予約の指図)

第27条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産と親投資信託の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属する親投資信託の受益証券の時価総額に親投資信託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。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

(信託業務の委託等)

第28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すべてに適合するもの（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

② 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。

③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限りません。）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内において、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

第29条 削除

(混蔵寄託)

第30条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこれ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ます。

(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あります。

- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。

(有価証券の売却等の指図)

第32条 委託者は、信託財産に属する親投資信託の受益証券に係る信託契約の一部解約の請求ならびに有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第33条 委託者は、前条の規定による一部解約の代金および売却代金、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34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。

- ② 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、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- ③ 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。
- ④ 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35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36条 信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、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。

- ② 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。
- ③ 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37条 この信託の計算期間は、毎年1月6日から3月5日、3月6日から5月5日、5月6日から7月5日、7月6日から9月5日、9月6日から11月5日、および11月6日から翌年1月5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、2006年3月17日から2006年7月5日までとします。

- ② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下本項において「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5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38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。

- ② 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39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、受託者の立替えた立替金の利息、信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該監査費用に係る消費税等相当額（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。なお、当該監査費用および当該監査費用に係る消費税等相当額は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の額)

第40条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第37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100の率を乗じて得た額とします。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。
- ③ 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41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、利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額は、諸経費、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利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、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てんした後、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。
- ② 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払込みと支払いに関する受託者の免責)

第42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に、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。）については第43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43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。

- ② 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、その責を負わないものとします。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第43条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ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委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関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て）に支払います。なお、2007年1月4日以降においても、第44条に規定する時効前の収益分配金に係る収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引換えに受益者に支払います。

- ② 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、収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関に交付されます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者毎に当該収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みに応じたものとし、当該取得申込みに応じるにより増加した受益権は、第11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。なお、第45条第3項により信託の一部解約が行われた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、第1項の規定に準じて受益者に支払います。

- ③ 償還金は、信託終了日後1ヵ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委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関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て）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。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引換えに当該受益者に支払います。

- ④ 一部解約金は、第45条第1項の受益者の請求を受け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。

- ⑤ 前各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、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の営業所等において行うものとします。

- ⑥ 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、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。

(収益分配金および償還金の時効)

第44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。

(信託契約の一部解約)

第45条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関が定める単位をもって、委託者に一部解約の実行を請求することができ

ます。

- ② 信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ③ 委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、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。
- ④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求を受け付けた日の翌営業日の基準価額とします。
- ⑤ 委託者は、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および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。）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。
- ⑥ 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け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。

（信託契約の解約）

第46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。

- ② 委託者は、受益権の口数が10億口を下ることとなった場合には、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。
- ③ 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すべ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。
- ④ 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。
- ⑤ 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項および第2項の信託契約の解約をしません。
- ⑥ 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、すべ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。
- ⑦ 第4項から前項までの規定は、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4項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付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47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。

- ② 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51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48条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、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。

- ② 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51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49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。

- ② 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50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51条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- ② 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51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。

- ② 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すべ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。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 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、すべ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。

(反対者の買取請求権)

第52条 第46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46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、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

(信託期間の延長)

第53条 委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託者と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第53条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

(公告)

第54条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載

します。

<https://www.am.mufg.jp/>

- ② 前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第54条の2 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り扱われます。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第55条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定め

ます。

(附則)

第1条 第43条第6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、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、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。

第2条 2006年12月29日現在の信託約款第11条、第12条、第14条から第20条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、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には、なおその効力を有するものとします。

2006年3月17日

 **MUFG** 三菱UFJアセットマネジメント